

国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指  
数证券投资基金  
2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 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。

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 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国联安中证 A500 增强 ETF                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 场内简称       | A500 增强 ETF                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金主代码      | 563630                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2025 年 6 月 19 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 报告期末基金份额总额 | 39,947,055.00 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资目标       | 本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略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，追求基金资产的长期增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资策略       | 本基金采用指数增强投资策略，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 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.50%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。在本基金运作过程中，如本基金标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人按照基金份额持有人利益优先原则，在履行内部决策程序后，通过成份股替代等方式对相关指数成份股进行调整。在对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金运用数量化的策略体系构建投资组合，主要包括多因子选股策略、事件驱动策略和风险优化等策略。同时，基金管理人通过事中监控、事后调整等手段优化组合交易并严格控制组合风险，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。 |
| 业绩比较基准     | 中证 A500 指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征     | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

|       |                      |
|-------|----------------------|
|       | 份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司          |
| 基金托管人 | 招商证券股份有限公司           |

§ 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 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 3,540,792.39                          |
| 2. 本期利润         | 7,614,988.66                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2025                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 55,922,172.99                         |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3999                                |

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上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，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

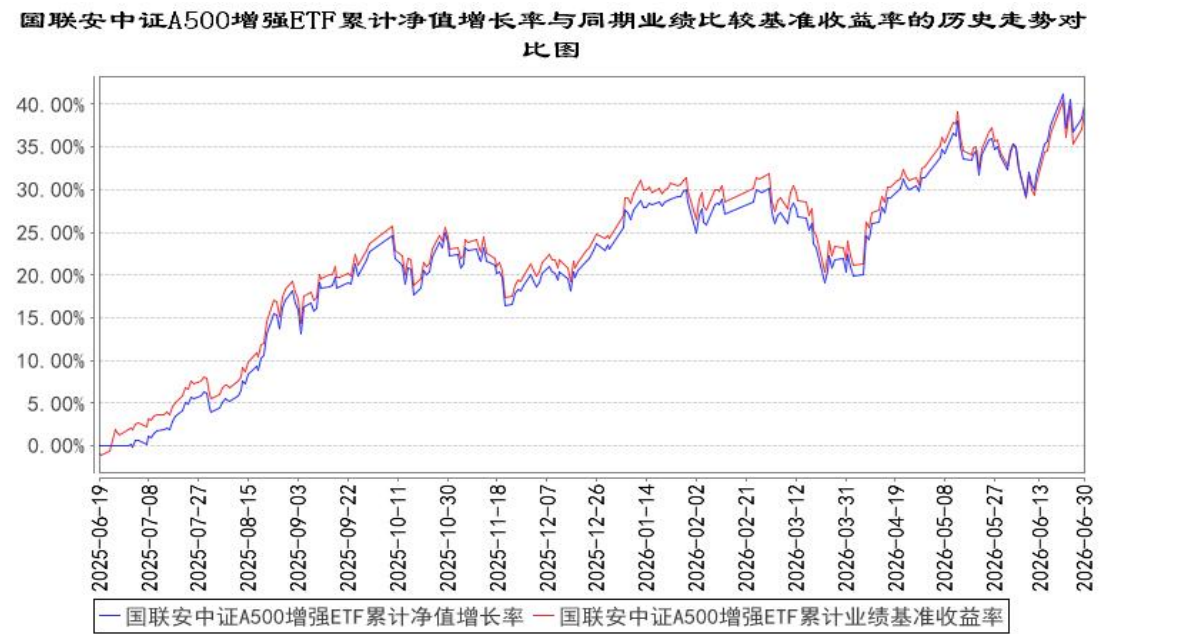
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（报告期：2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 16.33%     | 1.37%         | 14.26%         | 1.41%                 | 2.07% | -0.04% |
| 过去六个月 | 13.76%     | 1.24%         | 11.91%         | 1.29%                 | 1.85% | -0.05% |
| 过去一年  | 40.00%     | 1.12%         | 36.38%         | 1.14%                 | 3.62% | -0.02% |
| 过去三年  | —          | —             | —              | —                     | —     | —      |
| 过去五年  | —          | —             | —              | —                     | —     | —      |
| 过去七年  | —          | —             | —              | —                     | —     | —      |
| 过去十年  | —          | —             | —              | —                     | —     | —      |
| 自基金合同 | 39.99%     | 1.10%         | 39.08%         | 1.13%                 | 0.91% | -0.03% |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

