

# 国金沪深 300 指数增强证券投资基金 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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 .....                                 | 20        |
| 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>54</b> |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 54        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 54        |
| 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 .....     | 56        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 64        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 73        |
| 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 .....    | 73        |
| 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 ..... | 73        |
| 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 ..... | 73        |
| 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 .....    | 73        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 73        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 73        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 73        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>74</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 74        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 75        |
| 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 .....      | 75        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>75</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>76</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 76        |
| 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 .....      | 76        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 76        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 76        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 76        |
| 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 76        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 76        |
| 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 .....                   | 81        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>81</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 81        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 81        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 81        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                  |
|-----------------|---------------------|------------------|
| 基金名称            | 国金沪深 300 指数增强证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 国金 300 指数增强         |                  |
| 基金主代码           | 167601              |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                  |
| 基金合同生效日         | 2017 年 9 月 1 日      |                  |
| 基金管理人           | 国金基金管理有限公司          |                  |
| 基金托管人           | 中国光大银行股份有限公司        |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 214,332,616.67 份    |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 国金 300 指数增强 A       | 国金 300 指数增强 C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 167601              | 017925           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 82,889,448.87 份     | 131,443,167.80 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，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。  |
| 投资策略   | <p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、权证投资策略、跟踪误差的监控与管理、融资及转融通证券出借业务投资策略。</p> <p>本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。资产配置策略部分，本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%；投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金将采用指数化投资为主，增强型投资为辅的方式，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究及数量化投资分析技术谋求在偏离风险和超额收益间的最佳配置。股票投资策略部分，本基金主要采用指数增强投资策略，参考目标股票指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，并基于基本面研究及数量化投资分析技术等方法构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后，基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进行调整，使指数优化组合与标的指数的跟踪误差控制在限定的范围内。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 | 95%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）  |
| 风险收益特征 | 本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                         | 基金托管人                         |
|-------------|------|-------------------------------|-------------------------------|
| 名称          |      | 国金基金管理有限公司                    | 中国光大银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 虞志海                           | 王茵                            |
|             | 联系电话 | 010-88005852                  | 010-63639180                  |
|             | 电子邮箱 | yuzhihai@gfund.com            | wangyin@cebbank.com           |
| 客户服务电话      |      | 4000-2000-18                  | 95595                         |
| 传真          |      | 010-88005666                  | 010-63639132                  |
| 注册地址        |      | 北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室  | 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 |
| 办公地址        |      | 北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层 | 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心        |
| 邮政编码        |      | 100026                        | 100033                        |
| 法定代表人       |      | 邵海波                           | 吴利军                           |

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、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<br>数据和指标 | 2025 年            |                   | 2024 年             |                   | 2023 年             | 2023 年 2 月<br>28 日(基金<br>合同生效<br>日) - 2023<br>年 12 月 31<br>日 |
|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--|
|                   | 国金 300 指<br>数增强 A | 国金 300 指<br>数增强 C | 国金 300 指<br>数增强 A  | 国金 300 指<br>数增强 C | 国金 300 指<br>数增强 A  | 国金 300 指<br>数增强 C  |
| 本期已实现<br>收益       | 20,126,870<br>.95 | 57,699,344<br>.22 | -37,141,96<br>0.62 | 4,674,401.<br>65  | -40,000,00<br>8.90 | -36,031,35<br>5.08   |
| 本期利润              | 20,887,352<br>.45 | 61,570,947<br>.81 | -26,356,05<br>7.61 | 30,205,079<br>.03 | -58,873,96<br>4.72 | -51,117,53<br>9.35   |

|               |               |                |               |                |                |                |
|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2127        | 0.2413         | -0.0916       | 0.0493         | -0.2099        | -0.2169        |
| 本期加权平均净值利润率   | 20.68%        | 23.33%         | -10.39%       | 5.56%          | -21.50%        | -22.35%        |
| 本期基金份额净值增长率   | 20.90%        | 20.42%         | 3.46%         | 3.05%          | -4.43%         | -7.69%         |
| 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      | 13,024,559.92 | 19,016,591.27  | -4,416,835.75 | -7,398,281.58  | -57,366,709.36 | -47,729,838.67 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1571        | 0.1447         | -0.0429       | -0.0494        | -0.0749        | -0.0775        |
| 期末基金资产净值      | 95,914,008.79 | 150,459,759.07 | 98,601,069.84 | 142,295,706.82 | 709,023,188.92 | 568,238,490.18 |
| 期末基金份额净值      | 1.1571        | 1.1447         | 0.9571        | 0.9506         | 0.9251         | 0.9225         |
| 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   | 15.71%        | 14.54%         | -4.29%        | -4.88%         | -7.49%         | -7.69%         |

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金 300 指数增强 A

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

|                |        |       |         |       |        |        |
|----------------|--------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.55%  | 1.01% | -0.20%  | 0.90% | 1.75%  | 0.11%  |
| 过去六个月          | 15.88% | 0.90% | 16.72%  | 0.86% | -0.84% | 0.04%  |
| 过去一年           | 20.90% | 0.88% | 16.79%  | 0.91% | 4.11%  | -0.03% |
| 过去三年           | 19.54% | 1.06% | 18.82%  | 1.02% | 0.72%  | 0.04%  |
| 过去五年           | -8.74% | 1.15% | -10.22% | 1.08% | 1.48%  | 0.07%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 15.71% | 1.19% | 21.00%  | 1.14% | -5.29% | 0.05%  |

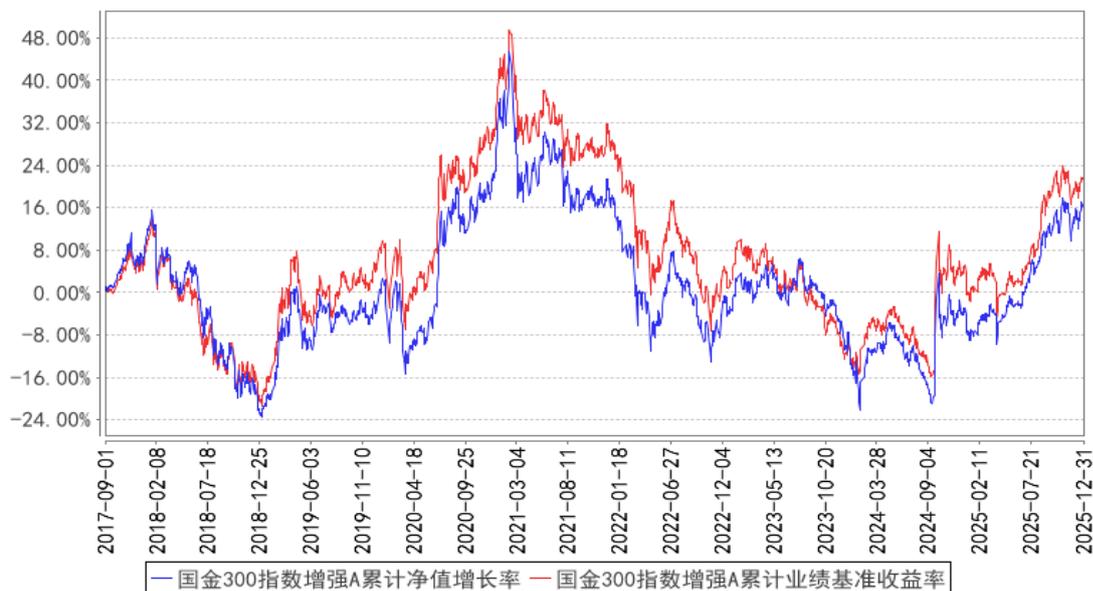
国金 300 指数增强 C

| 阶段             | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 1.45%    | 1.01%       | -0.20%     | 0.90%         | 1.65%  | 0.11%  |
| 过去六个月          | 15.65%   | 0.90%       | 16.72%     | 0.86%         | -1.07% | 0.04%  |
| 过去一年           | 20.42%   | 0.88%       | 16.79%     | 0.91%         | 3.63%  | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 14.54%   | 1.06%       | 14.00%     | 1.02%         | 0.54%  | 0.04%  |

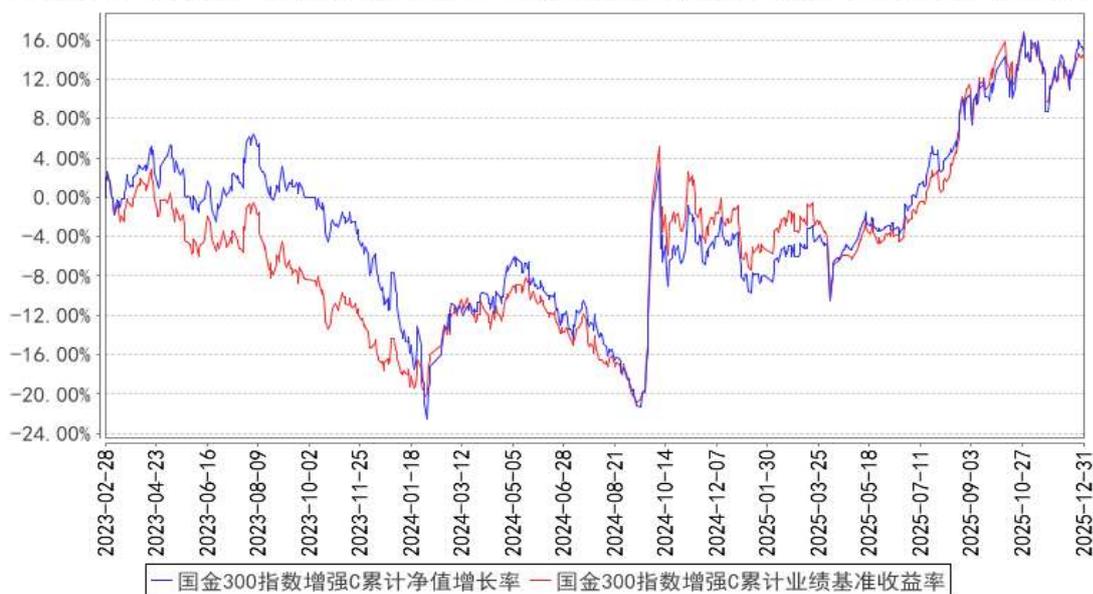
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%。

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

国金300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



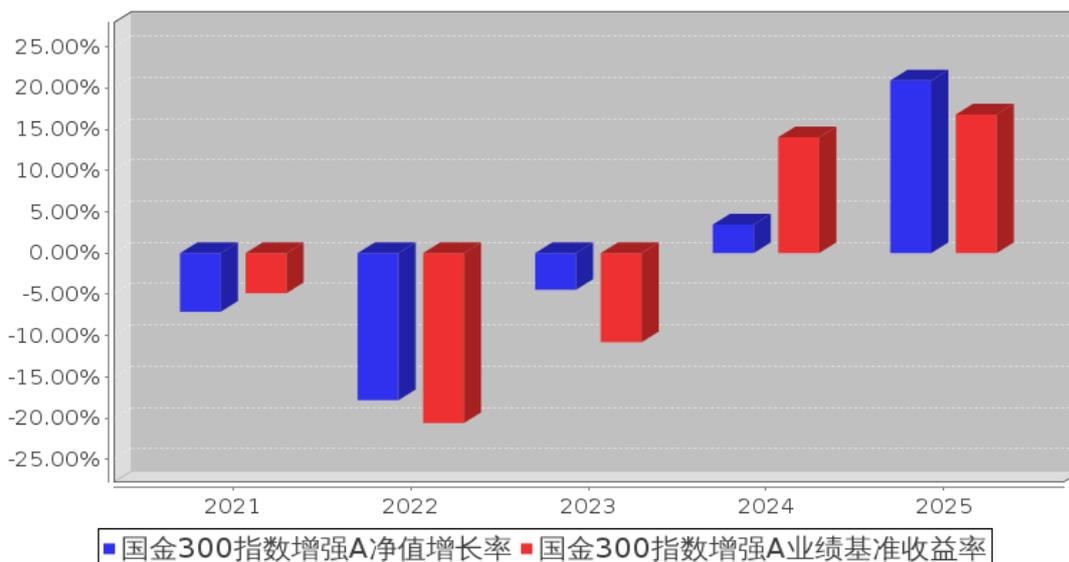
国金300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



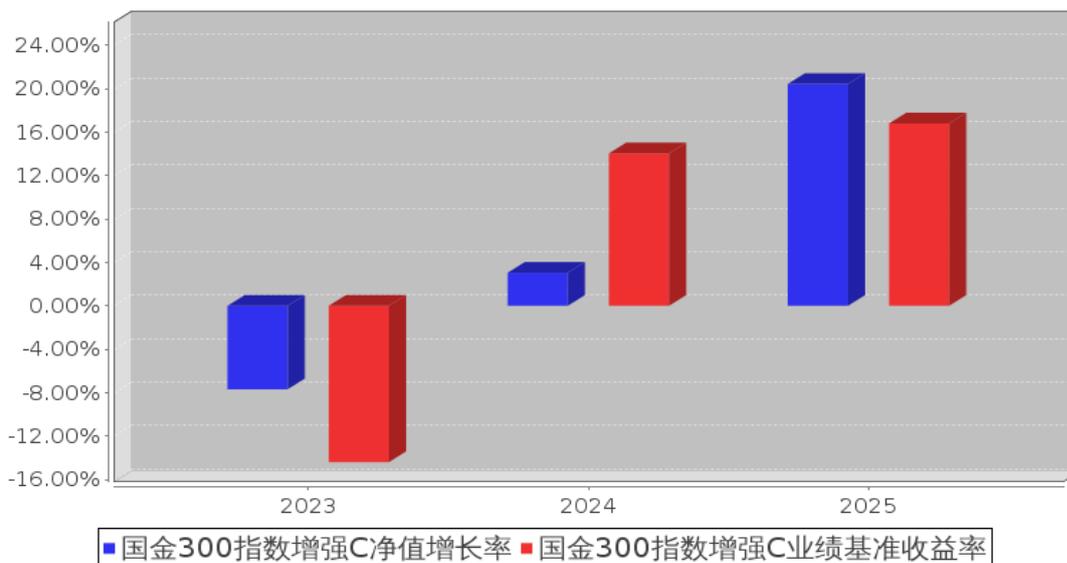
注：本基金由原“国金沪深 300 指数分级证券投资基金”于 2017 年 9 月 1 日转型而来。本基金 A 类份额基金合同生效日为 2017 年 9 月 1 日，图示日期为 2017 年 9 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2023 年 2 月 28 日，图示日期为 2023 年 2 月 28 日至 2025 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年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300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300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 C 类份额基金合同生效日为 2023 年 2 月 28 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 | 2022 年 11 月 14 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《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，本基金更加强调对跟踪误差的合理控制，力求提升风险调整后收益，风险收益特征基本符合预期。

