

国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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 08 月 28 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 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
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	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	57
7.12 投资组合报告附注	57

§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 盈利投资者数量占比	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.4 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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	60
10.8 其他重大事件	61
§ 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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国寿安保中证 800 指数增强	
基金主代码	026255	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 30 日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
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	291,131,838.68 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国寿安保中证 800 指数增强 A	国寿安保中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	026255	026256
报告期末下属分级基金的份额总额	231,973,389.26 份	59,158,449.42 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数中证 800 指数有效跟踪的基础上，力争实现超越基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 800 指数为标的指数。本基金主要策略为跟踪标的指数，在跟踪标的指数的基础上一定程度的调整个股，通过数量化模型及基本面分析优化投资组合，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 800 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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		国寿安保基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	韩占锋	方圆
	联系电话	010-50850888	95559
	电子邮箱	service@gsfunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4009-258-258	95559

传真	010-50850777	021-62701216
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	于泳	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	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

§ 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 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	国寿安保中证 800 指数增强 A	国寿安保中证 800 指数增强 C
本期已实现收益	-9,700,318.91	-3,382,478.21
本期利润	20,102,889.17	5,169,065.01
加权平均基金份额本期利润	0.0706	0.0532
本期加权平均净值利润率	7.06%	5.34%
本期基金份额净值增长率	7.44%	7.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-7,052,732.24	-1,918,151.76
期末可供分配基金份额利润	-0.0304	-0.0324
期末基金资产净值	249,238,883.91	63,431,683.00
期末基金份额净值	1.0744	1.0722
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	7.44%	7.22%

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的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

国寿安保中证 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	14.10%	1.25%	13.02%	1.27%	1.08%	-0.02%
过去六个月	7.44%	1.10%	10.59%	1.18%	-3.15%	-0.08%
自基金合同生效起至今	7.44%	1.09%	10.57%	1.17%	-3.13%	-0.08%

国寿安保中证 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	13.99%	1.25%	13.02%	1.27%	0.97%	-0.02%
过去六个月	7.22%	1.10%	10.59%	1.18%	-3.37%	-0.08%
自基金合同生效起至今	7.22%	1.09%	10.57%	1.17%	-3.35%	-0.08%

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

国寿安保中证800指数增强A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国寿安保中证800指数增强C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 30 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2025 年 12 月 30 日至 2026 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，National Mutual Funds Management Ltd.（国家共同基金管理有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 107 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划。

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		
李康	本基金的基金经理	2025 年 12 月 30 日	-	17 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。经分析，本报告期未发现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易

价差异异常的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

本基金为指数增强型基金，管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理。在严格控制与标的指数的行业和风格偏离的基础上，以量化指标精选个股。报告期内市场结构分化显著，外部因素频繁扰动，主题风格轮动迅速，应对市场环境变化积极优化投资模型，在成长敞口和市值偏离等方面做了相应调整。基金管理人通过分散持仓和适当降低换手率等方式尽量降低回撤和交易成本，对风险事件进行实时监控，以尽量避免个股负面影响冲击。报告期内本基金处于建仓期，相对基准的偏离主要源自成立初期市场快速上涨仓位不足。基金管理人将秉承勤勉尽责的态度，在审慎验证的基础上持续更新迭代投资模型，力争取得相对基准稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保中证 800 指数增强 A 基金份额净值为 1.0744 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.44%；截至本报告期末国寿安保中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 1.0722 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.22%；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

上半年 A 股市场呈现极致结构化，科创 50 上涨 64.25%，创业板指上涨 35.58%，半导体、电子与通信行业分别大涨 106.20%、86.29% 和 73.59%，但全市场仅约三成个股上涨，沪深 300 上涨 7.55%，与此同时上证 50 下跌 1.38%。宏观经济方面，国内 GDP 上半年同比增长 4.7%，其中一季度 5.0%、二季度回落至 4.3%，总量承压但价格端出现积极变化，GDP 平减指数近十三个季度以来首次转正，PPI 由负转正，上半年累计上涨 1.5%。六月制造业 PMI 回升至 50.3%，连续四个月保持在扩张区间，高技术制造

业增加值同比增长 13.3%，集成电路产量同比增长 23.1%，新动能以两成多的增加值占比贡献了近五成的工业增长，成为经济转型的核心动能。但内需复苏基础尚不牢固，上半年社零累计仅增长 1.3%，且六月当月同比滑落至 1.0%，地产投资上半年累计下降 18.0%，消费与地产仍是主要拖累。产业政策层面，科技仍然是主要抓手，“十五五”规划纲要对培育壮大新兴产业和未来产业作出专门部署，提出前瞻布局量子科技、生物制造、氢能、脑机接口和具身智能等未来产业。国常会明确将推进新型工业化作为长期战略任务，坚持智能化、绿色化、融合化方向，强调要加力推进人工智能创新突破，加快关键技术攻关和超大规模智算集群建设，深入实施“人工智能+”行动。政策已从技术突破转向全链条协同布局。货币政策方面，LPR 连续保持不变，央行保持较强政策定力。外部环境方面，美联储加息预期升温压制市场风险偏好，东欧与中东地缘冲突反复加剧供应链风险忧虑，油价成为全球通胀与货币政策路径的一个关键变量。展望下半年，市场核心特征可能由上半年的估值扩张转向业绩验证，业绩兑现确定性强的硬核科技板块的较高估值有望通过盈利上行逐步消化，企业盈利增长逐步带动居民收入和消费提升，经济稳中向好背景下消费、医药和红利等低位板块存在修复机会。整体而言，中国经济正处于新旧动能加速切换的关键期，科技主线明确但需关注阶段性交易拥挤风险，消费红利等低估价值板块具备中长期配置价值，力争通过策略和因子迭代调整更好地把握市场结构性投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、研究部负责人以及各投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，基金托管人在国寿安保中证 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，国寿安保基金管理有限公司在国寿安保中证 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真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国寿安保基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国寿安保中证 800 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： 国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	22,277,427.61	406,039,629.91
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	291,724,487.32	-

