

国联中证 800 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 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。本中期报告已经全体独立董事签字同意。

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18日复核了本报告中的财务指标、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01月01日起至2026年06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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	15
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	15
§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	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59

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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	60
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
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	61
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联中证800指数增强型证券投资基金	
基金简称	国联中证800指数增强	
基金主代码	024254	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年09月23日	
基金管理人	国联基金管理有限公司	
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	41,435,713.41份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联中证800指数增强A	国联中证800指数增强C
下属分级基金的交易代码	024254	024255
报告期末下属分级基金的份额总额	12,999,473.67份	28,436,239.74份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数有效跟踪的基础上，结合量化及基本面的方法，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证的投资策略；4、债券投资策略；5、可转债及可交换债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、参与股指期货交易策略；8、参与国债期货交易策略；9、股票期权投资策略；10、信用衍生品投资策略；11、融资交易策略；12、参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证800指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金可投资于港股，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	曹健	方圆
	联系电话	010-56517000	95559
	电子邮箱	caojian@glfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-160-6000；010-56517299	95559
传真		010-56517001	021-62701216
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100011	200336
法定代表人		王瑶	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.glfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国联基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层

会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25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01月01日-2026年06月30日)	
	国联中证800指数增强A	国联中证800指数增强C
本期已实现收益	1,893,939.61	3,750,246.91
本期利润	2,182,834.00	4,229,449.04
加权平均基金份额本期利润	0.1168	0.1062
本期加权平均净值利润率	11.06%	10.08%
本期基金份额净值增长率	9.70%	9.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	1,445,232.72	3,064,149.07
期末可供分配基金份额利润	0.1112	0.1078
期末基金资产净值	14,469,611.57	31,553,608.37
期末基金份额净值	1.1131	1.1096
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.31%	10.96%

注：1、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、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；

3、期末可供分配利润为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

国联中证800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	11.58%	1.27%	13.02%	1.27%	-1.44%	0.00%
过去六个月	9.70%	1.17%	10.59%	1.18%	-0.89%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	11.31%	1.01%	13.37%	1.10%	-2.06%	-0.09%

国联中证800指数增强C

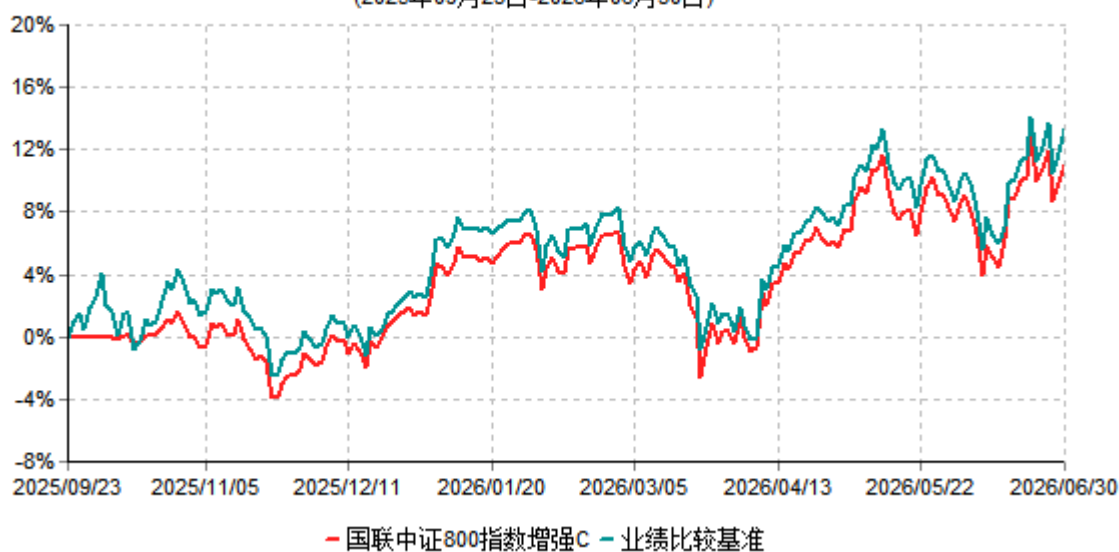
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	11.46%	1.27%	13.02%	1.27%	-1.56%	0.00%
过去六个月	9.48%	1.17%	10.59%	1.18%	-1.11%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	10.96%	1.01%	13.37%	1.10%	-2.41%	-0.09%

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

国联中证800指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年09月23日-2026年06月30日)



国联中证800指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年09月23日-2026年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。基金合同生效日起至本报告期末不满一年。

§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

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联民生证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2026年6月30日，国联基金管理有限公司共管理94只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联上海清算所银行间1-3年中等等级信用债指数发起式证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证

券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联稳健增益债券型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联稳健添益债券型证券投资基金、国联中证800指数增强型证券投资基金、国联价值均衡混合型证券投资基金、国联稳健鑫益债券型证券投资基金、国联多元配置3个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国联中证港股通综合指数增强型证券投资基金、国联金如意3个月滚动持有债券型证券投资基金、国联汇富债券型证券投资基金、国联昭元债券型证券投资基金、国联创业板综合指数增强型证券投资基金、国联周期优选混合型发起式证券投资基金、国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金。

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		
王喆	国联高股息精选混合型证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金、国联策略优	2025-09-23	-	11	王喆先生,中国国籍，毕业于北京航空航天大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限11年。2015年1月至2022年4月历任中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部基金研究员、权益投资部基金经理；2022年4月至2023年9月历任中信建投基金管理有限公司特定资

