

国联安沪深 300 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：国联安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了报告中的财务指标、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 日起至 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
§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国联安沪深 300 指数增强	
基金主代码	020220	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 23 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	382,504,724.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	020220	020221
报告期末下属分级基金的份额总额	302,748,056.25 份	79,756,667.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对沪深 300 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	本基金以沪深 300 指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。正常情况下，本基金力争控制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%。1、指数化投资策略本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数权重的偏离，控制跟踪误差，从而达成对标的指数的跟踪目标。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。2、指数增强策略本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，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	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	基金是股票指数增强型基金，其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。同时，本基金主要投资于标的指

	数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	-------------------------------

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		国联安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李露	方圆
	联系电话	021-38992888	95559
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200121	200336
法定代表人		于业明	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告置备地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国联安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

§ 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)	
	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	30,715,731.29	9,385,232.37
本期利润	44,363,092.05	12,212,237.31
加权平均基金份 额本期利润	0.2300	0.2055
本期加权平均净 值利润率	14.42%	12.98%
本期基金份额净	13.92%	13.81%

值增长率		
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	159,938,943.28	41,515,459.28
期末可供分配基金份额利润	0.5283	0.5205
期末基金资产净值	519,744,279.34	136,255,689.26
期末基金份额净值	1.7168	1.7084
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	71.68%	70.84%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）

国联安沪深 300 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	15.12%	1.18%	11.30%	1.19%	3.82%	-0.01%
过去六个月	13.92%	1.09%	7.20%	1.07%	6.72%	0.02%
过去一年	38.06%	0.99%	25.13%	0.97%	12.93%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起	71.68%	1.09%	51.71%	1.10%	19.97%	-0.01%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

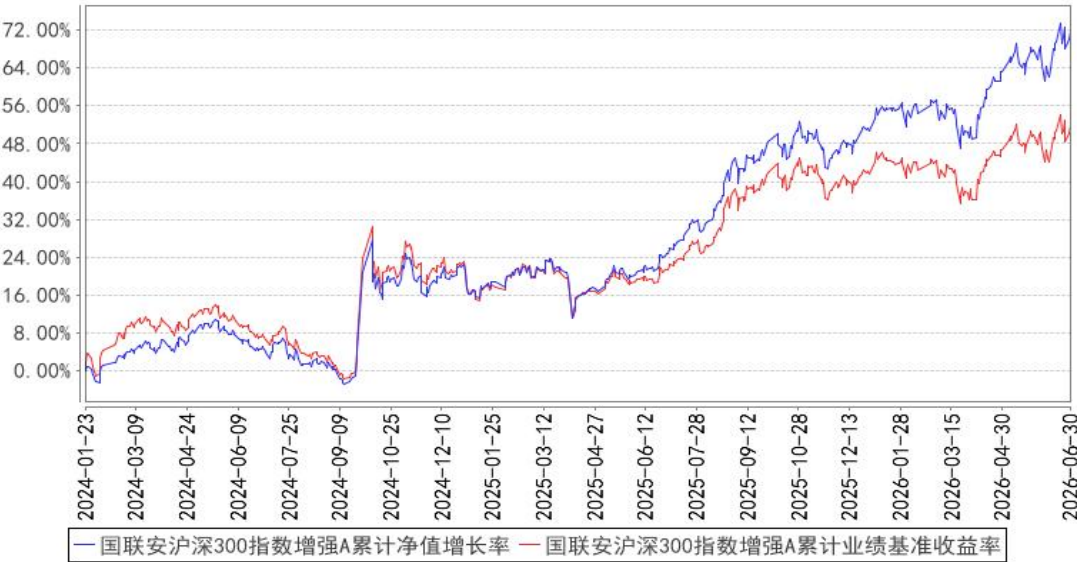
（报告期：2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）

国联安沪深 300 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	15.06%	1.18%	11.30%	1.19%	3.76%	-0.01%
过去六个月	13.81%	1.09%	7.20%	1.07%	6.61%	0.02%
过去一年	37.79%	0.99%	25.13%	0.97%	12.66%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	70.84%	1.09%	51.71%	1.10%	19.13%	-0.01%

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

国联安沪深300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

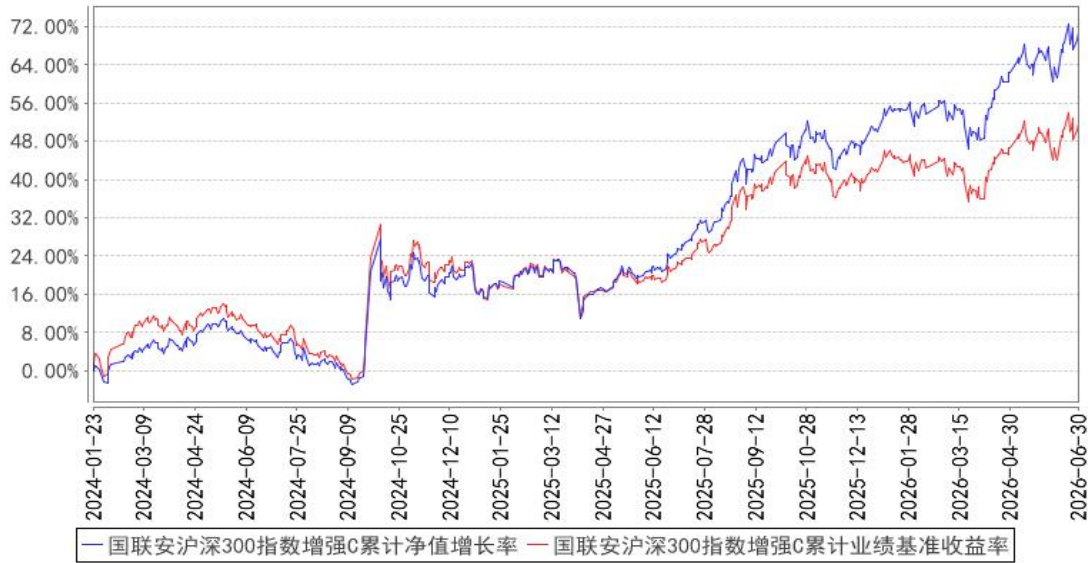


注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；

2、本基金基金合同于 2024 年 1 月 23 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，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

国联安沪深300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图



- 注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；
- 2、本基金基金合同于 2024 年 1 月 23 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，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