#### 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 1.1571 元，累计单位净值为 1.1571 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 20.90%，同期业绩比较基准增长率为 16.79%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.1447 元，累计单位净值为 1.1447 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 20.42%，同期业绩比较基准增长率为 16.79%。

#### 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遵规守信情况声明

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

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

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

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2025 年年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 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_A11 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 | 国金沪深 300 指数增强证券投资基金全体基金份额持有人                                      |
| 审计意见    | 我们审计了国金沪深 300 指数增强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 |

|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | <p>润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国金沪深 300 指数增强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，公允反映了国金沪深 300 指数增强证券投资基金 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。</p>   |
| 形成审计意见的基础       | <p>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要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金沪深 300 指数增强证券投资基金，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>                                |
| 强调事项            | 无   |
| 其他事项            | 无   |
| 其他信息            | <p>国金沪深 300 指数增强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> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <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沪深 300 指数增强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沪深 300 指数增强证券投资基金的财务报告过程。</p>                                       |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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，就可能对国金沪深 300 指数增强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沪深 300 指数增强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：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

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<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 货币资金       | 7.4.7.1 | 15,083,442.13           | 12,698,992.79            |
| 结算备付金      |         | 1,746,237.40            | 2,397,753.76             |
| 存出保证金      |         | 378,396.94              | 541,483.07               |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 230,502,412.17          | 229,923,768.44           |
| 其中：股票投资    |         | 230,502,412.17          | 223,847,964.60           |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | -                          | 6,075,803.84                |
| 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         |            | 809,534.46                 | 5,349,869.11                |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 68,214.27                  | 1,582,701.88                |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 248,588,237.37             | 252,494,569.05              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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         |            | 729,479.47                 | 9,356,737.97                |
| 应付管理人报酬       |            | 225,411.27                 | 223,328.95                  |
| 应付托管费         |            | 45,082.24                  | 44,665.81                   |
| 应付销售服务费       |            | 57,578.94                  | 55,139.97                   |
| 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    | 1,156,917.59               | 1,917,919.69                |
| 负债合计          |            | 2,214,469.51               | 11,597,792.39               |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 214,332,616.67             | 252,711,893.99              |
| 其他综合收益        | 7.4.7.11   | -                          | -                           |
| 未分配利润         | 7.4.7.12   | 32,041,151.19              | -11,815,117.33              |
| 净资产合计         |            | 246,373,767.86             | 240,896,776.66              |
| 负债和净资产总计      |            | 248,588,237.37             | 252,494,569.05              |

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，国金 300 指数增强 A 基金份额净值 1.1571 元，基金份额总额 82,889,448.87 份；国金 300 指数增强 C 基金份额净值 1.1447 元，基金份额总额 131,443,167.80 份。国金 300 指数增强份额总额合计为 214,332,616.67 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

本报告期：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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 88,075,049.97                             | 16,012,400.31                                  |
| 1. 利息收入                |            | 173,945.73                                | 457,915.33                                     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.13   | 147,570.89                                | 447,973.53                                     |
| 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             |            | 26,374.84                                 | 9,941.80                                       |
| 其他利息收入                 |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 83,208,371.43                             | -21,723,519.44                                 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.14   | 73,539,126.21                             | -40,078,899.89                                 |
| 基金投资收益                 |            | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.15   | 21,795.16                                 | 348,135.46                                     |
| 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   | 9,647,450.06                              | 18,007,244.99                                  |
| 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   | 4,632,085.09                              | 36,316,580.39                                  |
| 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   | 60,647.72                                 | 961,424.03                                     |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 5,616,749.71                              | 12,163,378.89                                  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 3,634,875.22                              | 7,992,105.88                                   |

|                            |            |                      |                     |
|----------------------------|------------|----------------------|---------------------|
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -                    | -                   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 726,974.92           | 1,598,421.17        |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 1,050,278.33         | 2,173,803.20        |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                    | -                   |
| 5. 利息支出                    |            | 732.00               | 4,048.64            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 732.00               | 4,048.64            |
| 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   | 203,889.24           | 395,000.00          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>82,458,300.26</b> | <b>3,849,021.42</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>82,458,300.26</b> | <b>3,849,021.42</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>             | <b>-</b>            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>82,458,300.26</b> | <b>3,849,021.42</b> |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>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             | 252,711,893.99                         | -      | -11,815,117.33 | 240,896,776.66 |
| 加：会计政策变更              | -                                      | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                | -                                      | -      | -              | -              |
| 其他                    | -                                      | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产             | 252,711,893.99                         | -      | -11,815,117.33 | 240,896,776.66 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）  | -38,379,277.32                         | -      | 43,856,268.52  | 5,476,991.20   |
| （一）、综合收益总额            | -                                      | -      | 82,458,300.26  | 82,458,300.26  |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 | -38,379,277.32                         | -      | -38,602,031.74 | -76,981,309.06 |

|  |                                  |        |                 |                   |
|--|----------------------------------|--------|-----------------|-------------------|
| (净资产减少以“-”号填列)                           |                                  |        |                 |                   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 479,728,600.42                   | -      | -13,675,681.06  | 466,052,919.36    |
| 2. 基金赎回款                                 | -518,107,877.74                  | -      | -24,926,350.68  | -543,034,228.42   |
| (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                                | 214,332,616.67                   | -      | 32,041,151.19   | 246,373,767.86    |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 1,382,358,227.13                 | -      | -105,096,548.03 | 1,277,261,679.10  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                | -      | -               | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                | -      | -               | -                 |
| 其他                                       | -                                | -      | -               | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,382,358,227.13                 | -      | -105,096,548.03 | 1,277,261,679.10  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -1,129,646,333.14                | -      | 93,281,430.70   | -1,036,364,902.44 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                | -      | 3,849,021.42    | 3,849,021.42      |
| (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)      | -1,129,646,333.14                | -      | 89,432,409.28   | -1,040,213,923.86 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,088,447,641.                   | -      | -129,202,132.5  | 959,245,509.38    |

|  |                   |   |                |                   |
|--|-------------------|---|----------------|-------------------|
|  | 96                |   | 8              |                   |
| 2. 基金赎回款                                 | -2,218,093,975.10 | - | 218,634,541.86 | -1,999,459,433.24 |
| (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                                | 252,711,893.99    | - | -11,815,117.33 | 240,896,776.66    |

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：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国金沪深 300 指数增强证券投资基金（以下简称“本基金”）由国金沪深 300 指数分级证券投资基金（以下简称“国金 300 指数分级”）变更注册而来，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]646 号文《关于准予国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复》注册，国金沪深 300 指数分级的基金合同于 2013 年 7 月 26 日生效并于 2017 年 9 月 1 日失效，本基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效，本基金首次设立募集规模为 323,127,755.17 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国金基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于 2023 年 2 月 28 日增设 C 类基金份额类别，本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有的风险。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

#### 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           | 15,083,442.13    | 12,698,992.79    |
| 等于：本金          | 15,081,768.25    | 12,696,029.07    |
| 加：应计利息         | 1,673.88         | 2,963.72         |
| 减：坏账准备         | -                | -                |
| 定期存款           | -                | -                |
| 等于：本金          | -                | -                |
| 加：应计利息         | -                | -                |
| 减：坏账准备         | -                | -                |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                | -                |
| 存款期限 1-3 个月    | -                | -                |
| 存款期限 3 个月以上    | -                | -                |
| 其他存款           | -                | -                |
| 等于：本金          | -                | -                |
| 加：应计利息         | -                | -                |
| 减：坏账准备         | -                | -                |
| 合计             | 15,083,442.13    | 12,698,992.79    |

## 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            |                  | 223,934,604.21 | -    | 230,502,412.17 | 6,567,807.96 |
| 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            |                  | 223,934,604.21 | -    | 230,502,412.17 | 6,567,807.96 |
| 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            |                  | 221,914,440.73 | -    | 223,847,964.60 | 1,933,523.87 |
| 贵金属投资-金交所     |                  | -              | -    | -              | -            |

|        |       |                |           |                |              |
|--------|-------|----------------|-----------|----------------|--------------|
| 黄金合约   |       |                |           |                |              |
| 债券     | 交易所市场 | 6,008,001.00   | 65,603.84 | 6,075,803.84   | 2,199.00     |
|        | 银行间市场 | -              | -         | -              | -            |
|        | 合计    | 6,008,001.00   | 65,603.84 | 6,075,803.84   | 2,199.00     |
| 资产支持证券 |       | -              | -         | -              | -            |
| 基金     |       | -              | -         | -              | -            |
| 其他     |       | -              | -         | -              | -            |
| 合计     |       | 227,922,441.73 | 65,603.84 | 229,923,768.44 | 1,935,722.87 |

#### 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<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 182.66                  | 1,586.59                 |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 996,734.93              | 1,791,333.10             |
| 其中：交易所市场    | 996,734.93              | 1,791,333.10             |
| 银行间市场       | -                       | -                        |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 160,000.00              | 75,000.00                |
| 应付指数使用费     | -                       | 50,000.00                |
| 合计          | 1,156,917.59            | 1,917,919.69             |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金 300 指数增强 A

| 项目            | 本期<br>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          | 103,017,905.59                         | 103,017,905.59 |
| 本期申购          | 54,991,653.58                          | 54,991,653.58  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -75,120,110.30                         | -75,120,110.30 |
| 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           | 82,889,448.87                          | 82,889,448.87  |

国金 300 指数增强 C

| 项目   | 本期<br>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 | 149,693,988.40                         | 149,693,988.40 |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期申购          | 424,736,946.84  | 424,736,946.84  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -442,987,767.44 | -442,987,767.44 |
| 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           | 131,443,167.80  | 131,443,167.80  |

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 300 指数增强 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计       |
|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 上年度末           | 14,082,168.57  | -18,499,004.32 | -4,416,835.75 |
| 加：会计政策变更       | -              | -              | -             |
| 前期差错更正         | -              | -              | -             |
| 其他             | -              | -              | -             |
| 本期期初           | 14,082,168.57  | -18,499,004.32 | -4,416,835.75 |
| 本期利润           | 20,126,870.95  | 760,481.50     | 20,887,352.45 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,437,088.04  | 991,131.26     | -3,445,956.78 |
| 其中：基金申购款       | 6,484,774.19   | -7,447,175.31  | -962,401.12   |
| 基金赎回款          | -10,921,862.23 | 8,438,306.57   | -2,483,555.66 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -             |
| 本期末            | 29,771,951.48  | -16,747,391.56 | 13,024,559.92 |

国金 300 指数增强 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 7,513,426.91   | -14,911,708.49 | -7,398,281.58  |
| 加：会计政策变更       | -              | -              | -              |
| 前期差错更正         | -              | -              | -              |
| 其他             | -              | -              | -              |
| 本期期初           | 7,513,426.91   | -14,911,708.49 | -7,398,281.58  |
| 本期利润           | 57,699,344.22  | 3,871,603.59   | 61,570,947.81  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -31,731,036.58 | -3,425,038.38  | -35,156,074.96 |
| 其中：基金申购款       | 30,460,733.47  | -43,174,013.41 | -12,713,279.94 |
| 基金赎回款          | -62,191,770.05 | 39,748,975.03  | -22,442,795.02 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 33,481,734.55  | -14,465,143.28 | 19,016,591.27  |

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 111,738.62                  | 346,834.90                       |
| 定期存款利息收入  | -                           | -                                |
| 其他存款利息收入  | -                           | -                                |
| 结算备付金利息收入 | 7,484.69                    | 90,596.91                        |
| 其他        | 28,347.58                   | 10,541.72                        |
| 合计        | 147,570.89                  | 447,973.53                       |

## 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<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 73,539,126.21               | -40,078,899.89                   |
| 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               | 73,539,126.21               | -40,078,899.89                   |

## 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<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 3,145,326,225.38            | 8,861,188,165.16                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,068,598,332.00            | 8,889,191,585.35                 |
| 减：交易费用     | 3,188,767.17                | 12,075,479.70                    |
| 买卖股票差价收入   | 73,539,126.21               | -40,078,899.89                   |

## 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

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 29,796.16                   | 306,293.02                       |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -8,001.00                   | 41,842.44                        |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                           | -                                |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                           | -                                |
| 合计                           | 21,795.16                   | 348,135.46                       |

## 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 6,095,400.00                | 62,716,534.46                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,008,001.00                | 61,980,434.00                    |
| 减：应计利息总额               | 95,400.00                   | 694,258.02                       |
| 减：交易费用                 | -                           | -                                |
| 买卖债券差价收入               | -8,001.00                   | 41,842.44                        |

