

联博中证 500 指数增强型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：联博基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 28 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 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 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	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	57
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	57
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	58
§ 8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 9	开放式基金份额变动	60
§ 10	重大事件揭示	60
10.1	基金份额持有人大会决议	60
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	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
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	61
10.8	其他重大事件	62
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	联博中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	联博中证 500 指数增强	
基金主代码	026059	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 09 日	
基金管理人	联博基金管理有限公司	
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	133,719,057.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	联博中证 500 指数增强 A	联博中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	026059	026060
报告期末下属分级基金的份额总额	101,655,183.31 份	32,063,873.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金,力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上,实现超越业绩比较基准的投资收益,力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 500 指数为标的指数,在对标的指数进行有效跟踪的基础上,力争获取高于标的指数的投资收益。在正常市场情况下,本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%,年化跟踪误差不超过 8%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度、年化跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。当标的指数成份股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的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 1、股票投资策略:(1) 指数投资策略。(2) 指数增强策略。(3) 本基金可通过港股通机制投资于香港股票市场,本基金将通过自下而上的方法,精选出具有投资价值的优质标的。(4) 本基金可根据法律法规和监管机构的要求投资存托凭证,将通过深度的基本面研究与量化分析,挑选长期盈利能力遭低估、并具备正向催化剂的公司所发行的存托凭证进行投资。 2、债券投资策略 3、衍生产品投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、参与融资和转融通证券出借业务的投资策略
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	本基金为股票型指数增强基金,其预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

	本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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		联博基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玲	方圆
	联系电话	021-80276528	95559
	电子邮箱	Iris.Wang@alliancebernstein.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4000011300	95559
传真		021-52560862-9999	021-62701216
注册地址		中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200041	200336
法定代表人		罗登攀	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.alliancebernstein.com.cn/
基金中期报告置备地点	基金管理人办公场所及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	联博基金管理有限公司	中国上海市静安区石门一路 288 号兴业太古汇香港兴业中心二座 16 楼 1606 室

§ 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）	
	联博中证 500 指数增强 A	联博中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	39,489,180.55	19,869,166.84
本期利润	40,943,145.44	22,679,098.22
加权平均基金份额本期利润	0.2951	0.3576
本期加权平均净值利润率	26.04%	31.83%
本期基金份额净值增长率	24.71%	24.47%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	联博中证 500 指数增强 A	联博中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	26,735,122.03	8,345,447.91
期末可供分配基金份额利润	0.2630	0.2603
期末基金资产净值	129,765,405.85	40,841,495.98
期末基金份额净值	1.2765	1.2738
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	联博中证 500 指数增强 A	联博中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	27.65%	27.38%

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

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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

联博中证 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
过去三个月	20.56%	1.57%	17.61%	1.56%	2.95%	0.01%
过去六个月	24.71%	1.53%	19.93%	1.58%	4.78%	-0.05%
自基金合同生效起至今	27.65%	1.46%	24.59%	1.50%	3.06%	-0.04%

联博中证 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
过去三个月	20.44%	1.57%	17.61%	1.56%	2.83%	0.01%
过去六个月	24.47%	1.53%	19.93%	1.58%	4.54%	-0.05%
自基金合同生效起至今	27.38%	1.46%	24.59%	1.50%	2.79%	-0.04%

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 日。

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

联博中证 500 指数增强 A



注：1、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

2、本基金建仓期为基金合同生效日起的 6 个月，报告期末本基金已建仓完毕。截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金合同约定。

§ 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

联博基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于 2021 年 9 月 3 日成立。公司经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2023 年 3 月 3 日《关于核准设立联博基金管理有限公司的批复》（证监许可[2023]464 号）核准设立，并于 2023 年 12 月 29 日取得中国证监会核发的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。公司股东为联博香港有限公司，注册资本为人民币 60000 万元。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司公开募集证券投资基金资产管理规模为人民币 5.62 亿元，包括联博智选混合型证券投资基金、联博智远混合型证券投资基金、联博汇利债券型证券投资基金、联博中证 500 指数增强型证券投资基金 4 只产品。

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		
朱良	基金经理、董事、副总经理、投资总监	2025 年 12 月 09 日	—	22 年	朱良于 2006 年加入联博集团，现任联博基金管理有限公司董事、副总经理、投资总监，负责投资管理等相关事务。曾任联博汇智（上海）海外投资基金管理有限公司投资组合经理；联博管理咨询（上海）有限公司（曾用名：联博汇智（上海）投资管理有限公司）股票投资部投资总监、投资组合经理；联博香港有限公司亚太量化研究负责人；联博集团上海代表处资深量计分析师；光大保德信基金管理有限公司高级组合分析师；天同基金管理有限公司基金经理；美国梅隆资本管理公司（Mellon Capital Management LTD）投资研究部高级经理。朱良

