

国金中证全指指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	62

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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金中证全指指数增强型证券投资基金	
基金简称	国金中证全指指数增强	
基金主代码	025041	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 16 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1,486,546,618.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	国金中证全指指数增强 A	国金中证全指指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	025041	025042
报告期末下属分级 基金的份额总额	977,894,857.50 份	508,651,760.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在力求对中证全指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，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货交易策略、股指期货交易策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。 本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。股票投资策略部分，本基金为指数增强型基金，以中证全指指数为标的指数，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、备选成分股及其他股票基本面的研究基础上，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，力争实现超额收益。 本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	虞志海	罗琦
	联系电话	010-88005852	020-66338888
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95575
传真		010-88005666	020-87553363-6847
注册地址		北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	广东省广州市黄埔区中新广州 知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址		北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	广州市天河区马场路 26 号广发 证券大厦 34 楼
邮政编码		100026	510627
法定代表人		邵海波	林传辉

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	国金中证全指指数增强 A	国金中证全指指数增强 C
本期已实现收益	155,743,540.26	104,578,720.92
本期利润	154,939,770.18	99,630,417.67
加权平均基金份 额本期利润	0.2249	0.2134
本期加权平均净 值利润率	19.82%	18.91%
本期基金份额净 值增长率	21.82%	21.58%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	215,485,738.94	110,137,047.76
期末可供分配基金份额利润	0.2204	0.2165
期末基金资产净值	1,193,380,596.44	618,788,808.63
期末基金份额净值	1.2204	1.2165
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	22.04%	21.65%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金中证全指指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	16.10%	1.54%	11.53%	1.30%	4.57%	0.24%
过去六个月	21.82%	1.46%	10.19%	1.26%	11.63%	0.20%
自基金合同生效起至今	22.04%	1.26%	13.02%	1.15%	9.02%	0.11%

国金中证全指指数增强 C

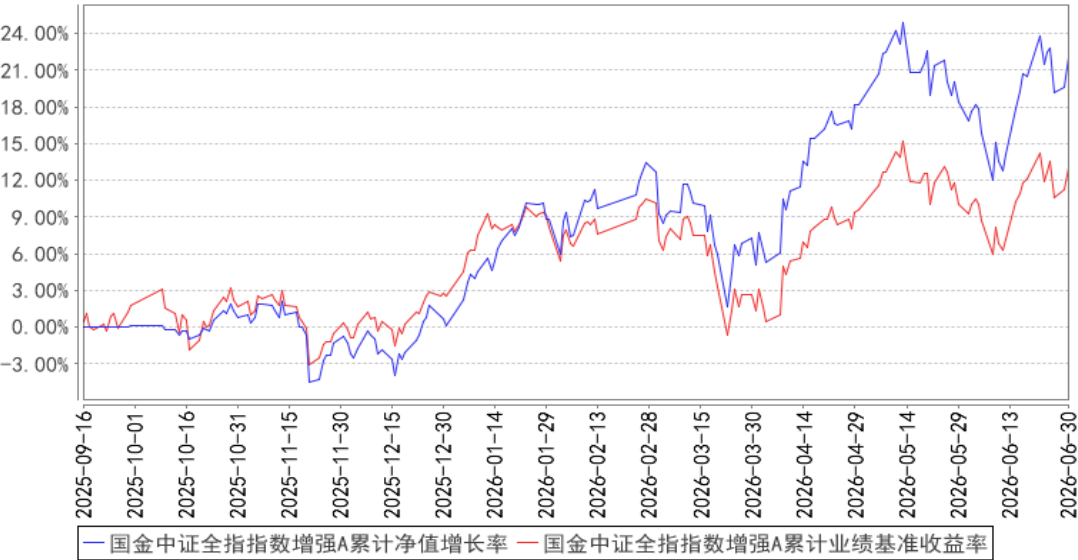
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.97%	1.54%	11.53%	1.30%	4.44%	0.24%

过去六个月	21.58%	1.46%	10.19%	1.26%	11.39%	0.20%
自基金合同生效 起至今	21.65%	1.26%	13.02%	1.15%	8.63%	0.11%

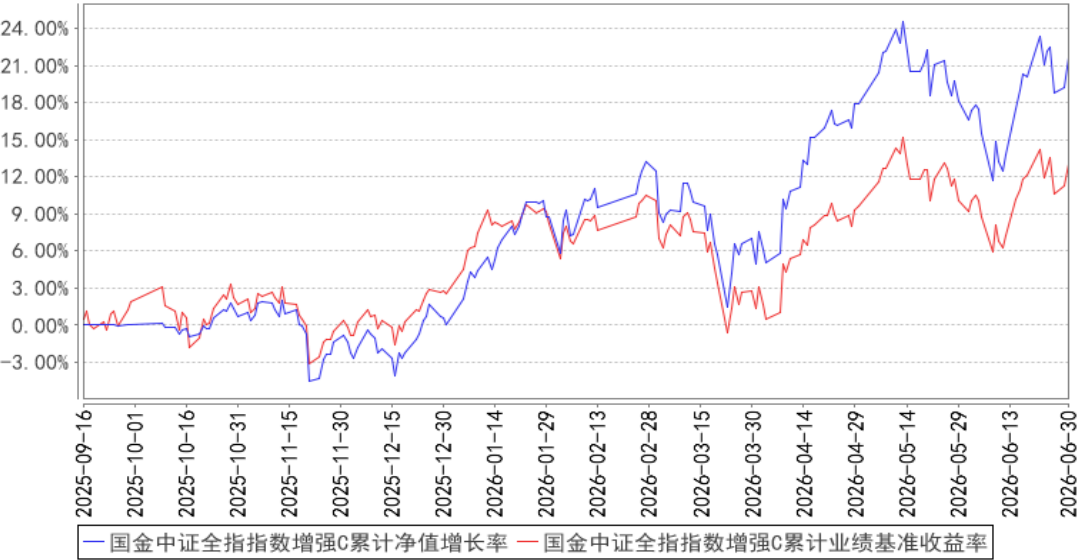
注：本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率*95%+同期银行活期存款利率(税后)*5%。

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

国金中证全指指数增强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



国金中证全指指数增强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 2025 年 9 月 16 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 2025 年 9 月 16 日至 2026 年 3 月 15 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661 号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2026 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 34 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金、国金中证 A500 指数增强型证券投资基金、国金安瑞平衡混合型证券投资基金、国金红利量化选股混合型证券投资基金、国金中证全指指数增强型证券投资基金、国金安和债券型证券投资基金、国金智远量化选股混合型证券投资基金、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金、国金安裕债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2025 年 9 月 16 日	-	10 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资中心副总经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场环境方面，上半年市场活跃度处于近五年较高水平。市场风格方面，贝塔值、动量和短期反转等市场风格因子在报告期内的波动高于其长期均值水平，但整体持续性较强，特别是动量因子表现出相较历史类似时段更为极致的特征；报告期末，市值类因子的波动有所增大。行业涨跌方面，超半数中信一级行业在报告期内录得负收益，其中涨幅大于 40% 的行业为电子、通信和建材，跌幅较大的行业为消费者服务、综合金融、综合等。上半年市场持续受到宏观事件和 AI 叙事等多重因素影响，市场波动较大，各大类资产的波动均不同程度抬升。

相较沪深 300、中证 500 等常见宽基指数，本基金所对标的基准指数有更为广泛的选股空间，在风险约束类似的条件下一定程度上有助于提升选股表现。报告期内，本基金各类超额收益来源互补性较强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 1.2204 元，累计单位净值为 1.2204 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 21.82%，同期业绩比较基准增长率为 10.19%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.2165 元，累计单位净值为 1.2165 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 21.58%，同期业绩比较基准增长率为 10.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在预期货币政策适度宽松、增量资金入场的背景下，市场流动性或保持充裕。上半年行情相对极致，市场经历较大幅度波动后，风格再平衡的可能性提升，行情有望逐步扩散，市场机会或趋于均衡，一定程度上利于量化基金超额收益的改善。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管人代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管人进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值

工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国金中证全指指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，国金基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对国金基金管理有限公司编制和披露的国金中证全指指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：国金中证全指指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	223,956,406.96	122,804,661.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,670,277,855.85	1,241,674,693.05
其中：股票投资		1,670,277,855.85	1,241,674,693.05
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		18,189,674.49	1,461,336.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,912,423,937.30	1,365,940,690.76
负 债 和 净 资 产			
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		98,630,425.65	51,728,474.68

应付管理人报酬		1,127,312.48	997,317.63
应付托管费		140,914.07	124,664.69
应付销售服务费		213,004.61	239,370.53
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	142,875.42	70,000.00
负债合计		100,254,532.23	53,159,827.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,486,546,618.37	1,311,151,153.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	325,622,786.70	1,629,709.42
净资产合计		1,812,169,405.07	1,312,780,863.23
负债和净资产总计		1,912,423,937.30	1,365,940,690.76

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，国金中证全指指数增强 A 基金份额净值 1.2204 元，基金份额总额 977,894,857.50 份；国金中证全指指数增强 C 基金份额净值 1.2165 元，基金份额总额 508,651,760.87 份。国金中证全指指数增强份额总额合计为 1,486,546,618.37 份。

6.2 利润表

会计主体：国金中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		261,523,650.83
1. 利息收入		390,512.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	371,560.39
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		18,952.26
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		266,653,599.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	261,679,592.54
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	4,974,007.20

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	-5, 752, 073. 33
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	231, 611. 77
减：二、营业总支出		6, 953, 462. 98
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	5, 171, 295. 62
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	646, 411. 94
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	1, 044, 015. 57
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	91, 739. 85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		254, 570, 187. 85
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		254, 570, 187. 85
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		254, 570, 187. 85

