

国联中证 500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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:2025 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，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月15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2025年01月01日起至2025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	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64

§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
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.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	国联中证500指数增强	
基金主代码	021051	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年08月13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	59,593,225.53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500指数增强 A	国联中证500指数增强 C
下属分级基金的交易代码	021051	021052
报告期末下属分级基金的份额总额	47,362,325.27份	12,230,900.26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、股指期货投资策略；8、国债期货投资策略；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500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。

	<p>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。</p>
--	--

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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.glfund.com
基金中期报告备置地点	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	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 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	国联中证500指数增强A	国联中证500指数增强C
本期已实现收益	2,231,939.67	646,884.84
本期利润	5,508,190.24	2,234,576.81
加权平均基金份额本期利润	0.1343	0.0894
本期加权平均净值利润率	11.31%	7.60%
本期基金份额净值增长率	8.57%	8.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	12,563,916.83	3,186,522.51
期末可供分配基金份额利润	0.2653	0.2605
期末基金资产净值	59,926,242.10	15,417,422.77
期末基金份额净值	1.2653	1.2605
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	26.53%	26.05%

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500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
过去一个月	5.20%	0.72%	4.09%	0.75%	1.11%	-0.03%
过去三个月	5.52%	1.39%	0.97%	1.43%	4.55%	-0.04%
过去六个月	8.57%	1.22%	3.21%	1.29%	5.36%	-0.07%
自基金合同生效起至今	26.53%	1.47%	24.28%	1.68%	2.25%	-0.21%

国联中证500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
过去一个月	5.16%	0.72%	4.09%	0.75%	1.07%	-0.03%
过去三个月	5.41%	1.39%	0.97%	1.43%	4.44%	-0.04%
过去六个月	8.36%	1.21%	3.21%	1.29%	5.15%	-0.08%
自基金合同生效起至今	26.05%	1.47%	24.28%	1.68%	1.77%	-0.21%

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500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
(2024年08月13日-2025年06月30日)



国联中证500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
(2024年08月13日-2025年06月30日)



注：按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起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2025年6月30日，国联基金管理有限公司共管理90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年中高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、国联智选红利股票型证券投资基金、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、国联研发创新混合型证券投资基金、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、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、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、国联鑫锐研究精选一年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、国联金融鑫选3个月持有期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、国联养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、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、国联消费精选混合型证券投资基金、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、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金、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

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		
陈薪羽	国联央视财经50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联接基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联智选红利股票型证券投资基金、	2024-08-13	-	9	陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入公司，现任多策略投资部基金经理。

	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、国联景盛一年持有期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的基金经理。				
王喆	国联高股息精选混合型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、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的基金经理及公司总裁助理、多策略投资部总经理、权益投研部总经理。	2024-08-20	-	10	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10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,现任公司总裁助理、多策略投资部总经理、权益投研部总经理。
黄磊鑫	国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联中证500指数增强型	2025-04-11	-	4	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4年。2021年6月

	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。				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

2025年上半年，A股市场在宏观经济复苏预期、政策红利释放以及外部环境变化的多重因素推动下，整体呈现震荡上行走势，但不同指数与行业板块间表现分化明显。从节奏上看，市场呈“N型”走势：年初至3月中旬在经济预期修复与政策持续加码带动下震荡上行；3月下旬受外部扰动影响出现调整；随后在中长期资金稳步入市以及政策工具加速落地的合力推动下，自4月中旬起市场重拾升势，延续至年中。

截至2025年6月30日，上证指数年内累计上涨2.76%，沪深300上涨0.03%，中证500上涨3.31%。风格上，小盘股显著跑赢大盘股。港股市场亦表现亮眼，恒生指数上涨20%，恒生科技指数上涨18.68%。行业方面，有色、军工、银行板块领涨，地产、煤炭及食品饮料板块跌幅居前。

基金运作方面，本基金以中证500指数为标的，通过多因子量化投资策略构建股票组合，在严控跟踪误差的前提下，力争实现稳健、可持续、具备高胜率的超额收益。上半年策略运行平稳，策略表现整体符合预期，风险控制良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联中证500指数增强A基金份额净值为1.2653元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.57%，同期业绩比较基准收益率为3.21%；截至报告期末国联中证500指数增强C基金份额净值为1.2605元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.36%，同期业绩比较基准收益率为3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年，全球市场并不太平，既有美国关税战的反复拉扯，以伊地缘冲突引发的战争危机，也有年初以deepseek、宇树机器人引领的中国资产重估，还有局部市场中新消费主题下对labubu等IP价值的重新认知。资产定价的信号并不一致，但归结到宏观叙事层面，我们认为有两个大方向，一是中国资产风险偏好提升，一是美国信用脆弱下的全球美元退潮。深究背后原因，实质是世界老格局已打破新格局未形成下科技革命、财政转型、贸易战等因素合力驱动的全球供应链重塑。

当前全球正在经历新一轮技术革命，疫情后通胀中枢上移，全球主要国家正在调整财政模式，美国财政赤字率收敛，中国财政转型进一步加速，与此同时美国想借由贸易战重塑全球供应链格局，这些变化一旦成型，都将被资本市场充分定价。

随着中国资产风险偏好的提升，不管是内资南下还是外资流入，港股成交量翻倍流动性变好，而A股继港股后也逐步转为增量市场，中国资产正在被重新估值。下半年股票市场将继续交易流动性，最重要的是不断寻找新的存在预期差且未来能够形成资金共识的板块。

展望2025年下半年，外部不确定性加大与国内有效需求不足仍是市场面临的核心挑战。但在政策持续加力的背景下，经济基本面有望延续修复态势，展现出较强韧性。

资金面角度，伴随中长期资金持续流入以及多项政策工具的落地实施，A股流动性环境预计将延续改善趋势。同时，居民财富加速向金融资产配置的趋势明确，有望为市场带来持续的增量资金支持，后续可重点关注市场情绪的边际修复节奏。估值角度，当前A股整体处于历史中等水平，较海外成熟市场仍具相对吸引力。从风险溢价与股息率角度看，A股中长期配置价值突出，具备较高的投资性价比。下半年仍需关注海外不确定性因素以及国内经济基本面修复节奏对风险偏好的扰动。