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：1、本基金业绩比较基准为中证 A500 指数收益率；

2、本基金基金合同于 2025 年 6 月 19 日生效；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§ 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 |                 |                                                                                                                                                             |
| 冯浩  | 基金经理                | 2025 年 7 月 30 日 | —    | 1 年（自 2025 年起）  | 冯浩先生，硕士研究生。曾任上海锐联景淳投资管理有限公司研究员、投资经理。2025 年 7 月加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理。2025 年 7 月起担任国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 8 月起兼任国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。 |
| 章樾元 | 基金经<br>理、量化<br>投资部总 | 2025 年 6 月 19 日 | —    | 18 年（自 2008 年起） | 章樾元先生，硕士研究生。曾任建信基金管理有限公司研究员，富国基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，融通基金                                                                                                      |

|  |    |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|----|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 经理 |  |  |  | <p>管理有限公司专户投资经理、基金经理、指数与量化投资部总经理。2019 年 5 月加入国联安基金管理有限公司,担任量化投资部总经理(兼投资经理)。2020 年 5 月起担任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2020 年 8 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2021 年 5 月至 2025 年 9 月兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2021 年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2022 年 11 月至 2025 年 1 月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2022 年 12 月起兼任国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理;2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2024 年 1 月起兼任国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理;2024 年 12 月起兼任国联安上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2025 年 6 月起兼任国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2025 年 8 月起兼任国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理;2025 年 9 月起兼任国联安中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2025 年 11 月起兼任国联安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|----|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |                           |                   |   |                   |                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----|---------------------------|-------------------|---|-------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 何贤发 | 基金经<br>理、主动<br>量化部总<br>经理 | 2025 年 9 月 4<br>日 | - | 3 年（自<br>2016 年起） | 何贤发先生，硕士研究生。曾任安联投资美国公司高级量化研究员，平安证券量化投资经理，歌斐诺宝（上海）资产管理有限公司投资经理，上海锐联景淳投资管理有限公司研究总监、股票投研负责人、投资经理。2025 年 8 月加入国联安基金管理有限公司，历任量化指数增强团队负责人、主动量化部总经理。2025 年 9 月起担任国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金和国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 12 月起兼任国联安红利慧选混合型发起式证券投资基金的基金经理。 |
|-----|---------------------------|-------------------|---|-------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；  
2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.1.1 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

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元）           | 任职时间           |
|-----|----------|---------|-------------------|----------------|
| 章榭元 | 公募基金     | 17      | 41,544,545,428.95 | 2020 年 5 月 6 日 |
|     | 私募资产管理计划 | 5       | 24,666,924,468.65 | 2024 年 9 月 2 日 |
|     | 其他组合     | -       | -                 | -              |
|     | 合计       | 22      | 66,211,469,897.60 | -              |

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，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

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统内的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度，A 股市场延续了结构性行情，风格分化进一步加剧。4 月上旬，中东军事行动与极限施压达到顶峰后，各方逐步达成阶段性停火协议，市场风险偏好随即快速修复，权益资产普遍反弹。此后市场走出 K 型分化的结构性牛市，其核心推动力有三：一是以人工智能为代表的新兴产业维持高景气，全球半导体产业链二季度业绩陆续兑现甚至超出预期，业绩与情绪共振；二是内需修复依然偏慢，截至 5 月经济数据显示，景气度回升主要集中在上游原材料与中游加工工业，下游消费端仍为负增长，居民部门在必选消费端的贡献持续走弱；三是极度宽松的资金面与低利率“资产荒”环境下，居民与企业存款持续入市，进一步推高高景气资产的估值水平。在此格局下，半导体上游设备、材料等环节全面爆发，科创 50、创业板指屡创历史新高、大幅领跑。沪指高位震荡，传统消费与部分高股息板块相对落后，市场呈现极端的结构分化与“科技独舞”格局，交投活跃度始终维持历史高位。

本产品沿用了“多策略选股、多工具增强、动态紧风控”的策略框架，着眼于为投资人提供有竞争力、低相关的量化增强产品。本基金作为一档增强型 ETF，我们希望充分发挥 ETF 工具特性，努力为投资者提供更稳健超额、更大策略容量的投资工具，追求在紧密跟踪对标指数的基础上最大化超额收益胜率，争取每年均能为投资者提供稳健的正超额回报。

展望下一季度，我们认为市场行情的核心推动力未发生根本变化，AI 产业高景气与宽松资金面仍将支撑高成长资产估值。宏观层面，利率环境整体宽松，国内流动性维持宽裕，对风险资产依然友好；产业层面，算力供需紧张状态仍将持续，全球半导体需求共振、行业仍处上行期，AI 叙事下科技景气投资或仍有持续演绎空间。本基金将持续在研究端迭代升级各个子策略模型，在投资端保持系统化投资的纪律性管理，力争为持有人持续创造稳健的超额收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.3999 元，本报告期份额净值增长率为 16.33%，同期业绩比较基准收益率为 14.26%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

