

国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

§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规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安沪深 300 指数增强
基金主代码	020220
交易代码	020220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 1 月 23 日
报告期末基金份额总额	208,491,129.98 份
投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以沪深 300 指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。正常情况下，本基金力

	争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	020220	020221
报告期末下属分级基金的份额总额	120,309,548.55 份	88,181,581.43 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 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
1.本期已实现收益	2,569,279.11	1,677,614.70
2.本期利润	19,434,503.22	14,083,230.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.1609	0.1479
4.期末基金资产净值	145,485,260.02	106,487,408.15
5.期末基金份额净值	1.2093	1.2076

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变

动收益)扣除相关费用和信用减值损失后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响;

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、国联安沪深 300 指数增强 A:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.55%	1.46%	15.25%	1.51%	0.30%	-0.05%
过去六个月	15.18%	1.16%	12.92%	1.19%	2.26%	-0.03%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	20.93%	1.06%	23.53%	1.14%	-2.60%	-0.08%

2、国联安沪深 300 指数增强 C:

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	15.48%	1.46%	15.25%	1.51%	0.23%	-0.05%
过去六个月	15.06%	1.16%	12.92%	1.19%	2.14%	-0.03%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	20.76%	1.06%	23.53%	1.14%	-2.77%	-0.08%

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

国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 1 月 23 日至 2024 年 9 月 30 日)

1. 国联安沪深 300 指数增强 A:



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；
 2、本基金基金合同于 2024 年 1 月 23 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；
 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

2. 国联安沪深 300 指数增强 C:



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；

- 2、本基金基金合同于 2024 年 1 月 23 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；
- 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章榭元	基金经理、量化投资部总经理	2024-01-23	-	16 年（自 2008 年起）	章榭元先生，硕士研究生。曾任建信基金管理有限公司研究员，富国基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，融通基金管理有限公司专户投资经理、基金经理、指数与量化投资部总经理。2019 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，担任量化投资部总经理（兼投资经理）。2020 年 5 月起担任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 8 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 5 月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置

					混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 11 月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月起兼任国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2024 年 1 月起兼任国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
章榭元	公募基金	14.00	47,604,551,186.93	2020-05-06
	私募资产管理计划	4.00	22,477,198,661.88	2024-09-02
	其他组合	0.00	0.00	-
	合计	18.00	70,081,749,848.81	

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》、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年第三季度，A 股市场强劲上涨，沪深 300 指数和中证 1000 指数分别上涨 16.07% 和 16.60%，反映投资者信心恢复。国内经济继续企稳回升，实体经济在政策支持下延续复苏态势，但仍存在一定的波动性。

货币政策保持稳健宽松，财政政策力度加大，企业投资信心和投资者风险偏好明显提升。房地产市场呈现积极变化，新房市场企稳，二手房交易回暖，成为经济复苏重要支撑。海外资金态度转变，外资重新流入中国资产，提振市场信心。尽管市场大幅上涨，整体估值仍处合理区间，结构性机会突出。科技创新、消费升级等主题受青睐。

展望未来，中国经济内生动力增强，A 股市场有望保持活力。本基金将坚持定量与定性相结合的价值投资理念，精选优质企业，力争为投资者创造稳定回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，国联安沪深 300 指数增强 A 的份额净值为 1.2093 元，国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值为 1.2076 元。本报告期内，国联安沪深 300 指数增强 A 的份额净值增长率为 15.55%，同期业绩比较基准收益率为 15.25%；国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值增长率为 15.48%，同期业绩比较基准收益率为 15.25%。

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	238,444,093.75	91.92
	其中：股票	238,444,093.75	91.92
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,544,063.06	2.14
7	其他各项资产	15,411,719.56	5.94
8	合计	259,399,876.37	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	31,250,715.79	12.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,439,250.92	0.97
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	1,359,973.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	1,095,720.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,788,205.65	0.71
J	金融业	4,335,621.00	1.72
K	房地产业	133,940.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,880.66	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	562,400.00	0.22
	合计	42,974,707.02	17.06

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,886,087.00	1.15
B	采矿业	10,099,528.00	4.01
C	制造业	103,820,908.44	41.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,458,346.00	2.56
E	建筑业	3,235,646.00	1.28
F	批发和零售业	1,711,011.00	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	6,557,297.00	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,742,093.08	2.68
J	金融业	49,224,778.21	19.54
K	房地产业	2,273,036.00	0.90
L	租赁和商务服务业	1,813,455.00	0.72

M	科学研究和技术服务业	356,048.00	0.14
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	291,153.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	195,469,386.73	77.58

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600519	贵州茅台	6,200	10,837,600.00	4.30
2	601318	中国平安	136,865	7,813,622.85	3.10
3	300750	宁德时代	24,100	6,070,549.00	2.41
4	600900	长江电力	168,800	5,072,440.00	2.01
5	000333	美的集团	63,400	4,822,204.00	1.91
6	600036	招商银行	114,200	4,295,062.00	1.70
7	601166	兴业银行	213,900	4,121,853.00	1.64
8	600276	恒瑞医药	69,600	3,640,080.00	1.44
9	000651	格力电器	72,100	3,456,474.00	1.37
10	000725	京东方 A	651,800	2,913,546.00	1.16

5.3.2 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	688208	道通科技	38,384.00	1,217,540.48	0.48
2	300529	健帆生物	36,300.00	1,188,462.00	0.47
3	688819	天能股份	34,667.00	1,175,211.30	0.47
4	301301	川宁生物	85,800.00	1,171,170.00	0.46
5	301381	赛维时代	41,600.00	1,159,808.00	0.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细****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	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-280,374.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-31,140.00

注：本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的股指期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆证监局、国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局黑龙江监管局、国家金融监督管理总局四川监管局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局河南监管局、国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局泉州监管分局、天津市市场监督管理委员会、国家金融监督管理总局北京监管局、河北省市场监督管理局的处罚。本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,288,399.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,123,320.39
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,411,719.56

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安沪深300指数增 强A	国联安沪深300指数增 强C
基金合同生效日基金份额总额	124,092,565.57	134,535,700.95
本报告期期初基金份额总额	120,593,840.40	101,723,490.81
报告期期间基金总申购份额	10,140,748.53	29,956,337.31
减：报告期期间基金总赎回份额	10,425,040.38	43,498,246.69
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	120,309,548.55	88,181,581.43

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

8.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二四年十月二十五日