

# 国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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。

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>52</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
8.3 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 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
8.6 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 .....	74
8.7 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 .....	74
8.8 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 .....	74
8.9 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 .....	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>75</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3 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 .....	76
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>76</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
11.2 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 .....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77
11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	77
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	77
11.8 其他重大事件 .....	78
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>80</b>
12.1 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 .....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	80
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>80</b>
13.1 备查文件目录 .....	80
13.2 存放地点 .....	80
13.3 查阅方式 .....	80

## § 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	401, 222, 158. 57 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	137, 783, 091. 72 份	263, 439, 066. 85 份

### 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	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		邰海波	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2025 年		2024 年		2023 年 3 月 22 日(基金合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日	
	国金中证 1000 指数增 强 A	国金中证 1000 指数增 强 C	国金中证 1000 指数增 强 A	国金中证 1000 指数增 强 C	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	62,054,732 .37	66,918,908 .29	-48,664,76 8.53	-36,570,71 4.88	-44,336,43 6.92	-51,540,39 5.49
本期利润	71,081,794 .45	70,593,719 .91	-28,511,74 9.32	-42,485,14 1.96	-54,926,26 7.13	-65,222,96 8.02
加权平均基 金份额本期	0.3859	0.3796	-0.0783	-0.1997	-0.0887	-0.1328

利润						
本期加权平均净值利润率	35.52%	33.31%	-9.74%	-24.90%	-9.20%	-13.91%
本期基金份额净值增长率	43.54%	42.98%	-0.12%	-0.53%	-8.58%	-8.86%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	31,629,649.54	56,820,417.46	-34,452,876.13	-18,095,297.86	-43,234,447.87	-41,501,861.04
期末可供分配基金份额利润	0.2296	0.2157	-0.1263	-0.1326	-0.0858	-0.0886
期末基金资产净值	180,595,653.31	341,497,842.94	248,999,233.33	123,701,729.60	460,738,286.89	426,819,267.61
期末基金份额净值	1.3107	1.2963	0.9131	0.9066	0.9142	0.9114
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	31.07%	29.63%	-8.69%	-9.34%	-8.58%	-8.86%

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	0.76%	1.09%	0.28%	1.07%	0.48%	0.02%

过去六个月	20.36%	1.04%	18.49%	1.06%	1.87%	-0.02%
过去一年	43.54%	1.24%	26.12%	1.32%	17.42%	-0.08%
自基金合同生效起至今	31.07%	1.51%	11.45%	1.52%	19.62%	-0.01%

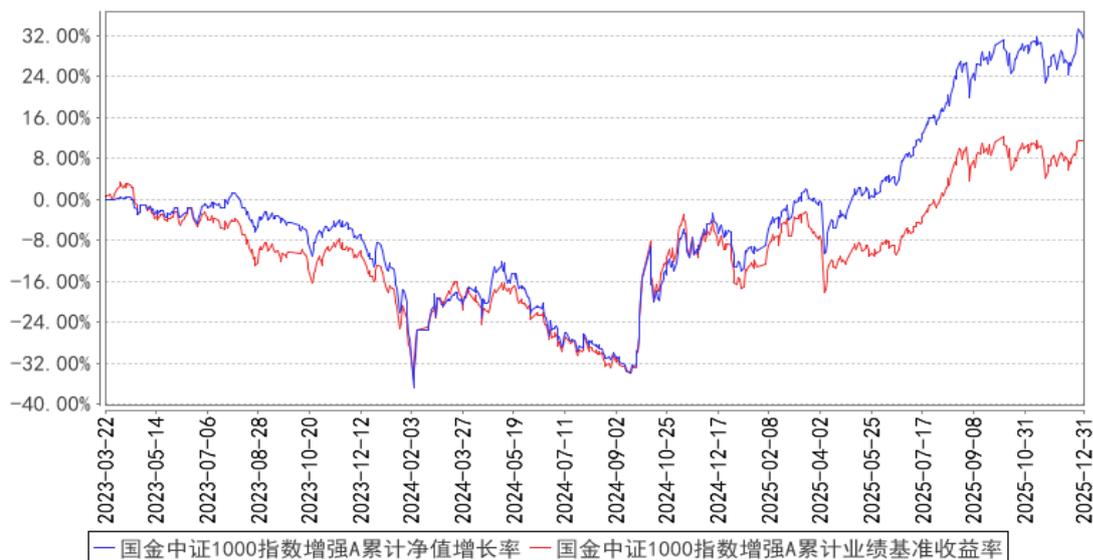
国金中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.66%	1.09%	0.28%	1.07%	0.38%	0.02%
过去六个月	20.12%	1.04%	18.49%	1.06%	1.63%	-0.02%
过去一年	42.98%	1.24%	26.12%	1.32%	16.86%	-0.08%
自基金合同生效起至今	29.63%	1.51%	11.45%	1.52%	18.18%	-0.01%

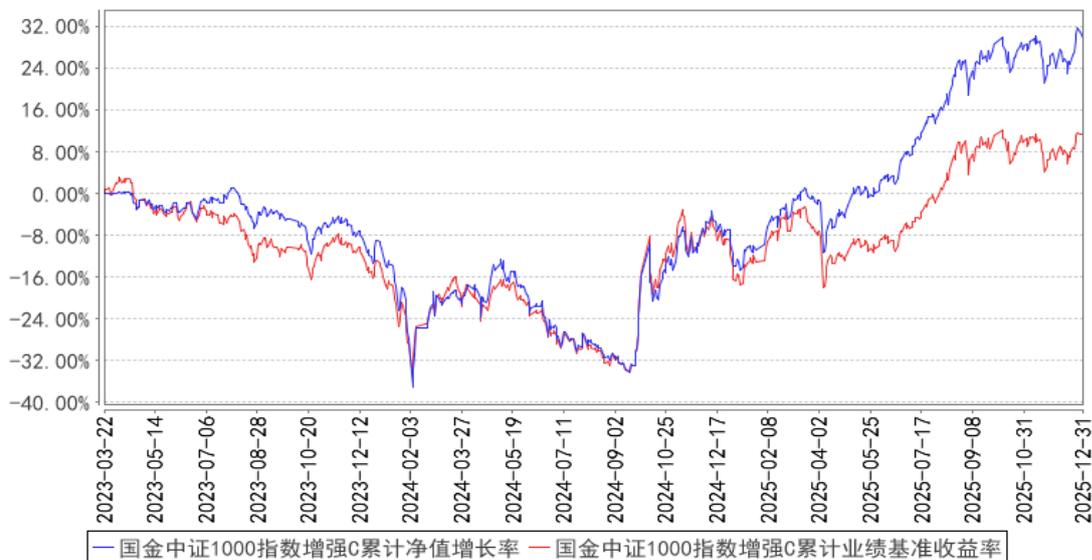
注：本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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

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



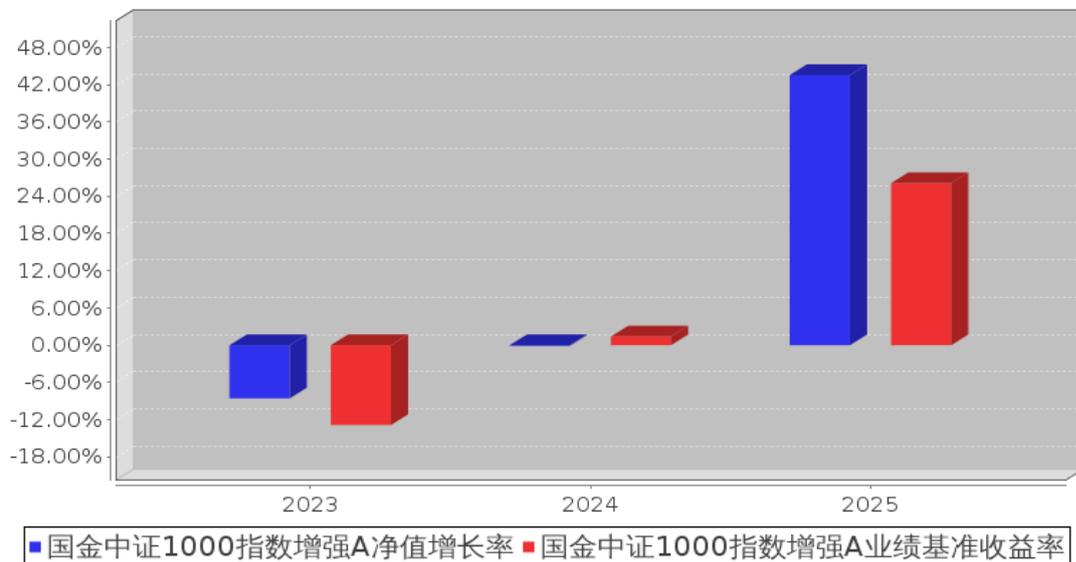
国金中证 1000 指数增强 C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



