

国联安上证科创板综合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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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	51
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 备查文件目录	58
11.1 备查文件目录	58
11.2 存放地点	59
11.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	国联安上证科创板综合指数增强	
基金主代码	024025	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 29 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	210,159,858.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	国联安上证科创板综合指数增强 A	国联安上证科创板综合指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	024025	024026
报告期末下属分级 基金的份额总额	130,830,270.93 份	79,329,587.86 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	本基金以上证科创板综合指数为标的指数，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 8.00%。 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，从而达到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	上证科创板综合指数收益率×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，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。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。本基金可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。
--------	--

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李露	汪小敏
	联系电话	021-38992888	021-31888888
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95528
传真		021-50151582	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200121	200126
法定代表人		于业明	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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)	
	国联安上证科创板综合指数增强 A	国联安上证科创板综合指数增强 C
本期已实现收益	14,966,774.69	19,620,065.32
本期利润	35,594,632.01	37,188,170.69

加权平均基金份额本期利润	0.8426	0.5832
本期加权平均净值利润率	71.53%	49.82%
本期基金份额净值增长率	57.08%	56.77%
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	43,554,923.29	26,049,497.63
期末可供分配基金份额利润	0.3329	0.3284
期末基金资产净值	210,580,052.80	127,255,436.98
期末基金份额净值	1.6096	1.6041
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	60.96%	60.41%

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）

国联安上证科创板综合指数增强 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	57.19%	2.24%	52.44%	2.24%	4.75%	0.00%
过去六个月	57.08%	2.03%	50.92%	2.11%	6.16%	-0.08%
过去一年	-	-	-	-	-	-

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	60.96%	1.69%	52.73%	1.95%	8.23%	-0.26%

(报告期：2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)

国联安上证科创板综合指数增强 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	57.03%	2.23%	52.44%	2.24%	4.59%	-0.01%
过去六个月	56.77%	2.03%	50.92%	2.11%	5.85%	-0.08%
过去一年	-	-	-	-	-	-
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	60.41%	1.69%	52.73%	1.95%	7.68%	-0.26%

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

国联安上证科创板综合指数增强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上证科创板综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；
2、本基金基金合同于 2025 年 8 月 29 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；

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。

国联安上证科创板综合指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金业绩比较基准为上证科创板综合指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%；
2、本基金基金合同于 2025 年 8 月 29 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；
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		
章樾元	基金经	2025 年 8	-	18 年	章樾元先生，硕士研究生。曾任建信基金

	理、量化 投资部总 经理	月 29 日		(自 2008 年 起)	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。
冯浩	基金经理	2025 年 8 月 29 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。
何贤发	基金经 理、主动 量化部总 经理	2025 年 9 月 4 日	-	3 年(自 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。
吴怀琛	基金经 理助 理	2025 年 8 月 28 日	-	1 年(自 2025 年起)	-

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》、《国联安上证科创板综合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

回顾 2026 年上半年，A 股市场整体 K 型分化的格局呈现愈演愈烈的趋势。以通信、电子为代表的科技赛道持续吸引增量资金入市，在算力供给短缺、硬件价格上涨，叠加市场流动性充裕，风险偏好提升的大背景下一路闯关，科技代表指数科创综指上半年录得收益超过 50%。中东军事行动从时间维度看仅短暂影响了科技牛行情，进入二季度后，科技股开启了长达三个月的全球跨市场主升浪。反观前些年被存量资金追捧的红利赛道，则因成长属性弱、内需不景气等多方面原因被严重吸筹，代表指数中证红利上半年仍为负收益，拆分行业看，仅煤炭、建材存在微弱的正收益贡献，诸如银行、交运、有色金属、石油石化、钢铁等重要红利类赛道，上半年均为负贡献。截至 6 月 30 日，成长风格相较红利风格近一年的超额收益达到历史新高，呈现极端的两极分化态势。

2026 年上半年，科创指增同类产品普遍较难获取超额收益，业绩中位数跑输基准——尤其在二季度高波动上行 beta 的环境下，如何稳定做出超额是量化策略的普遍难题。针对这一环境，本基金沿用了“多策略选股、多工具增强、动态紧风控”的策略框架，重点发挥科创综指增强策略

的两个核心价值：

一是分散参与科技板块内部高景气轮动。本基金以科创板综合指数为基准，通过中长周期基本面量化选股模型广泛纳入符合条件的科创板成分股及同行业非科创板优质基本面个股，避免对少数“潜在赢家”的集中押注，在紧密跟踪指数的同时广泛参与各科技细分赛道下更具竞争力企业的基本面成长

二是在波动中做超额收益增厚。针对科创板块高波动上行的特征，本基金通过短周期量价选股模型、自上而下动态配置模型、衍生品策略等，在市场急剧波动期进行下行保护与收益增强。具体到本期操作：3 月中东冲突期间科创综指出现约 16% 回撤，本基金通过多策略体系与衍生品工具的下行保护，超额净值在市场急剧波动中保持稳健上行；4 月后市场上行期间，策略组合通过长周期基本面叠加短周期量价模型，实现较好的向上锐度。

2026 年上半年，本基金 A 份额净值增长率为 57.08%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%，实现超额收益 6.16%；超额波动与超额回撤均控制在同类策略较低水平，体现了策略的稳健增强效应。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，国联安上证科创板综合指数增强 A 的份额净值为 1.6096 元，国联安上证科创板综合指数增强 C 的份额净值为 1.6041 元。本报告期内，国联安上证科创板综合指数增强 A 的份额净值增长率为 57.08%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；国联安上证科创板综合指数增强 C 的份额净值增长率为 56.77%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后续市场，投研团队认为，科技主升浪或将面临短期扰动和分歧：一方面，AI 引发的技术变革与生产力提升是真实的，这一共识在全球范围内加速形成；但另一方面“趋势确定”并不等于“路径确定”，更不等于“赢家可判”——技术路线、商业模式、企业份额都存在不确定性，短期关注度过高往往导致价格抢跑、透支未来回报。多类参与者在同一赛道博弈叠加 AI 行情的全球共振特征，也使得市场的脆弱性显著提升。我们还应看到，资金扎堆科技板块背后的深层次原因，是低利率环境下投资者对优质稀缺资产的诉求有增无减，权益市场在中国企业的全球竞争力持续提升的大环境下仍然是投资者财富增长的相对最优解。