## 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 资产支持证券投资收益

## 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   | 9,647,450.06          | 18,007,244.99         |
| 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            | 9,647,450.06          | 18,007,244.99         |

## 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             | 4,632,085.09 | 36,316,580.39 |
| 股票投资                   | 4,634,284.09 | 36,311,281.39 |
| 债券投资                   | -2,199.00    | 5,299.00      |
| 资产支持证券投资               | -            | -             |
| 基金投资                   | -            | -             |
| 贵金属投资                  | -            | -             |
| 其他                     | -            | -             |
| 2. 衍生工具                | -            | -             |
| 权证投资                   | -            | -             |
| 3. 其他                  | -            | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -            | -             |
| 合计                     | 4,632,085.09 | 36,316,580.39 |

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 60,647.72                   | 961,424.03                       |
| 合计      | 60,647.72                   | 961,424.03                       |

#### 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<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 40,000.00                   | 75,000.00                        |
| 信息披露费   | 120,000.00                  | 120,000.00                       |
| 证券出借违约金 | -                           | -                                |
| 指数使用费   | 43,889.24                   | 200,000.00                       |
| 合计      | 203,889.24                  | 395,000.00                       |

注：自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数许可使用费调整为基金管理人承担。

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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<br>2025年1月1日至2025年12月31日 |                 | 上年度可比期间<br>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 | 1,627,702,834.95            | 26.19           | 5,306,080,703.50                 | 31.66           |

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|
|-------|-----------------------------|----------------------------------|

|            | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 (%) |
|------------|------|------------------|---------------|------------------|
| 国金证券股份有限公司 | -    | -                | 80,668,401.74 | 88.81            |

#### 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<br>2025年1月1日至2025年12月31日 |                    | 上年度可比期间<br>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 | 128,500,000.00              | 26.62              | 102,000,000.00                   | 78.41              |

#### 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<br>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 | 318,872.00                       | 26.19          | 131,251.41 | 13.17            |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>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 | 2,010,651.72                     | 30.60          | 348,575.14 | 19.46            |

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<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>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   | 3,634,875.22 | 7,992,105.88 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 829,027.40   | 1,679,840.79 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 2,805,847.82 | 6,312,265.09 |

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

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>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 | 726,974.92                             | 1,598,421.17                                |

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

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 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 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|--|
|             |  |

| 方名称            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |               |              |
|----------------|---|---------------|--------------|
|                | 国金 300 指数增强 A                               | 国金 300 指数增强 C | 合计           |
| 国金基金管理有限公司     | -   | 478,290.80    | 478,290.80   |
| 国金证券股份有限公司     | -   | 33,570.43     | 33,570.43    |
| 合计             | -   | 511,861.23    | 511,861.23   |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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 300 指数增强 A                               | 国金 300 指数增强 C | 合计           |
| 国金基金管理有限公司     | -   | 1,293,746.32  | 1,293,746.32 |
| 国金证券股份有限公司     | -   | 92,157.47     | 92,157.47    |
| 合计             | -   | 1,385,903.79  | 1,385,903.79 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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<br>2025年1月1日至2025年12月<br>31日 |            | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国光大银行股份有限公司-活期存款 | 15,083,442.13                   | 111,738.62 | 12,698,992.79                    | 346,834.90 |

注：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

于本报告期内，本基金（因关联方名单更新而被动）持有并卖出管理人关联方发行的证券海光信息 3,487 股，成交总额为 498,698.41 元。（上年度可比期间：无其他关联交易事项）

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

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 |
| 001221               | 悍高集团 | 2025年7月23日 | 6个月 | 锁定期股票流通受限 | 15.43 | 56.94  | 67       | 1,033.81 | 3,814.98 | -  |
| 001388               | 信通   | 2025年6月    | 6个月 | 锁定期股      | 16.42 | 42.94  | 52       | 853.84   | 2,232.88 | -  |

|        |      |                  |      |           |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------------|------|-----------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        | 电子   | 24 日             |      | 票流通受限     |       |       |       |           |           |   |
| 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  | - |
| 301632 | 广东建科 | 2025 年 8 月 5 日   | 6 个月 | 锁定期股票流通受限 | 6.56  | 23.68 | 306   | 2,007.36  | 7,246.08  | - |
| 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 | 2,028 | 11,539.32 | 28,817.88 | - |
| 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 | 3,429 | 42,793.92 | 87,302.34 | - |
| 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 | 82    | 1,525.20  | 3,800.70  | - |
| 603406 | 天    | 2025             | 6 个月 | 锁定        | 23.60 | 40.16 | 61    | 1,439.60  | 2,449.76  | - |

|        |      |             |     |           |        |        |       |          |           |   |
|--------|------|-------------|-----|-----------|--------|--------|-------|----------|-----------|---|
|        | 富龙   | 年7月30日      |     | 期股票流通受限   |        |        |       |          |           |   |
| 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  | 1,008 | 8,688.96 | 18,506.88 | - |
| 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 | 55    | 6,285.40 | 22,889.90 | - |

#### 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 |
|--------|------|-------------|--------|--------|-----------|--------|-------|--------------|--------------|----|
| 688012 | 中微公司 | 2025年12月19日 | 重大事项停牌 | 272.72 | 2026年1月5日 | 278.00 | 3,739 | 1,017,447.92 | 1,019,700.08 | -  |

#### 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<br>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                | 15,083,442.13 | -     | -            | -    | -    | -               | 15,083,442.13  |
| 结算备付金               | 1,746,237.40  | -     | -            | -    | -    | -               | 1,746,237.40   |
| 存出保证金               | 378,396.94    | -     | -            | -    | -    | -               | 378,396.94     |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -            | -    | -    | -230,502,412.17 | 230,502,412.17 |
| 应收申购款               | -             | -     | -            | -    | -    | 68,214.27       | 68,214.27      |
| 应收清算款               | -             | -     | -            | -    | -    | 809,534.46      | 809,534.46     |
| 资产总计                | 17,208,076.47 | -     | -            | -    | -    | -231,380,160.90 | 248,588,237.37 |
| 负债                  |               |       |              |      |      |                 |                |
| 应付赎回款               | -             | -     | -            | -    | -    | 729,479.47      | 729,479.47     |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -            | -    | -    | 225,411.27      | 225,411.27     |
| 应付托管费               | -             | -     | -            | -    | -    | 45,082.24       | 45,082.24      |
| 应付销售服务费             | -             | -     | -            | -    | -    | 57,578.94       | 57,578.94      |
| 其他负债                | -             | -     | -            | -    | -    | 1,156,917.59    | 1,156,917.59   |
| 负债总计                | -             | -     | -            | -    | -    | 2,214,469.51    | 2,214,469.51   |
| 利率敏感度缺口             | 17,208,076.47 | -     | -            | -    | -    | -229,165,691.39 | 246,373,767.86 |
| 上年度末<br>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                | 12,698,992.79 | -     | -            | -    | -    | -               | 12,698,992.79  |
| 结算备付金               | 2,397,753.76  | -     | -            | -    | -    | -               | 2,397,753.76   |
| 存出保证金               | 541,483.07    | -     | -            | -    | -    | -               | 541,483.07     |
| 交易性金融资              | -             | -     | 6,075,803.84 | -    | -    | -223,847,964.60 | 229,923,768.44 |

|         |               |               |   |   |                 |                 |                |
|---------|---------------|---------------|---|---|-----------------|-----------------|----------------|
| 产       |               |               |   |   |                 |                 |                |
| 应收清算款   | -             | -             | - | - | -               | 5,349,869.11    | 5,349,869.11   |
| 应收申购款   | -             | -             | - | - | -               | 1,582,701.88    | 1,582,701.88   |
| 资产总计    | 15,638,229.62 | -6,075,803.84 | - | - | -230,780,535.59 | 252,494,569.05  |                |
| 负债      |               |               |   |   |                 |                 |                |
| 应付赎回款   | -             | -             | - | - | -               | 9,356,737.97    | 9,356,737.97   |
| 应付管理人报酬 | -             | -             | - | - | -               | 223,328.95      | 223,328.95     |
| 应付托管费   | -             | -             | - | - | -               | 44,665.81       | 44,665.81      |
| 应付销售服务费 | -             | -             | - | - | -               | 55,139.97       | 55,139.97      |
| 其他负债    | -             | -             | - | - | -               | 1,917,919.69    | 1,917,919.69   |
| 负债总计    | -             | -             | - | - | -               | 11,597,792.39   | 11,597,792.39  |
| 利率敏感度缺口 | 15,638,229.62 | -6,075,803.84 | - | - | -               | -219,182,743.20 | 240,896,776.66 |

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<br>2025 年 12 月 31 日 |                   | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|-------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 230,502,412.17          | 93.56             | 223,847,964.60           | 92.92             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                       | -                 | -                        | -                 |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                       | -                 | 6,075,803.84             | 2.52              |
| 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            | 230,502,412.17          | 93.56             | 229,923,768.44           | 95.44             |

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 | 假定沪深 300 指数 (000300.SH) 变化 5%，其他变量不变；                           |                             |                        |
|    | Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。 |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |   | 本期末（2025 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | +5%   | 10,871,290.08               | 11,488,187.97          |
|    | -5%   | -10,871,290.08              | -11,488,187.97         |

## 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<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 229,273,091.96          | 223,847,964.60           |
| 第二层次          | 1,019,700.08            | 6,075,803.84             |
| 第三层次          | 209,620.13              | -                        |
| 合计            | 230,502,412.17          | 229,923,768.44           |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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         | -                                      | -          | -          |
| 当期购买         | -                                      | 90,148.86  | 90,148.86  |
| 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    | -                                      | 119,471.27 | 119,471.27 |
| 其中：计入损益的利得或损 | -                                      | 119,471.27 | 119,471.27 |

|  |                                  |            |            |
|--|----------------------------------|------------|------------|
| 失  |                                  |            |            |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -          | -          |
| 期末余额                                       | -                                | 209,620.13 | 209,620.13 |
| 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 | -                                | 119,471.27 | 119,471.27 |
| 项目   | 上年度可比期间<br>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                             | -          |            |
| 期初余额                                       | -                                | -          | -          |
| 当期购买                                       | -                                | -          | -          |
| 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                                  | -                                | -          | -          |
| 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 |
| 限售股票 | 209,620.13 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 0.1800-3.0323 | 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              | 230,502,412.17 | 92.72         |
|    | 其中：股票             | 230,502,412.17 | 92.72         |
| 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      | 16,829,679.53  | 6.77          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,256,145.67   | 0.51          |
| 9  | 合计                | 248,588,237.37 | 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 | 586,728.00     | 0.24          |
| B  | 采矿业      | 13,656,516.00  | 5.54          |
| C  | 制造业      | 122,250,626.76 | 49.62         |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,606,540.00   | 1.46  |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,999,324.00   | 2.44  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 6,562,766.97   | 2.66  |
| J | 金融业              | 26,732,286.38  | 10.85 |
| K | 房地产业             | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | 2,609,856.00   | 1.06  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 3,389,936.00   | 1.38  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 185,394,580.11 | 75.25 |

### 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         | 1,203,182.00  | 0.49         |
| B  | 采矿业              | 346,094.00    | 0.14         |
| C  | 制造业              | 29,970,910.94 | 12.16        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,150,823.00  | 0.87         |
| E  | 建筑业              | 761,178.00    | 0.31         |
| F  | 批发和零售业           | 2,807,089.00  | 1.14         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 660,001.00    | 0.27         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,305,668.93  | 0.94         |
| J  | 金融业              | 2,007,272.00  | 0.81         |
| K  | 房地产业             | 43,504.00     | 0.02         |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业      | 804,754.00    | 0.33  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 217,535.84    | 0.09  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,606,964.35  | 0.65  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 201,405.00    | 0.08  |
| S | 综合            | 21,450.00     | 0.01  |
|   | 合计            | 45,107,832.06 | 18.31 |

