

# 国金沪深 300 指数增强证券投资基金 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
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 .....	42
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 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金沪深 300 指数增强证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	948,153,518.02 份	
基金合同存续期	不定期	
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	211,540,806.47 份	736,612,711.55 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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%。</p>
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、权证投资策略、跟踪误差的监控与管理、融资及转融通证券出借业务投资策略。</p> <p>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。资产配置策略部分，本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%；投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金将采用指数化投资为主，增强型投资为辅的方式，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究及数量化投资分析技术谋求在偏离风险和超额收益间的最佳配置。股票投资策略部分，本基金主要采用指数增强投资策略，参考目标股票指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，并基于基本面研究及数量化投资分析技术等方法构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后，基金定期对比较检验组合与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进行调整，使指数优化组合与标的指数的跟踪误差控制在限定的范围内。</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。
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。

## 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	石立平
	联系电话	010-88005695	010-63639180
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100020	100033
法定代表人		邵海波	吴利军

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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 300 指数增强 A	国金 300 指数增强 C
本期已实现收益	-43,038,293.03	-23,928,178.03
本期利润	-33,629,139.46	-23,956,040.01
加权平均基金份 额本期利润	-0.0783	-0.0348

本期加权平均净 值利润率	-8.92%	-3.92%
本期基金份额净 值增长率	-4.33%	-4.53%
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	-24,336,509.40	-87,896,806.16
期末可供分配基 金份额利润	-0.1150	-0.1193
期末基金资产净 值	187,204,297.07	648,715,905.39
期末基金份额净 值	0.8850	0.8807
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	-11.50%	-11.88%

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 300 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	-2.83%	0.70%	-3.14%	0.46%	0.31%	0.24%
过去三个月	-1.19%	0.84%	-2.03%	0.72%	0.84%	0.12%
过去六个月	-4.33%	1.11%	0.88%	0.85%	-5.21%	0.26%

过去一年	-10.94%	0.99%	-9.38%	0.83%	-1.56%	0.16%
过去三年	-31.12%	1.08%	-32.19%	0.99%	1.07%	0.09%
自基金合同生效起至今	-11.50%	1.20%	-8.35%	1.13%	-3.15%	0.07%

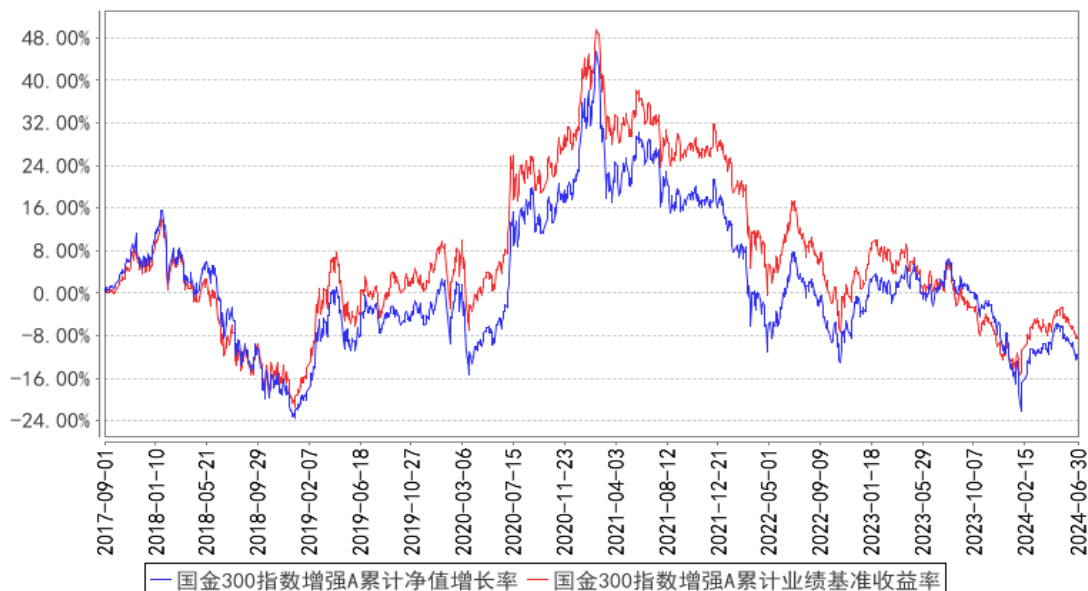
国金 300 指数增强 C

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	-2.87%	0.70%	-3.14%	0.46%	0.27%	0.24%
过去三个月	-1.30%	0.84%	-2.03%	0.72%	0.73%	0.12%
过去六个月	-4.53%	1.11%	0.88%	0.85%	-5.41%	0.26%
过去一年	-11.29%	0.99%	-9.38%	0.83%	-1.91%	0.16%
自基金合同生效起至今	-11.88%	0.95%	-13.66%	0.81%	1.78%	0.14%

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%。

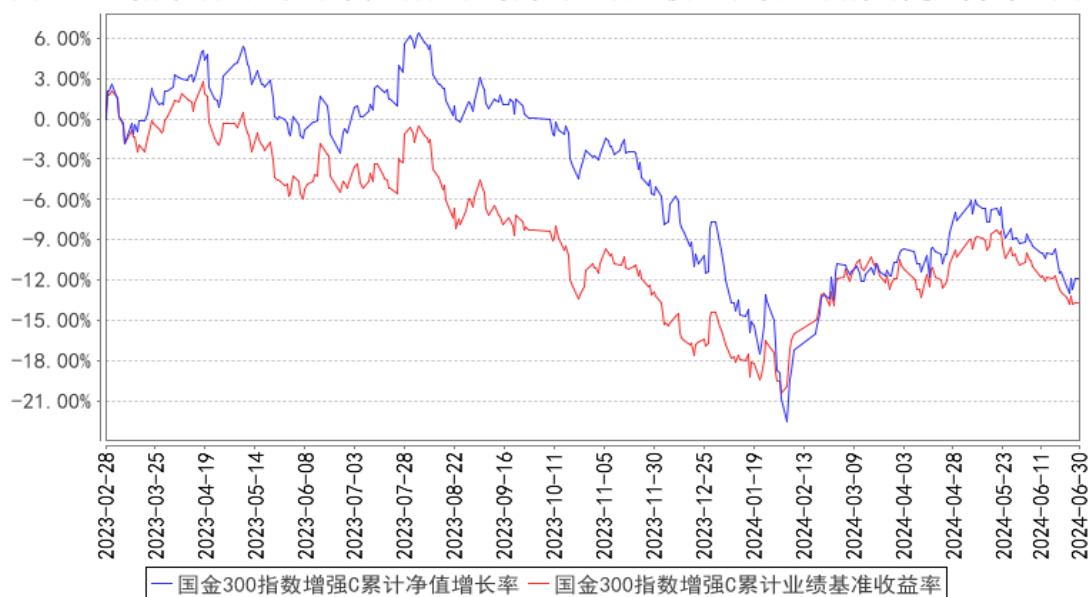
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2024 年 6 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 2024 年 6 月 30 日。