	选混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联中证800指数增强型证券投资基金、国联稳健添益债券型证券投资基金、国联中证港股通综合指数增强型证券投资基金、国联稳健鑫益债券型证券投资基金、国联创业板综合指数增强型证券投资基金的基金经理及多策略投资总监兼多策略投资部总经理。				产管理部投资经理、多元资产配置部投资经理。2023年9月加入公司，现任多策略投资总监兼任多策略投资部总经理。
黄磊鑫	国联中证800指数增强型证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。	2025-10-14	-	5	黄磊鑫先生，中国国籍，毕业于对外经济贸易大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限5年。2021年6月至2022年3月任中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员；2022年3月至2023年10月任中信建投基金管理有限公司多元资产配置部研究员。2023年10月加入公司，现任多策略投资部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

上半年A股市场整体表现有所改善，但不同风格和板块之间分化较为明显。科技成长方向继续占据市场主线，科创板、创业板相关指数表现居前，而上证50、北证50走势相对偏弱。资金主要流向产业逻辑清晰、盈利兑现能力较强的领域，通信、电子等行业表现亮眼，消费及地产链板块则整体表现欠佳。

基金投资运作方面，本基金以多因子量化投资策略为主，在控制基金与标的指数跟踪偏离度的基础上，力争为投资者创造更稳定、可持续、高胜率的超额回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联中证800指数增强A基金份额净值为1.1131元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.70%，同期业绩比较基准收益率为10.59%；截至报告期末国联中证800指数增强C基金份额净值为1.1096元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.48%，同期业绩比较基准收益率为10.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为A股市场仍将以结构性行情为主，宏观经济持续修复、稳增长政策逐步落地以及流动性保持合理充裕，将为市场提供有力支撑。短期来看，市场风格或仍会随着政策预期、业绩验证及资金流向出现阶段性轮动，但中长期来看，产业升级和科技创新仍是重要投资主线，具备核心竞争力和盈利持续改善能力的优质企业有望持续获得市场青睐。在行业轮动加快、个股分化加剧的市场环境下，主动选股的重要性进一步提升，指数增强策略有望依托量化模型精选个股，在严格控制风险的基础上持续获取稳定超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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，基金托管人在国联中证800指数增强型证券投资基金的托管过程中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，国联基金管理有限公司在国联中证800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、基金收益分配等问题上，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的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由国联基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联中证800指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、收益表现、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：国联中证800指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,786,686.72	8,239,196.31
结算备付金		12,572.56	12,504.25
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	43,445,665.37	95,650,410.57
其中：股票投资		43,445,665.37	95,650,410.57
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		4,618.07	3,590.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		46,249,542.72	103,905,701.73
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06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		108,441.91	3,079,332.59
应付管理人报酬		30,907.54	84,325.51
应付托管费		3,863.45	10,540.68
应付销售服务费		10,437.38	28,977.85
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	72,672.50	8,200.00
负债合计		226,322.78	3,211,376.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	41,435,713.41	99,310,083.26
未分配利润	6.4.7.8	4,587,506.53	1,384,241.84
净资产合计		46,023,219.94	100,694,325.10
负债和净资产总计		46,249,542.72	103,905,701.73

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额41,435,713.41份，其中A类基金份额的份额总额为12,999,473.67份，份额净值1.1131元；C类基金份额的份额总额为28,436,239.74份，份额净值1.1096元。

6.2 利润表

会计主体：国联中证800指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至2026年0 6月30日
一、营业总收入		6,843,120.05
1.利息收入		3,269.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,269.66
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）		6,071,104.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,640,465.11
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	430,638.92
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	768,096.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	649.84
减：二、营业总支出		430,837.01

1.管理人报酬		246,703.17
2.托管费		30,837.94
3.销售服务费		83,871.54
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	6.4.7.19	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.20	69,424.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,412,283.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,412,283.04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,412,283.04

注：本基金合同于2025年09月23日生效，本报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国联中证800指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	99,310,083.26	1,384,241.84	100,694,325.10
二、本期期初净资产	99,310,083.26	1,384,241.84	100,694,325.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-57,874,369.85	3,203,264.69	-54,671,105.16
（一）、综合收益	-	6,412,283.04	6,412,283.04

总额			
（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）	-57,874,369.85	-3,209,018.35	-61,083,388.20
其中：1.基金申购款	5,632,157.48	326,877.53	5,959,035.01
2.基金赎回款	-63,506,527.33	-3,535,895.88	-67,042,423.21
（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、本期期末净资产	41,435,713.41	4,587,506.53	46,023,219.94

注：本基金合同于2025年09月23日生效，本报表及报表附注均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：

王瑶	周妹云	李克
-----	-----	-----
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

国联中证800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〕919号《关于准予国联中证800指数增强型证券投资基金注册的批复》批准，由国联基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联中证800指数增强型证券投资基金基金合同》("基金合同")负责公开募集，于2025年9月23日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金募集期为自2025年9月1日起至2025年9月19日止，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币283,726,249.53元，折合283,726,249.53份“国联中证800指数增强”基金份额。有效认购户数为9,889户。其中，“国联中证800指数增

强” A类基金份额已收到首次募集的有效净认购金额为人民币67,476,928.55元，折合67,476,928.55份“国联中证800指数增强” A类基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币21,451.37元，折合21,451.37份“国联中证800指数增强” A类基金份额。

“国联中证800指数增强” C类基金份额已收到首次募集的有效净认购金额为人民币216,149,453.47元，折合216,149,453.47份“国联中证800指数增强” C类基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币78,416.14元，折合78,416.14份“国联中证800指数增强” C类基金份额。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

本基金的投资对象主要是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品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的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、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。

本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号-定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年半年度的经营成果和基金净值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

本基金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

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令826号文《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告2026年第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》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