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。

§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500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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，国联基金管理有限公司在国联中证500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

本报告期内，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500指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	18,156,572.19	5,847,544.34
结算备付金		1,097,053.01	784,434.23
存出保证金		704,088.00	823,622.40
交易性金融资产	6.4.7.2	65,059,461.95	97,537,735.62
其中：股票投资		65,040,754.54	91,062,724.99
基金投资		-	-
债券投资		18,707.41	6,475,010.63
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		3,224,718.51	899,024.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		88,241,893.66	105,892,360.98
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		12,771,086.71	2,020,246.04
应付管理人报酬		32,807.24	44,028.75
应付托管费		6,561.46	8,805.76
应付销售服务费		6,495.12	16,379.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,129.10	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	70,149.16	11,500.00
负债合计		12,898,228.79	2,100,960.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	59,593,225.53	89,139,562.83
未分配利润	6.4.7.8	15,750,439.34	14,651,837.73
净资产合计		75,343,664.87	103,791,400.56
负债和净资产总计		88,241,893.66	105,892,360.98

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额总额59,593,225.53份，其中A类基金份额的份额总额为47,362,325.27份，份额净值1.2653元；C类基金份额的份额总额为12,230,900.26份，份额净值1.2605元。

6.2 利润表

会计主体：国联中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至2025年0 6月30日
一、营业总收入		8,107,361.57
1.利息收入		19,847.74
其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,421.33
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		3,426.41
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,993,130.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,984,973.34
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	12,583.06
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	297,826.39
股利收益	6.4.7.16	697,747.23
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	4,863,942.54
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	230,441.27
减：二、营业总支出		364,594.52
1.管理人报酬		195,473.92
2.托管费		39,094.76
3.销售服务费		59,519.70

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		1,081.78
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）		7,742,767.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,742,767.05
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		7,742,767.05

注：本基金合同于2024年08月13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500指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025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	89,139,562.83	14,651,837.73	103,791,400.56
二、本期期初净资产	89,139,562.83	14,651,837.73	103,791,400.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-29,546,337.30	1,098,601.61	-28,447,735.69
（一）、综合收益总额	-	7,742,767.05	7,742,767.05
（二）、本期基金份额交易产生的净	-29,546,337.30	-6,644,165.44	-36,190,502.74

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	234,569,198.36	47,885,432.57	282,454,630.93
2.基金赎回款	-264,115,535.66	-54,529,598.01	-318,645,133.67
（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	59,593,225.53	15,750,439.34	75,343,664.87

注：本基金合同于2024年08月13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500指数增强型证券投资基金(以下简称“国联中证500指数增强”)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〔2024〕392号文《关于准予国联中证500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500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2024年8月13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2024年7月22日至2024年8月9日，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411,713,606.46元，折合411,713,606.46份“国联中证500指数增强”基金份额。有效认购户数为3,224户。其中，“国联中证500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163,092,395.20元，折合163,092,395.20份“国联中证500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36,384.06元，折合36,384.06份“国联中证500指数增强”A类基金份额。

“国联中证500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248,534,940.69元，折合248,534,940.69份“国联中证500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49,886.51元，折合49,886.51份“国联中证500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）。本基金将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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等。如法律法规或监管机构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。

本基金业绩比较基准为本基金的业绩比较基准：中证500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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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2025年06月30日的财务状况以及2025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

根据财政部、国家税务总局财税[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[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》、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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，暂免予缴纳印花税、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 2025年06月30日
活期存款	11,423,316.69
等于：本金	11,421,689.19
加：应计利息	1,627.50
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	6,733,255.50
等于：本金	6,733,128.90
加：应计利息	126.60
减：坏账准备	-
合计	18,156,572.19

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 2025年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	63,840,529.88	-	65,040,754.54	1,200,224.66	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,700.00	5.28	18,707.41	5,002.13
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,700.00	5.28	18,707.41	5,002.13
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	63,854,229.88	5.28	65,059,461.95	1,205,226.79	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06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	5,713,066.67	-	-	-
--股指期货	5,713,066.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,713,066.67	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为零。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)抵销后无余额。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2507	中证500股指期货2507合约	5.00	5,867,400.00	154,333.33
合计				154,333.33
减：可抵销 期货暂收 款				154,333.33
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,424.36
其他应付	724.80
合计	70,149.16

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 国联中证500指数增强A**

金额单位：人民币元

项目 (国联中证500指数增强A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	45,665,575.90	45,665,575.90
本期申购	161,660,473.11	161,660,473.11
本期赎回(以“-”号填列)	-159,963,723.74	-159,963,723.74
本期末	47,362,325.27	47,362,325.27

6.4.7.7.2 国联中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(国联中证500指数增强C)	2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	43,473,986.93	43,473,986.93
本期申购	72,908,725.25	72,908,725.25
本期赎回(以“-”号填列)	-104,151,811.92	-104,151,811.92
本期末	12,230,900.26	12,230,900.26

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500指数增强A

单位：人民币元

项目 (国联中证500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	11,734,522.72	-4,182,447.72	7,552,075.00
本期期初	11,734,522.72	-4,182,447.72	7,552,075.00
本期利润	2,231,939.67	3,276,250.57	5,508,190.24
本期基金份额交易产生的变动数	873,209.47	-1,369,557.88	-496,348.41
其中：基金申购款	44,381,570.85	-10,299,435.09	34,082,135.76
基金赎回款	-43,508,361.38	8,929,877.21	-34,578,484.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,839,671.86	-2,275,755.03	12,563,916.83

