

国金中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 3 月 22 日至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国金中证 1000 指数增强	
基金主代码	017846	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 22 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	891,748,750.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017846	017847
报告期末下属分级基金的份额总额	610,745,448.69 份	281,003,301.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要在基准成份内选股，力求在跟踪指数的前提下获取相对稳定的超额收益。 1、股票投资策略 本基金为指数增强型基金，以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在控制跟踪误差的基础上，力求获得相对稳定的超越标的指数的超额收益。 参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并通过分析投资组合相对标的指数的暴露度等因素，对组合跟踪效果进行评估，及时调整投资组合，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。 指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用机器学习技术构建量化选股模型，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。 2、债券投资策略 本基金将以价值分析为主线，主要通过类属配置与债券选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、债券供求等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调

	整，确定类属资产的最优权重。在券种选择上，以中长期利率趋势分析为基础，结合经济趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，重点选择流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。 对于可转换债券和可交换债券的投资，由于可转换债券、可交换债券兼备权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点，因此本基金将通过相对价值分析、基本面研究、估值分析、债券条款分析，选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券和可交换债券进行投资。 3、资产支持证券投资策略 依据风险可控和优化组合风险收益的原则，投资于资产支持证券产品，以期获得长期稳定的收益。坚持价值投资理念，综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，制定相应的资产支持证券投资策略，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化、把握市场交易机会，积极调整投资策略。 4、国债期货交易策略 本基金在参与国债期货交易时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。 5、股指期货交易策略 本基金管理人将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行交易旨在通过股指期货实现基金的套期保值。 6、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张静	张姗
	联系电话	010-88005695	0755-83077987

电子邮箱	zhangjing@gfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	4000-2000-18	95555
传真	010-88005666	0755-83195201
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100089	518040
法定代表人	邵海波	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
和指标	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-596,693.64	-691,664.20
本期利润	-8,859,058.31	-5,296,549.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0141	-0.0171
本期加权平均净值利润率	-1.44%	-1.74%
本期基金份额净值增长率	-1.35%	-1.46%
3.1.2 期末数据	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利润	-8,226,401.26	-4,091,216.20
期末可供分配基	-0.0135	-0.0146

金份额利润		
期末基金资产净值	602, 519, 047. 43	276, 912, 085. 41
期末基金份额净值	0. 9865	0. 9854
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-1. 35%	-1. 46%

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。

4. 本基金合同自 2023 年 3 月 22 日起生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1. 42%	0. 88%	0. 59%	0. 99%	0. 83%	-0. 11%
过去三个月	-1. 35%	0. 70%	-3. 77%	0. 87%	2. 42%	-0. 17%
自基金合同生效起至今	-1. 35%	0. 66%	-2. 88%	0. 84%	1. 53%	-0. 18%

国金中证 1000 指数增强 C

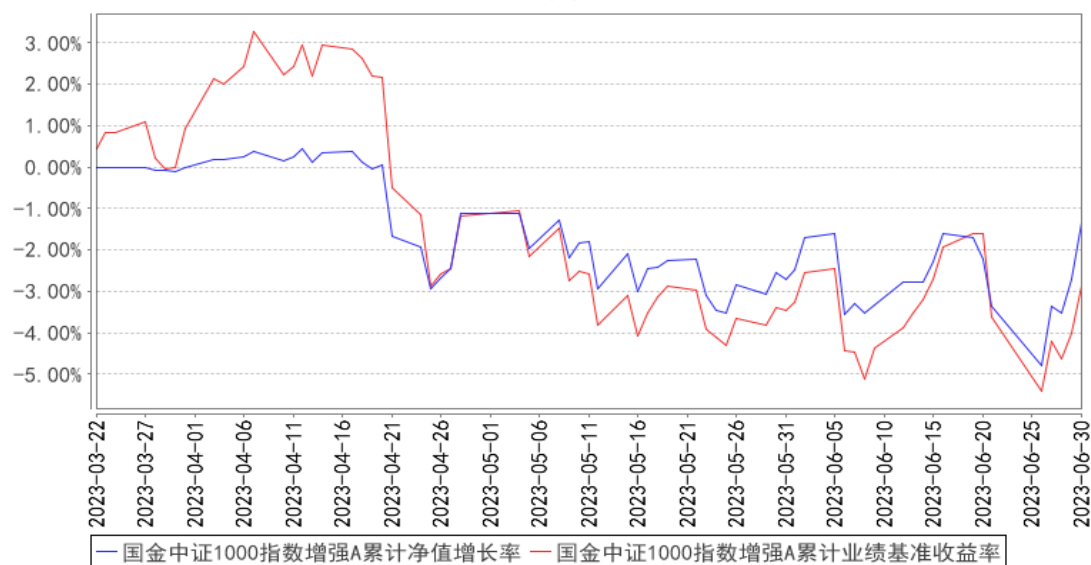
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1. 38%	0. 88%	0. 59%	0. 99%	0. 79%	-0. 11%
过去三个月	-1. 45%	0. 70%	-3. 77%	0. 87%	2. 32%	-0. 17%
自基金合同生效起	-1. 46%	0. 66%	-2. 88%	0. 84%	1. 42%	-0. 18%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

