

国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国金中证 1000 指数增强	
基金主代码	017846	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 22 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	538,608,811.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017846	017847
报告期末下属分级基金的份额总额	349,777,985.85 份	188,830,825.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货交易策略、股指期货交易策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。</p> <p>本基金主要在基准成份内选股，力求在跟踪指数的前提下获取相对稳定的超额收益。股票投资策略部分，本基金为指数增强型基金，以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在控制跟踪误差的基础上，力求获得相对稳定的超越标的指数的超额收益。参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并通过分析投资组合相对标的指数的暴露度等因素，对组合跟踪效果进行评估，及时调整投资组合，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用机器学习技术构建量化选股模型，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。</p> <p>本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×

	5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国金基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静
	联系电话	010-88005695
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com
客户服务电话	4000-2000-18	400-61-95555
传真	010-88005666	0755-83195201
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100020	518040
法定代表人	邵海波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-81,139,161.19	-55,234,138.57
本期利润	-77,581,939.73	-70,117,976.48
加权平均基金份额 本期利润	-0.1839	-0.2667
本期加权平均净	-22.72%	-32.92%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	-18.17%	-18.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-88,783,162.95	-48,635,095.33
期末可供分配基金份额利润	-0.2538	-0.2576
期末基金资产净值	261,667,224.68	140,544,607.22
期末基金份额净值	0.7481	0.7443
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-25.19%	-25.57%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.56%	1.73%	-8.15%	1.36%	-1.41%	0.37%
过去三个月	-7.41%	1.71%	-9.51%	1.42%	2.10%	0.29%
过去六个月	-18.17%	2.16%	-15.97%	1.87%	-2.20%	0.29%
过去一年	-24.17%	1.63%	-24.61%	1.47%	0.44%	0.16%

自基金合同生效起至今	-25.19%	1.47%	-26.78%	1.36%	1.59%	0.11%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	-------

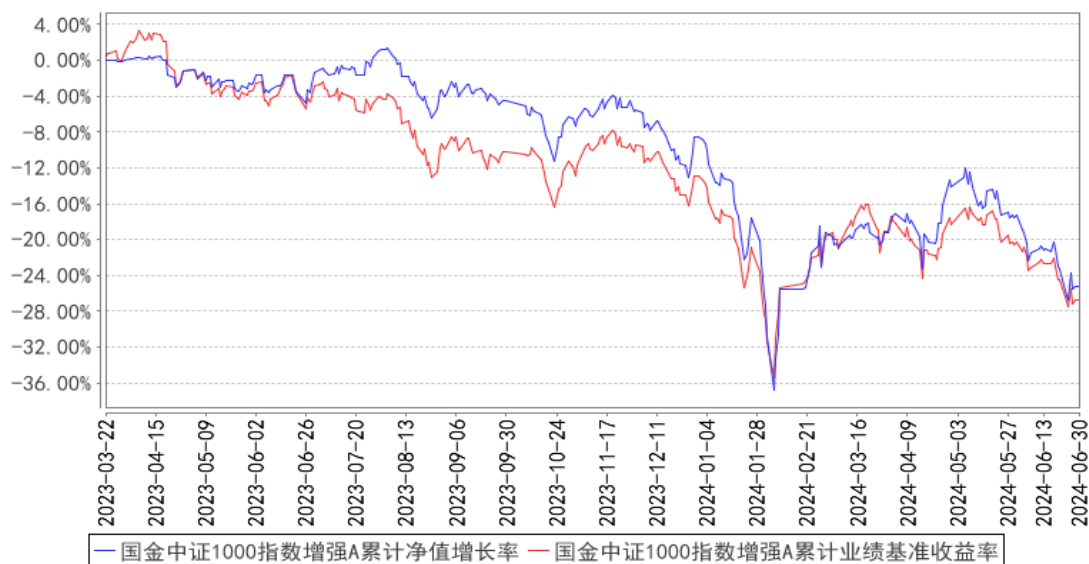
国金中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.58%	1.73%	-8.15%	1.36%	-1.43%	0.37%
过去三个月	-7.51%	1.71%	-9.51%	1.42%	2.00%	0.29%
过去六个月	-18.33%	2.16%	-15.97%	1.87%	-2.36%	0.29%
过去一年	-24.47%	1.63%	-24.61%	1.47%	0.14%	0.16%
自基金合同生效起至今	-25.57%	1.47%	-26.78%	1.36%	1.21%	0.11%

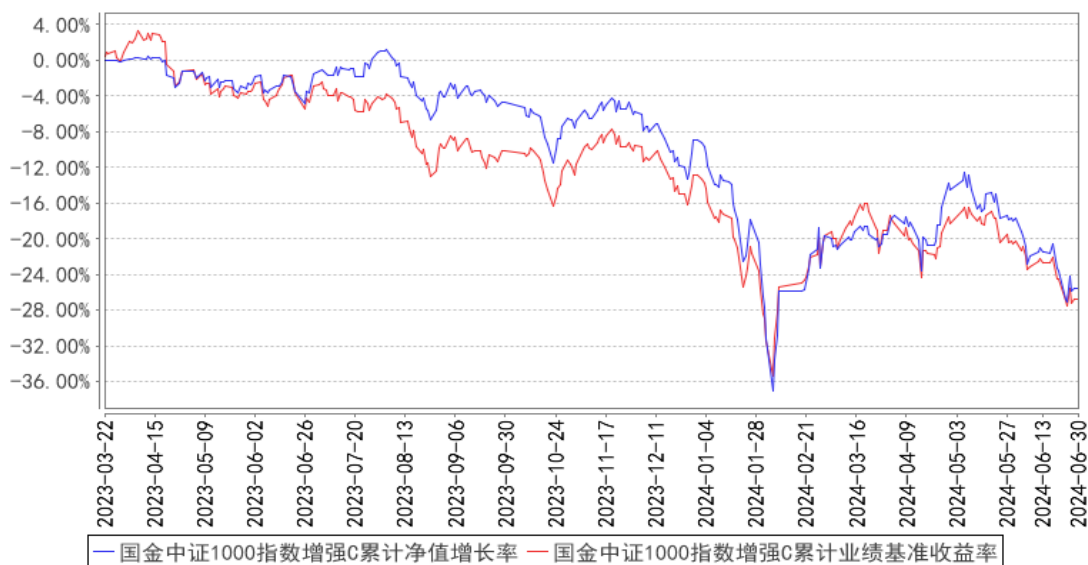
注：本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国金中证 1000 指数增强 A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



国金中证 1000 指数增强 C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 3 月 22 日，图示日期为 2023 年 3 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期为 2023 年 3 月 22 日至 2023 年 9 月 21 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2024 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 26 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券

投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2023 年 3 月 22 日	-	8 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资中心副总经理。

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和其他有关法律法规的规定，以及《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严

