

# 国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2022 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<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.....	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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	66
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.....	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
7.12 投资组合报告附注.....	67
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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的情况.....	69
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>70</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>71</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	73
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>75</b>

---

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>76</b>
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

## § 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
场内简称	-
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	36,346,576.69 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：国金沪深 300 指数增强证券投资基金由国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册而来，基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效。

### 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	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。
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。

注：国金沪深 300 指数增强证券投资基金由国金沪深 300 指数分级证券投资基金变更注册而来，基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽	石立平
	联系电话	010-88005632	010-63639180
	电子邮箱	zhangli@gfund.com	shiliping@cebbank.com

客户服务电话	4000-2000-18	95595
传真	010-88005666	010-63639132
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100089	100033
法定代表人	邵海波	李晓鹏

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	-4,609,330.59
本期利润	-3,755,725.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1025
本期加权平均净值利润率	-10.04%
本期基金份额净值增长率	-8.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2022 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	2,743,651.30
期末可供分配基金份额利润	0.0755
期末基金资产净值	39,090,227.99
期末基金份额净值	1.0755
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2022 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	7.55%

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

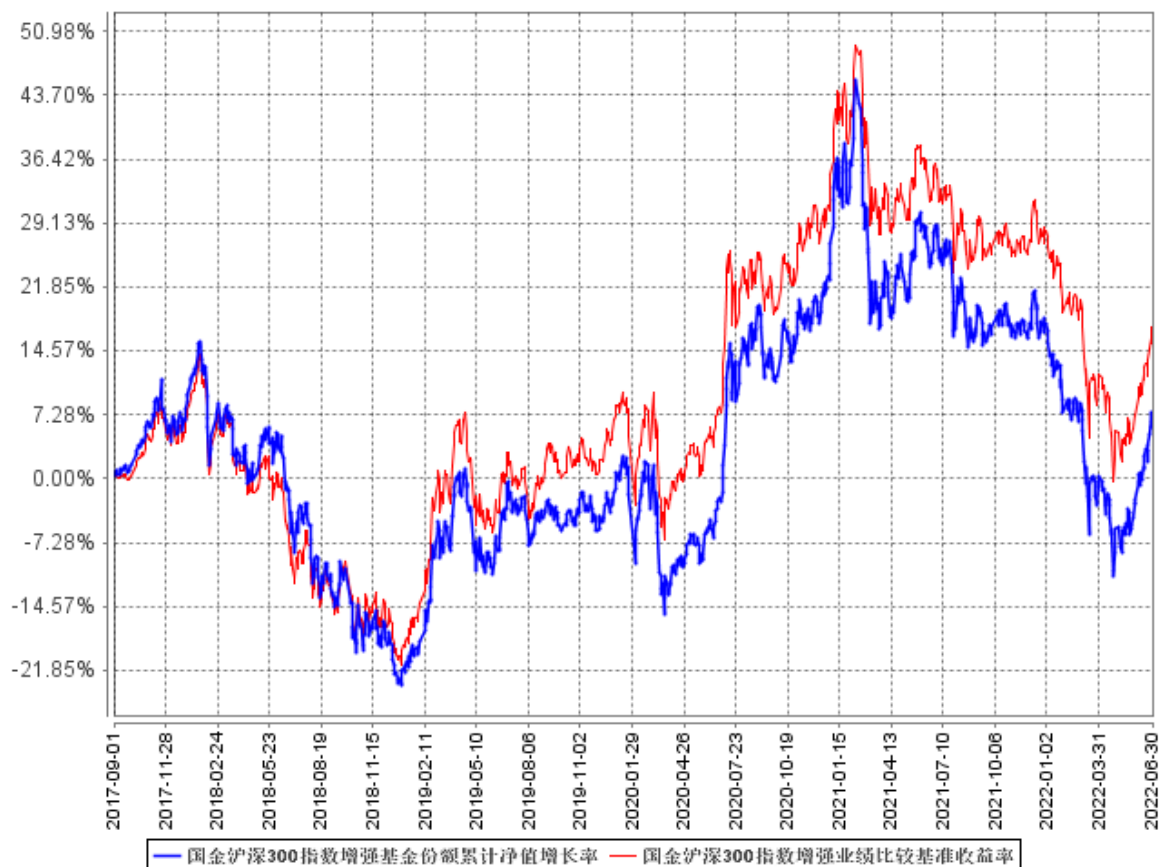
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.65%	1.06%	9.12%	1.02%	1.53%	0.04%
过去三个月	8.67%	1.42%	5.93%	1.36%	2.74%	0.06%
过去六个月	-8.69%	1.44%	-8.72%	1.38%	0.03%	0.06%
过去一年	-16.30%	1.25%	-13.40%	1.18%	-2.90%	0.07%
过去三年	11.45%	1.29%	16.70%	1.20%	-5.25%	0.09%
自基金合同生效起至今	7.55%	1.27%	17.05%	1.22%	-9.50%	0.05%



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

### 3.2.2 自基金转型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

国金沪深300指数增强基金份额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，图示日期为 2017 年 9 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为49%、19.5%、19.5%、7%、1.5%、1.9%和1.6%。截至2022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、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、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、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠远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、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金、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、国金量化精选混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金惠利纯债债券型证券投资基金、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。

#### 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		
宫雪	本基金基金经理， 国金上证50指数增强（LOF）、 国金鑫新	2013年7月26日	-	14	宫雪女士，中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月

	灵活配置 (LOF)、国金鑫瑞灵活基金经理, 创新投资部总经理				至今在国金基金管理有限公司, 历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理、量化投资事业三部总经理兼产品中心代总经理; 现任创新投资部总经理。
--	---------------------------------	--	--	--	---

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》、《国金沪深 300 指数增强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, 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

报告期内，货币政策保持宽松，促消费政策不断释放，且疫情恢复预期加强，消费相关领域呈现明显的恢复态势，新能源汽车受政策助力尤为明显，地产政策也在加快发力。股票市场反弹明显，目前股票估值水平回到中位以上，整体看有继续向好态势。本基金严格遵守基金合同，仍采取部分复制标的指数沪深 300 的投资策略，适当选择指数成份外个股，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法对波动因子进行筛选，配置驱动力强的因子并结合风险控制，追求超过沪深 300 指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为-8.69%，同期业绩比较基准增长率为-8.72%；报告期内，本基金的日均跟踪偏离度为 0.13%，低于合同约定的日均跟踪偏离度 0.5% 的水平，年化跟踪误差为 2.51%，低于合同约定的年化跟踪误差 8% 的水平。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前货币政策保持宽松，促消费政策不断释放，且疫情恢复预期加强，消费相关领域呈现明显的恢复态势，新能源汽车受政策助力尤为明显，地产政策也在加快发力。股票市场反弹明显，目前股票估值水平回到中位以上，整体看有继续向好态势，但热门板块估值抬升。展望 2022 年下半年市场仍以震荡为主，存在结构性机会。

#### 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《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定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。基金经理作为估值委员会的成员之一，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，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

