

国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金 300 指数增强	
基金主代码	167601	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 1 日	
报告期末基金份额总额	998,421,180.92 份	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使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 8.0%。	
投资策略	本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。	
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。	
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国金 300 指数增强 A	国金 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	167601	017925
报告期末下属分级基金的份额总额	571,846,048.96 份	426,575,131.96 份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益

	高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。	高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
--	-----------------------	-----------------------

注：国金沪深 300 指数增强证券投资基金由国金沪深 300 指数分级证券投资基金转型而来。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	国金 300 指数增强 A	国金 300 指数增强 C
1. 本期已实现收益	-2,121,774.24	-1,578,363.33
2. 本期利润	-7,273,310.20	-7,693,488.18
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0269	-0.0383
4. 期末基金资产净值	572,737,643.54	426,442,831.99
5. 期末基金份额净值	1.0016	0.9997

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（不含公允价值变动损益）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损益。

2、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 300 指数增强 A

阶段	净值增长率①	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	0.80%	0.81%	-3.77%	0.87%	4.57%	-0.06%
过去六个月	-1.84%	0.81%	-8.47%	0.83%	6.63%	-0.02%
过去一年	8.00%	0.97%	-2.81%	0.94%	10.81%	0.03%
过去三年	-10.34%	1.16%	-18.47%	1.07%	8.13%	0.09%
过去五年	11.72%	1.24%	7.50%	1.19%	4.22%	0.05%
自基金合同 生效起至今	0.16%	1.21%	-2.67%	1.17%	2.83%	0.04%

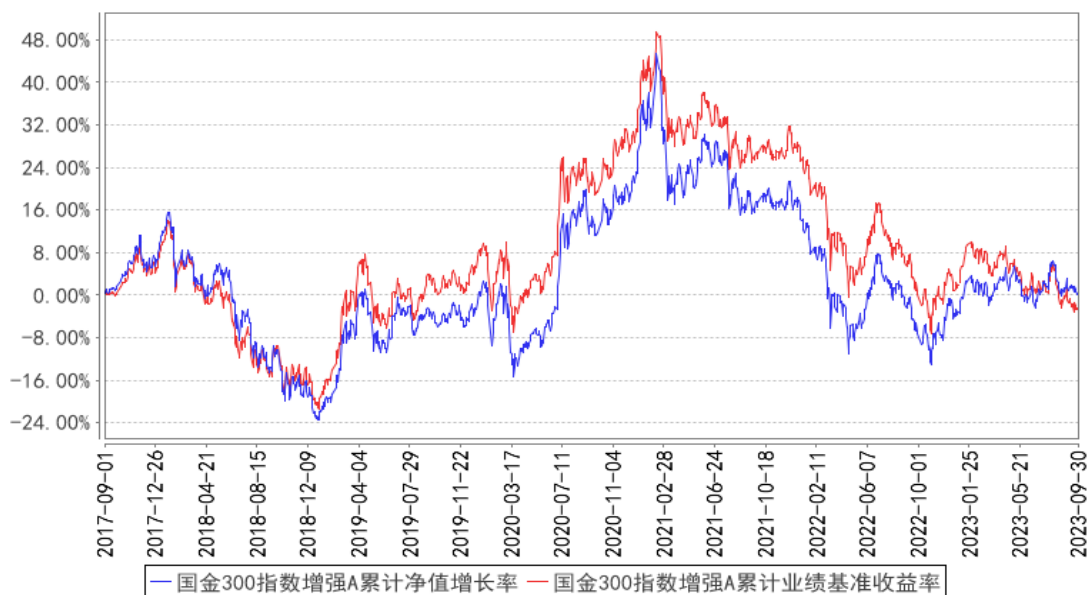
国金 300 指数增强 C

阶段	净值增长率①	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	0.70%	0.81%	-3.77%	0.87%	4.47%	-0.06%
过去六个月	-2.03%	0.81%	-8.47%	0.83%	6.44%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	0.03%	0.81%	-8.31%	0.81%	8.34%	0.00%

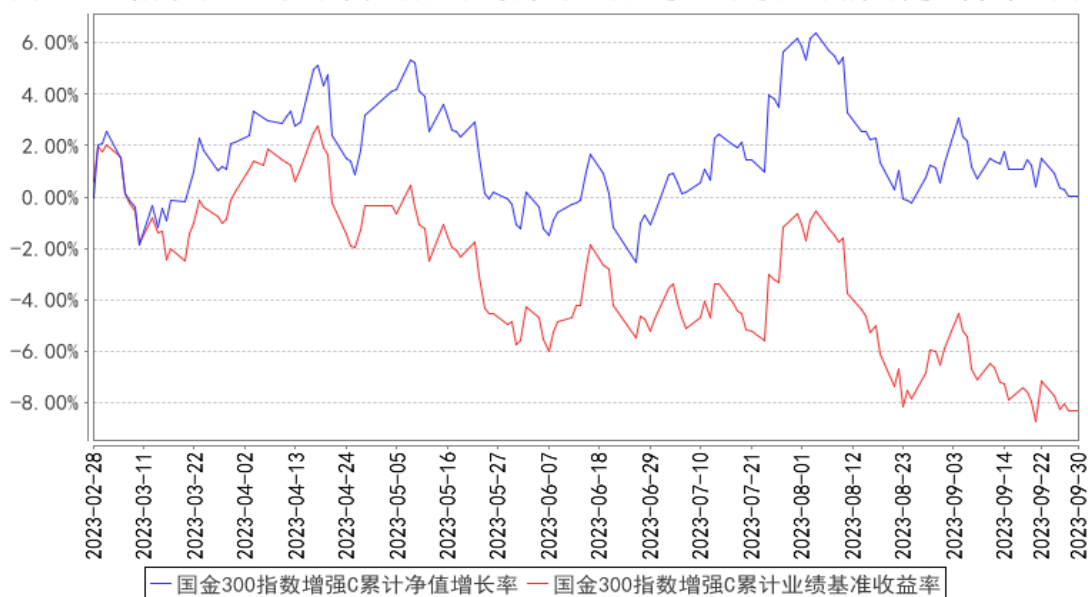
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

