

国金中证 1000 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60

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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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	64
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国金中证 1000 指数增强	
基金主代码	017846	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 22 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	607,074,097.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017846	017847
报告期末下属分级基金的份额总额	200,622,291.34 份	406,451,806.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	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。 本基金主要在基准成份内选股，力求在跟踪指数的前提下获取相对稳定的超额收益。股票投资策略部分，本基金为指数增强型基金，以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在控制跟踪误差的基础上，力求获得相对稳定的超越标的指数的超额收益。参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并通过分析投资组合相对标的指数的暴露度等因素，对组合跟踪效果进行评估，及时调整投资组合，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用机器学习技术构建量化选股模型，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。 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 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞志海	张姗
	联系电话	010-88005852	400-61-95555
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4000-2000-18	400-61-95555
传真		010-88005666	0755-83195201
注册地址		北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100026	518040
法定代表人		邵海波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告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 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	53,679,379.48	115,667,137.28
本期利润	50,182,669.26	115,036,531.99
加权平均基金份 额本期利润	0.3340	0.3380
本期加权平均净 值利润率	22.39%	23.01%
本期基金份额净 值增长率	25.55%	25.30%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	117, 175, 272. 70	228, 842, 708. 07
期末可供分配基金份额利润	0. 5841	0. 5630
期末基金资产净值	330, 137, 868. 00	660, 178, 495. 27
期末基金份额净值	1. 6456	1. 6242
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	64. 56%	62. 42%

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

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

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

3. 2 基金净值表现

3. 2. 1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	18. 23%	1. 66%	14. 83%	1. 53%	3. 40%	0. 13%
过去六个月	25. 55%	1. 54%	15. 23%	1. 54%	10. 32%	0. 00%
过去一年	51. 11%	1. 30%	36. 53%	1. 31%	14. 58%	-0. 01%
过去三年	66. 81%	1. 57%	32. 22%	1. 57%	34. 59%	0. 00%
自基金合同生效起至今	64. 56%	1. 52%	28. 42%	1. 52%	36. 14%	0. 00%

国金中证 1000 指数增强 C

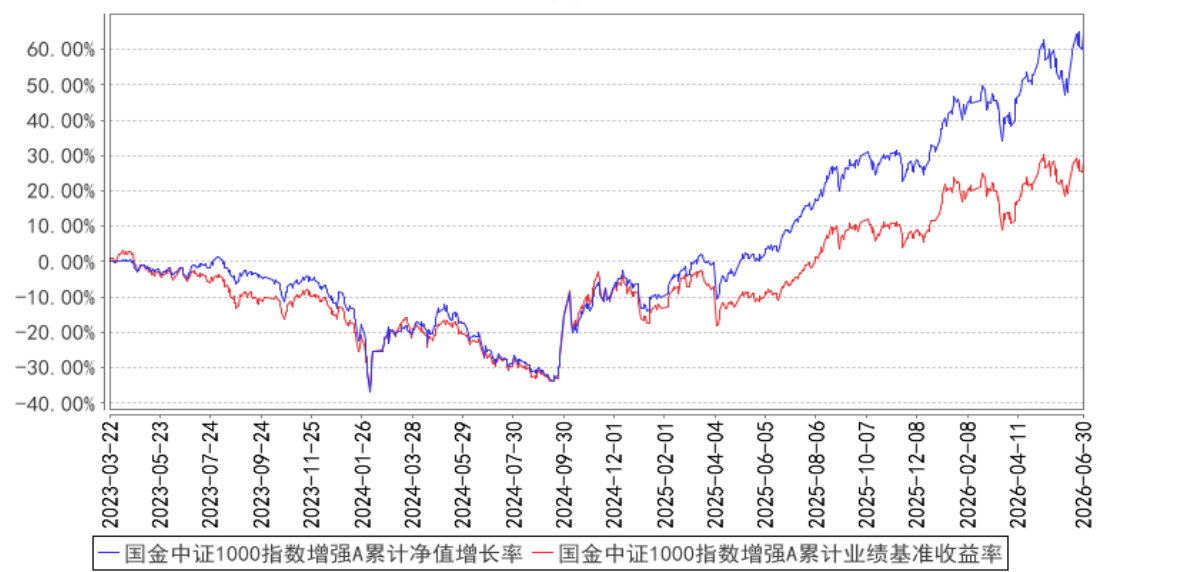
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去三个月	18.11%	1.66%	14.83%	1.53%	3.28%	0.13%
过去六个月	25.30%	1.54%	15.23%	1.54%	10.07%	0.00%
过去一年	50.50%	1.30%	36.53%	1.31%	13.97%	-0.01%
过去三年	64.83%	1.57%	32.22%	1.57%	32.61%	0.00%
自基金合同生效 起至今	62.42%	1.52%	28.42%	1.52%	34.00%	0.00%

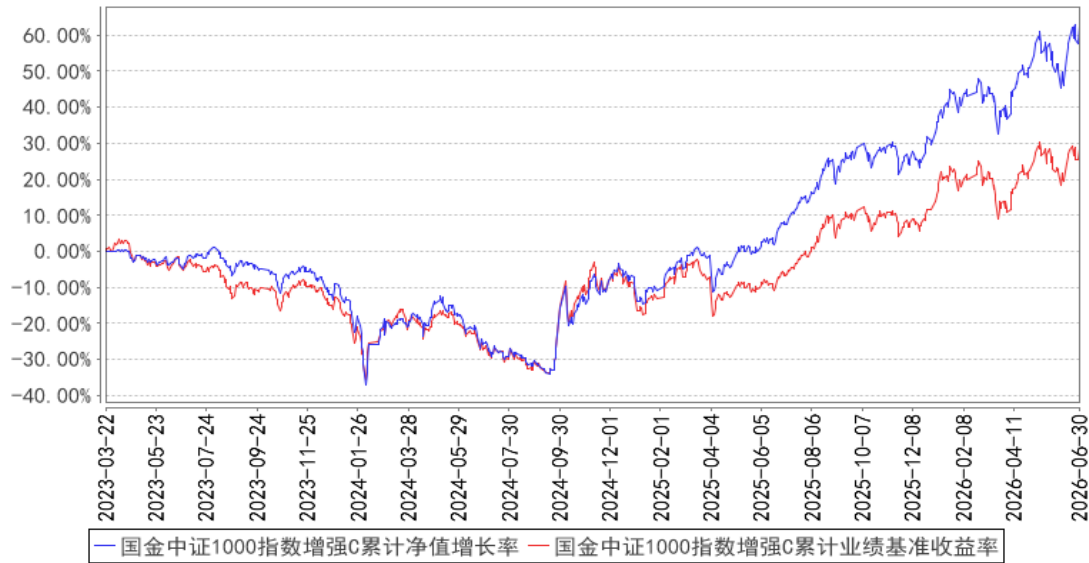
注：本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）*5%。

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

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



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



注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 3 月 22 日，图示日期为 2023 年 3 月 22 日至 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		
李洪超	本基金的基金经理	2025 年 7 月 24 日	-	10 年	李洪超先生，西安交通大学学士。2001 年 7 月至 2005 年 3 月在北京许继电气有限公司担任开发工程师，2005 年 3 月至 2007 年 12 月在奥博杰天软件(北京)有限公司担任开发工程师，2007 年 12 月至 2009 年 4 月在翱龙科技开发(北京)有限公司担任开发工程师，2009 年 4 月至 2012 年 2 月在 IGT 科技开发(北京)有限公司担任开发工程师，2012 年 2 月至 2016 年 1 月在松河(北京)信息咨询有限公司担任开发工程师。2016 年 1 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部软件开发经理、量化投资中心量化研究员、投资经理，现任量化投资中心基金经理。

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遵规守信情况的说明

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

本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，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，本基金的风险调整后收益水平基本符合预期。

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 1.6456 元，累计单位净值为 1.6456 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 25.55%，同期业绩比较基准增长率为 15.23%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.6242 元，累计单位净值为 1.6242 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 25.30%，同期业绩比较基准增长率为 15.23%。