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

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		
章堪元	基金经理、量化投资部总经理	2024 年 1 月 23 日	—	18 年（自 2008 年起）	章堪元先生，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。
冯雪	基金经理	2025 年 7 月 30 日	-	4 年(自 2019 年	冯雪女士，硕士研究生。曾任中泰证券（上海）资产管理有限公司量化研究员，上海

				起)	艾方资产管理有限公司量化分析师。2023 年 7 月加入国联安基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2025 年 7 月起担任国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
章野	基金经理	2026 年 6 月 15 日	-	8 年(自 2018 年起)	章野先生，硕士研究生。2018 年 7 月加入国联安基金管理有限公司，历任风险控制助理、研究员、基金经理助理、基金经理。2024 年 9 月起担任国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理；2026 年 6 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。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
章楫元	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合规守信情况的说明

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》、《国联安沪深 300 指数增强型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 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

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

时执行交易系统中的公平交易模块；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 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

2026 年上半年 A 股呈现极致 K 型分化格局，一季度与二季度风格迥异，市场从价值防御主线彻底转向科技成长主线，行业与指数间收益差创近年新高。

一季度市场震荡蓄势，价值防御风格占优。主要宽基普遍收跌，上证指数跌 1.94%、沪深 300 跌 3.89%，科创 50 调整幅度达 6.54%；中证 500、红利指数逆势上涨，涨幅分别为 2.03%、6.68%。行业层面，煤炭、石油石化领涨全市场，公用事业、建材等周期防御板块同步走强；非银金融、商贸零售、消费板块跌幅居前，科技赛道冲高回落。核心驱动在于地缘扰动升温、市场避险情绪抬升，叠加商品价格上行支撑周期盈利，资金偏向高股息防御资产。

二季度成长主线全面爆发，科技赛道独领风骚。科创 50 单季大涨超 75%，创业板指上涨 36.4%，电子、通信行业涨幅均超 60%，AI 算力产业链贯穿全程，光模块、存储芯片、半导体设备等细分方向轮番领涨。与之相对，食品饮料、消费、传统周期板块持续承压，资金虹吸效应显著。支撑逻辑是 AI 产业景气度持续验证，一季报硬科技盈利超预期，市场风险偏好全面回升。

整体来看，上半年市场完成了从“防御价值”到“科技成长”的风格切换，结构性行情特征极端，赚钱效应高度集中，多数个股跑输指数，“赚指数不赚钱”现象突出。在投资管理上，我们坚持定量与定性相结合的价值投资理念，精选优质股票，努力获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，国联安沪深 300 指数增强 A 的份额净值为 1.7168 元，国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值为 1.7084 元。本报告期内，国联安沪深 300 指数增强 A 的份额净值增长率为 13.92%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值增长率为 13.81%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，A 股大概率延续结构性行情主基调，上半年的极致分化格局有望边际收敛，行情驱动力从估值扩张逐步转向业绩兑现，风格再平衡进程将逐步推进。科技成长仍是全年

配置主轴，但内部将加速分化。AI 产业长期趋势未改，算力硬件、先进封装、AI 应用等细分赛道仍有景气支撑，但经过上半年估值大幅抬升后，纯题材标的将面临回调压力，行情转向订单落地、盈利确定性强的龙头个股，沿产业链向机器人、商业航天、算力配套等衍生方向扩散。需警惕中报业绩不及预期、交易拥挤度高位带来的波动放大风险。低位板块有望迎来阶段性修复窗口。经过上半年持续回调，红利资产估值性价比凸显，随着中报业绩验证，现金流稳定、股息确定性强的公用事业、运营商等标的具备估值修复动力；消费、医药、高端制造等板块若出现盈利边际改善信号，也将迎来超跌反弹机会，市场风格将从极致单边走向相对均衡。我们将紧密跟踪市场动态，把握相关的投资机会，持续以定量与定性结合的价值投资理念，挖掘优质股票，力求为投资者创造丰厚回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值委员会，对估值业务总体负责。估值委员会由公司负责营运相关领导、运营部、权益投资部、现金管理部、固定收益部、专户投资部、交易部、量化投资部、研究部、监察稽核部和风险管理部部门负责人组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值委员会成员 1/2 以上多数票通过，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

无。

§ 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，基金托管人在国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，国联安基金管理有限公司国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：国联安沪深 300 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	66,325,441.25	22,009,113.22
结算备付金		1,065,097.98	1,040,626.15
存出保证金		3,882,628.80	—
交易性金融资产	6.4.7.2	586,034,937.53	331,346,074.46
其中：股票投资		586,034,937.53	331,346,074.46
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	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		1,113,098.33	1,691,347.69
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		658,421,203.89	356,087,161.52
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
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		1,956,376.78	3,472,989.32
应付管理人报酬		323,198.37	234,518.21
应付托管费		40,399.80	29,314.76
应付销售服务费		16,743.43	14,964.78
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	6.4.7.6	84,516.91	170,000.00
负债合计		2,421,235.29	3,921,787.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	382,504,724.03	233,921,230.62
未分配利润	6.4.7.8	273,495,244.57	118,244,143.83
净资产合计		655,999,968.60	352,165,374.45
负债和净资产总计		658,421,203.89	356,087,161.52

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 382,504,724.03 份，其中国联安沪深 300 指数增强 A 份额净值 1.7168 元，基金份额总额 302,748,056.25 份；国联安沪深 300 指数增强 C 份额净值 1.7084 元，基金份额总额 79,756,667.78 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安沪深 300 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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		58,539,257.10	8,422,621.09
1. 利息收入		24,035.04	35,000.04
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,035.04	35,000.04
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		42,030,447.23	10,523,726.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	37,887,426.39	8,252,151.02

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-348,964.26	-1,094,425.59
股利收益	6.4.7.13	4,491,985.10	3,366,001.43
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	6.4.7.14	16,474,365.70	-2,137,038.47
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.15	10,409.13	932.66
减：二、营业总支出		1,963,927.74	1,282,872.22
1. 管理人报酬		1,587,509.99	999,915.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		198,438.76	124,989.33
3. 销售服务费		93,276.43	73,664.88
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		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	84,702.56	84,302.56
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		56,575,329.36	7,139,748.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		56,575,329.36	7,139,748.87
五、其他综合收益的税后净 额		-	-
六、综合收益总额		56,575,329.36	7,139,748.87