格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 6 次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场环境方面：2024 年 2 月前后的市场波动为近十年高点，后续虽有所降低，4 月和 5 月的波动水平仍处于历史较高位置，市场活跃度呈现持续下降的趋势，处于 2019 年以来的较低水平位置。具体因子方面：报告期内动量因子收益持续性较强，市值类和残差波动等因子波动性较大、持续性较弱。行业涨跌方面：大部分行业在报告期内录得负收益，其中涨幅高于 10% 的行业为银行、煤炭、石油石化和家电等，综合、消费者服务和计算机等行业跌幅较大，最大跌幅超过 37%。

国金量化策略收益来源多样化、持仓分散度高。本基金投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，2024 年上半年的市场环境下本基金的风险特征与所对标的业绩比较基准类似。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 0.7481 元，累计单位净值为 0.7481 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-18.17%，同期业绩比较基准增长率为-15.97%。

本基金 C 类份额单位净值为 0.7443 元，累计单位净值为 0.7443 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-18.33%，同期业绩比较基准增长率为-15.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场环境下，伴随市场活跃度较低的特征，市场风格的切换或较为频繁。但基于历史数据，较大范围偏离均值的情况其均值回归的动力亦较强。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管人代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管人进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产

品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	33,238,893.71	228,382,218.87
结算备付金		336.68	334.86
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	370,249,417.04	820,999,771.38
其中：股票投资		370,249,417.04	820,999,771.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-7,585.19
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		79,965.04	440,210.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		403,568,612.47	1,049,814,950.57
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		783,630.72	160,819,986.27
应付管理人报酬		348,860.33	912,395.25
应付托管费		69,772.07	182,479.08
应付销售服务费		48,620.66	202,460.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	105,896.79	140,075.37
负债合计		1,356,780.57	162,257,396.07
净 资 产:			
实收基金	6.4.7.10	538,608,811.81	972,293,863.41
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-136,396,979.91	-84,736,308.91
净资产合计		402,211,831.90	887,557,554.50
负债和净资产总计		403,568,612.47	1,049,814,950.57

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国金中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.7481 元，基金份额总额 349,777,985.85 份；国金中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.7443 元，基金份额总额 188,830,825.96 份。国金中证 1000 指数增强份额总额合计为 538,608,811.81 份。

6.2 利润表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 22 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-143,872,372.85	-10,740,571.16
1. 利息收入		61,538.32	776,262.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	53,953.13	216,046.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-

买入返售金融资产收入		7,585.19	560,215.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-132,698,512.60	1,308,548.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-135,665,252.85	-6,768,190.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,966,740.25	8,076,738.86
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-11,326,616.45	-12,867,249.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	91,217.88	41,867.67
减：二、营业总支出		3,827,543.36	3,415,036.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,748,119.57	2,525,266.97
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	549,623.88	505,053.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	419,674.48	334,081.24
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	110,125.43	50,634.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-147,699,916.21	-14,155,607.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-147,699,916.21	-14,155,607.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-147,699,916.21	-14,155,607.53

6.3 净资产变动表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	972,293,863.41	-	-84,736,308.91	887,557,554.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	972,293,863.41	-	-84,736,308.91	887,557,554.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 433,685,051.60	-	-51,660,671.00	-485,345,722.60
(一)、综合收益总额	-	-	- 147,699,916.21	-147,699,916.21
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 433,685,051.60	-	96,039,245.21	-337,645,806.39
其中：1. 基金申购款	45,819,157.87	-	-9,655,712.61	36,163,445.26
2. 基金赎回款	- 479,504,209.47	-	105,694,957.82	-373,809,251.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	538,608,811.81	-	-	402,211,831.90

			136,396,979.91	
项目	上年度可比期间 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	939,286,753.31	-	-	939,286,753.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-47,538,003.01	-	-12,317,617.46	-59,855,620.47
（一）、综合收益总额	-	-	-14,155,607.53	-14,155,607.53
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-47,538,003.01	-	1,837,990.07	-45,700,012.94
其中：1. 基金申购款	5,480,443.27	-	-159,491.30	5,320,951.97
2. 基金赎回款	-53,018,446.28	-	1,997,481.37	-51,020,964.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	891,748,750.30	-	-12,317,617.46	879,431,132.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金中证 1000 指数增强型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023]60 号文《关于准予国金中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2023 年 3 月 22 日正式生效，本基金首次募集规模为 939,286,753.31 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股（包括存托凭证、下同）、备选成份股（包括存托凭证、下同）、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证（包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债）、地方政府债券、可交换债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等）、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》

《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业

有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,696,161.68
等于：本金	1,695,950.89
加：应计利息	210.79
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	31,542,732.03
等于：本金	31,540,995.29
加：应计利息	1,736.74
减：坏账准备	-
合计	33,238,893.71

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	405,848,436.23	-	370,249,417.04	-35,599,019.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	405,848,436.23	-	370,249,417.04	-35,599,019.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
其他	1,469.60
合计	105,896.79

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	503,972,734.76	503,972,734.76
本期申购	8,949,665.44	8,949,665.44
本期赎回（以“-”号填列）	-163,144,414.35	-163,144,414.35

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	349,777,985.85	349,777,985.85

国金中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	468,321,128.65	468,321,128.65
本期申购	36,869,492.43	36,869,492.43
本期赎回(以“-”号填列)	-316,359,795.12	-316,359,795.12
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	188,830,825.96	188,830,825.96

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-36,716,034.27	-6,518,413.60	-43,234,447.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-36,716,034.27	-6,518,413.60	-43,234,447.87
本期利润	-81,139,161.19	3,557,221.46	-77,581,939.73
本期基金份额交易产生的变动数	29,072,032.51	3,633,593.92	32,705,626.43
其中：基金申购款	-1,404,709.89	-518,062.85	-1,922,772.74
基金赎回款	30,476,742.40	4,151,656.77	34,628,399.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-88,783,162.95	672,401.78	-88,110,761.17

国金中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-35,433,051.86	-6,068,809.18	-41,501,861.04
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-35,433,051.86	-6,068,809.18	-41,501,861.04
本期利润	-55,234,138.57	-14,883,837.91	-70,117,976.48
本期基金份额交易产生的变动数	42,032,095.10	21,301,523.68	63,333,618.78
其中：基金申购款	-6,616,545.45	-1,116,394.42	-7,732,939.87
基金赎回款	48,648,640.55	22,417,918.10	71,066,558.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-48,635,095.33	348,876.59	-48,286,218.74

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	11,482.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	42,469.06
结算备付金利息收入	1.82
其他	-
合计	53,953.13

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-135,665,252.85
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-135,665,252.85

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	3,139,310,505.47
减：卖出股票成本总额	3,269,299,623.63
减：交易费用	5,676,134.69
买卖股票差价收入	-135,665,252.85

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,966,740.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,966,740.25

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,326,616.45
股票投资	-11,326,616.45
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-11,326,616.45

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	89,576.64
基金转换费收入	1,641.24
合计	91,217.88