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 16 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国金中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 311, 151, 153. 81	-	1, 629, 709. 42	1, 312, 780, 863. 23
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,311,151,153.81	-	1,629,709.42	1,312,780,863.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	175,395,464.56	-	323,993,077.28	499,388,541.84
(一)、综合收益总额	-	-	254,570,187.85	254,570,187.85
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	175,395,464.56	-	69,422,889.43	244,818,353.99
其中：1. 基金申购款	1,544,330,354.96	-	232,733,173.88	1,777,063,528.84
2. 基金赎回款	-1,368,934,890.40	-	-163,310,284.45	-1,532,245,174.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,486,546,618.37	-	325,622,786.70	1,812,169,405.07

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 16 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

国金中证全指指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]1490 号文《关于准予国金中证全指指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2025 年 9 月 16 日正式生效，本基金首次设立募集规模为 1,533,950,109.24 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，基金托管人为广发证券股份有限公司。

本基金的投资范围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（包含主板、科创板、创业板及其他依法发行上市的股票和存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、以及其他银行存款等）、货币市场工具、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）。本基金可以根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者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。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）

编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文

《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所

得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	171,082,818.36
等于：本金	171,041,925.81
加：应计利息	40,892.55
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	52,873,588.60
等于：本金	52,872,562.86
加：应计利息	1,025.74

减：坏账准备	-
合计	223,956,406.96

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,687,280,853.45	-	1,670,277,855.85	-17,002,997.60
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		1,687,280,853.45	-	1,670,277,855.85	-17,002,997.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.8 其他资产

无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,020.42
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	91,739.85
其他	46,115.15
合计	142,875.42

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金中证全指指数增强 A

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	712,943,521.01	712,943,521.01
本期申购	915,481,117.52	915,481,117.52
本期赎回（以“-”号填列）	-650,529,781.03	-650,529,781.03
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	977,894,857.50	977,894,857.50

国金中证全指指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	598,207,632.80	598,207,632.80
本期申购	628,849,237.44	628,849,237.44
本期赎回（以“-”号填列）	-718,405,109.37	-718,405,109.37
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	508,651,760.87	508,651,760.87

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

6.4.7.11 其他综合收益

无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金中证全指指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,535,558.75	-5,270,830.22	1,264,728.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,535,558.75	-5,270,830.22	1,264,728.53
本期利润	155,743,540.26	-803,770.08	154,939,770.18
本期基金份额交易产生的变动数	68,973,607.34	-9,692,367.11	59,281,240.23
其中：基金申购款	133,903,489.99	390,607.15	134,294,097.14
基金赎回款	-64,929,882.65	-10,082,974.26	-75,012,856.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	231,252,706.35	-15,766,967.41	215,485,738.94

国金中证全指指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,784,829.52	-4,419,848.63	364,980.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,784,829.52	-4,419,848.63	364,980.89
本期利润	104,578,720.92	-4,948,303.25	99,630,417.67
本期基金份额交易产生的变动数	8,948,027.74	1,193,621.46	10,141,649.20
其中：基金申购款	93,881,838.07	4,557,238.67	98,439,076.74
基金赎回款	-84,933,810.33	-3,363,617.21	-88,297,427.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	118,311,578.18	-8,174,530.42	110,137,047.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	349,387.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15,433.04
结算备付金利息收入	-
其他	6,739.93
合计	371,560.39

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	261,679,592.54
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	261,679,592.54

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,766,296,302.15
减：卖出股票成本总额	4,499,808,379.68

减：交易费用	4,808,329.93
买卖股票差价收入	261,679,592.54

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,974,007.20
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	4,974,007.20

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,752,073.33
股票投资	-5,752,073.33
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	-5,752,073.33

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	231,330.66
基金转换费收入	281.11
合计	231,611.77

6.4.7.22 信用减值损失

无

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	91,739.85

6.4.7.24 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构、基金结算机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
广发证券股份有限公司	7,307,752,999.72	75.34

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
广发证券股份有限公司	22, 513, 000. 00	50. 00

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
广发证券股份有限公司	1, 358, 535. 88	75. 34	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5, 171, 295. 62
其中：应支付销售机构的客户维护费	2, 263, 659. 72
应支付基金管理人的净管理费	2, 907, 635. 90

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	646, 411. 94

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0. 10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金中证全指指数增强 A	国金中证全指指数增强 C	合计
国金基金管理有限公司	-	382. 38	382. 38
国金证券股份有限公司	-	11, 561. 30	11, 561. 30
广发证券股份有限公司	-	636, 844. 39	636, 844. 39
合计	-	648, 788. 07	648, 788. 07

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0. 40%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无

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

无

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司-其他存款	42,898,244.31	9,973.22
广发证券股份有限公司-活期存款	171,082,818.36	349,387.42

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

2. 除其他存款外，本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	锁定期股票流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603722	阿科力	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	39.60	2026 年 7 月 6 日	43.56	16,800	626,114.28	665,280.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理办公会负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理办公会下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产

比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6. 4. 13. 4 市场风险

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

6. 4. 13. 4. 1 利率风险

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

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

6. 4. 13. 4. 1. 1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	223,956,406.96	-	-	-	-	-	223,956,406.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,670,277,855.85	1,670,277,855.85
应收申购款	-	-	-	-	-	18,189,674.49	18,189,674.49
资产总计	223,956,406.96	-	-	-	-	1,688,467,530.34	1,912,423,937.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	98,630,425.65	98,630,425.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,127,312.48	1,127,312.48
应付托管费	-	-	-	-	-	140,914.07	140,914.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	213,004.61	213,004.61
其他负债	-	-	-	-	-	142,875.42	142,875.42

负债总计	-	-	-	-	-	100,254,532.23	100,254,532.23
利率敏感度缺口	223,956,406.96	-	-	-	-	-1,588,212,998.11	1,812,169,405.07
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	122,804,661.06	-	-	-	-	-	122,804,661.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,241,674,693.05	1,241,674,693.05
应收申购款	-	-	-	-	-	1,461,336.65	1,461,336.65
资产总计	122,804,661.06	-	-	-	-	-1,243,136,029.70	1,365,940,690.76
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	51,728,474.68	51,728,474.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	997,317.63	997,317.63
应付托管费	-	-	-	-	-	124,664.69	124,664.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	239,370.53	239,370.53
其他负债	-	-	-	-	-	70,000.00	70,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	53,159,827.53	53,159,827.53
利率敏感度缺口	122,804,661.06	-	-	-	-	-1,189,976,202.17	1,312,780,863.23

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,670,277,855.85	92.17	1,241,674,693.05	94.58
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	1,670,277,855.85	92.17	1,241,674,693.05	94.58

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证全指指数（000985.CSI）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全指指数数据回归得出，反映了基金和中证全指指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	+5%	94,910,568.86	43,013,923.10
	-5%	-94,910,568.86	-43,013,923.10

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,669,320,142.52	1,241,674,693.05
第二层次	665,280.00	—
第三层次	292,433.33	—
合计	1,670,277,855.85	1,241,674,693.05

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	1,670,277,855.85	87.34
	其中：股票	1,670,277,855.85	87.34
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	223,956,406.96	11.71
8	其他各项资产	18,189,674.49	0.95
9	合计	1,912,423,937.30	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	2,810,191.00	0.16
B	采矿业	79,257,230.00	4.37
C	制造业	1,169,655,087.88	64.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,703,118.00	2.96
E	建筑业	4,708,809.20	0.26
F	批发和零售业	30,947,130.20	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	45,852,820.32	2.53
H	住宿和餐饮业	1,124,454.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,284,922.09	5.04
J	金融业	117,816,678.98	6.50
K	房地产业	1,808,024.00	0.10

L	租赁和商务服务业	9,220,386.80	0.51
M	科学研究和技术服务业	52,335,552.57	2.89
N	水利、环境和公共设施管理业	4,464,052.08	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,087,104.00	0.06
Q	卫生和社会工作	496,976.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	3,041,394.00	0.17
S	综合	—	—
	合计	1,669,613,931.12	92.13

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	663,924.73	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	663,924.73	0.04

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	300014	亿纬锂能	779,700	50,703,891.00	2.80
2	000725	京东方 A	4,883,000	42,384,440.00	2.34
3	603259	药明康德	336,300	41,872,713.00	2.31
4	301396	宏景科技	111,480	36,966,768.00	2.04
5	002008	大族激光	213,400	32,033,474.00	1.77
6	605117	德业股份	285,540	30,318,637.20	1.67
7	000630	铜陵有色	4,739,200	30,141,312.00	1.66
8	600584	长电科技	285,500	29,563,525.00	1.63
9	002600	领益智造	1,700,003	29,478,052.02	1.63
10	002466	天齐锂业	470,016	28,821,381.12	1.59
11	300769	德方纳米	413,940	27,527,010.00	1.52
12	301536	星辰科技	211,900	27,273,649.00	1.51
13	300803	指南针	286,400	26,254,288.00	1.45
14	300438	鹏辉能源	309,400	25,633,790.00	1.41
15	600418	江淮汽车	984,800	25,437,384.00	1.40
16	600011	华能国际	3,348,400	25,414,356.00	1.40
17	001389	广合科技	101,300	24,033,425.00	1.33
18	600549	厦门钨业	242,700	20,678,040.00	1.14
19	601688	华泰证券	997,900	20,576,698.00	1.14
20	688469	芯联集成	1,886,882	20,019,818.02	1.10
21	600547	山东黄金	857,300	19,795,057.00	1.09
22	688390	固德威	177,962	19,310,656.62	1.07
23	300604	长川科技	46,600	15,910,172.00	0.88
24	603993	洛阳钼业	905,300	15,888,015.00	0.88
25	600115	中国东航	3,906,800	14,884,908.00	0.82
26	301086	鸿富瀚	69,080	14,457,062.40	0.80
27	601288	农业银行	2,357,900	14,312,453.00	0.79
28	601328	交通银行	2,029,400	13,049,042.00	0.72
29	688052	纳芯微	43,463	12,530,817.53	0.69
30	600026	中远海能	665,800	11,944,452.00	0.66