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

托管人声明：

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

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

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

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	76,627,491.44	50,371,185.59
结算备付金		343.98	342.17
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	911,819,686.04	480,007,036.78
其中：股票投资		911,819,686.04	480,007,036.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		11,013,080.57	1,229,244.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		999,460,602.03	531,607,808.55
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		7,949,416.49	8,675,430.07
应付管理人报酬		717,422.37	462,411.80
应付托管费		143,484.46	92,482.34
应付销售服务费		190,523.18	118,164.56
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	143,392.26	165,823.53
负债合计		9,144,238.76	9,514,312.30
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	607,074,097.43	401,222,158.57
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	383,242,265.84	120,871,337.68
净资产合计		990,316,363.27	522,093,496.25
负债和净资产总计		999,460,602.03	531,607,808.55

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，国金中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.6456 元，基金份额总额 200,622,291.34 份；国金中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.6242 元，基金份额总额 406,451,806.09 份。国金中证 1000 指数增强份额总额合计为 607,074,097.43 份。

6.2 利润表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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		170,579,099.17	65,745,917.68
1. 利息收入		65,237.62	41,115.43

其中：存款利息收入	6.4.7.13	65,237.62	35,964.89
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		-	5,150.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		173,198,441.98	48,707,023.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	170,801,179.81	46,433,253.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,397,262.17	2,273,769.95
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	-4,127,315.51	16,768,449.28
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	1,442,735.08	229,329.78
减：二、营业总支出		5,359,897.92	2,406,541.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,567,946.67	1,709,813.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	713,589.30	341,962.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	984,481.19	266,501.54
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	93,880.76	88,263.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		165,219,201.25	63,339,376.36

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		165,219,201.25	63,339,376.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		165,219,201.25	63,339,376.36

6.3 净资产变动表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	401,222,158.57	-	120,871,337.68	522,093,496.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	401,222,158.57	-	120,871,337.68	522,093,496.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	205,851,938.86	-	262,370,928.16	468,222,867.02
(一)、综合收益总额	-	-	165,219,201.25	165,219,201.25
(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)	205,851,938.86	-	97,151,726.91	303,003,665.77
其中：1. 基金申购款	713,080,869.64	-	344,114,030.90	1,057,194,900.54
2. 基金赎回款	-507,228,930.78	-	-246,962,303.99	-754,191,234.77
(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)	-	-	-	-

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	607,074,097.43	-	383,242,265.84	990,316,363.27
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	409,133,850.89	-	-36,432,887.96	372,700,962.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	409,133,850.89	-	-36,432,887.96	372,700,962.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 112,400,800.32	-	61,420,462.81	-50,980,337.51
(一)、综合收益总额	-	-	63,339,376.36	63,339,376.36
(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)	- 112,400,800.32	-	-1,918,913.55	-114,319,713.87
其中：1. 基金申购款	163,502,446.88	-	-4,037,588.22	159,464,858.66
2. 基金赎回款	- 275,903,247.20	-	2,118,674.67	-273,784,572.53
(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	296,733,050.57	-	24,987,574.85	321,720,625.42
-----------	----------------	---	---------------	----------------

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

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

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

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

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times$ 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 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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。

6.4.7 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	51,526,004.17
等于：本金	51,522,136.09
加：应计利息	3,868.08
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	25,101,487.27
等于：本金	25,100,824.10
加：应计利息	663.17
减：坏账准备	-
合计	76,627,491.44

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	913,278,938.46	-	911,819,686.04	-1,459,252.42
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	913,278,938.46	-	911,819,686.04	-1,459,252.42

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	806.11
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	89,260.15
其他	53,326.00
合计	143,392.26

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金中证 1000 指数增强 A

项目	本期 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	137,783,091.72	137,783,091.72
本期申购	205,548,445.06	205,548,445.06
本期赎回（以“-”号填列）	-142,709,245.44	-142,709,245.44

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	200,622,291.34	200,622,291.34

国金中证 1000 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	263,439,066.85	263,439,066.85
本期申购	507,532,424.58	507,532,424.58
本期赎回(以“-”号填列)	-364,519,685.34	-364,519,685.34
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	406,451,806.09	406,451,806.09

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 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,629,649.54	11,182,912.05	42,812,561.59
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	31,629,649.54	11,182,912.05	42,812,561.59
本期利润	53,679,379.48	-3,496,710.22	50,182,669.26
本期基金份额交易产生的变动数	31,866,243.68	4,654,102.13	36,520,345.81
其中：基金申购款	88,058,011.95	18,472,139.86	106,530,151.81
基金赎回款	-56,191,768.27	-13,818,037.73	-70,009,806.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,175,272.70	12,340,303.96	129,515,576.66

国金中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,820,417.46	21,238,358.63	78,058,776.09
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	56,820,417.46	21,238,358.63	78,058,776.09
本期利润	115,667,137.28	-630,605.29	115,036,531.99
本期基金份额交易产生的变动数	56,355,153.33	4,276,227.77	60,631,381.10
其中：基金申购款	205,163,478.85	32,420,400.24	237,583,879.09
基金赎回款	-148,808,325.52	-28,144,172.47	-176,952,497.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	228,842,708.07	24,883,981.11	253,726,689.18

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	49,341.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	9,012.53
结算备付金利息收入	1.81
其他	6,881.63
合计	65,237.62

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	170,801,179.81
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	170,801,179.81

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	2,695,608,809.26
减：卖出股票成本总额	2,522,022,224.42
减：交易费用	2,785,405.03
买卖股票差价收入	170,801,179.81

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

无

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	2,397,262.17
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,397,262.17

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	-4,127,315.51
股票投资	-4,127,315.51
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-4,127,315.51

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	1,434,556.78
基金转换费收入	8,178.30
合计	1,442,735.08

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,620.61
合计	93,880.76

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
招商银行股份有限公司	基金托管人
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构、基金结算机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	5,652,490,070.06	100.00	3,264,421,654.45	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	-	-	83,803,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

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 2026年1月1日至2026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	1,075,197.76	100.00	-	-
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 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	619,771.44	100.00	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。

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	3,567,946.67	1,709,813.59

其中：应支付销售机构的客户维护费	1, 316, 187. 83	635, 198. 48
应支付基金管理人的净管理费	2, 251, 758. 84	1, 074, 615. 11

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

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	713, 589. 30	341, 962. 73

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

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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 1000 指数 增强 A	国金中证 1000 指数 增强 C	合计
国金基金管理有限公司	—	107,452.49	107,452.49
国金证券股份有限公司	—	172,057.89	172,057.89
合计	—	279,510.38	279,510.38
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 1000 指数 增强 A	国金中证 1000 指数 增强 C	合计
国金基金管理有限公司	—	40,687.03	40,687.03
国金证券股份有限公司	—	159,669.02	159,669.02
合计	—	200,356.05	200,356.05

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

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

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
招商银行股份有限公司-活期存款	51,526,004.17	49,341.65	10,837,669.16	18,326.54
国金证券股份有限公司-其他存款	25,101,487.27	9,012.53	22,152,065.20	12,850.38

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

2. 除其他存款外，本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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
001237	惠康	2026 年 5	6 个月	锁定期股	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-

	科技	月 15 日		票流通受限						
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	锁定期股票流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票流通受限	10.12	27.73	4,541	45,954.92	125,921.93	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	锁定期股票流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	锁定期股票流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	锁定期股票流通受限	46.08	463.33	1,202	55,388.16	556,922.66	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	锁定期股票流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	锁定期股票流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	锁定期股票流通受限	11.18	17.59	558	6,238.44	9,815.22	-
603293	埃	2026	6 个月	锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

	泰克	年 4 月 9 日		期股票流通受限						
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	锁定期股票流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	锁定期股票流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	锁定期股票流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	锁定期股票流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	锁定期股票流通受限	19.68	141.49	1,172	23,064.96	165,826.28	-
920136	永励精密	2026 年 6 月 25 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920189	康美特	2026 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
920193	吉和	2026 年 6 月	1 个月内	新股流通	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-