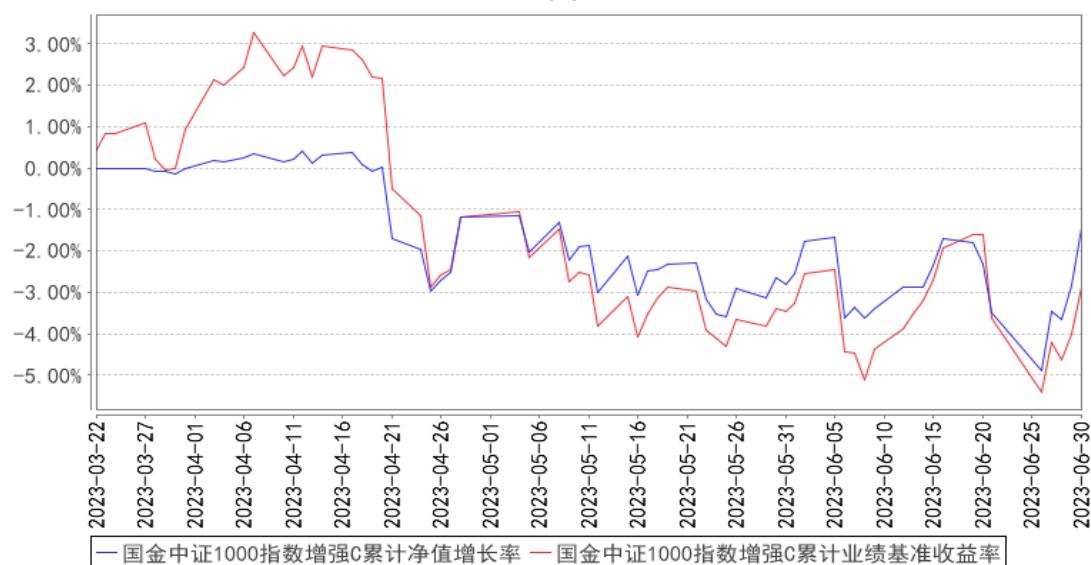
注：本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

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

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



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



注：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2023 年 3 月 22 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2023 年 3 月 22 日至 2023 年 9 月 21 日，截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

3.3 其他指标

注：无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至2023年6月30日，国金基金管理有限公司共管理28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，国金鑫盈货币市场证券投资基金，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，国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF），国金及第中短债债券型证券投资基金，国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金，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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2023年3月22日	-	7年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003年7月至2016年5月历任华泰贝通网络科技有限公司担任IT事业部测试工程师，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，北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理，2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资事业部副总经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场环境方面，上半年整体看既有趋势明显、波动较大的人工智能、计算机、传媒和通信等主题或者行业赛道，也有机会分散、相对均衡的结构化机会；风格和赛道的切换相对频繁，整体市场活跃度较好，但市场波动大部分处于历史相对较低位置。基本面因子层面：市值方面大小票风格交替占优；动量今年三月底以来至报告期末该风险因子收益上涨趋势明显；盈利率风格今年以来趋势明显，延续性较强。报告期内行业涨跌幅方面，通信、传媒和计算机等行业区间涨幅较大；消费者服务、房地产和综合等行业跌幅较大。国金中证 1000 指数增强基金主要在中证 1000 指数成份内选股，这与对标宽基的量化主动全市场选股基金在选股范围上有所不同，当然在跟踪误差方面，该基金要求更为严格。国金中证 1000 指数增强基金在运作方面遵守合同要求，高仓位运作、基金持仓分散度高，自运作以来超额收益特征相对稳健，源于策略收益来源的多样化和分散的持仓风格。国金量化策略模型是基于机器学习技术框架构建的，使用财务基本面和情绪面等数据，模型通过不断适应市场环境，目标是获取相对持续和稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类份额单位净值为 0.9865 元，累计单位净值为 0.9865 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-1.35%，同期业绩比较基准增长率为-3.77%；

本基金 C 类份额单位净值为 0.9854 元，累计单位净值为 0.9854 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-1.46%，同期业绩比较基准增长率为-3.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预期市场风格和赛道相对频繁切换在一定时间范围内仍将是主要旋律；市场波动持续较低水平的概率仍较大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、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，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估

值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	62,474,811.68
结算备付金		333.33
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	818,375,749.22
其中：股票投资		818,375,749.22
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		4,877,270.69
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		885,728,164.92
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		5,169,181.65
应付管理人报酬		745,753.11
应付托管费		149,150.62
应付销售服务费		98,145.87
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	134,800.83
负债合计		6,297,032.08
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	891,748,750.30
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-12,317,617.46
净资产合计		879,431,132.84
负债和净资产总计		885,728,164.92

注：1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，国金中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.9865 元，基金份额总额 610,745,448.69 份；国金中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.9854 元，基金份额总额 281,003,301.61 份。国金中证 1000 指数增强份额总额合计为 891,748,750.30 份。

2. 本期财务报表的实际编制期间系 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同 生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-10,740,571.16
1. 利息收入		776,262.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	216,046.95
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		560,215.31
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,308,548.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,768,190.26
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	8,076,738.86
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-12, 867, 249. 69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	41, 867. 67
减：二、营业总支出		3, 415, 036. 37
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2, 525, 266. 97
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	505, 053. 38
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	334, 081. 24
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	50, 634. 78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14, 155, 607. 53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14, 155, 607. 53
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-14, 155, 607. 53

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国金中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	939, 286, 753. 31	-	-	939, 286, 753. 31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47, 538, 003. 01	-	-12, 317, 617. 46	-59, 855, 620. 47
（一）、综合收益总额	-	-	-14, 155, 607. 53	-14, 155, 607. 53

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-47,538,003.01	-	1,837,990.07	-45,700,012.94
其中: 1. 基金申购款	5,480,443.27	-	-159,491.30	5,320,951.97
2. 基金赎回款	-53,018,446.28	-	1,997,481.37	-51,020,964.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	891,748,750.30	-	-12,317,617.46	879,431,132.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”),是经中国证监会 2023 年 1 月 10 日证监许可[2023]60 号文注册募集。由国金基金管理有限公司于 2023 年 3 月 9 日至 2023 年 3 月 17 日向社会公开募集,基金合同于 2023 年 3 月 22 日生效。首次募集规模为 939,286,753.31 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股(包括存托凭证、下同)、备选成份股(包括存托凭证、下同)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、地方政府债券、可交换债、公开发行的次级债、

短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确

定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

无

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非

货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	22,409,506.39
等于：本金	22,406,123.17
加：应计利息	3,383.22
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	40,065,305.29
等于：本金	40,061,549.11
加：应计利息	3,756.18
减：坏账准备	-
合计	62,474,811.68

