

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

§ 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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§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	11
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	11
§5 托管人报告	11
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等内容真实、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	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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的情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	博时中证 500 指数增强	
基金主代码	005062	
交易代码	005062	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	311,739,593.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005062	005795
报告期末下属分级基金的份额总额	236,042,949.67 份	75,696,643.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。
投资策略	<p>本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>本基金的股票投资策略包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、指数化投资策略。本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。 2、投资组合构建和优化。本基金将以博时数量化模型对股票的回报预测为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。 3、指数增强策略。本基金主要通过博时数量化模型对股票进行综合评定，结合风险控制模型，在控制投资组合风险预算下，对股票组合进行优化，力争获得超越业绩比较基准的回报。 4、股票组合调整。包括定期和不定期调整。 5、存托凭证投资策略。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，

	基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 其他投资策略包括：债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略以及融资及转融通证券出借业务投资策略。
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	本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。

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		博时基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	许俊
	联系电话	0755-83169999	010-66596688
	电子邮箱	service@bosera.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594942
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		江向阳	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.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	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§ 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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强

		C
本期已实现收益	55,245.22	-230,586.11
本期利润	21,124,605.81	6,266,778.06
加权平均基金份额本期利润	0.0836	0.0772
本期加权平均净值利润率	6.45%	6.12%
本期基金份额净值增长率	6.51%	6.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	73,725,111.20	20,863,940.61
期末可供分配基金份额利润	0.3123	0.2756
期末基金资产净值	321,571,828.47	100,192,997.85
期末基金份额净值	1.3623	1.3236
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	36.23%	35.21%

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。

期末可供分配利润是指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。

上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。

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

博时中证 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	4.93%	0.75%	4.09%	0.75%	0.84%	0.00%
过去三个月	3.11%	1.46%	0.97%	1.43%	2.14%	0.03%
过去六个月	6.51%	1.25%	3.21%	1.29%	3.30%	-0.04%
过去一年	21.76%	1.59%	18.83%	1.64%	2.93%	-0.05%
过去三年	-0.55%	1.25%	-7.61%	1.29%	7.06%	-0.04%
自基金合同生效起至今	36.23%	1.31%	-7.49%	1.32%	43.72%	-0.01%

博时中证 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	4.90%	0.75%	4.09%	0.75%	0.81%	0.00%
过去三个月	3.01%	1.46%	0.97%	1.43%	2.04%	0.03%
过去六个月	6.30%	1.25%	3.21%	1.29%	3.09%	-0.04%
过去一年	21.29%	1.59%	18.83%	1.64%	2.46%	-0.05%
过去三年	-1.74%	1.25%	-7.61%	1.29%	5.87%	-0.04%
自基金合同生效起至今	35.21%	1.32%	-2.28%	1.33%	37.49%	-0.01%

注：自 2018 年 3 月 31 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2018 年 4 月 3 日，相关数据按实际存续期计算。

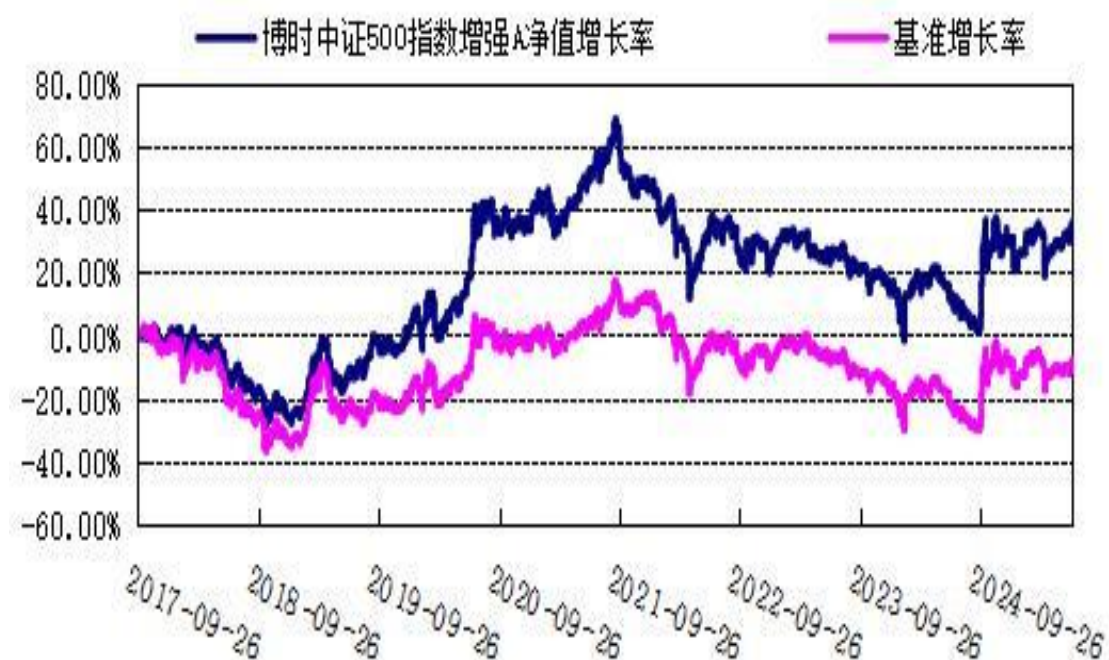
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

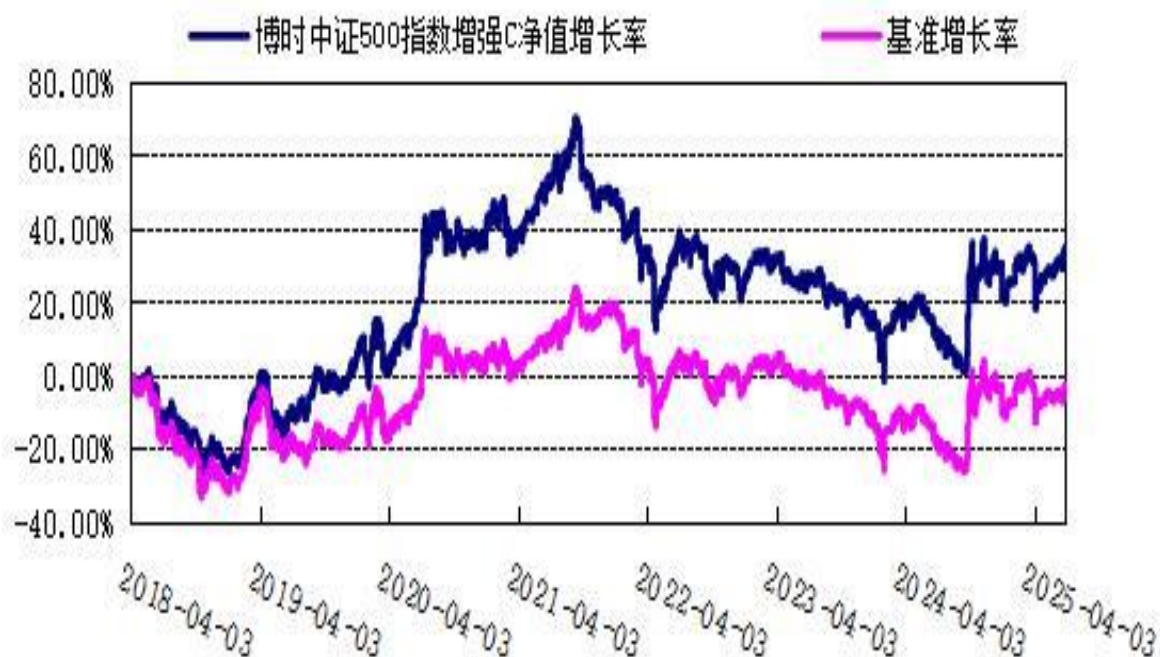
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 9 月 26 日至 2025 年 6 月 30 日)

