

国金中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	11
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等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 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	15
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54

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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
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	56
§ 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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	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 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国金中证 A500 指数增强	
基金主代码	022485	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 11 月 18 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	4,222,689,998.69 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 A500 指数增强 A	国金中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	022485	022486
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,588,484,982.49 份	2,634,205,016.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在力求对中证 A500 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，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	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。 本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。股票投资策略部分，本基金为指数增强型基金，以中证 A500 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研究基础上，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，力争实现超额收益。 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。
业绩比较基准	中证 A500 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	虞志海	杨军智
	联系电话	010-88005852	010-60834299
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		4000-2000-18	010-60836588
传真		010-88005666	010-60834004
注册地址		北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北 座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中 信证券大厦 5 层
邮政编码		100026	100125
法定代表人		邵海波	张佑君

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	国金中证 A500 指数增强 A	国金中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	325,199,668.15	479,688,615.73
本期利润	343,553,834.82	514,976,317.61
加权平均基金份 额本期利润	0.2967	0.2965
本期加权平均净 值利润率	20.28%	20.34%
本期基金份额净 值增长率	22.00%	21.76%

3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	864,497,714.55	1,406,910,961.71
期末可供分配基金份额利润	0.5442	0.5341
期末基金资产净值	2,553,629,875.21	4,207,530,785.82
期末基金份额净值	1.6076	1.5973
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	60.76%	59.73%

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 A500 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
过去三个月	17.95%	1.42%	13.54%	1.34%	4.41%	0.08%
过去六个月	22.00%	1.31%	11.34%	1.22%	10.66%	0.09%
过去一年	48.93%	1.13%	34.41%	1.09%	14.52%	0.04%
自基金合同生效 起至今	60.76%	1.06%	32.91%	1.07%	27.85%	-0.01%

国金中证 A500 指数增强 C

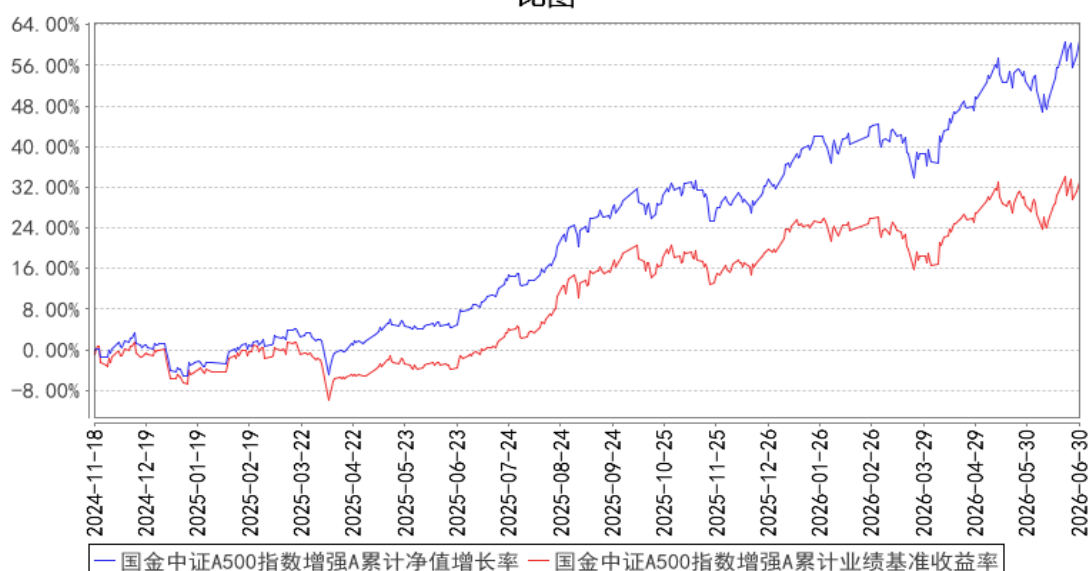
阶段	份额净值 增长	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较基准 收益率标准	①—③	②—④
----	------------	--------------	--------------	-----------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去三个月	17.83%	1.42%	13.54%	1.34%	4.29%	0.08%
过去六个月	21.76%	1.31%	11.34%	1.22%	10.42%	0.09%
过去一年	48.34%	1.13%	34.41%	1.09%	13.93%	0.04%
自基金合同生效 起至今	59.73%	1.06%	32.91%	1.07%	26.82%	-0.01%

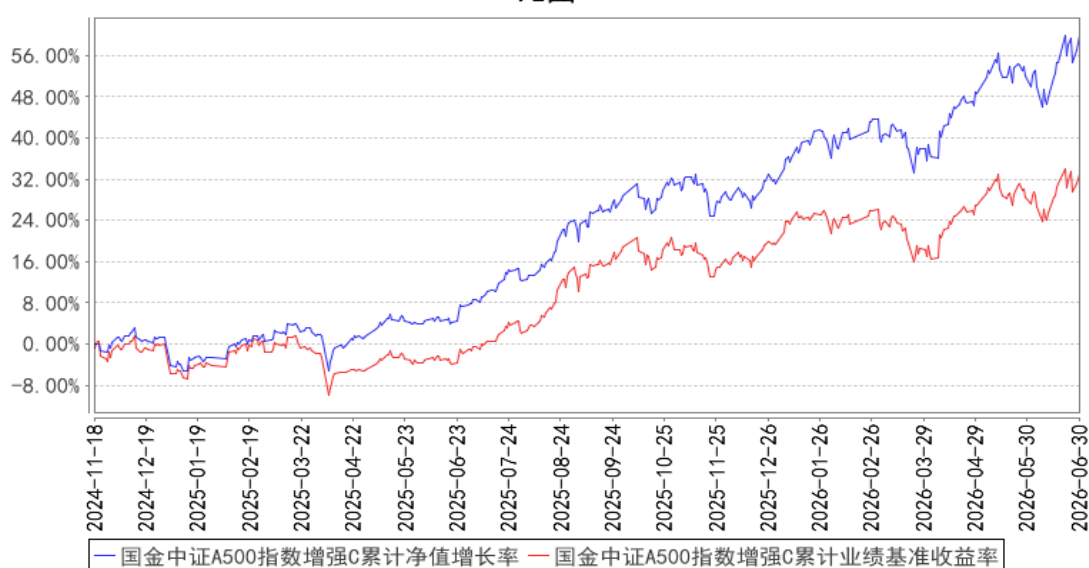
注：本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）*5%。

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A500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对比图



国金中证A500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对比图



注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2024 年 11 月 18 日，图示日期为 2024 年 11 月 18 日至 2026 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

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 2026 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 34 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、国金中证 A500 指数增强型证券投资基金、国金安瑞平衡混合型证券投资基金、国金红利量化选股混合型证券投资基金、国金中证全指指数增强型证券投资基金、国金安和债券型证券投资基金、国金智远量化选股混合型证券投资基金、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金、国金安裕债券型证券投资基金。