6.4.7.22 信用减值损失

注：无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	5,699.29
合计	110,125.43

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
国金证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构、基金结算机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	5,969,186,391.21	100.00	3,711,364,422.65	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年3月22日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	-	-	4,727,136,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	3,723,556.48	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年3月22日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	2,321,950.13	100.00	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和

市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,748,119.57	2,525,266.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,017,799.94	41,496.79
应支付基金管理人的净管理费	1,730,319.63	2,483,770.18

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	549,623.88	505,053.38

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核

对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金中证 1000 指数 增强 A	国金中证 1000 指数 增强 C	合计
国金基金管理有限公司	-	60,263.56	60,263.56
国金证券股份有限公司	-	247,664.62	247,664.62
合计	-	307,928.18	307,928.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金中证 1000 指数 增强 A	国金中证 1000 指数 增强 C	合计
国金基金管理有限公司	-	54,891.35	54,891.35
国金证券股份有限公司	-	244,656.37	244,656.37
合计	-	299,547.72	299,547.72

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年3月22日（基金合同生效日）至 2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司-活期存款	1,696,161.68	11,482.25	22,409,506.39	135,064.13
国金证券股份有限公司-其他存款	31,542,732.03	42,469.06	40,065,305.29	80,649.49

注：1. 本基金的其他存款为存放在开立于基金结算机构证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2. 除其他存款外，本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理办公会负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理办公会下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金

份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

目							
资产							
货币资金	33,238,893.71	-	-	-	-	-	33,238,893.71
结算备付金	336.68	-	-	-	-	-	336.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-370,249,417.04	370,249,417.04
应收申购款	-	-	-	-	-	79,965.04	79,965.04
资产总计	33,239,230.39	-	-	-	-	-370,329,382.08	403,568,612.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	783,630.72	783,630.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	348,860.33	348,860.33
应付托管费	-	-	-	-	-	69,772.07	69,772.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	48,620.66	48,620.66
其他负债	-	-	-	-	-	105,896.79	105,896.79
负债总计	-	-	-	-	-	1,356,780.57	1,356,780.57
利率敏感度缺口	33,239,230.39	-	-	-	-	-368,972,601.51	402,211,831.90
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	228,382,218.87	-	-	-	-	-	228,382,218.87
结算备付金	334.86	-	-	-	-	-	334.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-820,999,771.38	820,999,771.38
买入返售金融资产	-7,585.19	-	-	-	-	-	-7,585.19
应收申购款	-	-	-	-	-	440,210.65	440,210.65
资产总计	228,374,968.54	-	-	-	-	-821,439,982.03	1,049,814,950.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-160,819,986.27	160,819,986.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	912,395.25	912,395.25
应付托管费	-	-	-	-	-	182,479.08	182,479.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	202,460.10	202,460.10
其他负债	-	-	-	-	-	140,075.37	140,075.37
负债总计	-	-	-	-	-	-162,257,396.07	162,257,396.07
利率敏感度缺口	228,374,968.54	-	-	-	-	-659,182,585.96	887,557,554.50

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有交易性债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份股和备选成份股证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金为指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股（投资比例不低于非现金基金资产的 80%）。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	370,249,417.04	92.05	820,999,771.38	92.50
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	370,249,417.04	92.05	820,999,771.38	92.50
----	----------------	-------	----------------	-------

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 1000 指数（000852.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 1000 指数数据回归得出，反映了基金和中证 1000 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	+5%	20,679,516.29	33,831,092.11
	-5%	-20,679,516.29	-33,831,092.11

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	370,249,417.04	818,936,449.46
第二层次	-	2,057,239.78
第三层次	-	6,082.14
合计	370,249,417.04	820,999,771.38

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	370,249,417.04	91.74
	其中：股票	370,249,417.04	91.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,239,230.39	8.24
8	其他各项资产	79,965.04	0.02
9	合计	403,568,612.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	347,266.00	0.09
B	采矿业	2,348,478.00	0.58
C	制造业	231,652,514.37	57.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,224,126.00	0.80
F	批发和零售业	6,107,774.00	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,572,399.56	11.33
J	金融业	3,193,581.00	0.79
K	房地产业	239,432.00	0.06
L	租赁和商务服务业	3,851,585.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	1,115,151.03	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	2,553,978.00	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,086,579.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	2,718,500.00	0.68
S	综合	-	-
	合计	304,011,363.96	75.58

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	209,797.00	0.05
C	制造业	46,202,055.39	11.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,596,622.00	0.65
E	建筑业	1,701,830.00	0.42
F	批发和零售业	1,331,134.00	0.33
G	交通运输、仓储	829,922.00	0.21

	和邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,530,215.10	0.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,687,563.00	0.42
L	租赁和商务服务业	1,213,266.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	2,108,138.28	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	4,101,714.31	1.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	688,896.00	0.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	36,900.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	66,238,053.08	16.47

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688167	炬光科技	71,116	3,911,380.00	0.97
2	603583	捷昌驱动	189,300	3,857,934.00	0.96
3	600366	宁波韵升	718,600	3,751,092.00	0.93
4	300379	东方通	463,000	3,741,040.00	0.93
5	300303	聚飞光电	753,100	3,660,066.00	0.91
6	002036	联创电子	522,900	3,529,575.00	0.88
7	002446	盛路通信	609,500	3,443,675.00	0.86
8	300077	国民技术	394,000	3,439,620.00	0.86
9	688388	嘉元科技	348,883	3,401,609.25	0.85
10	002354	天娱数科	1,127,800	3,372,122.00	0.84
11	300366	创意信息	462,900	3,351,396.00	0.83
12	300123	亚光科技	711,400	3,300,896.00	0.82
13	002453	华软科技	758,100	3,252,249.00	0.81