### 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	2022 年 11 月 14 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《国金沪深 300 指数增强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 月前后的市场波动是近十年高点，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。具体因子层面：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%。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，上半年市场环境下产品风险特征与其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 0.8850 元，累计单位净值为 0.8850 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-4.33%，同期业绩比较基准增长率为 0.88%。

本基金 C 类份额单位净值为 0.8807 元，累计单位净值为 0.8807 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-4.53%，同期业绩比较基准增长率为 0.88%。

#### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国金沪深 300 指数增强证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 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：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	50,206,157.27	54,904,429.38
结算备付金		5,299,764.70	6,036,475.27
存出保证金		702,677.56	557,954.64
交易性金融资产	6.4.7.2	789,049,484.24	1,210,208,791.92
其中：股票投资		773,802,381.49	1,180,051,805.62
基金投资		-	-
债券投资		15,247,102.75	30,156,986.30
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		3,196,657.09	22,412,066.37
应收股利		-	-
应收申购款		3,107,923.16	6,685,125.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		851,562,664.02	1,300,804,842.90
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年6月30日</b>	<b>2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		6,352,456.06	-
应付赎回款		3,543,824.91	19,234,833.42
应付管理人报酬		683,942.89	1,066,107.87
应付托管费		136,788.59	213,221.59
应付销售服务费		210,269.85	190,376.93
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	4,715,179.26	2,838,623.99
负债合计		15,642,461.56	23,543,163.80
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	948,153,518.02	1,382,358,227.13
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-112,233,315.56	-105,096,548.03
净资产合计		835,920,202.46	1,277,261,679.10
负债和净资产总计		851,562,664.02	1,300,804,842.90

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，国金沪深 300 指数增强 A 基金份额净值 0.8850 元，基金份额总额 211,540,806.47 份；国金沪深 300 指数增强 C 基金份额净值 0.8807 元，基金份额总额 736,612,711.55 份。国金沪深 300 指数增强份额总额合计为 948,153,518.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

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	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-50,325,671.39	1,026,035.31

1. 利息收入		262,691.30	31,437.30
其中：存款利息收入	6.4.7.13	252,749.50	31,437.30
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		9,941.80	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-60,739,572.90	4,273,442.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-69,143,429.15	3,130,038.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	266,017.14	-
资产支持证券投资	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	8,137,839.11	1,143,404.33
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	9,381,291.59	-3,322,109.88
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	769,918.62	43,265.06
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,259,508.08</b>	<b>650,006.82</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,876,941.47	386,101.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	975,388.29	77,220.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,201,167.67	22,218.37
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,584.51	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,584.51	-
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	204,426.14	164,466.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-57,585,179.47</b>	<b>376,028.49</b>
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-57,585,179.47	376,028.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-57,585,179.47	376,028.49

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

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	1,382,358,227. 13	-	- 105,096,548.03	1,277,261,679.1 0
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,382,358,227. 13	-	- 105,096,548.03	1,277,261,679.1 0
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 434,204,709.11	-	-7,136,767.53	-441,341,476.64
（一）、综合收益总额	-	-	-57,585,179.47	-57,585,179.47
（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）	- 434,204,709.11	-	50,448,411.94	-383,756,297.17
其中：1. 基金申购款	842,414,762.20	-	- 107,439,065.63	734,975,696.57
2. 基金赎回款	- 1,276,619,471. 31	-	157,887,477.57	- 1,118,731,993.7 4
（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	948,153,518.02	-	112,233,315.56	835,920,202.46
项目	上年度可比期间 2023年1月1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	61,980,597.40	-	-1,984,151.59	59,996,445.81
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	61,980,597.40	-	-1,984,151.59	59,996,445.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	88,020,533.27	-	985,399.72	89,005,932.99
（一）、综合收益总额	-	-	376,028.49	376,028.49
（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）	88,020,533.27	-	609,371.23	88,629,904.50
其中：1. 基金申购款	143,220,118.11	-	1,415,732.54	144,635,850.65
2. 基金赎回款	-55,199,584.84	-	-806,361.31	-56,005,946.15
（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	150,001,130.67	-	-998,751.87	149,002,378.80

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：

<u>邵海波</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
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（以下简称“国金 300 指数分级”）变更注册而来，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[2017]646 号文《关于准予国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复》注册，国金沪深 300 指数分级的基金合同于 2013 年 7 月 26 日生效并于 2017 年 9 月 1 日失效，本基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效，本基金首次募集规模为 323,127,755.17 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为国金基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《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》等法律法规的规定和《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于 2023 年 2 月 28 日增设 C 类基金份额类别，本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），权证、股指期货、国债期货、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具（含同业存单）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）。

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货及国债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。

本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有的风险。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。

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

#### 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	50,206,157.27
等于：本金	50,196,392.86
加：应计利息	9,764.41

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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	50,206,157.27

#### 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	798,814,716.09	-	773,802,381.49	- 25,012,334.60	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	15,001,731.33	232,602.75	15,247,102.75	12,768.67
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	15,001,731.33	232,602.75	15,247,102.75	12,768.67
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	813,816,447.42	232,602.75	789,049,484.24	- 24,999,565.93	

#### 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	746.57
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,560,006.55

其中：交易所市场	4,560,006.55
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
应付指数使用费	50,000.00
合计	4,715,179.26

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金 300 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	766,389,898.28	766,389,898.28
本期申购	97,680,695.09	97,680,695.09
本期赎回（以“-”号填列）	-652,529,786.90	-652,529,786.90
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	211,540,806.47	211,540,806.47

国金 300 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	615,968,328.85	615,968,328.85
本期申购	744,734,067.11	744,734,067.11
本期赎回（以“-”号填列）	-624,089,684.41	-624,089,684.41
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	736,612,711.55	736,612,711.55

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 300 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	25,543,978.47	-82,910,687.83	-57,366,709.36
加：会计政策变更	-	-	-



前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	25,543,978.47	-82,910,687.83	-57,366,709.36
本期利润	-43,038,293.03	9,409,153.57	-33,629,139.46
本期基金份额交易产生的变动数	18,348,752.75	48,310,586.67	66,659,339.42
其中：基金申购款	-1,575,288.96	-11,814,566.85	-13,389,855.81
基金赎回款	19,924,041.71	60,125,153.52	80,049,195.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	854,438.19	-25,190,947.59	-24,336,509.40

## 国金 300 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	-4,078,102.44	-43,651,736.23	-47,729,838.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,078,102.44	-43,651,736.23	-47,729,838.67
本期利润	-23,928,178.03	-27,861.98	-23,956,040.01
本期基金份额交易产生的变动数	-12,365,703.17	-3,845,224.31	-16,210,927.48
其中：基金申购款	-44,828,522.66	-49,220,687.16	-94,049,209.82
基金赎回款	32,462,819.49	45,375,462.85	77,838,282.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,371,983.64	-47,524,822.52	-87,896,806.16