					拥有美国匹兹堡大学经济学硕士学位, 北京大学数学系基础数学学士学位。
杨光	基金经理	2025 年 12 月 09 日	—	6 年	基金经理, 于 2021 年加入联博集团, 致力于中国系统化股票多因子投资策略研究。曾任联博管理咨询(上海)有限公司(曾用名: 联博汇智(上海)投资管理有限公司)量化研究员; 平安资产管理有限责任公司研究经理; 人立方智能科技有限公司数据分析师; 上海鸣石投资管理有限公司投资研究经理。杨光先生拥有复旦大学理论物理博士学位, 复旦大学物理学学士学位。

注: 1. 此处的任职日期和离职日期均指公司决定生效之日, 首任基金经理, 任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 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

截至本报告期末, 本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司建立了公平交易

相关制度体系，使得不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格控制公平交易执行，确保所有组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

本报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。公司对各投资组合公平对待，不存在不公平交易或利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中国 A 股市场即便受地缘不确定性与美联储政策变动等外部风险压制，整体上涨趋势仍旧强劲，由全球人工智能资本开支浪潮驱动的科技板块表现尤为突出。虽然美伊地缘冲突持续扰动国际能源价格，同步推升全球债券收益率波动，但市场投资者大多淡化该短期利空扰动，资金持续聚焦科技硬件标的；而受益于全球 AI 资本开支带来的旺盛需求，科技硬件的调价趋势明显，带动企业盈利与股价显著上行。2026 年上半年，A 股中具备科技出口属性的企业更是表现显著领先。期间，中美高峰会也达成初步贸易磋商合作成果，贸易摩擦持续边际缓和，提振市场风险情绪。

本基金在市场风险情绪回温的背景下有所表现，其中本基金于科技与医疗板块的选股增厚了基金业绩，但相对减配工业则略微拖累了基金业绩。

联博基金将持续运用集团量化研究优势和算力优势，不断优化提升机器学习选股模型，目标打造高胜率、低跟踪误差，力争能创造相对稳定超额收益的系统化指增投资策略。我们认为本策略持仓分散，不集中配置单一赛道，有机会兼顾参与中证 500 指数的长线机会与控制短线回调风险，或有望为投资人创造更好的长期投资体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末联博中证 500 指数增强 A 份额净值为 1.2765 元，本报告期联博中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为 24.71%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；截至本报告期末联博中证 500

指数增强 C 份额净值为 1.2738 元，本报告期联博中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为 24.47%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初以来 A 股成长风格持续领涨，但行情的核心驱动并非广义的成长价值风格轮动，而是 AI 产业链的结构性机会。2025 年 1 月至 2026 年 6 月，MSCI 中国 A 股成长指数累计收益显著跑赢价值指数，指数权重明显向光模块、算力芯片等 AI “卖铲人”赛道倾斜，行情的 AI 属性显著。反观同期美股市场，价值指数反而累计收益优于成长指数，中美市场风格呈现明显分化，背后本质原因是 AI 产业链在不同指数中的分布差异。

我们认为，AI 算力需求的高景气，仍是当前全球市场相对更具确定性的增长主线之一。市场对 AI 数据中心全产业链的乐观需求预期，或将持续推升受益企业的盈利预测与股价表现；部分长期受技术迭代影响、产品价格处于下行通道的行业，也在 AI 需求的拉动下迎来供需格局反转。以存储行业为例，AI 服务器对存储容量的需求持续攀升，打破了存储价格跟随摩尔定律长期下行的趋势。DRAM 合约价格同比显著回升，产品均价触底反弹，产业链盈利与估值同步修复，成为本轮 AI 行情的核心受益方向之一。

尽管受贸易管制等因素约束，AI 硬件领域尚未掌握最前沿技术，但产业外溢效应正为国内科技板块带来明确支撑，存储赛道尤为典型。虽然当前 AI 高端存储 HBM 的晶圆产能仍由韩国与美国企业主导，但全球 DRAM 整体供给偏紧的格局，同样利好国内中低端存储的产能释放与盈利改善。数据显示，中国 DRAM 产能占全球比重持续提升，从 2019 年的 10%稳步攀升，预计 2026 年将达到 24%，国产存储产业链的成长或已成为今年 A 股市场的核心主线之一。

AI 与出口产业链的高景气，也进一步凸显了国内经济的 K 型分化特征。出口端同比增速维持在较高水平，成为经济增长的核心抓手；反观国内消费、工业生产、固定资产投资、社会融资等内需指标表现偏温和，内需修复力度偏弱，冷热不均的经济结构也在一定程度上加大了宏观政策的调控难度。

但需要注意的是，AI 算力需求的高景气并非无上限，当前已出现边际降温的信号。全球超大规模云厂商的现金流随资本开支的高增长持续承压，部分科技巨头已公开表态，AI 智能体技术落地进