6.3 净资产变动表

会计主体：国联安沪深 300 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	233,921,230.62	-	118,244,143.83	352,165,374.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	233,921,230.62	-	118,244,143.83	352,165,374.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	148,583,493.41	-	155,251,100.74	303,834,594.15
（一）、综合收益总额	-	-	56,575,329.36	56,575,329.36
（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）	148,583,493.41	-	98,675,771.38	247,259,264.79
其中：1. 基金申购款	261,792,877.79	-	165,519,707.97	427,312,585.76
2. 基金赎回款	-113,209,384.38	-	-66,843,936.59	-180,053,320.97
（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	382,504,724.03	-	273,495,244.57	655,999,968.60
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	204,008,084.89	-	42,086,298.21	246,094,383.10
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	204,008,084.89	-	42,086,298.21	246,094,383.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,424,187.72	-	7,734,252.60	9,158,440.32
(一)、综合收益总额	-	-	7,139,748.87	7,139,748.87
(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)	1,424,187.72	-	594,503.73	2,018,691.45
其中：1. 基金申购款	72,025,735.77	-	15,372,257.87	87,397,993.64
2. 基金赎回款	-70,601,548.05	-	-14,777,754.14	-85,379,302.19
(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	205,432,272.61	-	49,820,550.81	255,252,823.42

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：

唐华	蔡蓓蕾	仲晓峰
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

国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2023]2638 号《关于准予国联安沪深 300 指数增强型证券投

资基金注册的批复》准予注册，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 258,586,760.81 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0029 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 258,628,266.52 基金份额，其中认购资金利息折合 41,505.71 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指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)。本基金可以根据有关法律法规的规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。基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会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：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金中期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 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本报告期内本基金无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税 [2015] 101 号《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金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。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	14,298,042.95
等于：本金	14,297,535.63
加：应计利息	507.32
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—

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	52,027,398.30
等于：本金	52,026,973.71
加：应计利息	424.59
合计	66,325,441.25

注：本期末其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	538,522,579.09	-	586,034,937.53	47,512,358.44
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	538,522,579.09	-	586,034,937.53	47,512,358.44

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	32,309,078.82	-	-	-
其中：股指期货 投资	32,309,078.82	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	32,309,078.82	-	-	-
----	---------------	---	---	---

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2607	IF2607	16.00	23,625,600.00	6,381.18
IF2609	IF2609	6.00	8,729,640.00	39,780.00
合计				46,161.18
减：可抵销期货暂收款				46,161.18
净额				0.00

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.6 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	-
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	-
其他	214.35
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	84,516.91

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

国联安沪深 300 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	174,924,387.23	174,924,387.23
本期申购	184,930,283.74	184,930,283.74
本期赎回（以“-”号填列）	-57,106,614.72	-57,106,614.72
本期末	302,748,056.25	302,748,056.25

国联安沪深 300 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	58,996,843.39	58,996,843.39
本期申购	76,862,594.05	76,862,594.05
本期赎回（以“-”号填列）	-56,102,769.66	-56,102,769.66
本期末	79,756,667.78	79,756,667.78

注：此处申购含分红转投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

国联安沪深 300 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	64,470,365.37	24,209,669.76	88,680,035.13
本期期初	64,470,365.37	24,209,669.76	88,680,035.13
本期利润	30,715,731.29	13,647,360.76	44,363,092.05
本期基金份额交易产生的变动数	64,752,846.62	19,200,249.29	83,953,095.91
其中：基金申购款	90,317,125.19	27,567,178.09	117,884,303.28
基金赎回款	-25,564,278.57	-8,366,928.80	-33,931,207.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	159,938,943.28	57,057,279.81	216,996,223.09

国联安沪深 300 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	21,419,638.19	8,144,470.51	29,564,108.70
本期期初	21,419,638.19	8,144,470.51	29,564,108.70
本期利润	9,385,232.37	2,827,004.94	12,212,237.31
本期基金份额交易产生的变动数	10,710,588.72	4,012,086.75	14,722,675.47
其中：基金申购款	35,871,453.84	11,763,950.85	47,635,404.69
基金赎回款	-25,160,865.12	-7,751,864.10	-32,912,729.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,515,459.28	14,983,562.20	56,499,021.48

6.4.7.9 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	9,091.65
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	5,039.68
结算备付金利息收入	9,903.71
其他	—
合计	24,035.04

注：此处其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	591,304,011.10
减：卖出股票成本总额	552,768,417.27
减：交易费用	648,167.44
买卖股票差价收入	37,887,426.39

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内本基金无买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期内本基金无买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-348,964.26

6.4.7.13 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	4,491,985.10
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	4,491,985.10

6.4.7.14 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	16,428,204.52
——股票投资	16,428,204.52
——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	46,161.18
——权证投资	—
——期货投资	46,161.18
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	16,474,365.70

6.4.7.15 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	10,330.56
基金转换费收入	78.57
合计	10,409.13

6.4.7.16 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
其他费用	400.00
合计	84,702.56

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

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
国联安基金管理有限公司（“国联安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司（“太平洋资管”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,587,509.99	999,915.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	325,124.59	180,622.17
应支付基金管理人的净管理费	1,262,385.40	819,293.28

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{每日应计提的基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	198,438.76	124,989.33

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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		
	国联安沪深 300 指数 增强 A	国联安沪深 300 指数 增强 C	合计
	国联安基金管理有限公司	-	1.30
交通银行	-	652.97	652.97
合计	-	654.27	654.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安沪深 300 指数 增强 A	国联安沪深 300 指数 增强 C	合计
	国联安基金管理有限公司	-	1.07
交通银行	-	244.62	244.62
合计	-	245.69	245.69

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国联安基金管理有限公司，再由国联安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行转融通出借业务。

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

国联安沪深 300 指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

国联安沪深 300 指数增强 C

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

份额单位：份

国联安沪深 300 指数增强 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
太平洋资管	17,847,999.63	5.90	17,847,999.63	10.20

份额单位：份

国联安沪深 300 指数增强 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
-	-	-	-	-

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		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	14,298,042.95	9,091.65	24,482,381.24	4,579.09

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	163	8,681.38	9,574.62	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股待上市	10.11	10.11	5,887	59,517.57	59,517.57	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	13,737	138,881.07	138,881.07	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,429	11,174.78	29,637.46	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	131	2,407.78	2,198.18	-
001365	天海	2026 年 5 月	6 个月	新股	27.19	31.31	402	10,930.38	12,586.62	-

	电子	月 11 日		锁定						
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	291	8,840.58	11,346.09	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	2,271	22,982.52	62,974.83	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	532	24,514.56	246,491.56	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	109	6,322.00	12,225.44	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	318	22,151.88	50,899.08	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	79	6,192.02	9,619.83	-
301687	新广	2025 年 12	6 个月	新股	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-