	昌	月 18 日	(含)	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	76,627,491.44	-	-	-	-	-	76,627,491.44
结算备付金	343.98	-	-	-	-	-	343.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	911,819,686.04	911,819,686.04
应收申购款	-	-	-	-	-	11,013,080.57	11,013,080.57

资产总计	76,627,835.42	-	-	-	-	-922,832,766.61	999,460,602.03
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,949,416.49	7,949,416.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	717,422.37	717,422.37
应付托管费	-	-	-	-	-	143,484.46	143,484.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-	190,523.18	190,523.18
其他负债	-	-	-	-	-	143,392.26	143,392.26
负债总计	-	-	-	-	-	9,144,238.76	9,144,238.76
利率敏感度缺口	76,627,835.42	-	-	-	-	-913,688,527.85	990,316,363.27
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	50,371,185.59	-	-	-	-	-	50,371,185.59
结算备付金	342.17	-	-	-	-	-	342.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-480,007,036.78	480,007,036.78
应收申购款	-	-	-	-	-	1,229,244.01	1,229,244.01
资产总计	50,371,527.76	-	-	-	-	-481,236,280.79	531,607,808.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,675,430.07	8,675,430.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	462,411.80	462,411.80
应付托管费	-	-	-	-	-	92,482.34	92,482.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-	118,164.56	118,164.56
其他负债	-	-	-	-	-	165,823.53	165,823.53
负债总计	-	-	-	-	-	9,514,312.30	9,514,312.30
利率敏感度缺口	50,371,527.76	-	-	-	-	-471,721,968.49	522,093,496.25

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	911,819,686.04	92.07	480,007,036.78	91.94
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	911,819,686.04	92.07	480,007,036.78	91.94

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 1000 指数（000852.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 1000 指数数据回归得出，反映了基金和中证 1000 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	+5%	45,254,767.36	22,623,767.34

	-5%	-45,254,767.36	-22,623,767.34
--	-----	----------------	----------------

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	910,690,060.64	478,610,124.42
第二层次	9,968.00	1,191,168.00
第三层次	1,119,657.40	205,744.36
合计	911,819,686.04	480,007,036.78

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	911,819,686.04	91.23
	其中：股票	911,819,686.04	91.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	76,627,835.42	7.67
8	其他各项资产	11,013,080.57	1.10
9	合计	999,460,602.03	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	565,853.00	0.06
B	采矿业	30,247,871.60	3.05
C	制造业	575,716,701.32	58.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,771,822.00	0.78
E	建筑业	2,429,141.00	0.25
F	批发和零售业	8,498,480.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	9,703,409.20	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	104,624,238.86	10.56

	业		
J	金融业	5,454,258.00	0.55
K	房地产业	1,861,230.00	0.19
L	租赁和商务服务业	7,306,263.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	4,065,871.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	4,756,243.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	954,930.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,188,116.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	5,088,509.00	0.51
S	综合	—	—
	合计	770,232,936.98	77.78

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	255,320.00	0.03
B	采矿业	569,772.00	0.06
C	制造业	123,420,380.98	12.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,758,161.00	0.28
E	建筑业	2,330,163.60	0.24
F	批发和零售业	3,153,811.80	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	779,457.00	0.08
H	住宿和餐饮业	85,284.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,936,719.48	0.30
J	金融业	—	—
K	房地产业	271,566.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,448,953.20	0.15
M	科学研究和技术服务业	2,260,498.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	605,951.00	0.06
O	居民服务、修理	—	—

	和其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	261,898.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	448,813.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	141,586,749.06	14.30

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	301396	宏景科技	69,440	23,026,304.00	2.33
2	688388	嘉元科技	472,490	20,789,560.00	2.10
3	300870	欧陆通	60,100	20,775,969.00	2.10
4	300398	飞凯材料	303,235	18,724,761.25	1.89
5	600961	株冶集团	529,400	17,147,266.00	1.73
6	301018	申菱环境	139,820	16,164,590.20	1.63
7	688195	腾景科技	69,200	13,326,536.00	1.35
8	603063	禾望电气	232,400	12,291,636.00	1.24
9	688390	固德威	111,858	12,137,711.58	1.23
10	600888	新疆众和	727,100	11,553,619.00	1.17
11	002929	润建股份	172,200	11,516,736.00	1.16
12	688800	瑞可达	119,626	11,480,507.22	1.16
13	688531	日联科技	63,889	11,362,019.76	1.15
14	688536	思瑞浦	29,018	10,565,163.62	1.07
15	002716	湖南白银	1,259,600	10,190,164.00	1.03
16	601137	博威合金	444,200	9,918,986.00	1.00
17	603026	石大胜华	110,000	9,830,700.00	0.99
18	688127	蓝特光学	99,539	9,715,006.40	0.98
19	688003	天准科技	75,424	9,601,475.20	0.97
20	688025	杰普特	20,191	9,489,770.00	0.96
21	301205	联特科技	28,400	9,488,440.00	0.96
22	688409	富创精密	29,017	8,886,456.25	0.90
23	300438	鹏辉能源	106,000	8,782,100.00	0.89
24	300861	美畅股份	324,200	8,166,598.00	0.82
25	603083	剑桥科技	31,000	7,900,970.00	0.80
26	301511	德福科技	47,800	6,876,030.00	0.69
27	600458	时代新材	404,200	6,689,510.00	0.68

28	601126	四方股份	105,700	6,680,240.00	0.67
29	301196	唯科科技	53,255	6,679,242.10	0.67
30	002497	雅化集团	300,400	6,119,148.00	0.62
31	300323	华灿光电	282,200	5,756,880.00	0.58
32	002745	木林森	454,200	5,700,210.00	0.58
33	002913	奥士康	88,600	5,665,084.00	0.57
34	002237	恒邦股份	381,000	5,596,890.00	0.57
35	002643	万润股份	260,000	5,447,000.00	0.55
36	300102	乾照光电	209,000	5,442,360.00	0.55
37	688167	炬光科技	15,124	5,357,072.04	0.54
38	603124	江南新材	28,300	5,291,534.00	0.53
39	600331	宏达股份	465,000	5,110,350.00	0.52
40	603698	航天工程	129,500	4,993,520.00	0.50
41	601101	昊华能源	461,800	4,876,608.00	0.49
42	600151	航天机电	429,100	4,814,502.00	0.49
43	301219	腾远钴业	87,316	4,784,916.80	0.48
44	600259	中稀有色	45,600	4,633,416.00	0.47
45	300775	三角防务	208,400	4,593,136.00	0.46
46	603619	中曼石油	237,800	4,449,238.00	0.45
47	300133	华策影视	607,100	4,298,268.00	0.43
48	301510	固高科技	132,700	4,237,111.00	0.43
49	603305	旭升集团	330,600	4,006,872.00	0.40
50	002965	祥鑫科技	76,800	3,912,960.00	0.40
51	002245	蔚蓝锂芯	208,312	3,897,517.52	0.39
52	688502	茂莱光学	5,516	3,825,897.60	0.39
53	301571	国科天成	56,200	3,663,116.00	0.37
54	001287	中电港	116,700	3,635,205.00	0.37
55	605020	永和股份	88,600	3,607,792.00	0.36
56	002324	普利特	296,800	3,582,376.00	0.36
57	002534	西子洁能	191,100	3,544,905.00	0.36
58	600113	浙江东日	104,800	3,477,264.00	0.35
59	603533	掌阅科技	168,800	3,424,952.00	0.35
60	002317	众生药业	137,700	3,383,289.00	0.34
61	300872	天阳科技	210,900	3,332,220.00	0.34
62	002544	普天科技	174,300	3,175,746.00	0.32
63	002104	恒宝股份	307,800	3,173,418.00	0.32
64	603516	淳中科技	22,700	3,055,647.00	0.31
65	600399	抚顺特钢	724,300	2,976,873.00	0.30
66	002151	北斗星通	92,000	2,921,000.00	0.29
67	002158	汉钟精机	78,500	2,910,780.00	0.29
68	300855	图南股份	87,400	2,732,124.00	0.28
69	300378	鼎捷数智	75,600	2,729,160.00	0.28
70	600123	兰花科创	483,700	2,582,958.00	0.26