博时中证 500 指数增强 A



博时中证 500 指数增强 C



§ 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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2020-12-23	—	18.8	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、

				<p>深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日-2024 年 7 月 10 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日一至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日一至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日一至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日一至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日一至今)的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：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。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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 23 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。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。

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 股市场虽经历了一波贸易战冲击，但在新质生产力产业链发力、宏观政策持续呵护之下，延续了 2024 年下半年以来的上涨行情。

具体来看，春节前后，两家非上市企业——DeepSeek 和宇树科技——分别发布创新性产品，为相关行业及产业链企业提供了强大的技术支撑与信心提振，引领了当季科技行情。但二季度初始，国际贸易环境出现波动，尽管多方努力后中美达成临时性关税协议，但整体贸易环境的不确定性有所升高，导致不少企业推迟或调整资本开支计划，出口型制造业的上游环节面临阶段性调整。在股票市场波动加大的背景下，宏观政策更为积极。市场流动性充裕，交易情绪较为活跃，A 股市场风格顺势转向结构性行情，中小市值相关个股表现相对突出。

整个上半年，沪深 300 指数微涨 0.03%，中证 1000 指数上涨 6.69%，本基金业绩基准关联的权益指数——中证 500 指数上涨 3.31%。

不过即便市场多有变化，本基金仍然坚持了相对稳定且偏长期的因子配置逻辑：以业绩基准指数中证 500 指数为锚，不做仓位择时，只追求超额收益；在因子的配置上，坚持成长、分析师、价值、动量、反转等因子的协同互补，坚持模型逻辑的合理性和一致性；控制跟踪误差，限制市值敞口的一定偏离，控制行业风险敞口的偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.3623 元，份额累计净值为 1.3623 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.3236 元，份额累计净值为 1.3236 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 6.51%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 6.30%，同期业绩基准增长率为 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

展望下半年，我们对 A 股市场的乐观判断不变。国内方面，政策持续发力：7 月以来，先是年内第三批以旧换新补贴资金到账，随后国务院印发《育儿补贴制度实施方案》，开启新一波财政刺激。微观层面，陆续披露的半年报显示，AI 产业链景气度持续，大语言模型日益成熟，也为诸多传统行业提升生产率提供了助力。海外市场方面，美联储 9 月重启降息的预期升温，中美经贸会谈持续推进，双方正共同推动已暂停的对等关税及反制措施延续实施。市场对整体宏观基本面的担忧有限。值得关注的是，上证指数自 5 月以来连续数月上涨，市场内生的向上趋势正在形成，近十年高点 3732

点的压力区间已然松动。我们期待行情的进一步演绎。

本基金将继续坚持量化多因子模型的框架，紧扣长期表现稳定、逻辑清晰的因子，坚持控制基金与业绩基准中证 500 指数的跟踪误差，适当暴露一定的行业偏离，根据模型结果配置股票组合，争取获得一定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、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，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。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并出具报告。上述参与估值流程各方之间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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博时中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	21,149,553.14	26,230,970.79
结算备付金		4,008,905.05	4,287,365.72
存出保证金		52,316.81	73,812.02
交易性金融资产	6.4.6.2	397,383,724.55	417,306,846.81
其中：股票投资		397,361,423.08	417,306,846.81
基金投资		—	—
债券投资		22,301.47	—

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		2,261,933.18	3,678,328.53
应收股利		-	-
应收申购款		1,763,385.84	675,543.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		426,619,818.57	452,252,867.53
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	3,773,373.85
应付赎回款		3,986,928.53	865,390.16
应付管理人报酬		342,041.37	383,473.30
应付托管费		68,408.27	76,694.68
应付销售服务费		32,628.03	36,850.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	424,986.05	698,870.66
负债合计		4,854,992.25	5,834,654.08
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	311,739,593.59	351,273,810.55
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	110,025,232.73	95,144,402.90
净资产合计		421,764,826.32	446,418,213.45
负债和净资产总计		426,619,818.57	452,252,867.53

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 311,739,593.59 份。其中 A 类基金份额净值 1.3623 元，基金份额总额 236,042,949.67 份；C 类基金份额净值 1.3236 元，基金份额总额 75,696,643.92 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		30,279,846.12	-15,802,643.51
1. 利息收入		59,595.21	72,946.03
其中：存款利息收入	6.4.6.9	59,595.21	72,946.03
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,597,271.90	-5,914,045.92
其中：股票投资收益	6.4.6.10	-1,158,244.80	-11,048,475.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	10,710.10	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	-	-11,181.52
股利收益	6.4.6.14	3,744,806.60	5,145,610.86
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.15	27,566,724.76	-9,968,057.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	56,254.25	6,514.31
减：二、营业总支出		2,888,462.25	2,822,991.45
1. 管理人报酬		2,132,293.22	2,032,787.90
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		426,458.66	406,557.55
3. 销售服务费		202,988.20	195,922.04
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	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		0.04	-
8. 其他费用	6.4.6.18	126,722.13	187,723.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,391,383.87	-18,625,634.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,391,383.87	-18,625,634.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		27,391,383.87	-18,625,634.96
----------	--	---------------	----------------

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	351,273,810.55	-	95,144,402.90	446,418,213.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	351,273,810.55	-	95,144,402.90	446,418,213.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,534,216.96	-	14,880,829.83	-24,653,387.13
（一）、综合收益总额	-	-	27,391,383.87	27,391,383.87
（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）	-39,534,216.96	-	-12,510,554.04	-52,044,771.00
其中：1. 基金申购款	46,784,323.95	-	13,050,479.21	59,834,803.16
2. 基金赎回款	-86,318,540.91	-	-25,561,033.25	-111,879,574.16
（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	311,739,593.59	-	110,025,232.73	421,764,826.32
项目	上年度可比期间			