度不及预期，更有企业开始对外出售闲置算力资源，侧面反映全球算力军备竞赛的热度正在边际回落。我们认为，此前 AI 硬件板块持续陡峭的盈利上修趋势，大概率将从此转为平缓，板块盈利预期的上行动能正呈现边际减弱趋势。

我们认为，这一变化带来两方面核心启示：

其一，AI 硬件板块相对其他行业的超额收益或将逐步收窄。与海外市场不同，中国 AI 产业并非完全绑定全球科技资本开支周期，因此在一定程度上具备对冲后续 AI 硬件波动的能力。从资本开支占营业现金流的比例来看，国内科技企业的扩张节奏更为克制，现金流健康度更优；同时关键芯片领域的贸易限制，反而会加速国内国产化替代的进程，本土算力基建、国产芯片等赛道具备独立的成长逻辑，与全球资本开支周期的关联度相对较低。

其二，当前市场环境下分散配置的重要性显著提升。6 月末市场已出现初步的轮动迹象，投资者开始逐步布局能够对冲 AI 板块波动的方向。其中银行板块的配置机会正在显现，随着国内利率下行节奏趋缓，银行净息差逐步企稳，城商行盈利增速与 ROE 预期触底回升；同时在财政需求与监管导向下，银行分红支付率持续改善，高股息属性有望有效对冲成长板块的高波动，或成为平衡组合风险的优质选择之一。

我们认为，AI 与非 AI 板块的行情分化能否收敛，关键取决于非 AI 行业的盈利能否迎来实质性改善。尽管目前这一信号尚未明确，但当前市场内部估值离散度已显著高于长期均值，预计高度分化的估值水平已为分散配置提供了充足的性价比，多元布局的风险收益比预期持续提升。

展望后市，我们认为，一方面基本面叙事依然稳固，全球 AI 算力需求仍具备景气支撑，存储、硬件产业链盈利趋势明确，中国出口升级与国产替代的长期逻辑同步持续兑现，为相关板块提供独立的基本面支撑。但另一方面，市场已进入预期偏热、估值分化加剧的阶段。AI 赛道盈利预测普遍计入了极为乐观的远期假设，令前瞻估值存在一定失真，亚太市场个人投资者交易热度攀升，叠加全球 AI 资本开支增速临近高点、主要央行转向货币紧缩，预计高景气成长板块的波动风险正在持续上升。

有鉴于此，我们继续倡导更加多元化和均衡的投资策略，既关注受益于上述长期趋势的成长型

公司，同时也关注能够产生现金流的价值型股票，来对冲成长股较高的波动性。我们认为，这样既能参与当前 AI 板块的投资机会，又能有望缓释下行风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，切实维护基金持有人利益。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，基金托管人在联博中证 500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，联博基金管理有限公司在联博中证 500 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由联博基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关联博中证 500 指数增强

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：联博中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,196,668.30	2,276,493.54
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	160,710,471.81	417,035,058.03
其中：股票投资		160,710,471.81	417,035,058.03
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	20,106,178.68
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		266,819.13	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		171,173,959.24	439,417,730.25
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 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		319,816.33	-
应付管理人报酬		107,822.43	207,646.69
应付托管费		20,216.68	38,933.73

应付销售服务费		12,987.83	40,856.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	530.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	106,214.14	-
负债合计		567,057.41	287,966.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	133,719,057.28	429,042,021.84
未分配利润	6.4.7.8	36,887,844.55	10,087,741.54
净资产合计		170,606,901.83	439,129,763.38
负债和净资产总计		171,173,959.24	439,417,730.25

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，联博中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.2765 元，基金份额总额 101,655,183.31 份；联博中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.2738 元，基金份额总额 32,063,873.97 份。联博中证 500 指数增强份额总额合计为 133,719,057.28 份。

6.2 利润表

会计主体：联博中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		64,912,276.89
1. 利息收入		72,118.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	52,164.93
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		19,953.79
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		59,249,877.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	58,217,823.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,032,054.65
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,263,896.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,326,384.17

减：二、营业总支出		1,290,033.23
1. 管理人报酬		906,618.35
2. 托管费		169,990.92
3. 销售服务费		137,906.82
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	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		71.83
8. 其他费用	6.4.7.19	75,445.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		63,622,243.66
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		63,622,243.66
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		63,622,243.66

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 日，无上年度可比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：联博中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配 利润	净资产合计
一、上期期末净资产	429,042,021.84	10,087,741.54	439,129,763.38
二、本期期初净资产	429,042,021.84	10,087,741.54	439,129,763.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-295,322,964.56	26,800,103.01	-268,522,861.55
（一）、综合收益总额	-	63,622,243.66	63,622,243.66
（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）	-295,322,964.56	-36,822,140.65	-332,145,105.21
其中：1. 基金申购款	114,665,110.64	15,762,479.01	130,427,589.65
2. 基金赎回款	-409,988,075.20	-52,584,619.66	-462,572,694.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	133,719,057.28	36,887,844.55	170,606,901.83