6.4.7.8.2 国联中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (国联中证500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	11,073,761.66	-3,973,998.93	7,099,762.73
本期期初	11,073,761.66	-3,973,998.93	7,099,762.73
本期利润	646,884.84	1,587,691.97	2,234,576.81

本期基金份额交易产生的变动数	-7,946,942.01	1,799,124.98	-6,147,817.03
其中：基金申购款	19,035,101.33	-5,231,804.52	13,803,296.81
基金赎回款	-26,982,043.34	7,030,929.50	-19,951,113.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,773,704.49	-587,181.98	3,186,522.51

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	6,928.19
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,583.24
结算备付金利息收入	5,909.90
其他	-
合计	16,421.33

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
	2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	391,656,943.44
减：卖出股票成本总额	389,282,726.78
减：交易费用	389,243.32
买卖股票差价收入	1,984,973.34

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	10,859.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,723.17
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,583.06

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,481,085.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,404,302.38
减：应计利息总额	74,865.24
减：交易费用	194.45
买卖债券差价收入	1,723.17

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**6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
期货投资	297,826.39

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	697,747.23
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	697,747.23

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	4,488,643.77
——股票投资	4,490,339.26
——债券投资	-1,695.49
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	380,333.33
——权证投资	-
——期货投资	380,333.33
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	5,034.56
合计	4,863,942.54

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	230,441.27
合计	230,441.27

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
	2025年01月01日至2025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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**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
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东

交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
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：（1）根据国联民生证券股份有限公司公告，自2025年2月7日起，公司名称由“国联证券股份有限公司”正式变更为“国联民生证券股份有限公司”。

（2）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 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	195,473.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	88,951.66
应支付基金管理人的净管理费	106,522.26

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X0.50%/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
	2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,094.76

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，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X0.10%/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		
	2025年01月01日至2025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500指数增强A	国联中证500指数增强C	合计
国联基金管理有限公司	0.00	2,345.77	2,345.77
国联民生证券股份有限公司	0.00	53.96	53.96
交通银行股份有限公司	0.00	5,128.28	5,128.28
合计	-	7,528.01	7,528.01

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类基金资产净值的年费率计提，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 2025年01月01日至2025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	11,423,316.69	6,928.19

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（2025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：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123257	安克转债	2025-06-16	1个月内（含）	新债未流通	100.00	100.01	4	400.00	400.03	-

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-

AAA以下	18,707.41	-
未评级	-	-
合计	18,707.41	-

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

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 2025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	18,156,572.19	-	-	-	18,156,572.19
结算备付金	1,097,053.01	-	-	-	1,097,053.01
存出保证金	704,088.00	-	-	-	704,088.00
交易性金融资产	18,707.41	-	-	65,040,754.54	65,059,461.95
应收申购款	-	-	-	3,224,718.51	3,224,718.51
资产总计	19,976,420.61	-	-	68,265,473.05	88,241,893.66
负债					
应付赎回	-	-	-	12,771,086.71	12,771,086.71

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	32,807.24	32,807.24
应付托管费	-	-	-	6,561.46	6,561.46
应付销售服务费	-	-	-	6,495.12	6,495.12
应交税费	-	-	-	11,129.10	11,129.10
其他负债	-	-	-	70,149.16	70,149.16
负债总计	-	-	-	12,898,228.79	12,898,228.79
利率敏感度缺口	19,976,420.61	-	-	55,367,244.26	75,343,664.87
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,847,544.34	-	-	-	5,847,544.34
结算备付金	784,434.23	-	-	-	784,434.23
存出保证金	823,622.40	-	-	-	823,622.40
交易性金融资产	6,475,010.63	-	-	91,062,724.99	97,537,735.62
应收申购款	-	-	-	899,024.39	899,024.39
资产总计	13,930,611.60	-	-	91,961,749.38	105,892,360.98

负债					
应付赎回款	-	-	-	2,020,246.04	2,020,246.04
应付管理人报酬	-	-	-	44,028.75	44,028.75
应付托管费	-	-	-	8,805.76	8,805.76
应付销售服务费	-	-	-	16,379.87	16,379.87
其他负债	-	-	-	11,500.00	11,500.00
负债总计	-	-	-	2,100,960.42	2,100,960.42
利率敏感度缺口	13,930,611.60	-	-	89,860,788.96	103,791,400.56

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 2025年06月30日		上年度末 2024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	65,040,754.54	86.33	91,062,724.99	87.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	18,707.41	0.02	6,475,010.63	6.24
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	65,059,461.95	86.35	97,537,735.62	93.97

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
沪深300指数上升5%	3,489,599.91	4,473,375.77
沪深300指数下降5%	-3,489,599.91	-4,473,375.77

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	65,059,061.92	91,062,724.99
第二层次	400.03	6,475,010.63
第三层次	-	-
合计	65,059,461.95	97,537,735.62

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	65,040,754.54	73.71
	其中：股票	65,040,754.54	73.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,707.41	0.02
	其中：债券	18,707.41	0.02
	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	19,253,625.20	21.82
8	其他各项资产	3,928,806.51	4.45
9	合计	88,241,893.66	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	251,104.00	0.33
B	采矿业	1,476,796.00	1.96
C	制造业	35,519,723.63	47.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,508,501.00	2.00
E	建筑业	385,380.00	0.51
F	批发和零售业	1,880,232.00	2.50
G	交通运输、仓储和邮政业	866,487.00	1.15
H	住宿和餐饮业	309,777.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,921,315.50	6.53
J	金融业	6,001,921.90	7.97
K	房地产业	989,590.18	1.31
L	租赁和商务服务业	523,668.40	0.70
M	科学研究和技术服务业	131,741.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	524,011.70	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	357,408.00	0.47
Q	卫生和社会工作	427,749.00	0.57
R	文化、体育和娱乐业	1,117,649.00	1.48
S	综合	26,749.00	0.04
	合计	57,219,804.31	75.95