其中：股票投资		291,711,487.15	-
基金投资		-	-
债券投资		13,000.17	-
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		499,475.72	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		314,501,390.65	406,039,629.91
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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		1,476,920.24	-
应付管理人报酬		210,230.26	8,899.32
应付托管费		26,278.78	1,112.42
应付销售服务费		22,084.60	1,386.99
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	6.4.7.9	95,309.86	-
负债合计		1,830,823.74	11,398.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	291,131,838.68	406,023,388.97
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	21,538,728.23	4,842.21
净资产合计		312,670,566.91	406,028,231.18
负债和净资产总计		314,501,390.65	406,039,629.91

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日,基金份额总额 291,131,838.68 份，其中国寿安保中证 800 指数增强 A 基金份额总额 231,973,389.26 份，基金份额净值 1.0744 元；国寿安保中证 800 指数增强 C 基金份额总额 59,158,449.42 份，基金份额净值 1.0722 元。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,245,518.43
1. 利息收入		371,478.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	190,233.18
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		181,244.93
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,480,730.21
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-14,050,042.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	0.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	2,569,312.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	38,354,751.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	19.23
减：二、营业总支出		1,973,564.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,515,432.18
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	189,429.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	193,893.92
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		25.38

8. 其他费用	6. 4. 7. 23	74,783.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,271,954.18
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,271,954.18
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		25,271,954.18

6.3 净资产变动表

会计主体：国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他 综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	406,023,388.97	-	4,842.21	406,028,231.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	406,023,388.97	-	4,842.21	406,028,231.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-114,891,550.29	-	21,533,886.02	-93,357,664.27
（一）、综合收益总额	-	-	25,271,954.18	25,271,954.18
（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）	-114,891,550.29	-	-3,738,068.16	-118,629,618.45
其中：1. 基金申购款	44,359,012.21	-	-350,642.01	44,008,370.20
2. 基金赎回款	-159,250,562.50	-	-3,387,426.15	-162,637,988.65
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	291,131,838.68	-	21,538,728.23	312,670,566.91

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：

刘忠江
基金管理人负责人

王文英
主管会计工作负责人

于晓树
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保中证 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]2632 号《关于准予国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 405,947,809.99 元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2025]100Z0101 号予以验证。经向中国证监会备案，《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 406,023,388.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 75,578.98 份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司（以下简称“国寿安保”），基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

根据《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认（申）购时收取认（申）购费，不收取销售服务费，称为 A 类基金份额；在投资者认（申）购时不收取认（申）购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会部分投资于依法发行上市的非成份股（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）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权、债券回购、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）以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及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：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资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%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《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》《证券投资基金会计核算业务指引》《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

（1）金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具：

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

（3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；（2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；（3）该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；（4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费（若有）在费用涵盖期间按基金合同

约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包

括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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《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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、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》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续

暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 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 6 月 30 日
活期存款	6,793,332.50
等于：本金	6,791,901.28
加：应计利息	1,431.22
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	15,484,095.11
等于：本金	15,483,872.07
加：应计利息	223.04
减：坏账准备	—
合计	22,277,427.61

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户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 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	253,356,735.85	-	291,711,487.15	38,354,751.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	13,000.00	0.17	13,000.17
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,000.00	0.17	13,000.17
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	253,369,735.85	0.17	291,724,487.32	38,354,751.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 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	74,383.76
其他	20,926.10
合计	95,309.86

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保中证 800 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	279,462,836.68	279,462,836.68
本期申购	41,940,982.00	41,940,982.00
本期赎回（以“-”号填列）	-89,430,429.42	-89,430,429.42
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	231,973,389.26	231,973,389.26

国寿安保中证 800 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	126,560,552.29	126,560,552.29
本期申购	2,418,030.21	2,418,030.21
本期赎回（以“-”号填列）	-69,820,133.08	-69,820,133.08
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	59,158,449.42	59,158,449.42

注：本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保中证 800 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,287.51	-	4,287.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,287.51	-	4,287.51
本期利润	-9,700,318.91	29,803,208.08	20,102,889.17
本期基金份额交易产生的变动数	2,643,299.16	-5,484,981.19	-2,841,682.03
其中：基金申购款	-73,262.90	-261,805.65	-335,068.55
基金赎回款	2,716,562.06	-5,223,175.54	-2,506,613.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,052,732.24	24,318,226.89	17,265,494.65

国寿安保中证 800 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	554.70	-	554.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	554.70	-	554.70
本期利润	-3,382,478.21	8,551,543.22	5,169,065.01
本期基金份额交易产生的变动数	1,463,771.75	-2,360,157.88	-896,386.13
其中：基金申购款	-57,735.04	42,161.58	-15,573.46
基金赎回款	1,521,506.79	-2,402,319.46	-880,812.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,918,151.76	6,191,385.34	4,273,233.58

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	177,995.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,580.70
结算备付金利息收入	-
其他	7,656.98

合计	190,233.18
----	------------

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,050,042.66
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-14,050,042.66

6.4.7.14.2 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1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	495,820,606.61
减：卖出股票成本总额	509,343,774.18
减：交易费用	526,875.09
买卖股票差价收入	-14,050,042.66

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-
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	0.17

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,569,312.28
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	2,569,312.28

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	38,354,751.30
股票投资	38,354,751.30
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	38,354,751.30

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	19.23
合计	19.23

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	74,783.76

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
国寿安保	基金管理人、注册登记机构、直销机构
交通银行	基金托管人、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
广发银行股份有限公司（简称“广发银行”）	基金管理人股东之股东的联营企业、销售机构

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、广发银行为本基金管理人间接控股股东及基金份额重要持有人中国人寿保险股份有限公司的关联方。

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

本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,515,432.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	462,220.34
应支付基金管理人的净管理费	1,053,211.84