## 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	205,749.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	41,016.07
其他	5,984.06
合计	252,749.50

## 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	-69,143,429.15
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	-69,143,429.15

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	3,864,354,822.56
减：卖出股票成本总额	3,926,360,927.64
减：交易费用	7,137,324.07
买卖股票差价收入	-69,143,429.15

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	226,164.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	39,852.77
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	266,017.14

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,249,645.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,962,066.67
减：应计利息总额	247,726.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	39,852.77

## 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	8,137,839.11
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	8,137,839.11

#### 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	9,381,291.59
股票投资	9,365,422.92
债券投资	15,868.67
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	9,381,291.59

#### 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	769,918.62
合计	769,918.62

#### 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	-
指数使用费	100,000.00
合计	204,426.14

#### 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
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、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

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1月1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	1,765,823,662.50	23.94	149,356,169.78	31.19

6.4.10.1.2 债券交易

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1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)

国金证券股份有限公司	20,249,645.44	80.01	-	-
------------	---------------	-------	---	---

#### 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1月1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	53,000,000.00	65.36	-	-

#### 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	1,317,126.21	27.83	1,317,126.21	28.88
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1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	109,224.03	31.19	105,710.74	50.95

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月	2023年1月1日至2023年6月

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,876,941.47	386,101.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,088,348.89	134,206.04
应支付基金管理人的净管理费	3,788,592.58	251,895.32

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、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	975,388.29	77,220.32

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 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。费用自动扣划后，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	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金 300 指数增强 A	国金 300 指数增强 C	合计
国金基金管理有限公司	-	694,862.73	694,862.73
国金证券股份有限公司	-	52,939.38	52,939.38
合计	-	747,802.11	747,802.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 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 300 指数增强 A	国金 300 指数增强 C	合计
国金证券股份有限公司	-	732.97	732.97
合计	-	732.97	732.97

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% 的年费率计提。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1月1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
中国光大银行股份有限公司-活期存款	50,206,157.27	205,749.37	16,016,259.01	28,055.39

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

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	50,206,157.27	-	-	-	-	-	50,206,157.27
结算备付金	5,299,764.70	-	-	-	-	-	5,299,764.70
存出保证金	702,677.56	-	-	-	-	-	702,677.56
交易性金融资产	10,156,150.69	-	5,090,952.06	-	-	773,802,381.49	789,049,484.24
应收清算款	-	-	-	-	-	3,196,657.09	3,196,657.09
应收申购款	-	-	-	-	-	3,107,923.16	3,107,923.16
资产总计	66,364,750.22	-	5,090,952.06	-	-	780,106,961.74	851,562,664.02
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	6,352,456.06	6,352,456.06
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,543,824.91	3,543,824.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	683,942.89	683,942.89
应付托管费	-	-	-	-	-	136,788.59	136,788.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	210,269.85	210,269.85
其他负债	-	-	-	-	-	4,715,179.26	4,715,179.26
负债总计	-	-	-	-	-	15,642,461.56	15,642,461.56

利率敏感度缺口	66,364,750.22	-	5,090,952.06	-	-	764,464,500.18	835,920,202.46
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	54,904,429.38	-	-	-	-	-	54,904,429.38
结算备付金	6,036,475.27	-	-	-	-	-	6,036,475.27
存出保证金	557,954.64	-	-	-	-	-	557,954.64
交易性金融资产	-	-	30,156,986.30	-	-	1,180,051,805.62	1,210,208,791.92
应收清算款	-	-	-	-	-	22,412,066.37	22,412,066.37
应收申购款	-	-	-	-	-	6,685,125.32	6,685,125.32
资产总计	61,498,859.29	-	30,156,986.30	-	-	1,209,148,997.31	1,300,804,842.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,234,833.42	19,234,833.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,066,107.87	1,066,107.87
应付托管费	-	-	-	-	-	213,221.59	213,221.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	190,376.93	190,376.93
其他负债	-	-	-	-	-	2,838,623.99	2,838,623.99
负债总计	-	-	-	-	-	23,543,163.80	23,543,163.80
利率敏感度缺口	61,498,859.29	-	30,156,986.30	-	-	1,185,605,833.51	1,277,261,679.10

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	773,802,381.49	92.57	1,180,051,805.62	92.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	15,247,102.75	1.82	30,156,986.30	2.36
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	789,049,484.24	94.39	1,210,208,791.92	94.75

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	假定沪深 300 指数（000300.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沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 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%	45,150,340.54	58,890,617.37

	-5%	-45,150,340.54	-58,890,617.37
--	-----	----------------	----------------

#### 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	773,802,381.49	1,180,051,805.62
第二层次	15,247,102.75	30,156,986.30
第三层次	-	-
合计	789,049,484.24	1,210,208,791.92

###### 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	773,802,381.49	90.87
	其中：股票	773,802,381.49	90.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,247,102.75	1.79
	其中：债券	15,247,102.75	1.79
	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	55,505,921.97	6.52
8	其他各项资产	7,007,257.81	0.82
9	合计	851,562,664.02	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	-	-
B	采矿业	17,712,570.00	2.12
C	制造业	541,569,403.40	64.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,471,324.00	2.33
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	11,357,510.55	1.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	28,000,215.80	3.35



	业		
J	金融业	49,897,106.00	5.97
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	-	-
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	668,008,129.75	79.91

### 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	603,797.00	0.07
C	制造业	78,111,267.14	9.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,220,513.00	0.39
F	批发和零售业	2,185,754.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	562,608.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,180,247.32	1.46
J	金融业	842,710.00	0.10
K	房地产业	20,056.00	0.00
L	租赁和商务服务业	772,443.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	2,268,744.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	4,013,501.28	0.48
O	居民服务、修理	-	-

	和其他服务业		
P	教育	725,696.00	0.09
Q	卫生和社会工作	161,895.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	125,020.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	105,794,251.74	12.66

### 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	603501	韦尔股份	211,385	21,005,327.45	2.51
2	000100	TCL 科技	4,558,000	19,690,560.00	2.36
3	600760	中航沈飞	410,740	16,470,674.00	1.97
4	600219	南山铝业	4,214,300	16,056,483.00	1.92
5	601728	中国电信	2,557,800	15,730,470.00	1.88
6	000333	美的集团	235,500	15,189,750.00	1.82
7	300408	三环集团	501,400	14,635,866.00	1.75
8	002475	立讯精密	354,900	13,951,119.00	1.67
9	000338	潍柴动力	837,700	13,604,248.00	1.63
10	000157	中联重科	1,718,360	13,197,004.80	1.58
11	601668	中国建筑	2,398,100	12,733,911.00	1.52
12	600875	东方电气	676,600	12,483,270.00	1.49
13	300433	蓝思科技	676,800	12,351,600.00	1.48
14	000651	格力电器	310,600	12,181,732.00	1.46
15	000725	京东方 A	2,971,000	12,151,390.00	1.45
16	002415	海康威视	386,382	11,943,067.62	1.43
17	605499	东鹏饮料	54,700	11,801,525.00	1.41
18	601766	中国中车	1,545,200	11,604,452.00	1.39
19	002241	歌尔股份	592,400	11,557,724.00	1.38
20	600019	宝钢股份	1,715,200	11,406,080.00	1.36
21	000858	五粮液	87,100	11,152,284.00	1.33
22	601238	广汽集团	1,394,000	10,789,560.00	1.29
23	300750	宁德时代	59,700	10,747,791.00	1.29
24	600183	生益科技	490,200	10,323,612.00	1.23
25	000063	中兴通讯	367,600	10,281,772.00	1.23
26	600660	福耀玻璃	211,900	10,150,010.00	1.21
27	600309	万华化学	118,600	9,589,996.00	1.15