自2026年1月1日至2027年12月31日，对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；

自2026年1月1日至2027年12月31日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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06月30日	
活期存款	78,212.69	
等于：本金	78,160.53	
加：应计利息	52.16	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
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	2,708,474.03	
等于：本金	2,708,438.55	
加：应计利息	35.48	
减：坏账准备	-	
合计	2,786,686.72	

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易资金账户中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06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		42,544,386.80	-	43,445,665.37	901,278.57
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	42,544,386.80	-	43,445,665.37	901,278.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	144.64
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	-
预提费用	69,424.36
其他应付	3,103.50
合计	72,672.50

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 国联中证800指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (国联中证800指数增强A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,988,016.08	34,988,016.08
本期申购	4,049,164.09	4,049,164.09
本期赎回（以“-”号填列）	-26,037,706.50	-26,037,706.50
本期末	12,999,473.67	12,999,473.67

6.4.7.7.2 国联中证800指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (国联中证800指数增强C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,322,067.18	64,322,067.18
本期申购	1,582,993.39	1,582,993.39
本期赎回（以“-”号填列）	-37,468,820.83	-37,468,820.83
本期末	28,436,239.74	28,436,239.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 国联中证800指数增强A

单位：人民币元

项目 (国联中证800指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	648,665.89	-135,219.18	513,446.71
本期期初	648,665.89	-135,219.18	513,446.71
本期利润	1,893,939.61	288,894.39	2,182,834.00
本期基金份额交易产	-1,097,372.78	-128,770.03	-1,226,142.81

生的变动数			
其中：基金申购款	232,100.33	26,262.19	258,362.52
基金赎回款	-1,329,473.11	-155,032.22	-1,484,505.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,445,232.72	24,905.18	1,470,137.90

6.4.7.8.2 国联中证800指数增强C

单位：人民币元

项目 (国联中证800指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,119,758.27	-248,963.14	870,795.13
本期期初	1,119,758.27	-248,963.14	870,795.13
本期利润	3,750,246.91	479,202.13	4,229,449.04
本期基金份额交易产生的变动数	-1,805,856.11	-177,019.43	-1,982,875.54
其中：基金申购款	109,504.32	-40,989.31	68,515.01
基金赎回款	-1,915,360.43	-136,030.12	-2,051,390.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,064,149.07	53,219.56	3,117,368.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	2,143.82
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,057.53
结算备付金利息收入	68.31
其他	-
合计	3,269.66

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	217,896,952.09
减：卖出股票成本总额	212,051,486.24
减：交易费用	205,000.74
买卖股票差价收入	5,640,465.11

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

注：无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	430,638.92
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	430,638.92

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	768,096.52
——股票投资	768,096.52
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	768,096.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	649.84
合计	649.84

6.4.7.19 信用减值损失

注：无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	69,424.36

6.4.7.21 分部报告

无。

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，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

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
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国联民生证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

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01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	246,703.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	102,107.98
应支付基金管理人的净管理费	144,595.19

注：① 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.80%/当年天数；

② 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	30,837.94

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/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01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联中证800指数增强A	国联中证800指数增强C	合计
交通银行 股份有限 公司	0.00	28,118.50	28,118.50
国联基金 管理有限 公司	0.00	20,934.35	20,934.35
国联民生 证券股份 有限公司	0.00	2.66	2.66
合计	-	49,055.51	49,055.51

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%的费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：

C类基金份额的日销售服务费＝前一日C类基金资产净值X0.40%/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

注：无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.4.2 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

注：无。

6.4.10.5 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01月01日至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	78,212.69	2,143.82

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：无。

6.4.12 期末（2026年06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
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	首次公开发行限售	92.18	463.15	21	1,935.78	9,726.15	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	首次公开发行限售	11.18	17.59	76	849.68	1,336.84	-
603352	至信	2026-01-08	6个	首次	21.88	25.52	35	765.80	893.20	-

	股份		月	公开发 行 限售						
--	----	--	---	----------------	--	--	--	--	--	--

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示。如无表格，则本基金于本期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的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0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,786,686.72	-	-	-	2,786,686.72
结算备付金	12,572.56	-	-	-	12,572.56
交易性金融资产	-	-	-	43,445,665.37	43,445,665.37
应收申购款	-	-	-	4,618.07	4,618.07
资产总计	2,799,259.28	-	-	43,450,283.44	46,249,542.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	108,441.91	108,441.91
应付管理人报酬	-	-	-	30,907.54	30,907.54
应付托管费	-	-	-	3,863.45	3,863.45
应付销售服务费	-	-	-	10,437.38	10,437.38
其他负债	-	-	-	72,672.50	72,672.50
负债总计	-	-	-	226,322.78	226,322.78
利率敏感度缺口	2,799,259.28	-	-	43,223,960.66	46,023,219.94
上年度末 2025年1	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2月31日					
资产					
货币资金	8,239,196.31	-	-	-	8,239,196.31
结算备付金	12,504.25	-	-	-	12,504.25
交易性金融资产	-	-	-	95,650,410.57	95,650,410.57
应收申购款	-	-	-	3,590.60	3,590.60
资产总计	8,251,700.56	-	-	95,654,001.17	103,905,701.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,079,332.59	3,079,332.59
应付管理人报酬	-	-	-	84,325.51	84,325.51
应付托管费	-	-	-	10,540.68	10,540.68
应付销售服务费	-	-	-	28,977.85	28,977.85
其他负债	-	-	-	8,200.00	8,200.00
负债总计	-	-	-	3,211,376.63	3,211,376.63
利率敏感度缺口	8,251,700.56	-	-	92,442,624.54	100,694,325.10

