# 国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

# §1 重要提示

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

基金托管人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 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 364,138,070.48 份 |
| 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%。<br>1、指数化投资策略<br>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<br>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。 | |
| 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 | |
| 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 | 217,373,316.15 份 | 146,764,754.33 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 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 |
| 1.本期已实现收益 | -26,529,197.42 | -17,121,039.30 |
| 2.本期利润 | -76,645,155.52 | -48,710,421.00 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.3962 | -0.3830 |
| 4.期末基金资产净值 | 252,525,429.38 | 169,754,657.58 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1617 | 1.1566 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费

等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

（报告期：2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）

国联安上证科创板综合指数增强 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -27.83% | 3.06% | -26.67% | 2.96% | -1.16% | 0.10% |
| 过去六个月 | 13.45% | 2.75% | 11.78% | 2.69% | 1.67% | 0.06% |
| 过去一年 | 13.10% | 2.22% | 5.79% | 2.28% | 7.31% | -0.06% |
| 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 | 16.17% | 2.13% | 12.00% | 2.26% | 4.17% | -0.13% |

（报告期：2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）

国联安上证科创板综合指数增强 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -27.90% | 3.06% | -26.67% | 2.96% | -1.23% | 0.10% |
| 过去六个月 | 13.23% | 2.75% | 11.78% | 2.69% | 1.45% | 0.06% |
| 过去一年 | 12.65% | 2.22% | 5.79% | 2.28% | 6.86% | -0.06% |
| 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 | 15.66% | 2.13% | 12.00% | 2.26% | 3.66% | -0.13% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**国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；

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；

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

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 冯浩 | 基金经理 | 2025 年 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。 |
| 章椹元 | 基金经理、量化投资部总经理 | 2025 年 8 月 29 日 | 2026 年 9 月 11 日 | 18 年（自 2008 年起） | 章椹元先生，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 月至 2026 年 9 月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 月至 2026 年 7 月兼任国联安中证 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 月至 2026 年 9 月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；2026 年 9 月起兼任国联安中证科创创业人工智能交易型开放式指数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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，A 股市场由二季度中后期的大幅放量，极度分化的行情，走向了深度调整、缩量出清，再到阶段修复、震荡博弈的市场格局。本季度，上证指数下跌 6.15%，科创综指下跌 27.97%，对应中证红利上涨 9.38%。回望二季度末，市场尚处于“产业景气驱动、成长资产极致拥挤”的周期高点，成交量屡创历史新高；仅一个季度便切换为“流动性退潮，存量博弈”的低波状态，转变速度之快较为罕见。

具体来看，7 月，AI 算力产业链估值处于历史极高点，在美联储加息预期的冲击下遭遇全球性的“泡沫挤出”：韩国 KOSPI 指数单日下跌超 10%，A 股科技板块在交易拥挤度接近极值后快速瓦解，科创综指单月下跌 28%；另一端，前期回撤较大的红利类指数则承接了部分流出资金，录得显著正收益。8 月，随着“提升资本市场韧性和信心”的指导定调，叠加中报密集披露，以创新药为代表的低位成长赛道，和部分高景气的硬科技赛道快速反弹；但月末海外巨额算力融资计划再度引发“AI 债务化”担忧，长久期美债收益率创 2007 年以来新高，叠加 8 月 29 日 Jackson Hole 年会的偏鹰派表态，科技板块于 8 月末 9 月初二次探底，分歧加深，波动放大。9 月，市场剧烈震荡：上旬风险资产承压于多重利空；中旬加息确认后阶段性利空出尽，迎来反弹窗口；下旬再

度受到 AI 治理、美债长端利率攀升、地缘冲突等多重事件冲击，缩量回调。资金结构层面，本季度完成了一次深度出清：成交额自 7 月初 3.6 万亿天量，逐步萎缩至季度末 1.6 万亿的年内地量，市场的情绪及活跃程度显著衰退。两融余额自 3 万亿历史峰值迅速回落至 2.6 万亿附近，杠杆资金得到一定程度的消化。新发基金同样遇冷，发行数量与平均发行规模较二季度大幅下滑。经历了成长与价值的极端摆动后，股票间分化度自 9 月起有所收敛，市场由“高波分化”切换到“低波整固”，价格波动的结构趋于有序。