71	001339	智微智能	24,900	2,546,772.00	0.26
72	600596	新安股份	157,000	2,505,720.00	0.25
73	000810	创维数字	188,000	2,491,000.00	0.25
74	601918	新集能源	286,900	2,464,471.00	0.25
75	300634	彩讯股份	125,300	2,452,121.00	0.25
76	002979	雷赛智能	43,800	2,443,164.00	0.25
77	000035	中国天楹	503,600	2,432,388.00	0.25
78	300624	万兴科技	46,500	2,411,955.00	0.24
79	688062	迈威生物	85,092	2,403,849.00	0.24
80	300337	银邦股份	205,200	2,392,632.00	0.24
81	000555	神州信息	229,300	2,361,790.00	0.24
82	300229	拓尔思	170,500	2,356,310.00	0.24
83	603327	福蓉科技	276,600	2,345,568.00	0.24
84	300101	振芯科技	144,300	2,333,331.00	0.24
85	002174	游族网络	181,900	2,293,759.00	0.23
86	000758	中色股份	349,100	2,293,587.00	0.23
87	002747	埃斯顿	60,900	2,273,397.00	0.23
88	300602	飞荣达	44,300	2,268,160.00	0.23
89	000990	诚志股份	267,200	2,185,696.00	0.22
90	300580	贝斯特	108,300	2,177,913.00	0.22
91	688279	峰昭科技	9,609	2,156,643.96	0.22
92	688048	长光华芯	4,292	2,154,584.00	0.22
93	603588	高能环境	111,900	2,148,480.00	0.22
94	300045	华力创通	123,000	2,120,520.00	0.21
95	300638	广和通	113,700	2,104,587.00	0.21
96	301363	美好医疗	114,500	2,098,785.00	0.21
97	000600	建投能源	238,500	2,086,875.00	0.21
98	601975	招商南油	555,200	2,070,896.00	0.21
99	301631	壹连科技	28,300	2,033,638.00	0.21
100	603713	密尔克卫	28,500	2,028,345.00	0.20
101	300031	宝通科技	69,800	1,994,186.00	0.20
102	688068	热景生物	22,800	1,974,480.00	0.20
103	300779	惠城环保	39,180	1,966,836.00	0.20
104	603166	福达股份	143,100	1,913,247.00	0.19
105	603162	海通发展	211,460	1,896,796.20	0.19
106	002194	武汉凡谷	191,326	1,874,994.80	0.19
107	301500	飞南资源	70,500	1,836,525.00	0.19
108	688516	奥特维	31,873	1,829,191.47	0.18
109	601609	金田股份	166,700	1,800,360.00	0.18
110	301050	雷电微力	53,700	1,795,728.00	0.18
111	002518	科士达	33,300	1,784,547.00	0.18
112	300428	立中集团	97,400	1,770,732.00	0.18
113	300455	航天智装	80,200	1,727,508.00	0.17

114	002017	东信和平	117,800	1,723,414.00	0.17
115	300047	天源迪科	193,700	1,720,056.00	0.17
116	600971	恒源煤电	245,680	1,695,192.00	0.17
117	002345	潮宏基	179,200	1,643,264.00	0.17
118	605196	华通线缆	62,700	1,636,470.00	0.17
119	300990	同飞股份	15,500	1,628,585.00	0.16
120	002948	青岛银行	317,800	1,614,424.00	0.16
121	600740	山西焦化	503,900	1,607,441.00	0.16
122	600266	城建发展	400,200	1,564,782.00	0.16
123	000969	安泰科技	62,300	1,528,842.00	0.15
124	300036	超图软件	134,400	1,514,688.00	0.15
125	601187	厦门银行	219,600	1,499,868.00	0.15
126	300576	容大感光	28,800	1,475,136.00	0.15
127	002531	天顺风能	174,800	1,473,564.00	0.15
128	002075	沙钢股份	433,400	1,473,560.00	0.15
129	603317	天味食品	113,000	1,470,130.00	0.15
130	688484	南芯科技	26,012	1,469,417.88	0.15
131	301345	涛涛车业	6,335	1,463,385.00	0.15
132	300468	四方精创	69,200	1,453,892.00	0.15
133	601678	滨化股份	217,900	1,435,961.00	0.15
134	002182	宝武镁业	91,400	1,423,098.00	0.14
135	300416	苏试试验	67,400	1,373,612.00	0.14
136	002270	华明装备	72,600	1,368,510.00	0.14
137	600037	歌华有线	218,200	1,368,114.00	0.14
138	688262	国芯科技	31,604	1,366,240.92	0.14
139	000534	万泽股份	49,900	1,365,264.00	0.14
140	603915	国茂股份	96,200	1,365,078.00	0.14
141	300682	朗新科技	137,500	1,361,250.00	0.14
142	603127	昭衍新药	35,400	1,352,988.00	0.14
143	002488	金固股份	149,900	1,335,609.00	0.13
144	600502	安徽建工	303,000	1,318,050.00	0.13
145	688630	芯碁微装	2,368	1,300,955.52	0.13
146	688586	江航装备	109,995	1,285,841.55	0.13
147	002320	海峡股份	203,800	1,277,826.00	0.13
148	600395	盘江股份	280,000	1,276,800.00	0.13
149	002097	山河智能	176,200	1,273,926.00	0.13
150	000552	甘肃能化	568,400	1,273,216.00	0.13
151	600480	凌云股份	153,200	1,273,092.00	0.13
152	600645	中源协和	74,200	1,269,562.00	0.13
153	688443	智翔金泰	54,597	1,269,380.25	0.13
154	600718	东软集团	174,100	1,260,484.00	0.13
155	300841	康华生物	25,300	1,203,268.00	0.12
156	000923	河钢资源	96,400	1,196,324.00	0.12

157	300613	富瀚微	14,900	1,193,192.00	0.12
158	300244	迪安诊断	63,400	1,188,116.00	0.12
159	002947	恒铭达	15,500	1,178,775.00	0.12
160	301127	武汉天源	56,800	1,176,896.00	0.12
161	601882	海天精工	57,600	1,165,248.00	0.12
162	605011	杭州热电	75,100	1,161,046.00	0.12
163	600058	五矿发展	99,000	1,143,450.00	0.12
164	300680	隆盛科技	48,480	1,101,465.60	0.11
165	002928	华夏航空	156,100	1,091,139.00	0.11
166	600929	雪天盐业	239,600	1,087,784.00	0.11
167	688351	微电生理	47,314	1,072,135.24	0.11
168	601636	旗滨集团	104,100	1,064,943.00	0.11
169	300257	开山股份	36,200	1,038,216.00	0.10
170	002541	鸿路钢构	59,700	1,034,004.00	0.10
171	600006	东风股份	200,200	1,027,026.00	0.10
172	688182	灿勤科技	23,841	1,026,831.87	0.10
173	301550	斯菱智驱	11,000	1,005,730.00	0.10
174	688523	航天环宇	19,193	1,005,713.20	0.10
175	601069	西部黄金	45,700	1,005,400.00	0.10
176	600556	天下秀	227,300	1,004,666.00	0.10
177	002400	省广集团	158,700	1,001,397.00	0.10
178	301268	铭利达	71,100	993,978.00	0.10
179	301551	无线传媒	50,200	990,446.00	0.10
180	002093	国脉科技	151,600	955,080.00	0.10
181	300492	华图山鼎	27,800	954,930.00	0.10
182	002004	华邦健康	237,100	931,803.00	0.09
183	688660	电气风电	107,610	927,598.20	0.09
184	600361	创新新材	255,600	920,160.00	0.09
185	300409	道氏技术	45,800	912,794.00	0.09
186	603171	税友股份	22,800	908,580.00	0.09
187	603279	景津装备	75,700	908,400.00	0.09
188	300768	迪普科技	65,800	906,066.00	0.09
189	300348	长亮科技	102,900	905,520.00	0.09
190	600461	洪城环境	99,800	904,188.00	0.09
191	002110	三钢闽光	309,300	890,784.00	0.09
192	688631	莱斯信息	18,802	882,001.82	0.09
193	300579	数字认证	42,600	881,820.00	0.09
194	300098	高新兴	184,000	844,560.00	0.09
195	002897	意华股份	9,500	835,810.00	0.08
196	688382	益方生物	46,104	829,872.00	0.08
197	688658	悦康药业	63,926	822,088.36	0.08
198	002250	联化科技	59,900	818,833.00	0.08
199	603733	仙鹤股份	30,300	818,403.00	0.08