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		
姚加红	本基金的基金经理	2024 年 11 月 18 日	-	22 年	姚加红先生，北京航空航天大学硕士。2004 年 4 月至 2011 年 5 月在博时基金管理有限公司任信息技术部高级程序员。2011 年 6 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部总经理、指数投资事业部副总经理，现任量化投资中心总经理。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
姚加红	公募基金	4	27,750,947,236.52	2023 年 1 月 5 日
	私募资产管理计划	4	1,180,214,056.19	2016 年 4 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	28,931,161,292.71	-

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 A500 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，未出现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% 的情况。

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

市场环境方面，上半年市场活跃度处于近五年较高水平。市场风格方面，贝塔值、动量和短期反转等市场风格因子在报告期内的波动高于其长期均值水平，但整体持续性较强，特别是动量因子表现出相较历史类似时段更为极致的特征；报告期末，市值类因子的波动有所增大。行业涨跌方面，超半数中信一级行业在报告期内录得负收益，其中涨幅大于 40% 的行业为电子、通信和建材，跌幅较大的行业为消费者服务、综合金融、综合等。上半年市场持续受到宏观事件和 AI 叙事等多重因素影响，市场波动较大，各大类资产的波动均不同程度抬升。

本基金作为指数增强产品，投资于标的指数成份股及备选成份股的占比不低于 80%。报告期内，得益于较为严格的风险控制和分散持仓，本基金的超额收益水平和波动情况基本符合预期。

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 1.6076 元，累计单位净值为 1.6076 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 22.00%，同期业绩比较基准增长率为 11.34%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.5973 元，累计单位净值为 1.5973 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 21.76%，同期业绩比较基准增长率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在预期货币政策适度宽松、增量资金入场的背景下，市场流动性或保持充裕。上半年行情相对极致，市场经历较大幅度波动后，风格再平衡的可能性提升，行情有望逐步扩散，市场机会或趋于均衡，一定程度上利于量化基金超额收益的改善。

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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国金中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，由国金基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国金中证 A500 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	558,431,588.83	245,545,335.88
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,110,440,594.11	1,988,634,298.56
其中：股票投资		6,080,246,136.58	1,988,634,298.56
基金投资		-	-
债券投资		30,194,457.53	-
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	-	-
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		166,582,883.96	41,224,026.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,835,455,066.90	2,275,403,661.32
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		68,767,649.35	101,540,974.85

应付管理人报酬		3,774,241.85	1,279,589.77
应付托管费		471,780.23	159,948.71
应付销售服务费		1,167,379.79	424,321.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		963.94	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	112,390.71	187,792.95
负债合计		74,294,405.87	103,592,627.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,222,689,998.69	1,652,249,506.15
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,538,470,662.34	519,561,527.48
净资产合计		6,761,160,661.03	2,171,811,033.63
负债和净资产总计		6,835,455,066.90	2,275,403,661.32

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，国金中证 A500 指数增强 A 基金份额净值 1.6076 元，基金份额总额 1,588,484,982.49 份；国金中证 A500 指数增强 C 基金份额净值 1.5973 元，基金份额总额 2,634,205,016.20 份。国金中证 A500 指数增强份额总额合计为 4,222,689,998.69 份。

6.2 利润表

会计主体：国金中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		882,301,467.90	71,586,905.34
1. 利息收入		1,574,122.01	434,134.10
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,574,122.01	221,461.48
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		-	212,672.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		826,091,428.10	42,517,694.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	804,159,338.15	33,903,781.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	114,876.50	-
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	-

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	21,817,213.45	8,613,912.46
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	53,641,868.55	28,584,665.53
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	994,049.24	50,411.62
减：二、营业总支出		23,771,315.47	5,065,893.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,622,195.91	3,284,733.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,077,774.43	410,591.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,979,260.58	1,273,869.66
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		344.70	-
8. 其他费用	6.4.7.23	91,739.85	96,699.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		858,530,152.43	66,521,011.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		858,530,152.43	66,521,011.57
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		858,530,152.43	66,521,011.57

6.3 净资产变动表

会计主体：国金中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	1,652,249,506. 15	—	519,561,527.48	2,171,811,033.6 3
加：会计政策变更	—	—	—	—
前期差错更正	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
二、本期期初净资产	1,652,249,506. 15	—	519,561,527.48	2,171,811,033.6 3
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,570,440,492. 54	—	2,018,909,134. 86	4,589,349,627.4 0
(一)、综合收益总额	—	—	858,530,152.43	858,530,152.43
(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)	2,570,440,492. 54	—	1,160,378,982. 43	3,730,819,474.9 7
其中：1. 基金申购款	6,250,000,671. 16	—	2,857,685,151. 72	9,107,685,822.8 8
2. 基金赎回款	— 3,679,560,178. 62	—	— 1,697,306,169. 29	— 5,376,866,347.9 1
(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	4,222,689,998. 69	—	2,538,470,662. 34	6,761,160,661.0 3
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	984,997,661.78	-	-1,278,098.40	983,719,563.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	984,997,661.78	-	-1,278,098.40	983,719,563.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,362,430.73	-	76,625,670.99	66,263,240.26
(一)、综合收益总额	-	-	66,521,011.57	66,521,011.57
(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)	-10,362,430.73	-	10,104,659.42	-257,771.31
其中：1. 基金申购款	965,736,592.10	-	30,422,832.36	996,159,424.46
2. 基金赎回款	-976,099,022.83	-	-20,318,172.94	-996,417,195.77
(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	974,635,231.05	-	75,347,572.59	1,049,982,803.64

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 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），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[2024]1449 号文《关于准予国金中证 A500 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 2024 年 11 月 18 日正式生效，本基金首次设立募集规模为 984,997,661.78 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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金的投资范围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（包含主板、科创板、创业板及其他依法发行上市的股票和存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、以及其他银行存款等）、货币市场工具、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）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 50%。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，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构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 A500 指数收益率 $\times 95\%$ + 同期银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

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、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》、《公开募集

证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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》和中国证监会、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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止会计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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资

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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）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；

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。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	313,329,490.66
等于：本金	313,187,063.87
加：应计利息	142,426.79
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	245,102,098.17
等于：本金	245,100,112.92
加：应计利息	1,985.25
减：坏账准备	-
合计	558,431,588.83

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,989,700,207.42	-	6,080,246,136.58	90,545,929.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	29,989,500.00	167,457.53	30,194,457.53	37,500.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	29,989,500.00	167,457.53	30,194,457.53	37,500.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,019,689,707.42	167,457.53	6,110,440,594.11	90,583,429.16

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

无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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

无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.8 其他资产

无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,326.86
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	91,739.85
其他	15,324.00
合计	112,390.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	753,521,025.65	753,521,025.65
本期申购	1,451,888,150.90	1,451,888,150.90
本期赎回（以“-”号填列）	-616,924,194.06	-616,924,194.06

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	1,588,484,982.49	1,588,484,982.49

国金中证 A500 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	898,728,480.50	898,728,480.50
本期申购	4,798,112,520.26	4,798,112,520.26
本期赎回（以“-”号填列）	-3,062,635,984.56	-3,062,635,984.56
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	2,634,205,016.20	2,634,205,016.20