#### **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。

#### **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的情况。截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2022 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,362,162.37	2,829,028.07
结算备付金		64,865.15	83,196.37
存出保证金		10,062.63	9,384.06
交易性金融资产	6.4.7.2	37,175,536.67	39,997,473.35
其中：股票投资		37,175,536.67	39,955,473.35
基金投资		-	-
债券投资		-	42,000.00
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		-	347,027.90
应收股利		-	-
应收申购款		172,399.82	97,587.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	660.83
资产总计		39,785,026.64	43,364,357.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,468.42	447,362.40

应付赎回款		204,601.83	154,431.50
应付管理人报酬		30,478.22	35,642.51
应付托管费		6,095.65	7,128.48
应付销售服务费		-	-
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	451,154.53	570,181.10
负债合计		694,798.65	1,214,745.99
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	36,346,576.69	35,787,076.17
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,743,651.30	6,362,535.44
净资产合计		39,090,227.99	42,149,611.61
负债和净资产总计		39,785,026.64	43,364,357.60

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0755 元，基金份额总额 36,346,576.69 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金沪深 300 指数增强证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,383,192.21	1,000,806.56
1.利息收入		10,235.33	6,883.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,235.33	6,877.59
债券利息收入		-	5.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,265,359.04	1,864,775.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,609,037.42	1,708,063.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,829.03	6,493.05
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	338,849.35	150,219.43
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	853,604.67	-894,540.35
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	18,326.83	23,687.74
<b>减：二、营业总支出</b>		372,533.71	440,701.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	185,786.18	121,350.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,157.15	24,270.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	149,590.38	295,081.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,755,725.92	560,104.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,755,725.92	560,104.89
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-3,755,725.92	560,104.89

### 6.3 净资产（基金净值）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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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）	35,787,076.17	-	6,362,535.44	42,149,611.61

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)	35,787,076.17	-	6,362,535.44	42,149,611.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	559,500.52	-	-3,618,884.14	-3,059,383.62
(一)、综合收益总额	-	-	-3,755,725.92	-3,755,725.92
(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)	559,500.52	-	136,841.78	696,342.30
其中：1.基金申购款	14,144,482.38	-	458,387.92	14,602,870.30
2.基金赎回款	-13,584,981.86	-	-321,546.14	-13,906,528.00
(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)	36,346,576.69	-	2,743,651.30	39,090,227.99
项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	16,369,783.18	-	4,385,008.75	20,754,791.93

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)	16,369,783.18	-	4,385,008.75	20,754,791.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,368,388.81	-	953,715.99	3,322,104.80
(一)、综合收益总额	-	-	560,104.89	560,104.89
(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)	2,368,388.81	-	393,611.10	2,761,999.91
其中：1.基金申购款	16,308,727.73	-	4,846,515.73	21,155,243.46
2.基金赎回款	-13,940,338.92	-	-4,452,904.63	-18,393,243.55
(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)	18,738,171.99	-	5,338,724.74	24,076,896.73

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          

基金管理人负责人

          聂武鹏          

主管会计工作负责人

          于晓莲          

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国金沪深 300 指数增强证券投资基金（以下简称“国金沪深 300 指数增强”）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，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）[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》的核准，国金 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，国金沪深 300 指数增强基金合同于 2017 年 9 月 1 日生效。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。

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）。

### 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。

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（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

-

#### 6.4.4.2 记账本位币

-

#### 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**

-

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

-

#### **6.4.4.7 实收基金**

-

#### **6.4.4.8 损益平准金**

-

#### **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**

-

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

-

#### **6.4.4.12 分部报告**

-



### 6.4.4.13 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

#### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,829,028.07 元，

自应收利息转入的重分类金额为人民币 616.46 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,829,644.53 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 83,196.37 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 38.83 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 83,235.20 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,384.06 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4.62 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,388.68 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 97,587.02 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 97,587.02 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 660.83 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 616.46 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 38.83 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 4.62 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.92 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 42,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.92 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 42,000.92 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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

##### 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；

##### 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。

### 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。

### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,362,162.37
等于：本金	2,361,685.84
加：应计利息	476.53
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：	2,362,162.37

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	36,746,248.17	-	37,175,536.67	429,288.50
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	36,746,248.17	-	37,175,536.67	429,288.50

### 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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	749.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	350,814.70
其中：交易所市场	350,814.70
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	49,590.38
其他应付款-指数使用费	50,000.00

合计	451,154.53
----	------------

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	35,787,076.17	35,787,076.17
本期申购	14,144,482.38	14,144,482.38
本期赎回(以“-”号填列)	-13,584,981.86	-13,584,981.86
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	36,346,576.69	36,346,576.69

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,027,226.50	-1,664,691.06	6,362,535.44
本期利润	-4,609,330.59	853,604.67	-3,755,725.92
本期基金份额交易产生的变动数	167,361.58	-30,519.80	136,841.78
其中：基金申购款	2,209,037.17	-1,750,649.25	458,387.92
基金赎回款	-2,041,675.59	1,720,129.45	-321,546.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,585,257.49	-841,606.19	2,743,651.30

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	1,010.77
其他	101.81
合计	10,235.33

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	71,787,045.20
减：卖出股票成本总额	76,197,474.32
减：交易费用	198,608.30
买卖股票差价收入	-4,609,037.42

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.58
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,826.45
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	4,829.03

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	46,830.00

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	42,000.00
减：应计利息总额	3.50
减：交易费用	0.05
买卖债券差价收入	4,826.45

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	338,849.35
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	338,849.35

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	853,604.67
——股票投资	853,604.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	853,604.67

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,326.83
合计	18,326.83

#### 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	149,590.38

#### 6.4.7.24 分部报告

无

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期未发生变化。

#### 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
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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国金证券	21,172,955.10	14.68%	62,329,514.04	50.97%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国金证券	-	-	17,327.89	36.03%

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

###### 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 2022年1月1日至2022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	15,483.97	13.52%	75,825.38	21.61%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	45,581.48	45.82%	58,075.23	20.28%

**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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	185,786.18
其中：支付销售机构的客户维护费	68,762.01	40,654.14

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,157.15	24,270.06

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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

注：无

#### 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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行-活期	2,362,162.37	9,122.75	1,611,692.77	6,011.64

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无

#### 6.4.12 期末（2022 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

注：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：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	42,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	42,000.00

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	2,362,162.37	-	-	-	-	-	2,362,162.37
结算备付金	64,865.15	-	-	-	-	-	64,865.15
存出保证金	10,062.63	-	-	-	-	-	10,062.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	37,175,536.67	37,175,536.67