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	189,429.01

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保中证 800 指数增强 A	国寿安保中证 800 指数增强 C	合计
交通银行	-	13,728.54	13,728.54
合计	-	13,728.54	13,728.54

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.40\%/ \text{当年天数}$

H 为每日 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

国寿安保中证 800 指数增强 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
中国人寿	160,384,000.31	69.14	120,017,666.67	42.95

6.4.10.6 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------

	期末余额	当期利息收入
交通银行	6,793,332.50	177,995.50

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 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
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	166	8,841.16	9,750.84	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	10,048	101,585.28	101,585.28	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 日	新股未上市	10.11	10.11	4,305	43,523.55	43,523.55	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,694	13,247.08	35,133.56	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	444	12,072.36	13,901.64	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	312	9,478.56	12,164.88	-

001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	10.12	27.73	1,732	17,527.84	48,028.36	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股 流通 受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	636	29,306.88	294,677.88	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股 流通 受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股 流通 受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	17.70	84.32	272	4,814.40	22,935.04	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股 流通 受限	22.68	42.16	3,892	88,270.56	164,086.72	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	44.56	468.67	133	5,926.48	62,333.11	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	81.88	1,584.33	105	8,597.40	166,354.65	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 流通	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

				受限						
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	618	12,162.24	87,440.82	-
6.4.12.1.2 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
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 25 日	18 日	新债未上市	100.00	100.00	130	13,000.00	13,000.17	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,000	663,443.00	879,530.00	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会负责公司整体风险的预防和控制，确定公司风险战略，审核、

监督公司风险控制制度的有效执行，对有效的风险管理承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查。管理层对有效的风险管理承担直接责任，保证风险管理体系的持续有效运转，使公司风险管理的战略和政策要求及其各方面的具体工作落到实处。公司设督察长一名，负责牵头开展风险管理工作，监督检查公司内部风险控制情况，参与各项决策的风险评估及审批。公司设立合规管理部、监察稽核部两个独立的风险管理职能部门，由督察长领导，对督察长负责，并向督察长汇报工作。

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。

6.4.13.1 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。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会负责公司整体风险的预防和控制，确定公司风险战略，审核、监督公司风险控制制度的有效执行，对有效的风险管理承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查。管理层对有效的风险管理承担直接责任，保证风险管理体系的持续有效运转，使公司风险管理的战略和政策要求及其各方面的具体工作落到实处。公司设督察长一名，负责牵头开展风险管理工作，监督检查公司内部风险控制情况，参与各项决策的风险评估及审批。公司设立合规管理部、监察稽核部两个独立的风险管理职能部门，由督察长领导，对督察长负责，并向督察长汇报工作。

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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受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对于未来现金流影响的风险。

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 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	22,277,427.61	-	-	-	22,277,427.61
交易性金融资产	-	-	13,000.17	291,711,487.15	291,724,487.32
应收申购款	-	-	-	499,475.72	499,475.72
资产总计	22,277,427.61	-	13,000.17	292,210,962.87	314,501,390.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,476,920.24	1,476,920.24
应付管理人报酬	-	-	-	210,230.26	210,230.26
应付托管费	-	-	-	26,278.78	26,278.78
应付销售服务费	-	-	-	22,084.60	22,084.60
其他负债	-	-	-	95,309.86	95,309.86
负债总计	-	-	-	1,830,823.74	1,830,823.74
利率敏感度缺口	22,277,427.61	-	13,000.17	290,380,139.13	312,670,566.91
上年度末 2025 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	406,039,629.91	-	-	-	406,039,629.91
资产总计	406,039,629.91	-	-	-	406,039,629.91
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,899.32	8,899.32
应付托管费	-	-	-	1,112.42	1,112.42
应付销售服务费	-	-	-	1,386.99	1,386.99
负债总计	-	-	-	11,398.73	11,398.73
利率敏感度缺口	406,039,629.91	-	-	-11,398.73	406,028,231.18

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人通过对宏观经济和资本市场的深入分析，采用主动的投资管理策略，把握不同时期证券市场的收益水平，在基金合同约定范围内，合理配置股票、债券、货币市场工具等各类资产，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 6 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	291,711,487.15	93.30	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	13,000.17	0.00	—	—
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	291,724,487.32	93.30	—	—

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假 设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	+5%	13,970,167.04	—
	-5%	-13,970,167.04	—

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：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：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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	289,658,377.57	-
第二层次	1,037,639.00	-
第三层次	1,028,470.75	-
合计	291,724,487.32	-

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面

价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	291,711,487.15	92.75
	其中：股票	291,711,487.15	92.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,000.17	-
	其中：债券	13,000.17	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	22,277,427.61	7.08
8	其他各项资产	499,475.72	0.16
9	合计	314,501,390.65	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	241,732.00	0.08
B	采矿业	9,979,913.00	3.19
C	制造业	193,419,051.03	61.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,569,465.00	3.38
E	建筑业	3,990,104.00	1.28
F	批发和零售业	3,432,336.00	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	6,194,877.00	1.98
H	住宿和餐饮业	53,970.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,286,071.10	3.61
J	金融业	38,782,375.80	12.40
K	房地产业	1,304,234.00	0.42
L	租赁和商务服务业	1,927,768.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	3,960,518.00	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	851,940.00	0.27

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	94,864.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	73,644.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	286,162,862.93	91.52

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	35,133.56	0.01
C	制造业	5,368,381.83	1.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	145,108.83	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,548,624.22	1.77

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	8,900	11,303,000.00	3.61
2	300750	宁德时代	20,900	8,213,909.00	2.63
3	300502	新易盛	13,160	7,988,120.00	2.55
4	600519	贵州茅台	5,050	5,986,724.50	1.91
5	002384	东山精密	20,400	5,351,940.00	1.71