	益	月 24 日		锁 定						
301696	三 瑞 智 能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振 石 股 份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新 股 锁 定	11.18	17.59	319	3,566.42	5,611.21	-
603284	林 平 发 展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新 股 锁 定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃 泰 克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新 股 锁 定	33.49	33.93	68	2,277.32	2,307.24	-
603352	至 信 股 份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新 股 锁 定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长 裕 集 团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新 股 锁 定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉 德 利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新 股 锁 定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红 板 科 技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新 股 锁 定	17.70	84.32	226	4,000.20	19,056.32	-
688635	长 进 光 子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新 股 锁 定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北 芯 生 命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新 股 锁 定	17.52	35.92	1,375	24,090.00	49,390.00	-
688759	必 贝	2025 年 10	9 个月	新 股	17.78	30.65	7,061	125,544.58	216,419.65	-

	特	月 21 日		锁 定						
688781	视 涯 科 技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新 股 锁 定	22.68	42.16	3,168	71,850.24	133,562.88	-
688783	西 安 奕 材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新 股 锁 定	8.62	57.42	13,640	117,576.80	783,208.80	-
688785	恒 运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新 股 锁 定	92.18	463.15	85	7,835.30	39,367.75	-
688790	昂 瑞 微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新 股 锁 定	83.06	126.45	927	76,996.62	117,219.15	-
688795	摩 尔 线 程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新 股 锁 定	114.28	676.94	1,132	129,364.96	766,296.08	-
688797	臻 宝 科 技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定	44.56	468.67	176	7,842.56	82,485.92	-
688802	沐 曦 股 份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新 股 锁 定	104.66	768.89	832	87,077.12	639,716.48	-
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新 股 锁 定	81.88	1,584.33	96	7,860.48	152,095.68	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新 股 锁 定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新 股 锁 定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易 思	2026 年 2	6 个月	新 股	55.95	57.10	139	7,777.05	7,936.90	-

	维	月 4 日		锁定						
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	988	9,356.36	69,298.32	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	533	10,489.44	75,414.17	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	800	615,748.00	703,624.00	-

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本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采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况

下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本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	66,325,441.25	-	-	-	-	-	66,325,441.25
结算备付金	1,065,097.98	-	-	-	-	-	1,065,097.98
存出保证金	3,882,628.80	-	-	-	-	-	3,882,628.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	586,034,937.53	586,034,937.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,113,098.33	1,113,098.33
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	71,273,168.03	-	-	-	-	587,148,035.86	658,421,203.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,956,376.78	1,956,376.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	323,198.37	323,198.37
应付托管费	-	-	-	-	-	40,399.80	40,399.80
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务	-	-	-	-	-	16,743.43	16,743.43

费							
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	84,516.91	84,516.91
负债总计	-	-	-	-	-	2,421,235.29	2,421,235.29
利率敏感度缺口	71,273,168.03	-	-	-	-	584,726,800.57	655,999,968.60
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	22,009,113.22	-	-	-	-	-	22,009,113.22
结算备付金	1,040,626.15	-	-	-	-	-	1,040,626.15
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	331,346,074.46	331,346,074.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,691,347.69	1,691,347.69
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,049,739.37	-	-	-	-	333,037,422.15	356,087,161.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,472,989.32	3,472,989.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	234,518.21	234,518.21
应付托管费	-	-	-	-	-	29,314.76	29,314.76
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,964.78	14,964.78
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,921,787.07	3,921,787.07
利率敏感度缺口	23,049,739.37	-	-	-	-	329,115,635.08	352,165,374.45

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的债券、同业存单和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，因而未进行敏感性分析（2025 年 12 月 31 日：同）。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本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进行风险度量，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	586,034,937.53	89.33	331,346,074.46	94.09
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	586,034,937.53	89.33	331,346,074.46	94.09

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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）
	业绩比较基准上升 5%	33,179,301.16	17,671,248.01
	业绩比较基准下降 5%	-33,179,301.16	-17,671,248.01

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	581,319,698.56	326,758,805.47

第二层次	902,022.64	2,775,545.00
第三层次	3,813,216.33	1,811,723.99
合计	586,034,937.53	331,346,074.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	586,034,937.53	89.01
	其中：股票	586,034,937.53	89.01
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	67,390,539.23	10.24

8	其他各项资产	4,995,727.13	0.76
9	合计	658,421,203.89	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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	90,974.00	0.01
B	采矿业	20,339,829.00	3.10
C	制造业	316,015,955.76	48.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,129,602.00	2.31
E	建筑业	4,823,329.00	0.74
F	批发和零售业	1,516,900.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	10,703,288.00	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,251,613.41	2.63
J	金融业	101,408,986.10	15.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,312,069.00	0.35
M	科学研究和技术服务业	8,678,347.00	1.32
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	498,270,893.27	75.96

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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	1,375,056.90	0.21
B	采矿业	1,410,611.46	0.22
C	制造业	64,055,141.32	9.76

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,836,905.64	0.28
E	建筑业	2,217,796.00	0.34
F	批发和零售业	3,016,593.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,348,177.46	0.21
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,662,046.00	0.86
J	金融业	3,284,376.00	0.50
K	房地产业	736,573.00	0.11
L	租赁和商务服务业	282,132.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	2,538,635.48	0.39
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	87,764,044.26	13.38

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.3 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。

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	300308	中际旭创	24,800	31,496,000.00	4.80
2	300750	宁德时代	60,500	23,777,105.00	3.62
3	300502	新易盛	27,460	16,668,220.00	2.54
4	600519	贵州茅台	12,200	14,462,978.00	2.20
5	603986	兆易创新	16,600	13,529,000.00	2.06
6	601318	中国平安	266,665	12,730,587.10	1.94
7	688256	寒武纪	6,903	11,014,081.65	1.68
8	601899	紫金矿业	427,800	10,754,892.00	1.64