应收申购款	-	-	-	-	-	172,399.82	172,399.82
资产总计	2,437,090.15	-	-	-	-	37,347,936.49	39,785,026.64
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,468.42	2,468.42
应付赎回款	-	-	-	-	-	204,601.83	204,601.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,478.22	30,478.22
应付托管费	-	-	-	-	-	6,095.65	6,095.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	350,814.70	350,814.70
其他负债	-	-	-	-	-	100,339.83	100,339.83
负债总计	-	-	-	-	-	694,798.65	694,798.65
利率敏感度缺口	2,437,090.15	-	-	-	-	36,653,137.84	39,090,227.99
上年度末 2021 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							
银行存款	2,829,028.07	-	-	-	-	-	2,829,028.07
结算备付金	83,196.37	-	-	-	-	-	83,196.37
存出保证金	9,384.06	-	-	-	-	-	9,384.06
交易性金融资产	-	-	-	-	42,000.00	39,955,473.35	39,997,473.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	347,027.90	347,027.90
应收利息	-	-	-	-	-	660.83	660.83
应收申购款	-	-	-	-	-	97,587.02	97,587.02
资产总计	2,921,608.50	-	-	-	42,000.00	40,400,749.10	43,364,357.60
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	447,362.40	447,362.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	154,431.50	154,431.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,642.51	35,642.51
应付托管费	-	-	-	-	-	7,128.48	7,128.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	269,601.15	269,601.15
其他负债	-	-	-	-	-	300,579.95	300,579.95
负债总计	-	-	-	-	-	1,214,745.99	1,214,745.99
利率敏感度缺口	2,921,608.50	-	-	-	42,000.00	39,186,003.11	42,149,611.61

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-	-599.46
	-25 个基点	-	609.70

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股（投资比例不低于非现金基金资产的 80%）。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022 年 6 月 30 日		2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	37,175,536.67	95.10	39,955,473.35	94.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	37,175,536.67	95.10	39,955,473.35	94.79

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数 (000300.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	0.05	1,915,392.26	2,242,351.57
	-0.05	-1,915,392.26	-2,242,351.57

#### 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。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	37,175,536.67	39,951,506.15
第二层次	-	45,967.20
第三层次	-	-
合计	37,175,536.67	39,997,473.35

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,175,536.67	93.44
	其中：股票	37,175,536.67	93.44
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	2,427,027.52	6.10
8	其他各项资产	182,462.45	0.46
9	合计	39,785,026.64	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

金额单位：人民币元

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	390,654.52	1.00
B	采矿业	658,576.07	1.68
C	制造业	21,031,446.01	53.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	945,486.69	2.42
E	建筑业	444,259.02	1.14
F	批发和零售业	141,330.88	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	857,132.45	2.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,194,729.42	3.06
J	金融业	5,047,715.17	12.91
K	房地产业	754,685.41	1.93
L	租赁和商务服务业	869,265.50	2.22
M	科学研究和技术服务业	439,228.09	1.12
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	191,848.68	0.49
R	文化、体育和娱乐业	21,350.40	0.05
S	综合	-	-
	合计	32,987,708.31	84.39

### 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

金额单位：人民币元

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	18,466.00	0.05
B	采矿业	117,896.00	0.30
C	制造业	2,703,669.26	6.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,101.00	0.07
E	建筑业	91,782.00	0.23
F	批发和零售业	326,527.56	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	115,423.00	0.30
H	住宿和餐饮业	17,540.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,098.50	0.28
J	金融业	87,808.20	0.22
K	房地产业	443,375.00	1.13
L	租赁和商务服务业	12,412.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	27,802.00	0.07
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	41,192.84	0.11
R	文化、体育和娱乐业	32,351.00	0.08
S	综合	14,384.00	0.04
	合计	4,187,828.36	10.71

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,241	2,537,845.00	6.49
2	600036	招商银行	20,812	878,266.40	2.25
3	300750	宁德时代	1,600	854,400.00	2.19
4	601318	中国平安	15,372	717,718.68	1.84
5	000858	五粮液	3,309	668,186.37	1.71
6	601012	隆基绿能	9,680	644,978.40	1.65
7	601888	中国中免	2,690	626,581.70	1.60
8	600900	长江电力	25,605	591,987.60	1.51
9	000333	美的集团	9,679	584,514.81	1.50
10	002594	比亚迪	1,448	482,893.52	1.24
11	600887	伊利股份	12,114	471,840.30	1.21
12	300059	东方财富	16,115	409,321.00	1.05
13	000568	泸州老窖	1,557	383,862.78	0.98
14	300760	迈瑞医疗	1,100	344,520.00	0.88
15	000002	万科 A	15,351	314,695.50	0.81
16	601166	兴业银行	15,732	313,066.80	0.80
17	300274	阳光电源	3,100	304,575.00	0.78
18	600132	重庆啤酒	2,000	293,200.00	0.75
19	600309	万华化学	2,996	290,582.04	0.74
20	600000	浦发银行	35,972	288,135.72	0.74
21	002475	立讯精密	8,525	288,059.75	0.74
22	002049	紫光国微	1,500	284,580.00	0.73
23	300014	亿纬锂能	2,900	282,750.00	0.72
24	000651	格力电器	8,354	281,696.88	0.72
25	603501	韦尔股份	1,600	276,848.00	0.71
26	600690	海尔智家	9,660	265,263.60	0.68
27	600030	中信证券	12,092	261,912.72	0.67
28	002129	TCL 中环	4,400	259,116.00	0.66
29	603259	药明康德	2,491	259,039.09	0.66
30	600660	福耀玻璃	6,179	258,343.99	0.66
31	600276	恒瑞医药	6,755	250,542.95	0.64
32	002027	分众传媒	36,060	242,683.80	0.62
33	600406	国电南瑞	8,827	238,329.00	0.61

34	000001	平安银行	15,546	232,879.08	0.60
35	002714	牧原股份	4,156	229,702.12	0.59
36	600438	通威股份	3,800	227,468.00	0.58
37	002460	赣锋锂业	1,500	223,050.00	0.57
38	000538	云南白药	3,503	211,546.17	0.54
39	000725	京东方 A	53,664	211,436.16	0.54
40	600009	上海机场	3,690	209,223.00	0.54
41	300124	汇川技术	3,114	205,119.18	0.52
42	300450	先导智能	3,200	202,176.00	0.52
43	600585	海螺水泥	5,728	202,083.84	0.52
44	002812	恩捷股份	800	200,360.00	0.51
45	600600	青岛啤酒	1,900	197,448.00	0.51
46	300316	晶盛机电	2,900	196,011.00	0.50
47	002415	海康威视	5,287	191,389.40	0.49
48	002410	广联达	3,500	190,540.00	0.49
49	002352	顺丰控股	3,400	189,754.00	0.49
50	603799	华友钴业	1,929	184,450.98	0.47
51	002241	歌尔股份	5,390	181,104.00	0.46
52	002304	洋河股份	980	179,487.00	0.46
53	300122	智飞生物	1,600	177,616.00	0.45
54	002230	科大讯飞	4,152	171,145.44	0.44
55	002142	宁波银行	4,772	170,885.32	0.44
56	600048	保利发展	9,687	169,135.02	0.43
57	600809	山西汾酒	500	162,400.00	0.42
58	601899	紫金矿业	17,305	161,455.65	0.41
59	300498	温氏股份	7,560	160,952.40	0.41
60	002459	晶澳科技	2,020	159,378.00	0.41
61	002311	海大集团	2,600	156,026.00	0.40
62	601225	陕西煤业	7,168	151,818.24	0.39
63	603288	海天味业	1,677	151,533.72	0.39
64	002271	东方雨虹	2,900	149,263.00	0.38
65	600089	特变电工	5,400	147,906.00	0.38
66	600436	片仔癀	400	142,692.00	0.37
67	000661	长春高新	600	140,052.00	0.36
68	601229	上海银行	21,366	139,947.30	0.36
69	000063	中兴通讯	5,467	139,572.51	0.36
70	300347	泰格医药	1,200	137,340.00	0.35
71	601668	中国建筑	25,266	134,415.12	0.34
72	000100	TCL 科技	27,571	132,065.09	0.34