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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06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	43,445,665.37	94.40	95,650,410.57	94.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	43,445,665.37	94.40	95,650,410.57	94.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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06月30日	上年度末 2025年12月31日
	沪深300指数上升5%	2,020,294.94	2,751,055.43
	沪深300指数下降5%	-2,020,294.94	-2,751,055.43

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是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06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	43,433,709.18	94,555,272.58
第二层次	-	994,034.00
第三层次	11,956.19	101,103.99
合计	43,445,665.37	95,650,410.57

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。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的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

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	43,445,665.37	93.94

	其中：股票	43,445,665.37	93.94
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	2,799,259.28	6.05
8	其他各项资产	4,618.07	0.01
9	合计	46,249,542.72	100.00

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	210,764.00	0.46
B	采矿业	1,538,056.00	3.34
C	制造业	23,822,309.37	51.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	665,385.00	1.45
E	建筑业	536,761.00	1.17
F	批发和零售业	569,503.00	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	1,008,203.00	2.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,888,753.80	6.28
J	金融业	6,266,711.00	13.62
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	284,932.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	500,319.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	275,400.00	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	178,416.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	16,000.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	38,761,513.17	84.22

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	67,464.00	0.15
C	制造业	2,859,839.20	6.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,589.00	0.17
E	建筑业	53,398.00	0.12
F	批发和零售业	424,301.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	118,164.00	0.26
H	住宿和餐饮业	31,616.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	430,586.00	0.94
J	金融业	122,751.00	0.27
K	房地产业	7,953.00	0.02
L	租赁和商务服务业	53,298.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	151,170.00	0.33

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	59,064.00	0.13
Q	卫生和社会工作	7,496.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	217,463.00	0.47
S	综合	-	-
	合计	4,684,152.20	10.18

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

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	1,200	1,524,000.00	3.31
2	300750	宁德时代	3,500	1,375,535.00	2.99
3	688256	寒武纪	596	950,947.80	2.07
4	300502	新易盛	1,440	874,080.00	1.90
5	600519	贵州茅台	500	592,745.00	1.29
6	002384	东山精密	2,200	577,170.00	1.25
7	603986	兆易创新	700	570,500.00	1.24
8	688981	中芯国际	3,500	555,870.00	1.21
9	600030	中信证券	18,100	520,013.00	1.13
10	688041	海光信息	1,315	486,944.50	1.06
11	601166	兴业银行	29,300	485,208.00	1.05
12	603259	药明康德	3,800	473,138.00	1.03
13	600919	江苏银行	39,300	423,654.00	0.92
14	600183	生益科技	2,400	416,160.00	0.90
15	688008	澜起科技	1,312	406,588.80	0.88

16	601899	紫金矿业	16,100	404,754.00	0.88
17	601211	国泰海通	21,800	396,760.00	0.86
18	601318	中国平安	8,000	381,920.00	0.83
19	600887	伊利股份	15,900	380,964.00	0.83
20	600900	长江电力	14,300	378,521.00	0.82
21	000338	潍柴动力	13,600	370,600.00	0.81
22	000333	美的集团	4,600	347,438.00	0.75
23	688521	芯原股份	900	334,026.00	0.73
24	688012	中微公司	698	327,013.00	0.71
25	300408	三环集团	1,900	317,110.00	0.69
26	000100	TCL科技	52,200	303,804.00	0.66
27	601138	工业富联	4,200	303,030.00	0.66
28	601600	中国铝业	35,900	295,098.00	0.64
29	601688	华泰证券	14,300	294,866.00	0.64
30	600926	杭州银行	20,100	290,445.00	0.63
31	601668	中国建筑	66,800	289,912.00	0.63
32	600036	招商银行	8,100	287,550.00	0.62
33	002415	海康威视	8,400	287,280.00	0.62
34	002281	光迅科技	1,100	282,634.00	0.61
35	601009	南京银行	28,100	277,909.00	0.60
36	300476	胜宏科技	800	277,144.00	0.60
37	300124	汇川技术	4,100	271,953.00	0.59
38	601766	中国中车	51,100	265,720.00	0.58
39	002371	北方华创	300	265,368.00	0.58
40	601229	上海银行	30,400	263,872.00	0.57
41	600489	中金黄金	14,500	261,725.00	0.57
42	300059	东方财富	12,800	260,864.00	0.57
43	688387	信科移动	13,033	258,574.72	0.56
44	601360	三六零	29,700	258,093.00	0.56
45	002475	立讯精密	3,600	253,440.00	0.55
46	300857	协创数据	740	251,526.00	0.55

47	002602	世纪华通	17,800	250,980.00	0.55
48	600115	中国东航	64,700	246,507.00	0.54
49	000617	中油资本	36,900	243,171.00	0.53
50	000938	紫光股份	8,400	242,424.00	0.53
51	600570	恒生电子	11,400	241,566.00	0.52
52	300604	长川科技	700	238,994.00	0.52
53	688472	阿特斯	22,000	238,040.00	0.52
54	600704	物产中大	49,300	232,696.00	0.51
55	601857	中国石油	26,700	231,756.00	0.50
56	300999	金龙鱼	9,900	230,274.00	0.50
57	002916	深南电路	500	228,950.00	0.50
58	603993	洛阳钼业	12,800	224,640.00	0.49
59	600989	宝丰能源	10,800	219,564.00	0.48
60	301308	江波龙	300	211,140.00	0.46
61	002027	分众传媒	43,100	208,604.00	0.45
62	601618	中国中冶	84,600	206,424.00	0.45
63	000725	京东方A	23,600	204,848.00	0.45
64	688538	和辉光电	77,912	202,571.20	0.44
65	600406	国电南瑞	8,800	201,080.00	0.44
66	600372	中航机载	18,500	200,725.00	0.44
67	600893	航发动力	5,200	199,368.00	0.43
68	600196	复星医药	8,800	197,736.00	0.43
69	600031	三一重工	11,300	195,264.00	0.42
70	300014	亿纬锂能	3,000	195,090.00	0.42
71	000683	博源化工	33,500	192,960.00	0.42
72	001309	德明利	200	188,580.00	0.41
73	601816	京沪高铁	41,100	186,183.00	0.40
74	603296	华勤技术	2,440	181,218.80	0.39
75	300475	香农芯创	600	180,000.00	0.39
76	300136	信维通信	1,500	178,875.00	0.39
77	300015	爱尔眼科	21,600	178,416.00	0.39