6	600183	生益科技	29,000	5,028,600.00	1.61
7	300408	三环集团	30,100	5,023,690.00	1.61
8	688396	华润微	49,509	4,829,602.95	1.54
9	300604	长川科技	12,700	4,336,034.00	1.39
10	601899	紫金矿业	170,600	4,288,884.00	1.37
11	688256	寒武纪	2,682	4,279,265.10	1.37
12	000725	京东方 A	474,800	4,121,264.00	1.32
13	600522	中天科技	60,700	3,683,276.00	1.18
14	601318	中国平安	77,000	3,675,980.00	1.18
15	688008	澜起科技	11,400	3,532,860.00	1.13
16	603259	药明康德	27,900	3,473,829.00	1.11
17	301308	江波龙	4,900	3,448,620.00	1.10
18	600036	招商银行	96,400	3,422,200.00	1.09
19	000333	美的集团	40,700	3,074,071.00	0.98
20	605358	立昂微	37,300	2,894,480.00	0.93
21	002475	立讯精密	39,200	2,759,680.00	0.88
22	000100	TCL 科技	453,000	2,636,460.00	0.84
23	600919	江苏银行	237,700	2,562,406.00	0.82
24	002371	北方华创	2,800	2,476,768.00	0.79
25	601688	华泰证券	115,800	2,387,796.00	0.76
26	601211	国泰海通	129,500	2,356,900.00	0.75
27	688041	海光信息	6,100	2,258,830.00	0.72
28	600030	中信证券	75,800	2,177,734.00	0.70
29	002436	兴森科技	39,700	2,022,715.00	0.65
30	301536	星辰科技	15,500	1,995,005.00	0.64
31	601166	兴业银行	120,100	1,988,856.00	0.64
32	002463	沪电股份	12,900	1,971,120.00	0.63
33	000792	盐湖股份	64,700	1,953,293.00	0.62
34	688012	中微公司	4,000	1,874,000.00	0.60
35	601939	建设银行	193,800	1,866,294.00	0.60
36	601668	中国建筑	429,500	1,864,030.00	0.60
37	600900	长江电力	68,500	1,813,195.00	0.58
38	601872	招商轮船	100,900	1,772,813.00	0.57
39	300857	协创数据	5,120	1,740,288.00	0.56
40	688981	中芯国际	10,766	1,709,856.12	0.55
41	600926	杭州银行	117,500	1,697,875.00	0.54
42	601138	工业富联	23,200	1,673,880.00	0.54
43	000425	徐工机械	203,300	1,644,697.00	0.53
44	688220	翱捷科技	12,819	1,593,658.08	0.51
45	603986	兆易创新	1,900	1,548,500.00	0.50
46	600176	中国巨石	20,900	1,523,192.00	0.49
47	000408	藏格矿业	21,600	1,497,312.00	0.48
48	002709	天赐材料	28,900	1,486,327.00	0.48

49	301200	大族数控	4,100	1,478,665.00	0.47
50	000988	华工科技	8,000	1,476,880.00	0.47
51	600019	宝钢股份	266,200	1,445,466.00	0.46
52	600150	中国船舶	42,400	1,432,696.00	0.46
53	600549	厦门钨业	16,600	1,414,320.00	0.45
54	600886	国投电力	105,500	1,404,205.00	0.45
55	600674	川投能源	96,000	1,360,320.00	0.44
56	600887	伊利股份	56,600	1,356,136.00	0.43
57	601058	赛轮轮胎	116,000	1,337,480.00	0.43
58	601398	工商银行	188,300	1,331,281.00	0.43
59	002493	荣盛石化	122,600	1,317,950.00	0.42
60	000807	云铝股份	59,000	1,306,260.00	0.42
61	600050	中国联通	325,900	1,303,600.00	0.42
62	600026	中远海能	71,700	1,286,298.00	0.41
63	601117	中国化学	173,400	1,274,490.00	0.41
64	003816	中国广核	321,600	1,257,456.00	0.40
65	300567	精测电子	3,900	1,238,640.00	0.40
66	300628	亿联网络	36,400	1,231,048.00	0.39
67	300661	圣邦股份	8,500	1,219,580.00	0.39
68	000776	广发证券	51,600	1,207,440.00	0.39
69	601360	三六零	138,600	1,204,434.00	0.39
70	601877	正泰电器	47,800	1,198,346.00	0.38
71	600233	圆通速递	74,800	1,178,100.00	0.38
72	600704	物产中大	246,100	1,161,592.00	0.37
73	688498	源杰科技	600	1,131,600.00	0.36
74	300433	蓝思科技	21,000	1,126,860.00	0.36
75	688521	芯原股份	3,000	1,113,420.00	0.36
76	300390	天华新能	11,800	1,103,418.00	0.35
77	000001	平安银行	108,000	1,085,400.00	0.35
78	600489	中金黄金	59,800	1,079,390.00	0.35
79	300059	东方财富	51,700	1,053,646.00	0.34
80	002594	比亚迪	13,000	1,036,100.00	0.33
81	002409	雅克科技	4,600	1,032,700.00	0.33
82	300223	北京君正	4,100	1,020,490.00	0.33
83	600875	东方电气	35,400	1,018,458.00	0.33
84	000630	铜陵有色	156,100	992,796.00	0.32
85	601601	中国太保	34,700	989,644.00	0.32
86	300014	亿纬锂能	15,200	988,456.00	0.32
87	600601	方正科技	71,000	982,640.00	0.31
88	002027	分众传媒	198,000	958,320.00	0.31
89	002064	华峰化学	100,200	950,898.00	0.30
90	601233	桐昆股份	43,700	946,105.00	0.30
91	600276	恒瑞医药	18,000	936,720.00	0.30