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	65,614.00	0.09
B	采矿业	24,871.00	0.03
C	制造业	6,022,113.23	7.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	184,915.00	0.25
E	建筑业	78,302.00	0.10
F	批发和零售业	27,768.00	0.04
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	1,031,392.00	1.37
J	金融业	142,426.00	0.19
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	130,541.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	113,008.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	7,820,950.23	10.38

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	300476	胜宏科技	5,200	698,776.00	0.93
2	000988	华工科技	13,600	639,336.00	0.85
3	300339	润和软件	10,500	533,715.00	0.71
4	002340	格林美	80,100	508,635.00	0.68
5	300207	欣旺达	24,100	483,446.00	0.64
6	002273	水晶光电	23,300	465,301.00	0.62
7	601168	西部矿业	27,400	455,662.00	0.60
8	300017	网宿科技	42,400	454,528.00	0.60
9	002517	恺英网络	23,500	453,785.00	0.60
10	600885	宏发股份	20,320	453,339.20	0.60
11	002472	双环传动	12,900	432,021.00	0.57
12	600487	亨通光电	28,200	431,460.00	0.57
13	601577	长沙银行	43,200	429,408.00	0.57
14	688469	芯联集成	89,708	427,907.16	0.57
15	600862	中航高科	16,400	427,712.00	0.57
16	002138	顺络电子	15,100	424,612.00	0.56
17	002595	豪迈科技	7,100	420,462.00	0.56
18	000783	长江证券	60,500	419,265.00	0.56
19	300395	菲利华	8,200	419,020.00	0.56
20	688122	西部超导	8,072	418,775.36	0.56
21	002532	天山铝业	50,200	417,162.00	0.55
22	002410	广联达	31,100	417,051.00	0.55
23	300054	鼎龙股份	14,500	415,860.00	0.55
24	600143	金发科技	40,000	412,400.00	0.55
25	601555	东吴证券	47,000	411,250.00	0.55
26	300496	中科创达	7,100	406,262.00	0.54
27	600873	梅花生物	38,000	406,220.00	0.54
28	688249	晶合集成	19,889	403,150.03	0.54

29	000728	国元证券	50,900	401,601.00	0.53
30	000021	深科技	21,400	401,036.00	0.53
31	600895	张江高科	15,600	400,920.00	0.53
32	603087	甘李药业	7,300	399,894.00	0.53
33	605589	圣泉集团	13,900	385,725.00	0.51
34	000932	华菱钢铁	86,900	382,360.00	0.51
35	300001	特锐德	15,930	381,842.10	0.51
36	002673	西部证券	47,500	374,300.00	0.50
37	000878	云南铜业	29,400	373,968.00	0.50
38	601717	中创智领	22,500	373,950.00	0.50
39	601990	南京证券	46,200	373,296.00	0.50
40	600699	均胜电子	21,400	373,216.00	0.50
41	688777	中控技术	8,310	373,202.10	0.50
42	002414	高德红外	36,300	372,075.00	0.49
43	002007	华兰生物	23,700	371,379.00	0.49
44	600398	海澜之家	52,700	366,792.00	0.49
45	600497	驰宏锌锗	68,300	361,307.00	0.48
46	600369	西南证券	83,000	361,050.00	0.48
47	002409	雅克科技	6,600	360,954.00	0.48
48	300724	捷佳伟创	6,600	358,380.00	0.48
49	600909	华安证券	61,400	357,962.00	0.48
50	002607	中公教育	116,800	357,408.00	0.47
51	601665	齐鲁银行	56,500	357,080.00	0.47
52	600498	烽火通信	16,900	355,407.00	0.47
53	600637	东方明珠	47,100	351,837.00	0.47
54	000415	渤海租赁	103,600	344,988.00	0.46
55	000960	锡业股份	22,400	342,720.00	0.45
56	000887	中鼎股份	19,400	341,246.00	0.45
57	603338	浙江鼎力	7,100	336,540.00	0.45
58	600312	平高电气	21,800	335,502.00	0.45
59	600166	福田汽车	123,108	333,622.68	0.44

60	002244	滨江集团	33,700	328,575.00	0.44
61	300763	锦浪科技	5,700	327,123.00	0.43
62	000426	兴业银锡	20,600	325,480.00	0.43
63	600079	人福医药	15,500	325,190.00	0.43
64	002603	以岭药业	23,000	324,300.00	0.43
65	000921	海信家电	12,600	323,820.00	0.43
66	000060	中金岭南	70,500	322,890.00	0.43
67	600535	天士力	20,600	322,390.00	0.43
68	300146	汤臣倍健	28,500	320,340.00	0.43
69	000636	风华高科	23,200	318,768.00	0.42
70	600282	南钢股份	75,100	315,420.00	0.42
71	600131	国网信通	17,800	315,060.00	0.42
72	600177	雅戈尔	43,111	314,710.30	0.42
73	002966	苏州银行	35,800	314,324.00	0.42
74	300285	国瓷材料	18,100	314,035.00	0.42
75	600483	福能股份	32,500	313,300.00	0.42
76	000598	兴蓉环境	43,400	312,914.00	0.42
77	300529	健帆生物	14,500	312,765.00	0.42
78	000050	深天马A	36,600	311,832.00	0.41
79	002507	涪陵榨菜	24,300	310,797.00	0.41
80	300735	光弘科技	12,220	306,722.00	0.41
81	601918	新集能源	47,400	306,204.00	0.41
82	600737	中粮糖业	32,400	306,180.00	0.41
83	002429	兆驰股份	69,900	306,162.00	0.41
84	002430	杭氧股份	15,600	302,952.00	0.40
85	002439	启明星辰	18,900	302,211.00	0.40
86	600582	天地科技	50,000	299,500.00	0.40
87	600959	江苏有线	86,060	296,046.40	0.39
88	002299	圣农发展	20,700	295,803.00	0.39
89	600517	国网英大	57,800	294,780.00	0.39
90	300595	欧普康视	19,200	293,184.00	0.39