	2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	362,148,989.40	-	59,806,024.73	421,955,014.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	362,148,989.40	-	59,806,024.73	421,955,014.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,818,429.57	-	-20,525,383.88	-32,343,813.45
（一）、综合收益总额	-	-	-18,625,634.96	-18,625,634.96
（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）	-11,818,429.57	-	-1,899,748.92	-13,718,178.49
其中：1. 基金申购款	45,757,925.69	-	6,182,382.20	51,940,307.89
2. 基金赎回款	-57,576,355.26	-	-8,082,131.12	-65,658,486.38
（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	350,330,559.83	-	39,280,640.85	389,611,200.68

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：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时中证 500 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[2017]1137号《关于准予博时中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由博时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《博时中证 500 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 383,070,076.74 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 344 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 383,128,088.40 份基金份额,其中认购资金利息折合 58,011.66 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据申购费用与销售服务费收取方式等不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金自 2018 年 3 月 31 日起增加 C 类基金份额,原基金份额转为 A 类基金份额。在投资者申购时收取申购费用,不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者申购时不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以中证 500 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资组合比例为: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%;每个交易日日终在扣除股指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、应收申购款等。本基金业绩比较基准为:中证 500 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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

本基金本报告期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期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产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。

6.4.5 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]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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《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《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《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》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。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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	21,149,553.14
等于：本金	21,147,435.68
加：应计利息	2,117.46
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—

减：坏账准备	-
合计	21,149,553.14

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		381,074,321.33	-	397,361,423.08	16,287,101.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	22,300.00	1.47	22,301.47	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,300.00	1.47	22,301.47	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		381,096,621.33	1.47	397,383,724.55	16,287,101.75

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	405.95
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	302,339.58
其中：交易所市场	302,339.58
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	78,351.28
应付指数使用费	43,889.24
合计	424,986.05

6.4.6.7 实收基金

博时中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	266,495,854.94	266,495,854.94
本期申购	32,005,786.97	32,005,786.97
本期赎回（以“-”号填列）	-62,458,692.24	-62,458,692.24
本期末	236,042,949.67	236,042,949.67

博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	84,777,955.61	84,777,955.61
本期申购	14,778,536.98	14,778,536.98
本期赎回（以“-”号填列）	-23,859,848.67	-23,859,848.67
本期末	75,696,643.92	75,696,643.92

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

6.4.6.8 未分配利润

博时中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	83,036,921.32	-8,675,261.15	74,361,660.17
加：会计政策变更（若有）	—	—	—
前期差错更正（若有）	—	—	—
其他（若有）	—	—	—
本期期初	83,036,921.32	-8,675,261.15	74,361,660.17
本期利润	55,245.22	21,069,360.59	21,124,605.81
本期基金份额交易产生的变动数	-9,367,055.34	-590,331.84	-9,957,387.18
其中：基金申购款	9,399,884.02	-181,675.68	9,218,208.34

基金赎回款	-18,766,939.36	-408,656.16	-19,175,595.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,725,111.20	11,803,767.60	85,528,878.80

博时中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,519,861.37	-2,737,118.64	20,782,742.73
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	23,519,861.37	-2,737,118.64	20,782,742.73
本期利润	-230,586.11	6,497,364.17	6,266,778.06
本期基金份额交易产生的变动数	-2,425,334.65	-127,832.21	-2,553,166.86
其中：基金申购款	3,935,186.14	-102,915.27	3,832,270.87
基金赎回款	-6,360,520.79	-24,916.94	-6,385,437.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,863,940.61	3,632,413.32	24,496,353.93

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,474.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	16,637.23
其他	483.83
合计	59,595.21

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,491,009,195.91
减：卖出股票成本总额	1,490,629,995.84
减：交易费用	1,537,444.87
买卖股票差价收入	-1,158,244.80

6.4.6.11 债券投资收益
6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	8.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,701.57
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	10,710.10

6.4.6.11.2 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1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	57,711.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	47,000.00
减：应计利息总额	7.42
减：交易费用	2.31
买卖债券差价收入	10,701.57

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,744,806.60
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	3,744,806.60
----	--------------

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	27,566,724.76
——股票投资	27,566,724.76
——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	27,566,724.76

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	43,658.67
基金转换费收入	12,595.58
合计	56,254.25

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
其他	227.10
银行汇划费	4,254.51
指数使用费	43,889.24
合计	126,722.13

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	72,635,625.28	2.48%	565,271,200.54	22.72%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

无。

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	15,005.24	2.48%	15,005.24	4.96%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	421,641.82	22.72%	218,680.81	22.11%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,132,293.22	2,032,787.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	780,436.26	705,943.31
应支付基金管理人的净管理费	1,351,856.96	1,326,844.59

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的托管费	426,458.66	406,557.55
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.9.2.3 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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
招商证券	-	80.75	80.75
博时基金	-	17,364.71	17,364.71
合计	-	17,445.46	17,445.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	24,275.65	24,275.65
合计	-	24,275.65	24,275.65

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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

无。

6.4.9.4.2 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

无。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 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

无。

6.4.9.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	21,149,553.14	42,474.15	26,022,323.10	41,564.47

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	1,326.00	115,308.96

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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	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

				型						
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	首次公开发 行限售	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	首次公开发 行限售	47.27	124.16	326.00	15,410.02	40,476.16	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	首次公开发 行限售	11.68	26.95	994.00	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	首次公开发 行限售	10.40	34.11	701.00	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	首次公开发 行限售	27.50	56.19	397.00	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	首次公开发 行限售	25.80	79.68	227.00	5,855.50	18,087.36	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	首次公开发 行限售	12.80	44.54	382.00	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	首次公开发 行限售	6.70	24.80	658.00	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	首次公开发 行限售	27.49	45.22	350.00	9,620.72	15,827.00	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	首次公开发 行限售	29.93	77.87	182.00	5,447.00	14,172.34	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	首次公开	4.92	18.99	734.00	3,611.28	13,938.66	-

				发行 限售						
001388	信通 电子	2025-06-24	5 个 交易 日	新股 未上 市	16.42	16.42	843.00	13,842.06	13,842.06	-
688758	赛分 科技	2025-01-02	6 个 月	首次 公开 发行 限售	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和 磁材	2024-12-24	6 个 月	首次 公开 发行 限售	12.30	54.45	226.00	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工 科技	2025-04-10	6 个 月	首次 公开 发行 限售	26.60	82.50	143.00	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通 科技	2025-01-08	6 个 月	首次 公开 发行 限售	11.80	33.85	342.00	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭 股份	2025-01-16	6 个 月	首次 公开 发行 限售	5.30	14.44	709.00	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优 绿能	2025-05-28	6 个 月	首次 公开 发行 限售	89.60	139.48	73.00	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航 新能	2025-03-26	6 个 月	首次 公开 发行 限售	11.80	22.98	437.00	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾 股份	2025-04-02	6 个 月	首次 公开 发行 限售	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
603049	中策 橡胶	2025-05-27	6 个 月	首次 公开 发行 限售	46.50	42.85	191.00	8,881.50	8,184.35	-
688755	汉邦 科技	2025-05-09	6 个 月	首次 公开 发行	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-