作为本基金的管理人，国联安主动量化投研团队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，力争为持有人创造长期的正向绝对收益，和持续稳健的超额收益。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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本托管人复核的本报告中的财务指标、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：国联安上证科创板综合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	37,346,800.02	17,860,548.22
结算备付金		9,775,136.83	13,381,226.24
存出保证金		1,094,081.39	11,726.53
交易性金融资产	6.4.7.2	309,602,121.79	241,357,963.05
其中：股票投资		309,602,121.79	241,357,963.05
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	350,290.00	175,200.00
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	12,375,123.49
应收股利		-	-
应收申购款		23,481,473.52	93,093.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		381,649,903.55	285,254,880.74
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	431,960.00	3,075.00
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		20,145,302.45	-
应付赎回款		22,912,737.09	23,337,839.93
应付管理人报酬		93,151.59	201,165.73
应付托管费		11,643.95	25,145.70
应付销售服务费		25,967.33	44,651.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	64,218.81
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	193,651.36	282,163.71
负债合计		43,814,413.77	23,958,260.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	210,159,858.79	255,164,533.95
未分配利润	6.4.7.8	127,675,630.99	6,132,086.20
净资产合计		337,835,489.78	261,296,620.15
负债和净资产总计		381,649,903.55	285,254,880.74

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 210,159,858.79 份，其中国联安上证科创板综合指数增强 A 份额净值 1.6096 元，基金份额总额 130,830,270.93 份；国联安上证科创板综合指数增强 C 份额净值 1.6041 元，基金份额总额 79,329,587.86 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		73,584,831.81
1. 利息收入		47,680.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	47,680.43
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）		35,308,700.24
其中：股票投资收益	6.4.7.10	35,301,004.91
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	-172,154.73
股利收益	6.4.7.13	179,850.06
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	38,195,962.69
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	32,488.45
减：二、营业总支出		802,029.11

1. 管理人报酬		502,342.19
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费		62,792.83
3. 销售服务费		150,113.64
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	86,780.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		72,782,802.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		72,782,802.70
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		72,782,802.70

注：本基金基金合同于 2025 年 8 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国联安上证科创板综合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	255,164,533.95	-	6,132,086.20	261,296,620.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	255,164,533.95	-	6,132,086.20	261,296,620.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,004,675.16	-	121,543,544.79	76,538,869.63
（一）、综合收益总额	-	-	72,782,802.70	72,782,802.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-45,004,675.16	-	48,760,742.09	3,756,066.93

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	275,224,434.79	-	102,263,416.52	377,487,851.31
2. 基金赎回款	-320,229,109.95	-	-53,502,674.43	-373,731,784.38
(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	210,159,858.79	-	127,675,630.99	337,835,489.78

注：本基金基金合同于 2025 年 8 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>唐华</u>	<u>蔡蓓蕾</u>	<u>仲晓峰</u>
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

国联安上证科创板综合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[2025]709 号《关于准予国联安上证科创板综合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《国联安上证科创板综合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 433,518,745.35 元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2500546 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 433,612,042.47 基金份额，其中认购资金利息折合 93,297.12 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》和《国联安上证科创板综合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（含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、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（含可分离交易可转换债券）、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（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、股票期权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：本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 80%，其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%，投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）的资产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、股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。本基金标的指数为上证科创板综合指数。本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金

业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日至 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本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	37,346,800.02
等于：本金	37,342,938.39
加：应计利息	3,861.63
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	37,346,800.02

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		268,017,535.87	-	309,602,121.79	41,584,585.92
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		268,017,535.87	-	309,602,121.79	41,584,585.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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	31,700,000.00	350,290.00	431,960.00	-
其中：期权投资	31,700,000.00	350,290.00	431,960.00	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	31,700,000.00	350,290.00	431,960.00	-

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	106,870.91
其中：交易所市场	106,870.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	27,273.08
预提信息披露费	59,507.37
合计	193,651.36

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

国联安上证科创板综合指数增强 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	141,737,368.29	141,737,368.29
本期申购	141,206,906.31	141,206,906.31
本期赎回（以“-”号填列）	-152,114,003.67	-152,114,003.67
本期末	130,830,270.93	130,830,270.93

国联安上证科创板综合指数增强 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	113,427,165.66	113,427,165.66
本期申购	134,017,528.48	134,017,528.48
本期赎回（以“-”号填列）	-168,115,106.28	-168,115,106.28
本期末	79,329,587.86	79,329,587.86

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

国联安上证科创板综合指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,498,089.00	997,125.95	3,495,214.95
本期期初	2,498,089.00	997,125.95	3,495,214.95
本期利润	14,966,774.69	20,627,857.32	35,594,632.01
本期基金份额交易产生的变动数	26,090,059.60	14,569,875.31	40,659,934.91

其中：基金申购款	42,090,800.32	22,954,723.93	65,045,524.25
基金赎回款	-16,000,740.72	-8,384,848.62	-24,385,589.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,554,923.29	36,194,858.58	79,749,781.87

国联安上证科创板综合指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,840,507.17	796,364.08	2,636,871.25
本期期初	1,840,507.17	796,364.08	2,636,871.25
本期利润	19,620,065.32	17,568,105.37	37,188,170.69
本期基金份额交易产生的变动数	4,588,925.14	3,511,882.04	8,100,807.18
其中：基金申购款	27,377,726.47	9,840,165.80	37,217,892.27
基金赎回款	-22,788,801.33	-6,328,283.76	-29,117,085.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,049,497.63	21,876,351.49	47,925,849.12