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		831,242,998.91	-	818,375,749.22	-12,867,249.69
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		831,242,998.91	-	818,375,749.22	-12,867,249.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

6.4.7.8 其他资产

注：无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,295.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,614.23
其他	78,890.80

合计	134,800.83
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	627,872,206.43	627,872,206.43
本期申购	262,021.06	262,021.06
本期赎回（以“-”号填列）	-17,388,778.80	-17,388,778.80
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	610,745,448.69	610,745,448.69

国金中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	311,414,546.88	311,414,546.88
本期申购	5,218,422.21	5,218,422.21
本期赎回（以“-”号填列）	-35,629,667.48	-35,629,667.48
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	281,003,301.61	281,003,301.61

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-596,693.64	-8,262,364.67	-8,859,058.31
本期基金份额交易产生的变动数	56,523.33	576,133.72	632,657.05
其中：基金申购款	-849.26	-8,578.48	-9,427.74
基金赎回款	57,372.59	584,712.20	642,084.79
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-540,170.31	-7,686,230.95	-8,226,401.26
-----	-------------	---------------	---------------

国金中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-691,664.20	-4,604,885.02	-5,296,549.22
本期基金份额交易产生的变动数	138,595.63	1,066,737.39	1,205,333.02
其中：基金申购款	-14,874.53	-135,189.03	-150,063.56
基金赎回款	153,470.16	1,201,926.42	1,355,396.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-553,068.57	-3,538,147.63	-4,091,216.20

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	135,064.13
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	333.33
其他	80,649.49
合计	216,046.95

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月22日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,768,190.26
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	-6,768,190.26

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,438,703,024.24
减：卖出股票成本总额	1,441,418,399.50
减：交易费用	4,052,815.00
买卖股票差价收入	-6,768,190.26

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,076,738.86
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,076,738.86

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-12,867,249.69
股票投资	-12,867,249.69
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-12,867,249.69

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	41,867.67
合计	41,867.67

6.4.7.22 信用减值损失

注：无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	17,719.44
信息披露费	31,894.79
证券出借违约金	-
银行费用	620.55
其他	400.00
合计	50,634.78

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
国金证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
-------	--

	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	3,711,364,422.65	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	4,727,136,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年3月22日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国金证券股份有限 公司	2,321,950.13	100.00	—	—

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,525,266.97
其中：支付销售机构的客户维护费	41,496.79

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	505,053.38

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C	合计
国金基金管理有限公司	—	54,891.35	54,891.35
国金证券股份有限公司	—	244,656.37	244,656.37
合计	—	299,547.72	299,547.72

注：基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司-活期存款	22,409,506.39	135,064.13

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，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，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责

人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃

而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	62,474,811.68	-	-	-	-	-	62,474,811.68
结算备付金	333.33	-	-	-	-	-	333.33
交易性金融资产	-	-	-	-	-	818,375,749.22	818,375,749.22
应收申购款	-	-	-	-	-	4,877,270.69	4,877,270.69
资产总计	62,475,145.01	-	-	-	-	823,253,019.91	885,728,164.92
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,169,181.65	5,169,181.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	745,753.11	745,753.11
应付托管费	-	-	-	-	-	149,150.62	149,150.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	98,145.87	98,145.87
其他负债	-	-	-	-	-	134,800.83	134,800.83
负债总计	-	-	-	-	-	6,297,032.08	6,297,032.08
利率敏感度缺口	62,475,145.01	-	-	-	-	816,955,987.83	879,431,132.84

注：1、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。

2、本基金合同自 2023 年 3 月 22 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末未持有交易性债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份股和备选成份股证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金为指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股（投资比例不低于非现金基金资产的 80%）。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持

有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	818,375,749.22	93.06
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	818,375,749.22	93.06

注：1、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；

2、本基金合同自 2023 年 3 月 22 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 1000 指数（000852.SH）变化 5%，其他变量不变；	
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 1000 指数数据回归得出，反映了基金和中证 1000 指数的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023 年 6 月 30 日）
	+5%	29,255,791.64
	-5%	-29,255,791.64

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	818,375,749.22
第二层次	—
第三层次	—
合计	818,375,749.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	818,375,749.22	92.40
	其中：股票	818,375,749.22	92.40
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	62,475,145.01	7.05
8	其他各项资产	4,877,270.69	0.55
9	合计	885,728,164.92	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,843.00	-
B	采矿业	21,209,848.60	2.41
C	制造业	511,692,336.99	58.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,594,532.00	1.77
E	建筑业	26,098,903.98	2.97
F	批发和零售业	23,787,867.00	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	46,542,484.30	5.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,814,043.66	7.94
J	金融业	44,798,973.60	5.09
K	房地产业	25,988,543.48	2.96
L	租赁和商务服务业	13,223,505.00	1.50
M	科学研究和技术服务业	6,545,788.20	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	5,346,387.31	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,136,460.00	0.13
Q	卫生和社会工作	532,845.00	0.06
R	文化、体育和娱乐	5,187,611.10	0.59