我们认为，复盘三季度行情及宏观环境，有三个关键因素值得重视与总结。其一，主导权益市场定价的主要矛盾，或从前期的产业景气转向全球流动性：美联储年内重启加息、美债长端收益率攀升至近二十年高位，对本季度成长股的估值产生不可忽视的负面影响；其二，科技主线的定价范式，已经由之前的“远期叙事”驱动，转向更谨慎的“盈利兑现”和“债务结构可控”驱动：本季度科技板块多次探底并非产业趋势崩塌，更多由海外流动性收紧，叠加债务端争议触发，定价锚正逐步发生切换；其三，国内产业基本面“生产强、需求弱”的分化仍在进一步加深：高技术制造业保持双位数增长，消费和地产投资持续承压，红利资产凭借低估值、高股息以及盈利稳定性重获关注，与科技成长形成哑铃两端，与我们二季度末的观点相互印证。

本基金的投资运作管理采用国联安量化指数增强体系“多策略选股、多工具增强、动态紧风控”的策略框架，着眼于为投资人提供有竞争力且超额收益相关性较低的量化产品，在策略趋同的量化行业中提供有效的分散配置工具。投资团队通过异构模型获取两类收益：其一是分散参与科技板块内部高景气赛道轮动——以科创综指为基准，纳入符合条件的同行业非科创板公司，通过中长周期基本面模型筛选高景气、财务稳健的优质公司，避免对少数"潜在赢家"集中押注，在紧密跟踪指数的同时广泛参与各细分赛道中具备竞争力企业的成长；其二是在价格波动中通过积极交易积累超额——高波动资产更易在交易端提供收益土壤，本产品以短周期量价模型在波动中增强收益，辅以衍生品工具提供下行保护、自上而下的风险模型控制敞口。

报告期内，科创综指经历一轮剧烈震荡，7 月单月下跌近 28%。本基金在二季度创累计超额新高后，三季度面临较大的回撤压力，季度内绝对收益-27.83%，与基准基本持平。受外部输入性风险及科技板块高拥挤度影响，7 月以来组合超额收益承压并一度击穿风控预警值，此后投研团队严格执行预定的风控措施、组合保持整体紧敞口管理。与此同时，由于组合在市值风格上一贯的紧暴露，在 8-9 月小市值明显反弹的行情中未能明显受益。

基于内部归因分析，本季度组合负向超额主要来源于算力硬件板块的超配，基本面模型捕捉到该板块的高景气及业绩增长确定性符合我们预期。尽管阶段性超额收益承压，我们维持对模型能够有效精选基本面优质个股的信心。随着三季度拥挤度的逐步出清以及三季报期市场重新重视

个股基本面评估，超额收益有望迎来修复良机。

展望四季度，我们面临的是一个相对复杂、风险与收益并存的环境：第一，美联储加息预期叠加美债收益率持续上行意味着全球流动性边际收紧和风险偏好被压制，但 5.3%的 10 年期美债的投资性价比已追平美股；第二，十月份的三季报窗口大概率持续验证 AI 产业“供不应求”的高景气和资本开支持续高增的展望；第三，临近 11 月美国中期选举窗口，我们不排除中东局势阶段性缓和带来通胀回落预期及风险偏好提升；最后，国内增量政策有望陆续出台托底经济、稳定内需和信心。综合来看，风险偏好的压制或将阶段性缓和，权益市场有望在四季度迎来反弹。