78	600050	中国联通	43,500	174,000.00	0.38
79	300458	全志科技	4,400	173,624.00	0.38
80	600711	盛屯矿业	15,800	173,326.00	0.38
81	600000	浦发银行	19,900	171,339.00	0.37
82	002402	和而泰	6,600	170,478.00	0.37
83	601018	宁波港	53,900	169,785.00	0.37
84	000425	徐工机械	20,900	169,081.00	0.37
85	000408	藏格矿业	2,400	166,368.00	0.36
86	300498	温氏股份	13,500	166,320.00	0.36
87	600292	电投水电	13,800	166,152.00	0.36
88	600875	东方电气	5,700	163,989.00	0.36
89	688469	芯联集成	15,103	160,242.83	0.35
90	000166	申万宏源	36,100	158,840.00	0.35
91	300394	天孚通信	520	157,393.60	0.34
92	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.34
93	600584	长电科技	1,500	155,325.00	0.34
94	002152	广电运通	16,200	151,956.00	0.33
95	601658	邮储银行	30,600	150,858.00	0.33
96	000157	中联重科	21,200	147,764.00	0.32
97	601059	信达证券	9,100	147,329.00	0.32
98	600019	宝钢股份	26,800	145,524.00	0.32
99	601399	国机重装	41,300	144,550.00	0.31
100	688220	翱捷科技	1,100	136,752.00	0.30
101	600737	中粮糖业	11,000	135,630.00	0.29
102	601398	工商银行	19,000	134,330.00	0.29
103	002851	麦格米特	800	133,744.00	0.29
104	002236	大华股份	8,100	133,569.00	0.29
105	603256	宏和科技	500	132,665.00	0.29
106	603799	华友钴业	2,700	130,302.00	0.28
107	600795	国电电力	27,900	130,293.00	0.28
108	000792	盐湖股份	4,200	126,798.00	0.28

109	600938	中国海油	4,600	124,890.00	0.27
110	600016	民生银行	38,300	123,326.00	0.27
111	300390	天华新能	1,300	121,563.00	0.26
112	601288	农业银行	19,800	120,186.00	0.26
113	601212	白银有色	23,100	117,348.00	0.25
114	002001	新和成	4,100	116,522.00	0.25
115	600601	方正科技	8,400	116,256.00	0.25
116	301358	湖南裕能	1,500	113,805.00	0.25
117	600029	南方航空	21,900	113,442.00	0.25
118	688425	铁建重工	27,900	112,158.00	0.24
119	000977	浪潮信息	1,600	112,000.00	0.24
120	600150	中国船舶	3,300	111,507.00	0.24
121	601919	中远海控	8,000	106,080.00	0.23
122	688183	生益电子	800	105,920.00	0.23
123	002493	荣盛石化	9,600	103,200.00	0.22
124	300033	同花顺	420	101,220.00	0.22
125	300432	富临精工	5,000	100,450.00	0.22
126	600166	福田汽车	34,400	100,104.00	0.22
127	300115	长盈精密	3,500	97,790.00	0.21
128	300450	先导智能	2,400	97,728.00	0.21
129	300760	迈瑞医疗	700	95,081.00	0.21
130	002064	华峰化学	9,900	93,951.00	0.20
131	000988	华工科技	500	92,305.00	0.20
132	688568	中科星图	2,200	91,234.00	0.20
133	601665	齐鲁银行	15,300	88,281.00	0.19
134	600105	永鼎股份	1,300	87,724.00	0.19
135	300140	节能环保	17,400	86,478.00	0.19
136	600482	中国动力	2,600	85,280.00	0.19
137	605117	德业股份	800	84,944.00	0.18
138	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.18
139	601881	中国银河	6,600	82,962.00	0.18

140	601988	中国银行	14,500	82,940.00	0.18
141	600061	国投资本	12,300	80,565.00	0.18
142	601169	北京银行	16,000	78,400.00	0.17
143	688331	荣昌生物	600	78,156.00	0.17
144	002648	卫星化学	3,300	77,517.00	0.17
145	002532	天山铝业	7,200	77,256.00	0.17
146	300073	当升科技	1,600	76,864.00	0.17
147	300803	指南针	800	73,336.00	0.16
148	600276	恒瑞医药	1,400	72,856.00	0.16
149	600685	中船防务	2,800	71,232.00	0.15
150	002414	高德红外	5,200	68,952.00	0.15
151	600415	小商品城	6,700	68,072.00	0.15
152	601727	上海电气	9,700	67,900.00	0.15
153	688347	华虹宏力	200	67,260.00	0.15
154	603049	中策橡胶	1,500	67,215.00	0.15
155	002241	歌尔股份	2,900	65,337.00	0.14
156	000729	燕京啤酒	6,400	64,832.00	0.14
157	300274	阳光电源	400	63,608.00	0.14
158	688223	晶科能源	13,300	63,175.00	0.14
159	601111	中国国航	10,000	60,500.00	0.13
160	600025	华能水电	6,800	60,452.00	0.13
161	601608	中信重工	12,200	58,194.00	0.13
162	601106	中国一重	17,600	58,080.00	0.13
163	002265	建设工业	3,300	57,420.00	0.12
164	601607	上海医药	3,700	56,980.00	0.12
165	600741	华域汽车	3,600	55,872.00	0.12
166	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.12
167	600968	海油发展	16,500	54,945.00	0.12
168	002837	英维克	690	54,896.40	0.12
169	300972	万辰集团	300	52,023.00	0.11
170	002625	光启技术	1,700	51,544.00	0.11