31	301377	鼎泰高科	21,500	11,844,350.00	0.65
32	300782	卓胜微	108,000	11,834,640.00	0.65
33	301205	联特科技	32,600	10,891,660.00	0.60
34	002281	光迅科技	41,851	10,753,195.94	0.59
35	300870	欧陆通	30,940	10,695,648.60	0.59
36	002851	麦格米特	63,698	10,649,031.64	0.59
37	601699	潞安环能	725,000	10,353,000.00	0.57
38	300548	长芯博创	37,000	10,286,000.00	0.57
39	300059	东方财富	503,700	10,265,406.00	0.57
40	688536	思瑞浦	26,990	9,826,789.10	0.54
41	300395	菲利华	71,300	9,534,949.00	0.53
42	002294	信立泰	296,800	9,464,952.00	0.52
43	000539	粤电力 A	1,345,200	9,160,812.00	0.51
44	600150	中国船舶	270,149	9,128,334.71	0.50
45	002384	东山精密	34,300	8,998,605.00	0.50
46	002812	恩捷股份	133,209	8,913,014.19	0.49
47	688195	腾景科技	43,219	8,323,115.02	0.46
48	301511	德福科技	57,500	8,271,375.00	0.46
49	002493	荣盛石化	762,700	8,199,025.00	0.45
50	688268	华特气体	29,901	7,998,517.50	0.44
51	002436	兴森科技	153,000	7,795,350.00	0.43
52	300308	中际旭创	5,700	7,239,000.00	0.40
53	601009	南京银行	728,100	7,200,909.00	0.40
54	301018	申菱环境	62,200	7,190,942.00	0.40
55	688003	天准科技	56,215	7,156,169.50	0.39
56	600392	盛和资源	240,300	7,153,731.00	0.39
57	002185	华天科技	313,600	6,996,416.00	0.39
58	300475	香农芯创	22,264	6,679,200.00	0.37
59	688017	绿的谐波	15,940	6,660,688.40	0.37
60	601666	平煤股份	925,900	6,620,185.00	0.37
61	601111	中国国航	1,088,400	6,584,820.00	0.36
62	002913	奥士康	94,392	6,035,424.48	0.33
63	688388	嘉元科技	132,271	5,819,924.00	0.32
64	600497	驰宏锌锗	478,300	5,792,213.00	0.32
65	301358	湖南裕能	74,700	5,667,489.00	0.31
66	002460	赣锋锂业	86,420	5,651,868.00	0.31
67	600362	江西铜业	129,800	5,620,340.00	0.31
68	300790	宇瞳光学	214,100	5,590,151.00	0.31
69	002738	中矿资源	94,000	5,545,060.00	0.31
70	600961	株冶集团	165,700	5,367,023.00	0.30
71	301285	鸿日达	48,600	5,362,038.00	0.30
72	300765	石药创新	195,800	5,331,634.00	0.29
73	600893	航发动力	137,100	5,256,414.00	0.29

74	600029	南方航空	990,200	5,129,236.00	0.28
75	002558	巨人网络	179,800	4,955,288.00	0.27
76	301603	乔锋智能	34,000	4,889,200.00	0.27
77	688531	日联科技	27,283	4,852,008.72	0.27
78	002245	蔚蓝锂芯	252,680	4,727,642.80	0.26
79	300054	鼎龙股份	44,156	4,679,211.32	0.26
80	000983	山西焦煤	802,400	4,653,920.00	0.26
81	603124	江南新材	24,500	4,581,010.00	0.25
82	001339	智微智能	44,590	4,560,665.20	0.25
83	000783	长江证券	464,200	4,525,950.00	0.25
84	600188	兖矿能源	253,100	4,497,587.00	0.25
85	688628	优利德	44,708	4,423,409.52	0.24
86	002203	海亮股份	190,600	4,355,210.00	0.24
87	600378	昊华科技	57,400	4,326,812.00	0.24
88	601233	桐昆股份	197,700	4,280,205.00	0.24
89	688506	百利天恒	12,909	3,795,633.27	0.21
90	600985	淮北矿业	270,100	3,794,905.00	0.21
91	001287	中电港	121,600	3,787,840.00	0.21
92	600578	京能电力	567,300	3,659,085.00	0.20
93	688633	星球石墨	121,935	3,625,127.55	0.20
94	300724	捷佳伟创	50,800	3,586,480.00	0.20
95	600160	巨化股份	67,200	3,562,272.00	0.20
96	688127	蓝特光学	36,437	3,556,251.20	0.20
97	688025	杰普特	7,393	3,474,710.00	0.19
98	000878	云南铜业	211,200	3,353,856.00	0.19
99	600919	江苏银行	310,941	3,351,943.98	0.18
100	300861	美畅股份	128,500	3,236,915.00	0.18
101	301099	雅创电子	33,600	3,208,800.00	0.18
102	300986	志特新材	184,400	3,162,460.00	0.17
103	603115	海星股份	25,700	3,147,479.00	0.17
104	603806	福斯特	187,200	3,143,088.00	0.17
105	300033	同花顺	12,800	3,084,800.00	0.17
106	000629	钒钛股份	914,200	3,053,428.00	0.17
107	300576	容大感光	58,800	3,011,736.00	0.17
108	002153	石基信息	409,500	2,960,685.00	0.16
109	600903	贵州燃气	439,200	2,916,288.00	0.16
110	301196	唯科科技	22,800	2,859,576.00	0.16
111	003022	联泓新科	109,500	2,836,050.00	0.16
112	000301	东方盛虹	245,600	2,812,120.00	0.16
113	600458	时代新材	169,500	2,805,225.00	0.15
114	688409	富创精密	9,080	2,780,750.00	0.15
115	601567	三星电气	180,600	2,698,164.00	0.15
116	000733	振华科技	47,200	2,673,408.00	0.15

117	300602	飞荣达	52,200	2,672,640.00	0.15
118	300613	富瀚微	32,800	2,626,624.00	0.14
119	603890	春秋电子	94,500	2,610,090.00	0.14
120	300775	三角防务	118,100	2,602,924.00	0.14
121	688667	菱电电控	19,450	2,599,492.50	0.14
122	002745	木林森	206,100	2,586,555.00	0.14
123	301321	翰博高新	58,300	2,573,945.00	0.14
124	688677	海泰新光	24,990	2,527,238.70	0.14
125	601918	新集能源	288,500	2,478,215.00	0.14
126	600113	浙江东日	74,500	2,471,910.00	0.14
127	603950	长源东谷	29,200	2,465,356.00	0.14
128	300681	英搏尔	85,900	2,458,458.00	0.14
129	603125	常青科技	73,600	2,409,664.00	0.13
130	600816	建元信托	962,300	2,348,012.00	0.13
131	002544	普天科技	127,900	2,330,338.00	0.13
132	600688	上海石化	772,300	2,262,839.00	0.12
133	603225	新凤鸣	114,500	2,249,925.00	0.12
134	002138	顺络电子	29,900	2,185,690.00	0.12
135	600909	华安证券	194,800	2,164,228.00	0.12
136	601126	四方股份	34,200	2,161,440.00	0.12
137	301345	涛涛车业	9,300	2,148,300.00	0.12
138	605168	三人行	42,300	2,142,072.00	0.12
139	600123	兰花科创	397,500	2,122,650.00	0.12
140	301246	宏源药业	76,500	2,057,850.00	0.11
141	002643	万润股份	97,900	2,051,005.00	0.11
142	301631	壹连科技	27,940	2,007,768.40	0.11
143	000975	山金国际	112,500	1,912,500.00	0.11
144	688182	灿勤科技	44,342	1,909,809.94	0.11
145	601336	新华保险	31,900	1,903,154.00	0.11
146	603989	艾华集团	35,700	1,874,250.00	0.10
147	301280	珠城科技	37,000	1,871,090.00	0.10
148	601319	中国人保	274,900	1,858,324.00	0.10
149	603032	德新科技	69,000	1,856,100.00	0.10
150	001314	亿道信息	29,900	1,847,820.00	0.10
151	002079	苏州固锝	122,100	1,835,163.00	0.10
152	002957	科瑞技术	33,300	1,826,172.00	0.10
153	603318	水发燃气	182,000	1,736,280.00	0.10
154	603178	圣龙股份	122,100	1,691,085.00	0.09
155	603171	税友股份	41,800	1,665,730.00	0.09
156	688027	国盾量子	3,302	1,664,241.02	0.09
157	000572	海马汽车	449,500	1,663,150.00	0.09
158	605580	恒盛能源	60,000	1,656,600.00	0.09
159	301051	信濠光电	82,340	1,597,396.00	0.09