73	600905	三峡能源	20,900	131,461.00	0.34
74	600031	三一重工	6,852	130,599.12	0.33
75	688599	天合光能	1,985	129,521.25	0.33
76	600050	中国联通	35,799	123,864.54	0.32
77	688981	中芯国际	2,722	122,952.74	0.31
78	601328	交通银行	24,603	122,522.94	0.31
79	601919	中远海控	8,810	122,459.00	0.31
80	603833	欧派家居	800	120,544.00	0.31
81	600460	士兰微	2,300	119,600.00	0.31
82	601688	华泰证券	8,413	119,464.60	0.31
83	600104	上汽集团	6,703	119,380.43	0.31
84	000625	长安汽车	6,876	119,092.32	0.30
85	300015	爱尔眼科	2,584	115,685.68	0.30
86	002236	大华股份	6,945	114,036.90	0.29
87	002050	三花智控	4,040	111,019.20	0.28
88	002371	北方华创	400	110,848.00	0.28
89	688012	中微公司	933	108,927.75	0.28
90	600196	复星医药	2,396	105,639.64	0.27
91	601398	工商银行	22,093	105,383.61	0.27
92	600845	宝信软件	1,920	104,832.00	0.27
93	601658	邮储银行	19,400	104,566.00	0.27
94	600919	江苏银行	14,550	103,596.00	0.27
95	000338	潍柴动力	8,220	102,503.40	0.26
96	600111	北方稀土	2,882	101,331.12	0.26
97	001979	招商蛇口	7,516	100,939.88	0.26
98	002938	鹏鼎控股	3,300	99,693.00	0.26
99	002709	天赐材料	1,600	99,296.00	0.25
100	601138	工业富联	10,000	98,400.00	0.25
101	000963	华东医药	2,168	97,906.88	0.25
102	603486	科沃斯	800	97,512.00	0.25
103	688396	华润微	1,633	96,461.31	0.25
104	688036	传音控股	1,052	93,869.96	0.24
105	603392	万泰生物	590	91,627.00	0.23
106	002074	国轩高科	2,000	91,200.00	0.23
107	002001	新和成	3,988	90,966.28	0.23
108	000938	紫光股份	4,683	90,850.20	0.23
109	002120	韵达股份	5,159	88,012.54	0.23
110	002466	天齐锂业	700	87,360.00	0.22
111	600176	中国巨石	4,900	85,309.00	0.22

112	601601	中国太保	3,623	85,249.19	0.22
113	603659	璞泰来	1,000	84,400.00	0.22
114	601816	京沪高铁	16,500	82,830.00	0.21
115	600383	金地集团	6,152	82,682.88	0.21
116	601088	中国神华	2,431	80,952.30	0.21
117	000792	盐湖股份	2,700	80,892.00	0.21
117	600926	杭州银行	5,400	80,892.00	0.21
118	600588	用友网络	3,638	78,980.98	0.20
119	600745	闻泰科技	900	76,599.00	0.20
120	601186	中国铁建	9,561	75,531.90	0.19
121	000596	古井贡酒	300	74,898.00	0.19
122	601390	中国中铁	11,836	72,673.04	0.19
123	603806	福斯特	1,100	72,072.00	0.18
124	600795	国电电力	18,199	71,158.09	0.18
125	600741	华域汽车	3,076	70,748.00	0.18
126	601169	北京银行	15,522	70,469.88	0.18
127	601985	中国核电	10,100	69,286.00	0.18
128	600893	航发动力	1,516	68,993.16	0.18
129	600016	民生银行	18,532	68,939.04	0.18
130	601009	南京银行	6,509	67,823.78	0.17
131	300601	康泰生物	1,500	67,770.00	0.17
132	300142	沃森生物	1,400	67,746.00	0.17
133	601633	长城汽车	1,810	67,042.40	0.17
134	600085	同仁堂	1,258	66,523.04	0.17
135	601238	广汽集团	4,340	66,141.60	0.17
136	000786	北新建材	1,900	65,778.00	0.17
137	000895	双汇发展	2,241	65,661.30	0.17
138	002493	荣盛石化	4,200	64,638.00	0.17
139	600426	华鲁恒升	2,200	64,240.00	0.16
140	600019	宝钢股份	10,377	62,469.54	0.16
141	600570	恒生电子	1,425	62,044.50	0.16
142	601155	新城控股	2,400	61,032.00	0.16
143	601288	农业银行	20,126	60,780.52	0.16
144	300896	爱美客	100	60,001.00	0.15
145	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.15
146	601100	恒立液压	920	56,782.40	0.15
147	002032	苏泊尔	1,000	56,340.00	0.14
148	601939	建设银行	9,184	55,655.04	0.14
149	601669	中国电建	7,002	55,105.74	0.14

150	000425	徐工机械	10,131	54,606.09	0.14
151	300661	圣邦股份	300	54,606.00	0.14
152	603185	上机数控	340	53,036.60	0.14
153	688111	金山办公	268	52,828.16	0.14
154	688005	容百科技	400	51,776.00	0.13
155	601799	星宇股份	300	51,300.00	0.13
156	300408	三环集团	1,700	51,170.00	0.13
157	601877	正泰电器	1,400	50,092.00	0.13
158	300751	迈为股份	100	49,090.00	0.13
159	601838	成都银行	2,900	48,082.00	0.12
160	601898	中煤能源	4,600	47,748.00	0.12
161	000776	广发证券	2,500	46,750.00	0.12
162	000876	新希望	3,010	46,053.00	0.12
163	600999	招商证券	3,141	45,261.81	0.12
164	603899	晨光股份	800	44,864.00	0.11
165	600010	宝钢股份	19,000	44,650.00	0.11
166	002920	德赛西威	300	44,400.00	0.11
167	600989	宝丰能源	3,000	43,950.00	0.11
168	300957	贝泰妮	200	43,506.00	0.11
169	600188	兖矿能源	1,100	43,428.00	0.11
170	600655	豫园股份	4,600	43,424.00	0.11
171	601988	中国银行	13,253	43,204.78	0.11
172	300782	卓胜微	320	43,200.00	0.11
172	600584	长电科技	1,600	43,200.00	0.11
173	300759	康龙化成	450	42,849.00	0.11
174	300763	锦浪科技	200	42,600.00	0.11
175	000800	一汽解放	4,500	42,030.00	0.11
176	600346	恒力石化	1,880	41,811.20	0.11
177	603882	金域医学	500	41,275.00	0.11
178	600760	中航沈飞	680	41,106.00	0.11
179	601006	大秦铁路	6,153	40,548.27	0.10
180	002202	金风科技	2,692	39,841.60	0.10
181	601766	中国中车	7,627	39,660.40	0.10
182	002648	卫星化学	1,519	39,266.15	0.10
183	300496	中科创达	300	39,144.00	0.10
184	603993	洛阳钼业	6,770	38,792.10	0.10
185	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.10
186	600547	山东黄金	2,077	38,549.12	0.10
187	600219	南山铝业	10,300	38,007.00	0.10