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	22,803.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	24,873.35
其他	3.48
合计	47,680.43

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

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	456,370,665.84
减：卖出股票成本总额	420,606,501.56
减：交易费用	463,159.37
买卖股票差价收入	35,301,004.91

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	-440,625.83
期权投资收益	268,471.10

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	179,850.06
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	179,850.06

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	38,121,277.51
——股票投资	38,121,277.51
——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	74,685.18
——权证投资	-
——期权投资	74,685.18
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	38,195,962.69

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	32,488.14
基金转换费收入	0.31
合计	32,488.45

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	86,780.45

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的股票交易。本基金基金合同于 2025 年 08

月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的债券交易。本基金基金合同于 2025 年 08 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。本基金基金合同于 2025 年 08 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的权证交易。本基金基金合同于 2025 年 08 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内本基金未有应支付关联方的佣金。 本基金基金合同于 2025 年 08 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	502,342.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	244,624.98
应支付基金管理人的净管理费	257,717.21

注：1、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。计算公式为：

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

2、本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	62,792.83

注：1、支付基金托管人浦发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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

2、本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

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		
	国联安上证科创板综合指数增强 A	国联安上证科创板综合指数增强 C	合计
国联安基金管理有限公司	—	50.24	50.24
浦发银行	—	118,806.92	118,806.92
合计	—	118,857.16	118,857.16

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.40%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：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.40%/当年天数。

2、本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

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

本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

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，本基金未与关联方进行转融通出借业务。本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

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

国联安上证科创板综合指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2025 年 8 月 29 日）持有的基金份额	—
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	-

国联安上证科创板综合指数增强 C

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金合同生效日（ 2025 年 8 月 29 日）持有的基金份额	-
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

国联安上证科创板综合指数增强 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（%）
-	-	-	-	-

份额单位：份

国联安上证科创板综合指数增强 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	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	37, 346, 800. 02	22, 803. 60

注：1、本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计

息。本基金通过“上海浦东发展银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2026 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 403,684.89 元。

2、本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据

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，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。本基金于 2025 年 08 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	134	1,498.12	2,357.06	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	29	1,098.52	1,011.23	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	17	569.33	576.81	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	85	1,859.80	2,169.20	-
603407	长	2026	6 个月	新股	13.86	73.46	59	817.74	4,334.14	-

	裕集团	年 4 月 29 日		锁定						
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	40	630.40	1,868.40	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	58	1,026.60	4,890.56	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	86	1,506.72	3,089.12	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	39	3,595.02	18,062.85	-
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	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	768.89	766	80,169.56	588,969.74	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	24	1,965.12	38,023.92	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	291	1,865.31	7,021.83	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	71	1,865.88	12,218.39	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	66	3,692.70	3,768.60	-
688820	盛	2026	6 个月	新股	19.68	141.49	130	2,558.40	18,393.70	-

	合晶微	年 4 月 13 日		锁定						
--	-----	------------	--	----	--	--	--	--	--	--

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	6,249	3,577,611.84	5,496,182.97	-

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 2026 年 06 月 30 日止，本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 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	37,346,800.02	-	-	-	-	-	37,346,800.02
结算备付金	9,775,136.83	-	-	-	-	-	9,775,136.83
存出保证金	1,094,081.39	-	-	-	-	-	1,094,081.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	309,602,121.79	309,602,121.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-	350,290.00	350,290.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	23,481,473.52	23,481,473.52
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	48,216,018.24	-	-	-	-	333,433,885.31	381,649,903.55
负债							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	431,960.00	431,960.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	22,912,737.09	22,912,737.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	93,151.59	93,151.59
应付托管费	-	-	-	-	-	11,643.95	11,643.95
应付清算款	-	-	-	-	-	20,145,302.45	20,145,302.45
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	25,967.33	25,967.33
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-	-	-193,651.36	193,651.36
负债总计	-	-	-	-	-	43,814,413.77	43,814,413.77
利率敏感度缺口	48,216,018.24	-	-	-	-	289,619,471.54	337,835,489.78
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	17,860,548.22	-	-	-	-	-	17,860,548.22
结算备付金	13,381,226.24	-	-	-	-	-	13,381,226.24
存出保证金	11,726.53	-	-	-	-	-	11,726.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	241,357,963.05	241,357,963.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-	175,200.00	175,200.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	93,093.21	93,093.21
应收清算款	-	-	-	-	-	12,375,123.49	12,375,123.49
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,253,500.99	-	-	-	-	254,001,379.75	285,254,880.74
负债							
衍生金融负债	-	-	-	-	-	3,075.00	3,075.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	23,337,839.93	23,337,839.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	201,165.73	201,165.73
应付托管费	-	-	-	-	-	25,145.70	25,145.70
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	44,651.71	44,651.71
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	64,218.81	64,218.81
其他负债	-	-	-	-	-	282,163.71	282,163.71

负债总计	-	-	-	-	-	23,958,260.59	23,958,260.59
利率敏感度缺口	31,253,500.99	-	-	-	-	230,043,119.16	261,296,620.15

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。本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 80%，其中港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%，投资于标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）的资产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、股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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	309,602,121.79	91.64	241,357,963.05	92.37
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	-81,670.00	-0.02	—	—
合计	309,520,451.79	91.62	241,357,963.05	92.37

注：1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2、其他包含除权证投资外的权益衍生金融工具，按抵销后的净额列示。

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%	16,131,294.98	6,728,085.54
	业绩比较基准下降5%	-16,131,294.98	-6,728,085.54

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 第三层次输入值：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	302,983,177.19	235,509,649.15
第二层次	5,496,182.97	4,943,050.00
第三层次	1,473,051.63	905,263.90
合计	309,952,411.79	241,357,963.05