### 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  | 300750 | 宁德时代 | 28,760  | 10,562,397.60 | 4.29         |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 16,000  | 9,760,000.00  | 3.96         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 5,679   | 7,821,005.22  | 3.17         |
| 4  | 300274 | 阳光电源 | 39,400  | 6,738,976.00  | 2.74         |
| 5  | 300059 | 东方财富 | 197,500 | 4,578,050.00  | 1.86         |
| 6  | 002475 | 立讯精密 | 78,000  | 4,423,380.00  | 1.80         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 55,900  | 4,368,585.00  | 1.77         |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药 | 61,000  | 3,633,770.00  | 1.47         |
| 9  | 601288 | 农业银行 | 451,600 | 3,468,288.00  | 1.41         |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 7,385   | 3,390,305.80  | 1.38         |
| 11 | 603259 | 药明康德 | 37,400  | 3,389,936.00  | 1.38         |
| 12 | 000651 | 格力电器 | 82,800  | 3,330,216.00  | 1.35         |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 40,136  | 3,077,628.48  | 1.25         |
| 14 | 300502 | 新易盛  | 6,860   | 2,955,836.80  | 1.20         |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 75,600  | 2,860,704.00  | 1.16         |
| 16 | 600031 | 三一重工 | 128,400 | 2,713,092.00  | 1.10         |
| 17 | 601888 | 中国中免 | 27,600  | 2,609,856.00  | 1.06         |
| 18 | 601816 | 京沪高铁 | 504,900 | 2,600,235.00  | 1.06         |
| 19 | 300033 | 同花顺  | 7,900   | 2,545,222.00  | 1.03         |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 143,500 | 2,468,200.00  | 1.00         |
| 21 | 600690 | 海尔智家 | 92,000  | 2,400,280.00  | 0.97         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 22 | 601857 | 中国石油 | 227,700 | 2,370,357.00 | 0.96 |
| 23 | 601688 | 华泰证券 | 99,200  | 2,340,128.00 | 0.95 |
| 24 | 000792 | 盐湖股份 | 83,000  | 2,337,280.00 | 0.95 |
| 25 | 600111 | 北方稀土 | 49,700  | 2,292,164.00 | 0.93 |
| 26 | 000408 | 藏格矿业 | 27,000  | 2,278,800.00 | 0.92 |
| 27 | 000568 | 泸州老窖 | 19,500  | 2,266,290.00 | 0.92 |
| 28 | 601138 | 工业富联 | 36,000  | 2,233,800.00 | 0.91 |
| 29 | 600089 | 特变电工 | 100,500 | 2,233,110.00 | 0.91 |
| 30 | 601919 | 中远海控 | 146,800 | 2,228,424.00 | 0.90 |
| 31 | 002463 | 沪电股份 | 29,900  | 2,184,793.00 | 0.89 |
| 32 | 600926 | 杭州银行 | 142,300 | 2,174,344.00 | 0.88 |
| 33 | 601225 | 陕西煤业 | 101,700 | 2,168,244.00 | 0.88 |
| 34 | 601009 | 南京银行 | 188,200 | 2,151,126.00 | 0.87 |
| 35 | 688472 | 阿特斯  | 141,601 | 2,111,270.91 | 0.86 |
| 36 | 600010 | 包钢股份 | 860,900 | 2,048,942.00 | 0.83 |
| 37 | 601088 | 中国神华 | 50,400  | 2,041,200.00 | 0.83 |
| 38 | 601336 | 新华保险 | 28,900  | 2,014,330.00 | 0.82 |
| 39 | 601766 | 中国中车 | 291,600 | 1,988,712.00 | 0.81 |
| 40 | 688111 | 金山办公 | 6,291   | 1,931,777.37 | 0.78 |
| 41 | 600989 | 宝丰能源 | 95,800  | 1,880,554.00 | 0.76 |
| 42 | 002736 | 国信证券 | 139,900 | 1,835,488.00 | 0.75 |
| 43 | 603799 | 华友钴业 | 26,800  | 1,829,368.00 | 0.74 |
| 44 | 601012 | 隆基绿能 | 98,300  | 1,789,060.00 | 0.73 |
| 45 | 601985 | 中国核电 | 201,200 | 1,740,380.00 | 0.71 |
| 46 | 002466 | 天齐锂业 | 30,900  | 1,711,242.00 | 0.69 |
| 47 | 601100 | 恒立液压 | 15,500  | 1,703,605.00 | 0.69 |
| 48 | 000617 | 中油资本 | 177,000 | 1,699,200.00 | 0.69 |
| 49 | 600406 | 国电南瑞 | 75,000  | 1,686,000.00 | 0.68 |
| 50 | 600760 | 中航沈飞 | 29,900  | 1,678,885.00 | 0.68 |
| 51 | 601898 | 中煤能源 | 130,700 | 1,625,908.00 | 0.66 |
| 52 | 603993 | 洛阳钼业 | 80,800  | 1,616,000.00 | 0.66 |
| 53 | 003816 | 中国广核 | 429,700 | 1,615,672.00 | 0.66 |
| 54 | 600150 | 中国船舶 | 48,400  | 1,609,784.00 | 0.65 |
| 55 | 600438 | 通威股份 | 78,100  | 1,602,612.00 | 0.65 |
| 56 | 601319 | 中国人保 | 171,200 | 1,532,240.00 | 0.62 |
| 57 | 300433 | 蓝思科技 | 50,411  | 1,525,940.97 | 0.62 |
| 58 | 601728 | 中国电信 | 236,800 | 1,491,840.00 | 0.61 |
| 59 | 688256 | 寒武纪  | 1,072   | 1,453,149.60 | 0.59 |
| 60 | 600346 | 恒力石化 | 63,500  | 1,430,655.00 | 0.58 |
| 61 | 000166 | 申万宏源 | 268,594 | 1,415,490.38 | 0.57 |
| 62 | 603288 | 海天味业 | 37,100  | 1,373,442.00 | 0.56 |
| 63 | 601633 | 长城汽车 | 53,631  | 1,213,669.53 | 0.49 |
| 64 | 600547 | 山东黄金 | 31,000  | 1,200,010.00 | 0.49 |