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 09 日，无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗登攀

Bing Li

龚黎

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

联博中证 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[2025]第 2504 号《关于准予联博中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由联博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《联博中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 428,945,433.23 元。经向中国证监会备案，《联博中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 09 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 429,042,021.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 96,588.61 份基金份额。本基金的基金管理人为联博基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《联博中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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》及其配套规则和《联博中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为中证 500 指数。本基金的投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金还可投资于部分非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、信用衍生品、股指期货、国债期货、股票期权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。本基金可以根据有关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（包括但不限于股指期权等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×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

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《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》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，

分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现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。

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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《联博中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告。若《基金合同》生效不满 3 个月则不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，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每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权；但由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 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；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金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% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、

金融债券（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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、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。内地个人投资者通过沪港通、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。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 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。对于本基金通过沪港通、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。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 06 月 30 日
活期存款	6,496,594.06
等于：本金	6,495,210.51
加：应计利息	1,383.55
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
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	3,700,074.24
等于：本金	3,699,717.09
加：应计利息	357.15
合计	10,196,668.30

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用资金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 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	148,685,198.32	—	160,710,471.81	12,025,273.49
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	148,685,198.32	—	160,710,471.81	12,025,273.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
应付审计费	15,868.27
应付信息披露费	59,507.37
其他	30,838.50
合计	106,214.14

6.4.7.7 实收基金

联博中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	260,195,571.31	260,195,571.31
本期申购	76,299,335.82	76,299,335.82
本期赎回（以“-”号填列）	-234,839,723.82	-234,839,723.82
本期末	101,655,183.31	101,655,183.31

联博中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	168,846,450.53	168,846,450.53
本期申购	38,365,774.82	38,365,774.82
本期赎回（以“-”号填列）	-175,148,351.38	-175,148,351.38
本期末	32,063,873.97	32,063,873.97

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

联博中证 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	1,435,735.89	4,707,288.03	6,143,023.92
本期期初	1,435,735.89	4,707,288.03	6,143,023.92
本期利润	39,489,180.55	1,453,964.89	40,943,145.44
本期基金份额交易产生的变动数	-14,189,794.41	-4,786,152.41	-18,975,946.82
其中：基金申购款	8,899,491.25	1,309,694.04	10,209,185.29
基金赎回款	-23,089,285.66	-6,095,846.45	-29,185,132.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,735,122.03	1,375,100.51	28,110,222.54

联博中证 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	890,628.43	3,054,089.19	3,944,717.62
本期期初	890,628.43	3,054,089.19	3,944,717.62
本期利润	19,869,166.84	2,809,931.38	22,679,098.22
本期基金份额交易产生的变动数	-12,414,347.36	-5,431,846.47	-17,846,193.83
其中：基金申购款	5,156,993.11	396,300.61	5,553,293.72
基金赎回款	-17,571,340.47	-5,828,147.08	-23,399,487.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,345,447.91	432,174.10	8,777,622.01

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	45,525.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,599.54
结算备付金利息收入	-

其他	40.00
合计	52,164.93

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用资金账户的证券交易结算资金产生的利息收入，其他为申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	641,639,920.67
减：卖出股票成本总额	582,858,028.16
减：交易费用	564,069.43
买卖股票差价收入	58,217,823.08

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,032,054.65

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	1,032,054.65

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,263,896.27
--股票投资	4,263,896.27
--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	4,263,896.27

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,326,355.86
转换费收入	28.31
合计	1,326,384.17

注：1、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费全额计入基金资产。

2、本基金的赎回费率按持有期间递减，收取的赎回费全额计入基金资产。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	15,868.27
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	—
存托服务费	69.67
合计	75,445.31

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
联博基金管理有限公司（“联博基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	906,618.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	445,761.06
应支付基金管理人的净管理费	460,857.29

注：支付基金管理人联博基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值 0.80% 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：

日管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	169,990.92

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	联博中证 500 指数增强 A	联博中证 500 指数增强 C	合计
交通银行股份有限公司	-	104,491.53	104,491.53
合计	-	104,491.53	104,491.53

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给联博基金管理有限公司，再由联博基金管理有限公司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 类基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内未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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期内基金管理人未持有过本基金份额。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	6,496,594.06	45,525.39

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配

售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未因认购新发或增发证券而于期末持有流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2026 年 06 月 30 日，本基金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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、监事会、董事会风险控制委员会、公司管理层及其风险管理委员会、督察长、风控部、监察稽核部以及各个业务部门和全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，审议重大事件、重大决策的风险评估，审批重大风险解决方案，批准公司基本风险管理制度，对维持有效的公司风险管理框架承担最终责任。董事会下设风险控制委员会，负责审查公司监察稽核、风险管理工作情况，负责对公司合规管理制度、风险管理制度的执行情况进行监督。公司管理层负责风险管理制度的制定，在董事会授权范围内审批重大事件的风险评估意见和解决方案，组织各部门实施风险解决方案和开展风险管理工作，对有效的风险管理承担直接责任。公司管理层下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作。督察长通过监察稽核部和风控部对风险控制措施的