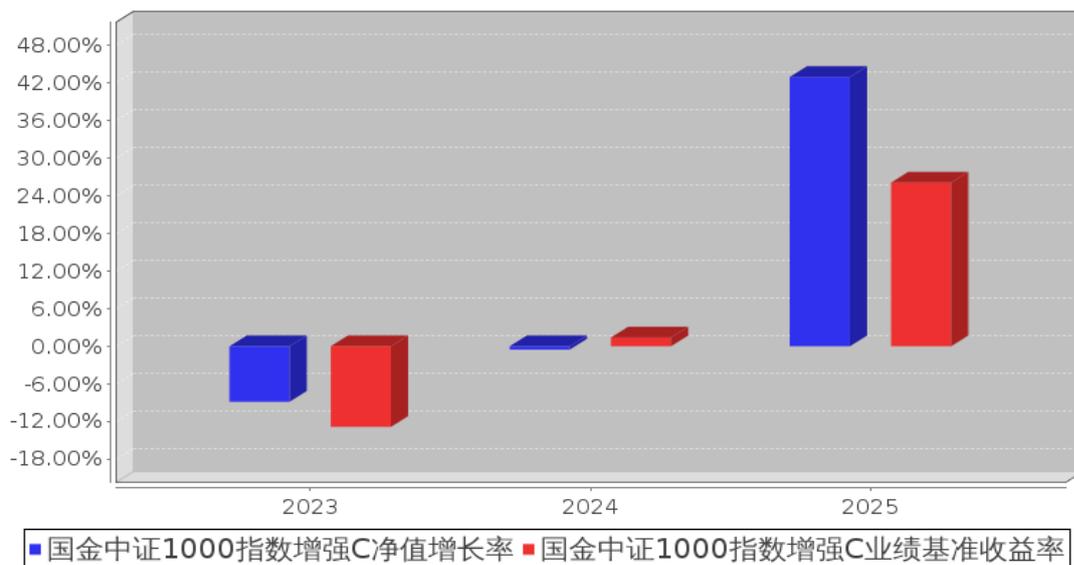
注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 3 月 22 日，图示日期为 2023 年 3 月 22 日至 2025 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国金中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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 2025 年 12 月 31 日，国金基金管理有限公司共管理 33 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、国金金腾通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。

#### 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	-	9 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。
马芳	本基金的基金经理	2023 年 3 月 22 日	2025 年 8 月 27 日	9 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经

					理，现任量化投资中心副总经理。
--	--	--	--	--	-----------------

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通

过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2025 年的市场环境呈现以下特征：市场风格方面，主要市场风格因子的波动幅度较 2024 年同期有所收窄，但较高波动行情的出现频率与 2024 年相当，贝塔值、动量和市值等风格因子在 2025 年内波动较大；市场活跃度方面，2025 年下半年整体高于上半年，市场活跃度的峰值水平与 2024 年四季度相当；行业表现方面，大部分中信一级行业在报告期内录得正收益，其中涨幅居前

的行业为有色金属、通信、电子，而食品饮料、煤炭则出现下跌，行业最大跌幅超过 6%。

报告期内，本基金超额收益的波动率低于历史均值，较为严格的风险约束一定程度上提升了超额收益的稳定性。随着机构投资者占比持续提升、投资方法论不断演进，各类飞速发展的计算机技术和人工智能模型为资产管理提供更为高效的工具，市场有效性的提升是大势所趋。在这一过程中，风险模型的成熟度要求相应提高，这也是国金量化模型持续迭代优化的重要方向之一。

本基金作为指数增强产品，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。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略高于预期。

#### 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 1.3107 元，累计单位净值为 1.3107 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 43.54%，同期业绩比较基准增长率为 26.12%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.2963 元，累计单位净值为 1.2963 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 42.98%，同期业绩比较基准增长率为 26.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，A 股市场出现巨幅波动的概率或将降低，但风格切换与行业轮动速度较快的特征可能仍将延续。在此背景下，指数增强产品需延续合理控制跟踪误差的运作思路，保持较为严格的风险控制，并持续优化风险模型，增强对市场风险的刻画能力，力争提升超额收益的稳健性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层以及董事会。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况及时制定相关管理制度，细化管理流程，并持续更新和完善，本基金管理人制定的规章制度涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、

通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，不断提高业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

#### 4.10 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合规守信情况声明

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2026)审字第 70015670_A05 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的

	<p>要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>国金中证 1000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相</p>

	<p>关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国金中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺耀	王蕊
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2026 年 03 月 31 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	50,371,185.59	38,468,510.67
结算备付金		342.17	338.52
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	480,007,036.78	335,398,926.17
其中：股票投资		480,007,036.78	335,398,926.17
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,229,244.01	542,736.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		531,607,808.55	374,410,511.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,675,430.07	1,099,961.78
应付管理人报酬		462,411.80	329,871.82
应付托管费		92,482.34	65,974.36
应付销售服务费		118,164.56	43,717.39
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	7.4.7.9	165,823.53	170,023.29
负债合计		9,514,312.30	1,709,548.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	401,222,158.57	409,133,850.89
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	120,871,337.68	-36,432,887.96
净资产合计		522,093,496.25	372,700,962.93
负债和净资产总计		531,607,808.55	374,410,511.57

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，国金中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.3107 元，基金份额总额 137,783,091.72 份；国金中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.2963 元，基金份额总额 263,439,066.85 份。国金中证 1000 指数增强份额总额合计为 401,222,158.57 份。

## 7.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		147,619,832.51	-64,565,441.38
1. 利息收入		90,011.28	102,444.57
其中：存款利息收入	7.4.7.13	67,918.82	94,859.38
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		22,092.46	7,585.19
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		133,684,230.33	-79,393,526.62
其中：股票投资收益	7.4.7.14	130,881,203.79	-84,750,381.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,803,026.54	5,356,854.91
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）	7.4.7.20	12,701,873.70	14,238,592.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,143,717.20	487,048.54
<b>减：二、营业总支出</b>		5,944,318.15	6,431,449.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,112,206.98	4,641,688.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	822,441.34	928,337.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	841,489.35	682,116.07
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	168,180.48	179,307.97

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		141,675,514.36	-70,996,891.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		141,675,514.36	-70,996,891.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		141,675,514.36	-70,996,891.28

### 7.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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）	-7,911,692.32	-	157,304,225.64	149,392,533.32
（一）、综合收益总额	-	-	141,675,514.36	141,675,514.36
（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）	-7,911,692.32	-	15,628,711.28	7,717,018.96
其中：1. 基金申购款	679,672,535.72	-	112,763,700.27	792,436,235.99
2. 基金赎回款	-687,584,228.04	-	-97,134,988.99	-784,719,217.03
（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	401,222,158.57	-	120,871,337.68	522,093,496.25
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	972,293,863.41	-	-84,736,308.91	887,557,554.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	972,293,863.41	-	-84,736,308.91	887,557,554.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-563,160,012.5 2	-	48,303,420.95	-514,856,591.57
（一）、综合收益总额	-	-	-70,996,891.28	-70,996,891.28
（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）	-563,160,012.5 2	-	119,300,312.23	-443,859,700.29
其中：1. 基金申购款	158,851,099.86	-	-27,383,799.78	131,467,300.08
2. 基金赎回款	-722,011,112.3 8	-	146,684,112.01	-575,327,000.37
（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	409,133,850.89	-	-36,432,887.96	372,700,962.93
-----------	----------------	---	----------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 7.4.2 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》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《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。

#### 7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金

融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估

值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 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征增值税试点的通知》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；

根据财政部 国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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。

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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	15,763,809.45	12,180,971.89
等于：本金	15,762,470.51	12,179,552.21
加：应计利息	1,338.94	1,419.68
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	34,607,376.14	26,287,538.78
等于：本金	34,606,762.20	26,286,860.34

加：应计利息	613.94	678.44
减：坏账准备	-	-
合计	50,371,185.59	38,468,510.67

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。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	477,338,973.69	-	480,007,036.78	2,668,063.09
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	477,338,973.69	-	480,007,036.78	2,668,063.09
项目	上年度末 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	345,432,736.78	-	335,398,926.17	-10,033,810.61
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	345,432,736.78	-	335,398,926.17	-10,033,810.61

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无
---

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

7.4.7.8 其他资产

无

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,823.53	23.29
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	160,000.00	170,000.00
合计	165,823.53	170,023.29

#### 7.4.7.10 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	272,694,430.48	272,694,430.48
本期申购	185,317,470.39	185,317,470.39
本期赎回（以“-”号填列）	-320,228,809.15	-320,228,809.15
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	137,783,091.72	137,783,091.72

国金中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,439,420.41	136,439,420.41
本期申购	494,355,065.33	494,355,065.33
本期赎回（以“-”号填列）	-367,355,418.89	-367,355,418.89
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	263,439,066.85	263,439,066.85

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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无

#### 7.4.7.12 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	-34,452,876.13	10,757,678.98	-23,695,197.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-34,452,876.13	10,757,678.98	-23,695,197.15
本期利润	62,054,732.37	9,027,062.08	71,081,794.45
本期基金份额交易产生的变动数	4,027,793.30	-8,601,829.01	-4,574,035.71
其中：基金申购款	20,276,250.77	14,800,757.47	35,077,008.24
基金赎回款	-16,248,457.47	-23,402,586.48	-39,651,043.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,629,649.54	11,182,912.05	42,812,561.59

## 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	-18,095,297.86	5,357,607.05	-12,737,690.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-18,095,297.86	5,357,607.05	-12,737,690.81
本期利润	66,918,908.29	3,674,811.62	70,593,719.91
本期基金份额交易产生的变动数	7,996,807.03	12,205,939.96	20,202,746.99
其中：基金申购款	37,742,555.36	39,944,136.67	77,686,692.03
基金赎回款	-29,745,748.33	-27,738,196.71	-57,483,945.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,820,417.46	21,238,358.63	78,058,776.09

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	42,105.09	26,795.74
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	21,023.33	68,059.98
结算备付金利息收入	3.65	3.66
其他	4,786.75	-
合计	67,918.82	94,859.38

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	130,881,203.79	-84,750,381.53

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	130,881,203.79	-84,750,381.53

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
卖出股票成交总 额	4,080,814,574.85	5,590,198,293.57
减：卖出股票成本 总额	3,945,820,245.80	5,666,831,336.33
减：交易费用	4,113,125.26	8,117,338.77
买卖股票差价收 入	130,881,203.79	-84,750,381.53