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

无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金中证 A500 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	202,442,416.73	36,927,478.20	239,369,894.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	202,442,416.73	36,927,478.20	239,369,894.93
本期利润	325,199,668.15	18,354,166.67	343,553,834.82
本期基金份额交易产生的变动数	336,855,629.67	45,365,533.30	382,221,162.97
其中：基金申购款	584,304,936.77	79,620,283.71	663,925,220.48
基金赎回款	-247,449,307.10	-34,254,750.41	-281,704,057.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	864,497,714.55	100,647,178.17	965,144,892.72

国金中证 A500 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	236,246,100.71	43,945,531.84	280,191,632.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	236,246,100.71	43,945,531.84	280,191,632.55
本期利润	479,688,615.73	35,287,701.88	514,976,317.61
本期基金份额交易产生的变动数	690,976,245.27	87,181,574.19	778,157,819.46
其中：基金申购款	1,928,244,298.96	265,515,632.28	2,193,759,931.24
基金赎回款	-1,237,268,053.69	-178,334,058.09	-1,415,602,111.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,406,910,961.71	166,414,807.91	1,573,325,769.62

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,490,814.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	48,490.47
结算备付金利息收入	-
其他	34,816.95
合计	1,574,122.01

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	804,159,338.15
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	804,159,338.15

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,693,472,885.14
减：卖出股票成本总额	11,875,528,750.59
减：交易费用	13,784,796.40
买卖股票差价收入	804,159,338.15

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	114,876.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	114,876.50

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

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

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

无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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

无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	21,817,213.45
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	21,817,213.45

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	53,641,868.55
股票投资	53,604,368.55
债券投资	37,500.00
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	53,641,868.55

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	992,343.32
基金转换费收入	1,705.92
合计	994,049.24

6.4.7.22 信用减值损失

无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	91,739.85

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、关联关系

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
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

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

无

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,622,195.91	3,284,733.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,135,263.74	1,264,820.37
应支付基金管理人的净管理费	10,486,932.17	2,019,912.86

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,077,774.43	410,591.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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 A500 指数 增强 A	国金中证 A500 指数 增强 C	合计
国金基金管理有限公司	-	268,473.01	268,473.01
国金证券股份有限公司	-	51,851.66	51,851.66
中信证券股份有限公司	-	975,922.96	975,922.96
合计	-	1,296,247.63	1,296,247.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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 A500 指数 增强 A	国金中证 A500 指数 增强 C	合计
国金基金管理有限公司	-	127,868.39	127,868.39
国金证券股份有限公司	-	18,674.29	18,674.29
中信证券股份有限公司	-	368,147.35	368,147.35
合计	-	514,690.03	514,690.03

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

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

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

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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	国金中证 A500 指数增强 A	国金中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 11 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	3,898,287.46
报告期间申购/买入总份额	17,820,006.10	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,820,006.10	3,898,287.46
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.1218%	0.1480%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	国金中证 A500 指数增强 A	国金中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 11 月 18 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	3,898,287.46
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	3,898,287.46
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.4971%

注：1. 基金管理人投资本基金的相关费用按基金招募说明书及相关公告的有关规定计算并支付。

2. 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。

6.4.10.5.2 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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
中信证券股份有限公司-活期存款	313,329,490.66	1,490,814.59	52,222,641.40	183,634.93

注：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

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688635	长	2026	6 个月	锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

	进 光 子	年 5 月 20 日		期股 票流 通受 限						
--	-------------	------------------	--	---------------------	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

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

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级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

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级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

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的同业存单投资。

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

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 2026 年 6 月 30 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	558,431,588.83	-	-	-	-	-	558,431,588.83

交易性金融资产	-	-	30,194,457.53	-	-	6,080,246,136.58	6,110,440,594.11
应收申购款	-	-	-	-	-	166,582,883.96	166,582,883.96
资产总计	558,431,588.83	-	30,194,457.53	-	-	6,246,829,020.54	6,835,455,066.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	68,767,649.35	68,767,649.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,774,241.85	3,774,241.85
应付托管费	-	-	-	-	-	471,780.23	471,780.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,167,379.79	1,167,379.79
应交税费	-	-	-	-	-	963.94	963.94
其他负债	-	-	-	-	-	112,390.71	112,390.71
负债总计	-	-	-	-	-	74,294,405.87	74,294,405.87
利率敏感度缺口	558,431,588.83	-	30,194,457.53	-	-	6,172,534,614.67	6,761,160,661.03
上年度末 2025 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	245,545,335.88	-	-	-	-	-	245,545,335.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,988,634,298.56	1,988,634,298.56
应收申购款	-	-	-	-	-	41,224,026.88	41,224,026.88
资产总计	245,545,335.88	-	-	-	-	2,029,858,325.44	2,275,403,661.32
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	101,540,974.85	101,540,974.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,279,589.77	1,279,589.77
应付托管费	-	-	-	-	-	159,948.71	159,948.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	424,321.41	424,321.41
其他负债	-	-	-	-	-	187,792.95	187,792.95
负债总计	-	-	-	-	-	103,592,627.69	103,592,627.69
利率敏感度缺口	245,545,335.88	-	-	-	-	1,926,265,697.75	2,171,811,033.63

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

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	6,080,246,136.58	89.93	1,988,634,298.56	91.57
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	30,194,457.53	0.45	—	—
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	6,110,440,594.11	90.38	1,988,634,298.56	91.57

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 A500 指数（000510.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 A500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 A500 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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	+5%	330,256,481.51	95,319,955.35
	-5%	-330,256,481.51	-95,319,955.35

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	6,080,206,688.26	1,988,634,298.56
第二层次	30,194,457.53	-
第三层次	39,448.32	-
合计	6,110,440,594.11	1,988,634,298.56

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	6,080,246,136.58	88.95
	其中: 股票	6,080,246,136.58	88.95
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	30,194,457.53	0.44
	其中: 债券	30,194,457.53	0.44
	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	558,431,588.83	8.17
8	其他各项资产	166,582,883.96	2.44
9	合计	6,835,455,066.90	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	1,861,468.00	0.03
B	采矿业	287,432,210.14	4.25

C	制造业	3,544,137,672.82	52.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	145,969,628.52	2.16
E	建筑业	11,198,247.00	0.17
F	批发和零售业	1,806,119.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	178,073,987.88	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	218,594,492.39	3.23
J	金融业	524,926,892.65	7.76
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	182,965,203.82	2.71
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,096,965,922.22	75.39

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	573,060.48	0.01
B	采矿业	46,041,583.57	0.68
C	制造业	483,275,630.11	7.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,826,387.00	0.38
E	建筑业	1,834,814.80	0.03
F	批发和零售业	16,230,332.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	2,392,309.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件	183,070,971.93	2.71

	和信息技术服务业		
J	金融业	199,210,224.30	2.95
K	房地产业	4,974,558.00	0.07
L	租赁和商务服务业	5,590,099.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	4,330,755.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	6,220,961.17	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,851,528.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,857,000.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	983,280,214.36	14.54