160	000810	创维数字	114,900	1,522,425.00	0.08
161	002865	钧达股份	25,300	1,509,904.00	0.08
162	301369	联动科技	6,145	1,505,525.00	0.08
163	300682	朗新科技	151,500	1,499,850.00	0.08
164	603327	福蓉科技	176,000	1,492,480.00	0.08
165	601869	长飞光纤	2,700	1,473,930.00	0.08
166	300843	胜蓝股份	9,400	1,468,750.00	0.08
167	688309	恒誉环保	23,711	1,443,525.68	0.08
168	301041	金百泽	41,600	1,404,000.00	0.08
169	002821	凯莱英	8,600	1,393,200.00	0.08
170	002972	科安达	71,200	1,392,672.00	0.08
171	603200	上海洗霸	31,600	1,370,176.00	0.08
172	002064	华峰化学	143,600	1,362,764.00	0.08
173	001313	粤海饲料	190,800	1,352,772.00	0.07
174	600489	中金黄金	74,900	1,351,945.00	0.07
175	688378	奥来德	21,644	1,341,928.00	0.07
176	688101	三达膜	81,098	1,340,549.94	0.07
177	603095	越剑智能	93,400	1,337,488.00	0.07
178	605189	富春染织	110,700	1,333,935.00	0.07
179	301551	无线传媒	67,400	1,329,802.00	0.07
180	300596	利安隆	25,300	1,327,744.00	0.07
181	002320	海峡股份	210,900	1,322,343.00	0.07
182	002845	同兴达	80,600	1,321,840.00	0.07
183	300848	美瑞新材	94,500	1,318,275.00	0.07
184	603937	丽岛新材	93,800	1,315,076.00	0.07
185	300755	华致酒行	113,300	1,290,487.00	0.07
186	600955	维远股份	87,600	1,289,472.00	0.07
187	300504	天邑股份	76,800	1,238,784.00	0.07
188	603317	天味食品	94,600	1,230,746.00	0.07
189	603135	中重科技	97,100	1,174,910.00	0.06
190	300183	东软载波	112,200	1,172,490.00	0.06
191	300154	瑞凌股份	155,600	1,170,112.00	0.06
192	605588	冠石科技	17,400	1,168,758.00	0.06
193	601001	晋控煤业	67,100	1,166,869.00	0.06
194	301587	中瑞股份	53,100	1,165,545.00	0.06
195	002948	青岛银行	229,200	1,164,336.00	0.06
196	600095	湘财股份	154,600	1,164,138.00	0.06
197	000552	甘肃能化	519,700	1,164,128.00	0.06
198	300331	苏大维格	16,300	1,159,093.00	0.06
199	603216	梦天家居	55,200	1,135,464.00	0.06
200	600929	雪天盐业	242,600	1,101,404.00	0.06
201	600971	恒源煤电	159,200	1,098,480.00	0.06
202	002982	湘佳股份	100,800	1,063,440.00	0.06

203	688239	航宇科技	17,609	1,053,546.47	0.06
204	688257	新锐股份	10,335	1,053,136.50	0.06
205	002830	名雕股份	60,860	1,052,269.40	0.06
206	300195	长荣股份	175,200	1,028,424.00	0.06
207	603270	金帝股份	30,100	1,008,651.00	0.06
208	002577	雷柏科技	54,700	1,004,292.00	0.06
209	001366	播恩集团	92,600	1,003,784.00	0.06
210	600830	香溢融通	125,500	1,000,235.00	0.06
211	600502	安徽建工	229,900	1,000,065.00	0.06
212	688107	安路科技	21,913	999,232.80	0.06
213	600135	乐凯胶片	124,900	997,951.00	0.06
214	301381	赛维时代	54,100	997,604.00	0.06
215	300851	交大思诺	44,800	996,800.00	0.06
216	002442	龙星科技	202,000	995,860.00	0.05
217	300753	爱朋医疗	52,600	995,718.00	0.05
218	300965	恒宇信通	23,500	995,460.00	0.05
219	688228	开普云	12,865	994,979.10	0.05
220	600318	新力金融	165,200	994,504.00	0.05
221	300928	华安鑫创	34,400	993,472.00	0.05
222	301031	中熔电气	8,248	985,223.60	0.05
223	601003	柳钢股份	286,700	966,179.00	0.05
224	002111	威海广泰	107,100	963,900.00	0.05
225	300876	蒙泰高新	66,880	958,390.40	0.05
226	301418	协昌科技	16,900	944,372.00	0.05
227	002737	葵花药业	83,600	937,156.00	0.05
228	003042	中农联合	74,500	905,175.00	0.05
229	601898	中煤能源	72,900	887,922.00	0.05
230	301090	华润材料	141,500	887,205.00	0.05
231	000576	甘化科工	134,000	880,380.00	0.05
232	300780	德恩精工	25,800	878,748.00	0.05
233	300694	蠡湖股份	90,100	864,960.00	0.05
234	002925	盈趣科技	34,600	853,236.00	0.05
235	300826	测绘股份	60,881	852,334.00	0.05
236	603260	合盛硅业	17,600	849,376.00	0.05
237	301072	中捷精工	20,700	848,907.00	0.05
238	688718	唯赛勃	53,092	847,879.24	0.05
239	600299	安迪苏	106,600	836,810.00	0.05
240	301136	招标股份	76,200	836,676.00	0.05
241	003030	祖名股份	40,700	836,385.00	0.05
242	688211	中科微至	24,270	835,373.40	0.05
243	600981	苏豪汇鸿	371,200	835,200.00	0.05
244	002375	亚厦股份	247,100	835,198.00	0.05
245	300844	山水比德	37,600	835,096.00	0.05

246	603895	天永智能	29,400	834,666.00	0.05
247	002660	茂硕电源	128,300	833,950.00	0.05
248	603519	立霸股份	54,500	833,850.00	0.05
249	601963	重庆银行	82,700	833,616.00	0.05
250	301202	朗威股份	25,000	833,250.00	0.05
251	301535	浙江华远	62,000	832,040.00	0.05
252	300968	格林精密	86,300	831,932.00	0.05
253	000757	浩物股份	243,900	831,699.00	0.05
254	001218	丽臣实业	37,700	831,662.00	0.05
255	002820	桂发祥	99,000	831,600.00	0.05
256	300805	电声股份	114,700	831,575.00	0.05
257	300659	中孚信息	87,500	831,250.00	0.05
258	002184	海得控制	90,700	830,812.00	0.05
259	300381	溢多利	147,800	830,636.00	0.05
260	002909	集泰股份	168,000	829,920.00	0.05
261	603066	音飞储存	85,000	829,600.00	0.05
262	603105	芯能科技	121,800	829,458.00	0.05
263	301159	三维天地	28,500	829,350.00	0.05
264	300941	创识科技	60,400	829,292.00	0.05
265	300112	万讯自控	133,900	828,841.00	0.05
266	301190	善水科技	51,700	828,751.00	0.05
267	300584	海辰药业	22,800	826,044.00	0.05
268	300645	正元智慧	70,100	825,077.00	0.05
269	688068	热景生物	9,496	822,353.60	0.05
270	600969	郴电国际	107,000	816,410.00	0.05
271	002671	龙泉股份	219,800	815,458.00	0.04
272	300610	晨化股份	83,400	813,150.00	0.04
273	301626	苏州天脉	2,100	806,316.00	0.04
274	301068	大地海洋	33,800	804,440.00	0.04
275	000919	金陵药业	137,700	802,791.00	0.04
276	301060	兰卫医学	97,900	799,843.00	0.04
277	603711	香飘飘	71,800	797,698.00	0.04
278	002849	威星智能	47,100	796,932.00	0.04
279	002412	汉森制药	144,500	794,750.00	0.04
280	002234	民和股份	120,300	771,123.00	0.04
281	300492	华图山鼎	22,400	769,440.00	0.04
282	603162	海通发展	85,556	767,437.32	0.04
283	002758	浙农股份	97,100	767,090.00	0.04
284	301067	显盈科技	18,800	711,016.00	0.04
285	600375	汉马科技	188,600	695,934.00	0.04
286	603266	天龙股份	41,000	690,030.00	0.04
287	300434	金石亚药	61,200	687,276.00	0.04
288	688558	国盛智科	20,907	687,004.02	0.04

289	605007	五洲特纸	51,200	685,568.00	0.04
290	001358	兴欣新材	26,500	684,760.00	0.04
291	301212	联盛化学	29,200	681,820.00	0.04
292	300916	朗特智能	29,100	680,067.00	0.04
293	301355	南王科技	69,300	677,754.00	0.04
294	600560	金自天正	61,100	676,988.00	0.04
295	301510	固高科技	21,200	676,916.00	0.04
296	002110	三钢闽光	234,600	675,648.00	0.04
297	300550	和仁科技	50,500	673,165.00	0.04
298	603276	恒兴新材	43,900	672,109.00	0.04
299	300691	联合光电	42,500	671,925.00	0.04
300	002687	乔治白	128,200	671,768.00	0.04
301	002716	湖南白银	83,000	671,470.00	0.04
302	002449	国星光电	86,600	671,150.00	0.04
303	603344	星德胜	27,700	670,894.00	0.04
304	603048	浙江黎明	37,800	670,572.00	0.04
305	688162	巨一科技	28,335	669,839.40	0.04
306	603206	嘉环科技	42,000	669,060.00	0.04
307	300956	英力股份	59,500	668,780.00	0.04
308	300583	赛托生物	59,500	668,185.00	0.04
309	000702	正虹科技	134,700	668,112.00	0.04
310	603856	东宏股份	48,300	667,989.00	0.04
311	300995	奇德新材	24,900	667,569.00	0.04
312	300675	建科院	56,300	667,155.00	0.04
313	000619	海螺新材	151,500	666,600.00	0.04
314	002999	天禾股份	125,300	666,596.00	0.04
315	300535	达威股份	48,900	666,507.00	0.04
316	688631	莱斯信息	14,208	666,497.28	0.04
317	688203	海正生材	66,776	666,424.48	0.04
318	605567	春雪食品	83,400	666,366.00	0.04
319	600099	林海股份	83,500	666,330.00	0.04
320	600148	长春一东	45,900	666,009.00	0.04
321	001278	一彬科技	43,300	665,954.00	0.04
322	603041	美思德	64,200	665,754.00	0.04
323	300822	贝仕达克	56,900	665,730.00	0.04
324	605151	西上海	37,800	665,658.00	0.04
325	301601	惠通科技	42,600	665,412.00	0.04
326	603722	阿科力	16,800	665,280.00	0.04
327	001236	弘业期货	95,700	665,115.00	0.04
328	600697	欧亚集团	68,400	664,848.00	0.04
329	001209	洪兴股份	41,500	664,830.00	0.04
330	601199	江南水务	119,900	664,246.00	0.04
331	603758	秦安股份	74,300	664,242.00	0.04