9	000333	美的集团	130,000	9,818,900.00	1.50
10	002384	东山精密	35,400	9,287,190.00	1.42
11	600900	长江电力	336,200	8,899,214.00	1.36
12	603259	药明康德	69,700	8,678,347.00	1.32
13	600036	招商银行	241,200	8,562,600.00	1.31
14	600030	中信证券	283,100	8,133,463.00	1.24
15	688981	中芯国际	50,904	8,084,573.28	1.23
16	688008	澜起科技	25,500	7,902,450.00	1.20
17	688041	海光信息	20,246	7,497,093.80	1.14
18	002371	北方华创	8,235	7,284,351.60	1.11
19	600183	生益科技	42,000	7,282,800.00	1.11
20	300408	三环集团	41,700	6,959,730.00	1.06
21	002475	立讯精密	81,300	5,723,520.00	0.87
22	688012	中微公司	11,951	5,599,043.50	0.85
23	600150	中国船舶	159,987	5,405,960.73	0.82
24	600919	江苏银行	499,200	5,381,376.00	0.82
25	601138	工业富联	73,600	5,310,240.00	0.81
26	002463	沪电股份	32,600	4,981,280.00	0.76
27	600887	伊利股份	202,200	4,844,712.00	0.74
28	000338	潍柴动力	154,500	4,210,125.00	0.64
29	601398	工商银行	590,100	4,172,007.00	0.64
30	601688	华泰证券	202,300	4,171,426.00	0.64
31	600276	恒瑞医药	77,600	4,038,304.00	0.62
32	000725	京东方 A	456,400	3,961,552.00	0.60
33	600999	招商证券	186,900	3,943,590.00	0.60
34	601939	建设银行	397,800	3,830,814.00	0.58
35	000776	广发证券	161,700	3,783,780.00	0.58
36	601166	兴业银行	227,500	3,767,400.00	0.57
37	000938	紫光股份	125,100	3,610,386.00	0.55
38	600926	杭州银行	242,400	3,502,680.00	0.53
39	601009	南京银行	337,400	3,336,886.00	0.51
40	002415	海康威视	95,300	3,259,260.00	0.50
41	601995	中金公司	88,300	3,192,045.00	0.49
42	601872	招商轮船	177,800	3,123,946.00	0.48
43	601288	农业银行	497,400	3,019,218.00	0.46
44	300059	东方财富	146,300	2,981,594.00	0.45
45	300274	阳光电源	17,900	2,846,458.00	0.43
46	688111	金山办公	13,110	2,793,085.50	0.43
47	002460	赣锋锂业	42,700	2,792,580.00	0.43
48	000408	藏格矿业	37,800	2,620,296.00	0.40
49	000792	盐湖股份	86,200	2,602,378.00	0.40
50	002142	宁波银行	87,600	2,600,844.00	0.40
51	000001	平安银行	258,700	2,599,935.00	0.40

52	002493	荣盛石化	237,900	2,557,425.00	0.39
53	002594	比亚迪	31,800	2,534,460.00	0.39
54	601668	中国建筑	566,800	2,459,912.00	0.37
55	300394	天孚通信	7,980	2,415,386.40	0.37
56	002466	天齐锂业	39,300	2,409,876.00	0.37
57	300476	胜宏科技	6,800	2,355,724.00	0.36
58	300661	圣邦股份	15,600	2,238,288.00	0.34
59	601816	京沪高铁	489,700	2,218,341.00	0.34
60	601117	中国化学	300,700	2,210,145.00	0.34
61	000166	申万宏源	495,700	2,181,080.00	0.33
62	600346	恒力石化	119,800	2,121,658.00	0.32
63	688396	华润微	21,605	2,107,567.75	0.32
64	002916	深南电路	4,600	2,106,340.00	0.32
65	603799	华友钴业	43,600	2,104,136.00	0.32
66	300124	汇川技术	31,400	2,082,762.00	0.32
67	600309	万华化学	30,400	2,079,664.00	0.32
68	601088	中国神华	51,700	2,018,368.00	0.31
69	600000	XD 浦发银	222,500	1,915,725.00	0.29
70	601377	兴业证券	316,500	1,911,660.00	0.29
71	300014	亿纬锂能	28,700	1,866,361.00	0.28
72	002648	卫星化学	78,800	1,851,012.00	0.28
73	002001	新和成	65,000	1,847,300.00	0.28
74	000538	云南白药	38,100	1,804,797.00	0.28
75	600549	厦门钨业	21,000	1,789,200.00	0.27
76	002027	分众传媒	363,400	1,758,856.00	0.27
77	002236	大华股份	106,500	1,756,185.00	0.27
78	601916	浙商银行	665,200	1,749,476.00	0.27
79	000157	中联重科	250,800	1,748,076.00	0.27
80	600028	中国石化	386,700	1,724,682.00	0.26
81	002353	杰瑞股份	11,300	1,723,250.00	0.26
82	002422	科伦药业	44,600	1,717,992.00	0.26
83	601077	渝农商行	276,300	1,688,193.00	0.26
84	601766	中国中车	320,700	1,667,640.00	0.25
85	600026	中远海能	91,100	1,634,334.00	0.25
86	000807	云铝股份	73,400	1,625,076.00	0.25
87	600031	三一重工	92,700	1,601,856.00	0.24
88	601985	中国核电	176,100	1,590,183.00	0.24
89	601988	中国银行	277,800	1,589,016.00	0.24
90	600741	华域汽车	102,200	1,586,144.00	0.24
91	600011	华能国际	207,700	1,576,443.00	0.24
92	600066	宇通客车	58,400	1,565,704.00	0.24
93	601229	上海银行	179,600	1,558,928.00	0.24
94	600426	华鲁恒升	64,400	1,540,448.00	0.23