执行情况进行监督，并对各个部门和员工实施的相关制度和控制措施提出建议。风控部负责就风险问题提供指导和建议，负责评估、监控、检查和报告公司风险管理状况，执行公司的风险管理战略和决策，定性和定量评估风险。公司各业务部门负责贯彻落实公司的风险管理措施，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

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评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，根据每个基金的投资目标，确定组合的相关风险收益特征，确保基金的风险收益特征与基金投资策略相适配；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的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，以及对各种风险量化指标进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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本基金的托管人，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。

于本期末，本基金无债券投资（上年末：同）。

6.4.13.3 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约定开放日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，有效保障基金份额持有人利益。

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《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《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，通过独立的风控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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同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 15%，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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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。

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的相关制度：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。

本基金本报告期末无重大流动性风险（上年末：同）。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2026年06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	10,196,668.30	-	-	-	10,196,668.30
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	160,710,471.81	160,710,471.81
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	266,819.13	266,819.13
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,196,668.30	-	-	160,977,290.94	171,173,959.24
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	319,816.33	319,816.33
应付管理人报酬	-	-	-	107,822.43	107,822.43
应付托管费	-	-	-	20,216.68	20,216.68

应付销售服务费	-	-	-	12,987.83	12,987.83
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	-	-	-	106,214.14	106,214.14
负债总计	-	-	-	567,057.41	567,057.41
利率敏感度缺口	10,196,668.30	-	-	160,410,233.53	170,606,901.83
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	2,276,493.54	-	-	-	2,276,493.54
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	417,035,058.03	417,035,058.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	20,106,178.68	-	-	-	20,106,178.68
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,382,672.22	-	-	417,035,058.03	439,417,730.25
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	207,646.69	207,646.69
应付托管费	-	-	-	38,933.73	38,933.73
应付销售服务费	-	-	-	40,856.06	40,856.06
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	530.39	530.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	287,966.87	287,966.87
利率敏感度缺口	22,382,672.22	-	-	416,747,091.16	439,129,763.38

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年末：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：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在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成分股和备选成分股的资产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、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，以识别和测算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 06 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	160,710,471.81	94.20	417,035,058.03	94.97
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	160,710,471.81	94.20	417,035,058.03	94.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	160,710,471.81	416,707,794.03
第二层次	—	327,264.00
第三层次	—	—
合计	160,710,471.81	417,035,058.03

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可转换债券等，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活

跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	160,710,471.81	93.89
	其中：股票	160,710,471.81	93.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,196,668.30	5.96
8	其他各项资产	266,819.13	0.16
9	合计	171,173,959.24	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	616,514.00	0.36
B	采矿业	4,340,704.17	2.54
C	制造业	98,337,505.84	57.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,236,222.00	1.90
E	建筑业	578,157.00	0.34
F	批发和零售业	3,102,022.00	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	2,633,292.00	1.54
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,157,749.60	5.37
J	金融业	7,723,058.00	4.53
K	房地产业	342,124.00	0.20
L	租赁和商务服务业	1,151,950.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	925,919.00	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	641,162.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	301,169.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	729,849.00	0.43
S	综合	—	—
	合计	133,817,397.61	78.44

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	1,535,614.00	0.90
C	制造业	15,029,107.00	8.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	668,910.00	0.39
E	建筑业	277,015.00	0.16
F	批发和零售业	1,122,574.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	566,701.00	0.33
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,700,989.20	2.17
J	金融业	1,612,455.00	0.95
K	房地产业	442,533.00	0.26
L	租赁和商务服务业	509,851.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	625,335.00	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	703,578.00	0.41
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	98,412.00	0.06