332	600128	苏豪弘业	87,500	664,125.00	0.04
333	688522	纳睿雷达	33,167	664,003.34	0.04
334	603999	读者传媒	132,800	664,000.00	0.04
335	002103	广博股份	113,100	663,897.00	0.04
336	600854	春兰股份	163,100	663,817.00	0.04
337	600399	抚顺特钢	161,500	663,765.00	0.04
338	603060	国检集团	120,000	663,600.00	0.04
339	002093	国脉科技	105,300	663,390.00	0.04
340	001378	德冠新材	37,030	663,207.30	0.04
341	688196	卓越新能	18,469	663,037.10	0.04
342	300481	濮阳惠成	34,800	661,896.00	0.04
343	301519	舜禹股份	61,000	661,850.00	0.04
344	603995	甬金股份	28,500	661,485.00	0.04
345	002722	物产金轮	56,100	661,419.00	0.04
346	600630	龙头股份	67,900	661,346.00	0.04
347	600493	凤竹纺织	126,200	661,288.00	0.04
348	600711	盛屯矿业	60,200	660,394.00	0.04
349	600573	惠泉啤酒	74,100	659,490.00	0.04
350	601968	宝钢包装	168,200	659,344.00	0.04
351	601061	中信金属	61,000	656,970.00	0.04
352	002566	益盛药业	108,700	656,548.00	0.04
353	688517	金冠电气	37,527	655,971.96	0.04
354	002813	路畅科技	34,700	655,830.00	0.04
355	603700	宁水集团	56,400	654,804.00	0.04
356	001206	依依股份	34,900	654,724.00	0.04
357	600469	风神股份	120,300	654,432.00	0.04
358	603223	恒通股份	50,100	653,805.00	0.04
359	300864	南大环境	33,900	650,202.00	0.04
359	600526	菲达环保	158,200	650,202.00	0.04
360	002224	三力士	198,700	649,749.00	0.04
361	001317	三羊马	16,400	649,112.00	0.04
362	688660	电气风电	75,300	649,086.00	0.04
363	002401	中远海科	55,900	648,999.00	0.04
364	603190	亚通精工	28,600	646,932.00	0.04
365	301339	通行宝	63,200	646,536.00	0.04
366	600037	歌华有线	103,100	646,437.00	0.04
367	301177	迪阿股份	23,400	645,138.00	0.04
368	603600	永艺股份	72,300	641,301.00	0.04
369	688582	芯动联科	9,860	640,900.00	0.04
370	605058	澳弘电子	17,700	640,032.00	0.04
371	002391	长青股份	131,408	639,956.96	0.04
372	301116	益客食品	74,700	639,432.00	0.04
373	001286	陕西能源	62,900	637,806.00	0.04

374	600137	浪莎股份	39,000	632,970.00	0.03
375	002819	东方中科	28,300	632,505.00	0.03
376	603739	蔚蓝生物	54,400	627,232.00	0.03
377	300452	山河药辅	53,100	620,208.00	0.03
378	301061	匠心家居	17,400	610,218.00	0.03
379	600051	宁波联合	107,200	603,536.00	0.03
380	002615	哈尔斯	76,300	526,470.00	0.03
381	301122	采纳股份	17,900	526,439.00	0.03
382	301499	维科精密	17,700	516,486.00	0.03
383	603004	鼎龙科技	21,300	513,117.00	0.03
384	300538	同益股份	30,600	510,714.00	0.03
385	001259	利仁科技	7,600	508,972.00	0.03
386	301448	开创电气	11,200	508,256.00	0.03
387	603161	科华控股	38,100	505,587.00	0.03
388	301055	张小泉	11,900	505,393.00	0.03
389	603836	海程邦达	63,840	504,336.00	0.03
390	301097	天益医疗	14,123	504,191.10	0.03
391	603615	茶花股份	31,200	503,880.00	0.03
392	600463	空港股份	66,000	503,580.00	0.03
392	600615	鑫源智造	54,500	503,580.00	0.03
393	603183	建研院	141,700	503,035.00	0.03
394	688659	元琛科技	48,152	502,706.88	0.03
395	600386	北巴传媒	161,000	502,320.00	0.03
396	600768	宁波富邦	33,500	501,830.00	0.03
397	605369	拱东医疗	28,600	501,644.00	0.03
398	000573	粤宏远 A	141,700	501,618.00	0.03
399	603506	南都物业	53,700	501,558.00	0.03
400	002441	众业达	64,300	501,540.00	0.03
401	000548	湖南投资	122,600	501,434.00	0.03
402	003012	东鹏控股	115,000	501,400.00	0.03
403	688616	西力科技	49,633	501,293.30	0.03
404	300514	友讯达	53,600	501,160.00	0.03
405	603630	拉芳家化	39,200	500,976.00	0.03
406	688577	浙海德曼	10,931	500,967.73	0.03
407	688288	鸿泉技术	28,189	500,918.53	0.03
408	301272	英华特	15,200	500,688.00	0.03
408	600853	龙建股份	164,700	500,688.00	0.03
409	600793	宜宾纸业	41,600	500,448.00	0.03
410	000715	中兴商业	107,800	500,192.00	0.03
411	300855	图南股份	16,000	500,160.00	0.03
412	300796	贝斯美	79,500	500,055.00	0.03
413	300856	科思股份	46,900	499,954.00	0.03
414	301180	万祥科技	39,900	499,947.00	0.03

415	301439	泓淋电力	31,800	499,896.00	0.03
416	000819	岳阳兴长	44,110	499,766.30	0.03
417	001201	东瑞股份	46,000	499,560.00	0.03
418	301383	天键股份	20,900	499,510.00	0.03
419	300625	三雄极光	55,000	499,400.00	0.03
420	001277	速达股份	18,100	499,379.00	0.03
421	605299	舒华体育	37,400	499,290.00	0.03
422	300512	中亚股份	73,200	499,224.00	0.03
423	300988	津荣天宇	31,940	499,222.20	0.03
424	605001	威奥股份	91,600	499,220.00	0.03
425	605033	美邦股份	30,000	499,200.00	0.03
426	002968	新大正	59,000	499,140.00	0.03
427	002838	道恩股份	16,300	499,106.00	0.03
428	000812	陕西金叶	161,000	499,100.00	0.03
429	000605	渤海股份	93,280	499,048.00	0.03
430	605138	盛泰集团	90,400	499,008.00	0.03
431	603956	威派格	79,200	498,960.00	0.03
432	603151	邦基科技	45,400	498,946.00	0.03
433	002835	同为股份	43,500	498,945.00	0.03
434	605086	龙高股份	20,100	498,882.00	0.03
435	300579	数字认证	24,100	498,870.00	0.03
436	301199	迈赫股份	28,600	498,784.00	0.03
437	300034	钢研高纳	29,100	498,774.00	0.03
438	603339	四方科技	34,900	498,721.00	0.03
439	300797	钢研纳克	37,600	498,576.00	0.03
440	002756	永兴材料	8,800	498,432.00	0.03
441	002144	宏达高科	50,600	498,410.00	0.03
442	301328	维峰电子	7,000	498,400.00	0.03
443	603680	今创集团	50,800	498,348.00	0.03
444	603860	中公高科	20,600	498,314.00	0.03
445	301429	森泰股份	31,800	498,306.00	0.03
446	600774	汉商集团	79,600	498,296.00	0.03
447	603709	中源家居	36,800	498,272.00	0.03
448	301006	迈拓股份	39,700	498,235.00	0.03
449	301025	读客文化	64,200	498,192.00	0.03
450	002301	齐心集团	68,900	498,147.00	0.03
451	300833	浩洋股份	16,500	497,970.00	0.03
452	301503	智迪科技	18,100	497,931.00	0.03
453	003000	劲仔食品	50,500	497,930.00	0.03
454	605266	健之佳	34,000	497,760.00	0.03
455	603029	天鹅股份	35,400	497,724.00	0.03
456	301100	风光股份	35,800	497,620.00	0.03
457	603810	丰山集团	44,700	497,511.00	0.03

458	002324	普利特	41,200	497,284.00	0.03
459	600561	江西长运	100,400	496,980.00	0.03
460	301106	骏成科技	23,960	496,930.40	0.03
461	002955	鸿合科技	13,900	496,925.00	0.03
462	603689	皖天然气	71,700	496,881.00	0.03
463	603788	宁波高发	36,000	496,800.00	0.03
464	301356	天振股份	18,900	496,503.00	0.03
465	603392	万泰生物	18,400	496,248.00	0.03
466	603569	长久物流	93,500	495,550.00	0.03
467	603208	江山欧派	46,300	495,410.00	0.03
468	688334	西高院	27,293	495,095.02	0.03
469	601065	江盐集团	73,700	494,527.00	0.03
470	301390	经纬股份	15,300	493,578.00	0.03
471	001228	永泰运	19,300	493,115.00	0.03
472	301038	深水规院	30,500	492,880.00	0.03
473	605218	伟时电子	29,800	492,594.00	0.03
474	601279	英利汽车	160,600	489,830.00	0.03
475	301366	一博科技	8,000	489,360.00	0.03
476	603759	海天股份	70,600	485,728.00	0.03
477	601238	广汽集团	95,600	485,648.00	0.03
478	002381	双箭股份	93,700	485,366.00	0.03
479	000411	英特集团	53,740	485,272.20	0.03
480	002116	中国海诚	71,780	485,232.80	0.03
481	000886	海南高速	118,900	485,112.00	0.03
482	600361	创新新材	134,700	484,920.00	0.03
483	603209	兴通股份	38,700	484,911.00	0.03
484	301166	优宁维	18,800	484,852.00	0.03
485	002016	世荣兆业	121,200	484,800.00	0.03
486	603136	天目湖	57,700	483,526.00	0.03
487	003008	开普检测	28,300	483,081.00	0.03
488	002186	全聚德	58,300	482,724.00	0.03
489	601007	金陵饭店	79,000	482,690.00	0.03
490	000419	通程控股	107,000	482,570.00	0.03
491	605268	王力安防	53,700	482,226.00	0.03
492	301370	国科恒泰	59,600	482,164.00	0.03
493	000421	南京公用	97,200	482,112.00	0.03
494	603566	普莱柯	49,200	481,668.00	0.03
495	001338	永顺泰	57,400	481,586.00	0.03
496	600249	两面针	108,200	481,490.00	0.03
497	600283	钱江水利	60,000	481,200.00	0.03
498	603987	康德莱	69,700	480,930.00	0.03
499	605011	杭州热电	31,100	480,806.00	0.03
500	002282	博深股份	85,200	479,676.00	0.03