188	600015	华夏银行	7,171	37,360.91	0.10
189	002008	大族激光	1,100	36,443.00	0.09
190	600150	中国船舶	1,900	36,062.00	0.09
191	603369	今世缘	700	35,700.00	0.09
192	601995	中金公司	800	35,592.00	0.09
193	688008	澜起科技	586	35,499.88	0.09
194	601111	中国国航	3,056	35,480.16	0.09
195	600763	通策医疗	200	34,888.00	0.09
196	300207	欣旺达	1,100	34,760.00	0.09
197	600028	中国石化	8,409	34,308.72	0.09
198	600958	东方证券	3,344	34,142.24	0.09
199	002555	三七互娱	1,600	33,968.00	0.09
200	601857	中国石油	6,153	32,610.90	0.08
201	601800	中国交建	3,454	32,053.12	0.08
202	601628	中国人寿	1,017	31,608.36	0.08
203	300454	深信服	300	31,134.00	0.08
204	600886	国投电力	2,954	31,017.00	0.08
205	600029	南方航空	4,163	30,431.53	0.08
206	002601	龙佰集团	1,500	30,075.00	0.08
207	601336	新华保险	932	30,001.08	0.08
208	601868	中国能建	11,600	27,492.00	0.07
209	601989	中国重工	7,230	26,823.30	0.07
210	000157	中联重科	4,271	26,309.36	0.07
211	000069	华侨城 A	4,037	26,200.13	0.07
212	000768	中航西飞	852	25,807.08	0.07
213	600332	白云山	776	24,513.84	0.06
214	000166	申万宏源	5,691	24,414.39	0.06
215	601881	中国银河	2,500	24,175.00	0.06
216	601377	兴业证券	3,419	24,103.95	0.06
217	000977	浪潮信息	900	23,832.00	0.06
218	603260	合盛硅业	200	23,592.00	0.06
219	601600	中国铝业	4,926	23,398.50	0.06
220	601021	春秋航空	400	23,340.00	0.06
221	601066	中信建投	800	23,128.00	0.06
222	300595	欧普康视	400	22,876.00	0.06
223	601865	福莱特	600	22,860.00	0.06
224	300628	亿联网络	300	22,845.00	0.06
225	600115	中国东航	4,155	22,810.95	0.06
226	002007	华兰生物	995	22,686.00	0.06

227	002841	视源股份	300	22,596.00	0.06
228	300003	乐普医疗	1,200	22,284.00	0.06
229	601916	浙商银行	6,700	22,244.00	0.06
230	601117	中国化学	2,300	21,643.00	0.06
231	300999	金龙鱼	400	21,608.00	0.06
232	300413	芒果超媒	640	21,350.40	0.05
233	003816	中国广核	7,500	21,000.00	0.05
234	603019	中科曙光	720	20,894.40	0.05
235	000703	恒逸石化	1,940	20,389.40	0.05
236	600011	华能国际	2,800	19,712.00	0.05
237	002600	领益智造	3,900	19,578.00	0.05
238	300033	同花顺	200	19,230.00	0.05
239	002916	深南电路	200	18,742.00	0.05
240	600183	生益科技	1,100	18,689.00	0.05
241	000301	东方盛虹	1,100	18,601.00	0.05
242	600362	江西铜业	1,037	18,489.71	0.05
243	600941	中国移动	300	18,150.00	0.05
244	601966	玲珑轮胎	700	17,759.00	0.05
245	601901	方正证券	2,600	17,446.00	0.04
246	002736	国信证券	1,800	17,226.00	0.04
247	600352	浙江龙盛	1,596	16,247.28	0.04
248	601618	中国中冶	4,543	15,900.50	0.04
249	688126	沪硅产业	688	15,810.24	0.04
250	601360	三六零	1,829	15,583.08	0.04
251	601808	中海油服	1,100	15,345.00	0.04
252	603195	公牛集团	100	15,291.00	0.04
253	300529	健帆生物	300	15,267.00	0.04
254	002252	上海莱士	2,556	15,157.08	0.04
255	300433	蓝思科技	1,250	13,837.50	0.04
256	002602	世纪华通	2,866	13,814.12	0.04
257	600918	中泰证券	1,800	13,770.00	0.04
258	601878	浙商证券	1,200	13,656.00	0.03
259	600489	中金黄金	1,836	13,568.04	0.03
260	002064	华峰化学	1,600	13,504.00	0.03
261	000066	中国长城	1,200	12,984.00	0.03
262	002791	坚朗五金	100	12,972.00	0.03
263	601728	中国电信	3,400	12,682.00	0.03
264	300919	中伟股份	100	12,390.00	0.03
265	603160	汇顶科技	200	12,386.00	0.03



266	600018	上港集团	2,100	12,243.00	0.03
267	000708	中信特钢	600	12,090.00	0.03
268	002414	高德红外	868	11,171.16	0.03
269	688363	华熙生物	77	10,947.86	0.03
270	300223	北京君正	100	10,625.00	0.03
271	601216	君正集团	2,088	10,189.44	0.03
272	601319	中国人保	2,000	10,120.00	0.03
273	600061	国投资本	1,588	10,099.68	0.03
274	002568	百润股份	336	10,093.44	0.03
275	000408	藏格矿业	300	9,882.00	0.03
276	600161	天坛生物	400	9,712.00	0.02
277	603087	甘李药业	200	9,594.00	0.02
278	600606	绿地控股	2,385	9,444.60	0.02
279	601998	中信银行	1,937	9,200.75	0.02
280	600025	华能水电	1,100	7,689.00	0.02
281	300979	华利集团	100	7,308.00	0.02
282	300866	安克创新	100	6,632.00	0.02
283	601236	红塔证券	620	5,660.60	0.01
284	000877	天山股份	400	4,920.00	0.01
285	688561	奇安信	77	4,296.60	0.01
286	601825	沪农商行	600	3,762.00	0.01
287	601698	中国卫通	300	3,393.00	0.01
288	001289	龙源电力	100	2,176.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603605	珀莱雅	520	85,893.60	0.22
2	603233	大参林	2,608	81,630.40	0.21
3	002541	鸿路钢构	2,390	79,826.00	0.20
4	002223	鱼跃医疗	3,000	76,980.00	0.20
5	603939	益丰药房	1,400	73,962.00	0.19
6	600703	三安光电	3,000	73,740.00	0.19
7	601615	明阳智能	1,900	64,220.00	0.16
8	002036	联创电子	3,900	59,904.00	0.15
9	601607	上海医药	3,076	55,614.08	0.14
10	002727	一心堂	2,300	52,739.00	0.13