				限售						
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	首次公开发 行限售	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	首次公开发 行限售	7.40	20.21	366.00	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	首次公开发 行限售	26.50	32.68	205.00	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	首次公开发 行限售	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	首次公开发 行限售	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	首次公开发 行限售	93.50	90.66	61.00	5,703.50	5,530.26	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	首次公开发 行限售	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	首次公开发 行限售	8.60	15.61	286.00	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	首次公开发 行限售	20.60	35.08	126.00	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	首次公开发 行限售	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	首次公开发 行	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-

				限售						
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	首次公开发 行限售	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	首次公开发 行限售	12.08	18.12	178.00	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	首次公开发 行限售	20.52	37.47	78.00	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	首次公开发 行限售	19.88	43.81	57.00	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	首次公开发 行限售	11.50	22.39	105.00	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	首次公开发 行限售	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	首次公开发 行限售	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	首次公开发 行限售	16.42	16.42	94.00	1,543.48	1,543.48	-

6.4.11.1.2 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
123257	安克转债	2025-06-16	14 个交易日	新债未上市	100.00	100.01	223.00	22,300.00	22,301.47	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份

自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.11.2 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	18,713.00	490,282.70	712,029.65	-

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%，实现对中证 500 指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风

险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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。

6.4.12.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，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主要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，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；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。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 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 6 月 30 日	上年末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	22,301.47	-
未评级	-	-
合计	22,301.47	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日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。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。此外，本基金还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。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额（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。

6.4.12.3.1 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《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。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”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。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	21,149,553.14	-	-	-	21,149,553.14
结算备付金	4,008,905.05	-	-	-	4,008,905.05
存出保证金	52,316.81	-	-	-	52,316.81
交易性金融资产	-	-	22,301.47	397,361,423.08	397,383,724.55
应收清算款	-	-	-	2,261,933.18	2,261,933.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,763,385.84	1,763,385.84
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,210,775.00	-	22,301.47	401,386,742.10	426,619,818.57
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,986,928.53	3,986,928.53
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	342,041.37	342,041.37
应付托管费	-	-	-	68,408.27	68,408.27
应付销售服务费	-	-	-	32,628.03	32,628.03
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	424,986.05	424,986.05
负债总计	-	-	-	4,854,992.25	4,854,992.25
利率敏感度缺口	25,210,775.00	-	22,301.47	396,531,749.85	421,764,826.32
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	26,230,970.79	-	-	-	26,230,970.79
结算备付金	4,287,365.72	-	-	-	4,287,365.72
存出保证金	73,812.02	-	-	-	73,812.02
交易性金融资产	-	-	-	417,306,846.81	417,306,846.81
应收清算款	-	-	-	3,678,328.53	3,678,328.53
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	675,543.66	675,543.66
应收股利	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产总计	30,592,148.53	-	-421,660,719.00	452,252,867.53
负债				
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	865,390.16	865,390.16
应付清算款	-	-	3,773,373.85	3,773,373.85
应付管理人报酬	-	-	383,473.30	383,473.30
应付托管费	-	-	76,694.68	76,694.68
应付销售服务费	-	-	36,850.90	36,850.90
应交税费	-	-	0.53	0.53
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	698,870.66	698,870.66
负债总计	-	-	5,834,654.08	5,834,654.08
利率敏感度缺口	30,592,148.53	-	-415,826,064.92	446,418,213.45

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。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债和可交换债）、资产支持证券投资和国债期货投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 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	397,361,423.08	94.21	417,306,846.81	93.48
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	22,301.47	0.01	—	—
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	397,383,724.55	94.22	417,306,846.81	93.48

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币万元)	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,938	增加约 2,167
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,938	减少约 2,167

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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6月30日
第一层次	396,194,230.04
第二层次	749,716.66
第三层次	439,777.85
合计	397,383,724.55

6.4.13.2.2 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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	397,361,423.08	93.14
	其中：股票	397,361,423.08	93.14
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	22,301.47	0.01
	其中：债券	22,301.47	0.01
	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	25,158,458.19	5.90
8	其他各项资产	4,077,635.83	0.96
9	合计	426,619,818.57	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	338,550.00	0.08
B	采矿业	6,551,283.50	1.55
C	制造业	243,585,074.62	57.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,341,258.00	2.93
E	建筑业	23,424.00	0.01
F	批发和零售业	24,576,598.30	5.83
G	交通运输、仓储和邮政业	4,323,564.00	1.03
H	住宿和餐饮业	108,801.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,035,845.04	7.12
J	金融业	44,350,124.26	10.52
K	房地产业	8,521,084.00	2.02
L	租赁和商务服务业	3,225,774.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	607,529.36	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	9,911,762.00	2.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	66,718.00	0.02
Q	卫生和社会工作	701,760.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	7,306,085.00	1.73
S	综合	786,188.00	0.19
	合计	397,361,423.08	94.21

7.2.2 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投资股票。

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

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	占基金资产净值比例 (%)
1	689009	九号公司	127,707	7,556,423.19	1.79
2	688213	思特威	67,100	6,858,962.00	1.63
3	002414	高德红外	659,720	6,762,130.00	1.60
4	300803	指南针	83,720	6,752,855.20	1.60
5	002624	完美世界	438,000	6,644,460.00	1.58
6	000783	长江证券	957,200	6,633,396.00	1.57
7	600873	梅花生物	617,000	6,595,730.00	1.56
8	603087	甘李药业	120,100	6,579,078.00	1.56
9	000893	亚钾国际	215,500	6,495,170.00	1.54
10	002202	金风科技	614,422	6,297,825.50	1.49
11	600998	九州通	1,222,100	6,281,594.00	1.49
12	300573	兴齐眼药	117,720	6,096,718.80	1.45
13	000959	首钢股份	1,725,200	5,865,680.00	1.39
14	603379	三美股份	119,700	5,759,964.00	1.37