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300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300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：本基金由原“国金沪深 300 指数分级证券投资基金”于 2017 年 9 月 1 日转型而来。本基金 A 类份额基金合同生效日为 2017 年 9 月 1 日，图示日期为 2017 年 9 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2023 年 2 月 28 日，图示日期为 2023 年 2 月 28 日至 2023 年 9 月 30 日。

3.3 其他指标

注：无

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2022 年 11 月 14 日	-	7 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，现任量化投资事业部副总经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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 公平交易专项说明

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 1 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场环境有以下特征：初期风格相对延续；中后期市场风格切换剧烈、波动变大，整体市场活跃度降低较为明显，市场波动处于历史平均以下或近三年低水平位置。具体看因子层面：小市值风格相对占优；成长和市值等风险因子期间延续性相对较好，动量等延续性相对较

差。行业涨跌方面，大部分行业在报告期内录得下跌收益，其中煤炭、非银金融和石油石化等行业涨幅相对较大，最高 10%以上；传媒、计算机和电力设备和新能源等行业跌幅较大，最大跌幅 14%以上。报告期末伴随市场环境切换加剧该产品超额波动有所增大，过往策略实盘中类似情况并不鲜见。报告期内该产品保持高仓位运作，选股范围是沪深 300 指数成份内标的。

4.5 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 1.0016 元，累计单位净值为 1.0016 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准增长率为-3.77%。

本基金 C 类份额单位净值为 0.9997 元，累计单位净值为 0.9997 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 0.70%，同期业绩比较基准增长率为-3.77%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	923,275,250.89	89.82
	其中：股票	923,275,250.89	89.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,975,219.18	2.92
	其中：债券	29,975,219.18	2.92
	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	-94.91	-0.00
	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	51,898,205.12	5.05
8	其他资产	22,783,174.72	2.22
9	合计	1,027,931,755.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	88,355,693.00	8.84
C	制造业	392,463,740.47	39.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,165,447.22	3.72
E	建筑业	59,350,910.81	5.94
F	批发和零售业	1,095,648.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	23,016,305.99	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,436,601.00	3.65
J	金融业	279,528,604.40	27.98
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,782,920.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	79,380.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	923,275,250.89	92.40

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	601319	中国人保	4,696,300	27,708,170.00	2.77
2	600028	中国石化	4,419,000	26,823,330.00	2.68
3	600809	山西汾酒	109,400	26,201,300.00	2.62
4	600519	贵州茅台	13,500	24,280,425.00	2.43
5	002304	洋河股份	174,480	22,577,712.00	2.26
6	601211	国泰君安	1,531,607	22,269,565.78	2.23

7	601088	中国神华	711,300	22,192,560.00	2.22
8	600036	招商银行	671,500	22,139,355.00	2.22
9	600019	宝钢股份	3,562,977	21,698,529.93	2.17
10	000895	双汇发展	790,700	20,866,573.00	2.09

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

注：无

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	29,975,219.18	3.00
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	29,975,219.18	3.00

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	300,000	29,975,219.18	3.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无

5.7 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

5.8 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权证投资明细

注：无

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，国泰君安证券股份有限公司于 2023 年 01 月 16 日受到中国人民银行上海分行给予罚款 95 万元的处罚；招商银行股份有限公司于 2022 年 11 月 04 日受到国家金融监督管理总局给予罚款 460 万元的处罚，于 2022 年 12 月 30 日受到中国人民银行给予警告、没收违法所得 5.692641 万元、罚款 3423.5 万元的处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	176,620.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,606,554.05
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	22,783,174.72

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**5.11.5.1 报告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

5.11.5.2 报告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

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金 300 指数增强 A	国金 300 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	90,382,424.39	59,618,706.28
报告期期间基金总申购份额	499,064,573.98	466,343,777.97
减：报告期期间基金总赎回份额	17,600,949.41	99,387,352.29
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	571,846,048.96	426,575,131.96

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

§8 影响投资者决策的其他重要信息**8.1 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**

投资者	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别		达到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	2023 年 7 月 27 日-2023 年 7 月 27 日	18,269,386.93	62,626,186.14		-80,895,573.07	8.10
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20% 的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。</p>							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同；
- 3、国金沪深 300 指数增强证券投资基金托管协议；
- 4、国金沪深 300 指数增强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。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

9.3 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

2023 年 10 月 25 日