14	603118	共进股份	477,400	3,198,580.00	0.80
15	301316	慧博云通	212,800	3,123,904.00	0.78
16	300079	数码视讯	748,100	3,037,286.00	0.76
17	603212	赛伍技术	275,100	3,037,104.00	0.76
18	301205	联特科技	47,500	2,980,625.00	0.74
19	002467	二六三	862,500	2,880,750.00	0.72
20	002194	武汉凡谷	357,100	2,874,655.00	0.71
21	002990	盛视科技	140,300	2,824,239.00	0.70
22	002488	金固股份	641,800	2,817,502.00	0.70
23	603328	依顿电子	351,900	2,765,934.00	0.69
24	002097	山河智能	455,800	2,748,474.00	0.68
25	688239	航宇科技	78,782	2,741,613.60	0.68
26	300382	斯莱克	456,100	2,695,551.00	0.67
27	002212	天融信	551,200	2,684,344.00	0.67
28	600610	中毅达	663,800	2,641,924.00	0.66
29	300085	银之杰	323,200	2,611,456.00	0.65
30	603989	艾华集团	185,700	2,610,942.00	0.65
31	300323	华灿光电	598,600	2,603,910.00	0.65
32	603123	翠微股份	437,100	2,596,374.00	0.65
33	002549	凯美特气	499,800	2,553,978.00	0.63
34	600110	诺德股份	833,100	2,540,955.00	0.63
35	300369	绿盟科技	478,700	2,446,157.00	0.61
36	688158	优刻得	237,410	2,428,704.30	0.60
37	300432	富临精工	373,950	2,408,238.00	0.60
38	603348	文灿股份	83,800	2,320,422.00	0.58
39	688800	瑞可达	82,573	2,318,649.84	0.58
40	002239	奥特佳	1,004,700	2,310,810.00	0.57
41	300409	道氏技术	264,300	2,262,408.00	0.56
42	600391	航发科技	147,800	2,253,950.00	0.56
43	603995	甬金股份	128,000	2,242,560.00	0.56
44	601015	陕西黑猫	787,804	2,205,851.20	0.55
45	000795	英洛华	395,300	2,189,962.00	0.54
46	300183	东软载波	186,200	2,156,196.00	0.54
47	601969	海南矿业	331,500	2,101,710.00	0.52
48	603466	风语筑	245,400	2,095,716.00	0.52
49	300226	上海钢联	121,900	2,064,986.00	0.51
50	002537	海联金汇	396,700	2,050,939.00	0.51
51	002402	和而泰	190,700	2,042,397.00	0.51
52	600691	阳煤化工	1,182,500	2,022,075.00	0.50
53	300035	中科电气	235,300	2,002,403.00	0.50
54	601886	江河集团	408,000	1,991,040.00	0.50
55	605222	起帆电缆	129,100	1,980,394.00	0.49
56	002782	可立克	175,900	1,948,972.00	0.48

57	603666	亿嘉和	121,500	1,917,270.00	0.48
58	003040	楚天龙	155,800	1,916,340.00	0.48
59	603906	龙蟠科技	242,600	1,889,854.00	0.47
60	300953	震裕科技	34,700	1,880,740.00	0.47
61	300747	锐科激光	104,900	1,861,975.00	0.46
62	600776	东方通信	188,500	1,852,955.00	0.46
63	688127	蓝特光学	100,252	1,843,634.28	0.46
64	300821	东岳硅材	267,700	1,831,068.00	0.46
65	603938	三孚股份	154,840	1,819,370.00	0.45
66	002283	天润工业	417,500	1,791,075.00	0.45
67	000058	深赛格	332,700	1,786,599.00	0.44
68	300772	运达股份	183,300	1,759,680.00	0.44
69	300166	东方国信	284,100	1,738,692.00	0.43
70	688031	星环科技	47,279	1,735,612.09	0.43
71	600775	南京熊猫	214,700	1,717,600.00	0.43
72	002068	黑猫股份	241,800	1,716,780.00	0.43
73	603489	八方股份	63,400	1,710,532.00	0.43
74	002125	湘潭电化	174,200	1,694,966.00	0.42
75	002516	旷达科技	458,100	1,667,484.00	0.41
76	601908	京运通	654,800	1,656,644.00	0.41
77	600449	宁夏建材	139,953	1,644,447.75	0.41
78	603013	亚普股份	121,300	1,633,911.00	0.41
79	300393	中来股份	279,300	1,611,561.00	0.40
80	688339	亿华通	53,523	1,604,619.54	0.40
81	688337	普源精电	62,872	1,585,631.84	0.39
82	002171	楚江新材	234,800	1,547,332.00	0.38
83	002191	劲嘉股份	417,400	1,506,814.00	0.37
84	300679	电连技术	37,400	1,504,602.00	0.37
85	002214	大立科技	133,100	1,501,368.00	0.37
86	603071	物产环能	119,000	1,491,070.00	0.37
87	002585	双星新材	299,700	1,486,512.00	0.37
88	300134	大富科技	217,500	1,483,350.00	0.37
89	603187	海容冷链	126,300	1,472,658.00	0.37
90	603113	金能科技	267,400	1,462,678.00	0.36
91	600797	浙大网新	309,200	1,431,596.00	0.36
92	000030	富奥股份	291,000	1,428,810.00	0.36
93	000503	国新健康	213,600	1,424,712.00	0.35
94	600577	精达股份	351,500	1,395,455.00	0.35
95	600330	天通股份	204,200	1,388,560.00	0.35
96	603609	禾丰股份	207,700	1,358,358.00	0.34
97	603297	永新光学	22,279	1,347,656.71	0.34
98	002190	成飞集成	94,700	1,337,164.00	0.33
99	600810	神马股份	213,400	1,323,080.00	0.33

100	300232	洲明科技	248,900	1,299,258.00	0.32
101	300850	新强联	86,100	1,293,222.00	0.32
102	300263	隆华科技	227,400	1,273,440.00	0.32
103	001236	弘业期货	179,100	1,273,401.00	0.32
104	300224	正海磁材	136,800	1,266,768.00	0.31
105	605365	立达信	79,400	1,260,078.00	0.31
106	002101	广东鸿图	119,600	1,259,388.00	0.31
107	000712	锦龙股份	162,000	1,215,000.00	0.30
108	002649	博彦科技	151,800	1,208,328.00	0.30
109	600562	国睿科技	88,100	1,203,446.00	0.30
110	301069	凯盛新材	90,100	1,181,211.00	0.29
111	002108	沧州明珠	383,100	1,172,286.00	0.29
112	001311	多利科技	48,170	1,164,750.60	0.29
113	000016	深康佳 A	542,600	1,155,738.00	0.29
114	688586	江航装备	121,653	1,131,372.90	0.28
115	300687	赛意信息	78,300	1,089,936.00	0.27
116	300143	盈康生命	144,300	1,086,579.00	0.27
117	603566	普莱柯	79,300	1,076,894.00	0.27
118	688680	海优新材	36,229	1,041,221.46	0.26
119	603197	保隆科技	32,700	1,030,050.00	0.26
120	600963	岳阳林纸	278,700	1,022,829.00	0.25
121	002250	联化科技	212,200	1,018,560.00	0.25
122	002706	良信股份	148,100	1,015,966.00	0.25
123	300741	华宝股份	66,300	1,010,412.00	0.25
124	002545	东方铁塔	148,100	1,008,561.00	0.25
125	688798	艾为电子	17,785	1,006,986.70	0.25
126	300674	宇信科技	90,700	1,004,956.00	0.25
127	300348	长亮科技	146,100	996,402.00	0.25
128	688372	伟测科技	25,151	989,188.83	0.25
129	301268	铭利达	62,400	970,320.00	0.24
130	601279	英利汽车	259,700	968,681.00	0.24
131	688711	宏微科技	59,861	961,367.66	0.24
132	603098	森特股份	122,300	961,278.00	0.24
133	600075	新疆天业	277,780	958,341.00	0.24
134	603915	国茂股份	92,400	950,796.00	0.24
135	002174	游族网络	124,200	942,678.00	0.23
136	300456	赛微电子	58,700	931,569.00	0.23
137	600618	氯碱化工	104,000	913,120.00	0.23
138	688531	日联科技	19,566	903,166.56	0.22
139	688400	凌云光	53,902	899,085.36	0.22
140	600151	航天机电	197,700	893,604.00	0.22
141	603636	南威软件	115,500	889,350.00	0.22
142	601011	宝泰隆	552,200	883,520.00	0.22

