国联安沪深300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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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
报告期末基金份额总额	464,271,392.48 份
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。	
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	
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	311,305,496.16 份	152,965,896.32 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）	
	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
1.本期已实现收益	-6,265,089.41	-2,699,736.76
2.本期利润	-59,680,543.30	-21,621,082.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1520	-0.1546
4.期末基金资产净值	482,151,661.92	235,637,409.22
5.期末基金份额净值	1.5488	1.5405

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）

国联安沪深 300 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	-9.79%	1.32%	-11.88%	1.22%	2.09%	0.10%
过去六个月	3.86%	1.27%	-1.92%	1.22%	5.78%	0.05%
过去一年	4.47%	1.12%	-5.72%	1.08%	10.19%	0.04%
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	54.88%	1.11%	33.69%	1.12%	21.19%	-0.01%

（报告期：2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）

国联安沪深 300 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	-9.83%	1.32%	-11.88%	1.22%	2.05%	0.10%
过去六个月	3.75%	1.27%	-1.92%	1.22%	5.67%	0.05%
过去一年	4.26%	1.12%	-5.72%	1.08%	9.98%	0.04%
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	54.05%	1.11%	33.69%	1.12%	20.36%	-0.01%

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



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 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。



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		
章椹元	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。
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。
冯雪	基金经理	2025 年 7 月 30 日	2026 年 9 月 21 日	4 年（自 2019 年起）	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 月至 2026 年 9 月担任国联安沪深 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
章椹元	公募基金	15	32,219,064,280.33	2020 年 5 月 6 日
	私募资产管理计划	5	36,507,604,644.70	2024 年 9 月 2 日
	其他组合	-	-	-
	合计	20	68,726,668,925.03	-

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 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

2026 年三季度 A 股呈现高位震荡调整与风格再平衡格局，市场在经历前期快速上涨后整体有所回落，成长风格明显降温。

三季度主要宽基普遍收跌，上证指数下跌 6.16%、沪深 300 下跌 12.49%，中证 500 下跌 17.67%，创业板指、科创 50 调整幅度分别达到 27.80%、30.70%。行业层面，科技成长等前期强势板块调整幅度较大，而资源、红利等方向相对稳健。三季度市场调整的核心驱动在于内外部环境共同变化。一方面，上半年科技成长板块涨幅较大，估值和交易拥挤度处于高位，随着市场风险偏好回落，高估值成长方向集中调整；另一方面，美联储时隔三年多重启加息，全球无风险利率上行预期对成长板块估值形成压制。整体来看，三季度市场完成了由上半年极致科技成长行情向风格再平衡的阶段性切换，市场风险偏好有所回落。

展望 2026 年四季度，A 股大概率延续结构性行情，市场风格有望进一步趋于均衡。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。在选股层面，结合盈利、估值等维度，动态评估不同因子的有效性及其适用环境，持续完善选股模型；在组合构建层面，根据模型信号动态调整成分股权重，结合风险控制体系优化组合结构，降低非系统性风险，提升组合风险收益比。同时，加强对宏观政策边际变化与市场情绪波动及交易拥挤度的跟踪，根据市场环境变化及时调整模型参数和组合结构，并通过风险预算、暴露约束等方式控制组合风险，力争在有效控制跟踪误差的基础上持续获取稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，国联安沪深 300 指数增强 A 的份额净值为 1.5488 元，国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值为 1.5405 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-9.79%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值增长率为-9.83%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。

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	674,470,985.98	78.55
	其中：股票	674,470,985.98	78.55
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	178,495,669.39	20.79
8	其他资产	5,713,408.87	0.67
9	合计	858,680,064.24	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	429,852.00	0.06
B	采矿业	27,953,299.00	3.89
C	制造业	309,231,319.63	43.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,321,946.00	2.69
E	建筑业	3,938,761.00	0.55
F	批发和零售业	408,744.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	21,347,425.00	2.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,567,077.65	2.31
J	金融业	138,891,092.65	19.35
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	14,357,772.00	2.00
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	552,447,288.93	76.97

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,470,813.00	0.34
B	采矿业	4,532,852.38	0.63
C	制造业	87,521,495.26	12.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,797,112.58	0.39
E	建筑业	730,312.00	0.10
F	批发和零售业	9,678,110.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,580,179.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,601,152.83	1.06
J	金融业	787,788.00	0.11
K	房地产业	976,903.00	0.14
L	租赁和商务服务业	796,613.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	1,305,926.00	0.18
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	244,440.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	122,023,697.05	17.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

1	300308	中际旭创	33,600	27,163,584.00	3.78
2	300750	宁德时代	80,100	23,317,911.00	3.25
3	600519	贵州茅台	15,700	19,760,334.00	2.75
4	601318	中国平安	342,565	18,255,288.85	2.54
5	300502	新易盛	44,560	17,333,840.00	2.41
6	600036	招商银行	407,600	16,817,576.00	2.34
7	603259	药明康德	85,800	14,357,772.00	2.00
8	000333	美的集团	165,600	13,264,560.00	1.85
9	601899	紫金矿业	396,900	11,823,651.00	1.65
10	601398	工商银行	1,230,600	10,189,368.00	1.42

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	688825	长鑫科技	88,189	3,408,504.85	0.47
2	300613	富瀚微	37,800	3,054,240.00	0.43
3	000933	神火股份	103,600	2,716,392.00	0.38
4	601168	西部矿业	75,800	2,679,530.00	0.37
5	300919	中伟新材	69,300	2,580,732.00	0.36

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	风险说明

				（元）	
IF2610	IF2610	-25	-32,646,000.00	-11,460.00	-
IF2612	IF2612	27	34,825,140.00	1,620.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-9,840.00
股指期货投资本期收益（元）					-3,150,674.01
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-56,001.18

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行安徽省分行、国家金融监督管理总局、牟平区市场监督管理局、济南市市中区财政局的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行泸州市分行、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行衢州市分行、中国人民银行、中国人民银行深圳市分行、国家金融监督管理总局江西监管局、国家金融监督管理总局榆林监管分局、国家税务总局白银市税务局稽查局、国家金融监督管理总局宁波监管局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局永州市监管分局、国家金融监督管理总局绍兴监管分局、博兴县市场监管局、广州市建

筑业管理服务中心、国家金融监督管理总局温州监管分局、国家税务总局内蒙古自治区税务局、深圳市市场监督管理局、济南市市中区财政局、国家金融监督管理总局湖州监管分局、国家金融监督管理总局深圳监管局的处罚。

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同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	4,179,016.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,534,392.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,713,408.87

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	3,408,504.85	0.47	新股锁定

§6 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
报告期期初基金份额总额	302,748,056.25	79,756,667.78
报告期期间基金总申购份额	148,431,525.12	222,581,395.98
减:报告期期间基金总赎回份额	139,874,085.21	149,372,167.44
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	311,305,496.16	152,965,896.32

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2026 年 7 月 1 日至 2026 年 7 月 13 日、2026 年 7 月 20 日至 2026 年 9 月 29 日	89,448,206.20	49,840,551.05	89,448,206.20	49,840,551.05	10.74
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。						

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安沪深 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

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日