95	600875	东方电气	53,500	1,539,195.00	0.23
96	000895	双汇发展	68,000	1,523,200.00	0.23
97	300628	亿联网络	44,900	1,518,518.00	0.23
98	601607	上海医药	98,500	1,516,900.00	0.23
99	300033	同花顺	6,280	1,513,480.00	0.23
100	600938	中国海油	52,600	1,428,090.00	0.22
101	000425	徐工机械	176,000	1,423,840.00	0.22
102	000708	中信特钢	111,500	1,407,130.00	0.21
103	600690	海尔智家	67,900	1,385,839.00	0.21
104	600176	中国巨石	19,000	1,384,720.00	0.21
105	000975	山金国际	81,200	1,380,400.00	0.21
106	600893	航发动力	35,800	1,372,572.00	0.21
107	600027	华电国际	307,800	1,369,710.00	0.21
108	301308	江波龙	1,900	1,337,220.00	0.20
109	601658	邮储银行	270,900	1,335,537.00	0.20
110	000988	华工科技	7,200	1,329,192.00	0.20
111	600015	华夏银行	205,300	1,311,867.00	0.20
112	000063	中兴通讯	36,100	1,306,459.00	0.20
113	603993	洛阳钼业	74,000	1,298,700.00	0.20
114	600482	中国动力	39,100	1,282,480.00	0.20
115	603893	瑞芯微	6,800	1,280,848.00	0.20
116	000651	格力电器	33,900	1,271,250.00	0.19
117	601127	赛力斯	20,300	1,243,375.00	0.19
118	601628	中国人寿	34,800	1,230,180.00	0.19
119	002558	巨人网络	43,700	1,204,372.00	0.18
120	601689	拓普集团	21,100	1,190,462.00	0.18
121	601066	中信建投	40,600	1,180,242.00	0.18
122	600019	宝钢股份	210,900	1,145,187.00	0.17
123	688047	龙芯中科	7,200	1,113,624.00	0.17
124	000858	五粮液	14,500	1,073,000.00	0.16
125	600522	中天科技	17,500	1,061,900.00	0.16
126	600115	中国东航	278,300	1,060,323.00	0.16
127	601021	春秋航空	22,600	1,030,108.00	0.16
128	002532	天山铝业	95,500	1,024,715.00	0.16
129	605499	东鹏饮料	8,190	1,010,891.70	0.15
130	002311	海大集团	22,300	994,803.00	0.15
131	601881	中国银河	77,200	970,404.00	0.15
132	600809	山西汾酒	8,200	896,834.00	0.14
133	003816	中国广核	220,400	861,764.00	0.13
134	601111	中国国航	137,200	830,060.00	0.13
135	600018	上港集团	170,800	806,176.00	0.12
136	688521	芯原股份	2,159	801,291.26	0.12
137	600547	山东黄金	34,400	794,296.00	0.12

138	601901	方正证券	102,200	735,840.00	0.11
139	600584	长电科技	6,900	714,495.00	0.11
140	002602	世纪华通	50,500	712,050.00	0.11
141	603019	中科曙光	6,600	707,718.00	0.11
142	603288	海天味业	21,300	706,308.00	0.11
143	688072	拓荆科技	800	703,624.00	0.11
144	300760	迈瑞医疗	4,900	665,567.00	0.10
145	601888	中国中免	10,300	553,213.00	0.08
146	601225	陕西煤业	26,300	535,205.00	0.08
147	600111	北方稀土	11,100	533,355.00	0.08
148	600025	华能水电	51,400	456,946.00	0.07
149	600660	福耀玻璃	8,300	418,652.00	0.06
150	601336	新华保险	7,000	417,620.00	0.06
151	002028	思源电气	2,300	397,900.00	0.06
152	600089	特变电工	17,200	387,000.00	0.06
153	600886	国投电力	28,200	375,342.00	0.06
154	600941	中国移动	4,300	370,359.00	0.06
155	300999	金龙鱼	14,500	337,270.00	0.05
156	601998	中信银行	46,700	323,631.00	0.05
157	601857	中国石油	36,700	318,556.00	0.05
158	000100	TCL 科技	54,600	317,772.00	0.05
159	601058	赛轮轮胎	24,200	279,026.00	0.04
160	002230	科大讯飞	6,600	269,544.00	0.04
161	300433	蓝思科技	5,000	268,300.00	0.04
162	600196	复星医药	9,700	217,959.00	0.03
163	601600	中国铝业	25,100	206,322.00	0.03
164	600362	江西铜业	4,500	194,850.00	0.03
165	600039	四川路桥	19,600	153,272.00	0.02
166	002050	三花智控	2,400	105,192.00	0.02
167	002714	牧原股份	2,600	90,974.00	0.01
168	600406	国电南瑞	3,800	86,830.00	0.01
169	600489	中金黄金	4,800	86,640.00	0.01
170	000657	中钨高新	800	76,576.00	0.01
171	601319	中国人保	7,700	52,052.00	0.01
172	600016	民生银行	10,500	33,810.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301536	星宸科技	18,900	2,432,619.00	0.37
2	300613	富瀚微	30,000	2,402,400.00	0.37
3	601869	长飞光纤	4,300	2,347,370.00	0.36
4	600487	亨通光电	21,200	2,318,008.00	0.35
5	001309	德明利	2,400	2,262,960.00	0.34

6	601677	明泰铝业	120,700	2,003,620.00	0.31
7	688503	聚和材料	13,348	1,771,279.60	0.27
8	300857	协创数据	4,700	1,597,530.00	0.24
9	688002	睿创微纳	10,263	1,587,583.47	0.24
10	300861	美畅股份	63,000	1,586,970.00	0.24
11	688110	东芯股份	7,644	1,557,082.80	0.24
12	000951	中国重汽	79,100	1,543,241.00	0.24
13	603929	亚翔集成	5,400	1,468,908.00	0.22
14	001339	智微智能	14,320	1,464,649.60	0.22
15	002487	大金重工	24,500	1,420,265.00	0.22
16	002458	益生股份	176,970	1,375,056.90	0.21
17	002948	青岛银行	263,400	1,338,072.00	0.20
18	688802	沐曦股份	1,652	1,318,922.48	0.20
19	300953	震裕科技	9,800	1,310,260.00	0.20
20	601333	广深铁路	476,200	1,309,550.00	0.20
21	601997	贵阳银行	253,300	1,299,429.00	0.20
22	002245	蔚蓝锂芯	68,900	1,289,119.00	0.20
23	002299	圣农发展	83,900	1,271,924.00	0.19
24	600801	华新建材	80,900	1,262,040.00	0.19
25	002850	科达利	6,400	1,211,520.00	0.18
26	301371	敷尔佳	46,400	1,206,400.00	0.18
27	001286	陕西能源	115,500	1,171,170.00	0.18
28	601061	中信金属	108,400	1,167,468.00	0.18
29	000933	神火股份	50,500	1,070,600.00	0.16
30	300975	商络电子	19,500	1,009,125.00	0.15
31	300671	富满微	11,700	1,008,072.00	0.15
32	300373	扬杰科技	6,100	959,103.00	0.15
33	300863	卡倍亿	12,500	957,875.00	0.15
34	300759	康龙化成	31,700	917,081.00	0.14
35	002738	中矿资源	15,500	914,345.00	0.14
36	300223	北京君正	3,600	896,040.00	0.14
37	300323	华灿光电	43,100	879,240.00	0.13
38	002025	航天电器	11,500	876,530.00	0.13
39	300765	石药创新	32,000	871,360.00	0.13
40	300842	帝科股份	9,700	864,949.00	0.13
41	688388	嘉元科技	19,600	862,400.00	0.13
42	300475	香农芯创	2,800	840,000.00	0.13
43	002197	证通电子	145,500	835,170.00	0.13
44	600498	烽火通信	10,900	802,240.00	0.12
45	688551	科威尔	11,320	795,456.40	0.12
46	002851	麦格米特	4,700	785,746.00	0.12
47	688783	西安奕材	13,640	783,208.80	0.12
48	301087	可孚医疗	16,300	776,695.00	0.12