143	002745	木林森	109,600	883,376.00	0.22
144	600882	妙可蓝多	68,100	849,207.00	0.21
145	300973	立高食品	29,800	837,082.00	0.21
146	300261	雅本化学	152,600	808,780.00	0.20
147	002777	久远银海	53,400	800,466.00	0.20
148	000813	德展健康	378,700	787,696.00	0.20
149	300113	顺网科技	76,700	785,408.00	0.20
150	001338	永顺泰	76,400	748,720.00	0.19
151	002651	利君股份	134,200	736,758.00	0.18
152	002891	中宠股份	34,900	728,363.00	0.18
153	002135	东南网架	178,900	708,444.00	0.18
154	002961	瑞达期货	64,400	705,180.00	0.18
155	300587	天铁股份	169,600	685,184.00	0.17
156	003009	中天火箭	17,700	684,636.00	0.17
157	000837	秦川机床	91,800	675,648.00	0.17
158	300065	海兰信	101,200	668,932.00	0.17
159	300428	立中集团	35,800	665,522.00	0.17
160	002960	青鸟消防	51,100	645,904.00	0.16
161	002123	梦网科技	90,800	638,324.00	0.16
162	300860	锋尚文化	29,600	622,784.00	0.15
163	600751	海航科技	277,500	616,050.00	0.15
164	600400	红豆股份	281,700	611,289.00	0.15
165	000810	创维数字	70,400	604,032.00	0.15
166	002265	建设工业	68,600	592,018.00	0.15
167	603026	石大胜华	17,500	591,500.00	0.15
168	300233	金城医药	37,800	563,976.00	0.14
169	001269	欧晶科技	20,100	558,780.00	0.14
170	300080	易成新能	193,700	557,856.00	0.14
171	603169	兰石重装	120,700	543,150.00	0.14
172	002416	爱施德	61,000	539,850.00	0.13
173	002489	浙江永强	227,700	539,649.00	0.13
174	688173	希荻微	48,407	533,929.21	0.13
175	300045	华力创通	30,200	533,030.00	0.13
176	301246	宏源药业	39,300	528,978.00	0.13
177	300755	华致酒行	38,500	525,910.00	0.13
178	688707	振华新材	53,762	523,641.88	0.13
179	000597	东北制药	132,000	510,840.00	0.13
180	600490	鹏欣资源	195,400	508,040.00	0.13
181	301180	万祥科技	31,400	491,096.00	0.12
182	300768	迪普科技	39,300	465,705.00	0.12
183	605009	豪悦护理	11,800	465,392.00	0.12
184	600552	凯盛科技	48,300	455,469.00	0.11
185	002145	中核钛白	135,800	445,424.00	0.11

186	002991	甘源食品	7,200	436,680.00	0.11
187	601311	骆驼股份	48,800	391,376.00	0.10
188	601609	金田股份	67,600	382,616.00	0.10
189	000735	罗牛山	80,200	347,266.00	0.09
190	301177	迪阿股份	18,200	338,520.00	0.08
191	300109	新开源	28,900	334,662.00	0.08
192	603301	振德医疗	15,400	321,244.00	0.08
193	601208	东材科技	43,600	316,536.00	0.08
194	300596	利安隆	11,000	298,430.00	0.07
195	600477	杭萧钢构	127,000	295,910.00	0.07
196	688503	聚和材料	10,479	294,459.90	0.07
197	600063	皖维高新	77,800	273,856.00	0.07
198	002163	海南发展	49,600	271,808.00	0.07
199	600206	有研新材	30,300	269,670.00	0.07
200	600877	电科芯片	25,100	269,072.00	0.07
201	000968	蓝焰控股	38,800	246,768.00	0.06
202	600604	市北高新	69,200	239,432.00	0.06
203	688152	麒麟信安	6,068	234,952.96	0.06
204	300267	尔康制药	110,800	230,464.00	0.06
205	002079	苏州固锝	24,500	208,740.00	0.05
206	301291	明阳电气	6,800	204,340.00	0.05
207	600869	远东股份	57,900	202,071.00	0.05
208	300869	康泰医学	15,200	198,664.00	0.05
209	300841	康华生物	3,600	182,304.00	0.05
210	300170	汉得信息	27,600	169,464.00	0.04
211	000420	吉林化纤	52,800	166,848.00	0.04
212	002434	万里扬	33,800	165,620.00	0.04
213	605376	博迁新材	7,300	164,761.00	0.04
214	600478	科力远	40,500	152,685.00	0.04
215	600929	雪天盐业	28,300	149,990.00	0.04
216	601678	滨化股份	40,800	141,984.00	0.04
217	000970	中科三环	18,000	137,700.00	0.03
218	000727	冠捷科技	62,800	129,368.00	0.03
219	688315	诺禾致源	11,535	125,962.20	0.03
220	688001	华兴源创	5,563	125,612.54	0.03
221	000059	华锦股份	29,800	124,862.00	0.03
222	603612	索通发展	8,800	112,288.00	0.03
223	300185	通裕重工	64,200	110,424.00	0.03
224	688776	国光电气	1,622	89,858.80	0.02
225	002498	汉缆股份	23,800	78,302.00	0.02
226	603075	热威股份	2,300	40,595.00	0.01
227	605020	永和股份	2,000	38,360.00	0.01
228	002617	露笑科技	4,700	22,560.00	0.01