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,803,026.54	5,356,854.91
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	2,803,026.54	5,356,854.91

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

1. 交易性金融资产	12,701,873.70	14,238,592.13
股票投资	12,701,873.70	14,238,592.13
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	12,701,873.70	14,238,592.13

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	1,134,807.70	484,252.92
基金转换费收入	8,909.50	2,795.62
合计	1,143,717.20	487,048.54

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	7,780.48	9,307.97
其他	400.00	-
合计	168,180.48	179,307.97

#### 7.4.7.24 分部报告

无

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

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
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
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
招商银行股份有限公司	基金托管人

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	8,158,042,329.41	100.00	10,757,190,192.56	100.00

##### 7.4.10.1.2 债券交易

无

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	393,625,000.00	100.00	-	-

#### 7.4.10.1.4 权证交易

无

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31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	1,549,603.76	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	4,632,250.32	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,112,206.98	4,641,688.25
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,510,142.10	1,769,943.68
应支付基金管理人的净管理费	2,602,064.88	2,871,744.57

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	822,441.34	928,337.61

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。

#### 7.4.10.2.3 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		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	-	141,111.34	141,111.34
国金证券股份有限公司	-	281,649.83	281,649.83
合计	-	422,761.17	422,761.17

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	-	61,700.47	61,700.47
国金证券股份有限公司	-	436,275.19	436,275.19
合计	-	497,975.66	497,975.66

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

##### 7.4.10.4.2 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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

##### 7.4.10.5.2 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

## 7.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	15,763,809.45	42,105.09	12,180,971.89	26,795.74
国金证券股份有限公司-其他存款	34,607,376.14	21,023.33	26,287,538.78	68,059.98

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。

## 7.4.10.7 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。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	锁定期股票流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	锁定期股票流通受限	5.69	14.21	2,198	12,506.62	31,233.58	-

301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	锁定期股票流通受限	12.48	25.46	3,633	45,339.84	92,496.18	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	锁定期股票流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	锁定期股票流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	锁定期股票流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	锁定期股票流通受限	18.60	46.35	45	837.00	2,085.75	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	6个月	锁定期股票流通受限	8.62	18.36	1,084	9,344.08	19,902.24	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月	锁定期股票流通受限	114.28	416.18	66	7,542.48	27,467.88	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600058	五矿发展	2025年12月30日	重大事项停牌	11.52	2026年1月15日	12.67	103,400	918,248.22	1,191,168.00	-

		日			日					
--	--	---	--	--	---	--	--	--	--	--

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 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列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 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列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 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列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.5 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列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 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列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 7.4.13.3.2 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

《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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 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
上年度末 2024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	38,468,510.67	-	-	-	-	-	38,468,510.67
结算备付金	338.52	-	-	-	-	-	338.52
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-335,398,926.17	335,398,926.17
应收申购款	-	-	-	-	-	542,736.21	542,736.21
资产总计	38,468,849.19	-	-	-	-	-335,941,662.38	374,410,511.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,099,961.78	1,099,961.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	329,871.82	329,871.82
应付托管费	-	-	-	-	-	65,974.36	65,974.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	43,717.39	43,717.39
其他负债	-	-	-	-	-	170,023.29	170,023.29
负债总计	-	-	-	-	-	1,709,548.64	1,709,548.64
利率敏感度缺口	38,468,849.19	-	-	-	-	-334,232,113.74	372,700,962.93

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	480,007,036.78	91.94	335,398,926.17	89.99
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	480,007,036.78	91.94	335,398,926.17	89.99

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。

#### 7.4.13.4.3.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	+5%	22,623,767.34	17,550,759.80
	-5%	-22,623,767.34	-17,550,759.80

#### 7.4.13.4.4 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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	478,610,124.42	335,398,926.17
第二层次	1,191,168.00	-
第三层次	205,744.36	-
合计	480,007,036.78	335,398,926.17

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	89,551.47	89,551.47
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	116,192.89	116,192.89
其中：计入损益的利得或损失	-	116,192.89	116,192.89
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	205,744.36	205,744.36
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	116,192.89	116,192.89
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	6,082.14	6,082.14
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,082.14	6,082.14
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估值	不可观察输入值
----	-------	-------	---------

	价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	205,744.36	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2086-3.0323	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2026 年 3 月 31 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	480,007,036.78	90.29
	其中：股票	480,007,036.78	90.29
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	50,371,527.76	9.48
8	其他各项资产	1,229,244.01	0.23
9	合计	531,607,808.55	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	757,980.60	0.15
B	采矿业	9,112,667.00	1.75
C	制造业	272,170,269.42	52.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,410,721.00	2.76
E	建筑业	14,700,346.96	2.82
F	批发和零售业	18,073,738.00	3.46
G	交通运输、仓储和邮政业	7,470,845.00	1.43
H	住宿和餐饮业	507,525.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,390,886.70	5.63
J	金融业	9,396,135.00	1.80
K	房地产业	321,447.00	0.06
L	租赁和商务服务业	4,387,231.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	5,392,465.34	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,972,194.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,475,635.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,487,280.00	0.28
S	综合	-	-
	合计	391,027,367.02	74.90

### 8.2.2 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	266,622.00	0.05
B	采矿业	51,345.00	0.01
C	制造业	66,957,605.50	12.82

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,445,199.00	1.04
E	建筑业	147,364.00	0.03
F	批发和零售业	2,573,923.40	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	2,665,988.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,067,688.52	1.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	416,306.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,159,366.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	56,361.76	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	890,773.58	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	141,427.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,139,700.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	88,979,669.76	17.04

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	300475	香农芯创	74,700	10,782,198.00	2.07
2	300620	光库科技	71,500	10,514,075.00	2.01
3	001309	德明利	41,500	9,623,435.00	1.84
4	300438	鹏辉能源	173,400	9,228,348.00	1.77
5	688498	源杰科技	11,412	7,326,389.88	1.40
6	002326	永太科技	206,800	5,153,456.00	0.99
7	002497	雅化集团	178,700	4,422,825.00	0.85
8	002151	北斗星通	86,000	3,906,980.00	0.75
9	002163	海南发展	153,719	3,664,660.96	0.70

10	300655	晶瑞电材	204,600	3,300,198.00	0.63
11	300602	飞荣达	99,000	3,282,840.00	0.63
12	002518	科士达	66,900	3,245,988.00	0.62
13	000555	神州信息	189,800	3,141,190.00	0.60
14	688123	聚辰股份	24,950	3,133,221.00	0.60
15	688063	派能科技	54,987	3,124,361.34	0.60
16	600986	浙文互联	396,200	3,098,284.00	0.59
17	601375	中原证券	719,300	3,092,990.00	0.59
18	300850	新强联	74,300	3,073,791.00	0.59
19	002192	融捷股份	58,400	3,022,200.00	0.58
20	688390	固德威	48,132	2,990,441.16	0.57
21	301526	国际复材	423,200	2,962,400.00	0.57
22	601678	滨化股份	693,900	2,942,136.00	0.56
23	600572	康恩贝	656,200	2,926,652.00	0.56
24	000600	建投能源	338,500	2,887,405.00	0.55
25	300827	上能电气	84,300	2,884,746.00	0.55
26	000059	华锦股份	532,500	2,848,875.00	0.55
27	603915	国茂股份	152,400	2,805,684.00	0.54
28	600252	中恒集团	1,012,500	2,774,250.00	0.53
29	002396	星网锐捷	91,400	2,769,420.00	0.53
30	600461	洪城环境	297,100	2,754,117.00	0.53
31	688403	汇成股份	166,461	2,726,631.18	0.52
32	603127	昭衍新药	75,100	2,629,251.00	0.50
33	000928	中钢国际	397,700	2,628,797.00	0.50
34	300428	立中集团	111,000	2,591,850.00	0.50
35	601519	大智慧	200,800	2,584,296.00	0.49
36	300618	寒锐钴业	55,405	2,504,860.05	0.48
37	688766	普冉股份	19,677	2,503,111.17	0.48
38	688503	聚和材料	41,020	2,502,220.00	0.48
39	000899	赣能股份	252,500	2,499,750.00	0.48
40	002541	鸿路钢构	147,300	2,421,612.00	0.46
41	002487	大金重工	46,100	2,393,973.00	0.46
42	300861	美畅股份	160,000	2,388,800.00	0.46
43	301071	力量钻石	65,400	2,343,936.00	0.45
44	001287	中电港	102,900	2,331,714.00	0.45
45	002182	宝武镁业	151,100	2,311,830.00	0.44
46	002324	普利特	143,800	2,299,362.00	0.44
47	600273	嘉化能源	261,100	2,282,014.00	0.44
48	688400	凌云光	53,667	2,274,407.46	0.44
49	300693	盛弘股份	59,400	2,273,832.00	0.44
50	603323	苏农银行	448,000	2,262,400.00	0.43
51	301018	申菱环境	35,600	2,261,312.00	0.43
52	601869	长飞光纤	19,200	2,234,112.00	0.43