|    |        |       |        |              |      |
|----|--------|-------|--------|--------------|------|
| 65 | 600188 | 兖矿能源  | 89,300 | 1,174,295.00 | 0.48 |
| 66 | 002938 | 鹏鼎控股  | 23,000 | 1,163,340.00 | 0.47 |
| 67 | 603019 | 中科曙光  | 13,400 | 1,147,576.00 | 0.47 |
| 68 | 600938 | 中国海油  | 37,200 | 1,122,696.00 | 0.46 |
| 69 | 002352 | 顺丰控股  | 28,100 | 1,076,792.00 | 0.44 |
| 70 | 600183 | 生益科技  | 14,800 | 1,056,868.00 | 0.43 |
| 71 | 688012 | 中微公司  | 3,739  | 1,019,700.08 | 0.41 |
| 72 | 688981 | 中芯国际  | 7,979  | 980,060.57   | 0.40 |
| 73 | 002028 | 思源电气  | 5,300  | 819,327.00   | 0.33 |
| 74 | 300999 | 金龙鱼   | 28,100 | 807,594.00   | 0.33 |
| 75 | 002241 | 歌尔股份  | 26,700 | 767,091.00   | 0.31 |
| 76 | 002594 | 比亚迪   | 7,000  | 684,040.00   | 0.28 |
| 77 | 300014 | 亿纬锂能  | 9,700  | 637,872.00   | 0.26 |
| 78 | 002714 | 牧原股份  | 11,600 | 586,728.00   | 0.24 |
| 79 | 605499 | 东鹏饮料  | 2,000  | 534,780.00   | 0.22 |
| 80 | 600919 | 江苏银行  | 51,200 | 532,480.00   | 0.22 |
| 81 | 600918 | 中泰证券  | 68,600 | 445,900.00   | 0.18 |
| 82 | 601899 | 紫金矿业  | 9,800  | 337,806.00   | 0.14 |
| 83 | 000725 | 京东方 A | 67,100 | 282,491.00   | 0.11 |
| 84 | 600795 | 国电电力  | 49,700 | 250,488.00   | 0.10 |
| 85 | 600426 | 华鲁恒升  | 5,400  | 169,722.00   | 0.07 |
| 86 | 300124 | 汇川技术  | 2,200  | 165,726.00   | 0.07 |
| 87 | 688008 | 澜起科技  | 1,291  | 152,079.80   | 0.06 |
| 88 | 601111 | 中国国航  | 5,100  | 47,787.00    | 0.02 |
| 89 | 600018 | 上港集团  | 8,200  | 44,444.00    | 0.02 |
| 90 | 603986 | 兆易创新  | 100    | 21,425.00    | 0.01 |
| 91 | 002460 | 赣锋锂业  | 200    | 12,578.00    | 0.01 |
| 92 | 600233 | 圆通速递  | 100    | 1,642.00     | 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  | 14,000  | 3,427,760.00 | 1.39         |
| 2  | 600487 | 亨通光电 | 83,000  | 2,052,590.00 | 0.83         |
| 3  | 600830 | 香溢融通 | 153,600 | 1,469,952.00 | 0.60         |
| 4  | 300616 | 尚品宅配 | 103,700 | 1,444,541.00 | 0.59         |
| 5  | 603700 | 宁水集团 | 102,500 | 1,392,975.00 | 0.57         |
| 6  | 001309 | 德明利  | 5,500   | 1,275,395.00 | 0.52         |
| 7  | 600021 | 上海电力 | 56,800  | 1,137,136.00 | 0.46         |
| 8  | 688030 | 山石网科 | 60,226  | 1,094,306.42 | 0.44         |
| 9  | 301539 | 宏鑫科技 | 49,900  | 1,042,910.00 | 0.42         |
| 10 | 301526 | 国际复材 | 143,500 | 1,004,500.00 | 0.41         |
| 11 | 688391 | 钜泉科技 | 33,011  | 935,201.63   | 0.38         |
| 12 | 301499 | 维科精密 | 28,900  | 850,527.00   | 0.35         |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 13 | 600573 | 惠泉啤酒 | 67,900  | 810,047.00 | 0.33 |
| 14 | 300187 | 永清环保 | 153,100 | 745,597.00 | 0.30 |
| 15 | 600354 | 敦煌种业 | 112,100 | 725,287.00 | 0.29 |
| 16 | 603968 | 醋化股份 | 64,700  | 722,699.00 | 0.29 |
| 17 | 603900 | 莱绅通灵 | 83,700  | 708,102.00 | 0.29 |
| 18 | 002732 | 燕塘乳业 | 36,900  | 628,038.00 | 0.25 |
| 19 | 002381 | 双箭股份 | 94,900  | 625,391.00 | 0.25 |
| 20 | 300612 | 宣亚国际 | 35,100  | 625,131.00 | 0.25 |
| 21 | 300751 | 迈为股份 | 3,000   | 617,970.00 | 0.25 |
| 22 | 603970 | 中农立华 | 43,700  | 561,982.00 | 0.23 |
| 23 | 688235 | 百济神州 | 2,086   | 560,299.60 | 0.23 |
| 24 | 603929 | 亚翔集成 | 5,700   | 544,350.00 | 0.22 |
| 25 | 603323 | 苏农银行 | 106,400 | 537,320.00 | 0.22 |
| 26 | 300800 | 力合科技 | 45,500  | 529,165.00 | 0.21 |
| 27 | 600127 | 金健米业 | 76,200  | 512,064.00 | 0.21 |
| 28 | 000068 | 华控赛格 | 147,600 | 498,888.00 | 0.20 |
| 29 | 002033 | 丽江股份 | 51,600  | 472,140.00 | 0.19 |
| 30 | 603237 | 五芳斋  | 27,900  | 465,372.00 | 0.19 |
| 31 | 300115 | 长盈精密 | 9,500   | 441,750.00 | 0.18 |
| 32 | 688216 | 气派科技 | 18,017  | 401,418.76 | 0.16 |
| 33 | 600348 | 华阳股份 | 41,900  | 346,094.00 | 0.14 |
| 34 | 000713 | 国投丰乐 | 51,800  | 342,916.00 | 0.14 |
| 35 | 603385 | 惠达卫浴 | 49,270  | 337,006.80 | 0.14 |
| 36 | 601869 | 长飞光纤 | 2,700   | 314,172.00 | 0.13 |
| 37 | 000529 | 广弘控股 | 52,000  | 312,520.00 | 0.13 |
| 38 | 002064 | 华峰化学 | 28,100  | 309,100.00 | 0.13 |
| 39 | 601366 | 利群股份 | 57,000  | 278,160.00 | 0.11 |
| 40 | 301338 | 凯格精机 | 3,000   | 264,330.00 | 0.11 |
| 41 | 001219 | 青岛食品 | 18,400  | 262,200.00 | 0.11 |
| 42 | 688170 | 德龙激光 | 8,236   | 259,104.56 | 0.11 |
| 43 | 603199 | 九华旅游 | 6,900   | 253,644.00 | 0.10 |
| 44 | 002632 | 道明光学 | 19,700  | 245,265.00 | 0.10 |
| 45 | 605567 | 春雪食品 | 21,300  | 234,300.00 | 0.10 |
| 46 | 600479 | 千金药业 | 22,900  | 232,664.00 | 0.09 |
| 47 | 000543 | 皖能电力 | 29,000  | 230,550.00 | 0.09 |
| 48 | 000911 | 广农糖业 | 31,000  | 226,610.00 | 0.09 |
| 49 | 605299 | 舒华体育 | 19,700  | 226,353.00 | 0.09 |
| 50 | 002353 | 杰瑞股份 | 3,100   | 219,573.00 | 0.09 |
| 51 | 002687 | 乔治白  | 44,300  | 213,526.00 | 0.09 |
| 52 | 002999 | 天禾股份 | 31,100  | 212,413.00 | 0.09 |
| 53 | 601518 | 吉林高速 | 74,600  | 210,372.00 | 0.09 |
| 54 | 300438 | 鹏辉能源 | 3,700   | 196,914.00 | 0.08 |
| 55 | 002488 | 金固股份 | 21,700  | 190,743.00 | 0.08 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 56 | 603221 | 爱丽家居 | 14,500 | 189,950.00 | 0.08 |
| 57 | 601065 | 江盐集团 | 22,300 | 185,090.00 | 0.08 |
| 58 | 603167 | 渤海轮渡 | 19,400 | 182,942.00 | 0.07 |
| 59 | 002661 | 克明食品 | 20,000 | 182,800.00 | 0.07 |
| 60 | 000707 | 双环科技 | 30,200 | 182,710.00 | 0.07 |
| 61 | 300475 | 香农芯创 | 1,200  | 173,208.00 | 0.07 |
| 62 | 603327 | 福蓉科技 | 14,700 | 159,642.00 | 0.06 |
| 63 | 600283 | 钱江水利 | 17,400 | 159,210.00 | 0.06 |
| 64 | 603096 | 新经典  | 9,100  | 158,522.00 | 0.06 |
| 65 | 603856 | 东宏股份 | 12,700 | 158,369.00 | 0.06 |
| 66 | 002763 | 汇洁股份 | 21,900 | 158,118.00 | 0.06 |
| 67 | 603836 | 海程邦达 | 11,300 | 155,488.00 | 0.06 |
| 68 | 600488 | 津药药业 | 37,800 | 154,602.00 | 0.06 |
| 69 | 603137 | 恒尚节能 | 11,000 | 151,140.00 | 0.06 |
| 70 | 000893 | 亚钾国际 | 2,900  | 139,113.00 | 0.06 |
| 71 | 603182 | 嘉华股份 | 8,600  | 136,052.00 | 0.06 |
| 72 | 301115 | 联检科技 | 8,500  | 134,385.00 | 0.05 |
| 73 | 601368 | 绿城水务 | 26,900 | 133,424.00 | 0.05 |
| 74 | 300620 | 光库科技 | 900    | 132,345.00 | 0.05 |
| 75 | 688667 | 菱电电控 | 1,879  | 132,319.18 | 0.05 |
| 76 | 688498 | 源杰科技 | 198    | 127,114.02 | 0.05 |
| 77 | 001313 | 粤海饲料 | 16,800 | 122,976.00 | 0.05 |
| 78 | 002443 | 金洲管道 | 14,900 | 121,584.00 | 0.05 |
| 79 | 601061 | 中信金属 | 8,100  | 116,640.00 | 0.05 |
| 80 | 603077 | 和邦生物 | 51,300 | 115,938.00 | 0.05 |
| 81 | 001378 | 德冠新材 | 4,900  | 115,542.00 | 0.05 |
| 82 | 301159 | 三维天地 | 3,100  | 113,987.00 | 0.05 |
| 83 | 603102 | 百合股份 | 2,600  | 111,722.00 | 0.05 |
| 84 | 301223 | 中荣股份 | 5,900  | 108,383.00 | 0.04 |
| 85 | 603689 | 皖天然气 | 12,800 | 103,808.00 | 0.04 |
| 86 | 000619 | 海螺新材 | 15,700 | 97,497.00  | 0.04 |
| 87 | 301116 | 益客食品 | 8,000  | 87,440.00  | 0.04 |
| 88 | 301656 | 联合动力 | 3,429  | 87,302.34  | 0.04 |
| 89 | 001387 | 雪祺电气 | 6,200  | 85,684.00  | 0.03 |
| 90 | 000598 | 兴蓉环境 | 11,100 | 79,587.00  | 0.03 |
| 91 | 300916 | 朗特智能 | 2,400  | 78,672.00  | 0.03 |
| 92 | 000548 | 湖南投资 | 14,200 | 77,248.00  | 0.03 |
| 93 | 002753 | 永东股份 | 10,700 | 76,291.00  | 0.03 |
| 94 | 002671 | 龙泉股份 | 14,500 | 75,980.00  | 0.03 |
| 95 | 601003 | 柳钢股份 | 14,700 | 73,941.00  | 0.03 |
| 96 | 001289 | 龙源电力 | 4,800  | 72,192.00  | 0.03 |
| 97 | 002099 | 海翔药业 | 11,500 | 71,760.00  | 0.03 |
| 98 | 600955 | 维远股份 | 4,400  | 71,280.00  | 0.03 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 99  | 001209 | 洪兴股份 | 3,400  | 70,924.00 | 0.03 |
| 100 | 002483 | 润邦股份 | 9,900  | 70,686.00 | 0.03 |
| 101 | 603759 | 海天股份 | 6,700  | 70,618.00 | 0.03 |
| 102 | 301198 | 喜悦智行 | 5,600  | 70,336.00 | 0.03 |
| 103 | 300365 | 恒华科技 | 11,100 | 70,152.00 | 0.03 |
| 104 | 601156 | 东航物流 | 3,800  | 69,958.00 | 0.03 |
| 105 | 002780 | 三夫户外 | 4,800  | 68,928.00 | 0.03 |
| 106 | 301118 | 恒光股份 | 2,700  | 66,852.00 | 0.03 |
| 107 | 600578 | 京能电力 | 12,900 | 65,790.00 | 0.03 |
| 108 | 688370 | 丛麟科技 | 2,655  | 64,702.35 | 0.03 |
| 109 | 600429 | 三元股份 | 12,000 | 62,160.00 | 0.03 |
| 110 | 600935 | 华塑股份 | 25,100 | 61,495.00 | 0.02 |
| 111 | 300839 | 博汇股份 | 5,100  | 61,404.00 | 0.02 |
| 112 | 001366 | 播恩集团 | 4,500  | 60,165.00 | 0.02 |
| 113 | 300845 | 捷安高科 | 5,200  | 58,604.00 | 0.02 |
| 114 | 600117 | 西宁特钢 | 20,600 | 58,504.00 | 0.02 |
| 115 | 603615 | 茶花股份 | 2,500  | 58,450.00 | 0.02 |
| 116 | 600713 | 南京医药 | 10,600 | 57,876.00 | 0.02 |
| 117 | 300417 | 南华仪器 | 4,100  | 57,359.00 | 0.02 |
| 118 | 000629 | 钒钛股份 | 17,800 | 55,180.00 | 0.02 |
| 119 | 000030 | 富奥股份 | 9,600  | 55,104.00 | 0.02 |
| 120 | 300504 | 天邑股份 | 3,700  | 55,093.00 | 0.02 |
| 121 | 000637 | 茂化实华 | 11,900 | 51,170.00 | 0.02 |
| 122 | 002136 | 安纳达  | 4,100  | 49,774.00 | 0.02 |
| 123 | 603895 | 天永智能 | 1,700  | 49,572.00 | 0.02 |
| 124 | 300667 | 必创科技 | 2,800  | 49,504.00 | 0.02 |
| 125 | 300305 | 裕兴股份 | 8,300  | 49,385.00 | 0.02 |
| 126 | 002330 | 得利斯  | 10,100 | 48,884.00 | 0.02 |
| 127 | 300162 | 雷曼光电 | 6,000  | 48,780.00 | 0.02 |
| 128 | 003030 | 祖名股份 | 2,400  | 48,456.00 | 0.02 |
| 129 | 300837 | 浙矿股份 | 1,400  | 47,628.00 | 0.02 |
| 130 | 002247 | 聚力文化 | 16,900 | 47,489.00 | 0.02 |
| 131 | 301567 | 贝隆精密 | 1,000  | 47,000.00 | 0.02 |
| 132 | 603937 | 丽岛新材 | 3,900  | 46,761.00 | 0.02 |
| 133 | 001201 | 东瑞股份 | 3,200  | 46,624.00 | 0.02 |
| 134 | 002442 | 龙星科技 | 7,500  | 46,575.00 | 0.02 |
| 135 | 600579 | 中化装备 | 5,600  | 46,480.00 | 0.02 |
| 136 | 600981 | 苏豪汇鸿 | 14,800 | 46,472.00 | 0.02 |
| 137 | 002845 | 同兴达  | 3,300  | 46,431.00 | 0.02 |
| 138 | 300929 | 华骐环保 | 4,300  | 46,225.00 | 0.02 |
| 139 | 002726 | 龙大美食 | 11,200 | 46,032.00 | 0.02 |
| 140 | 600982 | 宁波能源 | 10,600 | 46,004.00 | 0.02 |
| 141 | 300884 | 狄耐克  | 3,100  | 45,880.00 | 0.02 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 142 | 002234 | 民和股份 | 5,300  | 45,686.00 | 0.02 |
| 143 | 300868 | 杰美特  | 1,400  | 44,380.00 | 0.02 |
| 144 | 300985 | 致远新能 | 2,400  | 44,040.00 | 0.02 |
| 145 | 000717 | 中南股份 | 16,800 | 43,512.00 | 0.02 |
| 146 | 603999 | 读者传媒 | 6,100  | 42,883.00 | 0.02 |
| 147 | 002110 | 三钢闽光 | 9,700  | 42,583.00 | 0.02 |
| 148 | 301356 | 天振股份 | 1,900  | 40,261.00 | 0.02 |
| 149 | 002755 | 奥赛康  | 2,400  | 39,192.00 | 0.02 |
| 150 | 600159 | 大龙地产 | 14,100 | 39,057.00 | 0.02 |
| 151 | 601996 | 丰林集团 | 17,200 | 38,700.00 | 0.02 |
| 152 | 688455 | 科捷智能 | 1,907  | 38,311.63 | 0.02 |
| 153 | 002566 | 益盛药业 | 4,900  | 37,387.00 | 0.02 |
| 154 | 600561 | 江西长运 | 5,700  | 36,936.00 | 0.01 |
| 155 | 001278 | 一彬科技 | 1,900  | 36,746.00 | 0.01 |
| 156 | 301321 | 翰博高新 | 1,900  | 36,195.00 | 0.01 |
| 157 | 603982 | 泉峰汽车 | 4,300  | 35,991.00 | 0.01 |
| 158 | 300823 | 建科智能 | 2,300  | 35,926.00 | 0.01 |
| 159 | 688655 | 迅捷兴  | 2,063  | 35,339.19 | 0.01 |
| 160 | 603029 | 天鹅股份 | 1,900  | 34,656.00 | 0.01 |
| 161 | 002105 | 信隆健康 | 4,700  | 34,404.00 | 0.01 |
| 162 | 002408 | 齐翔腾达 | 7,000  | 34,160.00 | 0.01 |
| 163 | 601598 | 中国外运 | 5,500  | 33,330.00 | 0.01 |
| 164 | 600303 | 曙光股份 | 10,100 | 32,926.00 | 0.01 |
| 165 | 605008 | 长鸿高科 | 2,300  | 32,821.00 | 0.01 |
| 166 | 603048 | 浙江黎明 | 1,500  | 31,710.00 | 0.01 |
| 167 | 603506 | 南都物业 | 2,400  | 31,344.00 | 0.01 |
| 168 | 000702 | 正虹科技 | 4,600  | 30,728.00 | 0.01 |
| 169 | 301192 | 泰祥股份 | 1,000  | 29,690.00 | 0.01 |
| 170 | 301314 | 科瑞思  | 700    | 29,414.00 | 0.01 |
| 171 | 301638 | 南网数字 | 2,028  | 28,817.88 | 0.01 |
| 172 | 300535 | 达威股份 | 1,600  | 28,576.00 | 0.01 |
| 173 | 300625 | 三雄极光 | 2,400  | 28,440.00 | 0.01 |
| 174 | 000059 | 华锦股份 | 5,300  | 28,355.00 | 0.01 |
| 175 | 301349 | 信德新材 | 600    | 28,146.00 | 0.01 |
| 176 | 605268 | 王力安防 | 2,500  | 26,675.00 | 0.01 |
| 177 | 002541 | 鸿路钢构 | 1,600  | 26,304.00 | 0.01 |
| 178 | 603967 | 中创物流 | 1,900  | 26,087.00 | 0.01 |
| 179 | 688295 | 中复神鹰 | 759    | 24,902.79 | 0.01 |
| 180 | 300664 | 鹏鹞环保 | 4,600  | 24,656.00 | 0.01 |
| 181 | 300838 | 浙江力诺 | 1,600  | 24,400.00 | 0.01 |
| 182 | 603729 | 龙韵股份 | 1,500  | 24,135.00 | 0.01 |
| 183 | 301106 | 骏成科技 | 800    | 23,816.00 | 0.01 |
| 184 | 603677 | 奇精机械 | 1,300  | 23,634.00 | 0.01 |