15	600299	安迪苏	593,700	5,729,205.00	1.36
16	688582	芯动联科	82,500	5,544,000.00	1.31
17	600909	华安证券	945,050	5,509,641.50	1.31
18	600582	天地科技	903,800	5,413,762.00	1.28
19	300677	英科医疗	228,300	5,406,144.00	1.28
20	002266	浙富控股	1,701,400	5,240,312.00	1.24
21	300373	扬杰科技	100,900	5,236,710.00	1.24
22	603816	顾家家居	204,600	5,221,392.00	1.24
23	600166	福田汽车	1,922,900	5,211,059.00	1.24
24	600578	京能电力	1,157,400	5,196,726.00	1.23
25	688469	芯联集成	1,086,503	5,182,619.31	1.23
26	688425	铁建重工	1,248,929	5,095,630.32	1.21
27	600704	物产中大	962,100	5,070,267.00	1.20
28	300395	菲利华	98,100	5,012,910.00	1.19
29	000878	云南铜业	392,000	4,986,240.00	1.18
30	600517	国网英大	971,600	4,955,160.00	1.17
31	000050	深天马 A	572,900	4,881,108.00	1.16
32	000623	吉林敖东	286,800	4,861,260.00	1.15
33	000009	中国宝安	545,537	4,844,368.56	1.15
34	002958	青农商行	1,332,700	4,811,047.00	1.14
35	000060	中金岭南	1,029,100	4,713,278.00	1.12
36	300070	碧水源	1,038,100	4,671,450.00	1.11
37	600739	辽宁成大	420,000	4,620,000.00	1.10
38	600959	江苏有线	1,342,580	4,618,475.20	1.10
39	603858	步长制药	283,899	4,610,519.76	1.09
40	000825	太钢不锈	1,276,300	4,581,917.00	1.09
41	601568	北元集团	1,073,900	4,456,685.00	1.06
42	601019	山东出版	465,400	4,407,338.00	1.04
43	300140	节能环保	709,900	4,380,083.00	1.04
44	002138	顺络电子	147,500	4,147,700.00	0.98
45	300604	长川科技	84,600	3,799,386.00	0.90
46	688100	威胜信息	89,800	3,327,090.00	0.79
47	000988	华工科技	70,500	3,314,205.00	0.79
48	601456	国联民生	318,100	3,292,335.00	0.78
49	603565	中谷物流	340,200	3,248,910.00	0.77
50	000415	渤海租赁	957,200	3,187,476.00	0.76
51	688387	信科移动	548,248	3,097,601.20	0.73
52	600392	盛和资源	222,000	2,923,740.00	0.69
53	688188	柏楚电子	21,903	2,883,748.98	0.68
54	600499	科达制造	293,100	2,872,380.00	0.68
55	600325	华发股份	584,900	2,848,463.00	0.68
56	600483	福能股份	293,300	2,827,412.00	0.67
57	603233	大参林	171,900	2,801,970.00	0.66

58	601636	旗滨集团	558,100	2,796,081.00	0.66
59	600056	中国医药	266,800	2,758,712.00	0.65
60	603868	飞科电器	72,900	2,614,923.00	0.62
61	601991	大唐发电	810,600	2,569,602.00	0.61
62	688093	世华科技	71,700	2,226,285.00	0.53
63	003031	中瓷电子	38,900	2,069,869.00	0.49
64	002340	格林美	310,700	1,972,945.00	0.47
65	601555	东吴证券	217,000	1,898,750.00	0.45
66	300476	胜宏科技	13,674	1,837,512.12	0.44
67	603893	瑞芯微	11,600	1,761,576.00	0.42
68	300251	光线传媒	85,800	1,739,166.00	0.41
69	688270	臻镭科技	37,200	1,732,032.00	0.41
70	300241	瑞丰光电	297,400	1,695,180.00	0.40
71	301526	国际复材	461,100	1,678,404.00	0.40
72	688499	利元亨	40,200	1,672,722.00	0.40
73	688588	凌志软件	114,800	1,672,636.00	0.40
74	600219	南山铝业	434,500	1,664,135.00	0.39
75	002314	南山控股	631,600	1,661,108.00	0.39
76	600675	中华企业	573,200	1,650,816.00	0.39
77	603077	和邦生物	932,300	1,631,525.00	0.39
78	002155	湖南黄金	88,910	1,587,043.50	0.38
79	603529	爱玛科技	41,400	1,424,160.00	0.34
80	002487	大金重工	42,900	1,411,410.00	0.33
81	600663	陆家嘴	158,900	1,407,854.00	0.33
82	603486	科沃斯	23,800	1,385,874.00	0.33
83	601665	齐鲁银行	217,400	1,373,968.00	0.33
84	300454	深信服	13,027	1,226,882.86	0.29
85	300866	安克创新	10,616	1,205,977.60	0.29
86	600352	浙江龙盛	106,300	1,080,008.00	0.26
87	300888	稳健医疗	25,700	1,056,270.00	0.25
88	601061	中信金属	131,900	1,043,329.00	0.25
89	688608	恒玄科技	2,962	1,030,716.76	0.24
90	000553	安道麦 A	141,700	1,023,074.00	0.24
91	002532	天山铝业	118,900	988,059.00	0.23
92	600988	赤峰黄金	39,100	972,808.00	0.23
93	000898	鞍钢股份	418,200	970,224.00	0.23
94	000709	河钢股份	446,000	963,360.00	0.23
95	603766	隆鑫通用	72,900	930,204.00	0.22
96	600298	安琪酵母	25,700	903,869.00	0.21
97	601168	西部矿业	51,300	853,119.00	0.20
98	002595	豪迈科技	14,100	835,002.00	0.20
99	600038	中直股份	21,500	834,415.00	0.20
100	301165	锐捷网络	13,200	811,272.00	0.19

101	688120	华海清科	4,800	809,760.00	0.19
102	002080	中材科技	41,500	809,250.00	0.19
103	000423	东阿阿胶	15,400	805,420.00	0.19
104	301396	宏景科技	12,800	795,008.00	0.19
105	002683	广东宏大	23,300	790,802.00	0.19
106	600673	东阳光	67,600	786,188.00	0.19
107	300558	贝达药业	13,500	782,325.00	0.19
108	300627	华测导航	21,340	746,900.00	0.18
109	000987	越秀资本	108,700	745,682.00	0.18
110	603939	益丰药房	30,200	738,994.00	0.18
111	002850	科达利	6,500	735,605.00	0.17
112	301498	乖宝宠物	6,700	732,779.00	0.17
113	601098	中南传媒	55,100	722,912.00	0.17
114	600583	海油工程	131,500	717,990.00	0.17
115	688297	中无人机	13,400	715,560.00	0.17
116	688313	仕佳光子	18,713	712,029.65	0.17
117	300502	新易盛	5,600	711,312.00	0.17
118	600008	首创环保	234,150	707,133.00	0.17
119	000723	美锦能源	163,600	706,752.00	0.17
120	002056	横店东磁	49,800	704,670.00	0.17
121	600763	通策医疗	17,000	701,760.00	0.17
122	002939	长城证券	83,600	700,568.00	0.17
123	600435	北方导航	44,900	699,991.00	0.17
124	600132	重庆啤酒	12,700	699,770.00	0.17
125	688685	迈信林	12,500	698,125.00	0.17
126	002500	山西证券	118,100	689,704.00	0.16
127	002926	华西证券	76,200	681,228.00	0.16
128	688668	鼎通科技	10,906	681,188.76	0.16
129	000528	柳工	70,500	677,505.00	0.16
130	300699	光威复材	21,100	668,237.00	0.16
131	002299	圣农发展	46,400	663,056.00	0.16
132	601211	国泰海通	34,600	662,936.00	0.16
133	002572	索菲亚	47,000	658,470.00	0.16
134	300972	万辰集团	3,600	648,864.00	0.15
135	600339	中油工程	194,200	635,034.00	0.15
136	688256	寒武纪	1,014	609,921.00	0.14
137	000902	新洋丰	42,500	587,775.00	0.14
138	002281	光迅科技	11,900	586,908.00	0.14
139	300365	恒华科技	88,700	584,533.00	0.14
140	600338	西藏珠峰	52,600	583,334.00	0.14
141	300812	易天股份	25,200	582,372.00	0.14
142	000977	浪潮信息	11,400	580,032.00	0.14
143	002758	浙农股份	64,800	578,664.00	0.14