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	688256	寒武纪	126,989	202,617,298.95	3.00
2	000725	京东方 A	21,797,500	189,202,300.00	2.80
3	603259	药明康德	1,469,482	182,965,203.82	2.71
4	300308	中际旭创	137,831	175,045,370.00	2.59
5	601288	农业银行	23,050,200	139,914,714.00	2.07
6	688469	芯联集成	12,115,120	128,541,423.20	1.90
7	600150	中国船舶	3,797,192	128,307,117.68	1.90
8	002185	华天科技	5,737,309	127,999,363.79	1.89
9	002600	领益智造	7,345,900	127,377,906.00	1.88
10	605117	德业股份	1,125,020	119,454,623.60	1.77
11	002466	天齐锂业	1,929,193	118,298,114.76	1.75
12	601328	交通银行	17,993,500	115,698,205.00	1.71
13	603993	洛阳钼业	6,424,800	112,755,240.00	1.67
14	002916	深南电路	240,576	110,159,750.40	1.63
15	688008	澜起科技	352,048	109,099,675.20	1.61
16	600011	华能国际	14,325,200	108,728,268.00	1.61

17	300782	卓胜微	972,046	106,516,800.68	1.58
18	002384	东山精密	400,328	105,026,050.80	1.55
19	300033	同花顺	429,090	103,410,690.00	1.53
20	300014	亿纬锂能	1,537,866	100,007,425.98	1.48
21	600362	江西铜业	2,152,148	93,188,008.40	1.38
22	600584	长电科技	897,798	92,966,982.90	1.38
23	002281	光迅科技	361,082	92,776,409.08	1.37
24	002460	赣锋锂业	1,386,400	90,670,560.00	1.34
25	300408	三环集团	542,000	90,459,800.00	1.34
26	600547	山东黄金	3,812,796	88,037,459.64	1.30
27	600893	航发动力	2,169,576	83,181,543.84	1.23
28	002008	大族激光	538,901	80,894,429.11	1.20
29	601689	拓普集团	1,383,205	78,040,426.10	1.15
30	300604	长川科技	227,160	77,556,967.20	1.15
31	688390	固德威	674,766	73,218,858.66	1.08
32	600418	江淮汽车	2,810,416	72,593,045.28	1.07
33	300750	宁德时代	169,311	66,540,916.11	0.98
34	600026	中远海能	3,660,972	65,677,837.68	0.97
35	000938	紫光股份	1,967,300	56,776,278.00	0.84
36	601628	中国人寿	1,555,600	54,990,460.00	0.81
37	600115	中国东航	12,201,800	46,488,858.00	0.69
38	300274	阳光电源	284,179	45,190,144.58	0.67
39	600519	贵州茅台	37,200	44,100,228.00	0.65
40	603986	兆易创新	53,374	43,499,810.00	0.64
41	600489	中金黄金	2,346,180	42,348,549.00	0.63
42	002493	荣盛石化	3,863,900	41,536,925.00	0.61
43	600309	万华化学	577,711	39,521,209.51	0.58
44	300059	东方财富	1,916,300	39,054,194.00	0.58
45	600549	厦门钨业	447,300	38,109,960.00	0.56
46	002294	信立泰	1,176,800	37,528,152.00	0.56
47	688506	百利天恒	126,133	37,086,885.99	0.55
48	000333	美的集团	484,646	36,605,312.38	0.54
49	300803	指南针	396,259	36,325,062.53	0.54
50	600795	国电电力	7,443,756	34,762,340.52	0.51
51	002821	凯莱英	210,300	34,068,600.00	0.50
52	600160	巨化股份	582,800	30,894,228.00	0.46
53	002851	麦格米特	178,300	29,808,194.00	0.44
54	600029	南方航空	5,625,300	29,139,054.00	0.43
55	300919	中伟新材	653,700	28,599,375.00	0.42
56	300438	鹏辉能源	338,718	28,062,786.30	0.42
57	601225	陕西煤业	1,349,530	27,462,935.50	0.41
58	300433	蓝思科技	504,500	27,071,470.00	0.40
59	603799	华友钴业	520,300	25,109,678.00	0.37

60	601816	京沪高铁	5,234,700	23,713,191.00	0.35
61	300502	新易盛	39,014	23,681,498.00	0.35
62	000630	铜陵有色	3,540,300	22,516,308.00	0.33
63	002064	华峰化学	2,318,700	22,004,463.00	0.33
64	601319	中国人保	3,092,900	20,908,004.00	0.31
65	301308	江波龙	28,923	20,356,007.40	0.30
66	600346	恒力石化	1,122,200	19,874,162.00	0.29
67	002812	恩捷股份	287,900	19,263,389.00	0.28
68	688126	沪硅产业	475,028	18,948,866.92	0.28
69	000157	中联重科	2,489,800	17,353,906.00	0.26
70	002558	巨人网络	579,724	15,977,193.44	0.24
71	002273	水晶光电	421,000	14,937,080.00	0.22
72	603806	福斯特	886,500	14,884,335.00	0.22
73	000975	山金国际	735,900	12,510,300.00	0.19
74	300661	圣邦股份	84,900	12,181,452.00	0.18
75	000733	振华科技	210,800	11,939,712.00	0.18
76	000301	东方盛虹	974,900	11,162,605.00	0.17
77	000858	五 粮 液	146,650	10,852,100.00	0.16
78	002138	顺络电子	138,400	10,117,040.00	0.15
79	601868	中国能建	3,724,900	9,945,483.00	0.15
80	600816	建元信托	3,966,848	9,679,109.12	0.14
81	600018	上港集团	1,702,750	8,036,980.00	0.12
82	002738	中矿资源	124,100	7,320,659.00	0.11
83	000617	中油资本	750,600	4,946,454.00	0.07
84	002414	高德红外	333,300	4,419,558.00	0.07
85	300122	智飞生物	370,500	4,331,145.00	0.06
86	600028	中国石化	968,100	4,317,726.00	0.06
87	603260	合盛硅业	73,780	3,560,622.80	0.05
88	600426	华鲁恒升	130,600	3,123,952.00	0.05
89	600233	圆通速递	160,800	2,532,600.00	0.04
90	301358	湖南裕能	33,000	2,503,710.00	0.04
91	002756	永兴材料	44,100	2,497,824.00	0.04
92	601111	中国国航	410,800	2,485,340.00	0.04
93	603392	万泰生物	92,000	2,481,240.00	0.04
94	600803	新奥股份	156,900	2,479,020.00	0.04
95	002714	牧原股份	53,200	1,861,468.00	0.03
96	600998	九州通	385,100	1,806,119.00	0.03
97	600039	四川路桥	160,200	1,252,764.00	0.02
98	000932	华菱钢铁	309,711	1,074,697.17	0.02
99	002603	以岭药业	61,940	929,100.00	0.01
100	000738	航发控制	31,500	576,135.00	0.01
101	000977	浪潮信息	7,900	553,000.00	0.01
102	002120	韵达股份	20	127.20	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	301396	宏景科技	395,487	131,143,489.20	1.94
2	301536	星宸科技	716,800	92,259,328.00	1.36
3	601688	华泰证券	2,440,900	50,331,358.00	0.74
4	601869	长飞光纤	61,800	33,736,620.00	0.50
5	600919	江苏银行	3,032,000	32,684,960.00	0.48
6	300769	德方纳米	414,100	27,537,650.00	0.41
7	300548	长芯博创	88,900	24,714,200.00	0.37
8	601009	南京银行	2,484,800	24,574,672.00	0.36
9	001389	广合科技	98,900	23,464,025.00	0.35
10	000629	钒钛股份	6,657,800	22,237,052.00	0.33
11	601377	兴业证券	2,782,010	16,803,340.40	0.25
12	601699	潞安环能	917,700	13,104,756.00	0.19
13	600926	杭州银行	902,300	13,038,235.00	0.19
14	601698	中国卫通	404,600	12,239,150.00	0.18
15	300986	志特新材	688,512	11,807,980.80	0.17
16	301086	鸿富瀚	51,400	10,756,992.00	0.16
17	688667	菱电电控	80,062	10,700,286.30	0.16
18	300765	石药创新	383,036	10,430,070.28	0.15
19	600015	华夏银行	1,617,300	10,334,547.00	0.15
20	603950	长源东谷	116,600	9,844,538.00	0.15
21	000983	山西焦煤	1,504,100	8,723,780.00	0.13
22	600845	宝信软件	521,100	8,665,893.00	0.13
23	002736	国信证券	806,600	8,057,934.00	0.12
24	002445	中南文化	2,712,200	7,702,648.00	0.11
25	688301	奕瑞科技	58,506	7,254,744.00	0.11
26	601898	中煤能源	579,484	7,058,115.12	0.10
27	002945	华林证券	510,600	6,857,358.00	0.10
28	601336	新华保险	114,900	6,854,934.00	0.10
29	300870	欧陆通	18,400	6,360,696.00	0.09
30	600188	兖矿能源	350,885	6,235,226.45	0.09
31	000921	海信家电	212,300	5,800,036.00	0.09
32	603171	税友股份	140,200	5,586,970.00	0.08
33	688052	纳芯微	18,194	5,245,512.14	0.08
34	002153	石基信息	687,200	4,968,456.00	0.07
35	002488	金固股份	495,700	4,416,687.00	0.07
36	600901	江苏金租	757,800	4,357,350.00	0.06
37	600116	三峡水利	694,300	3,888,080.00	0.06
38	600318	新力金融	641,900	3,864,238.00	0.06
39	601061	中信金属	357,700	3,852,429.00	0.06