|     |        |       |       |           |      |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 185 | 300883 | 龙利得   | 3,500 | 23,625.00 | 0.01 |
| 186 | 301051 | 信濠光电  | 1,200 | 23,520.00 | 0.01 |
| 186 | 603126 | 中材节能  | 3,500 | 23,520.00 | 0.01 |
| 187 | 603225 | 新凤鸣   | 1,200 | 23,352.00 | 0.01 |
| 188 | 002641 | 公元股份  | 5,400 | 23,328.00 | 0.01 |
| 189 | 603183 | 建研院   | 5,400 | 23,274.00 | 0.01 |
| 190 | 002758 | 浙农股份  | 2,300 | 23,161.00 | 0.01 |
| 191 | 603117 | 万林物流  | 4,900 | 23,128.00 | 0.01 |
| 192 | 605162 | 新中港   | 2,700 | 23,058.00 | 0.01 |
| 193 | 000586 | 汇源通信  | 1,700 | 23,001.00 | 0.01 |
| 194 | 300405 | 科隆股份  | 3,600 | 22,968.00 | 0.01 |
| 195 | 002694 | 顾地科技  | 6,100 | 22,936.00 | 0.01 |
| 196 | 688795 | 摩尔线程  | 55    | 22,889.90 | 0.01 |
| 197 | 300110 | 华仁药业  | 7,200 | 22,680.00 | 0.01 |
| 198 | 300970 | 华绿生物  | 1,100 | 22,561.00 | 0.01 |
| 199 | 603057 | 紫燕食品  | 1,100 | 22,374.00 | 0.01 |
| 200 | 301088 | 戎美股份  | 1,300 | 22,295.00 | 0.01 |
| 201 | 002910 | 庄园牧场  | 2,000 | 22,220.00 | 0.01 |
| 202 | 002921 | 联诚精密  | 1,300 | 22,126.00 | 0.01 |
| 203 | 300656 | 民德电子  | 1,000 | 22,020.00 | 0.01 |
| 204 | 605258 | 协和电子  | 700   | 21,889.00 | 0.01 |
| 205 | 300928 | 华安鑫创  | 700   | 21,805.00 | 0.01 |
| 206 | 002760 | 凤形股份  | 1,000 | 21,710.00 | 0.01 |
| 207 | 000822 | 山东海化  | 4,100 | 21,525.00 | 0.01 |
| 208 | 603116 | 红蜻蜓   | 3,500 | 21,455.00 | 0.01 |
| 209 | 600620 | 天宸股份  | 3,300 | 21,450.00 | 0.01 |
| 210 | 000553 | 安道麦 A | 3,900 | 21,372.00 | 0.01 |
| 211 | 002666 | 德联集团  | 3,800 | 20,938.00 | 0.01 |
| 212 | 301097 | 天益医疗  | 400   | 20,648.00 | 0.01 |
| 213 | 603161 | 科华控股  | 1,500 | 20,595.00 | 0.01 |
| 214 | 600540 | 新赛股份  | 4,400 | 20,108.00 | 0.01 |
| 215 | 603787 | 新日股份  | 1,400 | 19,684.00 | 0.01 |
| 216 | 301060 | 兰卫医学  | 2,100 | 19,425.00 | 0.01 |
| 217 | 688783 | 西安奕材  | 1,008 | 18,506.88 | 0.01 |
| 218 | 605001 | 威奥股份  | 2,300 | 17,549.00 | 0.01 |
| 219 | 300700 | 岱勒新材  | 1,300 | 16,055.00 | 0.01 |
| 220 | 002996 | 顺博合金  | 2,100 | 15,876.00 | 0.01 |
| 221 | 000782 | 恒申新材  | 3,100 | 15,376.00 | 0.01 |
| 222 | 600969 | 郴电国际  | 1,500 | 15,345.00 | 0.01 |
| 223 | 002663 | 普邦股份  | 7,900 | 14,931.00 | 0.01 |
| 224 | 002790 | 瑞尔特   | 1,700 | 14,263.00 | 0.01 |
| 225 | 600726 | 华电能源  | 5,900 | 14,101.00 | 0.01 |
| 226 | 301322 | 绿通科技  | 500   | 13,740.00 | 0.01 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 227 | 301419 | 阿莱德  | 400   | 13,552.00 | 0.01 |
| 228 | 301512 | 智信精密 | 300   | 13,122.00 | 0.01 |
| 229 | 003012 | 东鹏控股 | 2,000 | 13,100.00 | 0.01 |
| 230 | 002968 | 新大正  | 1,000 | 12,160.00 | 0.00 |
| 231 | 000626 | 远大控股 | 1,500 | 11,895.00 | 0.00 |
| 232 | 002830 | 名雕股份 | 600   | 11,700.00 | 0.00 |
| 233 | 603609 | 禾丰股份 | 1,600 | 11,344.00 | 0.00 |
| 234 | 301687 | 新广益  | 195   | 10,606.05 | 0.00 |
| 235 | 301176 | 逸豪新材 | 400   | 10,068.00 | 0.00 |
| 236 | 605300 | 佳禾食品 | 800   | 9,280.00  | 0.00 |
| 237 | 603151 | 邦基科技 | 500   | 9,010.00  | 0.00 |
| 238 | 300891 | 惠云钛业 | 1,000 | 8,800.00  | 0.00 |
| 239 | 603175 | 超颖电子 | 169   | 8,206.64  | 0.00 |
| 240 | 002282 | 博深股份 | 1,100 | 8,085.00  | 0.00 |
| 241 | 600287 | 苏豪时尚 | 1,400 | 7,644.00  | 0.00 |
| 242 | 301449 | 天溯计量 | 112   | 7,305.76  | 0.00 |
| 243 | 301632 | 广东建科 | 306   | 7,246.08  | 0.00 |
| 244 | 300610 | 晨化股份 | 600   | 6,966.00  | 0.00 |
| 245 | 603065 | 宿迁联盛 | 800   | 6,648.00  | 0.00 |
| 246 | 002835 | 同为股份 | 400   | 6,552.00  | 0.00 |
| 247 | 601026 | 道生天合 | 451   | 6,440.28  | 0.00 |
| 248 | 301100 | 风光股份 | 300   | 6,393.00  | 0.00 |
| 249 | 001260 | 坤泰股份 | 300   | 6,036.00  | 0.00 |
| 250 | 600075 | 新疆天业 | 1,100 | 5,445.00  | 0.00 |
| 251 | 002367 | 康力电梯 | 600   | 4,836.00  | 0.00 |
| 252 | 002972 | 科安达  | 400   | 4,780.00  | 0.00 |
| 253 | 300789 | 唐源电气 | 200   | 4,600.00  | 0.00 |
| 254 | 300243 | 瑞丰高材 | 400   | 4,172.00  | 0.00 |
| 255 | 001221 | 悍高集团 | 67    | 3,814.98  | 0.00 |
| 256 | 603370 | 华新精科 | 82    | 3,800.70  | 0.00 |
| 257 | 300214 | 日科化学 | 500   | 3,340.00  | 0.00 |
| 258 | 300176 | 鸿特科技 | 400   | 2,668.00  | 0.00 |
| 259 | 001322 | 箭牌家居 | 300   | 2,661.00  | 0.00 |
| 260 | 603406 | 天富龙  | 61    | 2,449.76  | 0.00 |
| 261 | 300599 | 雄塑科技 | 300   | 2,445.00  | 0.00 |
| 262 | 002022 | 科华生物 | 400   | 2,376.00  | 0.00 |
| 263 | 001388 | 信通电子 | 52    | 2,232.88  | 0.00 |
| 264 | 300639 | 凯普生物 | 300   | 1,614.00  | 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  | 300033 | 同花顺  | 52,365,400.00 | 21.74 |
| 2  | 600941 | 中国移动 | 45,595,819.54 | 18.93 |
| 3  | 600900 | 长江电力 | 45,466,940.00 | 18.87 |
| 4  | 601728 | 中国电信 | 44,458,929.00 | 18.46 |
| 5  | 300750 | 宁德时代 | 41,123,416.50 | 17.07 |
| 6  | 688008 | 澜起科技 | 39,111,903.31 | 16.24 |
| 7  | 603019 | 中科曙光 | 38,317,555.00 | 15.91 |
| 8  | 603259 | 药明康德 | 34,824,597.00 | 14.46 |
| 9  | 601816 | 京沪高铁 | 34,271,793.24 | 14.23 |
| 10 | 688012 | 中微公司 | 33,597,602.88 | 13.95 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 33,279,434.36 | 13.81 |
| 12 | 600406 | 国电南瑞 | 33,002,650.52 | 13.70 |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 32,474,285.00 | 13.48 |
| 14 | 002050 | 三花智控 | 31,528,610.00 | 13.09 |
| 15 | 300014 | 亿纬锂能 | 30,986,557.00 | 12.86 |
| 16 | 300433 | 蓝思科技 | 30,000,837.08 | 12.45 |
| 17 | 300015 | 爱尔眼科 | 29,812,865.52 | 12.38 |
| 18 | 300274 | 阳光电源 | 29,543,977.00 | 12.26 |
| 19 | 601088 | 中国神华 | 28,880,314.00 | 11.99 |
| 20 | 002230 | 科大讯飞 | 27,187,455.10 | 11.29 |
| 21 | 601985 | 中国核电 | 26,967,052.00 | 11.19 |
| 22 | 688111 | 金山办公 | 26,243,921.31 | 10.89 |
| 23 | 300124 | 汇川技术 | 25,681,714.18 | 10.66 |
| 24 | 600519 | 贵州茅台 | 25,284,275.23 | 10.50 |
| 25 | 300308 | 中际旭创 | 25,050,104.52 | 10.40 |
| 26 | 688981 | 中芯国际 | 24,255,084.34 | 10.07 |
| 27 | 600111 | 北方稀土 | 22,982,295.00 | 9.54  |
| 28 | 600886 | 国投电力 | 22,663,132.38 | 9.41  |
| 29 | 601377 | 兴业证券 | 22,508,550.00 | 9.34  |
| 30 | 601225 | 陕西煤业 | 22,244,942.00 | 9.23  |
| 31 | 002241 | 歌尔股份 | 22,194,871.80 | 9.21  |
| 32 | 600795 | 国电电力 | 22,158,559.00 | 9.20  |
| 33 | 603986 | 兆易创新 | 22,146,370.24 | 9.19  |
| 34 | 601166 | 兴业银行 | 22,077,028.00 | 9.16  |
| 35 | 002475 | 立讯精密 | 22,076,224.10 | 9.16  |
| 36 | 600028 | 中国石化 | 21,846,898.00 | 9.07  |
| 37 | 601888 | 中国中免 | 21,705,347.00 | 9.01  |
| 38 | 002460 | 赣锋锂业 | 20,003,562.00 | 8.30  |
| 39 | 000617 | 中油资本 | 19,112,251.16 | 7.93  |
| 40 | 000333 | 美的集团 | 18,976,355.35 | 7.88  |
| 41 | 600660 | 福耀玻璃 | 18,927,217.98 | 7.86  |
| 42 | 600809 | 山西汾酒 | 18,722,381.59 | 7.77  |
| 43 | 601898 | 中煤能源 | 18,392,664.00 | 7.64  |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 44 | 600025 | 华能水电  | 18,277,292.00 | 7.59 |
| 45 | 601006 | 大秦铁路  | 18,244,447.00 | 7.57 |
| 46 | 002594 | 比亚迪   | 18,213,011.69 | 7.56 |
| 47 | 300476 | 胜宏科技  | 18,006,709.00 | 7.47 |
| 48 | 688256 | 寒武纪   | 17,464,068.32 | 7.25 |
| 49 | 600089 | 特变电工  | 17,062,069.09 | 7.08 |
| 50 | 600905 | 三峡能源  | 16,888,444.00 | 7.01 |
| 51 | 000625 | 长安汽车  | 16,546,753.00 | 6.87 |
| 52 | 600019 | 宝钢股份  | 16,218,411.00 | 6.73 |
| 53 | 300059 | 东方财富  | 16,063,805.00 | 6.67 |
| 54 | 300803 | 指南针   | 15,912,684.70 | 6.61 |
| 55 | 603799 | 华友钴业  | 15,669,154.80 | 6.50 |
| 56 | 002384 | 东山精密  | 15,609,266.00 | 6.48 |
| 57 | 601328 | 交通银行  | 15,356,503.60 | 6.37 |
| 58 | 003816 | 中国广核  | 15,142,370.00 | 6.29 |
| 59 | 601138 | 工业富联  | 14,948,614.00 | 6.21 |
| 60 | 601012 | 隆基绿能  | 14,849,930.76 | 6.16 |
| 61 | 000977 | 浪潮信息  | 14,820,246.00 | 6.15 |
| 62 | 601318 | 中国平安  | 14,809,763.00 | 6.15 |
| 63 | 601077 | 渝农商行  | 14,674,270.00 | 6.09 |
| 64 | 000725 | 京东方 A | 14,482,582.00 | 6.01 |
| 65 | 000063 | 中兴通讯  | 14,399,797.00 | 5.98 |
| 66 | 600011 | 华能国际  | 14,357,675.00 | 5.96 |
| 67 | 600919 | 江苏银行  | 13,967,145.00 | 5.80 |
| 68 | 002352 | 顺丰控股  | 13,227,792.00 | 5.49 |
| 69 | 000895 | 双汇发展  | 13,034,889.00 | 5.41 |
| 70 | 000568 | 泸州老窖  | 12,948,404.00 | 5.38 |
| 71 | 600674 | 川投能源  | 12,921,830.00 | 5.36 |
| 72 | 301236 | 软通动力  | 12,832,031.00 | 5.33 |
| 73 | 002028 | 思源电气  | 12,814,919.00 | 5.32 |
| 74 | 600018 | 上港集团  | 12,764,956.00 | 5.30 |
| 75 | 000938 | 紫光股份  | 12,585,145.00 | 5.22 |
| 76 | 600009 | 上海机场  | 12,385,867.00 | 5.14 |
| 77 | 002600 | 领益智造  | 11,803,781.00 | 4.90 |
| 78 | 300760 | 迈瑞医疗  | 11,462,921.00 | 4.76 |
| 79 | 300502 | 新易盛   | 11,353,676.60 | 4.71 |
| 80 | 600150 | 中国船舶  | 11,284,872.90 | 4.68 |
| 81 | 600346 | 恒力石化  | 11,280,201.00 | 4.68 |
| 82 | 601689 | 拓普集团  | 11,262,063.55 | 4.68 |
| 83 | 300394 | 天孚通信  | 10,993,141.00 | 4.56 |
| 84 | 002466 | 天齐锂业  | 10,923,320.00 | 4.53 |
| 85 | 000858 | 五粮液   | 10,667,545.00 | 4.43 |
| 86 | 601868 | 中国能建  | 10,623,286.26 | 4.41 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 87  | 600029 | 南方航空   | 10,453,205.00 | 4.34 |
| 88  | 002463 | 沪电股份   | 10,375,258.00 | 4.31 |
| 89  | 600570 | 恒生电子   | 10,366,411.00 | 4.30 |
| 90  | 300442 | 润泽科技   | 10,183,795.44 | 4.23 |
| 91  | 000100 | TCL 科技 | 10,106,189.80 | 4.20 |
| 92  | 600436 | 片仔癀    | 9,742,647.50  | 4.04 |
| 93  | 600183 | 生益科技   | 9,664,210.00  | 4.01 |
| 94  | 601899 | 紫金矿业   | 9,526,491.00  | 3.95 |
| 95  | 600188 | 兖矿能源   | 9,428,774.10  | 3.91 |
| 96  | 000538 | 云南白药   | 9,371,485.40  | 3.89 |
| 97  | 600585 | 海螺水泥   | 9,290,737.00  | 3.86 |
| 98  | 603288 | 海天味业   | 9,178,251.34  | 3.81 |
| 99  | 300999 | 金龙鱼    | 9,141,624.00  | 3.79 |
| 100 | 600196 | 复星医药   | 9,052,244.00  | 3.76 |
| 101 | 600938 | 中国海油   | 8,980,025.00  | 3.73 |
| 102 | 600309 | 万华化学   | 8,949,703.03  | 3.72 |
| 103 | 301308 | 江波龙    | 8,825,666.00  | 3.66 |
| 104 | 000002 | 万科 A   | 8,772,882.00  | 3.64 |
| 105 | 000792 | 盐湖股份   | 8,544,218.00  | 3.55 |
| 106 | 600031 | 三一重工   | 8,461,871.00  | 3.51 |
| 107 | 000425 | 徐工机械   | 8,328,551.00  | 3.46 |
| 108 | 600276 | 恒瑞医药   | 8,247,340.00  | 3.42 |
| 109 | 002415 | 海康威视   | 8,175,391.00  | 3.39 |
| 110 | 002938 | 鹏鼎控股   | 8,064,336.00  | 3.35 |
| 111 | 600690 | 海尔智家   | 8,008,634.00  | 3.32 |
| 112 | 688521 | 芯原股份   | 7,941,740.38  | 3.30 |
| 113 | 605499 | 东鹏饮料   | 7,911,464.00  | 3.28 |
| 114 | 601186 | 中国铁建   | 7,860,451.00  | 3.26 |
| 115 | 600438 | 通威股份   | 7,853,842.00  | 3.26 |
| 116 | 601939 | 建设银行   | 7,847,392.00  | 3.26 |
| 117 | 300857 | 协创数据   | 7,832,409.00  | 3.25 |
| 118 | 302132 | 中航成飞   | 7,744,716.99  | 3.21 |
| 119 | 688041 | 海光信息   | 7,595,700.41  | 3.15 |
| 120 | 601669 | 中国电建   | 7,561,338.00  | 3.14 |
| 121 | 002966 | 苏州银行   | 7,504,870.40  | 3.12 |
| 122 | 002371 | 北方华创   | 7,432,545.00  | 3.09 |
| 123 | 300408 | 三环集团   | 7,413,053.00  | 3.08 |
| 124 | 600115 | 中国东航   | 7,266,868.00  | 3.02 |
| 125 | 600760 | 中航沈飞   | 7,253,932.40  | 3.01 |
| 126 | 601336 | 新华保险   | 7,195,188.00  | 2.99 |
| 127 | 601658 | 邮储银行   | 7,167,410.00  | 2.98 |
| 128 | 600989 | 宝丰能源   | 7,092,940.00  | 2.94 |
| 129 | 601668 | 中国建筑   | 7,054,467.00  | 2.93 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 130 | 600050 | 中国联通 | 6,937,375.00 | 2.88 |
| 131 | 601766 | 中国中车 | 6,917,816.00 | 2.87 |
| 132 | 601390 | 中国中铁 | 6,897,320.00 | 2.86 |
| 133 | 603993 | 洛阳钼业 | 6,845,257.00 | 2.84 |
| 134 | 600010 | 包钢股份 | 6,796,996.00 | 2.82 |
| 135 | 688589 | 力合微  | 6,694,597.26 | 2.78 |
| 136 | 002304 | 洋河股份 | 6,649,864.00 | 2.76 |
| 137 | 601857 | 中国石油 | 6,526,726.00 | 2.71 |
| 138 | 600887 | 伊利股份 | 6,431,386.80 | 2.67 |
| 139 | 601919 | 中远海控 | 6,375,524.00 | 2.65 |
| 140 | 002493 | 荣盛石化 | 6,276,728.00 | 2.61 |
| 141 | 301499 | 维科精密 | 6,254,148.00 | 2.60 |
| 142 | 002074 | 国轩高科 | 6,224,779.00 | 2.58 |
| 143 | 601628 | 中国人寿 | 6,178,006.00 | 2.56 |
| 144 | 688347 | 华虹公司 | 6,131,253.89 | 2.55 |
| 145 | 001965 | 招商公路 | 6,093,553.00 | 2.53 |
| 146 | 601901 | 方正证券 | 6,088,583.00 | 2.53 |
| 147 | 002916 | 深南电路 | 6,086,234.50 | 2.53 |
| 148 | 002625 | 光启技术 | 6,077,499.00 | 2.52 |
| 149 | 600926 | 杭州银行 | 6,055,986.00 | 2.51 |
| 150 | 002236 | 大华股份 | 6,042,548.00 | 2.51 |
| 151 | 688235 | 百济神州 | 6,017,922.03 | 2.50 |
| 152 | 600901 | 江苏金租 | 5,920,732.00 | 2.46 |
| 153 | 300450 | 先导智能 | 5,913,751.00 | 2.45 |
| 154 | 601169 | 北京银行 | 5,571,613.00 | 2.31 |
| 155 | 601111 | 中国国航 | 5,564,999.00 | 2.31 |
| 156 | 600918 | 中泰证券 | 5,529,134.00 | 2.30 |
| 157 | 601009 | 南京银行 | 5,525,236.00 | 2.29 |
| 158 | 300496 | 中科创达 | 5,296,579.00 | 2.20 |
| 159 | 000001 | 平安银行 | 5,287,602.16 | 2.19 |
| 160 | 601100 | 恒立液压 | 5,181,787.00 | 2.15 |
| 161 | 002714 | 牧原股份 | 5,159,838.00 | 2.14 |
| 162 | 600703 | 三安光电 | 5,089,102.00 | 2.11 |
| 163 | 688435 | 英方软件 | 5,016,194.52 | 2.08 |
| 164 | 600547 | 山东黄金 | 4,925,359.20 | 2.04 |
| 165 | 601688 | 华泰证券 | 4,848,394.00 | 2.01 |