11	600325	华发股份	6,300	47,691.00	0.12
12	002273	水晶光电	3,900	47,229.00	0.12
13	603197	保隆科技	900	44,271.00	0.11
14	000011	深物业 A	3,200	43,232.00	0.11
15	600835	上海机电	3,100	42,563.00	0.11
16	000090	天健集团	6,100	42,029.00	0.11
17	600665	天地源	12,000	41,400.00	0.11
18	600007	中国国贸	2,800	41,300.00	0.11
19	601512	中新集团	4,600	41,262.00	0.11
20	600846	同济科技	5,200	41,080.00	0.11
21	600675	中华企业	13,400	41,004.00	0.10
22	600208	新湖中宝	14,800	40,848.00	0.10
23	600639	浦东金桥	3,000	40,770.00	0.10
24	600064	南京高科	3,700	40,700.00	0.10
25	600663	陆家嘴	3,900	40,404.00	0.10
26	603737	三棵树	300	38,829.00	0.10
27	603606	东方电缆	500	38,300.00	0.10
28	000799	酒鬼酒	200	37,162.00	0.10
29	600522	中天科技	1,600	36,960.00	0.09
30	002240	盛新锂能	600	36,216.00	0.09
31	300073	当升科技	400	36,136.00	0.09
32	300285	国瓷材料	1,000	35,920.00	0.09
33	600885	宏发股份	840	35,154.00	0.09
34	002557	洽洽食品	600	34,158.00	0.09
35	600392	盛和资源	1,400	31,640.00	0.08
36	300244	迪安诊断	1,000	31,100.00	0.08
37	600141	兴发集团	700	30,793.00	0.08
38	002756	永兴材料	200	30,442.00	0.08
39	002384	东山精密	1,300	29,809.00	0.08
40	605117	德业股份	100	27,989.00	0.07
41	688122	西部超导	300	27,660.00	0.07
42	000733	振华科技	200	27,194.00	0.07
43	600486	扬农化工	200	26,656.00	0.07
44	600233	圆通速递	1,300	26,507.00	0.07
45	603599	广信股份	940	26,461.00	0.07
46	002738	中矿资源	280	25,930.80	0.07
47	600256	广汇能源	2,400	25,296.00	0.06
48	002353	杰瑞股份	600	24,180.00	0.06
49	002507	涪陵榨菜	700	24,164.00	0.06

50	300803	指南针	400	23,512.00	0.06
51	300012	华测检测	1,000	23,210.00	0.06
52	601089	福元医药	1,066	22,439.30	0.06
53	600529	山东药玻	800	22,360.00	0.06
54	002597	金禾实业	500	21,665.00	0.06
55	002244	滨江集团	2,400	20,760.00	0.05
56	601689	拓普集团	300	20,529.00	0.05
57	600563	法拉电子	100	20,516.00	0.05
58	600298	安琪酵母	400	19,500.00	0.05
59	603489	八方股份	100	19,449.00	0.05
60	002372	伟星新材	800	19,232.00	0.05
61	300568	星源材质	649	18,846.96	0.05
62	000423	东阿阿胶	500	18,475.00	0.05
63	601128	常熟银行	2,400	18,336.00	0.05
64	601866	中远海发	6,100	18,300.00	0.05
65	600875	东方电气	1,100	18,095.00	0.05
66	000999	华润三九	400	18,000.00	0.05
67	300724	捷佳伟创	200	17,870.00	0.05
68	300144	宋城演艺	1,160	17,806.00	0.05
68	300850	新强联	200	17,806.00	0.05
69	300118	东方日升	600	17,598.00	0.05
70	603236	移远通信	130	17,375.80	0.04
71	300146	汤臣倍健	800	17,320.00	0.04
72	600872	中炬高新	500	17,305.00	0.04
73	600559	老白干酒	600	17,214.00	0.04
74	002075	沙钢股份	3,500	16,835.00	0.04
75	000422	湖北宜化	800	16,248.00	0.04
76	002439	启明星辰	800	15,944.00	0.04
77	002850	科达利	100	15,900.00	0.04
78	002930	宏川智慧	800	15,816.00	0.04
79	300253	卫宁健康	1,800	15,804.00	0.04
80	300502	新易盛	600	15,720.00	0.04
81	002216	三全食品	800	15,672.00	0.04
82	300308	中际旭创	500	15,525.00	0.04
83	002192	融捷股份	100	15,370.00	0.04
84	002747	埃斯顿	600	14,700.00	0.04
85	002407	多氟多	300	14,673.00	0.04
86	002508	老板电器	400	14,412.00	0.04
87	600673	东阳光	1,600	14,384.00	0.04

88	600153	建发股份	1,100	14,377.00	0.04
89	300457	赢合科技	500	14,205.00	0.04
90	000738	航发控制	500	14,050.00	0.04
91	603713	密尔克卫	100	13,670.00	0.03
92	002544	普天科技	600	13,650.00	0.03
93	605358	立昂微	200	13,476.00	0.03
94	002497	雅化集团	400	13,060.00	0.03
95	600803	新奥股份	700	13,013.00	0.03
96	002242	九阳股份	700	12,852.00	0.03
97	603613	国联股份	145	12,847.00	0.03
98	600754	锦江酒店	200	12,580.00	0.03
99	600348	华阳股份	800	12,368.00	0.03
100	600422	昆药集团	1,000	12,150.00	0.03
101	000983	山西焦煤	900	12,051.00	0.03
102	600884	杉杉股份	400	11,888.00	0.03
103	600160	巨化股份	900	11,835.00	0.03
104	002831	裕同科技	400	11,820.00	0.03
105	300699	光威复材	200	11,774.00	0.03
106	603589	口子窖	200	11,722.00	0.03
107	600993	马应龙	500	11,650.00	0.03
108	603517	绝味食品	200	11,564.00	0.03
109	300037	新宙邦	220	11,563.20	0.03
110	601717	郑煤机	800	11,528.00	0.03
111	300298	三诺生物	400	11,240.00	0.03
112	601233	桐昆股份	700	11,116.00	0.03
113	601577	长沙银行	1,400	11,102.00	0.03
114	002572	索菲亚	400	11,000.00	0.03
115	002340	格林美	1,200	10,920.00	0.03
116	002585	双星新材	600	10,854.00	0.03
117	600674	川投能源	900	10,728.00	0.03
118	000975	银泰黄金	1,100	10,714.00	0.03
119	002056	横店东磁	400	10,648.00	0.03
120	002258	利尔化学	440	10,392.80	0.03
121	603456	九洲药业	200	10,340.00	0.03
122	002463	沪电股份	700	10,332.00	0.03
123	600499	科达制造	500	10,320.00	0.03
124	000818	航锦科技	300	10,170.00	0.03
125	603338	浙江鼎力	200	10,140.00	0.03
126	688099	晶晨股份	100	10,100.00	0.03