91	002572	索菲亚	20,800	291,408.00	0.39
92	601608	中信重工	66,600	291,042.00	0.39
93	601156	东航物流	22,200	290,598.00	0.39
94	603565	中谷物流	30,400	290,320.00	0.39
95	000739	普洛药业	20,700	289,800.00	0.38
96	603233	大参林	17,700	288,510.00	0.38
97	600056	中国医药	27,700	286,418.00	0.38
98	600528	中铁工业	38,800	286,344.00	0.38
99	000893	亚钾国际	9,500	286,330.00	0.38
100	002372	伟星新材	26,900	278,684.00	0.37
101	600258	首旅酒店	19,700	278,361.00	0.37
102	603160	汇顶科技	3,900	277,017.00	0.37
103	688425	铁建重工	67,326	274,690.08	0.36
104	002841	视源股份	7,900	273,340.00	0.36
105	600096	云天化	12,400	272,428.00	0.36
106	601933	永辉超市	55,400	271,460.00	0.36
107	688172	燕东微	13,656	268,476.96	0.36
108	000729	燕京啤酒	20,700	267,651.00	0.36
109	601921	浙版传媒	33,100	266,786.00	0.35
110	603379	三美股份	5,500	264,660.00	0.35
111	600704	物产中大	50,200	264,554.00	0.35
112	300888	稳健医疗	6,400	263,040.00	0.35
113	601233	桐昆股份	24,800	262,880.00	0.35
114	000623	吉林敖东	15,500	262,725.00	0.35
115	301267	华夏眼科	13,700	262,629.00	0.35
116	600685	中船防务	9,600	261,024.00	0.35
117	600208	衢州发展	87,867	260,086.32	0.35
118	002739	万达电影	22,700	259,461.00	0.34
119	300919	中伟股份	7,800	256,464.00	0.34
120	601061	中信金属	32,400	256,284.00	0.34
121	300140	节能环境	40,800	251,736.00	0.33

122	601118	海南橡胶	53,200	251,104.00	0.33
123	600329	达仁堂	7,500	250,200.00	0.33
124	601099	太平洋	63,250	248,572.50	0.33
125	600109	国金证券	27,900	244,683.00	0.32
126	600352	浙江龙盛	24,000	243,840.00	0.32
127	300450	先导智能	9,800	243,530.00	0.32
128	688475	萤石网络	7,600	239,552.00	0.32
129	300627	华测导航	6,800	238,000.00	0.32
130	002624	完美世界	15,600	236,652.00	0.31
131	300144	宋城演艺	27,600	235,980.00	0.31
132	600970	中材国际	27,000	231,660.00	0.31
133	300699	光威复材	7,200	228,024.00	0.30
134	601098	中南传媒	17,300	226,976.00	0.30
135	001286	陕西能源	24,300	211,410.00	0.28
136	002078	太阳纸业	15,500	208,630.00	0.28
137	300136	信维通信	9,100	203,840.00	0.27
138	688387	信科移动	35,824	202,405.60	0.27
139	601139	深圳燃气	30,500	193,980.00	0.26
140	601568	北元集团	45,900	190,485.00	0.25
141	002385	大北农	46,800	189,072.00	0.25
142	600008	首创环保	62,100	187,542.00	0.25
143	603568	伟明环保	9,800	186,984.00	0.25
144	600998	九州通	36,300	186,582.00	0.25
145	002500	山西证券	31,430	183,551.20	0.24
146	000683	博源化工	38,100	182,499.00	0.24
147	300070	碧水源	39,961	179,824.50	0.24
148	002056	横店东磁	12,700	179,705.00	0.24
149	600988	赤峰黄金	7,200	179,136.00	0.24
150	000034	神州数码	4,700	176,908.00	0.23
151	603816	顾家家居	6,900	176,088.00	0.23
152	601958	金钼股份	15,700	171,758.00	0.23

153	688072	拓荆科技	1,100	169,081.00	0.22
154	000750	国海证券	41,000	168,920.00	0.22
155	300573	兴齐眼药	3,200	165,728.00	0.22
156	600763	通策医疗	4,000	165,120.00	0.22
157	601997	贵阳银行	26,100	162,864.00	0.22
158	601696	中银证券	14,800	158,212.00	0.21
159	000825	太钢不锈	43,900	157,601.00	0.21
160	002266	浙富控股	51,040	157,203.20	0.21
161	300346	南大光电	4,900	155,036.00	0.21
162	601598	中国外运	31,200	153,816.00	0.20
163	600820	隧道股份	25,200	153,720.00	0.20
164	600380	健康元	13,700	151,111.00	0.20
165	300373	扬杰科技	2,700	140,130.00	0.19
166	000951	中国重汽	7,800	137,124.00	0.18
167	600839	四川长虹	13,700	133,164.00	0.18
168	600299	安迪苏	13,700	132,205.00	0.18
169	002261	拓维信息	4,000	123,800.00	0.16
170	002958	青农商行	34,200	123,462.00	0.16
171	300623	捷捷微电	4,100	122,180.00	0.16
172	600906	财达证券	17,800	121,396.00	0.16
173	600118	中国卫星	4,200	119,994.00	0.16
174	601965	中国汽研	6,500	115,375.00	0.15
175	603858	步长制药	6,700	108,808.00	0.14
176	000403	派林生物	6,000	108,780.00	0.14
177	002223	鱼跃医疗	3,000	106,800.00	0.14
178	688608	恒玄科技	300	104,394.00	0.14
179	601179	中国西电	16,800	103,152.00	0.14
180	300058	蓝色光标	15,540	101,942.40	0.14
181	001213	中铁特货	24,900	101,094.00	0.13
182	601162	天风证券	20,500	101,065.00	0.13
183	600361	创新新材	24,300	96,957.00	0.13

