国联中证500指数增强型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09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

报告送出日期:2026年10月27日

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年7月1日起至2026年9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	150,751,442.97份
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。 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。	
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	
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	89,649,025.32份	61,102,417.65份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026年07月01日 - 2026年09月30日)	
	国联中证500指数增强A	国联中证500指数增强C
1.本期已实现收益	284,382.17	99,773.82
2.本期利润	-11,301,016.89	-2,691,255.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1404	-0.0505
4.期末基金资产净值	132,284,750.82	89,352,148.42
5.期末基金份额净值	1.4756	1.4623

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

2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联中证500指数增强A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		②	率③	率标准差④		
过去三个月	-9.37%	1.97%	-16.81%	1.89%	7.44%	0.08%
过去六个月	4.12%	1.78%	-2.17%	1.75%	6.29%	0.03%
过去一年	8.87%	1.56%	0.47%	1.58%	8.40%	-0.02%
自基金合同生效起至今	66.70%	1.45%	54.74%	1.57%	11.96%	-0.12%

国联中证500指数增强C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.46%	1.97%	-16.81%	1.89%	7.35%	0.08%
过去六个月	3.91%	1.78%	-2.17%	1.75%	6.08%	0.03%
过去一年	8.45%	1.56%	0.47%	1.58%	7.98%	-0.02%
自基金合同生效起至今	65.26%	1.45%	54.74%	1.57%	10.52%	-0.12%

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





注：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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭	2024-08-13	-	11	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11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。

	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、国联中证港股通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、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、国联创业板综合增强策略交易型开放式指数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、国联策略优选混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基	2024-08-20	-	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，现任副总裁

	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、国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联昭元债券型证券投资基金的基金经理及公司副总裁兼任多策略投资部总经理。				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、国联北证50成份指数增强型证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。	2025-04-11	-	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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的5%的交易共有1次，为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场风险偏好有所回落，中证500下跌17.67%，前期涨幅较大的成长板块调整幅度相对突出，市场风格与行业表现分化加剧。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。

4.5 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1.4756元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.37%，同期业绩比较基准收益率为-16.81%；截至报告期末国联中证500指数增强C基金份额净值为1.4623元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.46%，同期业绩比较基准收益率为-16.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	198,298,341.70	88.54
	其中：股票	198,298,341.70	88.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,644.32	0.00
	其中：债券	1,644.32	0.00
	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	18,667,881.30	8.33
8	其他资产	7,006,157.13	3.13
9	合计	223,974,024.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,048,502.00	0.47
B	采矿业	8,958,092.00	4.04
C	制造业	115,087,334.13	51.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,404,711.00	1.99
E	建筑业	1,154,356.00	0.52
F	批发和零售业	2,752,723.00	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	2,697,289.00	1.22

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,868,834.70	4.45
J	金融业	14,626,158.00	6.60
K	房地产业	998,215.00	0.45
L	租赁和商务服务业	302,023.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	1,077,801.00	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	2,937,618.00	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	156,722.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	481,716.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	166,552,094.83	75.15

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,518,799.93	0.69
C	制造业	21,975,036.33	9.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	300,950.12	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,750,582.65	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	496,949.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,170,177.84	1.43
J	金融业	945,030.00	0.43
K	房地产业	1,101,343.00	0.50
L	租赁和商务服务业	247,654.00	0.11

M	科学研究和技术服务业	77,225.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	58,295.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	104,204.00	0.05
	合计	31,746,246.87	14.32

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	300604	长川科技	13,000	3,117,270.00	1.41
2	688498	源杰科技	1,700	2,742,100.00	1.24
3	688347	华虹宏力	12,600	2,619,792.00	1.18
4	300757	罗博特科	4,100	2,187,350.00	0.99
5	002008	大族激光	26,400	2,112,792.00	0.95
6	688777	中控技术	23,838	1,908,231.90	0.86
7	300136	信维通信	36,300	1,859,649.00	0.84
8	300223	君正股份	14,300	1,846,845.00	0.83
9	688469	芯联集成	194,441	1,722,747.26	0.78
10	688099	晶晨股份	17,316	1,676,188.80	0.76

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	688825	长鑫科技	22,850	883,152.50	0.40
2	002001	新和成	30,700	796,665.00	0.36

3	002688	金河生物	151,300	786,760.00	0.35
4	300206	理邦仪器	67,000	781,890.00	0.35
5	002532	天山铝业	63,700	775,866.00	0.35

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	1,644.32	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,644.32	0.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金05转债	10	1,352.11	0.00
2	123257	安克转债	2	292.21	0.00

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2610	中证500股指期货2610合约	7	10,400,880.00	-14,160.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-14,160.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,386,419.91
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-494,220.00

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,248,105.60

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,758,051.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,006,157.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	118063	金05转债	1,352.11	0.00
2	123257	安克转债	292.21	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	883,152.50	0.40	首次公开发行限售

5.11.6 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	74,794,326.89	28,225,673.49
报告期期间基金总申购份额	60,975,875.45	47,991,237.12
减：报告期期间基金总赎回份额	46,121,177.02	15,114,492.96
报告期期间基金拆分变动份额	-	-

（份额减少以“-”填列）		
报告期期末基金份额总额	89,649,025.32	61,102,417.65

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 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

2026年10月27日