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股票和可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	309,602,121.79	81.12
	其中：股票	309,602,121.79	81.12
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	350,290.00	0.09

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	47,121,936.85	12.35
8	其他各项资产	24,575,554.91	6.44
9	合计	381,649,903.55	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	208,239,296.91	61.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,151,088.26	14.55
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	3,732,459.47	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	715,901.94	0.21
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	261,838,746.58	77.50

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	40,901,490.81	12.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	107,395.00	0.03
F	批发和零售业	2,521,892.00	0.75
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	1,990,844.00	0.59
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	1,923,019.40	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	170,432.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	148,302.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,763,375.21	14.14

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	688256	寒武纪	13,135	20,957,549.25	6.20
2	688041	海光信息	48,441	17,937,702.30	5.31
3	688012	中微公司	19,149	8,971,306.50	2.66
4	688498	源杰科技	3,568	6,729,248.00	1.99
5	688981	中芯国际	41,397	6,574,671.54	1.95
6	688795	摩尔线程	8,844	6,291,866.96	1.86

7	688802	沐曦股份	7,500	6,166,741.94	1.83
8	688008	澜起科技	19,569	6,064,433.10	1.80
9	688072	拓荆科技	6,249	5,496,182.97	1.63
10	688525	佰维存储	10,830	5,357,925.90	1.59
11	688521	芯原股份	10,784	4,002,373.76	1.18
12	688396	华润微	40,451	3,945,995.05	1.17
13	688766	普冉股份	4,983	3,819,967.80	1.13
14	688702	盛科通信	8,295	3,234,967.05	0.96
15	688110	东芯股份	15,370	3,130,869.00	0.93
16	688082	盛美上海	7,218	3,118,176.00	0.92
17	688120	华海清科	9,664	3,113,547.52	0.92
18	688347	华虹宏力	8,013	2,694,771.90	0.80
19	688630	芯碁微装	4,888	2,685,418.32	0.79
20	688146	中船特气	7,669	2,684,073.31	0.79
21	688629	华丰科技	13,995	2,624,202.45	0.78
22	688002	睿创微纳	16,307	2,522,529.83	0.75
23	688220	翱捷科技	19,187	2,385,327.84	0.71
24	688172	燕东微	28,383	2,374,521.78	0.70
25	688536	思瑞浦	6,360	2,315,612.40	0.69
26	688183	生益电子	16,752	2,217,964.80	0.66
27	688200	华峰测控	4,127	2,167,087.70	0.64
28	688025	杰普特	4,596	2,160,120.00	0.64
29	688676	金盘科技	24,343	2,060,391.52	0.61
30	688531	日联科技	10,547	1,875,678.48	0.56
31	688097	博众精工	29,692	1,872,080.60	0.55
32	688266	泽璟制药	16,003	1,866,909.98	0.55
33	688343	云天励飞	22,745	1,857,356.70	0.55
34	688249	晶合集成	31,242	1,844,215.26	0.55
35	688019	安集科技	5,329	1,808,982.34	0.54
36	688111	金山办公	8,363	1,781,737.15	0.53
37	688559	海目星	20,789	1,744,612.88	0.52
38	688361	中科飞测	4,019	1,728,170.00	0.51
39	688107	安路科技	37,387	1,704,847.20	0.50
40	688469	芯联集成	157,846	1,674,746.06	0.50
41	688777	中控技术	14,222	1,671,085.00	0.49
42	688686	奥普特	9,833	1,655,778.87	0.49
43	688599	天合光能	117,257	1,655,668.84	0.49
44	688515	裕太微	6,643	1,652,512.68	0.49
45	688390	固德威	14,231	1,544,205.81	0.46
46	688313	仕佳光子	8,113	1,498,065.45	0.44
47	688271	联影医疗	14,654	1,483,424.42	0.44
48	688717	艾罗能源	17,642	1,456,699.94	0.43
49	688114	华大智造	28,462	1,453,838.96	0.43

50	688005	容百科技	46,762	1,430,917.20	0.42
51	688353	华盛锂电	12,088	1,403,054.16	0.42
52	688126	沪硅产业	35,049	1,398,104.61	0.41
53	688017	绿的谐波	3,172	1,325,451.92	0.39
54	688506	百利天恒	4,466	1,313,137.98	0.39
55	688141	杰华特	8,380	1,286,330.00	0.38
56	688585	上纬新材	7,540	1,250,132.00	0.37
57	688063	派能科技	23,263	1,239,220.01	0.37
58	688047	龙芯中科	7,526	1,164,046.42	0.34
59	688187	时代电气	16,740	1,149,368.40	0.34
60	688188	柏楚电子	10,766	1,148,732.20	0.34
61	688387	信科移动	57,874	1,148,220.16	0.34
62	688319	欧林生物	24,138	1,061,589.24	0.31
63	688375	国博电子	9,914	1,034,030.20	0.31
64	688127	蓝特光学	10,298	1,005,084.80	0.30
65	688300	联瑞新材	4,010	980,044.00	0.29
66	688416	恒烁股份	6,935	970,900.00	0.29
67	688378	奥来德	15,611	967,882.00	0.29
68	688275	万润新能	7,541	961,854.55	0.28
69	688090	瑞松科技	8,964	954,217.80	0.28
70	688322	奥比中光	7,155	934,085.25	0.28
71	688239	航宇科技	14,967	895,475.61	0.27
72	688112	鼎阳科技	11,792	866,240.32	0.26
73	688663	新风光	9,733	860,981.18	0.25
74	688202	美迪西	10,634	858,270.14	0.25
75	688222	成都先导	26,703	857,433.33	0.25
76	688628	优利德	8,598	850,686.12	0.25
77	688411	海博思创	2,895	843,024.00	0.25
78	688150	莱特光电	12,229	839,153.98	0.25
79	688305	科德数控	12,701	828,994.27	0.25
80	688027	国盾量子	1,621	817,000.21	0.24
81	688668	鼎通科技	2,160	806,328.00	0.24
82	688719	爱科赛博	10,430	803,110.00	0.24
83	688226	威腾电气	18,678	799,978.74	0.24
84	688223	晶科能源	163,230	775,342.50	0.23
85	688578	艾力斯	7,085	773,682.00	0.23
86	688368	晶丰明源	3,560	770,811.20	0.23
87	688099	晶晨股份	7,489	770,618.10	0.23
88	688388	嘉元科技	17,298	761,112.00	0.23
89	688016	心脉医疗	8,565	759,201.60	0.22
90	688213	思特威	7,000	749,490.00	0.22
91	688036	传音控股	12,551	739,881.45	0.22
92	688449	联芸科技	8,545	737,518.95	0.22