184	002262	恩华药业	4,600	95,588.00	0.13
185	000423	东阿阿胶	1,800	94,140.00	0.12
186	688213	思特威	900	91,998.00	0.12
187	688538	和辉光电	39,304	91,971.36	0.12
188	688521	芯原股份	900	86,850.00	0.12
189	601399	国机重装	28,900	86,700.00	0.12
190	600021	上海电力	9,200	80,868.00	0.11
191	002195	岩山科技	14,000	78,820.00	0.10
192	300803	指南针	970	78,240.20	0.10
193	002831	裕同科技	3,300	77,286.00	0.10
194	600153	建发股份	7,400	76,738.00	0.10
195	603893	瑞芯微	500	75,930.00	0.10
196	600511	国药股份	2,600	75,816.00	0.10
197	002939	长城证券	9,000	75,420.00	0.10
198	002156	通富微电	2,900	74,298.00	0.10
199	600739	辽宁成大	6,700	73,700.00	0.10
200	000563	陕国投A	20,600	73,542.00	0.10
201	600578	京能电力	15,800	70,942.00	0.09
202	002558	巨人网络	2,900	68,295.00	0.09
203	600801	华新水泥	5,700	67,488.00	0.09
204	688120	华海清科	400	67,480.00	0.09
204	601106	中国一重	24,100	67,480.00	0.09
205	600062	华润双鹤	3,600	67,176.00	0.09
206	300251	光线传媒	3,300	66,891.00	0.09
207	002153	石基信息	7,500	64,950.00	0.09
208	601019	山东出版	6,500	61,555.00	0.08
209	600536	中国软件	1,300	60,801.00	0.08
210	002608	江苏国信	8,200	60,106.00	0.08
211	688617	惠泰医疗	200	59,400.00	0.08
212	000066	中国长城	4,000	59,200.00	0.08
213	002670	国盛金控	3,900	58,695.00	0.08

214	600298	安琪酵母	1,600	56,272.00	0.07
215	001696	宗申动力	2,400	53,880.00	0.07
216	002465	海格通信	3,800	52,972.00	0.07
217	300474	景嘉微	700	51,100.00	0.07
218	600707	彩虹股份	7,700	49,742.00	0.07
219	601991	大唐发电	15,500	49,135.00	0.07
220	000933	神火股份	2,900	48,256.00	0.06
221	002294	信立泰	1,000	47,330.00	0.06
222	000831	中国稀土	1,300	46,956.00	0.06
223	688235	百济神州	200	46,728.00	0.06
224	000528	柳工	4,700	45,167.00	0.06
225	002065	东华软件	4,300	41,280.00	0.05
226	603156	养元饮品	1,900	40,204.00	0.05
227	688578	艾力斯	400	37,216.00	0.05
228	600879	航天电子	3,400	35,598.00	0.05
229	600688	上海石化	12,400	35,340.00	0.05
230	601108	财通证券	4,100	32,431.00	0.04
231	002185	华天科技	3,200	32,320.00	0.04
232	600754	锦江酒店	1,400	31,416.00	0.04
233	000429	粤高速A	2,300	30,659.00	0.04
234	603658	安图生物	800	30,000.00	0.04
235	600549	厦门钨业	1,400	29,288.00	0.04
236	600295	鄂尔多斯	3,300	28,743.00	0.04
237	688099	晶晨股份	400	28,404.00	0.04
238	601158	重庆水务	6,100	28,304.00	0.04
239	300454	深信服	300	28,254.00	0.04
240	002353	杰瑞股份	800	28,000.00	0.04
241	688002	睿创微纳	400	27,888.00	0.04
242	300458	全志科技	700	27,783.00	0.04
243	300223	北京君正	400	27,680.00	0.04
244	002797	第一创业	3,900	27,612.00	0.04

245	600673	东阳光	2,300	26,749.00	0.04
246	000009	中国宝安	3,000	26,640.00	0.04
247	003031	中瓷电子	500	26,605.00	0.04
248	603596	伯特利	500	26,345.00	0.03
249	002130	沃尔核材	1,100	26,202.00	0.03
250	300212	易华录	1,200	26,112.00	0.03
251	000997	新大陆	800	25,904.00	0.03
252	002738	中矿资源	800	25,728.00	0.03
253	002085	万丰奥威	1,600	25,424.00	0.03
254	603605	珀莱雅	300	24,837.00	0.03
255	002281	光迅科技	500	24,660.00	0.03
256	300002	神州泰岳	2,000	23,600.00	0.03
257	600363	联创光电	400	23,332.00	0.03
258	002850	科达利	200	22,634.00	0.03
259	300024	机器人	1,300	22,334.00	0.03
260	601198	东兴证券	2,000	22,300.00	0.03
261	603129	春风动力	100	21,650.00	0.03
262	002202	金风科技	2,100	21,525.00	0.03
263	002436	兴森科技	1,600	21,184.00	0.03
264	603606	东方电缆	400	20,684.00	0.03
265	300765	新诺威	400	20,676.00	0.03
266	600580	卧龙电驱	1,040	20,560.80	0.03
267	600141	兴发集团	1,000	20,530.00	0.03
268	002851	麦格米特	400	20,056.00	0.03
269	600985	淮北矿业	1,700	19,278.00	0.03
269	002155	湖南黄金	1,080	19,278.00	0.03
270	300115	长盈精密	900	19,260.00	0.03
271	300604	长川科技	400	17,964.00	0.02
272	601615	明阳智能	1,500	17,235.00	0.02
273	300857	协创数据	200	17,212.00	0.02
274	002008	大族激光	700	17,059.00	0.02