53	000030	富奥股份	385,700	2,213,918.00	0.42
54	300085	银之杰	55,111	2,209,399.99	0.42
55	603876	鼎胜新材	146,900	2,204,969.00	0.42
56	002815	崇达技术	161,300	2,203,358.00	0.42
57	000597	东北制药	421,300	2,199,186.00	0.42
58	603305	旭升集团	135,000	2,184,300.00	0.42
59	601069	西部黄金	81,000	2,161,080.00	0.41
60	300593	新雷能	72,500	2,157,600.00	0.41
61	603612	索通发展	91,400	2,147,900.00	0.41
62	001337	四川黄金	76,700	2,136,862.00	0.41
63	605020	永和股份	79,000	2,124,310.00	0.41
64	301316	慧博云通	46,300	2,068,684.00	0.40
65	688372	伟测科技	18,854	2,056,782.86	0.39
66	600478	科力远	296,600	2,043,574.00	0.39
67	002060	广东建工	564,200	2,031,120.00	0.39
68	002913	奥士康	47,400	2,025,876.00	0.39
69	603009	北特科技	41,900	2,017,904.00	0.39
70	002626	金达威	101,600	2,002,536.00	0.38
71	688141	杰华特	46,016	1,998,474.88	0.38
72	000589	贵州轮胎	383,100	1,984,458.00	0.38
73	002649	博彦科技	147,600	1,946,844.00	0.37
74	600787	中储股份	342,600	1,925,412.00	0.37
75	301095	广立微	26,800	1,921,828.00	0.37
76	300088	长信科技	310,500	1,881,630.00	0.36
77	002174	游族网络	151,500	1,854,360.00	0.36
78	002434	万里扬	194,300	1,851,679.00	0.35
79	000628	高新发展	40,700	1,814,813.00	0.35
80	688700	东威科技	50,682	1,788,060.96	0.34
81	600750	华润江中	76,000	1,760,920.00	0.34
82	002947	恒铭达	32,900	1,711,458.00	0.33
83	002897	意华股份	31,300	1,692,391.00	0.32
84	002941	新疆交建	106,200	1,683,270.00	0.32
85	002761	浙江建投	194,800	1,669,436.00	0.32
86	000927	中国铁物	638,500	1,666,485.00	0.32
87	002643	万润股份	111,000	1,663,890.00	0.32
88	002985	北摩高科	52,300	1,659,479.00	0.32
89	301565	中仑新材	67,900	1,639,106.00	0.31
90	002079	苏州固锟	170,700	1,630,185.00	0.31
91	300953	震裕科技	9,700	1,629,794.00	0.31
92	300568	星源材质	105,600	1,610,400.00	0.31
93	002531	天顺风能	230,300	1,579,858.00	0.30
94	002755	奥赛康	96,200	1,570,946.00	0.30
95	688209	英集芯	76,626	1,527,922.44	0.29

96	000811	冰轮环境	81,100	1,501,972.00	0.29
97	002635	安洁科技	107,100	1,484,406.00	0.28
98	688006	杭可科技	50,489	1,478,822.81	0.28
99	300244	迪安诊断	93,100	1,475,635.00	0.28
100	600389	江山股份	57,700	1,458,656.00	0.28
101	300026	红日药业	403,900	1,421,728.00	0.27
102	000672	上峰水泥	108,800	1,413,312.00	0.27
103	688206	概伦电子	38,945	1,356,454.35	0.26
104	600757	长江传媒	149,500	1,327,560.00	0.25
105	300363	博腾股份	56,300	1,308,412.00	0.25
106	688326	经纬恒润	11,114	1,305,895.00	0.25
107	603713	密尔克卫	23,400	1,305,018.00	0.25
108	300035	中科电气	60,500	1,288,045.00	0.25
109	601096	宏盛华源	303,900	1,261,185.00	0.24
110	688639	华恒生物	38,592	1,257,327.36	0.24
111	600399	抚顺特钢	211,000	1,232,240.00	0.24
112	002275	桂林三金	87,200	1,229,520.00	0.24
113	002338	奥普光电	20,600	1,202,834.00	0.23
114	603530	神马电力	29,100	1,195,428.00	0.23
115	000089	深圳机场	171,000	1,195,290.00	0.23
116	002048	宁波华翔	37,900	1,192,334.00	0.23
117	600058	五矿发展	103,400	1,191,168.00	0.23
118	002488	金固股份	134,900	1,185,771.00	0.23
119	688800	瑞可达	14,119	1,171,877.00	0.22
120	301325	曼恩斯特	23,100	1,167,705.00	0.22
121	688717	艾罗能源	18,635	1,147,916.00	0.22
122	301339	通行宝	78,900	1,147,206.00	0.22
123	300047	天源迪科	88,300	1,108,165.00	0.21
124	603306	华懋科技	17,500	1,102,675.00	0.21
125	000498	山东路桥	180,000	1,085,400.00	0.21
126	300183	东软载波	71,900	1,066,277.00	0.20
127	002100	天康生物	144,500	1,064,965.00	0.20
128	002127	南极电商	315,600	1,063,572.00	0.20
129	300811	铂科新材	14,600	1,041,126.00	0.20
130	000650	仁和药业	183,000	1,033,950.00	0.20
131	600751	海航科技	269,300	1,031,419.00	0.20
132	300036	超图软件	56,400	1,024,224.00	0.20
133	002038	双鹭药业	138,800	1,022,956.00	0.20
134	601089	福元医药	42,600	1,022,400.00	0.20
135	600037	歌华有线	140,000	1,022,000.00	0.20
136	603693	江苏新能	85,800	1,017,588.00	0.19
137	300303	聚飞光电	143,400	980,856.00	0.19
138	002099	海翔药业	157,100	980,304.00	0.19

139	600116	三峡水利	148,900	973,806.00	0.19
140	300548	长芯博创	6,800	965,600.00	0.18
141	000058	深赛格	99,400	934,360.00	0.18
142	601636	旗滨集团	150,600	893,058.00	0.17
143	003012	东鹏控股	136,300	892,765.00	0.17
144	000761	本钢板材	265,900	890,765.00	0.17
145	600597	光明乳业	109,200	883,428.00	0.17
146	301175	中科环保	148,700	878,817.00	0.17
147	688007	光峰科技	46,579	864,972.03	0.17
148	600916	中国黄金	105,100	856,565.00	0.16
149	002507	涪陵榨菜	66,100	853,351.00	0.16
150	603881	数据港	26,800	815,524.00	0.16
151	002216	三全食品	72,100	814,009.00	0.16
152	300031	宝通科技	34,800	791,004.00	0.15
153	688686	奥普特	6,360	789,466.80	0.15
154	688502	茂莱光学	1,952	778,945.60	0.15
155	000543	皖能电力	95,300	757,635.00	0.15
156	300463	迈克生物	66,800	747,492.00	0.14
157	000012	南玻A	167,800	743,354.00	0.14
158	300702	天宇股份	30,400	717,440.00	0.14
159	600459	贵研铂业	38,500	716,485.00	0.14
160	003039	顺控发展	43,300	689,769.00	0.13
161	600812	华北制药	123,300	681,849.00	0.13
162	002302	西部建设	109,400	669,528.00	0.13
163	601969	海南矿业	56,300	668,844.00	0.13
164	002019	亿帆医药	55,800	667,368.00	0.13
165	300007	汉威科技	12,400	664,640.00	0.13
166	002458	益生股份	78,270	655,902.60	0.13
167	601107	四川成渝	106,100	645,088.00	0.12
168	300294	博雅生物	28,500	644,100.00	0.12
169	688536	思瑞浦	4,012	641,438.56	0.12
170	600120	浙江东方	103,700	639,829.00	0.12
171	002840	华统股份	64,900	624,338.00	0.12
172	603599	广信股份	54,200	622,216.00	0.12
173	600686	金龙汽车	34,200	606,708.00	0.12
174	300723	一品红	17,800	597,190.00	0.11
175	600361	创新新材	138,400	586,816.00	0.11
176	001203	大中矿业	19,000	582,350.00	0.11
177	600872	中炬高新	32,800	575,640.00	0.11
178	300470	中密控股	15,300	575,280.00	0.11
179	000686	东北证券	61,600	574,112.00	0.11
180	600056	中国医药	55,400	572,282.00	0.11
181	600456	宝钛股份	14,400	568,080.00	0.11

182	688131	皓元医药	7,781	560,854.48	0.11
183	688153	唯捷创芯	14,881	560,120.84	0.11
184	601200	上海环境	68,300	549,815.00	0.11
185	000019	深粮控股	77,800	540,710.00	0.10
186	002233	塔牌集团	58,900	530,689.00	0.10
187	002170	芭田股份	43,400	528,612.00	0.10
188	603057	紫燕食品	25,700	522,738.00	0.10
189	603026	石大胜华	6,900	516,189.00	0.10
190	600761	安徽合力	24,600	513,894.00	0.10
191	600258	首旅酒店	30,300	507,525.00	0.10
192	000778	新兴铸管	119,500	499,510.00	0.10
193	600595	中孚实业	62,600	491,410.00	0.09
194	605009	豪悦护理	15,800	488,220.00	0.09
195	600821	金开新能	95,600	487,560.00	0.09
196	002928	华夏航空	44,000	486,200.00	0.09
197	300580	贝斯特	18,400	483,736.00	0.09
198	601137	博威合金	22,400	478,688.00	0.09
199	688631	莱斯信息	6,949	473,087.92	0.09
200	603327	福蓉科技	42,300	459,378.00	0.09
201	002110	三钢闽光	103,700	455,243.00	0.09
202	601952	苏垦农发	49,000	446,880.00	0.09
203	603809	豪能股份	30,100	431,935.00	0.08
204	601677	明泰铝业	29,100	430,389.00	0.08
205	600550	保变电气	39,900	420,945.00	0.08
206	002267	陕天然气	54,800	412,644.00	0.08
207	300457	赢合科技	14,800	412,180.00	0.08
208	603663	三祥新材	11,400	402,990.00	0.08
209	301345	涛涛车业	1,600	402,112.00	0.08
210	600100	同方股份	44,900	400,508.00	0.08
211	603533	掌阅科技	18,000	398,160.00	0.08
212	601609	金田股份	36,300	392,040.00	0.08
213	301268	铭利达	21,500	391,945.00	0.08
214	000828	东莞控股	36,200	389,512.00	0.07
215	600662	外服控股	77,500	389,050.00	0.07
216	605123	派克新材	3,700	384,430.00	0.07
217	002004	华邦健康	78,400	374,752.00	0.07
218	600618	氯碱化工	31,500	374,220.00	0.07
219	600328	中盐化工	45,300	373,272.00	0.07
220	601500	通用股份	74,600	359,572.00	0.07
221	000767	晋控电力	127,500	357,000.00	0.07
222	002399	海普瑞	29,700	350,163.00	0.07
223	301263	泰恩康	11,900	344,981.00	0.07
224	688208	道通科技	9,364	344,595.20	0.07