93	688584	上海合晶	20,514	737,478.30	0.22
94	688095	福昕软件	12,312	731,702.16	0.22
95	688331	荣昌生物	5,568	725,287.68	0.21
96	688052	纳芯微	2,457	708,377.67	0.21
97	688409	富创精密	2,272	695,800.00	0.21
98	688800	瑞可达	7,217	692,615.49	0.21
99	688603	天承科技	3,213	668,143.35	0.20
100	688385	复旦微电	8,933	636,833.57	0.19
101	688519	南亚新材	1,629	619,085.16	0.18
102	688257	新锐股份	6,001	611,501.90	0.18
103	688362	甬矽电子	6,260	603,464.00	0.18
104	688195	腾景科技	3,079	592,953.82	0.18
105	688255	凯尔达	21,271	591,333.80	0.18
106	688472	阿特斯	53,622	580,190.04	0.17
107	688001	华兴源创	6,620	567,334.00	0.17
108	688373	盟科药业	122,854	556,528.62	0.16
109	688248	南网科技	8,030	555,515.40	0.16
110	688009	中国通号	114,192	543,553.92	0.16
111	688303	大全能源	30,359	529,157.37	0.16
112	688359	三孚新科	2,655	526,858.20	0.16
113	688037	芯源微	1,144	502,273.20	0.15
114	688301	奕瑞科技	4,003	496,372.00	0.15
115	688433	华曙高科	5,636	482,441.60	0.14
116	688372	伟测科技	2,584	480,624.00	0.14
117	688065	凯赛生物	9,955	476,346.75	0.14
118	688538	和辉光电	180,831	470,160.60	0.14
119	688568	中科星图	10,579	438,711.13	0.13
120	688757	胜科纳米	6,555	437,218.50	0.13
121	688205	德科立	2,076	432,202.44	0.13
122	688048	长光华芯	808	405,616.00	0.12
123	688586	江航装备	34,651	405,070.19	0.12
124	688035	德邦科技	4,293	394,097.40	0.12
125	688720	艾森股份	3,791	382,891.00	0.11
126	688235	百济神州	1,503	382,678.83	0.11
127	688328	深科达	3,922	375,335.40	0.11
128	688503	聚和材料	2,826	375,010.20	0.11
129	688400	凌云光	5,586	369,793.20	0.11
130	688775	影石创新	2,656	368,254.40	0.11
131	688028	沃尔德	2,347	365,826.89	0.11
132	688323	瑞华泰	6,472	365,668.00	0.11
133	688617	惠泰医疗	2,013	365,480.28	0.11
134	688234	天岳先进	2,073	359,686.23	0.11
135	688605	先锋精科	3,292	342,433.84	0.10

136	688778	厦钨新能	6,292	342,284.80	0.10
137	688692	达梦数据	1,363	332,967.27	0.10
138	688625	呈和科技	3,905	329,621.05	0.10
139	688484	南芯科技	5,749	324,761.01	0.10
140	688333	铂力特	3,152	322,764.80	0.10
141	688152	麒麟信安	11,472	315,250.56	0.09
142	688169	石头科技	3,179	301,909.63	0.09
143	688162	巨一科技	12,561	296,942.04	0.09
144	688700	东威科技	3,309	295,824.60	0.09
145	688180	君实生物	8,745	295,755.90	0.09
146	688115	思林杰	3,562	292,974.50	0.09
147	688059	华锐精密	1,456	290,777.76	0.09
148	688279	峰岷科技	1,294	290,425.36	0.09
149	688721	龙图光罩	4,906	286,412.28	0.08
150	688318	财富趋势	3,988	284,384.28	0.08
151	688069	德林海	7,605	284,122.80	0.08
152	688089	嘉必优	26,663	282,894.43	0.08
153	688383	新益昌	1,428	268,521.12	0.08
154	688309	恒誉环保	4,317	262,818.96	0.08
155	688349	三一重能	17,275	262,234.50	0.08
156	688175	高凌信息	10,005	251,625.75	0.07
157	688511	天微电子	8,321	251,377.41	0.07
158	688522	纳睿雷达	12,466	249,569.32	0.07
159	689009	九号公司	6,523	248,852.45	0.07
160	688011	新光光电	3,544	247,619.28	0.07
161	688215	瑞晟智能	5,780	232,124.80	0.07
162	688261	东微半导	2,159	226,543.87	0.07
163	688772	珠海冠宇	11,537	226,471.31	0.07
164	688247	宣泰医药	29,726	223,539.52	0.07
165	688209	英集芯	7,568	220,077.44	0.07
166	688691	灿芯股份	1,883	218,296.19	0.06
167	688615	合合信息	1,887	213,419.70	0.06
168	688819	天能股份	9,539	211,765.80	0.06
169	688563	航材股份	4,132	211,682.36	0.06
170	688325	赛微微电	1,607	209,568.87	0.06
171	688084	晶品特装	4,104	206,349.12	0.06
172	688156	路德科技	6,818	206,244.50	0.06
173	688285	高铁电气	28,335	203,161.95	0.06
174	688079	美迪凯	6,581	202,365.75	0.06
175	688137	近岸蛋白	5,581	200,916.00	0.06
176	688006	杭可科技	5,349	195,505.95	0.06
177	688551	科威尔	2,780	195,350.60	0.06
178	688616	西力科技	19,249	194,414.90	0.06