171	600312	平高电气	2,900	51,214.00	0.11
172	600176	中国巨石	700	51,016.00	0.11
173	002153	石基信息	7,000	50,610.00	0.11
174	000039	中集集团	6,100	49,471.00	0.11
175	000963	华东医药	1,700	47,804.00	0.10
176	601916	浙商银行	17,800	46,814.00	0.10
177	002273	水晶光电	1,300	46,124.00	0.10
178	002594	比亚迪	576	45,907.20	0.10
179	300207	欣旺达	2,400	45,576.00	0.10
180	601136	首创证券	3,200	44,640.00	0.10
181	600598	北大荒	4,100	44,444.00	0.10
182	688192	迪哲医药	1,100	43,923.00	0.10
183	600085	同仁堂	1,900	43,909.00	0.10
184	600958	东方证券	4,600	43,424.00	0.09
185	600018	上港集团	9,000	42,480.00	0.09
186	601939	建设银行	4,400	42,372.00	0.09
187	002065	东华软件	5,800	41,412.00	0.09
188	002487	大金重工	700	40,579.00	0.09
189	601117	中国化学	5,500	40,425.00	0.09
190	600901	江苏金租	6,900	39,675.00	0.09
191	603501	豪威集团	400	37,940.00	0.08
192	603893	瑞芯微	200	37,672.00	0.08
193	603659	璞泰来	1,300	37,609.00	0.08
194	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.08
195	002271	东方雨虹	3,100	36,797.00	0.08
196	600008	首创环保	13,300	36,176.00	0.08
197	301200	大族数控	100	36,065.00	0.08
198	600026	中远海能	2,000	35,880.00	0.08
199	601808	中海油服	3,300	35,673.00	0.08
200	601108	财通证券	4,000	34,600.00	0.08
201	600941	中国移动	400	34,452.00	0.07

202	601377	兴业证券	5,700	34,428.00	0.07
203	601139	深圳燃气	5,900	33,394.00	0.07
204	688099	晶晨股份	300	30,870.00	0.07
205	601696	中银证券	2,400	30,360.00	0.07
206	600111	北方稀土	600	28,830.00	0.06
207	000657	中钨高新	300	28,716.00	0.06
208	000776	广发证券	1,200	28,080.00	0.06
209	600999	招商证券	1,300	27,430.00	0.06
210	600460	士兰微	500	27,330.00	0.06
211	002966	苏州银行	3,900	27,144.00	0.06
212	601997	贵阳银行	5,200	26,676.00	0.06
213	000301	东方盛虹	2,300	26,335.00	0.06
214	002202	金风科技	1,100	26,290.00	0.06
215	300919	中伟新材	600	26,250.00	0.06
216	601012	隆基绿能	2,000	26,240.00	0.06
217	601901	方正证券	3,600	25,920.00	0.06
218	301536	星宸科技	200	25,742.00	0.06
219	000063	中兴通讯	700	25,333.00	0.06
220	601877	正泰电器	1,000	25,070.00	0.05
221	002120	韵达股份	3,900	24,804.00	0.05
222	300718	长盛轴承	400	24,388.00	0.05
223	601698	中国卫通	800	24,200.00	0.05
224	688520	神州细胞	700	23,947.00	0.05
225	002738	中矿资源	400	23,596.00	0.05
226	600398	海澜之家	4,400	23,012.00	0.05
227	002266	浙富控股	4,500	22,770.00	0.05
228	688615	合合信息	200	22,620.00	0.05
229	601866	中远海发	10,200	22,542.00	0.05
230	000831	中国稀土	400	22,196.00	0.05
231	600332	白云山	1,100	22,044.00	0.05
232	600100	同方股份	3,100	21,235.00	0.05

233	000001	平安银行	2,100	21,105.00	0.05
234	002436	兴森科技	400	20,380.00	0.04
235	300759	康龙化成	700	20,251.00	0.04
236	601878	浙商证券	2,000	19,000.00	0.04
237	002429	兆驰股份	1,700	17,663.00	0.04
238	000878	云南铜业	1,100	17,468.00	0.04
239	600132	重庆啤酒	400	16,520.00	0.04
240	601019	山东出版	2,500	16,000.00	0.03
241	300748	金力永磁	500	15,425.00	0.03
242	002463	沪电股份	100	15,280.00	0.03
243	001286	陕西能源	1,500	15,210.00	0.03
244	002008	大族激光	100	15,011.00	0.03
245	600637	东方明珠	1,800	14,958.00	0.03
246	000987	越秀资本	1,900	14,858.00	0.03
247	000783	长江证券	1,300	12,675.00	0.03
248	605499	东鹏饮料	100	12,343.00	0.03
249	600339	中油工程	4,000	12,280.00	0.03
250	300017	网宿科技	900	11,709.00	0.03
251	601066	中信建投	400	11,628.00	0.03
252	003816	中国广核	2,900	11,339.00	0.02
253	601717	中创智领	800	11,128.00	0.02
254	002600	领益智造	600	10,404.00	0.02
255	600219	南山铝业	2,500	9,975.00	0.02
256	603920	世运电路	200	9,608.00	0.02
257	601233	桐昆股份	400	8,660.00	0.02
258	601216	君正集团	1,900	8,474.00	0.02
259	600369	西南证券	2,100	8,442.00	0.02
260	300058	蓝色光标	600	8,256.00	0.02
261	600690	海尔智家	400	8,164.00	0.02
262	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.02
263	600390	五矿资本	1,600	7,296.00	0.02