28	601808	中海油服	556,100	9,564,920.00	1.14
29	002493	荣盛石化	987,300	9,537,318.00	1.14
30	600690	海尔智家	319,500	9,067,410.00	1.08
31	600050	中国联通	1,890,000	8,883,000.00	1.06
32	002236	大华股份	547,400	8,462,804.00	1.01
33	002371	北方华创	26,100	8,349,129.00	1.00
34	600519	贵州茅台	5,500	8,070,645.00	0.97
35	600372	中航机载	653,800	7,825,986.00	0.94
36	600346	恒力石化	559,800	7,809,210.00	0.93
37	600893	航发动力	206,900	7,562,195.00	0.90
38	601601	中国太保	259,900	7,240,814.00	0.87
39	600188	兖矿能源	317,000	7,205,410.00	0.86
40	600745	闻泰科技	254,799	7,198,071.75	0.86
41	603260	合盛硅业	153,400	7,165,314.00	0.86
42	300782	卓胜微	92,100	7,159,854.00	0.86
43	601998	中信银行	1,042,900	6,987,430.00	0.84
44	601877	正泰电器	366,200	6,979,772.00	0.83
45	601211	国泰君安	508,000	6,883,400.00	0.82
46	600989	宝丰能源	381,700	6,614,861.00	0.79
47	002841	视源股份	222,200	6,561,566.00	0.78
48	002601	龙佰集团	346,800	6,440,076.00	0.77
49	600018	上港集团	1,093,800	6,322,164.00	0.76
50	601688	华泰证券	504,400	6,249,516.00	0.75
51	601865	福莱特	302,100	6,072,210.00	0.73
52	603899	晨光股份	194,000	6,068,320.00	0.73
53	601012	隆基绿能	429,300	6,018,786.00	0.72
54	000768	中航西飞	244,000	5,863,320.00	0.70
55	601229	上海银行	789,800	5,733,948.00	0.69
56	600111	北方稀土	329,950	5,675,140.00	0.68
57	688187	时代电气	110,326	5,447,897.88	0.65
58	601319	中国人保	1,024,600	5,276,690.00	0.63
59	601872	招商轮船	595,899	5,035,346.55	0.60
60	603806	福斯特	342,080	5,028,576.00	0.60
61	000708	中信特钢	365,970	4,966,212.90	0.59
62	601336	新华保险	157,100	4,717,713.00	0.56
63	600732	爱旭股份	520,560	4,711,068.00	0.56
64	601633	长城汽车	167,900	4,247,870.00	0.51
65	000596	古井贡酒	18,900	3,989,223.00	0.48
66	300999	金龙鱼	138,100	3,777,035.00	0.45
67	300628	亿联网络	102,400	3,765,248.00	0.45
68	600015	华夏银行	510,100	3,264,640.00	0.39
69	300316	晶盛机电	106,480	3,059,170.40	0.37
70	601186	中国铁建	341,300	2,924,941.00	0.35

71	603833	欧派家居	52,700	2,822,612.00	0.34
72	603019	中科曙光	67,700	2,809,550.00	0.34
73	601800	中国交建	303,600	2,714,184.00	0.32
74	002129	TCL 中环	293,000	2,534,450.00	0.30
75	002311	海大集团	51,300	2,413,665.00	0.29
76	600926	杭州银行	183,500	2,394,675.00	0.29
77	600460	士兰微	131,600	2,304,316.00	0.28
78	601138	工业富联	82,900	2,271,460.00	0.27
79	600089	特变电工	160,900	2,231,683.00	0.27
80	600588	用友网络	215,000	2,150,000.00	0.26
81	603296	华勤技术	38,600	2,131,878.00	0.26
82	688041	海光信息	29,320	2,061,782.40	0.25
83	300223	北京君正	34,300	1,901,592.00	0.23
84	002001	新 和 成	96,400	1,850,880.00	0.22
85	000568	泸州老窖	11,400	1,635,786.00	0.20
86	688036	传音控股	16,601	1,270,640.54	0.15
87	601989	中国重工	233,000	1,148,690.00	0.14
88	600039	四川路桥	139,200	1,098,288.00	0.13
89	600999	招商证券	77,000	1,071,070.00	0.13
90	300919	中伟股份	32,380	1,003,456.20	0.12
91	601898	中煤能源	75,500	942,240.00	0.11
92	002410	广联达	96,900	928,302.00	0.11
93	600741	华域汽车	48,000	786,240.00	0.09
94	600150	中国船舶	14,600	594,366.00	0.07
95	600362	江西铜业	19,600	464,128.00	0.06
96	002252	上海莱士	46,300	362,066.00	0.04
97	600426	华鲁恒升	12,400	330,336.00	0.04
98	688008	澜起科技	5,668	323,982.88	0.04
99	600845	宝信软件	9,660	308,443.80	0.04
100	603195	公牛集团	2,200	169,664.00	0.02
101	688303	大全能源	7,434	151,579.26	0.02
102	688396	华润微	2,578	96,520.32	0.01
103	300122	智飞生物	3,100	86,893.00	0.01
104	002142	宁波银行	3,500	77,210.00	0.01

### 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	002202	金风科技	339,700	2,282,784.00	0.27
2	603609	禾丰股份	327,800	2,143,812.00	0.26
3	600812	华北制药	323,200	1,331,584.00	0.16
4	688038	中科通达	124,269	1,183,040.88	0.14
5	300635	中达安	150,700	1,137,785.00	0.14