501	002677	浙江美大	86,700	479,451.00	0.03
502	002790	瑞尔特	89,800	477,736.00	0.03
503	603079	圣达生物	42,100	476,572.00	0.03
504	603908	牧高笛	28,200	476,016.00	0.03
505	600833	第一医药	52,700	475,354.00	0.03
506	603231	索宝蛋白	32,000	473,600.00	0.03
507	603167	渤海轮渡	54,800	469,636.00	0.03
508	000553	安道麦 A	87,700	469,195.00	0.03
509	001324	长青科技	25,500	468,690.00	0.03
510	002275	桂林三金	38,400	468,096.00	0.03
511	001219	青岛食品	40,700	466,422.00	0.03
512	002644	佛慈制药	68,300	465,123.00	0.03
513	600551	时代出版	69,300	460,845.00	0.03
514	600616	金枫酒业	121,700	456,375.00	0.03
515	603182	嘉华股份	40,000	456,000.00	0.03
516	601187	厦门银行	66,000	450,780.00	0.02
517	000030	富奥股份	111,800	432,666.00	0.02
518	600168	武汉控股	99,700	402,788.00	0.02
519	300978	东箭科技	45,300	367,383.00	0.02
520	300838	浙江力诺	26,400	352,440.00	0.02
521	601882	海天精工	17,300	349,979.00	0.02
522	600851	海欣股份	38,700	348,687.00	0.02
523	603848	好太太	25,400	346,964.00	0.02
524	688709	成都华微	9,005	343,000.45	0.02
525	301251	威尔高	6,400	340,992.00	0.02
526	603661	恒林股份	8,500	340,000.00	0.02
527	688338	赛科希德	11,481	338,804.31	0.02
528	301223	中荣股份	21,000	338,520.00	0.02
529	688255	凯尔达	12,172	338,381.60	0.02
530	301586	佳力奇	10,000	336,600.00	0.02
531	300389	艾比森	26,200	335,884.00	0.02
532	603076	乐惠国际	16,200	335,664.00	0.02
533	603237	五芳斋	27,100	335,498.00	0.02
534	603527	众源新材	28,100	334,952.00	0.02
535	688557	兰剑智能	10,791	334,844.73	0.02
536	001336	楚环科技	15,200	334,704.00	0.02
537	300523	辰安科技	18,200	334,516.00	0.02
538	688489	三未信安	14,729	334,348.30	0.02
539	000586	汇源通信	25,300	334,213.00	0.02
540	603373	安邦护卫	9,220	334,132.80	0.02
541	605158	华达新材	52,200	334,080.00	0.02
542	688285	高铁电气	46,588	334,035.96	0.02
543	688638	誉辰智能	10,716	334,017.72	0.02

544	688357	建龙微纳	11,334	334,012.98	0.02
545	301273	瑞晨环保	10,600	334,006.00	0.02
546	002923	润都股份	35,300	333,938.00	0.02
547	603282	亚光股份	23,400	333,918.00	0.02
548	605377	华旺科技	35,900	333,870.00	0.02
549	300817	双飞集团	21,400	333,840.00	0.02
550	603808	歌力思	44,100	333,837.00	0.02
551	002666	德联集团	84,500	333,775.00	0.02
552	001308	康冠科技	16,000	333,760.00	0.02
553	603331	百达精工	31,300	333,658.00	0.02
554	301337	亚华电子	12,000	333,600.00	0.02
555	600785	新华百货	34,040	333,592.00	0.02
556	002344	海宁皮城	95,300	333,550.00	0.02
557	301063	海锅股份	19,900	333,524.00	0.02
558	002933	新兴装备	12,900	333,465.00	0.02
559	301019	宁波色母	18,700	333,421.00	0.02
560	001300	三柏硕	29,500	333,350.00	0.02
561	301208	中亦科技	11,700	333,333.00	0.02
562	000921	海信家电	12,200	333,304.00	0.02
563	300176	鸿特科技	68,700	333,195.00	0.02
564	300577	开润股份	22,800	333,108.00	0.02
565	301115	联检科技	9,500	333,070.00	0.02
565	301515	港通医疗	19,000	333,070.00	0.02
566	300229	拓尔思	24,100	333,062.00	0.02
567	301121	紫建电子	10,400	333,008.00	0.02
568	301512	智信精密	7,400	333,000.00	0.02
569	603409	汇通控股	18,147	332,997.45	0.02
570	003027	同兴科技	19,100	332,913.00	0.02
571	002961	瑞达期货	17,000	332,860.00	0.02
572	301255	通力科技	15,700	332,683.00	0.02
573	002238	天威视讯	61,600	332,640.00	0.02
573	301192	泰祥股份	17,600	332,640.00	0.02
574	688588	凌志软件	36,594	332,639.46	0.02
575	301276	嘉曼服饰	15,600	332,592.00	0.02
576	001360	南矿集团	18,800	332,572.00	0.02
577	688358	祥生医疗	10,879	332,571.03	0.02
578	300795	米奥会展	38,850	332,556.00	0.02
579	301516	中远通	23,500	332,525.00	0.02
580	001333	光华股份	18,200	332,514.00	0.02
581	300425	中建环能	88,900	332,486.00	0.02
582	300810	中科海讯	13,100	332,478.00	0.02
583	002986	宇新股份	28,100	332,423.00	0.02
584	300543	朗科智能	46,100	332,381.00	0.02

585	301260	格力博	24,600	332,346.00	0.02
586	603280	南方路机	13,400	332,320.00	0.02
587	300187	永清环保	65,800	332,290.00	0.02
588	300281	金明精机	55,100	332,253.00	0.02
589	002172	澳洋健康	117,800	332,196.00	0.02
590	301578	辰奕智能	16,290	332,153.10	0.02
591	002905	金逸影视	49,200	332,100.00	0.02
591	605003	众望布艺	16,200	332,100.00	0.02
592	301032	新柴股份	35,700	332,010.00	0.02
592	603126	中材节能	52,700	332,010.00	0.02
593	688466	金科环境	25,876	331,989.08	0.02
594	301456	盘古智能	14,700	331,926.00	0.02
595	002991	甘源食品	8,400	331,884.00	0.02
595	301083	百胜智能	25,200	331,884.00	0.02
596	002403	爱仕达	37,200	331,824.00	0.02
597	601068	中铝国际	76,800	331,776.00	0.02
598	300126	锐奇股份	57,400	331,772.00	0.02
599	300306	远方信息	34,200	331,740.00	0.02
600	301559	中集环科	27,200	331,568.00	0.02
601	605118	力鼎光电	9,500	331,455.00	0.02
602	000959	首钢股份	94,400	331,344.00	0.02
603	301268	铭利达	23,700	331,326.00	0.02
604	300542	新晨科技	29,900	331,292.00	0.02
605	603970	中农立华	34,400	331,272.00	0.02
606	603307	扬州金泉	14,185	331,219.75	0.02
607	603768	常青股份	36,200	330,506.00	0.02
608	301552	科力装备	14,800	330,484.00	0.02
609	001322	箭牌家居	54,700	330,388.00	0.02
610	301281	科源制药	6,700	330,310.00	0.02
611	002732	燕塘乳业	26,600	329,840.00	0.02
612	002333	罗普斯金	70,600	328,996.00	0.02
613	300239	东宝生物	61,700	328,861.00	0.02
614	603385	惠达卫浴	67,200	327,936.00	0.02
615	603708	家家悦	38,200	327,756.00	0.02
616	688420	美腾科技	15,531	327,238.17	0.02
617	002661	克明食品	47,200	327,096.00	0.02
618	001380	华纬科技	20,900	326,876.00	0.02
619	605300	佳禾食品	33,470	326,332.50	0.02
620	301198	喜悦智行	24,300	325,620.00	0.02
621	600579	中化装备	39,400	325,444.00	0.02
622	301215	中汽股份	62,700	325,413.00	0.02
623	000726	鲁泰 A	59,800	324,714.00	0.02
623	605259	绿田机械	18,100	324,714.00	0.02