S	综合	—	—
	合计	26,893,074.20	15.76

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	688498	源杰科技	1,635	3,083,610.00	1.81
2	688361	中科飞测	5,700	2,451,000.00	1.44
3	300604	长川科技	7,000	2,389,940.00	1.40
4	688347	华虹宏力	6,500	2,185,950.00	1.28
5	002409	雅克科技	9,500	2,132,750.00	1.25
6	002008	大族激光	12,900	1,936,419.00	1.14
7	002281	光迅科技	7,000	1,798,580.00	1.05
8	300857	协创数据	5,220	1,774,278.00	1.04
9	001309	德明利	1,800	1,697,220.00	0.99
10	603256	宏和科技	6,000	1,591,980.00	0.93
11	300223	北京君正	5,800	1,443,620.00	0.85
12	001389	广合科技	6,000	1,423,500.00	0.83
13	300475	香农芯创	4,400	1,320,000.00	0.77
14	688052	纳芯微	4,300	1,239,733.00	0.73
15	688629	华丰科技	6,400	1,200,064.00	0.70
16	300757	罗博特科	1,900	1,176,100.00	0.69
17	300285	国瓷材料	11,200	1,155,616.00	0.68
18	002407	多氟多	22,500	1,130,175.00	0.66
19	600105	永鼎股份	16,500	1,113,420.00	0.65
20	600988	赤峰黄金	42,000	1,105,440.00	0.65
21	000960	锡业股份	25,300	1,080,057.00	0.63
22	300395	菲利华	8,000	1,069,840.00	0.63
23	300037	新宙邦	11,400	1,058,490.00	0.62
24	600601	方正科技	76,400	1,057,376.00	0.62
25	600498	烽火通信	14,300	1,052,480.00	0.62
26	003031	中瓷电子	5,600	1,009,680.00	0.59
27	688017	绿的谐波	2,400	1,002,864.00	0.59
28	301536	星宸科技	7,700	991,067.00	0.58
29	688772	珠海冠宇	49,600	973,648.00	0.57
30	300136	信维通信	8,000	954,000.00	0.56

31	000728	国元证券	126,800	949,732.00	0.56
32	688002	睿创微纳	6,100	943,609.00	0.55
33	688702	盛科通信	2,400	935,976.00	0.55
34	002850	科达利	4,700	889,710.00	0.52
35	688120	华海清科	2,760	889,216.80	0.52
36	000750	国海证券	237,000	872,160.00	0.51
37	300620	光库科技	2,300	869,860.00	0.51
38	000034	神州数码	31,340	869,685.00	0.51
39	301358	湖南裕能	11,300	857,331.00	0.50
40	688469	芯联集成	77,500	822,275.00	0.48
41	601869	长飞光纤	1,500	818,850.00	0.48
42	000519	中兵红箭	38,500	811,195.00	0.48
43	300073	当升科技	16,800	807,072.00	0.47
44	300390	天华新能	8,600	804,186.00	0.47
45	601000	唐山港	189,900	788,085.00	0.46
46	300373	扬杰科技	5,000	786,150.00	0.46
47	003022	联泓新科	29,500	764,050.00	0.45
48	688728	格科微	36,300	763,752.00	0.45
49	002273	水晶光电	21,400	759,272.00	0.45
50	688313	仕佳光子	4,100	757,065.00	0.44
51	000951	中国重汽	38,600	753,086.00	0.44
52	603379	三美股份	9,900	751,311.00	0.44
53	600008	首创环保	273,800	744,736.00	0.44
54	300474	景嘉微	12,300	743,904.00	0.44
55	688301	奕瑞科技	5,859	726,516.00	0.43
56	301377	鼎泰高科	1,300	716,170.00	0.42
57	601099	太平洋	209,400	705,678.00	0.41
58	600109	国金证券	79,900	701,522.00	0.41
59	300567	精测电子	2,200	698,720.00	0.41
60	300699	光威复材	23,900	684,735.00	0.40
61	002821	凯莱英	4,200	680,400.00	0.40
62	603979	金诚信	11,500	678,845.00	0.40
63	688777	中控技术	5,700	669,750.00	0.39
64	002851	麦格米特	4,000	668,720.00	0.39
65	688578	艾力斯	6,100	666,120.00	0.39
66	300888	稳健医疗	23,600	660,564.00	0.39
67	300058	蓝色光标	47,300	650,848.00	0.38
68	002157	正邦科技	219,400	616,514.00	0.36
69	300146	汤臣倍健	67,200	607,488.00	0.36
70	002414	高德红外	45,100	598,026.00	0.35
71	002126	银轮股份	11,800	587,640.00	0.34