92	688347	华虹宏力	2,700	908,010.00	0.29
93	601169	北京银行	184,900	906,010.00	0.29
94	600346	恒力石化	50,600	896,126.00	0.29
95	688072	拓荆科技	1,000	879,530.00	0.28
96	603296	华勤技术	11,760	873,415.20	0.28
97	600011	华能国际	114,700	870,573.00	0.28
98	601600	中国铝业	105,300	865,566.00	0.28
99	603156	养元饮品	17,500	858,725.00	0.27
100	300274	阳光电源	5,400	858,708.00	0.27
101	600563	法拉电子	4,500	858,600.00	0.27
102	002236	大华股份	51,500	849,235.00	0.27
103	001309	德明利	900	848,610.00	0.27
104	000338	潍柴动力	30,500	831,125.00	0.27
105	300346	南大光电	8,800	815,320.00	0.26
106	000415	渤海租赁	200,000	814,000.00	0.26
107	601995	中金公司	22,300	806,145.00	0.26
108	300450	先导智能	19,000	773,680.00	0.25
109	301358	湖南裕能	9,400	713,178.00	0.23
110	600018	上港集团	148,300	699,976.00	0.22
111	603659	璞泰来	24,100	697,213.00	0.22
112	600999	招商证券	32,700	689,970.00	0.22
113	600061	国投资本	104,600	685,130.00	0.22
114	000708	中信特钢	54,100	682,742.00	0.22
115	601077	渝农商行	109,700	670,267.00	0.21
116	600027	华电国际	149,400	664,830.00	0.21
117	000651	格力电器	17,600	660,000.00	0.21
118	002414	高德红外	49,700	659,022.00	0.21
119	600884	杉杉股份	48,000	650,400.00	0.21
120	601898	中煤能源	52,400	638,232.00	0.20
121	300919	中伟新材	14,500	634,375.00	0.20
122	300476	胜宏科技	1,800	623,574.00	0.20
123	002266	浙富控股	122,400	619,344.00	0.20
124	000598	兴蓉环境	95,000	609,900.00	0.20
125	600188	兖矿能源	33,600	597,072.00	0.19
126	603606	东方电缆	14,340	595,253.40	0.19
127	000519	中兵红箭	28,100	592,067.00	0.19
128	000062	深圳华强	18,600	591,852.00	0.19
129	002460	赣锋锂业	8,800	575,520.00	0.18
130	000709	河钢股份	293,500	569,390.00	0.18
131	002415	海康威视	16,600	567,720.00	0.18
132	002841	视源股份	16,200	559,386.00	0.18
133	002155	湖南黄金	23,200	553,784.00	0.18
134	002624	完美世界	44,400	551,448.00	0.18

135	000960	锡业股份	12,900	550,701.00	0.18
136	601997	贵阳银行	107,100	549,423.00	0.18
137	600166	福田汽车	188,800	549,408.00	0.18
138	002603	以岭药业	36,500	547,500.00	0.18
139	600497	驰宏锌锗	45,100	546,161.00	0.17
140	000528	柳工	71,700	541,335.00	0.17
141	600765	中航重机	41,100	531,012.00	0.17
142	603379	三美股份	6,900	523,641.00	0.17
143	300003	乐普医疗	44,000	521,400.00	0.17
144	000975	山金国际	30,500	518,500.00	0.17
145	600380	健康元	54,000	508,680.00	0.16
146	601288	农业银行	83,200	505,024.00	0.16
147	600177	雅戈尔	66,300	499,239.00	0.16
148	600062	华润双鹤	30,100	482,804.00	0.15
149	600460	士兰微	8,800	481,008.00	0.15
150	002001	新和成	16,900	480,298.00	0.15
151	601728	中国电信	92,200	478,518.00	0.15
152	300458	全志科技	12,100	477,466.00	0.15
153	300037	新宙邦	5,100	473,535.00	0.15
154	002558	巨人网络	16,900	465,764.00	0.15
155	600208	衢州发展	163,800	463,554.00	0.15
156	300475	香农芯创	1,500	450,000.00	0.14
157	601988	中国银行	78,500	449,020.00	0.14
158	300373	扬杰科技	2,800	440,244.00	0.14
159	688472	阿特斯	40,200	434,964.00	0.14
160	002025	航天电器	5,700	434,454.00	0.14
161	000703	恒逸石化	31,600	428,812.00	0.14
162	000034	神州数码	15,080	418,470.00	0.13
163	600028	中国石化	92,500	412,550.00	0.13
164	000921	海信家电	14,600	398,872.00	0.13
165	002304	洋河股份	10,400	396,760.00	0.13
166	601577	长沙银行	45,500	396,305.00	0.13
167	600808	马钢股份	155,700	389,250.00	0.12
168	601991	大唐发电	54,200	383,736.00	0.12
169	002600	领益智造	22,000	381,480.00	0.12
170	600406	国电南瑞	16,400	374,740.00	0.12
171	688313	仕佳光子	2,000	369,300.00	0.12
172	601825	沪农商行	48,600	364,014.00	0.12
173	000786	北新建材	19,900	359,991.00	0.12
174	600909	华安证券	32,400	359,964.00	0.12
175	002271	东方雨虹	30,300	359,661.00	0.12
176	000878	云南铜业	22,600	358,888.00	0.11
177	600048	保利发展	77,400	358,362.00	0.11