	业		
S	综合	873, 776. 00	0. 10
	合计	818, 375, 749. 22	93. 06

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600531	豫光金铅	1, 408, 400	8, 872, 920. 00	1. 01
2	600420	国药现代	775, 700	8, 757, 653. 00	1. 00
3	600125	铁龙物流	1, 446, 600	8, 737, 464. 00	0. 99
4	300762	上海瀚讯	737, 660	8, 682, 258. 20	0. 99
5	600717	天津港	1, 952, 800	8, 650, 904. 00	0. 98
6	600285	羚锐制药	531, 200	8, 531, 072. 00	0. 97
7	600017	日照港	2, 815, 100	8, 417, 149. 00	0. 96
8	002085	万丰奥威	1, 182, 100	8, 191, 953. 00	0. 93
9	300131	英唐智控	1, 538, 800	8, 078, 700. 00	0. 92
10	002421	达实智能	2, 281, 737	8, 031, 714. 24	0. 91
11	600360	华微电子	1, 154, 900	7, 945, 712. 00	0. 90
12	002020	京新药业	617, 120	7, 911, 478. 40	0. 90
13	300398	飞凯材料	451, 900	7, 768, 161. 00	0. 88
14	603328	依顿电子	936, 000	7, 750, 080. 00	0. 88
15	600750	江中药业	347, 400	7, 618, 482. 00	0. 87
16	002635	安洁科技	544, 500	7, 514, 100. 00	0. 85
17	002815	崇达技术	602, 200	7, 497, 390. 00	0. 85
18	600320	振华重工	1, 986, 100	7, 408, 153. 00	0. 84
19	601929	吉视传媒	3, 951, 600	7, 270, 944. 00	0. 83
20	002302	西部建设	997, 300	7, 120, 722. 00	0. 81
21	000582	北部湾港	927, 590	7, 049, 684. 00	0. 80
22	002782	可立克	459, 590	7, 027, 131. 10	0. 80
23	002773	康弘药业	366, 800	7, 013, 216. 00	0. 80
24	002344	海宁皮城	1, 477, 400	6, 988, 102. 00	0. 79
25	600639	浦东金桥	553, 128	6, 864, 318. 48	0. 78
26	002697	红旗连锁	1, 159, 900	6, 773, 816. 00	0. 77
27	600583	海油工程	1, 141, 796	6, 679, 506. 60	0. 76
28	600284	浦东建设	1, 071, 900	6, 560, 028. 00	0. 75
29	002106	莱宝高科	758, 200	6, 444, 700. 00	0. 73

30	300035	中科电气	516,500	6,208,330.00	0.71
31	300382	斯莱克	446,541	5,889,875.79	0.67
32	300377	赢时胜	724,700	5,870,070.00	0.67
33	002367	康力电梯	640,200	5,845,026.00	0.66
34	002237	恒邦股份	525,100	5,718,339.00	0.65
35	002063	远光软件	657,800	5,709,704.00	0.65
36	002402	和而泰	327,800	5,566,044.00	0.63
37	600850	电科数字	231,380	5,458,254.20	0.62
38	000627	天茂集团	1,814,700	5,444,100.00	0.62
39	688148	芳源股份	436,585	5,326,337.00	0.61
40	002332	仙琚制药	398,800	5,284,100.00	0.60
41	600864	哈投股份	1,032,500	5,276,075.00	0.60
42	002990	盛视科技	143,000	5,262,400.00	0.60
43	300123	亚光科技	720,000	5,241,600.00	0.60
44	600720	祁连山	460,400	5,234,748.00	0.60
45	002768	国恩股份	215,900	5,222,621.00	0.59
46	603018	华设集团	569,800	4,985,750.00	0.57
47	600184	光电股份	377,200	4,952,636.00	0.56
48	600478	科力远	692,300	4,943,022.00	0.56
49	002017	东信和平	375,210	4,919,003.10	0.56
50	300352	北信源	965,200	4,864,608.00	0.55
51	002405	四维图新	410,100	4,748,958.00	0.54
52	000517	荣安地产	1,556,900	4,748,545.00	0.54
53	600990	四创电子	149,700	4,736,508.00	0.54
54	000650	仁和药业	770,500	4,730,870.00	0.54
55	002636	金安国纪	507,900	4,687,917.00	0.53
56	002139	拓邦股份	356,500	4,652,325.00	0.53
57	601137	博威合金	293,300	4,563,748.00	0.52
58	300765	新诺威	351,100	4,525,679.00	0.51
59	300900	广联航空	156,600	4,511,646.00	0.51
60	601963	重庆银行	568,400	4,496,044.00	0.51
61	600908	无锡银行	830,300	4,450,408.00	0.51
62	600172	黄河旋风	1,030,300	4,409,684.00	0.50
63	000901	航天科技	410,879	4,396,405.30	0.50
64	600502	安徽建工	823,677	4,349,014.56	0.49
65	600635	大众公用	1,286,900	4,272,508.00	0.49
66	000951	中国重汽	253,500	4,271,475.00	0.49
67	300102	乾照光电	633,000	4,165,140.00	0.47
68	600073	上海梅林	562,900	4,109,170.00	0.47
69	300348	长亮科技	391,700	4,089,348.00	0.46
70	600963	岳阳林纸	548,500	4,042,445.00	0.46
71	002130	沃尔核材	477,800	3,879,736.00	0.44
72	600621	华鑫股份	346,200	3,680,106.00	0.42

73	002061	浙江交科	824,400	3,676,824.00	0.42
74	300079	数码视讯	597,700	3,645,970.00	0.41
75	300767	震安科技	143,268	3,633,276.48	0.41
76	603915	国茂股份	171,340	3,628,981.20	0.41
77	601567	三星医疗	285,800	3,609,654.00	0.41
78	000885	城发环境	265,830	3,538,197.30	0.40
79	600120	浙江东方	915,300	3,505,599.00	0.40
80	002461	珠江啤酒	396,900	3,496,689.00	0.40
81	300319	麦捷科技	407,900	3,491,624.00	0.40
82	000059	华锦股份	553,200	3,479,628.00	0.40
83	001696	宗申动力	490,900	3,475,572.00	0.40
84	002413	雷科防务	657,800	3,440,294.00	0.39
85	600761	安徽合力	170,300	3,394,079.00	0.39
86	603989	艾华集团	155,000	3,264,300.00	0.37
87	002400	省广集团	673,600	3,240,016.00	0.37
88	002004	华邦健康	635,900	3,179,500.00	0.36
89	002243	力合科创	369,615	3,145,423.65	0.36
90	688425	铁建重工	638,492	3,071,146.52	0.35
91	600643	爱建集团	581,400	2,907,000.00	0.33
92	600308	华泰股份	778,380	2,895,573.60	0.33
93	601126	四方股份	190,100	2,887,619.00	0.33
94	300323	华灿光电	420,800	2,882,480.00	0.33
95	300428	立中集团	122,900	2,834,074.00	0.32
96	002215	诺普信	376,600	2,828,266.00	0.32
97	603466	风语筑	201,619	2,802,504.10	0.32
98	603601	再升科技	645,400	2,755,858.00	0.31
99	000811	冰轮环境	173,400	2,732,784.00	0.31
100	600508	上海能源	185,400	2,721,672.00	0.31
101	600210	紫江企业	502,100	2,671,172.00	0.30
102	600933	爱柯迪	113,400	2,641,086.00	0.30
103	600312	平高电气	211,500	2,620,485.00	0.30
104	600206	有研新材	198,900	2,613,546.00	0.30
105	000828	东莞控股	282,300	2,583,045.00	0.29
106	003012	东鹏控股	319,200	2,582,328.00	0.29
107	300455	航天智装	224,400	2,569,380.00	0.29
108	002737	葵花药业	104,793	2,550,661.62	0.29
109	603093	南华期货	231,100	2,516,679.00	0.29
110	300134	大富科技	241,835	2,478,808.75	0.28
111	002135	东南网架	382,500	2,470,950.00	0.28
112	300735	光弘科技	230,300	2,464,210.00	0.28
113	603212	赛伍技术	117,533	2,445,861.73	0.28
114	000727	冠捷科技	1,136,000	2,408,320.00	0.27
115	300457	赢合科技	136,338	2,407,729.08	0.27