624	603551	奥普科技	36,100	324,539.00	0.02
625	603053	成都燃气	38,800	324,368.00	0.02
626	301533	威马农机	13,700	324,142.00	0.02
627	600354	敦煌种业	67,800	322,728.00	0.02
628	300688	创业黑马	11,900	322,490.00	0.02
629	600992	贵绳股份	37,400	322,388.00	0.02
630	603329	上海雅仕	35,900	322,382.00	0.02
631	603587	地素时尚	29,000	322,190.00	0.02
632	003037	三和管桩	58,700	321,676.00	0.02
633	300406	九强生物	29,400	321,342.00	0.02
634	603866	桃李面包	87,300	321,264.00	0.02
635	603885	吉祥航空	31,100	320,019.00	0.02
636	603395	红四方	16,000	320,000.00	0.02
637	301371	敷尔佳	12,300	319,800.00	0.02
638	002852	道道全	45,100	319,759.00	0.02
639	000529	广弘控股	74,700	318,222.00	0.02
640	003039	顺控发展	28,900	318,189.00	0.02
641	601158	重庆水务	82,300	317,678.00	0.02
642	603351	威尔药业	13,000	317,330.00	0.02
643	002863	今飞凯达	74,700	316,728.00	0.02
644	601077	渝农商行	51,700	315,887.00	0.02
645	000019	深粮控股	55,400	314,118.00	0.02
646	601101	昊华能源	29,600	312,576.00	0.02
647	600261	阳光照明	101,200	311,696.00	0.02
648	601368	绿城水务	76,100	311,249.00	0.02
649	603639	海利尔	31,300	310,496.00	0.02
650	603096	新经典	23,100	309,078.00	0.02
651	001289	龙源电力	19,700	307,911.00	0.02
652	301305	朗坤科技	10,700	305,164.00	0.02
653	301193	家联科技	16,400	304,056.00	0.02
654	001328	登康口腔	11,700	303,147.00	0.02
655	605577	龙版传媒	33,500	295,135.00	0.02
656	300658	延江股份	20,500	234,315.00	0.01
657	002182	宝武镁业	13,000	202,410.00	0.01
658	688355	明志科技	9,988	192,269.00	0.01
659	300789	唐源电气	9,800	174,146.00	0.01
660	300488	恒锋工具	3,700	173,271.00	0.01
661	605018	长华集团	11,600	172,956.00	0.01
662	688045	必易微	2,133	172,303.74	0.01
663	001223	欧克科技	3,200	170,016.00	0.01
664	688153	唯捷创芯	5,283	169,689.96	0.01
665	688030	山石网科	10,678	168,605.62	0.01
666	301633	港迪技术	3,600	168,516.00	0.01

667	301598	博科测试	3,400	168,368.00	0.01
668	688283	坤恒顺维	5,064	167,669.04	0.01
669	603733	仙鹤股份	6,200	167,462.00	0.01
670	688398	赛特新材	6,462	167,430.42	0.01
671	603085	天成自控	15,400	167,398.00	0.01
672	603102	百合股份	5,300	167,321.00	0.01
673	300886	华业香料	8,400	167,160.00	0.01
674	605169	洪通燃气	18,800	167,132.00	0.01
675	603273	天元智能	12,900	167,055.00	0.01
676	688061	灿瑞科技	3,363	167,040.21	0.01
677	603073	彩蝶实业	11,200	166,992.00	0.01
678	300713	英可瑞	13,100	166,894.00	0.01
679	600802	福建水泥	40,500	166,860.00	0.01
680	688311	盟升电子	6,371	166,856.49	0.01
681	001296	长江材料	8,700	166,779.00	0.01
682	603585	苏利股份	12,200	166,774.00	0.01
683	600778	友好集团	34,100	166,749.00	0.01
684	301359	东南电子	10,500	166,740.00	0.01
685	301126	达嘉维康	19,500	166,725.00	0.01
685	301206	三元生物	7,500	166,725.00	0.01
686	301036	双乐股份	7,600	166,668.00	0.01
687	001202	炬申股份	12,300	166,665.00	0.01
688	300254	仟源医药	20,800	166,608.00	0.01
688	603617	君禾股份	23,400	166,608.00	0.01
689	300977	深圳瑞捷	10,800	166,536.00	0.01
690	300929	华骐环保	15,800	166,532.00	0.01
691	688315	诺禾致源	13,305	166,445.55	0.01
692	603381	永臻股份	10,800	166,428.00	0.01
693	301585	蓝宇股份	6,600	166,386.00	0.01
694	600510	黑牡丹	22,300	166,358.00	0.01
695	603787	新日股份	18,300	166,347.00	0.01
696	603037	凯众股份	16,600	166,332.00	0.01
697	600192	长城电工	25,200	166,320.00	0.01
698	688015	交控科技	10,814	166,319.32	0.01
699	002247	聚力文化	78,800	166,268.00	0.01
700	600865	百大集团	20,300	166,257.00	0.01
701	001269	欧晶科技	8,000	166,240.00	0.01
702	301258	富士莱	7,300	166,221.00	0.01
703	688687	凯因科技	10,188	166,166.28	0.01
704	600081	东风科技	18,300	166,164.00	0.01
705	300466	赛摩智能	23,600	166,144.00	0.01
706	301567	贝隆精密	4,800	166,128.00	0.01
707	603900	莱绅通灵	29,500	166,085.00	0.01

708	301066	万事利	14,300	166,023.00	0.01
709	603180	金牌家居	12,100	166,012.00	0.01
709	605258	协和电子	4,900	166,012.00	0.01
710	002696	百洋股份	33,400	165,998.00	0.01
711	301020	密封科技	7,600	165,984.00	0.01
711	603706	东方环宇	9,600	165,984.00	0.01
712	300519	新光药业	14,000	165,900.00	0.01
713	688579	地纬智能	21,855	165,879.45	0.01
714	002858	力盛体育	15,200	165,832.00	0.01
715	001373	翔腾新材	5,500	165,825.00	0.01
716	605089	味知香	7,900	165,821.00	0.01
717	688615	合合信息	1,466	165,804.60	0.01
718	600724	宁波富达	32,700	165,789.00	0.01
719	600250	南京商旅	21,500	165,765.00	0.01
720	301309	万得凯	5,400	165,510.00	0.01
721	301378	通达海	6,900	165,462.00	0.01
722	300673	佩蒂股份	12,300	165,435.00	0.01
723	301089	拓新药业	8,100	165,402.00	0.01
724	603022	新通联	20,700	165,393.00	0.01
725	603120	肯特催化	3,100	165,385.00	0.01
726	688157	松井股份	6,265	165,333.35	0.01
727	300371	汇中股份	16,900	165,282.00	0.01
728	301211	亨迪药业	14,600	165,272.00	0.01
729	301353	普莱得	9,950	165,269.50	0.01
730	600356	恒丰纸业	22,300	165,243.00	0.01
731	300966	共同药业	6,000	165,060.00	0.01
732	600679	上海凤凰	18,500	165,020.00	0.01
733	603028	赛福天	25,500	164,985.00	0.01
734	002641	公元股份	42,700	164,822.00	0.01
735	301103	何氏眼科	11,000	164,780.00	0.01
736	300915	海融科技	8,300	164,340.00	0.01
737	002889	东方嘉盛	15,800	163,688.00	0.01
738	603755	日辰股份	7,200	163,368.00	0.01
739	301335	天元宠物	8,300	162,929.00	0.01
740	603081	大丰实业	18,800	162,620.00	0.01
741	001368	通达创智	7,900	162,503.00	0.01
742	000565	渝三峡 A	28,600	162,448.00	0.01
743	603050	科林电气	8,300	162,348.00	0.01
744	600676	交运股份	25,000	162,250.00	0.01
745	300994	久祺股份	15,200	162,184.00	0.01
746	603648	畅联股份	18,900	162,162.00	0.01
747	300791	仙乐健康	10,100	161,802.00	0.01
748	688156	路德科技	5,348	161,777.00	0.01

749	600808	马钢股份	64,700	161,750.00	0.01
750	301275	汉朔科技	3,600	161,640.00	0.01
751	300824	北鼎股份	22,500	161,550.00	0.01
752	301170	锡南科技	7,500	161,325.00	0.01
753	600178	东安动力	16,400	161,212.00	0.01
754	600271	航天信息	24,500	161,210.00	0.01
755	001356	富岭股份	19,500	161,070.00	0.01
756	603214	爱婴室	13,300	161,063.00	0.01
757	003013	地铁设计	11,100	161,061.00	0.01
758	601811	新华文轩	14,700	160,818.00	0.01
759	600956	新天绿能	23,000	160,770.00	0.01
760	603896	寿仙谷	12,400	160,580.00	0.01
761	002942	新农股份	11,200	160,496.00	0.01
762	600455	博通股份	7,300	160,308.00	0.01
763	688356	键凯科技	2,069	159,478.52	0.01
764	000868	安凯客车	48,900	159,414.00	0.01
765	002890	弘宇股份	11,148	159,304.92	0.01
766	301088	戎美股份	13,900	159,294.00	0.01
767	605108	同庆楼	14,000	159,040.00	0.01
768	605020	永和股份	3,900	158,808.00	0.01
769	300213	佳讯飞鸿	26,200	158,772.00	0.01
770	603310	巍华新材	10,800	158,652.00	0.01
771	603967	中创物流	15,300	158,355.00	0.01
772	603235	天新药业	7,100	157,975.00	0.01
773	002900	哈三联	17,200	157,896.00	0.01
774	002880	卫光生物	8,100	157,788.00	0.01
775	000590	古汉医药	19,300	157,681.00	0.01
776	000526	学大教育	6,200	157,356.00	0.01
777	600888	新疆众和	9,900	157,311.00	0.01
778	603365	水星家纺	10,100	157,257.00	0.01
779	603020	爱普股份	11,100	156,510.00	0.01
780	301571	国科天成	2,400	156,432.00	0.01
781	002088	鲁阳节能	19,500	156,390.00	0.01
782	300662	科锐国际	9,200	156,216.00	0.01
783	000011	深物业 A	24,100	156,168.00	0.01
784	000544	中原环保	22,400	156,128.00	0.01
785	603057	紫燕食品	7,000	156,100.00	0.01
786	603170	宝立食品	13,800	155,940.00	0.01
787	301130	西点药业	6,500	155,870.00	0.01
788	603210	泰鸿万立	11,600	155,788.00	0.01
789	603230	内蒙新华	17,800	155,394.00	0.01
790	601089	福元医药	9,500	154,660.00	0.01
791	605296	神农集团	5,500	153,340.00	0.01