127	002044	美年健康	1,812	10,092.84	0.03
128	000960	锡业股份	600	10,062.00	0.03
129	601231	环旭电子	700	10,052.00	0.03
130	600380	健康元	800	9,880.00	0.03
131	002326	永太科技	300	9,879.00	0.03
132	000848	承德露露	1,000	9,680.00	0.02
133	600206	有研新材	500	9,670.00	0.02
134	002468	申通快递	800	9,536.00	0.02
135	002505	鹏都农牧	2,800	9,492.00	0.02
136	600779	水井坊	100	9,254.00	0.02
137	601222	林洋能源	1,100	9,185.00	0.02
138	000933	神火股份	700	9,156.00	0.02
139	000629	攀钢钒钛	2,400	9,120.00	0.02
140	600521	华海药业	400	9,080.00	0.02
141	603816	顾家家居	160	9,060.80	0.02
142	300390	天华超净	100	8,740.00	0.02
143	600985	淮北矿业	600	8,736.00	0.02
144	603279	景津装备	280	8,682.80	0.02
145	600549	厦门钨业	400	8,648.00	0.02
146	002481	双塔食品	1,000	8,490.00	0.02
147	300034	钢研高纳	200	8,436.00	0.02
148	002294	信立泰	300	8,430.00	0.02
149	000039	中集集团	600	8,310.00	0.02
150	000915	华特达因	200	8,270.00	0.02
151	002080	中材科技	300	8,250.00	0.02
152	002138	顺络电子	300	8,175.00	0.02
153	601666	平煤股份	600	8,154.00	0.02
154	000630	铜陵有色	2,500	8,150.00	0.02
155	600566	济川药业	300	8,148.00	0.02
156	002212	天融信	800	8,120.00	0.02
157	603690	至纯科技	200	8,060.00	0.02
158	603387	基蛋生物	560	7,985.60	0.02
159	601696	中银证券	600	7,980.00	0.02
160	600057	厦门象屿	900	7,911.00	0.02
161	603218	日月股份	300	7,620.00	0.02
162	300682	朗新科技	300	7,557.00	0.02
163	601098	中南传媒	800	7,552.00	0.02
164	002405	四维图新	500	7,535.00	0.02
165	688180	君实生物	100	7,534.00	0.02

166	002422	科伦药业	400	7,480.00	0.02
167	601933	永辉超市	1,736	7,430.08	0.02
168	002013	中航机电	600	7,410.00	0.02
169	603008	喜临门	200	7,340.00	0.02
170	603529	爱玛科技	140	7,333.20	0.02
171	601699	潞安环能	500	7,310.00	0.02
172	002839	张家港行	1,380	7,300.20	0.02
173	603077	和邦生物	1,700	7,242.00	0.02
174	600704	物产中大	1,400	7,182.00	0.02
175	002028	思源电气	200	7,132.00	0.02
176	300373	扬杰科技	100	7,125.00	0.02
177	000921	海信家电	500	7,090.00	0.02
178	600373	中文传媒	700	6,993.00	0.02
179	000988	华工科技	300	6,951.00	0.02
180	000089	深圳机场	900	6,948.00	0.02
181	000729	燕京啤酒	700	6,762.00	0.02
182	002517	恺英网络	1,200	6,696.00	0.02
183	000998	隆平高科	400	6,664.00	0.02
184	603650	彤程新材	200	6,516.00	0.02
185	603198	迎驾贡酒	100	6,514.00	0.02
186	002690	美亚光电	290	6,287.20	0.02
187	002430	杭氧股份	200	6,252.00	0.02
188	000739	普洛药业	300	6,192.00	0.02
189	002249	大洋电机	1,000	6,140.00	0.02
190	002139	拓邦股份	500	6,135.00	0.02
191	002124	天邦食品	900	6,048.00	0.02
192	600755	厦门国贸	800	6,000.00	0.02
193	600004	白云机场	400	5,964.00	0.02
194	601000	唐山港	2,300	5,934.00	0.02
195	002985	北摩高科	100	5,858.00	0.01
196	600801	华新水泥	300	5,853.00	0.01
197	000581	威孚高科	300	5,775.00	0.01
198	002299	圣农发展	300	5,754.00	0.01
199	600143	金发科技	600	5,712.00	0.01
200	600596	新安股份	260	5,629.00	0.01
201	300072	三聚环保	1,100	5,566.00	0.01
202	002386	天原股份	500	5,510.00	0.01
203	002465	海格通信	600	5,454.00	0.01
204	600711	盛屯矿业	700	5,432.00	0.01

205	002191	劲嘉股份	500	5,360.00	0.01
206	300737	科顺股份	400	5,272.00	0.01
207	300401	花园生物	300	5,202.00	0.01
208	600705	中航产融	1,500	5,190.00	0.01
209	601077	渝农商行	1,400	5,180.00	0.01
210	600667	太极实业	700	5,166.00	0.01
211	300685	艾德生物	160	5,120.00	0.01
212	002567	唐人神	600	5,106.00	0.01
213	603916	苏博特	200	5,098.00	0.01
214	603043	广州酒家	200	5,044.00	0.01
215	002624	完美世界	350	5,029.50	0.01
216	002511	中顺洁柔	400	5,008.00	0.01
217	600258	首旅酒店	200	4,960.00	0.01
217	600720	祁连山	400	4,960.00	0.01
218	002531	天顺风能	300	4,947.00	0.01
219	603681	永冠新材	200	4,916.00	0.01
220	002250	联化科技	300	4,911.00	0.01
221	000825	太钢不锈	900	4,905.00	0.01
222	603658	安图生物	100	4,889.00	0.01
223	300775	三角防务	100	4,815.00	0.01
224	603313	梦百合	400	4,800.00	0.01
225	600582	天地科技	1,000	4,780.00	0.01
226	601187	厦门银行	800	4,768.00	0.01
227	600998	九州通	400	4,764.00	0.01
228	600699	均胜电子	300	4,713.00	0.01
229	300382	斯莱克	300	4,701.00	0.01
230	002556	辉隆股份	400	4,680.00	0.01
230	600882	妙可蓝多	100	4,680.00	0.01
231	300138	晨光生物	300	4,671.00	0.01
232	002484	江海股份	200	4,668.00	0.01
233	600968	海油发展	1,800	4,644.00	0.01
234	603357	设计总院	400	4,592.00	0.01
235	300398	飞凯材料	200	4,572.00	0.01
236	600516	方大炭素	600	4,560.00	0.01
237	000878	云南铜业	400	4,556.00	0.01
238	600787	中储股份	800	4,552.00	0.01
239	002396	星网锐捷	200	4,528.00	0.01
240	601058	赛轮轮胎	400	4,508.00	0.01
241	002010	传化智联	700	4,501.00	0.01