72	002138	顺络电子	8,000	584,800.00	0.34
73	688411	海博思创	2,000	582,400.00	0.34
74	600906	财达证券	77,900	581,134.00	0.34
75	002078	太阳纸业	46,500	580,785.00	0.34
76	688172	燕东微	6,900	577,254.00	0.34
77	300054	鼎龙股份	5,400	572,238.00	0.34
78	600131	国网信通	37,700	550,420.00	0.32
79	300676	华大基因	15,600	546,936.00	0.32
80	600369	西南证券	135,600	545,112.00	0.32
81	300735	光弘科技	23,700	538,938.00	0.32
82	688037	芯源微	1,200	526,860.00	0.31
83	603596	伯特利	21,044	522,732.96	0.31
84	605589	圣泉集团	8,100	514,917.00	0.30
85	603659	璞泰来	17,700	512,061.00	0.30
86	600995	南网储能	41,500	510,450.00	0.30
87	600348	华阳股份	66,400	507,960.00	0.30
88	002266	浙富控股	100,300	507,518.00	0.30
89	002738	中矿资源	8,500	501,415.00	0.29
90	600885	宏发股份	14,500	500,105.00	0.29
91	603308	应流股份	8,200	495,280.00	0.29
92	300454	深信服	5,100	490,620.00	0.29
93	600392	盛和资源	16,300	485,251.00	0.28
94	002299	圣农发展	31,800	482,088.00	0.28
95	002436	兴森科技	9,300	473,835.00	0.28
96	000429	粤高速 A	34,700	473,655.00	0.28
97	002185	华天科技	21,200	472,972.00	0.28
98	600879	航天电子	22,200	472,638.00	0.28
99	000729	燕京啤酒	46,400	470,032.00	0.28
100	600909	华安证券	42,100	467,731.00	0.27
101	688692	达梦数据	1,900	464,151.00	0.27
102	688235	百济神州	1,800	458,298.00	0.27
103	000987	越秀资本	57,300	448,086.00	0.26
104	002155	湖南黄金	18,500	441,595.00	0.26
105	000893	亚钾国际	10,700	437,523.00	0.26
106	002318	久立特材	18,300	437,370.00	0.26
107	603606	东方电缆	10,500	435,855.00	0.26
108	603444	吉比特	1,200	430,104.00	0.25
109	600062	华润双鹤	26,800	429,872.00	0.25
110	002120	韵达股份	65,900	419,124.00	0.25
111	300432	富临精工	20,800	417,872.00	0.24
112	000709	河钢股份	212,300	411,862.00	0.24

113	603129	春风动力	1,600	409,280.00	0.24
114	002007	华兰生物	33,500	408,365.00	0.24
115	002271	东方雨虹	33,600	398,832.00	0.23
116	002812	恩捷股份	5,900	394,769.00	0.23
117	000009	中国宝安	62,300	388,129.00	0.23
118	002756	永兴材料	6,800	385,152.00	0.23
119	000997	新大陆	23,600	384,680.00	0.23
120	000878	云南铜业	24,000	381,120.00	0.22
121	300759	康龙化成	13,100	378,983.00	0.22
122	300558	贝达药业	5,800	377,406.00	0.22
123	000591	太阳能	81,800	376,280.00	0.22
124	600170	上海建工	168,200	373,404.00	0.22
125	688266	泽璟制药	3,200	373,312.00	0.22
126	300496	中科创达	6,000	370,740.00	0.22
127	300751	迈为股份	1,300	367,198.00	0.22
128	000598	兴蓉环境	57,100	366,582.00	0.21
129	605358	立昂微	4,700	364,720.00	0.21
130	688617	惠泰医疗	2,005	364,027.80	0.21
131	300207	欣旺达	19,000	360,810.00	0.21
132	000088	盐田港	88,200	360,738.00	0.21
133	600511	国药股份	13,600	354,144.00	0.21
134	002683	广东宏大	11,773	344,831.17	0.20
135	688114	华大智造	6,700	342,236.00	0.20
136	600398	海澜之家	65,200	340,996.00	0.20
137	600143	金发科技	22,000	339,900.00	0.20
138	002487	大金重工	5,800	336,226.00	0.20
139	688336	三生国健	6,270	332,937.00	0.20
140	000831	中国稀土	5,800	321,842.00	0.19
141	300002	神州泰岳	41,200	321,772.00	0.19
142	688778	厦钨新能	5,877	319,708.80	0.19
143	601928	凤凰传媒	36,300	319,077.00	0.19
144	600166	福田汽车	108,400	315,444.00	0.18
145	600497	驰宏锌锗	25,500	308,805.00	0.18
146	300919	中伟新材	7,000	306,250.00	0.18
147	600339	中油工程	98,100	301,167.00	0.18
148	300115	长盈精密	10,700	298,958.00	0.18
149	600535	天士力	22,500	297,675.00	0.17
150	002130	沃尔核材	15,700	297,672.00	0.17
151	688220	翱捷科技	2,379	295,757.28	0.17
152	000528	柳工	38,900	293,695.00	0.17
153	002312	川发龙蟒	31,500	288,855.00	0.17