792	600749	西藏旅游	11,100	152,070.00	0.01
793	301286	侨源股份	2,600	150,774.00	0.01
794	003011	海象新材	8,100	147,177.00	0.01
795	000683	博源化工	9,000	51,840.00	0.00
796	688351	微电生理	665	15,068.90	0.00
797	002833	弘亚数控	300	5,787.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	001399	惠科股份	16,218	551,403.64	0.03
2	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
3	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00

注：本基金本报告期末仅持有以上积极投资股票。

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	300308	中际旭创	81,645,752.00	6.22
2	300014	亿纬锂能	66,762,582.72	5.09
3	301396	宏景科技	65,093,733.43	4.96
4	601869	长飞光纤	60,376,474.78	4.60
5	001309	德明利	56,943,977.02	4.34
6	002384	东山精密	56,104,104.96	4.27
7	300750	宁德时代	55,550,141.50	4.23
8	688167	炬光科技	55,530,959.09	4.23
9	002916	深南电路	53,095,081.96	4.04
10	688498	源杰科技	51,574,170.37	3.93
11	688256	寒武纪	48,591,208.77	3.70
12	002008	大族激光	48,303,318.00	3.68
13	000725	京东方 A	46,904,088.00	3.57
14	002475	立讯精密	45,798,818.00	3.49
15	603993	洛阳钼业	45,468,528.00	3.46
16	002281	光迅科技	43,898,783.82	3.34
17	000630	铜陵有色	43,742,969.00	3.33
18	603259	药明康德	43,321,884.80	3.30
19	300548	长芯博创	42,390,237.00	3.23
20	002466	天齐锂业	42,340,728.95	3.23
21	300751	迈为股份	41,980,262.41	3.20
22	300274	阳光电源	40,378,399.98	3.08

23	600150	中国船舶	39,633,599.39	3.02
24	605117	德业股份	39,497,492.81	3.01
25	301308	江波龙	38,846,433.44	2.96
26	300475	香农芯创	37,803,671.82	2.88
27	300438	鹏辉能源	37,097,330.00	2.83
28	603986	兆易创新	36,568,905.00	2.79
29	600584	长电科技	36,364,900.00	2.77
30	300769	德方纳米	35,711,030.20	2.72
31	601872	招商轮船	35,386,933.40	2.70
32	300604	长川科技	34,322,260.00	2.61
33	600011	华能国际	32,353,418.00	2.46
34	688536	思瑞浦	32,155,519.99	2.45
35	603799	华友钴业	32,109,514.50	2.45
36	300394	天孚通信	31,169,246.40	2.37
37	300502	新易盛	30,620,364.60	2.33
38	688390	固德威	30,309,868.87	2.31
39	300017	网宿科技	30,019,502.71	2.29
40	600418	江淮汽车	29,720,068.50	2.26
41	600010	包钢股份	29,537,208.00	2.25
42	002460	赣锋锂业	29,406,113.52	2.24
43	001389	广合科技	29,387,618.95	2.24
44	002600	领益智造	29,234,067.22	2.23
45	002709	天赐材料	28,675,893.21	2.18
46	688525	佰维存储	28,605,365.37	2.18
47	300857	协创数据	28,302,751.80	2.16
48	300803	指南针	28,257,644.55	2.15
49	002812	恩捷股份	27,339,356.45	2.08
50	688025	杰普特	26,573,532.69	2.02

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	300308	中际旭创	96,377,410.44	7.34
2	001309	德明利	89,717,831.15	6.83
3	301308	江波龙	83,838,592.21	6.39
4	300274	阳光电源	78,332,480.94	5.97
5	601869	长飞光纤	77,521,328.01	5.91
6	688498	源杰科技	71,936,700.77	5.48
7	002916	深南电路	69,448,402.40	5.29
8	002475	立讯精密	60,094,021.59	4.58
9	688167	炬光科技	57,444,805.14	4.38
10	002384	东山精密	57,427,907.26	4.37

11	300750	宁德时代	57,329,401.20	4.37
12	603986	兆易创新	55,569,328.30	4.23
13	688256	寒武纪	52,566,264.17	4.00
14	301396	宏景科技	50,957,244.55	3.88
15	600487	亨通光电	46,781,243.65	3.56
16	000338	潍柴动力	44,195,367.14	3.37
17	300857	协创数据	43,972,346.78	3.35
18	601872	招商轮船	43,162,673.49	3.29
19	002008	大族激光	42,949,762.72	3.27
20	300475	香农芯创	42,491,345.08	3.24
21	300751	迈为股份	38,506,277.16	2.93
22	002281	光迅科技	38,251,276.56	2.91
23	603799	华友钴业	37,888,369.20	2.89
24	300394	天孚通信	34,754,066.70	2.65
25	300548	长芯博创	34,040,655.08	2.59
26	300502	新易盛	32,016,130.87	2.44
27	600010	包钢股份	31,265,888.00	2.38
28	688525	佰维存储	31,042,358.83	2.36
29	000063	中兴通讯	30,925,949.91	2.36
30	002371	北方华创	30,309,122.15	2.31
31	000792	盐湖股份	30,118,037.16	2.29
32	002709	天赐材料	29,778,596.10	2.27
33	300418	昆仑万维	29,524,555.74	2.25
34	300604	长川科技	29,010,825.00	2.21
35	688521	芯原股份	28,782,046.87	2.19
36	300014	亿纬锂能	28,245,734.31	2.15
37	300017	网宿科技	28,225,732.34	2.15
38	688025	杰普特	27,337,773.31	2.08
39	688536	思瑞浦	27,178,616.97	2.07

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	4,934,163,615.81
卖出股票收入（成交）总额	4,766,296,302.15

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,189,674.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,189,674.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001399	惠科股份	179,912.24	0.01	锁定期股票流通受限
2	688797	臻宝科技	97,014.69	0.01	锁定期股票流通受限
3	301669	高特电子	15,506.40	0.00	锁定期股票流通受限

注：本基金本报告期末仅持有以上积极投资股票。

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（%）
国金中证全指指数增强 A	18,672	52,372.26	220,076,487.00	22.51	757,818,370.50	77.49
国金中证全指指数增强 C	8,941	56,889.81	39,067,843.28	7.68	469,583,917.59	92.32
合计	27,613	53,835.03	259,144,330.28	17.43	1,227,402,288.09	82.57

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	国金中证全指指数增强 A	2,098,835.23	0.2146

理人所有从业人员持有本基金	国金中证全指指数增强 C	54, 511. 68	0. 0107
	合计	2, 153, 346. 91	0. 1449

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	国金中证全指指数增强 A	>100
	国金中证全指指数增强 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国金中证全指指数增强 A	0
	国金中证全指指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金中证全指指数增强 A	国金中证全指指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 9 月 16 日）基金份额总额	788, 290, 359. 16	745, 659, 750. 08
本报告期期初基金份额总额	712, 943, 521. 01	598, 207, 632. 80
本报告期基金总申购份额	915, 481, 117. 52	628, 849, 237. 44
减：本报告期基金总赎回份额	650, 529, 781. 03	718, 405, 109. 37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	977, 894, 857. 50	508, 651, 760. 87

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	3	7,307,752,999.72	75.34	1,358,535.88	75.34	—
国盛证券	3	2,392,411,931.48	24.66	444,773.68	24.66	—

注：（一）选择标准

1. 具备相关业务资质，公司经营行为规范；

- 2. 财务状况良好，公司经营状况稳定；
- 3. 具备较强的交易服务能力，相关制度建设、人员配置、系统建设等满足基金进行证券交易的
的需要；
- 4. 具备较强的研究服务能力，相关制度建设、人员配置、研究能力、研究质量等可以保障较
为专业、审慎的研究服务；
- 5. 具备较强的合规风控能力，合规风控管理体系机制较为健全；
- 6. 交易佣金费率标准符合要求。

(二) 选择程序

- 1. 基金管理人根据上述标准选用符合条件的证券公司；
- 2. 基金管理人和被选用的证券公司签订协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例 (%)	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比例 (%)
广发证券	-	-	22, 513, 000. 00	50. 00	-	-
国盛证券	-	-	22, 513, 000. 00	50. 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	《国金中证全指指数增强型证券投资 基金招募说明书(更新)》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
2	《国金中证全指指数增强型证券投资 基金（国金中证全指指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
3	《国金中证全指指数增强型证券投资 基金（国金中证全指指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 15 日
4	《国金中证全指指数增强型证券投资 基金 2025 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 1 月 22 日
5	《国金基金管理有限公司关于终止 浦领基金销售有限公司办理旗下基 金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 10 日
6	《国金基金管理有限公司旗下公募 基金通过证券公司证券交易及佣金 支付情况（2025 年度）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日

7	《国金中证全指指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
8	《国金基金管理有限公司关于公司 系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 17 日
9	《国金中证全指指数增强型证券投资 基金 2026 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
10	《2025 年度国金基金管理有限公司 以股东身份（通过公募基金持股） 参与股东大会投票信息披露》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 24 日
11	《国金基金管理有限公司关于终止 中证金牛（北京）基金销售有限公 司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 5 月 29 日
12	《国金基金管理有限公司关于终止 上海凯石财富基金销售有限公司办 理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 6 月 18 日
13	《国金基金管理有限公司关于旗下 部分基金调整业绩比较基准并修订 基金合同等法律文件的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 6 月 27 日
14	《国金基金管理有限公司关于提醒 投资者及时提供或更新身份资料信 息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日