229	300188	国投智能	1,600	17,776.00	0.00
230	605333	沪光股份	400	11,140.00	0.00
231	002139	拓邦股份	200	2,124.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603629	利通电子	160,500	2,962,830.00	0.74
2	600770	综艺股份	1,116,800	2,557,472.00	0.64
3	002866	传艺科技	178,500	2,297,295.00	0.57
4	688733	壹石通	124,733	1,864,758.35	0.46
5	603178	圣龙股份	76,300	1,635,109.00	0.41
6	300854	中兰环保	129,400	1,286,236.00	0.32
7	300377	赢时胜	251,200	1,276,096.00	0.32
8	002188	中天服务	247,500	1,081,575.00	0.27
9	603729	龙韵股份	81,300	1,078,038.00	0.27
10	002645	华宏科技	138,200	878,952.00	0.22
11	300665	飞鹿股份	169,000	856,830.00	0.21
12	300635	中达安	111,900	844,845.00	0.21
13	002786	银宝山新	103,000	826,060.00	0.21
14	002058	威尔泰	107,900	820,040.00	0.20
15	300767	震安科技	93,300	791,184.00	0.20
16	688681	科汇股份	76,758	783,699.18	0.19
17	002855	捷荣技术	35,200	739,904.00	0.18
18	600455	博通股份	46,800	688,896.00	0.17
19	301040	中环海陆	68,800	681,808.00	0.17
20	300329	海伦钢琴	172,300	649,571.00	0.16
21	688133	泰坦科技	40,026	631,610.28	0.16
22	300899	上海凯鑫	33,900	629,862.00	0.16
23	300912	凯龙高科	67,000	627,790.00	0.16
24	300535	达威股份	52,400	618,320.00	0.15
25	688701	卓锦股份	113,133	609,786.87	0.15
26	600510	黑牡丹	162,900	605,988.00	0.15
27	301037	保立佳	62,700	555,522.00	0.14
28	300749	顶固集创	102,400	542,720.00	0.13
29	002830	名雕股份	54,500	536,280.00	0.13
30	600539	狮头股份	141,700	515,788.00	0.13
31	300405	科隆股份	144,400	512,620.00	0.13
32	603272	联翔股份	55,600	472,600.00	0.12
33	600847	万里股份	72,700	461,645.00	0.11
34	002591	恒大高新	123,600	452,376.00	0.11
35	300931	通用电梯	81,100	444,428.00	0.11
36	688215	瑞晟智能	18,493	436,249.87	0.11

37	002633	申科股份	73,800	433,944.00	0.11
38	301228	实朴检测	46,200	431,970.00	0.11
39	600689	上海三毛	63,800	430,650.00	0.11
40	603709	中源家居	33,500	416,405.00	0.10
41	301010	晶雪节能	36,100	415,511.00	0.10
42	600768	宁波富邦	59,200	414,992.00	0.10
43	300710	万隆光电	27,300	414,141.00	0.10
44	603516	淳中科技	12,600	397,782.00	0.10
45	002494	华斯股份	125,300	390,936.00	0.10
46	688067	爱威科技	27,167	389,846.45	0.10
47	301273	瑞晨环保	24,500	381,465.00	0.09
48	603316	诚邦股份	104,300	376,523.00	0.09
49	300640	德艺文创	95,000	374,300.00	0.09
50	605255	天普股份	31,000	372,620.00	0.09
51	600243	青海华鼎	138,000	371,220.00	0.09
52	688096	京源环保	73,030	368,801.50	0.09
53	688367	工大高科	30,035	366,427.00	0.09
54	688081	兴图新科	41,514	365,323.20	0.09
55	300478	杭州高新	45,900	358,020.00	0.09
56	300076	GQY 视讯	111,000	355,200.00	0.09
57	300269	联建光电	141,200	354,412.00	0.09
58	300886	华业香料	21,500	353,030.00	0.09
59	688178	万德斯	33,840	348,890.40	0.09
60	001211	双枪科技	20,600	313,944.00	0.08
61	600561	江西长运	84,900	309,036.00	0.08
62	300605	恒锋信息	33,700	305,322.00	0.08
63	600156	华升股份	96,700	300,737.00	0.07
64	301288	清研环境	26,400	294,624.00	0.07
65	603045	福达合金	29,600	293,928.00	0.07
66	605303	园林股份	43,400	290,780.00	0.07
67	300935	盈建科	18,600	288,486.00	0.07
68	688021	奥福环保	30,408	279,753.60	0.07
69	300417	南华仪器	33,600	278,544.00	0.07
70	002316	亚联发展	87,600	272,436.00	0.07
71	603813	原尚股份	28,700	270,928.00	0.07
72	002209	达意隆	35,100	267,813.00	0.07
73	301075	多瑞医药	16,500	262,350.00	0.07
74	300929	华骐环保	35,500	259,860.00	0.06
75	300588	熙菱信息	33,300	257,742.00	0.06
76	301098	金埔园林	33,100	250,567.00	0.06
77	603955	大千生态	28,800	247,680.00	0.06
78	002910	庄园牧场	38,400	238,080.00	0.06
79	600493	凤竹纺织	54,700	237,945.00	0.06

80	002231	奥维通信	53,600	218,688.00	0.05
81	300385	雪浪环境	63,500	213,995.00	0.05
82	600137	浪莎股份	17,600	208,912.00	0.05
83	301032	新柴股份	30,300	203,313.00	0.05
84	301336	趣睡科技	6,800	200,736.00	0.05
85	688679	通源环境	28,724	199,919.04	0.05
86	300126	锐奇股份	43,500	197,055.00	0.05
87	300509	新美星	40,500	189,540.00	0.05
88	002848	高斯贝尔	27,200	188,768.00	0.05
89	002207	准油股份	45,200	185,772.00	0.05
90	603022	新通联	23,900	173,992.00	0.04
91	300611	美力科技	22,400	170,688.00	0.04
92	002952	亚世光电	8,300	170,565.00	0.04
93	300211	亿通科技	32,000	169,280.00	0.04
94	002084	海鸥住工	69,000	169,050.00	0.04
95	001260	坤泰股份	12,100	168,553.00	0.04
96	000586	汇源通信	21,000	164,850.00	0.04
97	300472	新元科技	37,200	164,796.00	0.04
98	000890	法尔胜	66,300	164,424.00	0.04
99	300883	龙利得	37,100	156,933.00	0.04
100	301066	万事利	19,200	155,520.00	0.04
101	688565	力源科技	33,159	155,515.71	0.04
102	300591	万里马	49,800	155,376.00	0.04
103	002571	德力股份	31,800	154,866.00	0.04
104	300955	嘉亨家化	12,200	154,574.00	0.04
105	300771	智莱科技	17,500	153,825.00	0.04
106	688395	正弦电气	10,763	153,372.75	0.04
107	002853	皮阿诺	20,500	152,315.00	0.04
108	300414	中光防雷	22,800	150,708.00	0.04
109	002809	红墙股份	20,900	149,853.00	0.04
110	300949	奥雅股份	5,000	149,050.00	0.04
111	002347	泰尔股份	39,300	148,161.00	0.04
112	603527	众源新材	20,800	147,680.00	0.04
113	600130	波导股份	45,900	146,421.00	0.04
114	301318	维海德	5,300	145,591.00	0.04
115	000020	深华发 A	14,500	143,550.00	0.04
116	300652	雷迪克	7,200	142,776.00	0.04
117	002909	集泰股份	34,500	141,450.00	0.04
118	300279	和晶科技	33,700	140,529.00	0.03
119	002753	永东股份	24,000	139,440.00	0.03
120	600099	林海股份	20,200	138,976.00	0.03
121	688229	博睿数据	5,381	138,399.32	0.03
122	300798	锦鸡股份	21,800	135,378.00	0.03