144	600007	中国国贸	27,800	572,124.00	0.14
145	300017	网宿科技	51,400	551,008.00	0.13
146	601399	国机重装	179,400	538,200.00	0.13
147	688775	影石创新	3,259	534,510.68	0.13
148	300492	华图山鼎	7,800	529,464.00	0.13
149	600801	华新水泥	44,600	528,064.00	0.13
150	600637	东方明珠	68,300	510,201.00	0.12
151	600956	新天绿能	63,800	492,536.00	0.12
152	300601	康泰生物	32,300	490,637.00	0.12
153	600271	航天信息	52,800	487,872.00	0.12
154	603596	伯特利	9,018	475,158.42	0.11
155	600901	江苏金租	74,900	453,894.00	0.11
156	000429	粤高速 A	33,200	442,556.00	0.10
157	603466	风语筑	42,700	430,843.00	0.10
158	002261	拓维信息	13,400	414,730.00	0.10
159	300735	光弘科技	16,400	411,640.00	0.10
160	300207	欣旺达	20,000	401,200.00	0.10
161	603636	南威软件	31,400	396,896.00	0.09
162	002185	华天科技	39,200	395,920.00	0.09
163	688072	拓荆科技	2,500	384,275.00	0.09
164	600728	佳都科技	67,500	367,875.00	0.09
165	002373	千方科技	39,300	365,490.00	0.09
166	688235	百济神州	1,543	360,506.52	0.09
167	002244	滨江集团	36,100	351,975.00	0.08
168	600062	华润双鹤	18,500	345,210.00	0.08
169	300967	晓鸣股份	18,300	338,550.00	0.08
170	300595	欧普康视	22,000	335,940.00	0.08
171	688122	西部超导	6,300	326,844.00	0.08
172	601158	重庆水务	68,100	315,984.00	0.07
173	600312	平高电气	19,600	301,644.00	0.07
174	600459	贵研铂业	18,800	291,588.00	0.07
175	600536	中国软件	6,200	289,974.00	0.07
176	000831	中国稀土	7,800	281,736.00	0.07
177	300033	同花顺	1,000	273,010.00	0.06
178	603380	易德龙	10,100	268,660.00	0.06
179	603173	福斯达	7,000	248,850.00	0.06
180	002603	以岭药业	17,200	242,520.00	0.06
181	600871	石化油服	120,300	234,585.00	0.06
182	601126	四方股份	13,400	218,018.00	0.05
183	300074	华平股份	43,600	212,768.00	0.05
184	603325	博隆技术	2,300	207,667.00	0.05
185	688428	诺诚健华	8,500	207,655.00	0.05
186	600498	烽火通信	9,000	189,270.00	0.04

187	600262	北方股份	8,300	189,240.00	0.04
188	600143	金发科技	18,100	186,611.00	0.04
189	600487	亨通光电	12,000	183,600.00	0.04
190	600380	健康元	16,600	183,098.00	0.04
191	603444	吉比特	600	181,170.00	0.04
192	603713	密尔克卫	3,300	175,956.00	0.04
193	600531	豫光金铅	21,900	169,506.00	0.04
194	600004	白云机场	18,300	166,530.00	0.04
195	600968	海油发展	40,100	163,608.00	0.04
196	300054	鼎龙股份	5,700	163,476.00	0.04
197	603225	新凤鸣	15,300	162,945.00	0.04
198	601156	东航物流	12,300	161,007.00	0.04
199	002315	焦点科技	3,500	159,915.00	0.04
200	300073	当升科技	3,400	149,158.00	0.04
201	000513	丽珠集团	3,800	136,952.00	0.03
202	600098	广州发展	21,800	136,250.00	0.03
203	688070	纵横股份	2,800	135,240.00	0.03
204	600496	精工钢构	41,900	134,080.00	0.03
205	300763	锦浪科技	2,300	131,997.00	0.03
206	600866	星湖科技	19,100	131,981.00	0.03
207	000039	中集集团	16,500	129,690.00	0.03
208	601333	广深铁路	44,500	128,605.00	0.03
209	002841	视源股份	3,600	124,560.00	0.03
210	000636	风华高科	8,800	120,912.00	0.03
211	688617	惠泰医疗	400	118,800.00	0.03
212	600528	中铁工业	15,200	112,176.00	0.03
213	600258	首旅酒店	7,700	108,801.00	0.03
214	000519	中兵红箭	4,600	100,694.00	0.02
215	300772	运达股份	7,700	99,176.00	0.02
216	688557	兰剑智能	3,132	93,740.76	0.02
217	300994	久祺股份	5,700	89,148.00	0.02
218	688099	晶晨股份	1,200	85,212.00	0.02
219	000733	振华科技	1,700	85,085.00	0.02
220	300048	合康新能	12,500	73,375.00	0.02
221	000960	锡业股份	4,700	71,910.00	0.02
222	688334	西高院	3,700	63,566.00	0.02
223	000526	学大教育	1,300	62,075.00	0.01
224	001696	宗申动力	2,600	58,370.00	0.01
225	300199	翰宇药业	3,500	57,925.00	0.01
226	603966	法兰泰克	6,100	56,608.00	0.01
227	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
228	601016	节能风电	15,900	45,951.00	0.01
229	002507	涪陵榨菜	3,500	44,765.00	0.01