225	002987	京北方	16,000	344,480.00	0.07
226	688127	蓝特光学	8,883	341,906.67	0.07
227	002015	协鑫能科	33,900	337,305.00	0.06
228	603690	至纯科技	10,600	333,370.00	0.06
229	600729	重庆百货	12,800	332,800.00	0.06
230	600596	新安股份	28,800	330,336.00	0.06
231	603496	恒为科技	11,800	321,904.00	0.06
232	600057	厦门象屿	37,700	321,204.00	0.06
233	301631	壹连科技	3,100	321,005.00	0.06
234	600933	爱柯迪	15,900	319,590.00	0.06
235	600409	三友化工	50,900	315,071.00	0.06
236	002222	福晶科技	5,500	309,870.00	0.06
237	600903	贵州燃气	45,200	298,772.00	0.06
238	600888	新疆众和	36,400	298,116.00	0.06
239	002242	九阳股份	28,300	295,452.00	0.06
240	603638	艾迪精密	15,600	295,308.00	0.06
241	002706	良信股份	27,200	293,216.00	0.06
242	000422	湖北宜化	20,600	292,726.00	0.06
243	000612	焦作万方	26,400	290,928.00	0.06
244	600744	华银电力	49,200	289,296.00	0.06
245	000917	电广传媒	27,600	283,728.00	0.05
246	301171	易点天下	7,000	283,500.00	0.05
247	300772	运达股份	14,700	280,182.00	0.05
248	600366	宁波韵升	20,300	279,937.00	0.05
249	600710	苏美达	25,600	276,736.00	0.05
250	601882	海天精工	13,800	268,548.00	0.05
251	000848	承德露露	30,400	258,400.00	0.05
252	600929	雪天盐业	44,600	251,990.00	0.05
253	601003	柳钢股份	49,500	248,985.00	0.05
254	600746	江苏索普	35,100	241,488.00	0.05
255	000829	天音控股	22,100	241,111.00	0.05
256	300034	钢研高纳	12,300	240,834.00	0.05
257	300127	银河磁体	7,900	239,607.00	0.05
258	688439	振华风光	3,678	237,598.80	0.05
259	600292	电投水电	18,200	237,510.00	0.05
260	601777	千里科技	22,300	237,049.00	0.05
261	600458	时代新材	17,300	229,571.00	0.04
262	600726	华电能源	89,300	213,427.00	0.04
263	600388	龙净环保	13,000	212,030.00	0.04
264	301238	瑞泰新材	10,100	206,040.00	0.04
265	300224	正海磁材	13,100	202,526.00	0.04
266	002408	齐翔腾达	40,900	199,592.00	0.04
267	000035	中国天楹	36,000	198,720.00	0.04

268	002563	森马服饰	36,000	195,120.00	0.04
269	002006	精工科技	8,400	194,544.00	0.04
270	000756	新华制药	12,500	192,625.00	0.04
271	688300	联瑞新材	3,102	192,603.18	0.04
272	002697	红旗连锁	32,400	192,456.00	0.04
273	600993	马应龙	6,800	190,400.00	0.04
274	600776	东方通信	11,500	189,750.00	0.04
275	600552	凯盛科技	15,300	189,720.00	0.04
276	603297	永新光学	1,800	189,540.00	0.04
277	300113	顺网科技	9,100	184,184.00	0.04
278	002675	东诚药业	13,300	182,742.00	0.04
279	688029	南微医学	2,179	177,719.24	0.03
280	600773	西藏城投	14,200	175,938.00	0.03
281	600428	中远海特	24,100	171,110.00	0.03
282	000758	中色股份	25,400	168,656.00	0.03
283	688097	博众精工	4,428	167,157.00	0.03
284	002093	国脉科技	14,400	165,600.00	0.03
285	601858	中国科传	8,800	159,720.00	0.03
286	002978	安宁股份	4,800	158,640.00	0.03
287	002073	软控股份	19,100	155,665.00	0.03
288	600866	星湖科技	22,200	154,290.00	0.03
289	600285	羚锐制药	7,400	153,254.00	0.03
290	600075	新疆天业	30,200	149,490.00	0.03
291	603218	日月股份	11,200	148,400.00	0.03
292	002745	木林森	15,400	147,378.00	0.03
293	002068	黑猫股份	16,500	145,530.00	0.03
294	600266	城建发展	28,700	145,509.00	0.03
295	300398	飞凯材料	6,400	143,424.00	0.03
296	300638	广和通	4,800	142,272.00	0.03
297	000875	吉电股份	25,200	142,128.00	0.03
298	301363	美好医疗	5,900	141,895.00	0.03
299	688567	孚能科技	9,065	141,867.25	0.03
300	600621	华鑫股份	9,300	141,732.00	0.03
301	301678	新恒汇	2,200	141,284.00	0.03
302	605118	力鼎光电	4,600	138,506.00	0.03
303	002091	江苏国泰	15,300	138,159.00	0.03
304	301511	德福科技	3,800	136,002.00	0.03
305	002075	沙钢股份	23,600	135,700.00	0.03
306	601126	四方股份	4,500	135,360.00	0.03
307	603279	景津装备	7,200	121,464.00	0.02
308	688612	威迈斯	3,620	119,351.40	0.02
309	000049	德赛电池	4,400	118,272.00	0.02
310	603997	继峰股份	8,500	118,150.00	0.02

311	000581	威孚高科	5,700	117,534.00	0.02
312	603383	顶点软件	3,200	115,552.00	0.02
313	603919	金徽酒	5,500	112,310.00	0.02
314	002516	旷达科技	16,500	108,735.00	0.02
315	603337	杰克科技	2,500	108,325.00	0.02
316	301047	义翘神州	1,600	108,160.00	0.02
317	600211	西藏药业	2,500	106,375.00	0.02
318	002895	川恒股份	2,900	106,314.00	0.02
319	603072	天和磁材	2,600	105,794.00	0.02
320	603328	依顿电子	9,600	105,216.00	0.02
321	688106	金宏气体	5,308	103,983.72	0.02
322	603317	天味食品	8,300	103,916.00	0.02
323	600033	福建高速	25,100	103,663.00	0.02
324	002588	史丹利	10,300	102,794.00	0.02
325	002041	登海种业	10,700	102,078.00	0.02
326	600864	哈投股份	15,200	100,776.00	0.02
327	002911	佛燃能源	8,200	99,384.00	0.02
328	301665	泰禾股份	3,500	98,840.00	0.02
329	688091	上海谊众	2,094	98,418.00	0.02
330	688548	广钢气体	6,766	98,377.64	0.02
331	605599	菜百股份	6,000	98,220.00	0.02
332	603267	鸿远电子	1,800	97,974.00	0.02
333	300777	中简科技	2,400	97,920.00	0.02
334	600559	老白干酒	6,100	97,844.00	0.02
335	601038	一拖股份	6,900	97,773.00	0.02
336	000923	河钢资源	4,600	97,382.00	0.02
337	601033	永兴股份	6,400	96,832.00	0.02
338	605011	杭州热电	4,700	96,068.00	0.02
339	600667	太极实业	12,000	95,640.00	0.02
340	300008	天海防务	12,100	95,469.00	0.02
341	002317	众生药业	5,000	94,900.00	0.02
342	600640	国脉文化	7,500	94,200.00	0.02
343	002539	云图控股	7,900	93,378.00	0.02
344	600163	中闽能源	17,200	93,224.00	0.02
345	605099	共创草坪	2,600	92,794.00	0.02
346	300181	佐力药业	5,700	92,112.00	0.02
347	002243	力合科创	9,000	89,550.00	0.02
348	300409	道氏技术	3,900	87,711.00	0.02
349	600586	金晶科技	15,500	87,265.00	0.02
350	000603	盛达资源	2,800	86,688.00	0.02
351	600740	山西焦化	20,200	75,952.00	0.01
352	688789	宏华数科	894	72,923.58	0.01
353	002859	洁美科技	2,600	71,760.00	0.01