116	003040	楚天龙	132,240	2,398,833.60	0.27
117	000557	西部创业	453,600	2,390,472.00	0.27
118	601619	嘉泽新能	522,700	2,378,285.00	0.27
119	603043	广州酒家	83,000	2,345,580.00	0.27
120	600971	恒源煤电	300,300	2,339,337.00	0.27
121	000737	北方铜业	433,410	2,336,079.90	0.27
122	002335	科华数据	64,100	2,304,395.00	0.26
123	000969	安泰科技	241,700	2,288,899.00	0.26
124	301238	瑞泰新材	112,500	2,288,250.00	0.26
125	688518	联赢激光	78,822	2,195,980.92	0.25
126	601975	招商南油	763,600	2,183,896.00	0.25
127	300332	天壕环境	190,000	2,179,300.00	0.25
128	002467	二六三	437,500	2,174,375.00	0.25
129	603567	珍宝岛	144,400	2,160,224.00	0.25
130	000923	河钢资源	159,500	2,153,250.00	0.24
131	000913	钱江摩托	117,600	2,143,848.00	0.24
132	601068	中铝国际	396,300	2,124,168.00	0.24
133	002489	浙江永强	521,200	2,110,860.00	0.24
134	601519	大智慧	290,600	2,080,696.00	0.24
135	002810	山东赫达	114,400	2,059,200.00	0.23
136	002895	川恒股份	104,500	2,058,650.00	0.23
137	603733	仙鹤股份	98,200	2,047,470.00	0.23
138	000028	国药一致	46,500	2,027,865.00	0.23
139	601528	瑞丰银行	416,660	2,020,801.00	0.23
140	002839	张家港行	472,600	1,999,098.00	0.23
141	002649	博彦科技	139,500	1,971,135.00	0.22
142	300477	合纵科技	421,400	1,967,938.00	0.22
143	600248	陕西建工	410,500	1,958,085.00	0.22
144	603906	龙蟠科技	107,700	1,954,755.00	0.22
145	002741	光华科技	115,800	1,954,704.00	0.22
146	002285	世联行	763,400	1,954,304.00	0.22
147	002314	南山控股	590,400	1,948,320.00	0.22
148	300409	道氏技术	154,400	1,940,808.00	0.22
149	300206	理邦仪器	128,000	1,930,240.00	0.22
150	002759	天际股份	137,600	1,923,648.00	0.22
151	000758	中色股份	406,300	1,917,736.00	0.22
152	002163	海南发展	190,900	1,909,000.00	0.22
153	600876	凯盛新能	119,600	1,908,816.00	0.22
154	000036	华联控股	458,900	1,890,668.00	0.21
155	300183	东软载波	114,300	1,887,093.00	0.21
156	603936	博敏电子	157,000	1,884,000.00	0.21
157	002206	海利得	346,800	1,858,848.00	0.21
158	002389	航天彩虹	83,000	1,843,430.00	0.21

159	002274	华昌化工	244,400	1,830,556.00	0.21
160	002218	拓日新能	380,952	1,828,569.60	0.21
161	000061	农产品	303,800	1,819,762.00	0.21
162	002267	陕天然气	228,200	1,807,344.00	0.21
163	601212	白银有色	662,000	1,800,640.00	0.20
164	002174	游族网络	106,300	1,785,840.00	0.20
165	600572	康恩贝	260,700	1,785,795.00	0.20
166	600789	鲁抗医药	275,000	1,765,500.00	0.20
167	002233	塔牌集团	225,700	1,742,404.00	0.20
168	002201	正威新材	182,100	1,731,771.00	0.20
169	000088	盐田港	352,500	1,709,625.00	0.19
170	300485	赛升药业	164,600	1,683,858.00	0.19
171	601200	上海环境	176,500	1,674,985.00	0.19
172	600007	中国国贸	90,400	1,674,208.00	0.19
173	600552	凯盛科技	140,100	1,658,784.00	0.19
174	603766	隆鑫通用	309,900	1,636,272.00	0.19
175	605369	拱东医疗	29,100	1,630,764.00	0.19
176	300768	迪普科技	96,300	1,595,691.00	0.18
177	002204	大连重工	309,800	1,592,372.00	0.18
178	600783	鲁信创投	121,100	1,565,823.00	0.18
179	300091	金通灵	525,380	1,565,632.40	0.18
180	603171	税友股份	38,900	1,555,222.00	0.18
181	603368	柳药集团	62,900	1,554,259.00	0.18
182	000426	兴业银锡	173,100	1,537,128.00	0.17
183	002961	瑞达期货	105,700	1,523,137.00	0.17
184	600997	开滦股份	252,200	1,505,634.00	0.17
185	002310	东方园林	877,300	1,491,410.00	0.17
186	600874	创业环保	250,700	1,469,102.00	0.17
187	600577	精达股份	347,200	1,465,184.00	0.17
188	000950	重药控股	214,200	1,441,566.00	0.16
189	301039	中集车辆	108,600	1,436,778.00	0.16
190	300101	振芯科技	72,600	1,407,714.00	0.16
191	300119	瑞普生物	79,000	1,406,200.00	0.16
192	603995	甬金股份	58,200	1,391,562.00	0.16
193	600729	重庆百货	43,800	1,377,072.00	0.16
194	300587	天铁股份	177,400	1,365,980.00	0.16
195	688127	蓝特光学	77,428	1,365,055.64	0.16
196	002051	中工国际	114,200	1,362,406.00	0.15
197	002194	武汉凡谷	124,600	1,361,878.00	0.15
198	002967	广电计量	66,500	1,335,985.00	0.15
199	300687	赛意信息	47,200	1,311,216.00	0.15
200	600490	鹏欣资源	355,000	1,306,400.00	0.15
201	002276	万马股份	107,800	1,305,458.00	0.15