230	603927	中科软	2,200	42,548.00	0.01
231	300100	双林股份	840	39,547.20	0.01
232	688096	京源环保	2,500	38,050.00	0.01
233	300394	天孚通信	448	35,768.32	0.01
234	002463	沪电股份	800	34,064.00	0.01
235	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
236	001227	兰州银行	10,500	26,250.00	0.01
237	688234	天岳先进	424	24,825.20	0.01
238	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
239	002209	达意隆	1,900	23,845.00	0.01
240	300383	光环新网	1,600	22,880.00	0.01
241	688208	道通科技	745	22,797.00	0.01
242	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.01
243	002048	宁波华翔	1,200	22,092.00	0.01
244	300474	景嘉微	300	21,900.00	0.01
245	000933	神火股份	1,300	21,632.00	0.01
246	600863	内蒙华电	5,100	20,961.00	0.00
247	301606	绿联科技	396	20,366.28	0.00
248	600282	南钢股份	4,800	20,160.00	0.00
249	600737	中粮糖业	2,100	19,845.00	0.00
250	002385	大北农	4,600	18,584.00	0.00
251	000932	华菱钢铁	4,200	18,480.00	0.00
252	603612	索通发展	1,000	18,380.00	0.00
253	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
254	600694	大商股份	946	17,548.30	0.00
255	600861	北京人力	900	17,370.00	0.00
256	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
257	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
258	600095	湘财股份	1,600	16,048.00	0.00
259	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
260	600566	济川药业	600	15,798.00	0.00
261	600699	均胜电子	900	15,696.00	0.00
262	001286	陕西能源	1,800	15,660.00	0.00
263	000930	中粮科技	2,800	15,624.00	0.00
264	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
265	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
266	300682	朗新集团	600	14,100.00	0.00
267	601600	中国铝业	2,000	14,080.00	0.00
268	002465	海格通信	1,000	13,940.00	0.00
269	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
270	600649	城投控股	3,200	13,728.00	0.00
271	601567	三星医疗	600	13,452.00	0.00
272	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00

273	600096	云天化	600	13,182.00	0.00
274	601077	渝农商行	1,800	12,852.00	0.00
275	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
276	600827	百联股份	1,300	11,882.00	0.00
277	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
278	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
279	600482	中国动力	500	11,535.00	0.00
280	000683	博源化工	2,400	11,496.00	0.00
281	600057	厦门象屿	1,600	11,248.00	0.00
282	300724	捷佳伟创	200	10,860.00	0.00
283	300776	帝尔激光	200	10,642.00	0.00
284	603737	三棵树	280	10,318.00	0.00
285	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
286	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
287	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
288	300390	天华新能	510	9,725.70	0.00
289	600755	厦门国贸	1,600	9,680.00	0.00
290	001339	智微智能	200	9,666.00	0.00
291	000156	华数传媒	1,200	9,528.00	0.00
292	600872	中炬高新	500	9,500.00	0.00
293	002558	巨人网络	400	9,420.00	0.00
294	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
295	601138	工业富联	400	8,552.00	0.00
296	603049	中策橡胶	191	8,184.35	0.00
297	600848	上海临港	900	8,163.00	0.00
298	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
299	600985	淮北矿业	700	7,938.00	0.00
300	600820	隧道股份	1,300	7,930.00	0.00
301	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
302	601601	中国太保	200	7,502.00	0.00
303	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
304	002925	盈趣科技	400	7,192.00	0.00
305	002170	芭田股份	700	7,175.00	0.00
306	000027	深圳能源	1,100	7,018.00	0.00
307	688180	君实生物	200	6,796.00	0.00
308	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
309	000997	新大陆	200	6,476.00	0.00
310	002756	永兴材料	200	6,350.00	0.00
311	688478	晶升股份	200	6,120.00	0.00
312	603517	绝味食品	400	6,100.00	0.00
313	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
314	600970	中材国际	700	6,006.00	0.00
315	600050	中国联通	1,100	5,874.00	0.00

316	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
317	000090	天健集团	1,600	5,664.00	0.00
318	002936	郑州银行	2,700	5,562.00	0.00
319	603202	天有为	61	5,530.26	0.00
320	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
321	000403	派林生物	260	4,713.80	0.00
322	300820	英杰电气	100	4,585.00	0.00
323	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
324	600551	时代出版	500	4,460.00	0.00
325	002167	东方锆业	400	4,452.00	0.00
326	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
327	601231	环旭电子	300	4,389.00	0.00
328	601958	金钼股份	400	4,376.00	0.00
329	688348	昱能科技	100	4,297.00	0.00
330	603156	养元饮品	200	4,232.00	0.00
331	600879	航天电子	400	4,188.00	0.00
332	000560	我爱我家	1,400	4,158.00	0.00
333	002469	三维化学	500	4,155.00	0.00
334	600141	兴发集团	200	4,106.00	0.00
335	601698	中国卫通	200	4,094.00	0.00
336	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
337	600170	上海建工	1,600	3,824.00	0.00
338	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
339	600177	雅戈尔	492	3,591.60	0.00
340	605098	行动教育	100	3,578.00	0.00
341	600171	上海贝岭	100	3,425.00	0.00
342	600795	国电电力	700	3,388.00	0.00
343	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
344	688516	奥特维	100	3,324.00	0.00
345	002023	海特高新	300	3,246.00	0.00
346	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
347	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
348	603866	桃李面包	500	2,700.00	0.00
349	600683	京投发展	700	2,695.00	0.00
350	600021	上海电力	300	2,637.00	0.00
351	000729	燕京啤酒	200	2,586.00	0.00
352	600713	南京医药	500	2,530.00	0.00
353	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
354	601997	贵阳银行	400	2,496.00	0.00
355	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
356	301029	怡合达	100	2,286.00	0.00
357	300696	爱乐达	100	2,258.00	0.00
358	603629	利通电子	100	2,250.00	0.00

359	002534	西子洁能	200	2,248.00	0.00
360	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
361	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
362	600420	国药现代	200	2,130.00	0.00
363	600079	人福医药	100	2,098.00	0.00
364	000738	航发控制	100	2,075.00	0.00
365	002372	伟星新材	200	2,072.00	0.00
366	600521	华海药业	110	2,049.30	0.00
367	601717	郑煤机	100	1,662.00	0.00
368	300369	绿盟科技	200	1,554.00	0.00
369	000338	潍柴动力	100	1,538.00	0.00
370	603185	弘元绿能	100	1,485.00	0.00
371	601966	玲珑轮胎	100	1,467.00	0.00
372	601801	皖新传媒	200	1,366.00	0.00
373	002249	大洋电机	200	1,316.00	0.00
374	600372	中航机载	100	1,206.00	0.00
375	300146	汤臣倍健	100	1,124.00	0.00
376	601216	君正集团	200	1,104.00	0.00
377	600661	昂立教育	100	1,065.00	0.00
378	002387	维信诺	100	969.00	0.00
379	601989	中国重工	200	928.00	0.00
380	000401	冀东水泥	200	876.00	0.00
381	600320	振华重工	200	874.00	0.00
382	601319	中国人保	100	871.00	0.00
383	002153	石基信息	100	866.00	0.00
384	300168	万达信息	100	767.00	0.00
385	002228	合兴包装	200	706.00	0.00
386	600398	海澜之家	100	696.00	0.00
387	601918	新集能源	100	646.00	0.00
388	002546	新联电子	100	549.00	0.00
389	600688	上海石化	100	285.00	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	300803	指南针	13,467,410.35	3.02
2	300677	英科医疗	13,458,526.00	3.01
3	002138	顺络电子	13,373,176.28	3.00
4	688213	思特威	12,914,682.21	2.89
5	600704	物产中大	12,407,728.00	2.78