354	002498	汉缆股份	18,700	71,621.00	0.01
355	601083	锦江航运	6,400	71,424.00	0.01
356	605555	德昌股份	3,900	71,370.00	0.01
357	603033	三维股份	6,300	68,103.00	0.01
358	301031	中熔电气	600	67,314.00	0.01
359	601326	秦港股份	19,200	67,008.00	0.01
360	002690	美亚光电	3,100	63,767.00	0.01
361	605507	国邦医药	2,400	59,520.00	0.01
362	002023	海特高新	4,300	58,222.00	0.01
363	300809	华辰装备	1,500	57,105.00	0.01
364	000902	新洋丰	3,600	56,232.00	0.01
365	600529	山东药玻	2,800	55,804.00	0.01
366	301219	腾远钴业	800	54,624.00	0.01
367	600894	广日股份	5,900	54,575.00	0.01
368	002511	中顺洁柔	6,300	53,928.00	0.01
369	301087	可孚医疗	1,200	53,604.00	0.01
370	603039	泛微网络	1,000	53,540.00	0.01
371	600420	国药现代	5,200	52,520.00	0.01
372	301571	国科天成	900	51,912.00	0.01
373	301392	汇成真空	400	51,616.00	0.01
374	000990	诚志股份	6,500	51,480.00	0.01
375	600055	万东医疗	3,300	51,414.00	0.01
376	002043	兔宝宝	3,500	50,435.00	0.01
377	301039	中集车辆	5,500	50,325.00	0.01
378	600422	昆药集团	4,000	50,240.00	0.01
379	002545	东方铁塔	2,700	49,815.00	0.01
380	688289	圣湘生物	2,627	49,676.57	0.01
381	603027	千禾味业	5,000	49,150.00	0.01
382	688690	纳微科技	1,901	49,064.81	0.01
383	300323	华灿光电	6,100	48,678.00	0.01
384	601022	宁波远洋	5,300	48,601.00	0.01
385	603262	技源集团	1,700	48,433.00	0.01
386	603730	岱美股份	5,500	48,180.00	0.01
387	300755	华致酒行	2,700	47,574.00	0.01
388	603227	雪峰科技	5,700	47,424.00	0.01
389	688139	海尔生物	1,478	46,970.84	0.01
390	603193	润本股份	1,900	46,037.00	0.01
391	603678	火炬电子	1,300	45,916.00	0.01
392	603229	奥翔药业	4,600	45,632.00	0.01
393	000681	视觉中国	1,900	45,239.00	0.01
394	002550	千红制药	5,600	44,016.00	0.01
395	300257	开山股份	3,100	43,555.00	0.01
396	603733	仙鹤股份	1,800	43,506.00	0.01

397	300406	九强生物	3,300	43,131.00	0.01
398	603219	富佳股份	2,500	42,100.00	0.01
399	002701	奥瑞金	7,000	41,650.00	0.01
400	002003	伟星股份	3,700	39,220.00	0.01
401	000065	北方国际	3,100	38,626.00	0.01
402	002967	广电计量	1,700	37,417.00	0.01
403	002373	千方科技	3,100	36,487.00	0.01
404	002390	信邦制药	11,100	35,742.00	0.01
405	300624	万兴科技	500	35,325.00	0.01
406	301035	润丰股份	500	34,005.00	0.01
407	002258	利尔化学	2,600	33,930.00	0.01
408	605116	奥锐特	1,300	32,565.00	0.01
409	603395	红四方	1,100	32,153.00	0.01
410	601890	亚星锚链	3,100	31,899.00	0.01
411	600063	皖维高新	5,400	31,806.00	0.01
412	600197	伊力特	2,200	30,448.00	0.01
413	603619	中曼石油	1,300	29,965.00	0.01
414	603883	老百姓	2,000	29,600.00	0.01
415	002051	中工国际	3,000	27,210.00	0.01
416	002204	大连重工	3,500	26,775.00	0.01
417	688586	江航装备	2,011	26,223.44	0.01
418	002777	久远银海	1,300	23,322.00	0.00
419	301177	迪阿股份	800	23,096.00	0.00
420	300687	赛意信息	900	20,673.00	0.00
421	002557	洽洽食品	900	19,458.00	0.00
422	002145	钛能化学	3,900	19,110.00	0.00
423	301029	怡合达	700	18,564.00	0.00
424	000557	西部创业	3,500	17,430.00	0.00
425	002011	盾安环境	1,300	16,484.00	0.00
426	603866	桃李面包	2,700	14,202.00	0.00
427	002489	浙江永强	3,700	14,171.00	0.00
428	603056	德邦股份	1,000	13,670.00	0.00
429	300415	伊之密	500	13,030.00	0.00
430	300226	上海钢联	500	12,560.00	0.00
431	600480	凌云股份	1,000	12,290.00	0.00
432	002101	广东鸿图	900	11,088.00	0.00
433	300171	东富龙	700	10,990.00	0.00
434	300925	法本信息	500	10,620.00	0.00
435	301109	军信股份	700	10,500.00	0.00
436	002572	索菲亚	700	9,527.00	0.00
437	002096	易普力	700	9,324.00	0.00
438	301207	华兰疫苗	500	9,315.00	0.00
439	300768	迪普科技	400	7,412.00	0.00

440	000913	钱江摩托	400	6,168.00	0.00
441	002543	万和电气	600	6,126.00	0.00
442	000156	华数传媒	800	6,056.00	0.00
443	600267	海正药业	600	5,934.00	0.00
444	300482	万孚生物	300	5,925.00	0.00
445	000860	顺鑫农业	400	5,860.00	0.00
446	600223	福瑞达	700	5,152.00	0.00
447	002705	新宝股份	300	4,278.00	0.00
448	000966	长源电力	900	3,843.00	0.00
449	300009	安科生物	400	3,828.00	0.00
450	002287	奇正藏药	100	2,366.00	0.00

### 8.3.2 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	301308	江波龙	26,500	6,488,260.00	1.24
2	300274	阳光电源	22,600	3,865,504.00	0.74
3	603444	吉比特	7,500	3,178,875.00	0.61
4	600021	上海电力	118,200	2,366,364.00	0.45
5	300520	科大国创	66,500	2,320,185.00	0.44
6	002885	京泉华	90,240	2,318,265.60	0.44
7	603185	弘元绿能	75,900	2,314,950.00	0.44
8	300014	亿纬锂能	31,100	2,045,136.00	0.39
9	300570	太辰光	17,200	1,987,460.00	0.38
10	603228	景旺电子	24,000	1,754,160.00	0.34
11	300903	科翔股份	89,500	1,726,455.00	0.33
12	000657	中钨高新	60,400	1,673,684.00	0.32
13	600195	中牧股份	209,200	1,646,404.00	0.32
14	301069	凯盛新材	58,600	1,629,080.00	0.31
15	688280	精进电动	172,366	1,499,584.20	0.29
16	002136	安纳达	115,700	1,404,598.00	0.27
17	300432	富临精工	83,600	1,396,120.00	0.27
18	300100	双林股份	34,400	1,362,928.00	0.26
19	301090	华润材料	192,200	1,353,088.00	0.26
20	000881	中广核技	141,300	1,278,765.00	0.24
21	000408	藏格矿业	14,400	1,215,360.00	0.23
22	603609	禾丰股份	171,000	1,212,390.00	0.23
23	600966	博汇纸业	165,700	1,131,731.00	0.22
24	600309	万华化学	14,700	1,127,196.00	0.22
25	600935	华塑股份	448,900	1,099,805.00	0.21
26	603729	龙韵股份	60,000	965,400.00	0.18
27	601065	江盐集团	113,700	943,710.00	0.18
28	688233	神工股份	13,084	916,272.52	0.18
29	002335	科华数据	16,400	910,692.00	0.17

30	603368	柳药集团	49,100	874,962.00	0.17
31	688095	福昕软件	9,580	855,206.60	0.16
32	601000	唐山港	220,600	847,104.00	0.16
33	600987	航民股份	122,900	846,781.00	0.16
34	000915	华特达因	24,000	792,960.00	0.15
35	002014	永新股份	66,100	787,912.00	0.15
36	601015	陕西黑猫	202,900	734,498.00	0.14
37	301052	果麦文化	18,300	698,877.00	0.13
38	301349	信德新材	13,400	628,594.00	0.12
39	688556	高测股份	54,322	620,357.24	0.12
40	600713	南京医药	108,200	590,772.00	0.11
41	600008	首创环保	195,100	585,300.00	0.11
42	000598	兴蓉环境	81,300	582,921.00	0.11
43	002910	庄园牧场	52,000	577,720.00	0.11
44	600004	白云机场	61,000	577,060.00	0.11
45	688472	阿特斯	38,073	567,668.43	0.11
46	688416	恒烁股份	10,288	567,177.44	0.11
47	002746	仙坛股份	92,100	559,047.00	0.11
48	301338	凯格精机	6,000	528,660.00	0.10
49	600573	惠泉啤酒	44,100	526,113.00	0.10
50	603700	宁水集团	38,000	516,420.00	0.10
51	002274	华昌化工	90,500	511,325.00	0.10
52	603071	物产环能	38,300	506,326.00	0.10
53	688655	迅捷兴	29,486	505,095.18	0.10
54	300261	雅本化学	73,700	496,001.00	0.10
55	000088	盐田港	110,100	489,945.00	0.09
56	002726	龙大美食	118,900	488,679.00	0.09
57	600127	金健米业	72,400	486,528.00	0.09
58	002763	汇洁股份	66,600	480,852.00	0.09
59	688593	新相微	23,663	477,519.34	0.09
60	605222	起帆电缆	25,100	461,589.00	0.09
61	002567	唐人神	97,200	427,680.00	0.08
62	300393	中来股份	62,700	420,090.00	0.08
63	600874	创业环保	70,500	418,770.00	0.08
64	688459	哈铁科技	42,405	409,208.25	0.08
65	600749	西藏旅游	23,300	397,964.00	0.08
66	002905	金逸影视	34,500	389,850.00	0.07
67	600604	市北高新	66,400	367,856.00	0.07
68	688021	奥福科技	19,090	350,301.50	0.07
69	002327	富安娜	51,100	342,881.00	0.07
70	600488	津药药业	83,500	341,515.00	0.07
71	002039	黔源电力	18,700	339,779.00	0.07
72	688718	唯赛勃	25,405	332,297.40	0.06