179	688468	科美诊断	33,610	191,240.90	0.06
180	688523	航天环宇	3,621	189,740.40	0.06
181	688456	有研粉材	1,357	189,437.20	0.06
182	688393	安必平	10,594	188,361.32	0.06
183	688131	皓元医药	1,963	185,699.80	0.05
184	688708	佳驰科技	3,533	179,476.40	0.05
185	688337	普源精电	2,368	177,434.24	0.05
186	688258	卓易信息	1,495	177,217.30	0.05
187	688701	卓锦股份	23,263	175,170.39	0.05
188	688369	致远互联	8,307	174,530.07	0.05
189	688262	国芯科技	3,915	169,245.45	0.05
190	688230	芯导科技	2,102	165,658.62	0.05
191	688135	利扬芯片	3,913	164,659.04	0.05
192	688601	力芯微	2,489	150,708.95	0.04
193	688049	炬芯科技	3,204	150,299.64	0.04
194	688075	安旭生物	5,034	149,811.84	0.04
195	688045	必易微	1,808	146,050.24	0.04
196	688173	希荻微	7,578	145,042.92	0.04
197	688192	迪哲医药	3,628	144,866.04	0.04
198	688693	锆威特	1,385	143,970.75	0.04
199	688627	精智达	200	143,000.00	0.04
200	688425	铁建重工	35,025	140,800.50	0.04
201	688281	华秦科技	2,742	137,730.66	0.04
202	688690	纳微科技	3,109	137,106.90	0.04
203	688147	微导纳米	838	135,655.44	0.04
204	688516	奥特维	2,358	135,325.62	0.04
205	688216	气派科技	3,210	134,852.10	0.04
206	688125	安达智能	817	133,579.50	0.04
207	688486	龙迅股份	2,047	130,148.26	0.04
208	688153	唯捷创芯	3,951	126,906.12	0.04
209	688312	燕麦科技	1,494	125,481.06	0.04
210	688010	福光股份	2,527	122,888.01	0.04
211	688620	安凯微	7,550	122,310.00	0.04
212	688655	迅捷兴	2,182	116,867.92	0.03
213	688595	芯海科技	2,638	115,702.68	0.03
214	688512	慧智微	7,204	115,047.88	0.03
215	688252	天德钰	4,777	114,648.00	0.03
216	688231	隆达股份	3,033	111,402.09	0.03
217	688191	智洋创新	3,071	109,634.70	0.03
218	688208	道通科技	4,280	107,813.20	0.03
219	688182	灿勤科技	2,497	107,545.79	0.03
220	688458	美芯晟	2,424	101,226.24	0.03
221	688556	高测股份	7,521	99,878.88	0.03

222	688259	创耀科技	2,553	99,873.36	0.03
223	688520	神州细胞	2,914	99,687.94	0.03
224	688479	友车科技	2,609	99,063.73	0.03
225	688229	博睿数据	1,267	97,178.90	0.03
226	688611	杭州柯林	1,354	96,743.30	0.03
227	688618	三旺通信	3,079	94,740.83	0.03
228	688233	神工股份	412	88,341.04	0.03
229	688619	罗普特	5,437	88,242.51	0.03
230	688570	天玛智控	6,126	87,172.98	0.03
231	688710	益诺思	1,211	81,379.20	0.02
232	688316	青云科技	1,506	81,324.00	0.02
233	688779	五矿新能	9,998	81,083.78	0.02
234	688561	奇安信	3,323	79,685.54	0.02
235	688518	联赢激光	2,515	77,713.50	0.02
236	688158	优刻得	2,114	77,710.64	0.02
237	688155	先惠技术	945	76,441.05	0.02
238	688105	诺唯赞	4,346	75,403.10	0.02
239	688589	力合微	3,243	74,524.14	0.02
240	688118	普元信息	3,535	71,124.20	0.02
241	688166	博瑞医药	2,029	71,035.29	0.02
242	688218	江苏北人	1,285	70,623.60	0.02
243	688548	广钢气体	1,342	69,918.20	0.02
244	688573	信宇人	3,816	67,619.52	0.02
245	688058	宝兰德	3,064	64,098.88	0.02
246	688448	磁谷科技	1,006	63,941.36	0.02
247	688170	德龙激光	655	62,886.55	0.02
248	688683	莱尔科技	1,613	61,164.96	0.02
249	688061	灿瑞科技	1,139	56,574.13	0.02
250	688623	双元科技	549	55,152.54	0.02
251	688418	震有科技	1,102	52,984.16	0.02
252	688697	纽威数控	3,852	52,348.68	0.02
253	688480	赛恩斯	575	50,364.25	0.01
254	688786	悦安新材	1,018	46,909.44	0.01
255	688787	海天瑞声	340	45,713.00	0.01
256	688499	利元亨	867	45,560.85	0.01
257	688733	壹石通	1,094	45,236.90	0.01
258	688428	诺诚健华	1,586	45,153.42	0.01
259	688088	虹软科技	1,263	44,899.65	0.01
260	688758	赛分科技	2,010	44,240.10	0.01
261	688350	富淼科技	1,078	37,223.34	0.01
262	688379	华光新材	429	36,048.87	0.01
263	688607	康众医疗	693	35,343.00	0.01
264	688161	威高骨科	1,654	34,700.92	0.01