202	603595	东尼电子	30,200	1,293,164.00	0.15
203	600185	格力地产	185,400	1,271,844.00	0.14
204	603053	成都燃气	125,500	1,263,785.00	0.14
205	002214	大立科技	91,500	1,248,975.00	0.14
206	600562	国睿科技	76,100	1,232,820.00	0.14
207	300065	海兰信	98,300	1,217,937.00	0.14
208	002488	金固股份	175,700	1,212,330.00	0.14
209	601099	太平洋	467,800	1,206,924.00	0.14
210	000603	盛达资源	99,400	1,201,746.00	0.14
211	002481	双塔食品	262,400	1,170,304.00	0.13
212	300180	华峰超纤	317,100	1,144,731.00	0.13
213	002727	一心堂	43,100	1,137,840.00	0.13
214	003032	传智教育	78,000	1,136,460.00	0.13
215	002324	普利特	78,700	1,123,049.00	0.13
216	002698	博实股份	63,700	1,114,113.00	0.13
217	603055	台华新材	99,000	1,099,890.00	0.13
218	601515	东风股份	249,702	1,093,694.76	0.12
219	600037	歌华有线	131,600	1,093,596.00	0.12
220	000488	晨鸣纸业	224,100	1,086,885.00	0.12
221	603098	森特股份	52,400	1,074,200.00	0.12
222	600649	城投控股	271,600	1,067,388.00	0.12
223	002283	天润工业	165,800	1,064,436.00	0.12
224	601921	浙版传媒	121,900	1,059,311.00	0.12
225	000560	我爱我家	393,000	1,041,450.00	0.12
226	600458	时代新材	83,800	1,004,762.00	0.11
227	002446	盛路通信	106,300	1,004,535.00	0.11
228	300821	东岳硅材	102,800	1,001,272.00	0.11
229	600559	老白干酒	40,800	1,000,008.00	0.11
230	603612	索通发展	57,500	996,475.00	0.11
231	300085	银之杰	84,500	993,720.00	0.11
232	603393	新天然气	36,800	987,712.00	0.11
233	002611	东方精工	170,700	979,818.00	0.11
234	000718	苏宁环球	353,100	963,963.00	0.11
235	600491	龙元建设	188,800	951,552.00	0.11
236	002549	凯美特气	82,600	949,900.00	0.11
237	600477	杭萧钢构	232,200	949,698.00	0.11
238	603306	华懋科技	32,500	943,150.00	0.11
239	603636	南威软件	62,800	921,276.00	0.10
240	600459	贵研铂业	59,600	911,880.00	0.10
241	002158	汉钟精机	35,900	896,064.00	0.10
242	000011	深物业 A	96,200	893,698.00	0.10
243	000682	东方电子	91,800	892,296.00	0.10
244	000685	中山公用	117,500	889,475.00	0.10

245	002320	海峡股份	145,400	878,216.00	0.10
246	600770	综艺股份	155,200	873,776.00	0.10
247	603979	金诚信	27,900	867,690.00	0.10
248	603013	亚普股份	54,800	859,264.00	0.10
249	000567	海德股份	66,180	848,427.60	0.10
250	601860	紫金银行	338,000	848,380.00	0.10
251	300109	新开源	34,100	848,067.00	0.10
252	601700	风范股份	157,900	838,449.00	0.10
253	600773	西藏城投	65,900	830,340.00	0.09
254	300738	奥飞数据	81,092	827,138.40	0.09
255	000652	泰达股份	196,800	810,816.00	0.09
256	002913	奥士康	21,200	809,416.00	0.09
257	002645	华宏科技	65,500	803,030.00	0.09
258	002946	新乳业	54,900	787,815.00	0.09
259	000058	深赛格	123,300	761,994.00	0.09
260	000801	四川九洲	103,500	755,550.00	0.09
261	600158	中体产业	73,800	749,808.00	0.09
262	000612	焦作万方	154,500	747,780.00	0.09
263	002312	川发龙蟒	87,500	711,375.00	0.08
264	300298	三诺生物	26,100	705,744.00	0.08
265	002245	蔚蓝锂芯	62,800	687,660.00	0.08
266	603113	金能科技	84,600	684,414.00	0.08
267	600363	联创光电	18,300	678,930.00	0.08
268	000921	海信家电	25,100	676,445.00	0.08
269	002573	清新环境	121,500	669,465.00	0.08
270	002498	汉缆股份	163,300	654,833.00	0.07
271	600523	贵航股份	45,600	654,816.00	0.07
272	000761	本钢板材	157,500	630,000.00	0.07
273	301071	力量钻石	14,300	629,200.00	0.07
274	002859	洁美科技	22,700	628,790.00	0.07
275	603505	金石资源	26,920	628,582.00	0.07
276	300055	万邦达	86,200	620,640.00	0.07
277	688733	壹石通	19,998	619,138.08	0.07
278	600742	一汽富维	74,800	612,612.00	0.07
279	601678	滨化股份	131,000	607,840.00	0.07
280	000498	山东路桥	94,501	606,696.42	0.07
281	300203	聚光科技	29,600	599,992.00	0.07
282	300080	易成新能	117,600	598,584.00	0.07
283	000030	富奥股份	118,000	594,720.00	0.07
284	603208	江山欧派	16,100	586,362.00	0.07
285	000762	西藏矿业	19,300	571,859.00	0.07
286	002747	埃斯顿	18,800	526,400.00	0.06
287	002190	成飞集成	23,600	522,504.00	0.06