200	600986	浙文互联	117,100	817,358.00	0.08
201	000676	智度股份	159,400	814,534.00	0.08
202	300034	钢研高纳	47,100	807,294.00	0.08
203	688543	国科军工	19,792	780,794.40	0.08
204	002737	葵花药业	68,600	769,006.00	0.08
205	002557	洽洽食品	42,500	763,300.00	0.08
206	603057	紫燕食品	33,900	755,970.00	0.08
207	000672	上峰材料	31,300	741,184.00	0.07
208	688326	经纬恒润	10,395	736,797.60	0.07
209	301556	托普云农	12,600	736,596.00	0.07
210	603638	艾迪精密	31,400	736,330.00	0.07
211	000612	焦作万方	69,500	736,005.00	0.07
212	600686	金龙汽车	65,100	734,979.00	0.07
213	300127	银河磁体	26,100	729,495.00	0.07
214	301061	匠心家居	20,800	729,456.00	0.07
215	603599	广信股份	76,100	729,038.00	0.07
216	000686	东北证券	86,600	727,440.00	0.07
217	600654	中安科	273,200	726,712.00	0.07
218	688515	裕太微	2,920	726,379.20	0.07
219	001337	四川黄金	19,800	725,868.00	0.07
220	002045	国光电器	90,500	710,425.00	0.07
221	301215	中汽股份	135,900	705,321.00	0.07
222	301658	首航新能	26,100	703,917.00	0.07
223	600508	上海能源	95,480	703,687.60	0.07
224	601089	福元医药	43,100	701,668.00	0.07
225	300171	东富龙	62,200	687,932.00	0.07
226	301263	泰恩康	33,500	686,415.00	0.07
227	002216	三全食品	58,700	676,811.00	0.07
228	603118	共进股份	55,800	675,738.00	0.07
229	002396	星网锐捷	35,100	672,867.00	0.07
230	301087	可孚医疗	13,600	648,040.00	0.07
231	000506	招金黄金	55,100	645,772.00	0.07
232	002127	南极电商	232,700	637,598.00	0.06
233	600726	华电能源	89,500	637,240.00	0.06
234	300363	博腾股份	39,200	636,608.00	0.06
235	600509	天富能源	75,300	636,285.00	0.06
236	002985	北摩高科	22,900	634,330.00	0.06
237	301091	深城交	40,900	633,950.00	0.06
238	002537	海联金汇	119,800	633,742.00	0.06
239	301262	海看股份	35,200	632,544.00	0.06
240	600776	东方通信	47,500	624,150.00	0.06
241	600751	海航科技	212,300	617,793.00	0.06
242	688567	孚能科技	58,650	615,825.00	0.06

243	000156	华数传媒	97,300	613,963.00	0.06
244	301381	赛维时代	33,100	610,364.00	0.06
245	301153	中科江南	37,400	609,246.00	0.06
246	002891	中宠股份	22,400	598,528.00	0.06
247	600916	中国黄金	87,000	595,080.00	0.06
248	301339	通行宝	57,700	590,271.00	0.06
249	000550	江铃汽车	36,300	588,786.00	0.06
250	601963	重庆银行	58,300	587,664.00	0.06
251	002761	浙江建投	87,700	581,451.00	0.06
252	002096	易普力	65,800	577,724.00	0.06
253	688153	唯捷创芯	17,870	573,984.40	0.06
254	002041	登海种业	71,900	565,853.00	0.06
255	688612	威迈斯	18,559	549,160.81	0.06
256	000848	承德露露	74,000	547,600.00	0.06
257	300850	新强联	20,400	546,720.00	0.06
258	002516	旷达科技	97,300	542,934.00	0.05
259	002838	道恩股份	17,700	541,974.00	0.05
260	300446	航天智造	31,800	535,194.00	0.05
261	688300	联瑞新材	2,186	534,258.40	0.05
262	601311	骆驼股份	66,500	518,035.00	0.05
263	301225	恒勃股份	5,900	464,861.00	0.05
264	000059	华锦股份	121,500	455,625.00	0.05
265	688177	百奥泰	27,070	455,317.40	0.05
266	301177	迪阿股份	16,500	454,905.00	0.05
267	600446	金证股份	45,200	454,712.00	0.05
268	301565	中仑新材	19,930	454,204.70	0.05
269	600167	联美控股	80,700	451,113.00	0.05
270	688252	天德钰	18,671	448,104.00	0.05
271	688639	华恒生物	27,733	447,610.62	0.05
272	605123	派克新材	4,600	446,246.00	0.05
273	301207	华兰疫苗	27,300	444,717.00	0.04
274	603556	海兴电力	20,100	442,200.00	0.04
275	000719	中原传媒	38,600	441,198.00	0.04
276	601003	柳钢股份	128,900	434,393.00	0.04
277	603132	金徽股份	27,300	425,334.00	0.04
278	002315	焦点科技	17,700	412,056.00	0.04
279	002267	陕天然气	61,400	401,556.00	0.04
280	000061	农产品	70,800	396,480.00	0.04
281	002626	金达威	28,400	374,312.00	0.04
282	002832	比音勒芬	17,900	369,456.00	0.04
283	002258	利尔化学	28,800	366,048.00	0.04
284	600416	湘电股份	37,200	364,560.00	0.04
285	688686	奥普特	2,098	353,282.22	0.04

286	002099	海翔药业	65,700	346,896.00	0.04
287	000935	四川双马	13,200	344,388.00	0.03
288	600075	新疆天业	85,000	343,400.00	0.03
289	600618	氯碱化工	34,100	342,705.00	0.03
290	600328	中盐化工	56,900	341,400.00	0.03
291	600055	万东医疗	33,300	340,326.00	0.03
292	601528	瑞丰银行	76,600	338,572.00	0.03
293	600997	开滦股份	69,500	330,125.00	0.03
294	002727	一心堂	33,900	325,101.00	0.03
295	600033	福建高速	99,300	319,746.00	0.03
296	601107	四川成渝	64,500	314,760.00	0.03
297	003039	顺控发展	28,300	311,583.00	0.03
298	003006	百亚股份	20,700	300,357.00	0.03
299	002373	千方科技	37,700	270,686.00	0.03
300	002338	奥普光电	4,700	268,840.00	0.03
301	002961	瑞达期货	13,700	268,246.00	0.03
302	002020	京新药业	21,300	266,037.00	0.03
303	601595	上海电影	15,500	257,300.00	0.03
304	601068	中铝国际	59,200	255,744.00	0.03
305	001914	招商积余	31,300	255,408.00	0.03
306	000928	中钢国际	51,200	254,976.00	0.03
307	600662	外服控股	62,600	252,278.00	0.03
308	000950	重药控股	50,000	250,500.00	0.03
309	002987	京北方	20,900	203,357.00	0.02
310	605507	国邦医药	13,000	192,400.00	0.02
311	000901	航天科技	10,300	183,237.00	0.02
312	688107	安路科技	4,014	183,038.40	0.02
313	600640	国脉文化	18,900	182,763.00	0.02
314	300773	拉卡拉	11,900	182,070.00	0.02
315	603108	润达医疗	20,400	181,560.00	0.02
316	300525	博思软件	24,400	181,536.00	0.02
317	688522	纳睿雷达	9,049	181,160.98	0.02
318	603100	川仪股份	10,000	180,500.00	0.02
319	300678	中科信息	8,000	179,200.00	0.02
320	002251	步步高	53,000	179,140.00	0.02
321	688232	新点软件	9,957	177,035.46	0.02
322	002221	东华能源	33,600	176,736.00	0.02
323	301039	中集车辆	25,000	176,250.00	0.02
324	600475	华光环能	11,500	175,375.00	0.02
325	301078	孩子王	25,900	175,084.00	0.02
326	001236	弘业期货	25,100	174,445.00	0.02
327	301371	敷尔佳	6,600	171,600.00	0.02
328	002651	利君股份	23,100	168,861.00	0.02