178	603369	今世缘	15,100	358,021.00	0.11
179	600699	均胜电子	16,500	356,565.00	0.11
180	002517	恺英网络	21,800	354,250.00	0.11
181	601857	中国石油	40,600	352,408.00	0.11
182	600578	京能电力	54,200	349,590.00	0.11
183	600109	国金证券	39,600	347,688.00	0.11
184	000938	紫光股份	12,000	346,320.00	0.11
185	600521	华海药业	23,600	339,840.00	0.11
186	688019	安集科技	1,000	339,460.00	0.11
187	603806	福斯特	20,100	337,479.00	0.11
188	601555	东吴证券	42,300	335,016.00	0.11
189	600741	华域汽车	21,400	332,128.00	0.11
190	600015	华夏银行	51,900	331,641.00	0.11
191	600132	重庆啤酒	8,000	330,400.00	0.11
192	601156	东航物流	19,800	319,176.00	0.10
193	000887	中鼎股份	17,700	316,653.00	0.10
194	001286	陕西能源	31,200	316,368.00	0.10
195	600398	海澜之家	60,200	314,846.00	0.10
196	600312	平高电气	17,800	314,348.00	0.10
197	600685	中船防务	12,300	312,912.00	0.10
198	601009	南京银行	31,600	312,524.00	0.10
199	601128	常熟银行	53,540	311,602.80	0.10
200	002142	宁波银行	10,400	308,776.00	0.10
201	001389	广合科技	1,300	308,425.00	0.10
202	600499	科达制造	22,300	307,740.00	0.10
203	300146	汤臣倍健	33,900	306,456.00	0.10
204	001965	招商公路	33,000	302,280.00	0.10
205	000883	湖北能源	69,700	301,104.00	0.10
206	600482	中国动力	9,100	298,480.00	0.10
207	600517	国网英大	62,900	294,372.00	0.09
208	688187	时代电气	4,208	288,921.28	0.09
209	002008	大族激光	1,900	285,209.00	0.09
210	600332	白云山	14,200	284,568.00	0.09
211	600098	广州发展	47,900	283,089.00	0.09
212	603338	浙江鼎力	6,600	280,500.00	0.09
213	601456	国联民生	31,500	278,460.00	0.09
214	000060	中金岭南	36,700	277,819.00	0.09
215	601998	中信银行	40,000	277,200.00	0.09
216	688036	传音控股	4,600	271,170.00	0.09
217	600039	四川路桥	34,500	269,790.00	0.09
218	600989	宝丰能源	13,200	268,356.00	0.09
219	000987	越秀资本	34,300	268,226.00	0.09
220	603993	洛阳钼业	15,200	266,760.00	0.09

221	300316	晶盛机电	4,400	265,760.00	0.08
222	600104	上汽集团	27,100	264,496.00	0.08
223	601228	广州港	92,600	261,132.00	0.08
224	300394	天孚通信	840	254,251.20	0.08
225	601958	金钼股份	9,000	252,990.00	0.08
226	300866	安克创新	2,386	249,337.00	0.08
227	605589	圣泉集团	3,900	247,923.00	0.08
228	601665	齐鲁银行	42,400	244,648.00	0.08
229	601607	上海医药	15,800	243,320.00	0.08
230	600598	北大荒	22,300	241,732.00	0.08
231	600363	联创光电	6,600	236,148.00	0.08
232	600795	国电电力	50,500	235,835.00	0.08
233	300140	节能环保	46,800	232,596.00	0.07
234	601106	中国一重	70,000	231,000.00	0.07
235	600010	包钢股份	103,500	230,805.00	0.07
236	002583	海能达	30,000	230,700.00	0.07
237	000683	博源化工	39,900	229,824.00	0.07
238	601618	中国中冶	93,400	227,896.00	0.07
239	600893	航发动力	5,800	222,372.00	0.07
240	603799	华友钴业	4,600	221,996.00	0.07
241	000983	山西焦煤	38,000	220,400.00	0.07
242	601869	长飞光纤	400	218,360.00	0.07
243	600535	天士力	16,500	218,295.00	0.07
244	600588	用友网络	23,600	216,648.00	0.07
245	688002	睿创微纳	1,400	216,566.00	0.07
246	002085	万丰奥威	19,400	215,146.00	0.07
247	600295	鄂尔多斯	20,000	214,400.00	0.07
248	300054	鼎龙股份	2,000	211,940.00	0.07
249	601878	浙商证券	22,200	210,900.00	0.07
250	601088	中国神华	5,400	210,816.00	0.07
251	002153	石基信息	28,700	207,501.00	0.07
252	603920	世运电路	4,300	206,572.00	0.07
253	601901	方正证券	28,500	205,200.00	0.07
254	600023	浙能电力	38,700	203,562.00	0.07
255	300759	康龙化成	6,900	199,617.00	0.06
256	600585	海螺水泥	11,400	193,230.00	0.06
257	002244	滨江集团	25,000	190,000.00	0.06
258	300001	特锐德	5,000	189,150.00	0.06
259	600348	华阳股份	24,100	184,365.00	0.06
260	300676	华大基因	5,200	182,312.00	0.06
261	000733	振华科技	3,200	181,248.00	0.06
262	002736	国信证券	18,000	179,820.00	0.06
263	002608	江苏国信	26,000	179,400.00	0.06

264	300136	信维通信	1,500	178,875.00	0.06
265	000997	新大陆	10,800	176,040.00	0.06
266	600141	兴发集团	3,700	173,789.00	0.06
267	000157	中联重科	24,700	172,159.00	0.06
268	600570	恒生电子	8,000	169,520.00	0.05
269	601390	中国中铁	40,600	169,302.00	0.05
270	600848	上海临港	22,200	166,278.00	0.05
271	600690	海尔智家	8,100	165,321.00	0.05
272	002532	天山铝业	15,000	160,950.00	0.05
273	002311	海大集团	3,500	156,135.00	0.05
274	600415	小商品城	15,300	155,448.00	0.05
275	002203	海亮股份	6,800	155,380.00	0.05
276	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.05
277	300474	景嘉微	2,500	151,200.00	0.05
278	600309	万华化学	2,200	150,502.00	0.05
279	603444	吉比特	400	143,368.00	0.05
280	600862	中航高科	7,900	142,437.00	0.05
281	002432	九安医疗	2,000	141,360.00	0.05
282	600066	宇通客车	5,200	139,412.00	0.04
283	600369	西南证券	34,400	138,288.00	0.04
284	300999	金龙鱼	5,800	134,908.00	0.04
285	688183	生益电子	1,000	132,400.00	0.04
286	600845	宝信软件	7,700	128,051.00	0.04
287	688295	中复神鹰	2,100	127,134.00	0.04
288	600515	海南机场	46,000	126,040.00	0.04
289	603699	纽威股份	2,500	125,750.00	0.04
290	601059	信达证券	7,600	123,044.00	0.04
291	600901	江苏金租	21,300	122,475.00	0.04
292	002353	杰瑞股份	800	122,000.00	0.04
293	601216	君正集团	27,100	120,866.00	0.04
294	688188	柏楚电子	1,120	119,504.00	0.04
295	600546	山煤国际	10,800	118,044.00	0.04
296	601615	明阳智能	10,000	115,700.00	0.04
297	600873	梅花生物	15,500	113,925.00	0.04
298	000963	华东医药	4,000	112,480.00	0.04
299	600655	豫园股份	27,100	111,381.00	0.04
300	603077	和邦生物	47,600	110,432.00	0.04
301	603766	隆鑫通用	9,200	109,756.00	0.04
302	688336	三生国健	2,000	106,200.00	0.03
303	003035	南网能源	18,000	104,760.00	0.03
304	300972	万辰集团	600	104,046.00	0.03
305	688303	大全能源	5,900	102,837.00	0.03
306	603288	海天味业	3,100	102,796.00	0.03