结合过去一季度 A 股相对低迷的走势，当前市场所处的位置已经较为充分反映未来的悲观预期，也给投资者带来相对高性价比的低位布局窗口。投资团队也将在组合管理密切跟踪上述市场重要变量和灵活捕捉潜在市场机会，力争为投资者带来超额回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，国联安上证科创板综合指数增强 A 的份额净值为 1.1617 元，国联安上证科创板综合指数增强 C 的份额净值为 1.1566 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-27.83%，同期业绩比较基准收益率为-26.67%；国联安上证科创板综合指数增强 C 的份额净值增长率为-27.90%，同期业绩比较基准收益率为-26.67%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 387,035,671.00 | 90.50 |
| | 其中：股票 | 387,035,671.00 | 90.50 |
| 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 | 25,800.00 | 0.01 |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 38,808,634.57 | 9.07 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 8 | 其他资产 | 1,782,979.38 | 0.42 |
| 9 | 合计 | 427,653,084.95 | 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。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 258,955,371.33 | 61.32 |
| 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 | 57,306,892.70 | 13.57 |
| 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 | 8,173,756.51 | 1.94 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 469,402.90 | 0.11 |
| 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 | 324,905,423.44 | 76.94 |

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,390.75 | 0.00 |
| C | 制造业 | 53,969,608.81 | 12.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 403,798.00 | 0.10 |
| E | 建筑业 | 724,587.00 | 0.17 |
| F | 批发和零售业 | 1,873,728.00 | 0.44 |
| 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 | 3,889,321.00 | 0.92 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 务业 | | |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 139,564.00 | 0.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 399,527.00 | 0.09 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 271,471.00 | 0.06 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 317,300.00 | 0.08 |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 137,952.00 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 62,130,247.56 | 14.71 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688256 | 寒武纪 | 20,876 | 21,064,092.76 | 4.99 |
| 2 | 688041 | 海光信息 | 76,409 | 17,329,561.20 | 4.10 |
| 3 | 688012 | 中微公司 | 30,800 | 9,811,340.00 | 2.32 |
| 4 | 688981 | 中芯国际 | 81,237 | 9,097,731.63 | 2.15 |
| 5 | 688498 | 源杰科技 | 5,057 | 8,156,941.00 | 1.93 |
| 6 | 688808 | 联讯仪器 | 5,090 | 7,870,573.34 | 1.86 |
| 7 | 688008 | 澜起科技 | 36,470 | 7,378,245.70 | 1.75 |
| 8 | 688820 | 盛合晶微 | 60,596 | 7,015,373.28 | 1.66 |
| 9 | 688802 | 沐曦股份 | 13,296 | 6,609,175.68 | 1.57 |
| 10 | 688795 | 摩尔线程 | 15,092 | 5,945,342.48 | 1.41 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300438 | 鹏辉能源 | 45,600 | 2,237,592.00 | 0.53 |
| 2 | 300613 | 富瀚微 | 26,000 | 2,100,800.00 | 0.50 |
| 3 | 300855 | 图南股份 | 49,200 | 1,633,440.00 | 0.39 |
| 4 | 002653 | 海思科 | 25,500 | 1,585,590.00 | 0.38 |
| 5 | 601869 | 长飞光纤 | 3,400 | 1,397,944.00 | 0.33 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IM2612 | IM2612 | 4 | 5,740,480.00 | -309,120.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -309,120.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -808,981.94 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -309,120.00 |

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本，追求对标的指数的紧密跟踪。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，澜起科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到韩国首尔中央地方检察厅公平贸易调查部的处罚。

本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 754,716.66 |
| 2 | 应收证券清算款 | 288,056.95 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 740,205.77 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,782,979.38 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688808 | 联讯仪器 | 53,905.32 | 0.01 | 新股锁定 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 2 | 688820 | 盛合晶微 | 14,619.80 | 0.00 | 新股锁定 |

### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 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 |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 130,830,270.93 | 79,329,587.86 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 138,903,099.26 | 132,373,761.36 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 52,360,054.04 | 64,938,594.89 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 217,373,316.15 | 146,764,754.33 |

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。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

## §8 备查文件目录

### 8.1 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

### 8.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

### 8.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

**国联安基金管理有限公司**

**二〇二六年十月二十七日**