329	600750	华润江中	7,600	167,732.00	0.02
330	000030	富奥股份	41,800	161,766.00	0.02
331	601860	紫金银行	44,400	107,448.00	0.01
332	601858	中国科传	5,300	91,743.00	0.01
333	300341	麦克奥迪	6,900	91,425.00	0.01
334	003010	若羽臣	3,700	89,910.00	0.01
335	600787	中储股份	20,600	86,108.00	0.01
336	688779	五矿新能	10,611	86,055.21	0.01
337	605599	莱百股份	6,200	84,940.00	0.01
338	600612	老凤祥	2,600	83,590.00	0.01
339	601375	中原证券	20,500	81,795.00	0.01
340	603248	锡华科技	3,500	73,815.00	0.01
341	002233	塔牌集团	9,700	67,609.00	0.01
342	600651	飞乐音响	10,700	59,813.00	0.01
343	600908	无锡银行	10,700	54,356.00	0.01
344	600639	浦东金桥	4,500	41,040.00	0.00
345	300088	长信科技	3,200	37,120.00	0.00
346	002563	森马服饰	4,400	22,176.00	0.00
347	000498	山东路桥	4,000	18,920.00	0.00
348	301031	中熔电气	156	18,634.20	0.00
349	600116	三峡水利	900	5,040.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	001309	德明利	15,600	14,709,240.00	1.49
2	300769	德方纳米	213,100	14,171,150.00	1.43
3	601869	长飞光纤	12,100	6,605,390.00	0.67
4	688313	仕佳光子	28,394	5,242,952.10	0.53
5	688268	华特气体	16,473	4,406,527.50	0.44
6	300953	震裕科技	31,180	4,168,766.00	0.42
7	002384	东山精密	14,500	3,804,075.00	0.38
8	300666	江丰电子	7,300	2,690,780.00	0.27
9	600150	中国船舶	75,400	2,547,766.00	0.26
10	300548	长芯博创	9,156	2,545,368.00	0.26
11	301536	星宸科技	18,600	2,394,006.00	0.24
12	301526	国际复材	48,400	2,258,828.00	0.23
13	300842	帝科股份	22,100	1,970,657.00	0.20
14	301246	宏源药业	70,900	1,907,210.00	0.19
15	601868	中国能建	674,700	1,801,449.00	0.18
16	301086	鸿富瀚	8,400	1,757,952.00	0.18
17	002824	和胜股份	50,200	1,735,916.00	0.18
18	688633	星球石墨	55,066	1,637,112.18	0.17

19	688628	优利德	15,725	1,555,831.50	0.16
20	603256	宏和科技	5,800	1,538,914.00	0.16
21	688667	菱电电控	11,130	1,487,524.50	0.15
22	300986	志特新材	84,700	1,452,605.00	0.15
23	300890	翔丰华	42,300	1,403,091.00	0.14
24	002865	钧达股份	21,500	1,283,120.00	0.13
25	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.13
26	002931	锋龙股份	17,800	1,227,844.00	0.12
27	603259	药明康德	8,700	1,083,237.00	0.11
28	300780	德恩精工	29,700	1,011,582.00	0.10
29	300067	安诺其	185,700	1,006,494.00	0.10
30	603538	美诺华	30,700	999,285.00	0.10
31	603178	圣龙股份	71,900	995,815.00	0.10
32	688309	恒誉环保	14,882	906,016.16	0.09
33	000725	京东方 A	103,300	896,644.00	0.09
34	300540	蜀道装备	22,400	848,960.00	0.09
35	300183	东软载波	79,700	832,865.00	0.08
36	002649	博彦科技	98,000	797,720.00	0.08
37	002136	安纳达	56,500	739,020.00	0.07
38	301603	乔锋智能	5,100	733,380.00	0.07
39	603095	越剑智能	50,800	727,456.00	0.07
40	300755	华致酒行	62,700	714,153.00	0.07
41	603318	水发燃气	69,300	661,122.00	0.07
42	688155	先惠技术	7,927	641,215.03	0.06
43	300079	数码视讯	151,400	635,880.00	0.06
44	300226	上海钢联	41,420	634,140.20	0.06
45	301041	金百泽	17,000	573,750.00	0.06
46	601699	潞安环能	39,900	569,772.00	0.06
47	002079	苏州固锝	37,100	557,613.00	0.06
48	301666	大普微	1,202	556,922.66	0.06
49	002335	科华数据	12,850	545,482.50	0.06
50	002777	久远银海	43,300	520,899.00	0.05
51	001389	广合科技	2,000	474,500.00	0.05
52	002791	坚朗五金	35,700	467,670.00	0.05
53	605222	起帆电缆	19,800	461,736.00	0.05
54	000539	粤电力 A	67,700	461,037.00	0.05
55	300965	恒宇信通	10,800	457,488.00	0.05
56	600966	博汇纸业	95,600	456,968.00	0.05
57	300753	爱朋医疗	24,100	456,213.00	0.05
58	003042	中农联合	37,500	455,625.00	0.05
59	000576	甘化科工	69,100	453,987.00	0.05
60	300805	电声股份	62,600	453,850.00	0.05
61	300876	蒙泰高新	31,540	451,968.20	0.05

62	300941	创识科技	32,900	451,717.00	0.05
63	000881	中广核技	68,600	444,528.00	0.04
64	300856	科思股份	40,400	430,664.00	0.04
65	300406	九强生物	39,100	427,363.00	0.04
66	001399	惠科股份	11,352	385,965.91	0.04
67	000919	金陵药业	65,000	378,950.00	0.04
68	301072	中捷精工	9,200	377,292.00	0.04
69	603937	丽岛新材	26,000	364,520.00	0.04
70	002820	桂发祥	43,200	362,880.00	0.04
71	000619	海螺新材	82,400	362,560.00	0.04
72	002905	金逸影视	53,700	362,475.00	0.04
73	002696	百洋股份	72,800	361,816.00	0.04
74	000757	浩物股份	105,900	361,119.00	0.04
75	300928	华安鑫创	12,500	361,000.00	0.04
76	688228	开普云	4,653	359,863.02	0.04
77	300535	达威股份	26,300	358,469.00	0.04
78	301051	信濠光电	18,260	354,244.00	0.04
79	000915	华特达因	12,500	353,875.00	0.04
80	002034	旺能环境	23,000	348,450.00	0.04
81	603700	宁水集团	29,900	347,139.00	0.04
82	600903	贵州燃气	51,500	341,960.00	0.03
83	002390	信邦制药	130,500	340,605.00	0.03
84	600713	南京医药	66,300	331,500.00	0.03
85	600479	千金药业	31,800	295,740.00	0.03
86	002921	联诚精密	10,800	295,272.00	0.03
87	605567	春雪食品	35,300	282,047.00	0.03
88	300997	欢乐家	20,400	276,420.00	0.03
89	002687	乔治白	52,700	276,148.00	0.03
90	300823	建科智能	18,800	274,104.00	0.03
91	605266	健之佳	18,720	274,060.80	0.03
92	603367	辰欣药业	21,300	273,279.00	0.03
93	001366	播恩集团	25,200	273,168.00	0.03
94	603070	万控智造	21,700	272,986.00	0.03
95	001209	洪兴股份	17,000	272,340.00	0.03
96	605001	威奥股份	49,900	271,955.00	0.03
97	002968	新大正	32,100	271,566.00	0.03
98	300625	三雄极光	29,900	271,492.00	0.03
99	603709	中源家居	20,000	270,800.00	0.03
100	301110	青木科技	7,140	270,320.40	0.03
101	603022	新通联	33,800	270,062.00	0.03
102	600493	凤竹纺织	51,500	269,860.00	0.03
103	002014	永新股份	25,400	268,224.00	0.03
104	300583	赛托生物	23,600	265,028.00	0.03