242	600363	联创光电	200	4,492.00	0.01
243	002595	豪迈科技	200	4,468.00	0.01
244	000567	海德股份	300	4,440.00	0.01
245	300596	利安隆	100	4,411.00	0.01
246	300755	华致酒行	100	4,385.00	0.01
247	600273	嘉化能源	400	4,344.00	0.01
247	600498	烽火通信	300	4,344.00	0.01
248	600125	铁龙物流	800	4,272.00	0.01
248	603708	家家悦	300	4,272.00	0.01
249	300054	鼎龙股份	200	4,234.00	0.01
250	002643	万润股份	200	4,172.00	0.01
251	300463	迈克生物	200	4,098.00	0.01
252	600216	浙江医药	300	4,095.00	0.01
253	603505	金石资源	100	4,091.00	0.01
254	000656	金科股份	1,400	4,004.00	0.01
255	688002	睿创微纳	100	3,972.00	0.01
256	002332	仙琚制药	400	3,928.00	0.01
257	601333	广深铁路	1,800	3,924.00	0.01
258	002745	木林森	400	3,908.00	0.01
259	000400	许继电气	200	3,840.00	0.01
260	002402	和而泰	200	3,812.00	0.01
261	000672	上峰水泥	240	3,787.20	0.01
262	300151	昌红科技	200	3,780.00	0.01
263	002444	巨星科技	200	3,768.00	0.01
264	600285	羚锐制药	300	3,759.00	0.01
265	000937	冀中能源	500	3,730.00	0.01
266	300748	金力永磁	100	3,680.00	0.01
267	000910	大亚圣象	400	3,668.00	0.01
268	002558	巨人网络	400	3,660.00	0.01
269	002701	奥瑞金	700	3,640.00	0.01
270	600459	贵研铂业	200	3,622.00	0.01
271	000513	丽珠集团	100	3,621.00	0.01
272	300470	中密控股	100	3,529.00	0.01
273	002399	海普瑞	200	3,516.00	0.01
274	002375	亚厦股份	700	3,507.00	0.01
275	300171	东富龙	100	3,391.00	0.01
276	601016	节能风电	700	3,360.00	0.01
277	600577	精达股份	600	3,330.00	0.01
278	002706	良信股份	200	3,306.00	0.01



279	002318	久立特材	200	3,198.00	0.01
280	300369	绿盟科技	300	3,156.00	0.01
281	002276	万马股份	400	3,128.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,299,470.00	3.08
2	600519	贵州茅台	1,295,074.00	3.07
3	000858	五粮液	1,155,149.00	2.74
4	600036	招商银行	956,707.00	2.27
5	000333	美的集团	845,350.00	2.01
6	601012	隆基绿能	734,289.00	1.74
7	002049	紫光国微	658,505.00	1.56
8	002594	比亚迪	655,847.00	1.56
9	601888	中国中免	620,769.00	1.47
10	002812	恩捷股份	620,116.00	1.47
11	601318	中国平安	593,475.00	1.41
12	300014	亿纬锂能	518,772.00	1.23
13	300274	阳光电源	518,375.00	1.23
14	300059	东方财富	511,382.00	1.21
15	603501	韦尔股份	509,316.00	1.21
16	600900	长江电力	493,888.00	1.17
17	603259	药明康德	485,463.00	1.15
18	600132	重庆啤酒	451,019.00	1.07
19	002142	宁波银行	434,917.00	1.03
20	600887	伊利股份	434,570.00	1.03

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,569,823.00	3.72

2	600519	贵州茅台	1,055,263.00	2.50
3	000858	五粮液	1,037,192.00	2.46
4	601888	中国中免	990,317.00	2.35
5	002812	恩捷股份	966,748.00	2.29
6	600036	招商银行	781,974.00	1.86
7	601012	隆基绿能	777,676.60	1.85
8	002594	比亚迪	725,489.00	1.72
9	600809	山西汾酒	692,564.00	1.64
10	603501	韦尔股份	672,421.00	1.60
11	603259	药明康德	665,443.00	1.58
12	000333	美的集团	655,348.00	1.55
13	601318	中国平安	523,463.00	1.24
14	002371	北方华创	511,955.00	1.21
15	000568	泸州老窖	509,710.00	1.21
16	002049	紫光国微	496,047.00	1.18
17	600309	万华化学	478,131.00	1.13
18	300059	东方财富	451,530.00	1.07
19	000596	古井贡酒	446,953.00	1.06
20	002142	宁波银行	435,496.00	1.03

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	72,563,932.97
卖出股票收入（成交）总额	71,787,045.20

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

报告期本基金未投资股指期货。

## 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司于 2022 年 3 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 360 万元的行政处罚。比亚迪股份有限公司于 2022 年 5 月 6 日受到深圳消防给予罚款 500 元的行政处罚。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	10,062.63
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	172,399.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	182,462.45

**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

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
9,726	3,737.05	773,876.77	2.13%	35,572,699.92	97.87%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	75.47	0.0002%

### 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的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 9 月 1 日）基金份额总额	196,802,728.21
本报告期期初基金份额总额	35,787,076.17
本报告期基金总申购份额	14,144,482.38
减:本报告期基金总赎回份额	13,584,981.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	36,346,576.69

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人董事会于 2021 年 12 月 13 日审议通过了《关于批准国金基金管理有限公司原任董事、总经理尹庆军先生辞职的议案》、《关于董事长纪路先生提名邵海波先生担任国金基金管理有限公司总经理的议案》等议案，邵海波先生自 2022 年 1 月 28 日起担任公司总经理职务。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期，本基金投资策略未发生改变。

### 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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 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	
中信证券	1	45,646,169.55	31.66%	42,512.09	37.11%	-
天风证券	1	21,962,750.71	15.23%	16,061.69	14.02%	-
国金证券	2	21,172,955.10	14.68%	15,483.97	13.52%	-
恒泰证券	1	20,234,315.75	14.03%	14,797.60	12.92%	-
国盛证券	1	16,354,713.06	11.34%	11,960.34	10.44%	-
招商证券	1	10,637,610.11	7.38%	7,779.61	6.79%	-

华创证券	1	8,164,583.42	5.66%	5,970.77	5.21%	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

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

### 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	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的



		例		成交总额的 比例		比例
中信证券	46,830.00	100.00%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证 券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2021 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金管理人网站	2022 年 1 月 21 日
2	《国金基金管理有限公司关于开展直销柜台申购费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金管理人网站	2022 年 1 月 29 日
3	《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管理人网站	2022 年 1 月 29 日
4	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日

5	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日
6	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日
7	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2021 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 30 日
8	《国金沪深 300 指数增强证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 22 日
9	《关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 23 日
10	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 30 日
11	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 5 月 28 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、国金沪深 300 指数增强证券投资基金基金合同；
- 3、国金沪深 300 指数增强证券投资基金托管协议；
- 4、国金沪深 300 指数增强证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 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

2022 年 8 月 30 日