275	688361	中科飞测	200	16,838.00	0.02
276	300012	华测检测	1,400	16,366.00	0.02
277	603000	人民网	800	16,168.00	0.02
278	603345	安井食品	200	16,084.00	0.02
279	300383	光环新网	1,100	15,730.00	0.02
280	688220	翱捷科技	200	15,660.00	0.02
281	000959	首钢股份	4,600	15,640.00	0.02
282	603659	璞泰来	800	15,024.00	0.02
283	000733	振华科技	300	15,015.00	0.02
284	002837	英维克	500	14,855.00	0.02
285	600171	上海贝岭	400	13,700.00	0.02
286	688180	君实生物	400	13,592.00	0.02
287	688525	佰维存储	200	13,480.00	0.02
288	600529	山东药玻	600	13,284.00	0.02
289	600392	盛和资源	900	11,853.00	0.02
290	601216	君正集团	2,100	11,592.00	0.02
291	300037	新宙邦	300	10,560.00	0.01
292	600663	陆家嘴	1	8.86	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	300777	中简科技	6,200	224,750.00	0.30
2	002881	美格智能	4,800	222,720.00	0.30
3	300206	理邦仪器	18,500	222,370.00	0.30
4	002655	共达电声	17,000	220,320.00	0.29
5	688147	微导纳米	7,300	220,314.00	0.29
6	002380	科远智慧	9,000	220,050.00	0.29
7	605111	新洁能	7,100	218,254.00	0.29

8	603306	华懋科技	5,000	217,500.00	0.29
9	002198	嘉应制药	34,400	211,560.00	0.28
10	002121	科陆电子	38,200	191,000.00	0.25
11	002373	千方科技	20,500	190,650.00	0.25
12	300113	顺网科技	9,100	179,816.00	0.24
13	688400	凌云光	6,400	176,448.00	0.23
14	002918	蒙娜丽莎	21,100	175,130.00	0.23
15	000100	TCL科技	40,230	174,195.90	0.23
16	002249	大洋电机	23,500	154,630.00	0.21
17	000001	平安银行	11,800	142,426.00	0.19
18	002079	苏州固锝	14,400	140,400.00	0.19
19	300628	亿联网络	4,000	139,040.00	0.18
20	002888	惠威科技	7,200	130,608.00	0.17
21	600619	海立股份	11,400	130,074.00	0.17
22	603466	风语筑	11,200	113,008.00	0.15
23	301329	信音电子	5,700	111,036.00	0.15
24	301578	辰奕智能	3,100	110,949.00	0.15
25	300241	瑞丰光电	19,400	110,580.00	0.15
26	002698	博实股份	7,100	110,334.00	0.15
27	002725	跃岭股份	8,300	109,394.00	0.15
28	002236	大华股份	6,700	106,396.00	0.14
29	300446	航天智造	6,000	103,920.00	0.14
30	002587	奥拓电子	15,900	102,555.00	0.14
31	300303	聚飞光电	15,900	100,806.00	0.13
32	603887	城地香江	5,100	88,434.00	0.12
33	300246	宝莱特	10,100	80,699.00	0.11
34	300316	晶盛机电	2,900	78,735.00	0.10
35	600667	太极实业	11,900	78,302.00	0.10
36	600728	佳都科技	14,100	76,845.00	0.10
37	600726	华电能源	32,300	75,582.00	0.10
38	300014	亿纬锂能	1,600	73,296.00	0.10

39	600718	东软集团	7,500	73,125.00	0.10
40	300762	上海瀚讯	3,000	67,890.00	0.09
41	001379	腾达科技	3,200	66,304.00	0.09
42	300292	吴通控股	13,500	65,745.00	0.09
43	600354	敦煌种业	10,600	65,614.00	0.09
44	600769	祥龙电业	6,300	65,205.00	0.09
45	002625	光启技术	1,600	63,968.00	0.08
46	002075	沙钢股份	10,800	62,856.00	0.08
47	002935	天奥电子	3,700	59,200.00	0.08
48	688009	中国通号	11,172	57,424.08	0.08
49	002102	能特科技	17,400	54,984.00	0.07
50	002445	中南文化	17,800	45,390.00	0.06
51	301359	东南电子	2,200	45,298.00	0.06
52	002434	万里扬	6,100	44,713.00	0.06
53	301106	骏成科技	1,500	44,700.00	0.06
54	003025	思进智能	3,300	44,682.00	0.06
55	688685	迈信林	800	44,680.00	0.06
56	301321	翰博高新	2,900	44,341.00	0.06
57	002420	毅昌科技	7,100	44,304.00	0.06
58	600654	中安科	14,900	44,253.00	0.06
59	002139	拓邦股份	3,200	44,192.00	0.06
60	600320	振华重工	10,100	44,137.00	0.06
61	002782	可立克	3,400	44,132.00	0.06
62	000157	中联重科	6,100	44,103.00	0.06
63	300360	炬华科技	2,800	44,100.00	0.06
64	600626	申达股份	12,100	43,923.00	0.06
65	603329	上海雅仕	3,900	43,875.00	0.06
66	002953	日丰股份	4,200	43,596.00	0.06
67	002823	凯中精密	3,100	43,493.00	0.06
68	301598	博科测试	700	43,155.00	0.06
69	600662	外服控股	8,300	42,413.00	0.06

