国联沪深300指数增强型证券投资基金

2026年第2季度报告

2026年06月30日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2026年07月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在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4月1日起至2026年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联沪深300指数增强
基金主代码	022309
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年11月26日
报告期末基金份额总额	216,260,426.57份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数有效跟踪的基础上，结合量化及基本面的方法，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、资产配置策略； 2、股票投资策略； 3、存托凭证的投资策略； 4、债券投资策略； 5、可转债及可交换债投资策略； 6、资产支持证券投资策略； 7、股指期货投资策略； 8、国债期货投资策略； 9、股票期权投资策略； 10、信用衍生品投资策略； 11、融资交易策略；

	12、参与转融通证券出借业务策略。	
业绩比较基准	沪深300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	本基金为股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。	
基金管理人	国联基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国联沪深300指数增强A	国联沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	022309	022310
报告期末下属分级基金的份额总额	180,367,108.44份	35,893,318.13份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年04月01日 - 2026年06月30日)	
	国联沪深300指数增强A	国联沪深300指数增强C
1.本期已实现收益	6,426,462.96	943,099.25
2.本期利润	24,962,414.69	3,797,197.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.1302	0.1255
4.期末基金资产净值	242,279,376.19	47,903,569.90
5.期末基金份额净值	1.3433	1.3346

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，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

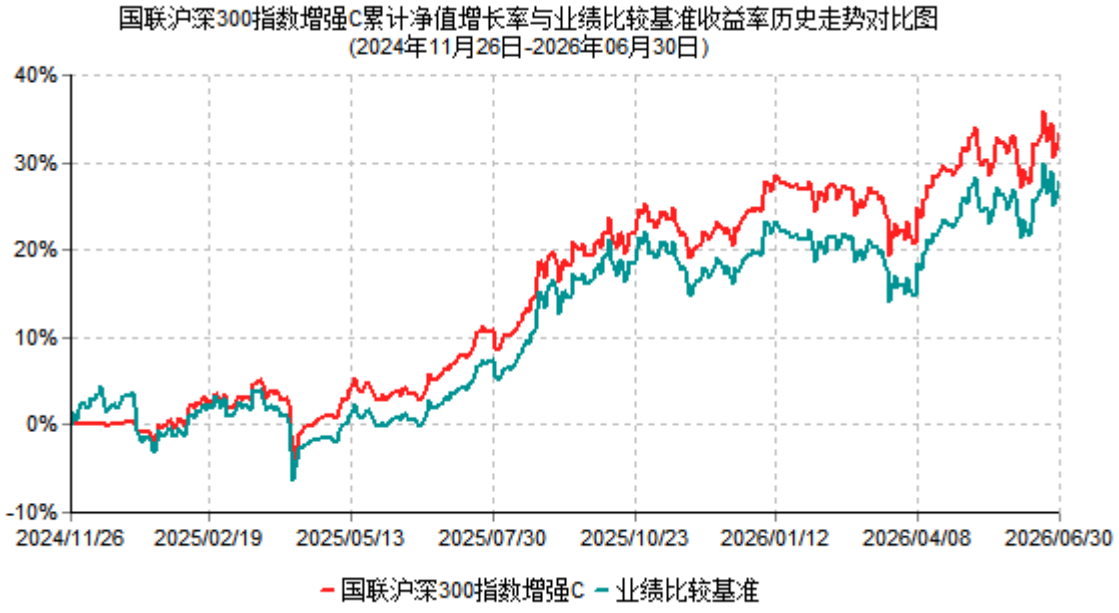
国联沪深300指数增强A净值表现

阶段	净值增长率①	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	10.19%	1.17%	11.30%	1.19%	-1.11%	-0.02%
过去六个月	7.52%	1.05%	7.20%	1.07%	0.32%	-0.02%
过去一年	27.12%	0.92%	25.13%	0.97%	1.99%	-0.05%
自基金合同生效起至今	34.33%	0.89%	27.90%	0.96%	6.43%	-0.07%

国联沪深300指数增强C净值表现

阶段	净值增长率①	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	10.07%	1.17%	11.30%	1.19%	-1.23%	-0.02%
过去六个月	7.29%	1.05%	7.20%	1.07%	0.09%	-0.02%
过去一年	26.61%	0.92%	25.13%	0.97%	1.48%	-0.05%
自基金合同生效起至今	33.46%	0.89%	27.90%	0.96%	5.56%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵菲	国联物联网主题灵	2024-	-	17	赵菲先生，中国国籍，毕业

