

国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 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 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保中证 800 指数增强
基金主代码	026255
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 12 月 30 日
报告期末基金份额总额	291,131,838.68 份
投资目标	本基金通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数中证 800 指数有效跟踪的基础上，力争实现超越基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 800 指数为标的指数。本基金主要策略为跟踪标的指数，在跟踪标的指数的基础上一定程度的调整个股，通过数量化模型及基本面分析优化投资组合，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。 如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

	本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国寿安保中证 800 指数增强 A	国寿安保中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	026255	026256
报告期末下属分级基金的份额总额	231,973,389.26 份	59,158,449.42 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 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）	
	国寿安保中证 800 指数增强 A	国寿安保中证 800 指数增强 C
1. 本期已实现收益	-112,094.67	-146,492.24
2. 本期利润	38,024,740.22	11,149,162.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1380	0.1379
4. 期末基金资产净值	249,238,883.91	63,431,683.00
5. 期末基金份额净值	1.0744	1.0722

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的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

国寿安保中证 800 指数增强 A

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	14.10%	1.25%	13.02%	1.27%	1.08%	-0.02%
过去六个月	7.44%	1.10%	10.59%	1.18%	-3.15%	-0.08%
自基金合同生效 起至今	7.44%	1.09%	10.57%	1.17%	-3.13%	-0.08%

国寿安保中证 800 指数增强 C

阶段	净值增长率	净值增长率标准	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	-------	---------	----------	------------	-----	-----

	①	差②	率③	准差④		
过去三个月	13.99%	1.25%	13.02%	1.27%	0.97%	-0.02%
过去六个月	7.22%	1.10%	10.59%	1.18%	-3.37%	-0.08%
自基金合同生效起至今	7.22%	1.09%	10.57%	1.17%	-3.35%	-0.08%

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

国寿安保中证800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



国寿安保中证800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：本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 30 日，按照本基金的基金合同规定，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关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2025 年 12 月 30 日至 2026

年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
李康	本基金的基金经理	2025 年 12 月 30 日	-	17 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

本基金管理人对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用不同的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。经分析，本报告期未发现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内，未发生基金管理人管理的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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金为指数增强型基金，管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理。在严格控制与标的指数的行业和风格偏离的基础上，以量化指标精选个股。报告期内市场结构分化显著，应对市场环境变化积极优化投资模型，适度放开成长敞口同时收紧市值偏离。基金管理人通过分散持仓和适当降低换手率等方式尽量降低回撤和交易成本，对风险事件进行实时监控，以尽量避免个股负面影响冲击。基金管理人将秉承勤勉尽责的态度，在审慎验证的基础上持续更新迭代投资模型，力争取得相对基准稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保中证 800 指数增强 A 基金份额净值为 1.0744 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.10%；截至本报告期末国寿安保中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 1.0722 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.99%；业绩比较基准收益率为 13.02%。

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	291,711,487.15	92.75
	其中：股票	291,711,487.15	92.75
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	13,000.17	0.00
	其中：债券	13,000.17	0.00
	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	22,277,427.61	7.08
8	其他资产	499,475.72	0.16
9	合计	314,501,390.65	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	241,732.00	0.08
B	采矿业	9,979,913.00	3.19
C	制造业	193,419,051.03	61.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,569,465.00	3.38
E	建筑业	3,990,104.00	1.28
F	批发和零售业	3,432,336.00	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	6,194,877.00	1.98
H	住宿和餐饮业	53,970.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,286,071.10	3.61
J	金融业	38,782,375.80	12.40
K	房地产业	1,304,234.00	0.42
L	租赁和商务服务业	1,927,768.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	3,960,518.00	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	851,940.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	94,864.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	73,644.00	0.02
S	综合	—	—
	合计	286,162,862.93	91.52

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	35,133.56	0.01

C	制造业	5,368,381.83	1.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	145,108.83	0.05
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	5,548,624.22	1.77

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	8,900	11,303,000.00	3.61
2	300750	宁德时代	20,900	8,213,909.00	2.63
3	300502	新易盛	13,160	7,988,120.00	2.55
4	600519	贵州茅台	5,050	5,986,724.50	1.91
5	002384	东山精密	20,400	5,351,940.00	1.71
6	600183	生益科技	29,000	5,028,600.00	1.61
7	300408	三环集团	30,100	5,023,690.00	1.61
8	688396	华润微	49,509	4,829,602.95	1.54
9	300604	长川科技	12,700	4,336,034.00	1.39
10	601899	紫金矿业	170,600	4,288,884.00	1.37

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	688525	佰维存储	3,000	1,484,190.00	0.47

2	688808	联讯仪器	605	1,327,519.65	0.42
3	600487	亨通光电	10,200	1,115,268.00	0.36
4	688392	骄成超声	2,198	499,341.64	0.16
5	301666	大普微	636	294,677.88	0.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	13,000.17	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,000.17	0.00

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111025	圣泉转债	130	13,000.17	0.00

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	499,475.72
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	499,475.72

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	294,677.88	0.09	新股流通受限
2	688808	联讯仪器	166,354.65	0.05	新股流通受限

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，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

项目	国寿安保中证 800 指数增强 A	国寿安保中证 800 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	312,166,954.91	99,384,828.84
报告期期间基金总申购份额	928,590.02	1,573,799.95
减：报告期期间基金总赎回份额	81,122,155.67	41,800,179.37
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	231,973,389.26	59,158,449.42

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本基金基金管理人本报告期末投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金交易本基金。

§ 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	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20260401~20260630	160,384,000.31	-	-	160,384,000.31	55.09
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。 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，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金募集的文件

9.1.2 《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》

9.1.3 《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司，地址：北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.gsfoods.com.cn

9.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日