40	001280	中国铷业	57,500	3,835,250.00	0.06
41	600578	京能电力	588,200	3,793,890.00	0.06
42	300638	广和通	203,600	3,768,636.00	0.06
43	600830	香溢融通	468,500	3,733,945.00	0.06
44	300187	永清环保	738,700	3,730,435.00	0.06
45	600348	华阳股份	481,500	3,683,475.00	0.05
46	603937	丽岛新材	246,400	3,454,528.00	0.05
47	600461	洪城环境	369,700	3,349,482.00	0.05
48	600023	浙能电力	633,300	3,331,158.00	0.05
49	301072	中捷精工	77,300	3,170,073.00	0.05
50	603682	锦和商管	421,900	3,122,060.00	0.05
51	600369	西南证券	774,100	3,111,882.00	0.05
52	300381	溢多利	553,000	3,107,860.00	0.05
53	601555	东吴证券	391,900	3,103,848.00	0.05
54	001278	一彬科技	201,600	3,100,608.00	0.05
55	301159	三维天地	106,400	3,096,240.00	0.05
56	601686	友发集团	578,600	2,794,638.00	0.04
57	603085	天成自控	256,700	2,790,329.00	0.04
58	601229	上海银行	315,000	2,734,200.00	0.04
59	002863	今飞凯达	629,400	2,668,656.00	0.04
60	600969	郴电国际	347,500	2,651,425.00	0.04
61	300550	和仁科技	189,800	2,530,034.00	0.04
62	603615	茶花股份	155,300	2,508,095.00	0.04
63	300823	建科智能	171,100	2,494,638.00	0.04
64	000619	海螺新材	565,100	2,486,440.00	0.04
65	002110	三钢闽光	863,100	2,485,728.00	0.04
66	301060	兰卫医学	303,900	2,482,863.00	0.04
67	002566	益盛药业	407,600	2,461,904.00	0.04
68	300916	朗特智能	104,200	2,435,154.00	0.04
69	605007	五洲特纸	178,000	2,383,420.00	0.04
70	002845	同兴达	144,900	2,376,360.00	0.04
71	600479	千金药业	246,100	2,288,730.00	0.03
72	601128	常熟银行	381,160	2,218,351.20	0.03
73	002483	润邦股份	447,540	2,210,847.60	0.03
74	600025	华能水电	248,100	2,205,609.00	0.03
75	600985	淮北矿业	153,700	2,159,485.00	0.03
76	600351	亚宝药业	346,800	1,994,100.00	0.03
77	002687	乔治白	371,100	1,944,564.00	0.03
78	300514	友讯达	201,800	1,886,830.00	0.03
79	003030	祖名股份	91,800	1,886,490.00	0.03
80	605369	拱东医疗	106,976	1,876,359.04	0.03
81	001366	播恩集团	172,900	1,874,236.00	0.03
82	688616	西力科技	185,447	1,873,014.70	0.03

83	000729	燕京啤酒	184,700	1,871,011.00	0.03
84	300929	华骐环保	177,500	1,870,850.00	0.03
85	301166	优宁维	72,500	1,869,775.00	0.03
86	000548	湖南投资	457,100	1,869,539.00	0.03
87	601003	柳钢股份	554,600	1,869,002.00	0.03
88	000581	威孚高科	109,700	1,867,094.00	0.03
89	300535	达威股份	136,900	1,865,947.00	0.03
90	688101	三达膜	112,878	1,865,873.34	0.03
91	301061	匠心家居	53,200	1,865,724.00	0.03
92	605268	王力安防	207,600	1,864,248.00	0.03
93	002999	天禾股份	350,400	1,864,128.00	0.03
94	600955	维远股份	126,600	1,863,552.00	0.03
95	300768	迪普科技	135,300	1,863,081.00	0.03
96	603836	海程邦达	235,760	1,862,504.00	0.03
97	600236	桂冠电力	212,100	1,862,238.00	0.03
98	001218	丽臣实业	84,400	1,861,864.00	0.03
99	603917	合力科技	158,500	1,860,790.00	0.03
100	000576	甘化科工	283,200	1,860,624.00	0.03
101	688187	时代电气	27,081	1,859,381.46	0.03
102	688356	键凯科技	24,118	1,859,015.44	0.03
103	603787	新日股份	204,400	1,857,996.00	0.03
104	000166	申万宏源	422,200	1,857,680.00	0.03
105	002671	龙泉股份	500,700	1,857,597.00	0.03
106	603999	读者传媒	371,400	1,857,000.00	0.03
107	001338	永顺泰	221,200	1,855,868.00	0.03
108	600713	南京医药	370,900	1,854,500.00	0.03
109	301103	何氏眼科	123,600	1,851,528.00	0.03
110	300928	华安鑫创	63,900	1,845,432.00	0.03
111	002830	名雕股份	106,120	1,834,814.80	0.03
112	002850	科达利	9,100	1,722,630.00	0.03
113	603700	宁水集团	147,300	1,710,153.00	0.03
114	600809	山西汾酒	15,400	1,684,298.00	0.02
115	601158	重庆水务	426,700	1,647,062.00	0.02
116	301198	喜悦智行	122,400	1,640,160.00	0.02
117	603786	科博达	37,500	1,534,125.00	0.02
118	688615	合合信息	13,406	1,516,218.60	0.02
119	600742	富维股份	202,400	1,465,376.00	0.02
120	002670	国盛证券	132,700	1,459,700.00	0.02
121	002921	联诚精密	46,400	1,268,576.00	0.02
122	301223	中荣股份	78,200	1,260,584.00	0.02
123	300838	浙江力诺	94,000	1,254,900.00	0.02
124	001373	翔腾新材	41,500	1,251,225.00	0.02
125	301097	天益医疗	35,026	1,250,428.20	0.02