6	300665	飞鹿股份	210,500	1,067,235.00	0.13
7	600810	神马股份	166,500	1,032,300.00	0.12
8	301040	中环海陆	101,500	1,005,865.00	0.12
9	000795	英洛华	180,300	998,862.00	0.12
10	300912	凯龙高科	103,500	969,795.00	0.12
11	301178	天亿马	40,400	833,452.00	0.10
12	000586	汇源通信	104,000	816,400.00	0.10
13	300329	海伦钢琴	213,600	805,272.00	0.10
14	600606	绿地控股	581,600	785,160.00	0.09
15	300899	上海凯鑫	41,500	771,070.00	0.09
16	000703	恒逸石化	108,100	766,429.00	0.09
17	688081	兴图新科	84,755	745,844.00	0.09
18	600539	狮头股份	200,800	730,912.00	0.09
19	688681	科汇股份	71,251	727,472.71	0.09
20	600455	博通股份	49,300	725,696.00	0.09
21	300535	达威股份	61,200	722,160.00	0.09
22	301228	实朴检测	74,700	698,445.00	0.08
23	002036	联创电子	103,300	697,275.00	0.08
24	002354	天娱数科	218,300	652,717.00	0.08
25	603118	共进股份	95,200	637,840.00	0.08
26	688167	炬光科技	11,571	636,405.00	0.08
27	301205	联特科技	10,100	633,775.00	0.08
28	300088	长信科技	134,300	631,210.00	0.08
29	300379	东方通	77,300	624,584.00	0.07
30	300126	锐奇股份	133,600	605,208.00	0.07
31	688215	瑞晟智能	25,439	600,106.01	0.07
32	600282	南钢股份	118,800	591,624.00	0.07
33	603328	依顿电子	75,100	590,286.00	0.07
34	603316	诚邦股份	162,800	587,708.00	0.07
35	002494	华斯股份	180,400	562,848.00	0.07
36	300640	德艺文创	141,200	556,328.00	0.07
37	300605	恒锋信息	61,000	552,660.00	0.07
38	300509	新美星	114,500	535,860.00	0.06
39	300931	通用电梯	97,700	535,396.00	0.06
40	002913	奥士康	19,700	528,157.00	0.06
41	300123	亚光科技	113,600	527,104.00	0.06
42	603272	联翔股份	61,700	524,450.00	0.06
43	688178	万德斯	50,516	520,819.96	0.06
44	300710	万隆光电	34,200	518,814.00	0.06
45	002745	木林森	64,300	518,258.00	0.06
46	601216	君正集团	139,900	516,231.00	0.06
47	688565	力源科技	109,755	514,750.95	0.06
48	688171	纬德信息	33,682	507,924.56	0.06

49	600366	宁波韵升	97,000	506,340.00	0.06
50	603022	新通联	69,500	505,960.00	0.06
51	603729	龙韵股份	38,100	505,206.00	0.06
52	002453	华软科技	116,600	500,214.00	0.06
53	688067	爱威科技	34,278	491,889.30	0.06
54	600610	中毅达	121,400	483,172.00	0.06
55	688153	唯捷创芯	13,028	482,036.00	0.06
56	300588	熙菱信息	62,200	481,428.00	0.06
57	603583	捷昌驱动	23,500	478,930.00	0.06
58	300753	爱朋医疗	43,700	478,515.00	0.06
59	603906	龙蟠科技	60,800	473,632.00	0.06
60	300935	盈建科	30,400	471,504.00	0.06
61	601568	北元集团	125,300	464,863.00	0.06
62	300136	信维通信	23,700	464,046.00	0.06
63	603893	瑞芯微	7,700	455,609.00	0.05
64	300303	聚飞光电	93,100	452,466.00	0.05
65	301075	多瑞医药	28,400	451,560.00	0.05
66	002990	盛视科技	22,100	444,873.00	0.05
67	688607	康众医疗	35,703	443,431.26	0.05
68	300079	数码视讯	109,200	443,352.00	0.05
69	301273	瑞晨环保	27,800	432,846.00	0.05
70	002212	天融信	88,500	430,995.00	0.05
71	301037	保立佳	47,860	424,039.60	0.05
72	688096	京源环保	83,848	423,432.40	0.05
73	300886	华业香料	25,700	421,994.00	0.05
74	688800	瑞可达	14,846	416,875.68	0.05
75	301288	清研环境	37,100	414,036.00	0.05
76	601015	陕西黑猫	147,100	411,880.00	0.05
77	300929	华骐环保	56,260	411,823.20	0.05
78	301057	汇隆新材	35,800	409,552.00	0.05
79	300085	银之杰	50,600	408,848.00	0.05
80	603113	金能科技	74,700	408,609.00	0.05
81	603045	福达合金	40,800	405,144.00	0.05
82	603123	翠微股份	68,000	403,920.00	0.05
83	002436	兴森科技	39,000	402,480.00	0.05
84	603955	大千生态	46,700	401,620.00	0.05
85	300382	斯莱克	67,800	400,698.00	0.05
86	603212	赛伍技术	36,200	399,648.00	0.05
87	002402	和而泰	37,300	399,483.00	0.05
88	002549	凯美特气	77,700	397,047.00	0.05
89	002414	高德红外	67,100	395,219.00	0.05
90	301198	喜悦智行	49,200	394,092.00	0.05
91	300183	东软载波	33,800	391,404.00	0.05

92	301316	慧博云通	26,600	390,488.00	0.05
93	000627	天茂集团	221,800	388,150.00	0.05
94	300478	杭州高新	49,700	387,660.00	0.05
95	603995	甬金股份	22,000	385,440.00	0.05
96	688680	海优新材	13,296	382,127.04	0.05
97	601231	环旭电子	23,800	381,990.00	0.05
98	688711	宏微科技	23,750	381,425.00	0.05
99	600776	东方通信	38,700	380,421.00	0.05
100	688229	博睿数据	14,697	378,006.84	0.05
101	000066	中国长城	42,400	371,000.00	0.04
102	000016	深康佳 A	172,900	368,277.00	0.04
103	300749	顶固集创	69,100	366,230.00	0.04
104	300077	国民技术	41,600	363,168.00	0.04
105	605303	园林股份	53,900	361,130.00	0.04
106	600493	凤竹纺织	82,800	360,180.00	0.04
107	603989	艾华集团	25,600	359,936.00	0.04
108	300417	南华仪器	43,400	359,786.00	0.04
109	002058	威尔泰	47,200	358,720.00	0.04
110	301010	晶雪节能	31,000	356,810.00	0.04
111	300369	绿盟科技	69,200	353,612.00	0.04
112	603666	亿嘉和	22,400	353,472.00	0.04
113	600156	华升股份	111,900	348,009.00	0.04
114	002194	武汉凡谷	43,000	346,150.00	0.04
115	601208	东材科技	46,900	340,494.00	0.04
116	688051	佳华科技	20,414	338,464.12	0.04
117	600691	阳煤化工	197,000	336,870.00	0.04
118	002683	广东宏大	16,700	336,171.00	0.04
119	300366	创意信息	46,400	335,936.00	0.04
120	002585	双星新材	67,600	335,296.00	0.04
121	600552	凯盛科技	35,400	333,822.00	0.04
122	600319	亚星化学	99,900	330,669.00	0.04
123	002591	恒大高新	90,000	329,400.00	0.04
124	605376	博迁新材	14,500	327,265.00	0.04
125	605255	天普股份	27,200	326,944.00	0.04
126	301125	腾亚精工	33,000	326,370.00	0.04
127	688127	蓝特光学	17,659	324,749.01	0.04
128	688379	华光新材	23,510	322,322.10	0.04
129	300323	华灿光电	73,900	321,465.00	0.04
130	300992	泰福泵业	20,300	320,334.00	0.04
131	300261	雅本化学	59,900	317,470.00	0.04
132	002135	东南网架	80,100	317,196.00	0.04
133	600689	上海三毛	46,500	313,875.00	0.04
134	003003	天元股份	39,300	313,221.00	0.04