73	688170	德龙激光	10,101	317,777.46	0.06
74	603188	亚邦股份	65,300	299,727.00	0.06
75	002382	蓝帆医疗	53,100	297,360.00	0.06
76	002034	旺能环境	18,700	297,330.00	0.06
77	600073	光明肉业	45,700	292,480.00	0.06
78	600479	千金药业	28,700	291,592.00	0.06
79	688455	科捷智能	14,479	290,883.11	0.06
80	601568	北元集团	77,400	287,928.00	0.06
81	000919	金陵药业	35,900	285,405.00	0.05
82	688056	莱伯泰科	8,464	284,475.04	0.05
83	603070	万控智造	20,500	265,680.00	0.05
84	603167	渤海轮渡	27,600	260,268.00	0.05
85	002833	弘亚数控	15,800	258,646.00	0.05
86	688600	皖仪科技	10,322	258,566.10	0.05
87	002367	康力电梯	31,400	253,084.00	0.05
88	600222	太龙药业	38,300	252,014.00	0.05
89	601139	深圳燃气	37,900	250,140.00	0.05
90	601518	吉林高速	87,800	247,596.00	0.05
91	603367	辰欣药业	13,900	240,748.00	0.05
92	603008	喜临门	10,400	212,992.00	0.04
93	000713	国投丰乐	30,900	204,558.00	0.04
94	001213	中铁特货	48,300	195,615.00	0.04
95	688659	元琛科技	20,558	194,273.10	0.04
96	688071	华依科技	5,803	192,485.51	0.04
97	600303	曙光股份	54,500	177,670.00	0.03
98	688528	秦川物联	15,766	169,799.82	0.03
99	601368	绿城水务	30,600	151,776.00	0.03
100	605266	健之佳	7,820	150,300.40	0.03
101	002033	丽江股份	16,400	150,060.00	0.03
102	600917	重庆燃气	26,900	147,681.00	0.03
103	603689	皖天然气	18,200	147,602.00	0.03
104	600159	大龙地产	53,200	147,364.00	0.03
105	002687	乔治白	30,400	146,528.00	0.03
106	601366	利群股份	29,700	144,936.00	0.03
107	002818	富森美	13,000	144,430.00	0.03
108	688178	万德斯	5,986	143,843.58	0.03
109	301239	普瑞眼科	4,300	141,427.00	0.03
110	688115	思林杰	2,021	132,537.18	0.03
111	301223	中荣股份	7,100	130,427.00	0.02
112	300334	津膜科技	17,800	123,888.00	0.02
113	300839	博汇股份	9,400	113,176.00	0.02
114	688216	气派科技	4,680	104,270.40	0.02
115	300596	利安隆	2,400	101,304.00	0.02

116	002381	双箭股份	15,300	100,827.00	0.02
117	301558	三态股份	12,300	100,245.00	0.02
118	603199	九华旅游	2,700	99,252.00	0.02
119	002884	凌霄泵业	5,600	99,064.00	0.02
120	000619	海螺新材	15,700	97,497.00	0.02
121	000720	新能泰山	29,600	96,792.00	0.02
122	603982	泉峰汽车	11,500	96,255.00	0.02
123	600976	健民集团	2,800	93,996.00	0.02
124	301010	晶雪节能	4,200	93,030.00	0.02
125	301656	联合动力	3,633	92,496.18	0.02
126	002793	罗欣药业	19,100	91,680.00	0.02
127	603937	丽岛新材	7,400	88,726.00	0.02
128	301159	三维天地	2,400	88,248.00	0.02
129	001366	播恩集团	6,400	85,568.00	0.02
130	300845	捷安高科	5,900	66,493.00	0.01
131	002234	民和股份	7,200	62,064.00	0.01
132	003011	海象新材	2,600	57,304.00	0.01
133	605001	威奥股份	7,300	55,699.00	0.01
134	603161	科华控股	3,800	52,174.00	0.01
135	603132	金徽股份	3,500	51,345.00	0.01
136	300129	泰胜风能	4,900	51,254.00	0.01
137	605577	龙版传媒	3,900	50,973.00	0.01
138	300929	华骐环保	4,700	50,525.00	0.01
139	002780	三夫户外	3,500	50,260.00	0.01
140	300365	恒华科技	7,900	49,928.00	0.01
141	000421	南京公用	7,200	49,752.00	0.01
142	601158	重庆水务	11,100	49,617.00	0.01
143	603836	海程邦达	3,600	49,536.00	0.01
144	300246	宝莱特	6,100	49,410.00	0.01
145	603877	太平鸟	3,400	49,402.00	0.01
146	300176	鸿特科技	7,400	49,358.00	0.01
147	001323	慕思股份	1,900	49,324.00	0.01
148	002999	天禾股份	7,200	49,176.00	0.01
149	601330	绿色动力	7,300	49,129.00	0.01
150	603126	中材节能	7,300	49,056.00	0.01
151	600232	金鹰股份	6,200	49,042.00	0.01
152	000637	茂化实华	11,400	49,020.00	0.01
153	603053	成都燃气	5,100	48,960.00	0.01
154	002333	罗普斯金	8,700	48,894.00	0.01
155	002566	益盛药业	6,400	48,832.00	0.01
156	300110	华仁药业	15,500	48,825.00	0.01
157	002671	龙泉股份	9,300	48,732.00	0.01
158	002054	德美化工	6,600	48,708.00	0.01

159	300405	科隆股份	7,600	48,488.00	0.01
160	002314	南山控股	17,000	48,450.00	0.01
161	600548	深高速	5,500	48,400.00	0.01
162	300106	西部牧业	4,500	48,375.00	0.01
162	601996	丰林集团	21,500	48,375.00	0.01
163	603168	莎普爱思	6,500	47,840.00	0.01
164	300985	致远新能	2,600	47,710.00	0.01
165	300936	中英科技	1,200	46,800.00	0.01
166	002923	润都股份	3,800	46,170.00	0.01
167	605007	五洲特纸	3,300	44,583.00	0.01
168	603986	兆易创新	200	42,850.00	0.01
169	603048	浙江黎明	2,000	42,280.00	0.01
170	001278	一彬科技	2,000	38,680.00	0.01
171	301638	南网数字	2,198	31,233.58	0.01
172	688795	摩尔线程	66	27,467.88	0.01
173	002873	新天药业	2,600	25,792.00	0.00
174	300535	达威股份	1,300	23,218.00	0.00
175	688783	西安奕材	1,084	19,902.24	0.00
176	300823	建科智能	1,000	15,620.00	0.00
177	301060	兰卫医学	1,400	12,950.00	0.00
178	600851	海欣股份	1,700	11,611.00	0.00
179	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
180	301198	喜悦智行	800	10,048.00	0.00
181	603811	诚意药业	900	9,450.00	0.00
182	600969	郴电国际	900	9,207.00	0.00
183	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
184	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
185	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
186	603370	华新精科	45	2,085.75	0.00
187	600774	汉商集团	200	1,828.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300475	香农芯创	27,957,482.00	7.50
2	001309	德明利	22,421,036.90	6.02
3	300870	欧陆通	22,239,168.00	5.97
4	300620	光库科技	20,325,273.65	5.45
5	603083	剑桥科技	20,186,247.00	5.42
6	688629	华丰科技	17,525,220.38	4.70
7	000651	格力电器	17,099,665.00	4.59
8	300638	广和通	16,588,540.00	4.45

9	300762	上海瀚讯	16,523,248.00	4.43
10	300432	富临精工	15,959,966.71	4.28
11	300570	太辰光	15,824,569.00	4.25
12	301377	鼎泰高科	14,975,060.00	4.02
13	002402	和而泰	14,955,289.00	4.01
14	301511	德福科技	14,688,984.29	3.94
15	300438	鹏辉能源	14,000,573.00	3.76
16	600750	江中药业	13,746,245.00	3.69
17	002335	科华数据	13,678,473.00	3.67
18	300672	国科微	13,616,344.00	3.65
19	002948	青岛银行	13,004,834.00	3.49
20	301069	凯盛新材	12,692,585.00	3.41
21	300476	胜宏科技	12,507,373.00	3.36
22	688502	茂莱光学	12,236,623.59	3.28
23	300602	飞荣达	12,164,069.74	3.26
24	301205	联特科技	12,046,097.00	3.23
25	603920	世运电路	11,906,490.01	3.19
26	600941	中国移动	11,901,890.00	3.19
27	300593	新雷能	11,881,732.00	3.19
28	301510	固高科技	11,778,409.12	3.16
29	600461	洪城环境	11,480,148.65	3.08
30	688800	瑞可达	11,374,438.88	3.05
31	300548	长芯博创	11,350,737.00	3.05
32	002222	福晶科技	10,886,504.00	2.92
33	300363	博腾股份	10,775,691.00	2.89
34	601869	长飞光纤	10,414,322.74	2.79
35	300274	阳光电源	10,393,405.00	2.79
36	603915	国茂股份	10,322,651.00	2.77
37	300598	诚迈科技	10,294,716.40	2.76
38	300803	指南针	10,191,664.00	2.73
39	600273	嘉化能源	10,190,778.00	2.73
40	301029	怡合达	10,162,179.96	2.73
41	301316	慧博云通	10,018,947.00	2.69
42	601077	渝农商行	9,793,690.00	2.63
43	000555	神州信息	9,742,107.00	2.61
44	601519	大智慧	9,683,634.00	2.60
45	300613	富瀚微	9,544,962.15	2.56
46	600810	神马股份	9,542,948.00	2.56
47	600757	长江传媒	9,456,181.00	2.54
48	688498	源杰科技	9,392,522.09	2.52
49	300857	协创数据	9,164,419.00	2.46
50	300618	寒锐钴业	8,886,844.48	2.38
51	300077	国民技术	8,844,319.21	2.37