123	600960	渤海汽车	50,500	134,330.00	0.03
124	300334	津膜科技	28,400	132,912.00	0.03
125	300571	平治信息	6,300	131,922.00	0.03
126	300264	佳创视讯	33,500	131,655.00	0.03
127	300897	山科智能	7,100	130,924.00	0.03
128	300328	宜安科技	30,100	128,828.00	0.03
129	603051	鹿山新材	5,900	128,797.00	0.03
130	002689	远大智能	59,700	127,758.00	0.03
131	002474	榕基软件	29,300	127,748.00	0.03
132	688622	禾信仪器	7,862	125,792.00	0.03
133	605066	天正电气	22,400	124,768.00	0.03
134	002666	德联集团	34,400	124,528.00	0.03
135	688309	恒誉环保	10,346	124,048.54	0.03
136	688251	井松智能	6,680	124,047.60	0.03
137	605228	神通科技	14,400	123,552.00	0.03
138	003027	同兴环保	9,900	121,770.00	0.03
139	603333	尚纬股份	39,000	121,290.00	0.03
140	300707	威唐工业	9,500	117,610.00	0.03
141	688071	华依科技	5,410	117,234.70	0.03
142	300227	光韵达	21,100	115,417.00	0.03
143	301321	翰博高新	9,900	113,949.00	0.03
144	300464	星徽股份	32,000	112,640.00	0.03
145	000510	新金路	40,600	112,462.00	0.03
146	002376	新北洋	20,800	112,112.00	0.03
147	002931	锋龙股份	10,800	110,052.00	0.03
148	300549	优德精密	8,100	109,512.00	0.03
149	300030	阳普医疗	29,300	108,996.00	0.03
150	301007	德迈仕	9,300	108,624.00	0.03
151	002213	大为股份	11,100	108,225.00	0.03
152	603949	雪龙集团	9,600	108,096.00	0.03
153	002998	优彩资源	19,000	107,730.00	0.03
154	688078	龙软科技	4,658	107,273.74	0.03
155	300331	苏大维格	6,500	104,520.00	0.03
156	600232	金鹰股份	23,300	100,423.00	0.02
157	603048	浙江黎明	6,800	98,736.00	0.02
158	001202	炬申股份	8,700	98,571.00	0.02
159	601616	广电电气	33,800	98,358.00	0.02
160	603681	永冠新材	7,700	98,175.00	0.02
161	003003	天元股份	12,300	98,031.00	0.02
162	002890	弘宇股份	12,220	98,004.40	0.02
163	603926	铁流股份	11,700	97,110.00	0.02
164	000985	大庆华科	7,700	97,020.00	0.02
165	300694	蠡湖股份	11,400	97,014.00	0.02

166	603115	海星股份	9,300	96,720.00	0.02
167	603192	汇得科技	7,200	96,696.00	0.02
168	300599	雄塑科技	19,400	96,418.00	0.02
169	002369	卓翼科技	25,900	95,571.00	0.02
170	300892	品渥食品	7,000	95,480.00	0.02
171	605208	永茂泰	15,300	95,319.00	0.02
172	301056	森赫股份	12,400	95,108.00	0.02
173	600676	交运股份	34,300	95,011.00	0.02
174	300132	青松股份	27,300	95,004.00	0.02
175	603700	宁水集团	10,100	94,738.00	0.02
176	603095	越剑智能	7,200	94,392.00	0.02
177	002164	宁波东力	24,400	93,696.00	0.02
178	300248	新开普	14,400	93,456.00	0.02
179	301020	密封科技	5,900	93,338.00	0.02
180	603917	合力科技	8,600	93,052.00	0.02
181	300980	祥源新材	5,900	92,984.00	0.02
182	603106	恒银科技	21,800	92,868.00	0.02
183	603819	神力股份	8,500	89,250.00	0.02
184	002480	新筑股份	28,400	88,608.00	0.02
185	002972	科安达	9,600	87,936.00	0.02
186	300805	电声股份	13,700	87,132.00	0.02
187	002718	友邦吊顶	8,300	86,652.00	0.02
188	002148	北纬科技	18,300	85,095.00	0.02
189	600319	亚星化学	25,700	85,067.00	0.02
190	002817	黄山胶囊	15,900	84,906.00	0.02
191	688335	复洁环保	10,253	83,561.95	0.02
192	002295	精艺股份	15,700	83,524.00	0.02
193	605136	丽人丽妆	15,100	83,201.00	0.02
194	688193	仁度生物	3,155	82,944.95	0.02
195	300923	研奥股份	4,800	81,600.00	0.02
196	603768	常青股份	7,100	80,514.00	0.02
197	300412	迦南科技	27,800	80,064.00	0.02
198	300810	中科海讯	5,200	79,612.00	0.02
199	300559	佳发教育	8,100	77,517.00	0.02
200	300986	志特新材	11,200	75,824.00	0.02
201	600802	福建水泥	27,200	75,616.00	0.02
202	000635	英力特	12,900	75,465.00	0.02
203	000953	河化股份	32,300	75,259.00	0.02
204	688217	睿昂基因	3,758	74,182.92	0.02
205	002691	冀凯股份	16,800	73,752.00	0.02
206	300473	德尔股份	5,400	73,494.00	0.02
207	000626	远大控股	17,300	71,795.00	0.02
208	301185	鸥玛软件	5,000	71,650.00	0.02

209	600698	湖南天雁	20,700	70,173.00	0.02
210	601002	晋亿实业	24,100	69,890.00	0.02
211	000678	襄阳轴承	18,100	68,056.00	0.02
212	300651	金陵体育	5,500	66,660.00	0.02
213	002362	汉王科技	4,000	66,600.00	0.02
214	002921	联诚精密	6,600	66,066.00	0.02
215	600202	哈空调	18,500	66,045.00	0.02
216	688365	光云科技	10,703	64,432.06	0.02
217	605118	力鼎光电	4,300	64,027.00	0.02
218	603829	洛凯股份	5,400	63,882.00	0.02
219	300148	天舟文化	27,400	63,294.00	0.02
220	300978	东箭科技	6,800	62,764.00	0.02
221	002798	帝欧家居	19,100	62,266.00	0.02
222	300112	万讯自控	9,000	62,100.00	0.02
223	600152	维科技术	12,800	61,440.00	0.02
224	300701	森霸传感	7,300	61,393.00	0.02
225	300877	金春股份	5,600	60,704.00	0.02
226	600800	渤海化学	30,400	60,496.00	0.02
227	000663	永安林业	14,400	60,336.00	0.02
228	002397	梦洁股份	31,000	59,520.00	0.01
229	688013	天臣医疗	4,008	59,478.72	0.01
230	603488	展鹏科技	8,500	57,800.00	0.01
231	002418	康盛股份	30,400	57,456.00	0.01
232	603790	雅运股份	5,900	56,640.00	0.01
233	001317	三羊马	2,400	56,376.00	0.01
234	603188	亚邦股份	23,800	53,788.00	0.01
235	002529	海源复材	10,400	53,664.00	0.01
236	688292	浩瀚深度	3,413	52,764.98	0.01
237	002860	星帅尔	6,000	49,140.00	0.01
238	605122	四方新材	5,000	48,600.00	0.01
239	300242	佳云科技	28,800	48,096.00	0.01
240	301053	远信工业	2,300	45,908.00	0.01
241	300157	新锦动力	24,800	45,632.00	0.01
242	002576	通达动力	4,000	45,400.00	0.01
243	000599	青岛双星	12,000	42,360.00	0.01
244	000545	金浦钛业	24,700	41,002.00	0.01
245	002553	南方精工	4,300	39,861.00	0.01
246	603798	康普顿	4,700	39,574.00	0.01
247	000407	胜利股份	15,000	39,150.00	0.01
248	002863	今飞凯达	9,600	39,072.00	0.01
249	300449	汉邦高科	9,100	38,129.00	0.01
250	603937	丽岛新材	4,800	37,248.00	0.01
251	300176	派生科技	8,400	37,044.00	0.01