49	688795	摩尔线程	1,132	766,296.08	0.12
50	000090	天健集团	248,800	748,888.00	0.11
51	300715	凯伦股份	45,300	745,638.00	0.11
52	300769	德方纳米	11,200	744,800.00	0.11
53	603225	新凤鸣	37,300	732,945.00	0.11
54	603228	景旺电子	10,000	724,100.00	0.11
55	300564	筑博设计	59,500	714,595.00	0.11
56	300073	当升科技	13,800	662,952.00	0.10
57	002156	通富微电	8,700	660,069.00	0.10
58	002379	宏桥控股	44,000	649,880.00	0.10
59	688005	容百科技	21,200	648,720.00	0.10
60	600901	江苏金租	112,500	646,875.00	0.10
61	603920	世运电路	13,400	643,736.00	0.10
62	300919	中伟新材	14,400	630,000.00	0.10
63	300949	奥雅股份	30,750	620,227.50	0.09
64	300969	恒帅股份	6,600	618,816.00	0.09
65	300814	中富电路	3,000	613,500.00	0.09
66	300738	奥飞数据	29,300	592,446.00	0.09
67	300424	航新科技	35,500	558,770.00	0.09
68	600266	城建发展	129,900	507,909.00	0.08
69	000983	山西焦煤	83,600	484,880.00	0.07
70	601615	明阳智能	41,300	477,841.00	0.07
71	001289	龙源电力	29,900	467,337.00	0.07
72	002868	绿康生化	20,400	450,636.00	0.07
73	300933	中辰股份	73,700	448,096.00	0.07
74	301116	益客食品	52,100	445,976.00	0.07
75	688353	华盛锂电	3,800	441,066.00	0.07
76	603979	金诚信	7,200	425,016.00	0.06
77	301085	亚康股份	6,700	406,087.00	0.06
78	300681	英搏尔	13,900	397,818.00	0.06
79	000733	振华科技	6,900	390,816.00	0.06
80	002517	恺英网络	23,200	377,000.00	0.06
81	600871	石化油服	183,100	371,693.00	0.06
82	002737	葵花药业	29,300	328,453.00	0.05
83	000059	华锦股份	86,100	322,875.00	0.05
84	300395	菲利华	2,400	320,952.00	0.05
85	603683	晶华新材	10,200	314,364.00	0.05
86	300042	朗科科技	3,900	297,063.00	0.05
87	300844	山水比德	12,800	284,288.00	0.04
88	601828	美凯龙	138,300	282,132.00	0.04
89	300720	海川智能	2,900	278,980.00	0.04
90	600418	江淮汽车	10,000	258,300.00	0.04
91	301666	大普微	532	246,491.56	0.04

92	603317	天味食品	18,800	244,588.00	0.04
93	000619	海螺新材	49,900	219,560.00	0.03
94	688759	必贝特	7,061	216,419.65	0.03
95	601233	桐昆股份	9,500	205,675.00	0.03
96	002079	苏州固锔	13,500	202,905.00	0.03
97	001248	华润新能源	19,624	198,398.64	0.03
98	603868	飞科电器	5,800	178,640.00	0.03
99	600383	金地集团	82,600	174,286.00	0.03
100	600601	方正科技	12,500	173,000.00	0.03
101	688808	联讯仪器	96	152,095.68	0.02
102	603609	禾丰股份	26,100	150,336.00	0.02
103	688781	视涯科技	3,168	133,562.88	0.02
104	688790	昂瑞微	927	117,219.15	0.02
105	603305	旭升集团	9,200	111,504.00	0.02
106	601666	平煤股份	13,900	99,385.00	0.02
107	688813	泰金新能	465	88,779.06	0.01
108	688797	臻宝科技	176	82,485.92	0.01
109	001308	康冠科技	3,900	81,354.00	0.01
110	600740	山西焦化	24,300	77,517.00	0.01
111	688820	盛合晶微	533	75,414.17	0.01
112	000960	锡业股份	1,700	72,573.00	0.01
113	600316	洪都航空	2,500	69,850.00	0.01
114	688818	电科蓝天	988	69,298.32	0.01
115	001399	惠科股份	2,271	62,974.83	0.01
116	688809	强一股份	98	61,054.00	0.01
117	001212	中旗新材	1,200	56,856.00	0.01
118	601155	新城控股	5,300	54,378.00	0.01
119	301682	宏明电子	318	50,899.08	0.01
120	688712	北芯生命	1,375	49,390.00	0.01
121	300789	唐源电气	2,300	40,871.00	0.01
122	301498	乖宝宠物	1,000	40,590.00	0.01
123	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
124	688785	恒运昌	85	39,367.75	0.01
125	603885	吉祥航空	3,600	37,044.00	0.01
126	001257	盛龙股份	1,429	29,637.46	0.00
127	600630	龙头股份	2,900	28,246.00	0.00
128	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
129	603459	红板科技	226	19,056.32	0.00
130	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
131	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
132	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
133	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
134	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00

135	001365	天海电子	402	12,586.62	0.00
136	301680	固德电材	109	12,225.44	0.00
137	001393	维通利	291	11,346.09	0.00
138	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
139	301683	慧谷新材	79	9,619.83	0.00
140	001237	惠康科技	163	9,574.62	0.00
141	688816	易思维	139	7,936.90	0.00
142	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
143	001369	双欣材料	502	6,787.04	0.00
144	601112	振石股份	319	5,611.21	0.00
145	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
146	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
147	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
148	603293	埃泰克	68	2,307.24	0.00
149	001312	福恩股份	131	2,198.18	0.00
150	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
151	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
152	300932	三友联众	20	212.00	0.00