264	601699	潞安环能	500	7,140.00	0.02
265	300012	华测检测	500	6,930.00	0.02
266	600547	山东黄金	300	6,927.00	0.02
267	688009	中国通号	1,298	6,178.48	0.01
268	601112	振石股份	76	1,336.84	0.00

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	601061	中信金属	16,200	174,474.00	0.38
2	002969	嘉美包装	11,900	167,552.00	0.36
3	002080	中材科技	1,800	162,000.00	0.35
4	605577	龙版传媒	18,300	161,223.00	0.35
5	301578	辰奕智能	7,800	159,042.00	0.35
6	301558	三态股份	25,700	158,569.00	0.34
7	600418	江淮汽车	5,900	152,397.00	0.33
8	688779	五矿新能	17,700	143,547.00	0.31
9	603797	联泰环保	34,900	130,875.00	0.28
10	688689	银河微电	2,000	129,440.00	0.28
11	300822	贝仕达克	10,600	124,020.00	0.27
12	002948	青岛银行	22,200	112,776.00	0.25
13	002688	金河生物	20,900	96,558.00	0.21
14	300253	卫宁健康	14,000	94,220.00	0.20
15	000701	厦门信达	20,600	91,258.00	0.20
16	000933	神火股份	3,400	72,080.00	0.16
17	688428	诺诚健华	2,404	68,441.88	0.15
18	603967	中创物流	6,600	68,310.00	0.15
19	688795	摩尔线程	95	68,066.55	0.15
20	002405	四维图新	10,500	67,935.00	0.15

21	600733	北汽蓝谷	13,300	64,771.00	0.14
22	600703	三安光电	2,900	61,538.00	0.13
23	002376	新北洋	10,400	59,800.00	0.13
24	002805	丰元股份	2,000	57,180.00	0.12
25	688802	沐曦股份	68	56,324.40	0.12
26	300793	佳禾智能	5,000	56,250.00	0.12
27	600880	博瑞传播	15,200	56,240.00	0.12
28	688588	凌志软件	6,100	55,449.00	0.12
29	300512	中亚股份	8,000	54,560.00	0.12
30	601168	西部矿业	2,000	54,280.00	0.12
31	600320	振华重工	13,100	54,103.00	0.12
32	002180	奔图科技	3,300	53,988.00	0.12
33	000812	陕西金叶	17,400	53,940.00	0.12
34	002379	宏桥控股	3,500	51,695.00	0.11
35	000599	青岛双星	12,000	50,640.00	0.11
36	000045	深纺织A	4,800	50,592.00	0.11
37	000958	电投产融	8,900	50,196.00	0.11
38	688285	高铁电气	7,000	50,190.00	0.11
39	600512	腾达建设	26,200	48,994.00	0.11
40	603839	安正时尚	8,400	48,468.00	0.11
41	002855	捷荣技术	5,100	48,450.00	0.11
42	002238	天威视讯	8,700	46,980.00	0.10
43	688609	九联科技	4,251	46,803.51	0.10
44	002151	北斗星通	1,400	44,450.00	0.10
45	600872	中炬高新	2,500	43,400.00	0.09
46	002607	中公教育	23,600	42,480.00	0.09
47	688247	宣泰医药	5,300	39,856.00	0.09
48	300543	朗科智能	5,300	38,213.00	0.08
49	603836	海程邦达	4,800	37,920.00	0.08
50	002468	申通快递	2,400	34,944.00	0.08
51	600487	亨通光电	300	32,802.00	0.07

52	600854	春兰股份	7,900	32,153.00	0.07
53	000428	华天酒店	10,400	31,616.00	0.07
54	300047	天源迪科	3,500	31,080.00	0.07
55	002216	三全食品	2,600	29,978.00	0.07
56	603706	东方环宇	1,700	29,393.00	0.06
57	301262	海看股份	1,600	28,752.00	0.06
58	300168	万达信息	6,100	27,999.00	0.06
59	002291	遥望科技	5,400	25,920.00	0.06
60	603511	爱慕股份	2,000	23,000.00	0.05
61	600616	金枫酒业	6,100	22,875.00	0.05
62	605339	南侨食品	1,900	22,686.00	0.05
63	603228	景旺电子	300	21,723.00	0.05
64	688807	优迅股份	53	21,328.79	0.05
65	002555	三七互娱	1,100	20,757.00	0.05
66	301175	中科环保	4,100	20,295.00	0.04
67	300199	翰宇药业	900	19,872.00	0.04
68	300213	佳讯飞鸿	3,200	19,392.00	0.04
69	000869	张裕A	1,200	18,696.00	0.04
70	300315	掌趣科技	4,600	17,940.00	0.04
71	003028	振邦智能	800	17,576.00	0.04
72	301665	泰禾股份	800	16,768.00	0.04
73	600661	昂立教育	2,400	16,584.00	0.04
74	002391	长青股份	3,200	15,584.00	0.03
75	300061	旗天科技	2,200	15,378.00	0.03
76	601083	锦江航运	1,500	14,910.00	0.03
77	002674	兴业科技	500	14,265.00	0.03
78	688562	航天软件	900	13,554.00	0.03
79	000426	兴业银锡	400	13,184.00	0.03
80	002661	克明食品	1,700	11,781.00	0.03
81	688790	昂瑞微	84	11,241.72	0.02
82	601375	中原证券	2,500	9,975.00	0.02