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  | 600941 | 中国移动 | 52,472,862.00 | 21.78          |
| 2  | 600900 | 长江电力 | 50,649,339.00 | 21.03          |

|    |        |       |               |       |
|----|--------|-------|---------------|-------|
| 3  | 300033 | 同花顺   | 49,915,909.30 | 20.72 |
| 4  | 601728 | 中国电信  | 42,534,879.00 | 17.66 |
| 5  | 688008 | 澜起科技  | 40,208,163.03 | 16.69 |
| 6  | 300750 | 宁德时代  | 38,822,718.60 | 16.12 |
| 7  | 603019 | 中科曙光  | 38,448,727.63 | 15.96 |
| 8  | 601398 | 工商银行  | 34,039,922.00 | 14.13 |
| 9  | 688012 | 中微公司  | 33,518,108.60 | 13.91 |
| 10 | 603259 | 药明康德  | 33,172,725.32 | 13.77 |
| 11 | 600406 | 国电南瑞  | 32,854,259.56 | 13.64 |
| 12 | 002050 | 三花智控  | 32,711,862.20 | 13.58 |
| 13 | 300014 | 亿纬锂能  | 31,808,471.40 | 13.20 |
| 14 | 601288 | 农业银行  | 31,265,995.00 | 12.98 |
| 15 | 601816 | 京沪高铁  | 31,121,259.00 | 12.92 |
| 16 | 300015 | 爱尔眼科  | 29,990,214.06 | 12.45 |
| 17 | 300433 | 蓝思科技  | 29,723,417.78 | 12.34 |
| 18 | 002230 | 科大讯飞  | 27,689,137.82 | 11.49 |
| 19 | 300274 | 阳光电源  | 26,887,476.60 | 11.16 |
| 20 | 601088 | 中国神华  | 26,879,468.00 | 11.16 |
| 21 | 300124 | 汇川技术  | 26,573,303.46 | 11.03 |
| 22 | 601888 | 中国中免  | 25,875,022.72 | 10.74 |
| 23 | 688111 | 金山办公  | 25,664,166.45 | 10.65 |
| 24 | 601985 | 中国核电  | 25,130,786.61 | 10.43 |
| 25 | 601006 | 大秦铁路  | 25,041,939.08 | 10.40 |
| 26 | 603986 | 兆易创新  | 24,644,938.00 | 10.23 |
| 27 | 601377 | 兴业证券  | 24,514,464.00 | 10.18 |
| 28 | 600660 | 福耀玻璃  | 24,506,971.38 | 10.17 |
| 29 | 688981 | 中芯国际  | 24,500,251.14 | 10.17 |
| 30 | 002460 | 赣锋锂业  | 23,054,139.46 | 9.57  |
| 31 | 600919 | 江苏银行  | 22,642,187.00 | 9.40  |
| 32 | 600886 | 国投电力  | 22,239,037.11 | 9.23  |
| 33 | 002241 | 歌尔股份  | 22,062,177.90 | 9.16  |
| 34 | 600028 | 中国石化  | 21,838,951.30 | 9.07  |
| 35 | 601166 | 兴业银行  | 21,835,256.00 | 9.06  |
| 36 | 300308 | 中际旭创  | 21,804,028.00 | 9.05  |
| 37 | 600795 | 国电电力  | 21,649,706.01 | 8.99  |
| 38 | 600111 | 北方稀土  | 21,510,866.00 | 8.93  |
| 39 | 000725 | 京东方 A | 21,117,964.00 | 8.77  |
| 40 | 000333 | 美的集团  | 20,241,741.32 | 8.40  |
| 41 | 600519 | 贵州茅台  | 20,163,920.00 | 8.37  |
| 42 | 601225 | 陕西煤业  | 19,953,728.00 | 8.28  |
| 43 | 002475 | 立讯精密  | 19,921,597.00 | 8.27  |
| 44 | 300476 | 胜宏科技  | 19,769,832.02 | 8.21  |
| 45 | 600809 | 山西汾酒  | 19,011,168.21 | 7.89  |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 46 | 600025 | 华能水电 | 18,046,827.00 | 7.49 |
| 47 | 601898 | 中煤能源 | 18,014,753.00 | 7.48 |
| 48 | 688256 | 寒武纪  | 17,941,759.99 | 7.45 |
| 49 | 002594 | 比亚迪  | 17,803,756.00 | 7.39 |
| 50 | 000568 | 泸州老窖 | 17,385,859.93 | 7.22 |
| 51 | 000617 | 中油资本 | 17,181,754.35 | 7.13 |
| 52 | 601077 | 渝农商行 | 16,940,558.10 | 7.03 |
| 53 | 601012 | 隆基绿能 | 16,868,418.08 | 7.00 |
| 54 | 600905 | 三峡能源 | 16,843,395.00 | 6.99 |
| 55 | 601318 | 中国平安 | 16,643,927.00 | 6.91 |
| 56 | 000625 | 长安汽车 | 16,509,455.35 | 6.85 |
| 57 | 600019 | 宝钢股份 | 16,395,793.00 | 6.81 |
| 58 | 300760 | 迈瑞医疗 | 16,266,575.00 | 6.75 |
| 59 | 002384 | 东山精密 | 16,032,240.00 | 6.66 |
| 60 | 300803 | 指南针  | 15,908,744.50 | 6.60 |
| 61 | 603799 | 华友钴业 | 15,625,035.68 | 6.49 |
| 62 | 600089 | 特变电工 | 15,392,485.50 | 6.39 |
| 63 | 000895 | 双汇发展 | 15,303,733.00 | 6.35 |
| 64 | 601328 | 交通银行 | 15,235,689.00 | 6.32 |
| 65 | 000858 | 五粮液  | 15,184,429.84 | 6.30 |
| 66 | 000977 | 浪潮信息 | 15,035,478.00 | 6.24 |
| 67 | 601868 | 中国能建 | 15,019,255.12 | 6.23 |
| 68 | 600938 | 中国海油 | 14,549,622.00 | 6.04 |
| 69 | 600009 | 上海机场 | 14,346,355.97 | 5.96 |
| 70 | 600011 | 华能国际 | 14,333,874.00 | 5.95 |
| 71 | 600029 | 南方航空 | 13,315,219.00 | 5.53 |
| 72 | 601138 | 工业富联 | 13,311,384.00 | 5.53 |
| 73 | 600887 | 伊利股份 | 13,275,860.72 | 5.51 |
| 74 | 003816 | 中国广核 | 13,218,661.00 | 5.49 |
| 75 | 301236 | 软通动力 | 13,044,145.00 | 5.41 |
| 76 | 000938 | 紫光股份 | 12,766,953.00 | 5.30 |
| 77 | 600018 | 上港集团 | 12,745,728.00 | 5.29 |
| 78 | 600674 | 川投能源 | 12,705,684.00 | 5.27 |
| 79 | 002371 | 北方华创 | 12,616,903.10 | 5.24 |
| 80 | 300394 | 天孚通信 | 12,507,218.00 | 5.19 |
| 81 | 000063 | 中兴通讯 | 12,472,376.00 | 5.18 |
| 82 | 002352 | 顺丰控股 | 12,421,461.00 | 5.16 |
| 83 | 002028 | 思源电气 | 12,228,459.08 | 5.08 |
| 84 | 601899 | 紫金矿业 | 12,166,186.00 | 5.05 |
| 85 | 600309 | 万华化学 | 12,106,956.00 | 5.03 |
| 86 | 601689 | 拓普集团 | 12,031,938.00 | 4.99 |
| 87 | 601111 | 中国国航 | 11,990,767.00 | 4.98 |
| 88 | 300502 | 新易盛  | 11,936,645.93 | 4.96 |