126	003012	东鹏控股	286,700	1,250,012.00	0.02
127	688211	中科微至	36,299	1,249,411.58	0.02
128	000586	汇源通信	94,500	1,248,345.00	0.02
129	000990	诚志股份	152,500	1,247,450.00	0.02
130	300583	赛托生物	111,000	1,246,530.00	0.02
131	300978	东箭科技	153,700	1,246,507.00	0.02
132	603506	南都物业	133,400	1,245,956.00	0.02
133	688338	赛科希德	42,198	1,245,262.98	0.02
134	600510	黑牡丹	166,900	1,245,074.00	0.02
135	603190	亚通精工	55,000	1,244,100.00	0.02
136	688358	祥生医疗	40,696	1,244,076.72	0.02
137	603161	科华控股	93,700	1,243,399.00	0.02
138	301539	宏鑫科技	94,900	1,243,190.00	0.02
139	603345	安井食品	15,500	1,242,945.00	0.02
140	300659	中孚信息	130,800	1,242,600.00	0.02
141	603987	康德莱	180,000	1,242,000.00	0.02
142	002968	新大正	146,800	1,241,928.00	0.02
143	300519	新光药业	104,800	1,241,880.00	0.02
144	605567	春雪食品	155,400	1,241,646.00	0.02
145	002016	世荣兆业	310,400	1,241,600.00	0.02
146	600925	苏能股份	309,600	1,241,496.00	0.02
147	601065	江盐集团	184,900	1,240,679.00	0.02
148	000919	金陵药业	212,800	1,240,624.00	0.02
149	301339	通行宝	121,200	1,239,876.00	0.02
150	603126	中材节能	196,600	1,238,580.00	0.02
151	603689	皖天然气	178,700	1,238,391.00	0.02
152	601199	江南水务	223,500	1,238,190.00	0.02
153	300753	爱朋医疗	65,400	1,238,022.00	0.02
154	000702	正虹科技	249,600	1,238,016.00	0.02
155	000590	古汉医药	151,300	1,236,121.00	0.02
156	301100	风光股份	88,900	1,235,710.00	0.02
157	002737	葵花药业	110,100	1,234,221.00	0.02
158	603970	中农立华	128,100	1,233,603.00	0.02
159	600572	康恩贝	314,600	1,233,232.00	0.02
160	300439	美康生物	153,500	1,232,605.00	0.02
161	002333	罗普斯金	259,400	1,208,804.00	0.02
162	002758	浙农股份	150,600	1,189,740.00	0.02
163	002275	桂林三金	97,100	1,183,649.00	0.02
164	301051	信濠光电	60,400	1,171,760.00	0.02
165	688633	星球石墨	38,020	1,130,334.60	0.02
166	603296	华勤技术	14,840	1,102,166.80	0.02
167	603385	惠达卫浴	219,800	1,072,624.00	0.02
168	601963	重庆银行	98,800	995,904.00	0.01

169	688628	优利德	9,922	981,682.68	0.01
170	600851	海欣股份	72,300	651,423.00	0.01
171	600688	上海石化	219,600	643,428.00	0.01
172	301177	迪阿股份	23,100	636,867.00	0.01
173	688026	洁特生物	40,508	636,380.68	0.01
174	603737	三棵树	26,100	629,010.00	0.01
175	600615	鑫源智造	68,000	628,320.00	0.01
176	688030	山石网科	39,681	626,562.99	0.01
177	603237	五芳斋	50,600	626,428.00	0.01
178	301337	亚华电子	22,500	625,500.00	0.01
179	301215	中汽股份	120,500	625,395.00	0.01
180	600386	北巴传媒	200,100	624,312.00	0.01
181	603519	立霸股份	40,800	624,240.00	0.01
182	001223	欧克科技	11,740	623,746.20	0.01
183	002773	康弘药业	30,500	623,725.00	0.01
184	688533	上声电子	29,890	623,505.40	0.01
185	688475	萤石网络	22,775	622,896.25	0.01
186	603355	莱克电气	23,600	622,568.00	0.01
187	301515	港通医疗	35,500	622,315.00	0.01
188	600051	宁波联合	110,500	622,115.00	0.01
189	001236	弘业期货	89,500	622,025.00	0.01
190	300365	恒华科技	135,700	621,506.00	0.01
191	003008	开普检测	36,400	621,348.00	0.01
192	301065	本立科技	35,200	621,280.00	0.01
193	300926	博俊科技	35,000	621,250.00	0.01
194	600081	东风科技	68,400	621,072.00	0.01
195	688681	科汇股份	44,413	620,893.74	0.01
196	601368	绿城水务	151,800	620,862.00	0.01
197	600099	林海股份	77,800	620,844.00	0.01
198	300176	鸿特科技	128,000	620,800.00	0.01
198	603059	倍加洁	25,600	620,800.00	0.01
199	300851	交大思诺	27,900	620,775.00	0.01
200	000597	东北制药	146,400	620,736.00	0.01
201	605001	威奥股份	113,800	620,210.00	0.01
202	601952	苏垦农发	82,800	620,172.00	0.01
203	301006	迈拓股份	49,400	619,970.00	0.01
204	301202	朗威股份	18,600	619,938.00	0.01
205	300532	今天国际	99,500	619,885.00	0.01
206	002767	先锋电子	37,400	619,718.00	0.01
207	688466	金科环境	48,299	619,676.17	0.01
208	301170	锡南科技	28,800	619,488.00	0.01
209	300577	开润股份	42,400	619,464.00	0.01
210	301268	铭利达	44,300	619,314.00	0.01