83	688785	恒运昌	21	9,726.15	0.02
84	300079	数码视讯	2,200	9,240.00	0.02
85	688389	普门科技	900	8,811.00	0.02
86	000553	安道麦A	1,600	8,560.00	0.02
87	000581	威孚高科	500	8,510.00	0.02
88	603551	奥普科技	900	8,091.00	0.02
89	000402	金融街	3,300	7,953.00	0.02
90	300244	迪安诊断	400	7,496.00	0.02
91	688567	孚能科技	700	7,350.00	0.02
92	688560	明冠新材	600	7,110.00	0.02
93	002507	涪陵榨菜	600	6,480.00	0.01
94	688203	海正生材	500	4,990.00	0.01
95	601133	柏诚股份	100	4,404.00	0.01
96	603352	至信股份	35	893.20	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	300502	新易盛	1,480,084.40	1.47
2	300308	中际旭创	1,199,035.00	1.19
3	000426	兴业银锡	1,113,317.00	1.11
4	600879	航天电子	1,032,204.00	1.03
5	300750	宁德时代	986,361.00	0.98
6	002837	英维克	967,737.00	0.96
7	000657	中钨高新	889,131.00	0.88
8	688469	芯联集成	838,541.67	0.83
9	600221	海航控股	823,246.00	0.82
10	603986	兆易创新	809,715.00	0.80

11	688387	信科移动	800,190.31	0.79
12	002384	东山精密	771,244.00	0.77
13	600118	中国卫星	736,412.00	0.73
14	600489	中金黄金	734,320.00	0.73
15	600549	厦门钨业	714,356.00	0.71
16	601899	紫金矿业	706,862.00	0.70
17	600183	生益科技	705,707.00	0.70
18	002969	嘉美包装	696,769.00	0.69
19	600115	中国东航	677,169.00	0.67
20	000100	TCL科技	651,412.00	0.65

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	300750	宁德时代	2,847,540.00	2.83
2	300308	中际旭创	2,575,267.00	2.56
3	300502	新易盛	2,368,994.00	2.35
4	600519	贵州茅台	2,110,821.00	2.10
5	601899	紫金矿业	1,509,108.00	1.50
6	601318	中国平安	1,267,242.00	1.26
7	300274	阳光电源	1,259,502.00	1.25
8	688008	澜起科技	1,246,625.14	1.24
9	600673	东阳光	1,220,768.00	1.21
10	603259	药明康德	1,156,270.00	1.15
11	000426	兴业银锡	1,137,092.00	1.13
12	000657	中钨高新	1,123,686.00	1.12
13	600183	生益科技	1,100,011.00	1.09

14	601138	工业富联	1,095,377.00	1.09
15	600900	长江电力	1,079,430.00	1.07
16	000338	潍柴动力	1,010,659.00	1.00
17	000792	盐湖股份	1,003,806.00	1.00
18	688041	海光信息	1,003,363.00	1.00
19	601166	兴业银行	984,269.00	0.98
20	600549	厦门钨业	958,234.00	0.95

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	159,078,644.52
卖出股票收入（成交）总额	217,896,952.09

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在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未超过基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,618.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,618.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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 中证8 00指 数增 强A	2,387	5,445.95	-	-	12,999,473.67	100.00%
国联 中证8 00指 数增 强C	385	73,860.36	10,001,555.55	35.17%	18,434,684.19	64.83%
合计	2,772	14,947.95	10,001,555.55	24.14%	31,434,157.86	75.86%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	国联中证800指数 增强A	18.72	0.00%
	国联中证800指数 增强C	-	-
	合计	18.72	0.00%

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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	国联中证800指数增强A	国联中证800指数增强C
基金合同生效日(2025年09月23日)基金份额总额	67,498,379.92	216,227,869.61
本报告期期初基金份额总额	34,988,016.08	64,322,067.18
本报告期基金总申购份额	4,049,164.09	1,582,993.39
减：本报告期基金总赎回份额	26,037,706.50	37,468,820.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,999,473.67	28,436,239.74

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营以及涉及基金财产的诉讼。
本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

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

注：本报告期内管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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	
国泰	2	50,840,124.70	13.49%	9,453.65	13.15%	-

海通 证券						
西南 证券	2	270,946,776.22	71.88%	51,855.76	72.15%	-
湘财 证券	2	55,153,875.89	14.63%	10,565.30	14.70%	-

注：①根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等法规及监管要求，公司制定了选择券商的标准，即为：

- 1、财务状况良好；
- 2、经营行为规范；
- 3、合规风控能力和交易能力较强；
- 4、研究能力较强，可为公司提供需要的研究支持。研究能力包括但不限于：
 - （1）有较强的宏观及行业研究能力。能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并进行路演、培训等。
 - （2）有较强的数据资源提供能力。拥有丰富的数据库资源，能够及时准确地为公司提供国内外宏观经济、政策、行业、公司等各层面的学术文献、研究报告、信息资讯、数据资源等。
 - （3）有提供特色定制服务的能力。能够根据不同类型基金投资的特点，提供专门的定制研究和定制服务（如专题研究、专题会议、专题路演、专题研讨等）。

②券商专用交易单元选择程序：

- 1、对提供服务的券商按照上述标准进行遴选及审批，确定合作券商；
- 2、本基金管理人与合作券商签订相关协议。

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

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	国联基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-27

§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	20260507-20260630	10,001,555.55	0.00	0.00	10,001,555.55	24.14%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。 当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予国联中证800指数增强型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《国联中证800指数增强型证券投资基金基金合同》
- （三）《国联中证800指数增强型证券投资基金托管协议》
- （四）关于申请募集注册国联中证800指数增强型证券投资基金的法律意见
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，（010）56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日