288	300130	新国都	18,400	521,272.00	0.06
289	300855	图南股份	14,700	519,204.00	0.06
290	603187	海容冷链	25,540	510,544.60	0.06
291	600569	安阳钢铁	254,300	506,057.00	0.06
292	000555	神州信息	41,100	505,530.00	0.06
293	000829	天音控股	55,900	505,336.00	0.06
294	002239	奥特佳	188,700	503,829.00	0.06
295	002088	鲁阳节能	26,900	496,036.00	0.06
296	600618	氯碱化工	55,200	495,144.00	0.06
297	000672	上峰水泥	54,178	494,645.14	0.06
298	603718	海利生物	52,100	491,303.00	0.06
299	601330	绿色动力	66,129	488,693.31	0.06
300	605365	立达信	32,500	486,850.00	0.06
301	300973	立高食品	7,100	485,782.00	0.06
302	600223	鲁商发展	46,800	480,168.00	0.05
303	002733	雄韬股份	27,500	475,475.00	0.05
304	688508	芯朋微	8,118	470,762.82	0.05
305	600586	金晶科技	60,200	464,744.00	0.05
306	600966	博汇纸业	76,400	452,288.00	0.05
307	603916	苏博特	33,800	447,512.00	0.05
308	002979	雷赛智能	18,700	444,312.00	0.05
309	300143	盈康生命	38,900	441,126.00	0.05
310	000928	中钢国际	45,600	440,040.00	0.05
311	300236	上海新阳	10,600	420,290.00	0.05
312	603323	苏农银行	98,800	415,948.00	0.05
313	003006	百亚股份	23,400	404,352.00	0.05
314	600662	外服控股	70,600	403,832.00	0.05
315	300860	锋尚文化	7,200	399,168.00	0.05
316	002099	海翔药业	46,400	398,576.00	0.05
317	601702	华峰铝业	28,900	395,352.00	0.04
318	601399	国机重装	120,900	384,462.00	0.04
319	603416	信捷电气	9,000	371,790.00	0.04
320	002390	信邦制药	81,800	362,374.00	0.04
321	002664	信质集团	24,700	347,776.00	0.04
322	300031	宝通科技	12,900	318,888.00	0.04
323	600657	信达地产	75,100	317,673.00	0.04
324	688321	微芯生物	13,850	313,564.00	0.04
325	300662	科锐国际	8,300	293,571.00	0.03
326	300596	利安隆	7,200	292,824.00	0.03
327	002677	浙江美大	27,500	291,225.00	0.03
328	600151	航天机电	32,000	285,120.00	0.03
329	000657	中钨高新	28,600	277,134.00	0.03
330	600775	南京熊猫	25,500	275,145.00	0.03

331	002651	利君股份	34,100	264,957.00	0.03
332	603896	寿仙谷	5,700	252,510.00	0.03
333	603010	万盛股份	22,800	247,836.00	0.03
334	601918	新集能源	56,600	240,550.00	0.03
335	002641	公元股份	42,200	238,008.00	0.03
336	002023	海特高新	25,200	231,840.00	0.03
337	603060	国检集团	21,420	224,053.20	0.03
338	600821	金开新能	32,300	222,547.00	0.03
339	600366	宁波韵升	23,500	208,445.00	0.02
340	000968	蓝焰控股	27,500	207,900.00	0.02
341	300613	富瀚微	3,600	204,264.00	0.02
342	000989	九 芝 堂	14,300	197,912.00	0.02
343	605376	博迁新材	6,300	197,694.00	0.02
344	603877	太平鸟	7,200	182,016.00	0.02
345	603103	横店影视	10,500	176,820.00	0.02
346	600110	诺德股份	23,300	168,692.00	0.02
347	603299	苏盐井神	16,600	165,668.00	0.02
348	600370	三房巷	61,400	164,552.00	0.02
349	002626	金达威	8,300	155,957.00	0.02
350	002318	久立特材	8,600	146,458.00	0.02
351	600929	雪天盐业	18,400	146,096.00	0.02
352	688268	华特气体	1,791	144,587.43	0.02
353	601677	明泰铝业	10,400	144,352.00	0.02
354	000403	派林生物	7,100	141,716.00	0.02
355	300653	正海生物	4,100	140,999.00	0.02
356	300224	正海磁材	10,700	137,602.00	0.02
357	000566	海南海药	26,600	133,000.00	0.02
358	000791	甘肃能源	23,800	124,474.00	0.01
359	002646	天佑德酒	9,000	121,410.00	0.01
360	600057	厦门象屿	13,800	120,060.00	0.01
361	600480	凌云股份	14,900	117,114.00	0.01
362	000422	湖北宜化	9,700	111,356.00	0.01
363	600746	江苏索普	16,200	105,786.00	0.01
364	600169	太原重工	39,700	98,456.00	0.01
365	601011	宝泰隆	26,600	95,494.00	0.01
366	002891	中宠股份	3,900	94,146.00	0.01
367	000848	承德露露	10,600	93,810.00	0.01
368	002044	美年健康	12,900	91,719.00	0.01
369	601069	西部黄金	7,000	89,880.00	0.01
370	601886	江河集团	9,200	81,788.00	0.01
371	300894	火星人	3,200	81,728.00	0.01
372	002516	旷达科技	16,600	80,344.00	0.01
373	600058	五矿发展	8,100	79,623.00	0.01