6	600517	国网英大	12,321,925.00	2.76
7	002797	第一创业	11,847,777.00	2.65
8	688469	芯联集成	11,209,988.44	2.51
9	601168	西部矿业	11,138,980.99	2.50
10	300476	胜宏科技	11,108,919.86	2.49
11	002958	青农商行	10,992,565.00	2.46
12	000039	中集集团	10,860,477.00	2.43
13	000050	深天马 A	10,719,225.00	2.40
14	600008	首创环保	10,360,301.50	2.32
15	688778	厦钨新能	10,240,160.61	2.29
16	600998	九州通	9,999,666.00	2.24
17	600352	浙江龙盛	9,992,248.00	2.24
18	002432	九安医疗	9,755,079.00	2.19
19	600299	安迪苏	9,605,921.11	2.15
20	600909	华安证券	9,505,715.00	2.13
21	300866	安克创新	9,257,619.88	2.07
22	000783	长江证券	9,163,499.00	2.05
23	600578	京能电力	8,981,987.00	2.01
24	002831	裕同科技	8,928,466.00	2.00

注：本项“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	601168	西部矿业	17,744,931.00	3.97
2	600008	首创环保	15,220,721.00	3.41
3	000039	中集集团	13,976,652.00	3.13
4	002850	科达利	13,091,027.00	2.93
5	002432	九安医疗	12,838,867.00	2.88
6	603596	伯特利	12,512,053.00	2.80
7	300476	胜宏科技	12,452,079.00	2.79
8	000997	新大陆	12,420,664.00	2.78
9	600380	健康元	12,307,354.60	2.76
10	002273	水晶光电	12,232,731.15	2.74
11	002517	恺英网络	12,180,761.00	2.73
12	601399	国机重装	11,397,065.00	2.55
13	002797	第一创业	11,190,249.00	2.51
14	600704	物产中大	10,947,141.00	2.45
15	000401	冀东水泥	10,803,644.00	2.42
16	688778	厦钨新能	10,751,767.80	2.41

17	002368	太极股份	10,686,573.00	2.39
18	001227	兰州银行	10,307,460.00	2.31
19	002557	洽洽食品	10,266,878.00	2.30
20	300866	安克创新	10,225,025.00	2.29
21	600583	海油工程	10,150,466.00	2.27
22	600339	中油工程	10,077,385.00	2.26
23	300002	神州泰岳	10,070,834.00	2.26
24	688281	华秦科技	10,051,958.82	2.25
25	600208	衢州发展	10,020,410.00	2.24
26	688002	睿创微纳	9,760,111.79	2.19
27	603444	吉比特	9,745,572.00	2.18
28	600352	浙江龙盛	9,689,283.00	2.17
29	600663	陆家嘴	9,667,322.00	2.17
30	002958	青农商行	9,342,634.00	2.09
31	002138	顺络电子	9,333,235.00	2.09
32	600655	豫园股份	9,281,164.22	2.08
33	688772	珠海冠宇	9,252,394.51	2.07
34	603129	春风动力	9,205,980.00	2.06
35	688122	西部超导	9,114,943.17	2.04

注：本项“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

买入股票的成本（成交）总额	1,443,117,847.35
卖出股票的收入（成交）总额	1,491,009,195.91

注：本项“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）	22,301.47	0.01
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	22,301.47	0.01

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	123257	安克转债	223	22,301.47	0.01

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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	52,316.81
2	应收清算款	2,261,933.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,763,385.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,077,635.83

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，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
博时中证 500 指数增强 A	13,592	17,366.31	13,112,793.06	5.56%	222,930,156.61	94.44%
博时中证 500 指数增强 C	9,683	7,817.48	1,469,460.47	1.94%	74,227,183.45	98.06%
合计	23,053	13,522.73	14,582,253.53	4.68%	297,157,340.06	95.32%

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	博时中证 500 指数增强 A	164,562.34	0.07%

	博时中证 500 指数增强 C	7,668.81	0.01%
	合计	172,231.15	0.06%

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的情况

- 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、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 26 日）基金份额总额	383,128,088.40	—
本报告期期初基金份额总额	266,495,854.94	84,777,955.61
本报告期基金总申购份额	32,005,786.97	14,778,536.98
减：本报告期基金总赎回份额	62,458,692.24	23,859,848.67
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	236,042,949.67	75,696,643.92

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

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，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及本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

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
国泰海通	5	52,743,304.18	1.80%	10,866.16	1.80%	增加 5 个
东吴证券	2	250,961,307.56	8.56%	51,726.16	8.56%	—
广发证券	2	75,038,002.96	2.56%	15,450.77	2.56%	—
华泰证券	1	—	—	—	—	减少 2 个
国新证券	2	—	—	—	—	—
第一创业	1	—	—	—	—	—
财通证券	1	354,268,138.84	12.08%	72,984.33	12.08%	—
银河证券	2	38,349,603.97	1.31%	7,895.12	1.31%	—
江海证券	2	—	—	—	—	—
东方财富证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	3	395,877,814.75	13.50%	81,510.89	13.50%	—
方正证券	1	506,690,235.05	17.28%	104,330.13	17.27%	—
东兴证券	2	681,913,552.65	23.26%	140,428.06	23.25%	—
招商证券	5	72,635,625.28	2.48%	15,005.24	2.48%	—
西部证券	1	138,654,991.57	4.73%	28,558.65	4.73%	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	54,832,903.76	1.87%	11,289.47	1.87%	减少 1 个
中信建投	1	169,146,354.18	5.77%	34,853.19	5.77%	—
东北证券	1	—	—	—	—	—

中金公司	2	141,186,859.47	4.81%	29,071.97	4.81%	-
------	---	----------------	-------	-----------	-------	---

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

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		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
国泰海通	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	57,711.30	100.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
2	博时中证 500 指数增强型证券投资基金（博时中证 500 指数增强 C）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
3	博时中证 500 指数增强型证券投资基金（博时中证 500 指数增强 A）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250606	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
5	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250603	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
6	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-22
7	博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下公募基金的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
8	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250408	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
9	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
12	博时中证 500 指数增强型证券投资基金（博时中证 500 指数增强 C）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-22
13	博时中证 500 指数增强型证券投资基金（博时中证 500 指数增强 A）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-22
14	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-21

		网站	
15	博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
16	博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
17	关于博时基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-27
19	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-22

§ 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

无。

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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时中证 500 指数增强型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时中证 500 指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日