2026 年 2 月 2 日至 2026 年 5 月 6 日，本基金资产净值低于 5000 万。

基金管理人已通过持续营销活动，增加基金规模。

# § 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              | 53,229,910.37 | 95.05        |
|    | 其中：股票             | 53,229,910.37 | 95.05        |
| 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           | 3,400.00      | 0.01         |
| 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      | 2,769,308.62  | 4.94         |
| 8  | 其他资产              | —             | —            |
| 9  | 合计                | 56,002,618.99 | 100.00       |

注：1、上表中的权益投资股票项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值；

2、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 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         | 97,972.00     | 0.18         |
| B  | 采矿业              | 2,191,469.00  | 3.92         |
| C  | 制造业              | 34,190,197.54 | 61.14        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 416,727.00    | 0.75         |
| E  | 建筑业              | 415,872.00    | 0.74         |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 455,719.00    | 0.81  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 658,977.00    | 1.18  |
| H | 住宿和餐饮业          | 12,593.00     | 0.02  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,345,451.58  | 4.19  |
| J | 金融业             | 4,627,926.00  | 8.28  |
| K | 房地产业            | 59,136.00     | 0.11  |
| L | 租赁和商务服务业        | 25,652.00     | 0.05  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 592,380.00    | 1.06  |
| 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         | 12,390.00     | 0.02  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | —             | —     |
| S | 综合              | —             | —     |
|   | 合计              | 46,102,462.12 | 82.44 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 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         | —            | —            |
| B  | 采矿业              | 310,905.00   | 0.56         |
| C  | 制造业              | 5,257,428.63 | 9.40         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 358,839.00   | 0.64         |
| E  | 建筑业              | 70,170.00    | 0.13         |
| F  | 批发和零售业           | —            | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 115,912.00   | 0.21         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —            | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 102,965.00   | 0.18         |
| J  | 金融业              | 588,375.20   | 1.05         |
| K  | 房地产业             | —            | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 72,319.00    | 0.13         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 127,674.42   | 0.23         |
| 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               | 79,517.00    | 0.14         |
| Q  | 卫生和社会工作          | —            | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 43,343.00    | 0.08         |
| S  | 综合               | —            | —            |
|    | 合计               | 7,127,448.25 | 12.75        |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

### 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 | 2,000  | 2,540,000.00 | 4.54         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 4,220  | 1,658,502.20 | 2.97         |
| 3  | 300502 | 新易盛  | 2,240  | 1,359,680.00 | 2.43         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 1,100  | 1,304,039.00 | 2.33         |
| 5  | 603986 | 兆易创新 | 1,200  | 978,000.00   | 1.75         |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 25,400 | 901,700.00   | 1.61         |
| 7  | 601899 | 紫金矿业 | 35,300 | 887,442.00   | 1.59         |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 18,100 | 864,094.00   | 1.55         |
| 9  | 002384 | 东山精密 | 3,100  | 813,285.00   | 1.45         |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 820    | 725,339.20   | 1.30         |

#### 5.3.2 报告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  | 301536 | 星辰科技 | 2,100  | 270,291.00 | 0.48         |
| 2  | 600320 | 振华重工 | 41,000 | 169,330.00 | 0.30         |
| 3  | 001389 | 广合科技 | 600    | 142,350.00 | 0.25         |
| 4  | 300548 | 长芯博创 | 500    | 139,000.00 | 0.25         |
| 5  | 688717 | 艾罗能源 | 1,664  | 137,396.48 | 0.25         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 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

本报告期末本基金未持有债券。

### 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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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       |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|------------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -          |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -          |
| 股指期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | -56,710.32 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | -2,640.00  |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可根据风险管理原则，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，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本，追求对标的指数的紧密跟踪。

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

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行安徽省分行、中国人民银行山东省分行、烟台市牟平区市场监督管理局、济南市市中区财政局、国家金融监督管理总局浙江监管局、国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。

本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，除上述主

体外，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

本报告期末本基金未持有其他资产。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 37,947,055.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 10,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 8,000,000.00  |
| 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               | 39,947,055.00 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |         |    |    |    | 报告期末持有基金情况 |     |
|-------|----------------|---------|----|----|----|------------|-----|
|       | 序              | 持有基金份额比 | 期初 | 申购 | 赎回 | 持有份额       | 份额占 |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 号 | 例达到或者超过 20%的时间区间                | 份额            | 份额 | 份额 |               | 比（%）  |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|---------------------------------|---------------|----|----|---------------|-------|
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 1 | 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 20,001,055.00 | -  | -  | 20,001,055.00 | 50.07 |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |   |                                 |               |    |    |               |       |
| <p>（1）持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>（2）基金净值大幅波动的风险</p> <p>高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>（3）基金规模较小导致的风险</p> <p>高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> |   |                                 |               |    |    |               |       |

注：申购份额包含本报告期内发生的买入份额；赎回份额包含本报告期内发生的卖出份额。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司  
二〇二六年七月二十一日