135	300741	华宝股份	20,500	312,420.00	0.04
136	002416	爱施德	35,200	311,520.00	0.04
137	600561	江西长运	84,800	308,672.00	0.04
138	301113	雅艺科技	15,500	308,295.00	0.04
139	600126	杭钢股份	74,100	304,551.00	0.04
140	002488	金固股份	69,200	303,788.00	0.04
141	600707	彩虹股份	43,600	296,916.00	0.04
142	301197	工大科雅	22,600	296,512.00	0.04
143	002853	皮阿诺	39,800	295,714.00	0.04
144	601678	滨化股份	84,900	295,452.00	0.04
145	600768	宁波富邦	42,000	294,420.00	0.04
146	688679	通源环境	41,944	291,930.24	0.03
147	688296	和达科技	29,896	290,589.12	0.03
148	600243	青海华鼎	106,700	287,023.00	0.03
149	002516	旷达科技	78,000	283,920.00	0.03
150	605589	圣泉集团	13,700	277,973.00	0.03
151	001211	双枪科技	18,200	277,368.00	0.03
152	603709	中源家居	22,300	277,189.00	0.03
153	688561	奇安信	11,711	276,613.82	0.03
154	300877	金春股份	25,500	276,420.00	0.03
155	301098	金埔园林	36,300	274,791.00	0.03
156	688669	聚石化学	24,251	274,521.32	0.03
157	300076	GQY 视讯	85,600	273,920.00	0.03
158	688395	正弦电气	19,199	273,585.75	0.03
159	688388	嘉元科技	27,785	270,903.75	0.03
160	002830	名雕股份	27,500	270,600.00	0.03
161	300269	联建光电	105,400	264,554.00	0.03
162	688622	禾信仪器	16,475	263,600.00	0.03
163	002467	二六三	78,500	262,190.00	0.03
164	002010	传化智联	67,800	260,352.00	0.03
165	688367	工大高科	21,328	260,201.60	0.03
166	600391	航发科技	16,800	256,200.00	0.03
167	688798	艾为电子	4,495	254,506.90	0.03
168	603813	原尚股份	26,900	253,936.00	0.03
169	003017	大洋生物	15,600	253,656.00	0.03
170	600847	万里股份	39,800	252,730.00	0.03
171	600137	浪莎股份	21,200	251,644.00	0.03
172	688173	希荻微	22,670	250,050.10	0.03
173	300405	科隆股份	70,400	249,920.00	0.03
174	603160	汇顶科技	3,600	247,500.00	0.03
175	002171	楚江新材	36,800	242,512.00	0.03
176	300955	嘉亨家化	19,100	241,997.00	0.03
177	300747	锐科激光	13,600	241,400.00	0.03



178	688701	卓锦股份	44,732	241,105.48	0.03
179	300264	佳创视讯	61,000	239,730.00	0.03
180	688251	井松智能	12,856	238,735.92	0.03
181	301268	铭利达	15,300	237,915.00	0.03
182	688329	艾隆科技	15,992	237,641.12	0.03
183	002174	游族网络	31,200	236,808.00	0.03
184	605222	起帆电缆	15,200	233,168.00	0.03
185	300296	利亚德	51,300	230,850.00	0.03
186	601886	江河集团	46,600	227,408.00	0.03
187	002910	庄园牧场	36,500	226,300.00	0.03
188	300687	赛意信息	16,200	225,504.00	0.03
189	688586	江航装备	24,143	224,529.90	0.03
190	600063	皖维高新	63,500	223,520.00	0.03
191	603185	弘元绿能	13,000	222,170.00	0.03
192	300211	亿通科技	41,800	221,122.00	0.03
193	600718	东软集团	26,700	220,809.00	0.03
194	300923	研奥股份	12,900	219,300.00	0.03
195	600449	宁夏建材	18,500	217,375.00	0.03
196	300399	天利科技	24,700	217,113.00	0.03
197	600802	福建水泥	76,800	213,504.00	0.03
198	688021	奥福环保	22,994	211,544.80	0.03
199	002283	天润工业	49,300	211,497.00	0.03
200	000813	德展健康	100,000	208,000.00	0.02
201	301300	远翔新材	9,400	205,954.00	0.02
202	600409	三友化工	41,000	205,820.00	0.02
203	688217	睿昂基因	10,297	203,262.78	0.02
204	002890	弘宇股份	25,220	202,264.40	0.02
205	601609	金田股份	35,700	202,062.00	0.02
206	002145	中核钛白	61,400	201,392.00	0.02
207	300385	雪浪环境	59,600	200,852.00	0.02
208	601279	英利汽车	53,800	200,674.00	0.02
209	300953	震裕科技	3,700	200,540.00	0.02
210	300591	万里马	64,000	199,680.00	0.02
211	300838	浙江力诺	19,300	198,404.00	0.02
212	002961	瑞达期货	18,100	198,195.00	0.02
213	603297	永新光学	3,200	193,568.00	0.02
214	002185	华天科技	23,700	193,155.00	0.02
215	300658	延江股份	45,600	192,432.00	0.02
216	002545	东方铁塔	28,100	191,361.00	0.02
217	603013	亚普股份	14,200	191,274.00	0.02
218	000663	永安林业	45,500	190,645.00	0.02
219	600392	盛和资源	21,900	188,778.00	0.02
220	688013	天臣医疗	12,633	187,473.72	0.02

221	688381	帝奥微	9,605	187,105.40	0.02
222	300920	润阳科技	12,400	186,496.00	0.02
223	002718	友邦吊顶	17,700	184,788.00	0.02
224	600075	新疆天业	53,100	183,195.00	0.02
225	603187	海容冷链	15,700	183,062.00	0.02
226	002643	万润股份	18,000	180,000.00	0.02
227	600299	安迪苏	18,500	179,450.00	0.02
228	300949	奥雅股份	6,000	178,860.00	0.02
229	688078	龙软科技	7,732	178,067.96	0.02
230	300134	大富科技	26,100	178,002.00	0.02
231	688193	仁度生物	6,549	172,173.21	0.02
232	605365	立达信	10,800	171,396.00	0.02
233	603810	丰山集团	20,500	171,380.00	0.02
234	603098	森特股份	21,400	168,204.00	0.02
235	600967	内蒙一机	23,100	166,320.00	0.02
236	600110	诺德股份	54,500	166,225.00	0.02
237	301336	趣睡科技	5,600	165,312.00	0.02
238	300611	美力科技	21,400	163,068.00	0.02
239	002633	申科股份	27,600	162,288.00	0.02
240	300143	盈康生命	21,500	161,895.00	0.02
241	300334	津膜科技	34,500	161,460.00	0.02
242	688309	恒誉环保	13,424	160,953.76	0.02
243	688485	九州一轨	20,618	160,820.40	0.02
244	300113	顺网科技	15,700	160,768.00	0.02
245	603071	物产环能	12,600	157,878.00	0.02
246	300549	优德精密	11,500	155,480.00	0.02
247	300892	品渥食品	11,300	154,132.00	0.02
248	001236	弘业期货	21,500	152,865.00	0.02
249	600582	天地科技	22,000	151,580.00	0.02
250	603159	上海亚虹	14,100	146,781.00	0.02
251	601908	京运通	57,400	145,222.00	0.02
252	300564	筑博设计	17,000	145,010.00	0.02
253	600562	国睿科技	10,600	144,796.00	0.02
254	600667	太极实业	25,200	143,892.00	0.02
255	688152	麒麟信安	3,711	143,689.92	0.02
256	601311	骆驼股份	17,900	143,558.00	0.02
257	688026	洁特生物	14,377	143,194.92	0.02
258	002777	久远银海	9,400	140,906.00	0.02
259	601969	海南矿业	22,100	140,114.00	0.02
260	300449	汉邦高科	33,300	139,527.00	0.02
261	688448	磁谷科技	7,303	137,880.64	0.02
262	688335	复洁环保	16,583	135,151.45	0.02
263	603937	丽岛新材	17,300	134,248.00	0.02