105	688227	品高股份	2,574	264,324.06	0.03
106	000088	盐田港	64,100	262,169.00	0.03
107	600073	光明肉业	55,500	258,630.00	0.03
108	003008	开普检测	15,100	257,757.00	0.03
109	600874	创业环保	48,000	257,280.00	0.03
110	603689	皖天然气	37,000	256,410.00	0.03
111	600195	中牧股份	43,400	256,060.00	0.03
112	600573	惠泉啤酒	28,000	249,200.00	0.03
113	603200	上海洗霸	5,700	247,152.00	0.02
114	002275	桂林三金	16,900	206,011.00	0.02
115	300675	建科院	16,500	195,525.00	0.02
116	001314	亿道信息	3,100	191,580.00	0.02
117	600851	海欣股份	21,000	189,210.00	0.02
118	603488	展鹏科技	18,100	186,068.00	0.02
119	300713	英可瑞	14,600	186,004.00	0.02
120	300126	锐奇股份	32,000	184,960.00	0.02
121	688175	高凌信息	7,350	184,852.50	0.02
122	603278	大业股份	16,900	183,703.00	0.02
123	002660	茂硕电源	28,200	183,300.00	0.02
124	301166	优宁维	7,100	183,109.00	0.02
125	603017	中衡设计	18,300	182,085.00	0.02
126	601789	宁波建工	45,400	182,054.00	0.02
127	300030	阳普医疗	31,300	181,853.00	0.02
128	002103	广博股份	30,900	181,383.00	0.02
128	605151	西上海	10,300	181,383.00	0.02
129	603900	莱绅通灵	32,200	181,286.00	0.02
130	002862	实丰文化	14,100	180,903.00	0.02
131	001373	翔腾新材	6,000	180,900.00	0.02
132	301167	建研设计	14,600	180,894.00	0.02
133	301010	晶雪节能	11,100	180,819.00	0.02
134	301006	迈拓股份	14,400	180,720.00	0.02
135	301100	风光股份	13,000	180,700.00	0.02
136	002767	先锋电子	10,900	180,613.00	0.02
137	301223	中荣股份	11,200	180,544.00	0.02
138	002712	思美传媒	43,500	180,525.00	0.02
139	600561	江西长运	36,400	180,180.00	0.02
140	603768	常青股份	19,700	179,861.00	0.02
141	300596	利安隆	3,400	178,432.00	0.02
142	600749	西藏旅游	13,000	178,100.00	0.02
143	600310	广西能源	41,900	176,818.00	0.02
144	301558	三态股份	28,500	175,845.00	0.02
145	601065	江盐集团	26,100	175,131.00	0.02
146	603609	禾丰股份	30,300	174,528.00	0.02

147	600992	贵绳股份	20,100	173,262.00	0.02
148	688331	荣昌生物	1,328	172,985.28	0.02
149	003011	海象新材	9,500	172,615.00	0.02
150	002381	双箭股份	33,300	172,494.00	0.02
151	000589	贵州轮胎	42,400	172,144.00	0.02
152	600697	欧亚集团	17,700	172,044.00	0.02
153	600051	宁波联合	30,400	171,152.00	0.02
154	001213	中铁特货	51,000	170,850.00	0.02
155	301239	普瑞眼科	5,600	170,520.00	0.02
156	002234	民和股份	26,500	169,865.00	0.02
157	000090	天健集团	55,900	168,259.00	0.02
158	002327	富安娜	28,300	168,102.00	0.02
159	000597	东北制药	39,600	167,904.00	0.02
160	603167	渤海轮渡	19,400	166,258.00	0.02
161	688820	盛合晶微	1,172	165,826.28	0.02
162	600689	上海三毛	16,900	163,930.00	0.02
163	300658	延江股份	9,100	104,013.00	0.01
164	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
165	301555	惠柏新材	2,100	95,361.00	0.01
166	301448	开创电气	2,100	95,298.00	0.01
167	002301	齐心集团	12,900	93,267.00	0.01
168	300434	金石亚药	8,300	93,209.00	0.01
169	603995	甬金股份	4,000	92,840.00	0.01
170	603600	永艺股份	10,400	92,248.00	0.01
171	301272	英华特	2,800	92,232.00	0.01
172	603661	恒林股份	2,300	92,000.00	0.01
173	603280	南方路机	3,700	91,760.00	0.01
174	301337	亚华电子	3,300	91,740.00	0.01
175	300691	联合光电	5,800	91,698.00	0.01
176	603311	金海高科	2,500	91,625.00	0.01
177	301103	何氏眼科	6,100	91,378.00	0.01
178	002375	亚厦股份	27,000	91,260.00	0.01
178	300822	贝仕达克	7,800	91,260.00	0.01
179	002566	益盛药业	15,100	91,204.00	0.01
180	301198	喜悦智行	6,800	91,120.00	0.01
181	603836	海程邦达	11,520	91,008.00	0.01
182	603073	彩蝶实业	6,100	90,951.00	0.01
183	688718	唯赛勃	5,695	90,949.15	0.01
184	600774	汉商集团	14,500	90,770.00	0.01
185	603630	拉芳家化	7,100	90,738.00	0.01
186	300176	鸿特科技	18,700	90,695.00	0.01
187	002184	海得控制	9,900	90,684.00	0.01
187	300365	恒华科技	19,800	90,684.00	0.01

188	300929	华骐环保	8,600	90,644.00	0.01
189	603819	神力股份	7,900	90,455.00	0.01
190	002909	集泰股份	18,300	90,402.00	0.01
191	603519	立霸股份	5,900	90,270.00	0.01
192	605003	众望布艺	4,400	90,200.00	0.01
193	002247	聚力文化	42,700	90,097.00	0.01
194	301519	舜禹股份	8,300	90,055.00	0.01
195	605007	五洲特纸	6,700	89,713.00	0.01
196	300610	晨化股份	9,200	89,700.00	0.01
197	300645	正元智慧	7,600	89,452.00	0.01
198	300688	创业黑马	3,300	89,430.00	0.01
199	301237	和顺科技	1,200	88,896.00	0.01
200	600793	宜宾纸业	7,300	87,819.00	0.01
201	002333	罗普斯金	18,800	87,608.00	0.01
202	300106	西部牧业	8,900	87,576.00	0.01
203	600586	金晶科技	19,100	87,287.00	0.01
204	002830	名雕股份	5,040	87,141.60	0.01
205	002399	海普瑞	9,700	87,106.00	0.01
206	002671	龙泉股份	23,400	86,814.00	0.01
207	002661	克明食品	12,500	86,625.00	0.01
208	605577	龙版传媒	9,800	86,338.00	0.01
209	003030	祖名股份	4,200	86,310.00	0.01
210	002746	仙坛股份	16,900	86,190.00	0.01
211	603053	成都燃气	10,300	86,108.00	0.01
212	600232	金鹰股份	13,600	85,680.00	0.01
213	600917	重庆燃气	18,800	85,540.00	0.01
214	002982	湘佳股份	8,100	85,455.00	0.01
215	002186	全聚德	10,300	85,284.00	0.01
216	600128	苏豪弘业	11,200	85,008.00	0.01
217	000529	广弘控股	19,900	84,774.00	0.01
218	601368	绿城水务	20,400	83,436.00	0.01
219	603216	梦天家居	3,700	76,109.00	0.01
220	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
221	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
222	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
223	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
224	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
225	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
226	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
227	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
228	601112	振石股份	558	9,815.22	0.00
229	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
230	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00