211	300941	创识科技	45,100	619,223.00	0.01
212	603711	香飘飘	55,700	618,827.00	0.01
213	603029	天鹅股份	44,000	618,640.00	0.01
214	301290	东星医疗	22,700	618,575.00	0.01
215	300694	蠡湖股份	64,400	618,240.00	0.01
216	603600	永艺股份	69,700	618,239.00	0.01
217	300371	汇中股份	63,200	618,096.00	0.01
218	002813	路畅科技	32,700	618,030.00	0.01
219	603317	天味食品	47,500	617,975.00	0.01
220	600616	金枫酒业	164,700	617,625.00	0.01
221	300406	九强生物	56,500	617,545.00	0.01
222	000030	富奥股份	159,200	616,104.00	0.01
223	603566	普莱柯	62,900	615,791.00	0.01
224	001228	永泰运	23,700	605,535.00	0.01
225	002099	海翔药业	108,700	573,936.00	0.01
226	001201	东瑞股份	52,768	573,060.48	0.01
227	600075	新疆天业	141,600	572,064.00	0.01
228	003011	海象新材	30,100	546,917.00	0.01
229	600873	梅花生物	74,200	545,370.00	0.01
230	600908	无锡银行	106,800	542,544.00	0.01
231	603323	苏农银行	139,410	539,516.70	0.01
232	000589	贵州轮胎	131,300	533,078.00	0.01
233	600928	西安银行	162,600	531,702.00	0.01
234	603167	渤海轮渡	61,000	522,770.00	0.01
235	688635	长进光子	340	135,802.32	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	603986	兆易创新	480,915,368.48	22.14
2	300308	中际旭创	444,182,323.25	20.45
3	300274	阳光电源	331,197,217.47	15.25
4	002916	深南电路	302,310,305.26	13.92
5	688008	澜起科技	287,172,142.80	13.22
6	300750	宁德时代	273,015,229.70	12.57
7	688256	寒武纪	268,069,924.36	12.34
8	300408	三环集团	228,383,984.28	10.52
9	002384	东山精密	225,136,966.13	10.37
10	601288	农业银行	220,448,592.00	10.15
11	603993	洛阳钼业	220,416,419.00	10.15
12	002008	大族激光	197,369,241.99	9.09
13	002463	沪电股份	196,373,145.94	9.04

14	300014	亿纬锂能	191,146,636.76	8.80
15	603259	药明康德	187,005,674.91	8.61
16	002475	立讯精密	180,139,001.90	8.29
17	605117	德业股份	171,250,206.79	7.89
18	300782	卓胜微	171,087,600.74	7.88
19	000725	京东方 A	170,116,111.43	7.83
20	002371	北方华创	166,901,290.33	7.68
21	002281	光迅科技	158,458,457.06	7.30
22	002466	天齐锂业	156,512,028.93	7.21
23	601869	长飞光纤	156,042,225.40	7.18
24	600150	中国船舶	154,536,513.41	7.12
25	600547	山东黄金	153,631,790.04	7.07
26	002460	赣锋锂业	151,706,413.43	6.99
27	300394	天孚通信	148,678,276.63	6.85
28	300502	新易盛	147,916,315.76	6.81
29	600362	江西铜业	145,256,645.91	6.69
30	601689	拓普集团	143,140,362.36	6.59
31	300751	迈为股份	142,418,330.50	6.56
32	688012	中微公司	141,149,210.23	6.50
33	002185	华天科技	139,047,681.46	6.40
34	301396	宏景科技	135,705,483.51	6.25
35	603799	华友钴业	133,250,955.50	6.14
36	601328	交通银行	131,607,030.00	6.06
37	300136	信维通信	130,676,632.74	6.02
38	002600	领益智造	128,232,509.00	5.90
39	600584	长电科技	128,149,740.38	5.90
40	301308	江波龙	127,548,573.94	5.87
41	300604	长川科技	126,768,996.00	5.84
42	600011	华能国际	123,701,261.97	5.70
43	000063	中兴通讯	123,393,782.41	5.68
44	688469	芯联集成	117,838,769.54	5.43
45	600519	贵州茅台	116,648,243.81	5.37
46	600893	航发动力	115,551,711.94	5.32
47	688521	芯原股份	113,504,736.27	5.23
48	000338	潍柴动力	112,663,772.60	5.19
49	300033	同花顺	110,449,111.06	5.09
50	300438	鹏辉能源	109,597,920.74	5.05
51	601872	招商轮船	104,965,009.46	4.83
52	600309	万华化学	104,895,305.80	4.83
53	000938	紫光股份	98,793,183.00	4.55
54	600183	生益科技	97,092,159.00	4.47
55	002273	水晶光电	96,218,541.00	4.43
56	601225	陕西煤业	90,980,379.25	4.19

57	600010	包钢股份	90,773,247.40	4.18
58	600026	中远海能	90,508,521.64	4.17
59	600115	中国东航	90,245,707.05	4.16
60	300059	东方财富	89,152,522.25	4.10
61	002812	恩捷股份	87,574,872.76	4.03
62	002436	兴森科技	86,806,915.37	4.00
63	600418	江淮汽车	86,517,032.08	3.98
64	688167	炬光科技	86,361,771.70	3.98
65	002709	天赐材料	86,154,853.01	3.97
66	688390	固德威	84,865,468.13	3.91
67	300017	网宿科技	84,591,844.44	3.89
68	001309	德明利	84,556,466.00	3.89
69	301536	星宸科技	81,609,695.00	3.76
70	300454	深信服	80,820,703.83	3.72
71	002493	荣盛石化	75,648,562.32	3.48
72	002294	信立泰	67,275,313.35	3.10
73	688525	佰维存储	67,250,266.76	3.10
74	300567	精测电子	66,241,088.85	3.05
75	300442	润泽科技	66,043,636.60	3.04
76	000792	盐湖股份	65,563,595.43	3.02
77	601012	隆基绿能	64,903,730.64	2.99
78	601919	中远海控	62,793,662.60	2.89
79	000768	中航西飞	60,426,829.00	2.78
80	300919	中伟新材	60,029,049.27	2.76
81	600938	中国海油	58,333,417.00	2.69
82	601628	中国人寿	57,621,597.20	2.65
83	300124	汇川技术	56,594,961.63	2.61
84	601688	华泰证券	55,914,675.00	2.57
85	000651	格力电器	55,054,447.78	2.53
86	600489	中金黄金	54,088,915.06	2.49
87	002738	中矿资源	52,154,814.76	2.40
88	600118	中国卫星	50,596,334.67	2.33
89	300857	协创数据	50,391,690.86	2.32
90	600879	航天电子	49,846,082.57	2.30
91	601868	中国能建	48,856,501.00	2.25
92	600029	南方航空	48,780,016.00	2.25
93	002821	凯莱英	47,669,393.48	2.19
94	002851	麦格米特	46,287,324.00	2.13
95	600690	海尔智家	46,079,141.00	2.12
96	600549	厦门钨业	45,699,884.00	2.10
97	688498	源杰科技	45,429,397.79	2.09
98	600795	国电电力	44,316,159.00	2.04
99	000629	钒钛股份	43,847,336.00	2.02