307	600820	隧道股份	19,100	99,511.00	0.03
308	601000	唐山港	23,700	98,355.00	0.03
309	600863	华能蒙电	20,500	96,350.00	0.03
310	603233	大参林	6,400	96,192.00	0.03
311	600763	通策医疗	2,800	94,864.00	0.03
312	300748	金力永磁	3,000	92,550.00	0.03
313	603816	顾家家居	4,000	89,440.00	0.03
314	600906	财达证券	11,700	87,282.00	0.03
315	600483	福能股份	8,500	86,615.00	0.03
316	601186	中国铁建	14,300	85,085.00	0.03
317	000027	深圳能源	13,600	84,320.00	0.03
318	300735	光弘科技	3,600	81,864.00	0.03
319	002130	沃尔核材	4,200	79,632.00	0.03
320	603087	甘李药业	1,400	79,464.00	0.03
321	002673	西部证券	12,100	78,529.00	0.03
322	000895	双汇发展	3,500	78,400.00	0.03
323	600282	南钢股份	16,500	75,735.00	0.02
324	600737	中粮糖业	6,000	73,980.00	0.02
325	600977	中国电影	5,700	73,644.00	0.02
326	600998	九州通	15,500	72,695.00	0.02
327	002500	山西证券	14,000	72,240.00	0.02
328	003031	中瓷电子	400	72,120.00	0.02
329	601018	宁波港	22,600	71,190.00	0.02
330	600511	国药股份	2,700	70,308.00	0.02
331	600927	永安期货	5,600	69,720.00	0.02
332	601598	中国外运	13,500	66,960.00	0.02
333	002422	科伦药业	1,700	65,484.00	0.02
334	600871	石化油服	30,800	62,524.00	0.02
335	600350	山东高速	5,600	62,328.00	0.02
336	600038	中直股份	2,400	60,696.00	0.02
337	600968	海油发展	17,100	56,943.00	0.02
338	601865	福莱特	5,400	56,754.00	0.02
339	600583	海油工程	11,200	56,336.00	0.02
340	002683	广东宏大	1,900	55,651.00	0.02
341	601699	潞安环能	3,800	54,264.00	0.02
342	600754	锦江酒店	3,000	53,970.00	0.02
343	601399	国机重装	15,200	53,200.00	0.02
344	002202	金风科技	2,200	52,580.00	0.02
345	605499	东鹏饮料	410	50,606.30	0.02
346	688425	铁建重工	11,900	47,838.00	0.02
347	688363	华熙生物	1,300	46,501.00	0.01
348	601139	深圳燃气	8,200	46,412.00	0.01
349	600004	白云机场	6,200	45,012.00	0.01

350	603529	爱玛科技	2,300	44,873.00	0.01
351	300888	稳健医疗	1,500	41,985.00	0.01
352	600316	洪都航空	1,500	41,910.00	0.01
353	603341	龙旗科技	900	38,241.00	0.01
354	002508	老板电器	2,600	38,012.00	0.01
355	600809	山西汾酒	300	32,811.00	0.01
356	601816	京沪高铁	6,900	31,257.00	0.01
357	002738	中矿资源	400	23,596.00	0.01
358	600021	上海电力	1,500	22,605.00	0.01
359	600426	华鲁恒升	900	21,528.00	0.01
360	600600	青岛啤酒	400	20,892.00	0.01

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	688525	佰维存储	3,000	1,484,190.00	0.47
2	688808	联讯仪器	605	1,327,519.65	0.42
3	600487	亨通光电	10,200	1,115,268.00	0.36
4	688392	骄成超声	2,198	499,341.64	0.16
5	301666	大普微	636	294,677.88	0.09
6	688781	视涯科技	3,892	164,086.72	0.05
7	001248	华润新能源	14,353	145,108.83	0.05
8	300283	温州宏丰	5,600	115,080.00	0.04
9	688820	盛合晶微	618	87,440.82	0.03
10	688797	臻宝科技	133	62,333.11	0.02
11	001399	惠科股份	1,732	48,028.36	0.02
12	001257	盛龙股份	1,694	35,133.56	0.01
13	603459	红板科技	272	22,935.04	0.01
14	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
15	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
16	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
17	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
18	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
19	001365	天海电子	444	13,901.64	0.00
20	001393	维通利	312	12,164.88	0.00
21	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
22	001237	惠康科技	166	9,750.84	0.00
23	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
24	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
25	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
26	001312	福恩股份	134	2,248.52	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	600519	贵州茅台	9,331,957.00	2.30
2	300750	宁德时代	9,160,148.00	2.26
3	601899	紫金矿业	6,823,014.81	1.68
4	000333	美的集团	6,489,497.99	1.60
5	601318	中国平安	6,295,436.00	1.55
6	600036	招商银行	6,123,170.00	1.51
7	300308	中际旭创	5,063,700.00	1.25
8	603259	药明康德	4,642,612.00	1.14
9	601166	兴业银行	4,500,521.00	1.11
10	300059	东方财富	4,375,856.00	1.08
11	601211	国泰海通	4,309,481.00	1.06
12	300502	新易盛	4,112,286.00	1.01
13	688981	中芯国际	4,078,849.53	1.00
14	601688	华泰证券	3,907,951.00	0.96
15	002475	立讯精密	3,816,237.00	0.94
16	000425	徐工机械	3,739,877.00	0.92
17	601398	工商银行	3,627,269.00	0.89
18	000725	京东方 A	3,575,070.00	0.88
19	601600	中国铝业	3,540,503.00	0.87
20	600150	中国船舶	3,422,146.00	0.84