264	600316	洪都航空	8,000	133,040.00	0.02
265	000929	兰州黄河	21,400	130,754.00	0.02
266	002649	博彦科技	16,400	130,544.00	0.02
267	300883	龙利得	30,500	129,015.00	0.02
268	300850	新强联	8,500	127,670.00	0.02
269	600281	华阳新材	48,000	125,760.00	0.02
270	300948	冠中生态	14,200	125,670.00	0.02
271	002205	国统股份	20,000	125,400.00	0.02
272	300030	阳普医疗	33,100	123,132.00	0.01
273	600206	有研新材	13,700	121,930.00	0.01
274	300821	东岳硅材	17,500	119,700.00	0.01
275	000030	富奥股份	23,800	116,858.00	0.01
276	002858	力盛体育	11,200	116,480.00	0.01
277	002209	达意隆	15,200	115,976.00	0.01
278	002696	百洋股份	29,200	115,340.00	0.01
279	301105	鸿铭股份	4,500	112,455.00	0.01
280	688163	赛伦生物	9,206	111,760.84	0.01
281	688528	秦川物联	13,655	109,103.45	0.01
282	300746	汉嘉设计	17,300	108,644.00	0.01
283	301053	远信工业	5,300	105,788.00	0.01
284	300348	长亮科技	15,400	105,028.00	0.01
285	000712	锦龙股份	13,800	103,500.00	0.01
286	000825	太钢不锈	30,100	101,738.00	0.01
287	300973	立高食品	3,600	101,124.00	0.01
288	000856	冀东装备	16,400	99,712.00	0.01
289	600835	上海机电	8,500	97,835.00	0.01
290	002998	优彩资源	17,200	97,524.00	0.01
291	300724	捷佳伟创	1,700	91,817.00	0.01
292	002108	沧州明珠	29,800	91,188.00	0.01
293	300694	蠡湖股份	10,700	91,057.00	0.01
294	600096	云天化	4,600	89,332.00	0.01
295	600778	友好集团	22,400	87,136.00	0.01
296	603938	三孚股份	7,300	85,775.00	0.01
297	300166	东方国信	14,000	85,680.00	0.01
298	002207	准油股份	20,800	85,488.00	0.01
299	002123	梦网科技	12,100	85,063.00	0.01
300	301069	凯盛新材	6,300	82,593.00	0.01
301	603489	八方股份	3,000	80,940.00	0.01
302	002249	大洋电机	17,000	80,410.00	0.01
303	002571	德力股份	16,500	80,355.00	0.01
304	601869	长飞光纤	3,300	80,289.00	0.01
305	300599	雄塑科技	16,100	80,017.00	0.01
306	300387	富邦股份	13,100	78,469.00	0.01

307	300409	道氏技术	9,100	77,896.00	0.01
308	300333	兆日科技	16,000	77,280.00	0.01
309	688707	振华新材	7,898	76,926.52	0.01
310	001260	坤泰股份	5,300	73,829.00	0.01
311	300170	汉得信息	11,800	72,452.00	0.01
312	600623	华谊集团	12,300	71,094.00	0.01
313	301032	新柴股份	10,300	69,113.00	0.01
314	300854	中兰环保	6,900	68,586.00	0.01
315	002909	集泰股份	15,700	64,370.00	0.01
316	603926	铁流股份	7,700	63,910.00	0.01
317	002743	富煌钢构	17,300	63,837.00	0.01
318	002809	红墙股份	8,800	63,096.00	0.01
319	600618	氯碱化工	6,600	57,948.00	0.01
320	000678	襄阳轴承	14,900	56,024.00	0.01
321	300626	华瑞股份	7,400	55,426.00	0.01
322	603177	德创环保	7,800	54,834.00	0.01
323	000953	河化股份	22,900	53,357.00	0.01
324	600615	丰华股份	6,300	53,298.00	0.01
325	300472	新元科技	12,000	53,160.00	0.01
326	000890	法尔胜	21,000	52,080.00	0.01
327	003040	楚天龙	4,200	51,660.00	0.01
328	600498	烽火通信	3,200	50,880.00	0.01
329	002316	亚联发展	15,800	49,138.00	0.01
330	600883	博闻科技	7,700	47,355.00	0.01
331	000810	创维数字	5,400	46,332.00	0.01
332	300132	青松股份	13,200	45,936.00	0.01
333	001278	一彬科技	2,700	42,687.00	0.01
334	600968	海油发展	10,200	42,024.00	0.01
335	600143	金发科技	6,300	41,643.00	0.00
336	603616	韩建河山	13,700	40,415.00	0.00
337	002250	联化科技	8,100	38,880.00	0.00
338	600099	林海股份	5,500	37,840.00	0.00
339	000635	英力特	6,100	35,685.00	0.00
340	002295	精艺股份	6,200	32,984.00	0.00
341	300587	天铁股份	7,900	31,916.00	0.00
342	002191	劲嘉股份	8,800	31,768.00	0.00
343	300176	派生科技	6,800	29,988.00	0.00
344	301066	万事利	3,700	29,970.00	0.00
345	688065	凯赛生物	639	29,004.21	0.00
346	002004	华邦健康	7,300	27,740.00	0.00
347	002084	海鸥住工	11,000	26,950.00	0.00
348	002529	海源复材	5,000	25,800.00	0.00
349	300267	尔康制药	11,200	23,296.00	0.00