265	688363	华熙生物	969	34,661.13	0.01
266	688277	天智航	1,946	33,276.60	0.01
267	688351	微电生理	1,468	33,264.88	0.01
268	688600	皖仪科技	986	32,814.08	0.01
269	688510	航亚科技	1,366	32,620.08	0.01
270	688750	金天钛业	1,942	32,295.46	0.01
271	688739	成大生物	1,598	31,145.02	0.01
272	688108	赛诺医疗	1,463	27,109.39	0.01
273	688181	八亿时空	398	24,914.80	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	000062	深圳华强	40,600	1,291,892.00	0.38
2	300814	中富电路	6,300	1,288,350.00	0.38
3	301536	星辰科技	10,000	1,287,100.00	0.38
4	300308	中际旭创	1,000	1,270,000.00	0.38
5	300458	全志科技	32,060	1,265,087.60	0.37
6	002384	东山精密	4,800	1,259,280.00	0.37
7	300613	富瀚微	15,600	1,249,248.00	0.37
8	601138	工业富联	17,300	1,248,195.00	0.37
9	002636	金安国纪	10,400	1,247,688.00	0.37
10	300607	拓斯达	30,200	1,245,146.00	0.37
11	300223	北京君正	5,000	1,244,500.00	0.37
12	300475	香农芯创	4,100	1,230,000.00	0.36
13	002185	华天科技	55,000	1,227,050.00	0.36
14	600183	生益科技	7,000	1,213,800.00	0.36
15	600522	中天科技	19,900	1,207,532.00	0.36
16	301308	江波龙	1,700	1,196,460.00	0.35
17	002008	大族激光	7,900	1,185,869.00	0.35
18	300438	鹏辉能源	14,300	1,184,755.00	0.35
19	301071	力量钻石	12,700	1,174,750.00	0.35
20	301377	鼎泰高科	2,100	1,156,890.00	0.34
21	603986	兆易创新	1,400	1,141,000.00	0.34
22	603256	宏和科技	4,300	1,140,919.00	0.34
23	001309	德明利	1,200	1,131,480.00	0.33
24	300363	博腾股份	68,900	1,118,936.00	0.33
25	002064	华峰化学	112,100	1,063,829.00	0.31
26	603225	新凤鸣	41,100	807,615.00	0.24
27	605117	德业股份	7,500	796,350.00	0.24
28	300127	银河磁体	23,900	668,005.00	0.20
29	002931	锋龙股份	9,500	655,310.00	0.19
30	002134	天津普林	21,200	644,904.00	0.19
31	300769	德方纳米	9,600	638,400.00	0.19

32	002810	山东赫达	25,300	624,910.00	0.18
33	301087	可孚医疗	12,900	614,685.00	0.18
34	301176	逸豪新材	9,000	612,000.00	0.18
35	600267	海正药业	59,500	601,545.00	0.18
36	600487	亨通光电	5,500	601,370.00	0.18
37	300201	海伦哲	28,500	600,495.00	0.18
38	688796	百奥赛图	5,456	596,886.40	0.18
39	300404	博济医药	66,900	586,044.00	0.17
40	301248	杰创智能	6,400	537,152.00	0.16
41	002901	大博医疗	12,800	534,784.00	0.16
42	300679	电连技术	8,600	515,914.00	0.15
43	300424	航新科技	28,700	451,738.00	0.13
44	600315	上海家化	24,600	413,772.00	0.12
45	002511	中顺洁柔	46,900	311,885.00	0.09
46	601798	蓝科高新	40,000	289,600.00	0.09
47	301196	唯科科技	2,000	250,840.00	0.07
48	300817	双飞集团	15,900	248,040.00	0.07
49	002399	海普瑞	27,400	246,052.00	0.07
50	603273	天元智能	18,800	243,460.00	0.07
51	300374	中铁装配	19,900	200,393.00	0.06
52	301318	维海德	9,500	193,800.00	0.06
53	603811	诚意药业	24,520	184,390.40	0.05
54	300948	冠中生态	6,400	170,432.00	0.05
55	301616	浙江华业	4,800	160,896.00	0.05
56	300778	新城市	16,200	154,710.00	0.05
57	300949	奥雅股份	7,600	153,292.00	0.05
58	300977	深圳瑞捷	9,900	152,658.00	0.05
59	300784	利安科技	3,600	152,532.00	0.05
60	301022	海泰科	6,700	151,152.00	0.04
61	301097	天益医疗	4,200	149,940.00	0.04
62	301103	何氏眼科	9,900	148,302.00	0.04
63	301577	美信科技	1,900	147,326.00	0.04
64	300169	天晟新材	29,500	147,205.00	0.04
65	300886	华业香料	7,300	145,270.00	0.04
66	300412	迦南科技	31,600	144,096.00	0.04
67	300753	爱朋医疗	7,500	141,975.00	0.04
68	300675	建科院	11,900	141,015.00	0.04
69	300451	创业慧康	42,500	136,000.00	0.04
70	301539	宏鑫科技	10,300	134,930.00	0.04
71	300069	金利华电	4,000	127,320.00	0.04
72	002703	浙江世宝	8,200	116,686.00	0.03
73	605303	园林股份	4,700	107,395.00	0.03
74	000813	德展健康	32,500	98,475.00	0.03