252	301052	果麦文化	1,800	36,900.00	0.01
253	600841	动力新科	11,200	36,736.00	0.01
254	600615	丰华股份	3,400	28,764.00	0.01
255	300420	五洋自控	12,900	28,251.00	0.01
256	300082	奥克股份	6,600	28,116.00	0.01
257	300746	汉嘉设计	4,400	27,632.00	0.01
258	300608	思特奇	3,000	26,940.00	0.01
259	002512	达华智能	7,500	25,875.00	0.01
260	002094	青岛金王	13,500	24,165.00	0.01
261	002629	仁智股份	15,500	24,025.00	0.01
262	300564	筑博设计	2,700	23,031.00	0.01
263	000533	顺钠股份	6,900	22,701.00	0.01
264	301198	喜悦智行	2,700	21,627.00	0.01
265	000619	海螺新材	4,600	18,584.00	0.00
266	002451	摩恩电气	3,300	17,721.00	0.00
267	300190	维尔利	6,400	17,600.00	0.00
268	603028	赛福天	3,000	16,890.00	0.00
269	600448	华纺股份	8,500	16,745.00	0.00
270	688329	艾隆科技	850	12,631.00	0.00
271	002169	智光电气	2,800	12,348.00	0.00
272	600128	苏豪弘业	1,800	11,466.00	0.00
273	002988	豪美新材	700	10,745.00	0.00
274	300846	首都在线	1,100	10,296.00	0.00
275	600778	友好集团	2,600	10,114.00	0.00
276	002175	东方智造	1,800	3,168.00	0.00
277	603810	丰山集团	300	2,508.00	0.00
278	300011	鼎汉技术	300	1,497.00	0.00
279	002495	佳隆股份	800	1,104.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300123	亚光科技	14,998,720.00	1.69
2	603123	翠微股份	12,620,430.00	1.42
3	600782	新钢股份	11,509,650.00	1.30
4	600098	广州发展	10,803,515.00	1.22
5	002212	天融信	10,475,852.00	1.18
6	603212	赛伍技术	10,352,296.00	1.17
7	002123	梦网科技	9,485,139.00	1.07
8	300366	创意信息	9,458,482.00	1.07
9	688262	国芯科技	9,157,627.66	1.03
10	002436	兴森科技	8,805,827.00	0.99

11	600508	上海能源	8,781,463.00	0.99
12	603530	神马电力	8,772,762.00	0.99
13	688711	宏微科技	8,751,088.75	0.99
14	300379	东方通	8,670,160.00	0.98
15	603118	共进股份	8,467,821.00	0.95
16	300767	震安科技	8,332,151.20	0.94
17	002446	盛路通信	8,299,932.00	0.94
18	300079	数码视讯	8,232,805.00	0.93
19	600151	航天机电	8,202,420.00	0.92
20	300369	绿盟科技	8,186,860.00	0.92

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603212	赛伍技术	17,489,788.01	1.97
2	300188	国投智能	15,997,629.00	1.80
3	300319	麦捷科技	13,475,126.32	1.52
4	300369	绿盟科技	13,121,899.39	1.48
5	300323	华灿光电	12,947,625.00	1.46
6	600782	新钢股份	12,656,234.00	1.43
7	688031	星环科技	12,589,346.26	1.42
8	300123	亚光科技	12,010,826.00	1.35
9	600098	广州发展	11,740,375.50	1.32
10	603118	共进股份	11,579,270.68	1.30
11	688711	宏微科技	11,578,496.41	1.30
12	000829	天音控股	11,398,848.00	1.28
13	002467	二六三	11,370,229.50	1.28
14	002402	和而泰	11,368,396.00	1.28
15	002815	崇达技术	11,340,007.00	1.28
16	601609	金田股份	11,136,873.00	1.25
17	300671	富满微	10,942,399.00	1.23
18	300377	赢时胜	10,874,422.00	1.23
19	300747	锐科激光	10,810,991.20	1.22
20	603936	博敏电子	10,776,115.00	1.21

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,829,875,885.74
卖出股票收入（成交）总额	3,139,310,505.47

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），

不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	79,965.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,965.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国金中证 1000 指数增强 A	4,192	83,439.41	9,844,315.39	2.81	339,933,670.46	97.19
国金中证 1000 指数增强 C	4,916	38,411.48	30,913,135.16	16.37	157,917,690.80	83.63
合计	9,108	59,135.79	40,757,450.55	7.57	497,851,361.26	92.43

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业	国金中证 1000 指数增强 A	288,030.55	0.0823
	国金中证 1000 指数增强 C	2,008.08	0.0011

人员持有本基金			
	合计	290,038.63	0.0538

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	国金中证 1000 指数增强 A	10~50
	国金中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国金中证 1000 指数增强 A	0
	国金中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 22 日) 基金份额总额	627,872,206.43	311,414,546.88
本报告期期初基金份额总额	503,972,734.76	468,321,128.65
本报告期基金总申购份额	8,949,665.44	36,869,492.43
减：本报告期基金总赎回份额	163,144,414.35	316,359,795.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	349,777,985.85	188,830,825.96

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国金证券	2	5,969,186,391.21	100.00	3,723,556.48	100.00	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。

(1) 基金交易单元的选择标准如下：

- ① 券商经纪人经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；

⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金使用券商交易单元的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 01 月 11 日
2	《国金基金管理有限公司关于本公司办公地址变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 01 月 19 日
3	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 01 月 20 日
4	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 02 月 08 日
5	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 02 月 08 日
6	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 02 月 08 日
7	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 03 月 29 日
8	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 04 月 16 日
9	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 04 月 20 日
10	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 04 月 30 日
11	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 05 月 23 日

12	《国金基金管理有限公司旗下基金调整股票估值方法的提示性公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 06 月 22 日
13	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 06 月 25 日
14	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2024 年 06 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日