350	300663	科蓝软件	2,300	22,701.00	0.00
351	603188	亚邦股份	10,000	22,600.00	0.00
352	000573	粤宏远 A	9,200	20,056.00	0.00
353	301177	迪阿股份	1,000	18,600.00	0.00
354	603958	哈森股份	2,200	17,974.00	0.00
355	603301	振德医疗	800	16,688.00	0.00
356	600232	金鹰股份	3,800	16,378.00	0.00
357	300188	国投智能	1,400	15,554.00	0.00
358	300319	麦捷科技	1,600	14,928.00	0.00
359	002921	联诚精密	1,400	14,014.00	0.00
360	688400	凌云光	665	11,092.20	0.00
361	688001	华兴源创	444	10,025.52	0.00
362	002798	帝欧家居	2,800	9,128.00	0.00
363	603466	风语筑	1,000	8,540.00	0.00
364	000757	浩物股份	3,100	7,781.00	0.00
365	600850	电科数字	400	7,240.00	0.00
366	601828	美凯龙	2,700	6,885.00	0.00
367	600877	电科芯片	400	4,288.00	0.00
368	301022	海泰科	200	3,950.00	0.00
369	300212	易华录	100	1,683.00	0.00
370	600100	同方股份	100	509.00	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	601318	中国平安	60,512,739.00	4.74
2	601169	北京银行	50,827,610.40	3.98
3	600019	宝钢股份	41,757,575.48	3.27
4	000333	美的集团	38,715,629.22	3.03
5	600036	招商银行	37,718,334.54	2.95
6	601688	华泰证券	37,641,240.00	2.95
7	600150	中国船舶	34,993,387.00	2.74
8	000858	五粮液	34,345,070.11	2.69
9	601398	工商银行	32,126,967.00	2.52
10	601288	农业银行	32,052,525.00	2.51
11	002129	TCL 中环	31,148,691.25	2.44
12	601229	上海银行	27,456,643.00	2.15
13	000725	京东方 A	26,855,662.00	2.10
14	600028	中国石化	26,105,485.00	2.04
15	601238	广汽集团	25,555,495.20	2.00
16	000651	格力电器	25,278,854.00	1.98
17	601988	中国银行	25,246,831.00	1.98

18	300782	卓胜微	24,936,142.72	1.95
19	603501	韦尔股份	24,853,950.20	1.95
20	000157	中联重科	24,757,533.10	1.94

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	601318	中国平安	61,672,688.47	4.83
2	601169	北京银行	53,338,191.55	4.18
3	601688	华泰证券	45,450,920.00	3.56
4	601319	中国人保	43,784,363.00	3.43
5	600918	中泰证券	40,144,766.00	3.14
6	600036	招商银行	39,552,764.33	3.10
7	300347	泰格医药	36,764,891.84	2.88
8	600150	中国船舶	33,842,843.00	2.65
9	601336	新华保险	33,632,591.09	2.63
10	601288	农业银行	33,053,328.00	2.59
11	000661	长春高新	32,322,672.04	2.53
12	300413	芒果超媒	32,255,643.20	2.53
13	601360	三六零	32,006,393.00	2.51
14	601398	工商银行	31,810,961.00	2.49
15	601601	中国太保	31,664,459.00	2.48
16	002410	广联达	31,586,837.30	2.47
17	000858	五粮液	31,029,358.76	2.43
18	600346	恒力石化	30,762,875.00	2.41
19	600019	宝钢股份	30,032,451.60	2.35
20	600588	用友网络	29,420,689.61	2.30
21	000938	紫光股份	28,827,773.86	2.26
22	002129	TCL 中环	28,476,671.53	2.23
23	601728	中国电信	28,323,827.00	2.22
24	002241	歌尔股份	28,119,923.00	2.20
25	688223	晶科能源	28,082,958.62	2.20
26	601236	红塔证券	26,624,991.78	2.08
27	600028	中国石化	26,582,197.00	2.08
28	688363	华熙生物	26,225,729.44	2.05
29	300033	同花顺	26,158,706.51	2.05
30	601138	工业富联	26,025,094.00	2.04
31	600887	伊利股份	25,567,582.32	2.00

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	3,510,746,080.59
卖出股票收入（成交）总额	3,864,354,822.56

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	15,247,102.75	1.82
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	15,247,102.75	1.82

## 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	019709	23 国债 16	100,000	10,156,150.69	1.21
2	019727	23 国债 24	50,000	5,090,952.06	0.61

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

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，根据中联重科股份有限公司于 2023 年 09 月 10 日发布的公告，其受到卡拉苏海关给予罚款 0.1 万元的行政处罚。

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	702,677.56
2	应收清算款	3,196,657.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,107,923.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,007,257.81

### 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 300 指数增强 A	17,331	12,205.92	78,178,240.36	36.96	133,362,566.11	63.04
国金 300 指数增强 C	23,906	30,812.88	542,583,452.79	73.66	194,029,258.76	26.34
合计	41,237	22,992.79	620,761,693.15	65.47	327,391,824.87	34.53

## 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 300 指数增强 A	309,833.78	0.1465
	国金 300 指数增强 C	2,260.75	0.0003
	合计	312,094.53	0.0329

## 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 300 指数增强 A	10~50
	国金 300 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 300 指数增强 A	0
	国金 300 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 300 指数增强 A	国金 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2017 年 9 月 1 日) 基金份额总额	196,802,728.21	-
本报告期期初基金 份额总额	766,389,898.28	615,968,328.85
本报告期基金总申 购份额	97,680,695.09	744,734,067.11
减：本报告期基金 总赎回份额	652,529,786.90	624,089,684.41
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	211,540,806.47	736,612,711.55

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	1,765,823,662.50	23.94	1,317,126.21	27.83	-
中邮证券	1	1,123,476,482.30	15.23	500,962.62	10.59	-
平安证券	1	1,018,227,102.54	13.81	759,505.50	16.05	-
银河证券	1	939,737,784.22	12.74	667,895.07	14.11	-
华安证券	1	620,260,139.66	8.41	276,578.94	5.84	-
东吴证券	1	591,874,031.47	8.03	263,920.35	5.58	-
招商证券	1	385,343,787.57	5.22	287,437.65	6.07	-
国信证券	1	379,444,939.11	5.14	283,029.49	5.98	-
东方财富证券	2	346,780,756.15	4.70	258,661.95	5.47	-
国盛证券	1	86,785,209.33	1.18	64,732.06	1.37	-
中山证券	1	74,444,252.42	1.01	33,195.37	0.70	-
光大证券	2	42,902,755.88	0.58	19,130.51	0.40	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-

国元证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 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) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本基金本报告期新增中邮证券、东吴证券、光大证券各 1 个交易单元。

### 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	20,249,645.44	80.01	53,000,000.00	65.36	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	5,057,876.08	19.99	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	28,092,000.00	34.64	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

### 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	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 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	《国金沪深 300 指数增强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 06 日
5	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 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 06 日
6	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 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 06 日
7	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 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	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 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个人资料信息的公告》	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	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 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	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 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

投资者类别	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	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024 年 2 月 23 日-2024 年 6 月 30 日	-	427,054,478.30	-	427,054,478.30	45.04
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比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</li> <li>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</li> <li>3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延期支付赎回款项、部分延期赎回或者暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</li> <li>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</li> <li>5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</li> </ol>							

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。

### 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。

### 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