75	002045	国光电器	12,200	95,770.00	0.03
76	301225	恒勃股份	1,200	94,548.00	0.03
77	600055	万东医疗	9,000	91,980.00	0.03
78	301505	苏州规划	5,400	86,940.00	0.03
79	300953	震裕科技	600	80,220.00	0.02
80	603012	创力集团	9,200	75,440.00	0.02
81	300271	华宇软件	14,200	68,444.00	0.02
82	301317	鑫磊股份	1,000	56,120.00	0.02
83	000710	贝瑞基因	6,900	51,474.00	0.02
84	688808	联讯仪器	24	38,023.92	0.01
85	002900	哈三联	2,500	22,950.00	0.01
86	688820	盛合晶微	130	18,393.70	0.01
87	688785	恒运昌	39	18,062.85	0.01
88	688813	泰金新能	71	12,218.39	0.00
89	688811	有研复材	291	7,021.83	0.00
90	603459	红板科技	58	4,890.56	0.00
91	603407	长裕集团	59	4,334.14	0.00
92	688816	易思维	66	3,768.60	0.00
93	688712	北芯生命	86	3,089.12	0.00
94	601112	振石股份	134	2,357.06	0.00
95	603352	至信股份	85	2,169.20	0.00
96	603435	嘉德利	40	1,868.40	0.00
97	603284	林平发展	29	1,011.23	0.00
98	603293	埃泰克	17	576.81	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	688256	寒武纪	13,761,422.74	5.27
2	688041	海光信息	12,490,122.01	4.78
3	688498	源杰科技	7,172,665.13	2.75
4	688795	摩尔线程	6,254,531.62	2.39
5	688802	沐曦股份	5,861,962.43	2.24
6	688012	中微公司	5,571,499.24	2.13
7	688525	佰维存储	4,722,925.94	1.81
8	688008	澜起科技	4,708,610.05	1.80
9	688981	中芯国际	4,673,840.60	1.79
10	688396	华润微	3,335,403.11	1.28
11	688766	普冉股份	3,250,745.79	1.24
12	688146	中船特气	3,200,376.60	1.22
13	688515	裕太微	3,183,475.77	1.22
14	688072	拓荆科技	3,108,947.57	1.19
15	688001	华兴源创	3,067,340.10	1.17

16	688599	天合光能	3,018,137.54	1.16
17	688676	金盘科技	2,924,378.21	1.12
18	688082	盛美上海	2,915,057.58	1.12
19	688295	中复神鹰	2,887,017.17	1.10
20	688521	芯原股份	2,849,461.69	1.09

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	688256	寒武纪	12,707,092.42	4.86
2	688041	海光信息	12,705,464.47	4.86
3	688981	中芯国际	5,885,134.14	2.25
4	688012	中微公司	5,531,162.34	2.12
5	688111	金山办公	4,965,913.69	1.90
6	688008	澜起科技	4,114,087.72	1.57
7	688072	拓荆科技	3,848,481.38	1.47
8	688295	中复神鹰	3,804,995.24	1.46
9	688188	柏楚电子	3,525,404.97	1.35
10	688002	睿创微纳	3,467,279.70	1.33
11	688271	联影医疗	3,418,496.53	1.31
12	688183	生益电子	3,367,351.89	1.29
13	688700	东威科技	3,333,061.55	1.28
14	688779	五矿新能	3,259,745.87	1.25
15	688498	源杰科技	3,196,914.88	1.22
16	688001	华兴源创	3,121,395.77	1.19
17	688249	晶合集成	3,116,701.16	1.19
18	688409	富创精密	2,963,590.04	1.13
19	688506	百利天恒	2,937,223.30	1.12
20	688301	奕瑞科技	2,890,612.72	1.11

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	450,729,382.79
卖出股票收入（成交）总额	456,370,665.84

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。

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	1,094,081.39
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,481,473.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,575,554.91

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	5,496,182.97	1.63	重大事项停牌
2	688795	摩尔线程	766,296.08	0.23	新股锁定
3	688802	沐曦股份	588,969.74	0.17	新股锁定

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（%）
国联安上证科创板综合指数增强 A	693	188,788.27	33,002,023.49	25.23	97,828,247.44	74.77
国联安上证科创板综合指数增强 C	2,657	29,856.83	—	—	79,329,587.86	100.00
合计	3,350	62,734.29	33,002,023.49	15.70	177,157,835.30	84.30

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	国联安上证科创板综合指数增强 A	116,314.56	0.09
	国联安上证科创板综合指数增强 C	10.00	0.00
	合计	116,324.56	0.06

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、	国联安上证科创板综合指数	0

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	增强 A	
	国联安上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安上证科创板综合指数增强 A	0
	国联安上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；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	国联安上证科创板综合指数增强 A	国联安上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日 （2025 年 8 月 29 日） 基金份额总额	221,998,139.18	211,613,903.29
本报告期期初基金份额总额	141,737,368.29	113,427,165.66
本报告期基金总申购份额	141,206,906.31	134,017,528.48
减：本报告期基金总赎回份额	152,114,003.67	168,115,106.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	130,830,270.93	79,329,587.86

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

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，基金托管人相关从业人员未有受调查和处罚的情况发生。

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(%)	
国泰海通证券股份有限公司	2	150,240,016.03	16.57	28,566.36	16.15	-
华源证券股份有限公司	1	756,616,826.58	83.43	148,263.34	83.85	-
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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对拟合作证券经营机构开展尽职调查、建立证券经营机构白名单。基金管理人与白名单内的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人定期对合作证券经营机构开展服务评价，根据各证券经营机构的研究能力和质量、投资研究服务水平、上市公司交流机会和投资研讨会质量等进行评比排名，并

对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。

基金管理人定期评估、维护证券经营机构白名单。如评估发现合作证券经营机构不再符合上述标准的，基金管理人将其从证券经营机构白名单中删除。若证券经营机构所提供的服务不符合要求的，基金管理人可提前中止租用其交易单元。

三、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内租用证券公司交易单元无变更。

四、由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

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(%)
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	国联安上证科创板综合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
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
4	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
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	规定报刊、规定网站	2026 年 3 月 28 日
6	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
7	国联安上证科创板综合指数增强型证	规定网站	2026 年 3 月 31 日

	券投资基金 2025 年年度报告		
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关于旗下部分基金增加东莞证券为销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 4 月 13 日
10	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
11	国联安上证科创板综合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
12	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
13	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
14	国联安上证科创板综合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
15	国联安上证科创板综合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
16	国联安上证科创板综合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
17	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
18	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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安上证科创板综合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
- 7、中国证监会要求的其他文件

11.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

11.3 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