70	603660	苏州科达	5,400	39,042.00	0.05
71	300124	汇川技术	600	38,742.00	0.05
72	600986	浙文互联	4,700	38,399.00	0.05
73	603344	星德胜	1,500	38,160.00	0.05
74	300168	万达信息	4,700	36,049.00	0.05
75	002296	辉煌科技	3,100	34,565.00	0.05
76	688055	龙腾光电	9,300	34,410.00	0.05
77	603811	诚意药业	3,300	30,459.00	0.04
78	300408	三环集团	900	30,060.00	0.04
79	600539	狮头股份	2,600	27,768.00	0.04
80	002209	达意隆	2,200	27,610.00	0.04
81	600719	大连热电	4,100	26,568.00	0.04
82	300691	联合光电	1,300	24,895.00	0.03
83	600489	中金黄金	1,700	24,871.00	0.03
84	002405	四维图新	2,800	23,912.00	0.03
85	002201	九鼎新材	3,400	22,270.00	0.03
86	300320	海达股份	2,100	20,874.00	0.03
87	600771	广誉远	1,000	20,160.00	0.03
88	600965	福成股份	3,900	19,188.00	0.03
89	000990	诚志股份	2,500	18,900.00	0.03
90	603583	捷昌驱动	500	18,260.00	0.02
91	000685	中山公用	2,000	17,560.00	0.02
92	002463	沪电股份	400	17,032.00	0.02
93	002668	TCL智家	1,700	16,609.00	0.02
94	300365	恒华科技	2,000	13,180.00	0.02
95	300413	芒果超媒	600	13,092.00	0.02
96	600850	电科数字	500	12,095.00	0.02
97	002011	盾安环境	1,000	11,600.00	0.02
98	301312	智立方	60	2,382.00	0.00
99	301399	英特科技	95	1,895.25	0.00
100	688567	孚能科技	98	1,421.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600418	江淮汽车	1,872,735.00	1.80
2	002625	光启技术	1,846,275.00	1.78
3	300476	胜宏科技	1,635,575.00	1.58
4	000988	华工科技	1,593,364.00	1.54
5	300012	华测检测	1,527,568.00	1.47
6	002384	东山精密	1,493,577.00	1.44
7	002340	格林美	1,448,061.00	1.40
8	600079	人福医药	1,444,205.00	1.39
9	002410	广联达	1,412,974.00	1.36
10	688777	中控技术	1,394,743.60	1.34
11	600699	均胜电子	1,394,556.00	1.34
12	603660	苏州科达	1,385,633.00	1.34
13	600498	烽火通信	1,341,986.00	1.29
14	000750	国海证券	1,337,243.00	1.29
15	002624	完美世界	1,324,953.00	1.28
16	600873	梅花生物	1,316,753.00	1.27
17	600497	驰宏锌锗	1,303,075.00	1.26
18	600312	平高电气	1,278,169.00	1.23
19	301236	软通动力	1,275,172.00	1.23
20	601168	西部矿业	1,247,494.00	1.20

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	300476	胜宏科技	2,036,807.00	1.96
2	600418	江淮汽车	2,012,405.00	1.94
3	301236	软通动力	1,755,563.00	1.69
4	002625	光启技术	1,742,384.00	1.68
5	002624	完美世界	1,632,412.00	1.57
6	002384	东山精密	1,614,380.00	1.56
7	300012	华测检测	1,512,188.00	1.46
8	002368	太极股份	1,468,114.00	1.41
9	600699	均胜电子	1,449,836.00	1.40
10	600435	北方导航	1,421,641.00	1.37
11	603660	苏州科达	1,417,682.00	1.37
12	002465	海格通信	1,411,942.00	1.36
13	600079	人福医药	1,360,781.00	1.31
14	002517	恺英网络	1,359,511.00	1.31
15	000403	派林生物	1,353,169.80	1.30
16	300054	鼎龙股份	1,343,477.00	1.29
17	600529	山东药玻	1,312,766.00	1.26
18	301165	锐捷网络	1,306,360.00	1.26
19	300001	特锐德	1,298,922.70	1.25
20	688777	中控技术	1,273,605.51	1.23

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	358,770,417.07
卖出股票收入（成交）总额	391,656,943.44

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	18,707.41	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,707.41	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123255	鼎龙转债	133	18,307.38	0.02
2	123257	安克转债	4	400.03	0.00

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

本基金为指数增强型基金，投资股指期货将根据风险管理的原则，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。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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	704,088.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,224,718.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,928,806.51

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**

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500指数增强A	591	80,139.30	80,467.61	0.17%	47,281,857.66	99.83%
国联中证500指数增强C	324	37,749.69	1,040,234.47	8.50%	11,190,665.79	91.50%
合计	915	65,129.21	1,120,702.08	1.88%	58,472,523.45	98.12%

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500指数增强A	999.67	0.00%
	国联中证500指数增强C	1,101.96	0.01%
	合计	2,101.63	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500指数增强A	国联中证500指数增强C
基金合同生效日(2024年08月13日)基金份额总额	163,128,779.26	248,584,827.20
本报告期期初基金份额总额	45,665,575.90	43,473,986.93
本报告期基金总申购份额	161,660,473.11	72,908,725.25
减：本报告期基金总赎回份额	159,963,723.74	104,151,811.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	47,362,325.27	12,230,900.26

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

本基金管理人于2025年3月25日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁刘鲁旦先生离任。

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

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

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变化。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
江海证券	2	321,600,283.02	42.86%	61,471.02	42.18%	-

联储 证券	2	185,966,017.75	24.78%	36,604.00	25.12%	-
粤开 证券	2	242,861,059.74	32.36%	47,644.89	32.70%	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
江海证券	4,502,750.00	70.29%	4,370,000.00	34.38%	-	-	-	-
联储证券	-	-	7,140,000.00	56.18%	-	-	-	-
粤开证券	1,903,470.00	29.71%	1,200,000.00	9.44%	-	-	-	-

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高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-25
2	国联基金管理有限公司基金经理变更公告（国联中证500指数增强）	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-12
3	国联基金管理有限公司关于国联基金直销电子交易平台等业务临时暂停服务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-25

§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

注：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

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500指数增强型证券投资基金募集注册的文件
- （二）《国联中证500指数增强型证券投资基金基金合同》
- （三）《国联中证500指数增强型证券投资基金托管协议》
- （四）关于申请募集国联中证500指数增强型证券投资基金之法律意见书
- （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
二〇二五年八月三十一日