231	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
232	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
233	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
234	920189	康美特	200	1,628.00	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	001309	德明利	59,141,575.00	11.33
2	601869	长飞光纤	40,040,607.00	7.67
3	300548	长芯博创	39,337,223.52	7.53
4	603083	剑桥科技	33,871,570.18	6.49
5	688167	炬光科技	32,131,853.01	6.15
6	301396	宏景科技	28,520,454.85	5.46
7	300475	香农芯创	28,327,321.60	5.43
8	688498	源杰科技	27,580,457.05	5.28
9	300398	飞凯材料	26,584,637.00	5.09
10	300438	鹏辉能源	26,319,383.39	5.04
11	300620	光库科技	25,673,493.60	4.92
12	301205	联特科技	25,425,206.00	4.87
13	002245	蔚蓝锂芯	24,701,443.88	4.73
14	601126	四方股份	23,034,198.00	4.41
15	300870	欧陆通	22,301,187.20	4.27
16	301550	斯菱智驱	22,004,844.90	4.21
17	688331	荣昌生物	21,783,579.32	4.17
18	688536	思瑞浦	21,050,093.45	4.03
19	688388	嘉元科技	20,865,755.38	4.00
20	600961	株冶集团	20,406,392.00	3.91
21	301511	德福科技	20,090,995.00	3.85
22	688390	固德威	19,823,380.90	3.80
23	301018	申菱环境	19,690,196.17	3.77
24	688270	ST 臻镭	19,255,013.26	3.69
25	300769	德方纳米	19,233,991.80	3.68
26	300624	万兴科技	18,529,942.08	3.55
27	688516	奥特维	18,241,965.54	3.49
28	603063	禾望电气	17,478,018.00	3.35
29	601975	招商南油	17,383,510.00	3.33
30	002716	湖南白银	16,886,128.00	3.23
31	600331	宏达股份	16,678,567.00	3.19
32	002008	大族激光	16,661,422.00	3.19
33	000422	湖北宜化	16,231,019.00	3.11
34	688127	蓝特光学	16,131,841.88	3.09

35	002460	赣锋锂业	16,123,435.92	3.09
36	600151	航天机电	16,068,296.24	3.08
37	300953	震裕科技	15,990,282.83	3.06
38	300751	迈为股份	15,863,686.00	3.04
39	300102	乾照光电	15,334,562.00	2.94
40	300456	赛微电子	15,084,636.29	2.89
41	688800	瑞可达	14,723,602.99	2.82
42	300170	汉得信息	14,625,596.00	2.80
43	002151	北斗星通	14,588,952.00	2.79
44	688525	佰维存储	14,095,547.87	2.70
45	301526	国际复材	13,830,002.00	2.65
46	603026	石大胜华	13,746,591.00	2.63
47	002222	福晶科技	13,640,493.90	2.61
48	688195	腾景科技	13,593,203.11	2.60
49	300088	长信科技	13,583,843.00	2.60
50	000603	盛达资源	13,563,021.00	2.60
51	301171	易点天下	13,493,046.04	2.58
52	002929	润建股份	13,266,087.15	2.54
53	603698	航天工程	13,132,311.91	2.52
54	301217	铜冠铜箔	13,023,311.00	2.49
55	688025	杰普特	12,971,022.00	2.48
56	600888	新疆众和	12,853,565.00	2.46
57	300567	精测电子	12,640,890.00	2.42
58	688300	联瑞新材	12,352,761.03	2.37
59	688503	聚和材料	12,087,340.93	2.32
60	000725	京东方 A	11,908,427.00	2.28
61	601137	博威合金	11,863,063.00	2.27
62	603305	旭升集团	11,762,902.00	2.25
63	688409	富创精密	11,598,779.22	2.22
64	600259	中稀有色	11,539,046.00	2.21
65	002497	雅化集团	11,130,361.00	2.13
66	300409	道氏技术	11,048,075.00	2.12
67	688502	茂莱光学	10,995,442.33	2.11
68	688003	天准科技	10,975,807.94	2.10
69	603256	宏和科技	10,769,755.00	2.06
70	688531	日联科技	10,737,187.81	2.06
71	300502	新易盛	10,601,587.20	2.03

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	001309	德明利	70,093,614.00	13.43

2	601869	长飞光纤	50,935,435.96	9.76
3	688498	源杰科技	44,474,646.60	8.52
4	300475	香农芯创	42,605,622.30	8.16
5	300548	长芯博创	42,180,531.00	8.08
6	300620	光库科技	39,423,016.44	7.55
7	603083	剑桥科技	34,058,172.91	6.52
8	688167	炬光科技	30,952,035.10	5.93
9	300438	鹏辉能源	25,380,746.35	4.86
10	301526	国际复材	24,412,985.00	4.68
11	688331	荣昌生物	22,040,275.49	4.22
12	301205	联特科技	21,620,919.87	4.14
13	603256	宏和科技	21,530,757.00	4.12
14	002245	蔚蓝锂芯	21,516,755.08	4.12
15	301308	江波龙	21,479,469.00	4.11
16	301511	德福科技	20,022,734.53	3.84
17	301550	斯菱智驱	19,161,439.12	3.67
18	002008	大族激光	18,277,480.00	3.50
19	688270	ST 臻镭	18,160,430.62	3.48
20	301217	铜冠铜箔	17,639,970.60	3.38
21	300088	长信科技	17,486,796.00	3.35
22	601126	四方股份	17,378,733.00	3.33
23	002460	赣锋锂业	16,648,764.16	3.19
24	601975	招商南油	16,601,744.00	3.18
25	000422	湖北宜化	16,051,966.00	3.07
26	300398	飞凯材料	15,869,611.44	3.04
27	688525	佰维存储	15,824,186.67	3.03
28	002222	福晶科技	15,806,875.92	3.03
29	300751	迈为股份	15,714,989.62	3.01
30	688503	聚和材料	15,528,388.39	2.97
31	300170	汉得信息	15,163,854.00	2.90
32	688536	思瑞浦	14,835,994.03	2.84
33	301396	宏景科技	14,807,123.58	2.84
34	300456	赛微电子	14,529,580.54	2.78
35	300567	精测电子	14,411,858.04	2.76
36	300624	万兴科技	14,406,967.00	2.76
37	002151	北斗星通	14,290,127.18	2.74
38	688300	联瑞新材	13,876,208.37	2.66
39	688516	奥特维	13,011,237.95	2.49
40	301171	易点天下	12,687,520.00	2.43
41	000603	盛达资源	12,564,489.00	2.41
42	600331	宏达股份	12,356,077.00	2.37
43	688390	固德威	12,299,497.45	2.36
44	000725	京东方 A	12,060,306.00	2.31

45	300502	新易盛	11,431,942.00	2.19
46	300953	震裕科技	11,161,086.60	2.14
47	300102	乾照光电	10,641,944.00	2.04
48	688502	茂莱光学	10,641,923.28	2.04
49	600986	浙文互联	10,473,454.00	2.01
50	300257	开山股份	10,449,142.00	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	2,957,962,189.19
卖出股票收入（成交）总额	2,695,608,809.26

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

无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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	11,013,080.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,013,080.57

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
国金中证 1000 指数 增强 A	12,814	15,656.49	26,187,678.01	13.05	174,434,613.33	86.95
国金中证 1000 指数 增强 C	10,831	37,526.71	141,171,775.25	34.73	265,280,030.84	65.27
合计	23,645	25,674.52	167,359,453.26	27.57	439,714,644.17	72.43

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	国金中证 1000 指数增强 A	139,573.38	0.0696
	国金中证 1000 指数增强 C	59,504.78	0.0146
	合计	199,078.16	0.0328

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 1000 指数增强 A	0
	国金中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	国金中证 1000 指数增强 A	0
	国金中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 （2023 年 3 月 22 日）基金份额总额	627,872,206.43	311,414,546.88
本报告期期初基金 份额总额	137,783,091.72	263,439,066.85

本报告期基金总申购份额	205,548,445.06	507,532,424.58
减：本报告期基金总赎回份额	142,709,245.44	364,519,685.34
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	200,622,291.34	406,451,806.09

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 (%)	
国金证券	3	5,652,490,070.06	100.00	1,075,197.76	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
的需要；
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。

（三）变更情况

本基金本报告期新增国金证券 1 个交易单元。

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 (%)
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金中证 1000 指数增强型证券投	指定披露媒体和本基金	2026 年 1 月 15 日

	资基金招募说明书(更新)》	基金管理人网站	
2	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
3	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
4	《国金中证 1000 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 1000 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 1000 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 1000 指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日