|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 89  | 002600 | 领益智造  | 11,752,628.48 | 4.88 |
| 90  | 000002 | 万科A   | 11,428,712.00 | 4.74 |
| 91  | 002415 | 海康威视  | 11,226,490.00 | 4.66 |
| 92  | 600570 | 恒生电子  | 10,878,941.00 | 4.52 |
| 93  | 300059 | 东方财富  | 10,835,765.60 | 4.50 |
| 94  | 601669 | 中国电建  | 10,788,382.72 | 4.48 |
| 95  | 601009 | 南京银行  | 10,572,268.00 | 4.39 |
| 96  | 600346 | 恒力石化  | 10,296,540.00 | 4.27 |
| 97  | 002493 | 荣盛石化  | 10,071,303.00 | 4.18 |
| 98  | 000100 | TCL科技 | 10,016,035.60 | 4.16 |
| 99  | 601336 | 新华保险  | 9,907,929.00  | 4.11 |
| 100 | 601688 | 华泰证券  | 9,815,593.00  | 4.07 |
| 101 | 600585 | 海螺水泥  | 9,801,793.00  | 4.07 |
| 102 | 300442 | 润泽科技  | 9,779,094.00  | 4.06 |
| 103 | 600015 | 华夏银行  | 9,733,672.51  | 4.04 |
| 104 | 600436 | 片仔癀   | 9,681,405.06  | 4.02 |
| 105 | 000651 | 格力电器  | 9,465,637.00  | 3.93 |
| 106 | 002466 | 天齐锂业  | 9,355,726.00  | 3.88 |
| 107 | 002304 | 洋河股份  | 9,284,074.31  | 3.85 |
| 108 | 000338 | 潍柴动力  | 9,235,641.00  | 3.83 |
| 109 | 600196 | 复星医药  | 9,215,488.00  | 3.83 |
| 110 | 000538 | 云南白药  | 9,193,871.40  | 3.82 |
| 111 | 600150 | 中国船舶  | 9,108,801.00  | 3.78 |
| 112 | 600188 | 兖矿能源  | 8,885,127.10  | 3.69 |
| 113 | 600183 | 生益科技  | 8,361,274.00  | 3.47 |
| 114 | 002463 | 沪电股份  | 8,302,238.00  | 3.45 |
| 115 | 000425 | 徐工机械  | 8,231,289.00  | 3.42 |
| 116 | 300999 | 金龙鱼   | 8,186,323.00  | 3.40 |
| 117 | 302132 | 中航成飞  | 8,150,346.00  | 3.38 |
| 118 | 688041 | 海光信息  | 8,024,517.43  | 3.33 |
| 119 | 300857 | 协创数据  | 8,023,128.00  | 3.33 |
| 120 | 601939 | 建设银行  | 7,912,876.00  | 3.28 |
| 121 | 688521 | 芯原股份  | 7,904,956.93  | 3.28 |
| 122 | 603288 | 海天味业  | 7,784,659.85  | 3.23 |
| 123 | 601186 | 中国铁建  | 7,753,058.00  | 3.22 |
| 124 | 000792 | 盐湖股份  | 7,684,359.00  | 3.19 |
| 125 | 002966 | 苏州银行  | 7,628,523.90  | 3.17 |
| 126 | 601658 | 邮储银行  | 7,501,664.00  | 3.11 |
| 127 | 600115 | 中国东航  | 7,432,754.00  | 3.09 |
| 128 | 300408 | 三环集团  | 7,154,014.00  | 2.97 |
| 129 | 601668 | 中国建筑  | 7,124,703.00  | 2.96 |
| 130 | 600050 | 中国联通  | 7,092,005.00  | 2.94 |
| 131 | 002938 | 鹏鼎控股  | 6,955,855.00  | 2.89 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 132 | 605499 | 东鹏饮料 | 6,883,460.00 | 2.86 |
| 133 | 688589 | 力合微  | 6,874,650.62 | 2.85 |
| 134 | 601390 | 中国中铁 | 6,844,075.00 | 2.84 |
| 135 | 600031 | 三一重工 | 6,793,551.00 | 2.82 |
| 136 | 000166 | 申万宏源 | 6,643,323.00 | 2.76 |
| 137 | 601901 | 方正证券 | 6,446,299.68 | 2.68 |
| 138 | 002236 | 大华股份 | 6,281,929.00 | 2.61 |
| 139 | 002916 | 深南电路 | 6,265,073.60 | 2.60 |
| 140 | 601628 | 中国人寿 | 6,218,832.00 | 2.58 |
| 141 | 002625 | 光启技术 | 6,054,461.00 | 2.51 |
| 142 | 600438 | 通威股份 | 6,043,221.00 | 2.51 |
| 143 | 001965 | 招商公路 | 6,008,336.00 | 2.49 |
| 144 | 600901 | 江苏金租 | 5,942,675.00 | 2.47 |
| 145 | 300450 | 先导智能 | 5,920,913.00 | 2.46 |
| 146 | 688347 | 华虹公司 | 5,909,375.11 | 2.45 |
| 147 | 002074 | 国轩高科 | 5,889,777.00 | 2.44 |
| 148 | 688235 | 百济神州 | 5,854,104.09 | 2.43 |
| 149 | 002714 | 牧原股份 | 5,814,842.00 | 2.41 |
| 150 | 603993 | 洛阳钼业 | 5,769,313.00 | 2.39 |
| 151 | 600918 | 中泰证券 | 5,719,784.00 | 2.37 |
| 152 | 600690 | 海尔智家 | 5,665,568.00 | 2.35 |
| 153 | 301499 | 维科精密 | 5,644,951.00 | 2.34 |
| 154 | 300496 | 中科创达 | 5,523,685.00 | 2.29 |
| 155 | 000001 | 平安银行 | 5,417,342.72 | 2.25 |
| 156 | 600926 | 杭州银行 | 5,371,850.00 | 2.23 |
| 157 | 301308 | 江波龙  | 5,333,348.00 | 2.21 |
| 158 | 688435 | 英方软件 | 5,314,060.73 | 2.21 |
| 159 | 600760 | 中航沈飞 | 5,295,961.00 | 2.20 |
| 160 | 601169 | 北京银行 | 5,213,501.00 | 2.16 |
| 161 | 600989 | 宝丰能源 | 5,207,301.00 | 2.16 |
| 162 | 600703 | 三安光电 | 5,058,556.00 | 2.10 |
| 163 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,947,932.00 | 2.05 |
| 164 | 300812 | 易天股份 | 4,834,899.00 | 2.01 |

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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 | 3,070,618,495.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,145,326,225.38 |

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，根据中国农业银行股份有限公司于 2025 年 01 月 27 日发布的公告，其被中国人民银行给予行政处罚：警告，没收违法所得 487.594705 万元，罚款 4672.941544 万元。根据中国农业银行股份有限公司于 2025 年 10 月 31 日发布的公告，其被国家金融监督管理总局给予罚款 2720 万元。

除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。本基金投资上述主体的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 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 | 378,396.94   |
| 2  | 应收清算款 | 809,534.46   |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 68,214.27    |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 1,256,145.67 |

#### 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<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额          | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 国金 300<br>指数增强<br>A | 7,410        | 11,186.16     | 31,072,522.92  | 37.49             | 51,816,925.95 | 62.51                 |
| 国金 300<br>指数增强<br>C | 4,662        | 28,194.59     | 100,101,036.13 | 76.16             | 31,342,131.67 | 23.84                 |
| 合计                  | 12,072       | 17,754.52     | 131,173,559.05 | 61.20             | 83,159,057.62 | 38.80                 |

## 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 300 指数增强 A | 249,459.38 | 0.3010      |
|                  | 国金 300 指数增强 C | 2,235.67   | 0.0017      |
|                  | 合计            | 251,695.05 | 0.1174      |

## 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 国金 300 指数增强 A | 10~50             |
|                                | 国金 300 指数增强 C | 0                 |
|                                | 合计            | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 国金 300 指数增强 A | 0                 |
|                                | 国金 300 指数增强 C | 0                 |
|                                | 合计            | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                    | 国金 300 指数增强 A  | 国金 300 指数增强 C  |
|---------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>（2017 年 9 月 1 日）<br>基金份额总额 | 196,802,728.21 | -              |
| 本报告期期初基金份额总额                          | 103,017,905.59 | 149,693,988.40 |
| 本报告期基金总申购份额                           | 54,991,653.58  | 424,736,946.84 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                         | 75,120,110.30  | 442,987,767.44 |
| 本报告期基金拆分变动份额                          | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                          | 82,889,448.87  | 131,443,167.80 |

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。

2025 年 1 月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

除上述人事调整以外，本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无其他重大人事变动。

### 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   | 1 | 1,627,702,834.95 | 26.19 | 318,872.00 | 26.19 | - |
| 天风证券   | 2 | 1,381,128,116.99 | 22.22 | 270,566.81 | 22.22 | - |
| 东吴证券   | 1 | 952,069,398.54   | 15.32 | 186,512.79 | 15.32 | - |
| 光大证券   | 2 | 537,873,925.21   | 8.65  | 105,373.70 | 8.65  | - |
| 国信证券   | 1 | 510,610,079.20   | 8.22  | 100,029.97 | 8.22  | - |
| 申万宏源证券 | 1 | 317,932,109.33   | 5.12  | 62,283.01  | 5.12  | - |
| 华安证券   | 1 | 299,235,177.01   | 4.81  | 58,621.39  | 4.81  | - |
| 中邮证券   | 1 | 295,336,284.30   | 4.75  | 57,856.54  | 4.75  | - |
| 中信建投证券 | 1 | 238,652,548.40   | 3.84  | 46,752.27  | 3.84  | - |
| 招商证券   | 1 | 54,843,465.98    | 0.88  | 10,743.67  | 0.88  | - |
| 东方财富证券 | 1 | -                | -     | -          | -     | - |
| 国盛证券   | 1 | -                | -     | -          | -     | - |
| 国元证券   | 1 | -                | -     | -          | -     | - |
| 华福证券   | 1 | -                | -     | -          | -     | - |
| 平安证券   | 1 | -                | -     | -          | -     | - |
| 中山证券   | 1 | -                | -     | -          | -     | - |

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

本基金本报告期减少方正证券、东兴证券共 2 个交易单元,新增中信建投证券、华福证券共 2 个交易单元。

## 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   | -    | -                | 128,500,000.00 | 26.62              | -    | -                |
| 天风证券   | -    | -                | 95,639,000.00  | 19.81              | -    | -                |
| 东吴证券   | -    | -                | 97,477,000.00  | 20.19              | -    | -                |
| 光大证券   | -    | -                | 34,110,000.00  | 7.07               | -    | -                |
| 国信证券   | -    | -                | 52,792,000.00  | 10.94              | -    | -                |
| 申万宏源证券 | -    | -                | 46,384,000.00  | 9.61               | -    | -                |
| 华安证券   | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 中邮证券   | -    | -                | 27,869,000.00  | 5.77               | -    | -                |
| 中信建投证券 | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 招商证券   | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 东方财富证券 | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 国盛证券   | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 国元证券   | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 华福证券   | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 平安证券   | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |
| 中山证券   | -    | -                | -              | -                  | -    | -                |

## 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  | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书(更新)》                    | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2025 年 1 月 17 日 |
| 2  | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金(国金 300 指数增强 A 份额)基金产品资料概要更新》 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2025 年 1 月 17 日 |
| 3  | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金(国金 300 指数增强 C 份额)基金          | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2025 年 1 月 17 日 |

|    |   |                       |                 |
|----|---|-----------------------|-----------------|
|    | 产品资料概要更新》   |                       |                 |
| 4  | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》                | 指定披露媒体和本基金<br>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<br>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<br>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<br>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<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 9  | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同》                           | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 10 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金托管协议》                           | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 20 日 |
| 11 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书(更新)》                      | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 12 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金(国金 300 指数增强 A 份额)基金产品资料概要(更新)》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 13 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金(国金 300 指数增强 C 份额)基金产品资料概要(更新)》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 14 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2024 年年度报告》                    | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 28 日 |
| 15 | 《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<br>基金管理人网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 16 | 《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<br>基金管理人网站 | 2025 年 4 月 14 日 |
| 17 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》                | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 18 | 《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<br>基金管理人网站 | 2025 年 4 月 25 日 |
| 19 | 《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<br>基金管理人网站 | 2025 年 7 月 1 日  |
| 20 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2025 年第 2 季度报告》                | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 7 月 19 日 |
| 21 | 《关于国金沪深 300 指数增强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<br>基金管理人网站 | 2025 年 7 月 25 日 |

|    |   |                       |                  |
|----|---|-----------------------|------------------|
| 22 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 7 月 25 日  |
| 23 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 7 月 25 日  |
| 24 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书（更新）》                      | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 7 月 25 日  |
| 25 | 《关于国金沪深 300 指数增强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<br>基金管理人网站 | 2025 年 8 月 27 日  |
| 26 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书（更新）》                      | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 8 月 29 日  |
| 27 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 8 月 29 日  |
| 28 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金（国金 300 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）》 | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 8 月 29 日  |
| 29 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2025 年中期报告》                    | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 8 月 30 日  |
| 30 | 《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2025 年第 3 季度报告》                | 指定披露媒体和本基金<br>基金管理人网站 | 2025 年 10 月 28 日 |
| 31 | 《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<br>基金管理人网站 | 2025 年 12 月 19 日 |
| 32 | 《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<br>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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                  |      |                |                | 报告期末持有基金情况 |          |
|---|----------------|----------------------------------|------|----------------|----------------|------------|----------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间          | 期初份额 | 申购份额           | 赎回份额           | 持有份额       | 份额占比 (%) |
| 机构  | 1              | 2025 年 4 月 1 日-2025 年 4 月 10 日   | -    | 62,781,207.48  | 62,781,207.48  | -          | -        |
|   | 2              | 2025 年 5 月 27 日-2025 年 11 月 20 日 | -    | 103,199,530.51 | 103,199,530.51 | -          | -        |
| 产品特有风险  |                |                                  |      |                |                |            |          |
| 报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险 |                |                                  |      |                |                |            |          |

险主要包括：

- 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延期支付赎回款项、部分延期赎回或者暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

## 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、国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同；
- 3、国金沪深 300 指数增强证券投资基金托管协议；
- 4、国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 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