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（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	000333	美的集团	3,258,832.00	0.80
2	002415	海康威视	2,945,576.00	0.73
3	688525	佰维存储	2,931,284.62	0.72
4	603799	华友钴业	2,813,781.00	0.69
5	300059	东方财富	2,808,957.00	0.69
6	601857	中国石油	2,713,314.00	0.67
7	688981	中芯国际	2,550,886.30	0.63
8	000338	潍柴动力	2,489,598.00	0.61
9	002475	立讯精密	2,473,859.00	0.61
10	601225	陕西煤业	2,370,234.00	0.58

11	300014	亿纬锂能	2,351,451.00	0.58
12	600893	航发动力	2,332,175.00	0.57
13	601231	环旭电子	2,331,744.00	0.57
14	601918	新集能源	2,324,456.00	0.57
15	600690	海尔智家	2,291,612.00	0.56
16	300782	卓胜微	2,237,239.99	0.55
17	688336	三生国健	2,231,347.66	0.55
18	600036	招商银行	2,213,517.00	0.55
19	601398	工商银行	2,160,726.00	0.53
20	600989	宝丰能源	2,146,361.00	0.53

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（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	762,700,510.03
卖出股票收入（成交）总额	495,820,606.61

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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）	13,000.17	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	13,000.17	0.00

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	111025	圣泉转债	130	13,000.17	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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	499,475.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	499,475.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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

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	301666	大普微	294,677.88	0.09	新股流通受限
2	688808	联讯仪器	166,354.65	0.05	新股流通受限

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，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(%)
国寿安保中证800指数增强A	330	702,949.66	160,384,000.31	69.14	71,589,388.95	30.86
国寿安保中证800指数增强C	724	81,710.57	-	-	59,158,449.42	100.00
合计	1,054	276,216.17	160,384,000.31	55.09	130,747,838.37	44.91

8.2 盈利投资者数量占比

不适用。

8.3 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	国寿安保中证 800 指数增强 A	9.97	0.00
	国寿安保中证 800 指数增强 C	1.00	0.00
	合计	10.97	0.00

8.4 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量 区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国寿安保中证 800 指数增强 A	0
	国寿安保中证 800 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保中证 800 指数增强 A	0
	国寿安保中证 800 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保中证 800 指数增强 A	国寿安保中证 800 指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 12 月 30 日) 基金份额总额	279,462,836.68	126,560,552.29
本报告期期初基金份额总额	279,462,836.68	126,560,552.29
本报告期基金总申购份额	41,940,982.00	2,418,030.21
减：本报告期基金总赎回份额	89,430,429.42	69,820,133.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	231,973,389.26	59,158,449.42

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内，基金管理人于 2026 年 6 月 23 日发布公告，刘忠江先生于 2026 年 6 月 22 日起任公司总经理，鄂华先生于 2026 年 6 月 22 日离任公司总经理；基金管理人于 2026 年 7 月 2 日发布公告，岳海先生于 2026 年 6 月 30 日离任公司总经理助理。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

本报告期内，基金管理人未受监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

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

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 (%)	

山西 证券	2	1, 257, 243, 718. 45	100. 00	195, 502. 33	100. 00	-
----------	---	----------------------	---------	--------------	---------	---

注：根据中国证券监督管理委员会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号）相关规定，本公司制定了基金专用交易单元的选择标准和程序，具体如下：

1、关于基金专用交易单元的选择标准：

（1）综合实力较强，财务状况良好，具有较强研究实力，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演（为被动股票型基金选择证券公司不适用该条）；

（2）市场信誉良好、经营状况稳健；

（3）经营行为规范，合规风控能力较强，具备健全的内部控制制度；

（4）交易能力较强，具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能够提供全面的交易信息服务；

（5）从制度上和技术上保证我公司交易信息严格保密。

2、关于基金专用交易单元的选择程序：

（1）公司相关业务部门提出新增交易单元的需求，研究部根据公司《证券公司交易服务管理办法》的选择标准提出备选证券公司名单；

（2）备选的证券公司名单确定后，研究部会同投资相关部门组织证券公司就研究服务和佣金费率等展开评估，并对证券公司进行打分，最终按照综合分数排名情况确定入选的证券公司名单，合规管理部对谈判、打分及选择的过程进行合规性监督；

（3）入选证券公司名单确定后，研究部将全部协议内容以书面方式确定为合同文本，交由合规管理部审核后，与证券公司签署交易单元租用协议，协议约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

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

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	
	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 (%)
山西 证券	-	-	3, 320, 000, 000. 00	100. 00	-	-

10.8 其他重大事件

序	公告事项	法定披露方式	法定披露
---	------	--------	------

号			日期
1	国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上证报、证监会规定网站及公司网站	2026 年 1 月 30 日

§ 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	20260101~20260630	120,017,666.67	40,366,333.64	-	160,384,000.31	55.09
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。							
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，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保中证 800 指数增强型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司，地址：北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中

心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.gsfunds.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日