52	300735	光弘科技	8,829,017.00	2.37
53	300170	汉得信息	8,763,783.00	2.35
54	000429	粤高速 A	8,659,420.00	2.32
55	301217	铜冠铜箔	8,645,444.00	2.32
56	300580	贝斯特	8,589,030.12	2.30
57	000600	建投能源	8,562,957.00	2.30
58	300226	上海钢联	8,526,100.40	2.29
59	600459	贵研铂业	8,493,910.00	2.28
60	002079	苏州固锴	8,426,168.00	2.26
61	688063	派能科技	8,425,399.76	2.26
62	002126	银轮股份	8,416,433.00	2.26
63	002120	韵达股份	8,361,472.00	2.24
64	300101	振芯科技	8,331,449.84	2.24
65	002405	四维图新	8,293,319.00	2.23
66	300100	双林股份	8,290,685.20	2.22
67	600572	康恩贝	8,288,778.00	2.22
68	603444	吉比特	8,284,343.00	2.22
69	601975	招商南油	8,258,822.00	2.22
70	002245	蔚蓝锂芯	8,220,050.23	2.21
71	601375	中原证券	8,168,981.00	2.19
72	300088	长信科技	8,086,832.00	2.17
73	688347	华虹公司	8,051,768.99	2.16
74	002326	永太科技	8,020,269.00	2.15
75	600323	瀚蓝环境	7,993,936.12	2.14
76	300493	润欣科技	7,938,318.00	2.13
77	301153	中科江南	7,938,210.68	2.13
78	603323	苏农银行	7,911,539.00	2.12
79	002428	云南锗业	7,840,518.00	2.10
80	601311	骆驼股份	7,803,561.00	2.09
81	603876	鼎胜新材	7,802,541.00	2.09
82	000543	皖能电力	7,747,625.20	2.08
83	002897	意华股份	7,744,116.00	2.08
84	000917	电广传媒	7,738,098.00	2.08
85	000676	智度股份	7,618,278.00	2.04
86	301486	致尚科技	7,604,467.00	2.04
87	600938	中国海油	7,588,457.50	2.04
88	601107	四川成渝	7,521,059.00	2.02
89	002635	安洁科技	7,454,212.00	2.00

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。

#### 8.4.2 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	300870	欧陆通	25,158,395.31	6.75
2	603083	剑桥科技	22,485,959.50	6.03
3	300762	上海瀚讯	20,416,099.80	5.48
4	300475	香农芯创	20,361,551.00	5.46
5	000651	格力电器	18,196,851.00	4.88
6	688629	华丰科技	17,781,320.85	4.77
7	002402	和而泰	17,067,968.88	4.58
8	300638	广和通	16,677,152.00	4.47
9	300672	国科微	16,457,585.00	4.42
10	301511	德福科技	16,365,558.20	4.39
11	301377	鼎泰高科	16,104,798.22	4.32
12	300432	富临精工	15,704,978.38	4.21
13	001309	德明利	15,203,690.00	4.08
14	300570	太辰光	14,506,840.00	3.89
15	002335	科华数据	13,676,328.00	3.67
16	002948	青岛银行	13,391,755.00	3.59
17	300476	胜宏科技	13,283,110.00	3.56
18	300857	协创数据	13,201,574.50	3.54
19	300620	光库科技	12,919,169.48	3.47
20	300548	长芯博创	12,429,498.00	3.33
21	301205	联特科技	12,413,722.40	3.33
22	603920	世运电路	12,388,315.00	3.32
23	301510	固高科技	12,083,155.00	3.24
24	600750	江中药业	12,039,836.98	3.23
25	688502	茂莱光学	11,991,206.54	3.22
26	600941	中国移动	11,940,609.00	3.20
27	300593	新雷能	11,866,403.10	3.18
28	301069	凯盛新材	11,708,699.91	3.14
29	002222	福晶科技	11,418,352.24	3.06
30	601975	招商南油	11,200,737.80	3.01
31	600757	长江传媒	11,136,166.60	2.99
32	000429	粤高速 A	10,896,475.00	2.92
33	300598	诚迈科技	10,863,251.98	2.91
34	688800	瑞可达	10,832,526.09	2.91
35	300363	博腾股份	10,786,093.00	2.89
36	300803	指南针	10,520,025.55	2.82
37	301029	怡合达	10,470,185.00	2.81
38	600259	中稀有色	10,407,373.00	2.79
39	300101	振芯科技	10,230,125.84	2.74
40	600810	神马股份	9,982,079.00	2.68
41	300613	富瀚微	9,803,222.90	2.63
42	601077	渝农商行	9,801,372.00	2.63
43	300682	朗新集团	9,765,528.00	2.62

44	300525	博思软件	9,726,167.39	2.61
45	002245	蔚蓝锂芯	9,580,447.17	2.57
46	301217	铜冠铜箔	9,528,483.00	2.56
47	300232	洲明科技	9,498,422.00	2.55
48	600461	洪城环境	9,265,604.81	2.49
49	300602	飞荣达	9,145,947.00	2.45
50	301153	中科江南	9,117,722.20	2.45
51	002212	天融信	9,086,808.07	2.44
52	300735	光弘科技	9,076,916.00	2.44
53	002126	银轮股份	9,038,144.00	2.43
54	300077	国民技术	9,033,561.69	2.42
55	300170	汉得信息	8,919,351.00	2.39
56	300226	上海钢联	8,811,947.03	2.36
57	601519	大智慧	8,740,692.00	2.35
58	000543	皖能电力	8,631,696.60	2.32
59	603915	国茂股份	8,556,946.00	2.30
60	601311	骆驼股份	8,548,228.00	2.29
61	600728	佳都科技	8,440,671.00	2.26
62	002428	云南锗业	8,436,045.00	2.26
63	300674	宇信科技	8,388,196.57	2.25
64	300079	数码视讯	8,382,769.05	2.25
65	600459	贵研铂业	8,327,410.14	2.23
66	002120	韵达股份	8,293,218.00	2.23
67	300438	鹏辉能源	8,254,822.00	2.21
68	002405	四维图新	8,240,734.00	2.21
69	000676	智度股份	8,208,936.00	2.20
70	000917	电广传媒	8,198,790.00	2.20
71	300580	贝斯特	8,176,922.00	2.19
72	600151	航天机电	8,134,335.00	2.18
73	688347	华虹公司	8,124,847.67	2.18
74	600323	瀚蓝环境	8,120,888.00	2.18
75	000970	中科三环	8,075,500.49	2.17
76	300493	润欣科技	8,034,685.61	2.16
77	600273	嘉化能源	7,951,160.00	2.13
78	601128	常熟银行	7,943,611.80	2.13
79	000555	神州信息	7,879,844.00	2.11
80	601869	长飞光纤	7,877,387.06	2.11
81	603583	捷昌驱动	7,674,840.00	2.06
82	000837	秦川机床	7,637,447.00	2.05
83	300229	拓尔思	7,621,035.00	2.04
84	301486	致尚科技	7,559,420.17	2.03
85	300346	南大光电	7,529,466.00	2.02
86	688003	天准科技	7,514,796.62	2.02

87	301078	孩子王	7,489,038.70	2.01
88	301339	通行宝	7,457,563.60	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。

#### 8.4.3 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	4,077,726,482.71
卖出股票收入（成交）总额	4,080,814,574.85

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

#### 8.6 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

#### 8.7 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

#### 8.8 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

#### 8.9 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

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	1,229,244.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,229,244.01

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
国金中证 1000 指数 增强 A	3,106	44,360.30	477,176.79	0.35	137,305,914.93	99.65

国金中证 1000 指数增强 C	8,894	29,619.86	91,659,299.00	34.79	171,779,767.85	65.21
合计	12,000	33,435.18	92,136,475.79	22.96	309,085,682.78	77.04

### 9.2 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	95,391.56	0.0692
	国金中证 1000 指数增强 C	416,127.07	0.1580
	合计	511,518.63	0.1275

### 9.3 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

## § 10 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	272,694,430.48	136,439,420.41
本报告期基金总申购份额	185,317,470.39	494,355,065.33
减：本报告期基金总赎回份额	320,228,809.15	367,355,418.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,783,091.72	263,439,066.85

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费用为 40,000.00 元，该会计师事务所自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 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。

#### 11.6.3 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。

#### 11.6.4 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	8,158,042,329.41	100.00	1,549,603.76	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需
- 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。

### 11.7.2 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	-	-	393,625,000.00	100.00	-	-

### 11.8 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	2025 年 1 月 17 日
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	2025 年 1 月 17 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	2025 年 1 月 17 日
4	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日

5	《国金基金管理有限公司关于关闭微信交易平台的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 2 月 7 日
6	《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	2025 年 2 月 20 日
7	《国金基金管理有限公司关于终止厦门市鑫鼎盛控股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	2025 年 3 月 11 日
8	《关于国金基金管理公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 20 日
9	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
10	《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（2024 年度）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 31 日
11	《国金基金管理有限公司关于运用公司固有资金和高级管理人员自有资金投资旗下权益基金的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 14 日
12	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
13	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 25 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	2025 年 7 月 1 日
15	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 19 日
16	《关于国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 25 日
17	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 25 日
18	《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	2025 年 7 月 25 日
19	《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	2025 年 7 月 25 日
20	《关于国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 8 月 27 日
21	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 8 月 29 日
22	《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	2025 年 8 月 29 日

23	《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	2025 年 8 月 29 日
24	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 8 月 30 日
25	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 10 月 28 日
26	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 12 月 19 日
27	《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	2025 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 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。

### 13.3 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 3 月 31 日