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	603986	兆易创新	561,685,344.44	25.86
2	300308	中际旭创	384,473,105.83	17.70
3	300274	阳光电源	373,849,850.48	17.21
4	300750	宁德时代	268,093,629.96	12.34
5	002916	深南电路	265,620,388.67	12.23
6	002371	北方华创	253,389,667.50	11.67
7	688008	澜起科技	221,487,206.15	10.20
8	002463	沪电股份	217,227,019.77	10.00
9	002475	立讯精密	196,264,225.69	9.04
10	300408	三环集团	194,283,270.24	8.95
11	301308	江波龙	193,963,673.43	8.93
12	002008	大族激光	187,305,071.13	8.62
13	002384	东山精密	179,863,590.92	8.28
14	000063	中兴通讯	179,467,958.51	8.26
15	000338	潍柴动力	168,141,663.60	7.74
16	300394	天孚通信	168,097,160.46	7.74
17	601869	长飞光纤	159,397,686.71	7.34
18	300136	信维通信	148,241,651.65	6.83
19	688012	中微公司	145,801,181.89	6.71
20	601872	招商轮船	137,344,205.31	6.32
21	300502	新易盛	135,644,852.21	6.25
22	300751	迈为股份	134,447,624.50	6.19
23	600183	生益科技	129,978,359.24	5.98
24	688521	芯原股份	126,742,307.47	5.84
25	001309	德明利	124,077,174.20	5.71
26	688256	寒武纪	121,025,519.00	5.57
27	300014	亿纬锂能	108,329,857.76	4.99
28	002273	水晶光电	104,482,664.88	4.81
29	603799	华友钴业	104,077,598.77	4.79
30	600309	万华化学	98,257,947.22	4.52
31	600010	宝钢股份	97,731,089.60	4.50
32	688167	炬光科技	96,869,671.87	4.46
33	600519	贵州茅台	96,059,165.72	4.42
34	002436	兴森科技	95,023,991.03	4.38
35	300604	长川科技	94,434,364.94	4.35
36	600487	亨通光电	93,961,292.50	4.33
37	603993	洛阳钼业	92,474,372.00	4.26
38	000792	盐湖股份	87,859,219.07	4.05

39	002812	恩捷股份	87,782,320.71	4.04
40	300438	鹏辉能源	87,018,796.77	4.01
41	002281	光迅科技	84,188,067.34	3.88
42	601288	农业银行	84,156,940.00	3.87
43	300017	网宿科技	82,666,332.10	3.81
44	000725	京东方 A	80,765,153.00	3.72
45	601012	隆基绿能	80,355,694.12	3.70
46	002709	天赐材料	79,195,553.97	3.65
47	300059	东方财富	77,696,951.87	3.58
48	600584	长电科技	75,319,812.88	3.47
49	300442	润泽科技	74,311,126.38	3.42
50	300567	精测电子	74,295,179.32	3.42
51	000651	格力电器	72,608,686.72	3.34
52	300782	卓胜微	72,167,583.30	3.32
53	601919	中远海控	72,034,738.60	3.32
54	688525	佰维存储	71,622,758.54	3.30
55	601225	陕西煤业	68,792,580.80	3.17
56	600938	中国海油	67,401,982.00	3.10
57	300454	深信服	67,275,781.06	3.10
58	000408	藏格矿业	66,983,301.39	3.08
59	002738	中矿资源	62,044,218.62	2.86
60	300058	蓝色光标	57,217,783.80	2.63
61	300857	协创数据	55,383,150.73	2.55
62	000768	中航西飞	54,248,381.51	2.50
63	300033	同花顺	53,022,219.04	2.44
64	601689	拓普集团	52,896,317.24	2.44
65	300124	汇川技术	52,568,152.00	2.42
66	600879	航天电子	51,998,793.29	2.39
67	600118	中国卫星	49,427,424.20	2.28
68	688498	源杰科技	49,087,781.85	2.26
69	600690	海尔智家	49,036,612.10	2.26
70	002460	赣锋锂业	48,868,422.00	2.25
71	301396	宏景科技	48,535,767.20	2.23
72	600362	江西铜业	47,636,098.50	2.19
73	605117	德业股份	47,186,626.00	2.17
74	300418	昆仑万维	46,831,318.61	2.16
75	301358	湖南裕能	44,148,185.75	2.03
76	002756	永兴材料	43,668,652.36	2.01

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	15,913,536,220.06
卖出股票收入（成交）总额	12,693,472,885.14

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	30,194,457.53	0.45
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	30,194,457.53	0.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	300,000	30,194,457.53	0.45

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

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

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

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中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局处罚。

除上述情况外，本基金投资的其他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。本基金投资上述主体的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	166,582,883.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,582,883.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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

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 A500 指数增强 A	69,353	22,904.34	716,301,456.52	45.09	872,183,525.97	54.91
国金中证 A500 指数增强 C	104,911	25,108.95	765,645,328.16	29.07	1,868,559,688.04	70.93
合计	174,264	24,231.57	1,481,946,784.68	35.09	2,740,743,214.01	64.91

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人员持有本基金	国金中证 A500 指数增强 A	640,833.27	0.0403
	国金中证 A500 指数增强 C	262,295.10	0.0100
	合计	903,128.37	0.0214

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金中证 A500 指数增强 A	10~50
	国金中证 A500 指数增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国金中证 A500 指数增强 A	0~10
	国金中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金中证 A500 指数增强 A	国金中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 (2024 年 11 月 18 日) 基金份额总额	197,327,798.98	787,669,862.80
本报告期期初基金份额总额	753,521,025.65	898,728,480.50
本报告期基金总申购份额	1,451,888,150.90	4,798,112,520.26
减：本报告期基金总赎回份额	616,924,194.06	3,062,635,984.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,588,484,982.49	2,634,205,016.20

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中信证券（山东）	2	28,606,957,019.62	100.00	5,604,105.72	100.00	-

注：（一）选择标准

1. 具备相关业务资质，公司经营行为规范；
2. 财务状况良好，公司经营状况稳定；
3. 具备较强的交易服务能力，相关制度建设、人员配置、系统建设等满足基金进行证券交易的需
4. 具备较强的研究服务能力，相关制度建设、人员配置、研究能力、研究质量等可以保障较为专业、审慎的研究服务；
5. 具备较强的合规风控能力，合规风控管理体系机制较为健全；
6. 交易佣金费率标准符合要求。

（二）选择程序

1. 基金管理人根据上述标准选用符合条件的证券公司；
2. 基金管理人和被选用的证券公司签订协议。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
中信证券 (山东)	30,038,634.25	100.00	-	-	-	-

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	《国金中证 A500 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	2026 年 1 月 15 日
2	《国金中证 A500 指数增强型证券投资基金（国金中证 A500 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	2026 年 1 月 15 日
3	《国金中证 A500 指数增强型证券投资基金（国金中证 A500 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	2026 年 1 月 15 日
4	《国金中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 22 日
5	《国金基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 10 日
6	《国金基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
7	《国金中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 31 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	2026 年 4 月 17 日
9	《国金中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
10	《2025 年度国金基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 24 日
11	《国金基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 5 月 29 日
12	《国金基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 6 月 18 日
13	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 6 月 27 日

14	《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	2026 年 6 月 30 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

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、中国证监会批准基金募集注册的文件；
- 2、国金中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、国金中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、国金中证 A500 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

2026 年 8 月 29 日