374	600323	瀚蓝环境	3,800	71,934.00	0.01
375	000048	京基智农	3,500	68,320.00	0.01
376	600688	上海石化	19,600	60,956.00	0.01
377	300191	潜能恒信	2,900	53,012.00	0.01
378	002918	蒙娜丽莎	3,400	52,496.00	0.01
379	603305	旭升集团	1,820	50,723.40	0.01
380	300470	中密控股	1,000	46,220.00	0.01
381	605009	豪悦护理	900	43,200.00	0.00
382	600266	城建发展	8,200	41,656.00	0.00
383	002440	闰土股份	6,200	41,354.00	0.00
384	002960	青鸟消防	2,000	36,420.00	0.00
385	002950	奥美医疗	3,500	36,330.00	0.00
386	600869	远东股份	6,000	33,120.00	0.00
387	002378	章源钨业	5,100	29,682.00	0.00
388	002216	三全食品	1,400	21,812.00	0.00
389	601609	金田股份	2,600	16,874.00	0.00
390	000712	锦龙股份	1,100	13,728.00	0.00
391	300761	立华股份	100	1,843.00	0.00
392	603123	翠微股份	100	974.00	0.00
393	603429	集友股份	100	886.00	0.00

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

注：无

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601519	大智慧	17,047,669.73	1.94
2	600750	江中药业	14,400,307.76	1.64
3	300348	长亮科技	13,665,960.00	1.55
4	002405	四维图新	13,173,498.00	1.50
5	688680	海优新材	13,030,419.83	1.48
6	600125	铁龙物流	12,913,889.00	1.47
7	002020	京新药业	12,778,808.44	1.45
8	002061	浙江交科	12,740,200.00	1.45
9	300134	大富科技	11,570,387.83	1.32
10	600531	豫光金铅	11,529,887.14	1.31
11	600502	安徽建工	11,431,071.73	1.30
12	002773	康弘药业	11,334,219.42	1.29
13	300398	飞凯材料	10,881,638.00	1.24
14	300382	斯莱克	10,871,765.40	1.24
15	600420	国药现代	10,779,881.76	1.23

16	000951	中国重汽	10,641,374.35	1.21
17	600717	天津港	10,475,655.99	1.19
18	603328	依顿电子	10,468,232.00	1.19
19	002302	西部建设	10,302,385.00	1.17
20	600583	海油工程	10,292,886.48	1.17

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601519	大智慧	15,527,311.18	1.77
2	688680	海优新材	11,912,818.93	1.35
3	600710	苏美达	11,177,123.11	1.27
4	300134	大富科技	10,064,918.06	1.14
5	000989	九 芝 堂	10,016,931.40	1.14
6	600266	城建发展	9,985,896.00	1.14
7	600797	浙大网新	9,789,797.44	1.11
8	300451	创业慧康	9,436,171.00	1.07
9	600586	金晶科技	9,322,550.97	1.06
10	002617	露笑科技	9,301,373.70	1.06
11	000917	电广传媒	9,225,169.92	1.05
12	605111	新洁能	9,221,546.58	1.05
13	300687	赛意信息	9,176,164.00	1.04
14	300348	长亮科技	8,764,039.00	1.00
15	002061	浙江交科	8,573,775.40	0.97
16	000860	顺鑫农业	8,477,858.88	0.96
17	603118	共进股份	8,465,556.00	0.96
18	300393	中来股份	8,405,234.00	0.96
19	600776	东方通信	8,375,739.62	0.95
20	002126	银轮股份	8,252,825.32	0.94

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,272,661,398.41
卖出股票收入（成交）总额	1,438,703,024.24

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，浙江万丰奥威汽轮股份有限公司于 2023 年 06 月 07 日受到中华人民共和国宁波海事局给予 19000 元罚款，于 2023 年 02 月 17 日受到中华人民共和国宁波海事局给予 8500 元罚款。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,877,270.69

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,877,270.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国金中证 1000 指数增强 A	6,228	98,064.46	56,964,328.76	9.33	553,781,119.93	90.67
国金中证 1000 指数增强 C	3,273	85,854.97	53,721,287.03	19.12	227,282,014.58	80.88
合计	9,501	93,858.41	110,685,615.79	12.41	781,063,134.51	87.59

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金中证 1000 指数增强 A	277,814.16	0.0455
	国金中证 1000 指数增强 C	301,271.69	0.1072
	合计	579,085.85	0.0649

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金中证 1000 指数增强 A	10~50
	国金中证 1000 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	国金中证 1000 指数增强 A	0
	国金中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金中证 1000 指数增强 A	国金中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 3 月 22 日) 基金份额总额	627,872,206.43	311,414,546.88
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	262,021.06	5,218,422.21
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	17,388,778.80	35,629,667.48
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	610,745,448.69	281,003,301.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

原督察长张丽女士自 2023 年 6 月 14 日起由于个人原因离任基金管理人督察长职务，自 2023 年 6 月 14 日至 2023 年 7 月 23 日由公司总经理邵海波先生代任督察长职务，张静女士自 2023 年 7 月 24 日起担任基金管理人督察长职务。

除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内未有投资策略改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国金证券股份有限公司	2	3,711,364,422.65	100.00	2,321,950.13	100.00	-

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

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ①经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券

市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；

⑤交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

②本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本基金本报告期新增国金证券两个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国金证券股份有限公司	-	-	4,727,136.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 01 日
2	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 01 日
3	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 01 日
4	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 A 份额）基金产品资料概要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 01 日
5	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 C 份额）基金产品资料概要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 01 日
6	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 01 日
7	《关于国金中证 1000 指数增强型证券投资基金提前结束募集的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 13 日
8	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 23 日
9	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 24 日

10	《国金中证 1000 指数增强型证券投资基金（国金中证 1000 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 24 日
11	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 31 日
12	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 16 日

注：本报告期内，基金管理人按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日