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	15,791,061.00	4.48
2	300750	宁德时代	14,392,631.00	4.09
3	600183	生益科技	9,011,383.00	2.56
4	300502	新易盛	8,556,024.00	2.43
5	002384	东山精密	8,354,382.35	2.37
6	603986	兆易创新	7,651,182.00	2.17
7	601318	中国平安	7,458,628.00	2.12
8	600150	中国船舶	7,347,157.76	2.09
9	688981	中芯国际	7,227,398.88	2.05
10	601899	紫金矿业	6,906,304.00	1.96
11	600519	贵州茅台	6,861,066.00	1.95
12	000725	京东方 A	6,826,482.00	1.94
13	600900	长江电力	6,464,672.00	1.84
14	000333	美的集团	6,448,701.00	1.83
15	688256	寒武纪	5,650,305.02	1.60
16	688008	澜起科技	5,246,918.14	1.49
17	600030	中信证券	5,183,271.00	1.47
18	601398	工商银行	5,122,133.00	1.45
19	688041	海光信息	5,055,134.70	1.44
20	600887	伊利股份	4,900,455.00	1.39

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	600183	生益科技	6,537,432.32	1.86
2	300750	宁德时代	5,328,868.00	1.51
3	000725	京东方 A	5,142,431.00	1.46
4	601398	工商银行	5,075,827.00	1.44
5	300502	新易盛	4,768,005.00	1.35
6	601857	中国石油	4,729,360.00	1.34
7	300014	亿纬锂能	4,479,765.00	1.27
8	603993	洛阳钼业	4,357,655.00	1.24
9	603986	兆易创新	4,341,505.00	1.23
10	002916	深南电路	4,287,658.68	1.22
11	300308	中际旭创	4,269,403.00	1.21
12	600989	宝丰能源	4,040,729.00	1.15
13	600000	XD 浦发银	3,849,388.28	1.09
14	000338	潍柴动力	3,626,879.00	1.03
15	601088	中国神华	3,602,057.00	1.02
16	601816	京沪高铁	3,404,108.00	0.97
17	000792	盐湖股份	3,354,964.00	0.95
18	601166	兴业银行	3,335,269.00	0.95
19	300033	同花顺	3,266,578.00	0.93
20	601600	中国铝业	3,244,357.00	0.92

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	791,029,075.82
卖出股票收入（成交）总额	591,304,011.10

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的股指期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.11.2 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。

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，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。

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	3,882,628.80
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,113,098.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,995,727.13

7.12.4 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。

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

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的情况。

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

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。

§ 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（%）
国联安沪深 300 指数增强 A	5,854	51,716.44	256,227,003.95	84.63	46,521,052.30	15.37
国联安沪深 300 指数增强 C	12,396	6,434.06	43,672,816.80	54.76	36,083,850.98	45.24
合计	18,250	20,959.16	299,899,820.75	78.40	82,604,903.28	21.60

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安沪深 300 指数增强 A	144,703.72	0.05
	国联安沪深 300 指数增强 C	6,582.91	0.01
	合计	151,286.63	0.04

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	国联安沪深 300 指数增强 A	10~50
	国联安沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安沪深 300 指数增强 A	0
	国联安沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0

注：截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2024 年 1 月 23 日) 基金份额总额	124,092,565.57	134,535,700.95
本报告期期初基金份 额总额	174,924,387.23	58,996,843.39
本报告期基金总申购 份额	184,930,283.74	76,862,594.05
减：本报告期基金总 赎回份额	57,106,614.72	56,102,769.66
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	302,748,056.25	79,756,667.78

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§ 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

- 1、本报告期内，李华先生离任基金管理人督察长，唐华先生代任；李露女士任职基金管理人督察长，唐华先生不再代任；黄峰先生任职、离任基金管理人首席信息官；王宏超先生任职基金管理人首席信息官。
- 2、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

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

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

管理人受调查或处罚等情况-	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 4 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令整改
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、公司治理、其他问题（权限管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	本报告期内，管理人已从完善制度流程、优化管理机制、强化监督检查等方面完成整改，整改成果已经中国证券监督管理委员会上海监管局验收通过。
其他	无

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，未发生基金管理人相关从业人员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，基金托管人未有受调查和处罚的情况发生。

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，未发生基金托管人相关从业人员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 (%)	
西南证券股份有限公司	2	1,380,375,977.15	100.00	264,007.47	100.00	-

注：

一、选择证券经营机构参与证券交易的标准

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券经营机构参与证券交易。具体标准如下：

- （一）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- （二）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （三）经营行为稳健、规范；
- （四）合规风控能力强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具有完善的合规风控机制，能满足基金运作高度保密要求；
- （五）不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- （六）交易服务能力较强，具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；
- （七）研究能力较强，能及时、全面地向基金管理人提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据基金管理人所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；
- （八）能协助基金管理人拓展资产管理业务和能力，促进基金管理人业务发展等。

二、选择证券经营机构参与证券交易的程序

基金管理人根据上述标准测试并考察后，确定拟合作证券经营机构，并与其签订证券经纪服务协议。若证券经营机构不再符合上述标准的，经与基金托管人协商后，基金管理人可与其中止合作。

三、报告期内使用证券经营机构交易单元的变更情况

本报告期内使用证券经营机构交易单元情况无变化。

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(%)
西南证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
------------	--	--	--	--	--	--

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	国联安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	规定报刊、规定网站	2026 年 1 月 7 日
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 1 月 22 日
3	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026 年 1 月 22 日
4	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金增加招商证券为销售机构的公告	规定报刊、规定网站	2026 年 1 月 30 日
5	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026 年 2 月 27 日
6	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2026 年 3 月 2 日
7	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2026 年 3 月 28 日
8	国联安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）	规定网站	2026 年 3 月 31 日
9	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 3 月 31 日
10	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026 年 3 月 31 日
11	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 4 月 22 日
12	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026 年 4 月 22 日
13	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加证达通基金为销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 4 月 27 日
14	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026 年 4 月 30 日
15	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026 年 5 月 15 日
16	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026 年 5 月 15 日
17	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书更新(2026 年第 1 号)	规定网站	2026 年 5 月 15 日

18	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金增加华夏财富为销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 5 月 29 日
19	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信嘉利基金为销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 6 月 10 日
20	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	规定网站、规定报刊	2026 年 6 月 16 日
21	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 6 月 16 日
22	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026 年 6 月 22 日
23	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026 年 6 月 22 日
24	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026 年 6 月 22 日
25	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书更新(2026 年第 2 号)	规定网站	2026 年 6 月 22 日
26	国联安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销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 6 月 26 日
27	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金增加山西证券为销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 6 月 29 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

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	2026 年 6 月 25 日至 2026 年 6 月 30 日	0.00	89,448,206.20	0.00	89,448,206.20	23.38
产品特有风险							
(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。							

(2) 基金净值大幅波动的风险

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。

(3) 基金规模较小导致的风险

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安沪深 300 指数增强型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

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日