	活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。	11-29			于北京师范大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限17年。2008年8月至2011年5月曾任国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部投资经理；2011年5月至2012年11月曾任嘉实基金管理有限公司结构产品投资部专户投资经理 。2012年11月加入公司筹备组，现任多策略投资部基金经理。
王喆	国联高股息精选混合型证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联中证800指数增强型证券投资基金、国联稳健添益债券型证券投资基金、国联中证港股通综合指数增强型证券投资基金、国联稳健鑫益债券型证券投资基金、国联创业板综合指数增强型	2024-11-26	-	11	王喆先生,中国国籍，毕业于北京航空航天大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限11年。2015年1月至2022年4月历任中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部基金研究员、权益投资部基金经理；2022年4月至2023年9月历任中信建投基金管理有限公司特定资产管理部投资经理、多元资产配置部投资经理。2023年9月加入公司，现任多策略投资总监兼任多策略投资部总经理。

	证券投资基金的基金经理及多策略投资总监兼多策略投资部总经理。				
黄磊鑫	国联中证800指数增强型证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。	2025-06-14	-	5	黄磊鑫先生，中国国籍，毕业于对外经济贸易大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限5年。2021年6月至2022年3月任中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员；2022年3月至2023年10月任中信建投基金管理有限公司多元资产配置部研究员。2023年10月加入公司，现任多策略投资部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

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。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价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5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，市场呈现显著的结构性行情，成长风格大幅占优，主要宽基指数录得季度正收益。从指数表现来看，二季度上证指数上涨5.20%，沪深300上涨11.90%。从行业表现来看，二季度仅有少部分中信一级行业正收益，其中电子上涨89.88%，通信上涨66.12%，消费者服务下跌21.84%。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上，力争为投资者创造更稳定、可持续、高胜率的超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联沪深300指数增强A基金份额净值为1.3433元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.19%，同期业绩比较基准收益率为11.30%；截至报告期末国联沪深300指数增强C基金份额净值为1.3346元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.07%，同期业绩比较基准收益率为11.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	265,111,689.19	90.51
	其中：股票	265,111,689.19	90.51
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	25,377,688.12	8.66
8	其他资产	2,423,934.19	0.83
9	合计	292,913,311.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	10,033,120.00	3.46
C	制造业	153,124,336.90	52.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,429,004.00	1.53
E	建筑业	2,765,880.00	0.95
F	批发和零售业	825,144.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	7,785,247.00	2.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,302,502.00	6.31
J	金融业	43,991,503.00	15.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,188,484.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	3,884,712.00	1.34
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	1,005,242.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	249,335,174.90	85.92

5.2.2 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	64,800.00	0.02
B	采矿业	417,768.78	0.14
C	制造业	9,091,515.16	3.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	212,870.20	0.07
E	建筑业	305,598.00	0.11
F	批发和零售业	1,617,777.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	415,776.46	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	936,759.00	0.32
J	金融业	811,469.00	0.28
K	房地产业	652,750.00	0.22
L	租赁和商务服务业	436,719.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	8,432.69	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	804,279.00	0.28
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	15,776,514.29	5.44

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300308	中际旭创	11,800	14,986,000.00	5.16
2	300750	宁德时代	28,340	11,137,903.40	3.84
3	300502	新易盛	12,340	7,490,380.00	2.58
4	688256	寒武纪	3,980	6,350,289.00	2.19
5	600519	贵州茅台	4,900	5,808,901.00	2.00
6	601899	紫金矿业	204,700	5,146,158.00	1.77
7	688981	中芯国际	28,140	4,469,194.80	1.54
8	603986	兆易创新	5,000	4,075,000.00	1.40
9	600030	中信证券	139,200	3,999,216.00	1.38
10	603259	药明康德	31,200	3,884,712.00	1.34

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002414	高德红外	57,200	758,472.00	0.26
2	601061	中信金属	59,700	642,969.00	0.22
3	600704	物产中大	116,700	550,824.00	0.19
4	688538	和辉光电	181,800	472,680.00	0.16
5	002266	浙富控股	90,900	459,954.00	0.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IF2607	沪深300股指期货2607合约	6	8,859,600.00	498,120.00	-
公允价值变动总额合计（元）					498,120.00
股指期货投资本期收益（元）					37,318.95
股指期货投资本期公允价值变动（元）					713,125.71

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数增强型基金，投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响较小，并符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,063,152.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,360,782.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,423,934.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	国联沪深300指数增强A	国联沪深300指数增强C
报告期期初基金份额总额	198,886,072.36	32,288,079.96
报告期期间基金总申购份额	24,161,361.39	20,383,309.51
减：报告期期间基金总赎回份额	42,680,325.31	16,778,071.34
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	180,367,108.44	35,893,318.13

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予国联沪深300指数增强型证券投资基金募集注册的文件

（二）《国联沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》

（三）《国联沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》

（四）关于申请募集注册国联沪深300指数增强型证券投资基金之法律意见

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000,（010）56517299。

网址：http://www.glfund.com/

国联基金管理有限公司

2026年07月21日