154	600038	中直股份	11,400	288,306.00	0.17
155	603728	鸣志电器	4,700	286,324.00	0.17
156	000582	北部湾港	26,300	282,199.00	0.17
157	002065	东华软件	39,500	282,030.00	0.17
158	002402	和而泰	10,800	278,964.00	0.16
159	688213	思特威	2,600	278,382.00	0.16
160	688234	天岳先进	1,600	277,616.00	0.16
161	002261	拓维信息	9,900	277,299.00	0.16
162	300339	润和软件	7,200	277,272.00	0.16
163	600316	洪都航空	9,900	276,606.00	0.16
164	601997	贵阳银行	53,500	274,455.00	0.16
165	002568	百润股份	16,200	274,104.00	0.16
166	603786	科博达	6,500	265,915.00	0.16
167	600483	福能股份	25,900	263,921.00	0.15
168	600801	华新建材	16,900	263,640.00	0.15
169	688615	合合信息	2,320	262,392.00	0.15
170	300458	全志科技	6,600	260,436.00	0.15
171	603179	新泉股份	5,240	260,166.00	0.15
172	000415	渤海租赁	63,600	258,852.00	0.15
173	600298	安琪酵母	7,100	257,020.00	0.15
174	000703	恒逸石化	18,800	255,116.00	0.15
175	002517	恺英网络	15,600	253,500.00	0.15
176	301200	大族数控	700	252,455.00	0.15
177	300748	金力永磁	8,100	249,885.00	0.15
178	600132	重庆啤酒	5,900	243,670.00	0.14
179	603486	科沃斯	4,800	243,600.00	0.14
180	002131	利欧股份	51,000	242,250.00	0.14
181	600711	盛屯矿业	22,000	241,340.00	0.14
182	000537	绿发电力	32,700	239,037.00	0.14
183	688019	安集科技	700	237,622.00	0.14
184	002195	岩山科技	35,900	234,786.00	0.14
185	600582	天地科技	52,000	231,400.00	0.14
186	600352	浙江龙盛	19,000	230,090.00	0.13
187	000737	北方铜业	17,400	230,028.00	0.13
188	688180	君实生物	6,700	226,594.00	0.13
189	601699	潞安环能	15,700	224,196.00	0.13
190	002966	苏州银行	32,100	223,416.00	0.13
191	300666	江丰电子	600	221,160.00	0.13
192	603119	浙江荣泰	3,300	218,922.00	0.13
193	002340	格林美	32,800	216,808.00	0.13
194	688297	中无人机	5,200	216,060.00	0.13

195	601019	山东出版	33,700	215,680.00	0.13
196	688018	乐鑫科技	1,680	214,905.60	0.13
197	688349	三一重能	14,090	213,886.20	0.13
198	600663	陆家嘴	33,300	209,124.00	0.12
199	000883	湖北能源	48,100	207,792.00	0.12
200	000027	深圳能源	33,400	207,080.00	0.12
201	300017	网宿科技	15,900	206,859.00	0.12
202	689009	九号公司	5,400	206,010.00	0.12
203	600536	中国软件	7,300	205,276.00	0.12
204	600820	隧道股份	39,300	204,753.00	0.12
205	000062	深圳华强	6,400	203,648.00	0.12
206	601866	中远海发	91,900	203,099.00	0.12
207	688065	凯赛生物	4,200	200,970.00	0.12
208	600704	物产中大	42,050	198,476.00	0.12
209	601966	玲珑轮胎	19,200	195,648.00	0.11
210	600977	中国电影	15,100	195,092.00	0.11
211	601615	明阳智能	16,800	194,376.00	0.11
212	301498	乖宝宠物	4,700	190,773.00	0.11
213	600985	淮北矿业	13,000	182,650.00	0.11
214	002044	美年健康	36,300	182,589.00	0.11
215	000738	航发控制	9,700	177,413.00	0.10
216	601717	中创智领	12,700	176,657.00	0.10
217	601665	齐鲁银行	30,400	175,408.00	0.10
218	688099	晶晨股份	1,700	174,930.00	0.10
219	603077	和邦生物	75,400	174,928.00	0.10
220	601001	晋控煤业	10,000	173,900.00	0.10
221	600141	兴发集团	3,700	173,789.00	0.10
222	600282	南钢股份	35,220	161,659.80	0.09
223	002841	视源股份	4,600	158,838.00	0.09
224	603298	杭叉集团	6,620	157,953.20	0.09
225	603156	养元饮品	3,200	157,024.00	0.09
226	002624	完美世界	12,600	156,492.00	0.09
227	300972	万辰集团	900	156,069.00	0.09
228	603345	安井食品	1,900	152,361.00	0.09
229	600637	东方明珠	18,300	152,073.00	0.09
230	002465	海格通信	11,900	151,963.00	0.09
231	688192	迪哲医药	3,800	151,734.00	0.09
232	002444	巨星科技	4,800	149,280.00	0.09
233	600499	科达制造	10,700	147,660.00	0.09
234	002025	航天电器	1,900	144,818.00	0.08
235	000932	华菱钢铁	41,400	143,658.00	0.08

236	688166	博瑞医药	4,100	143,541.00	0.08
237	600390	五矿资本	31,300	142,728.00	0.08
238	601555	东吴证券	18,000	142,560.00	0.08
239	000887	中鼎股份	7,900	141,331.00	0.08
240	600562	国睿科技	6,500	137,930.00	0.08
241	000155	川能动力	11,500	137,770.00	0.08
242	000783	长江证券	14,000	136,500.00	0.08
243	600095	湘财股份	18,100	136,293.00	0.08
244	000423	东阿阿胶	3,000	136,080.00	0.08
245	002064	华峰化学	14,300	135,707.00	0.08
246	600292	电投水电	11,100	133,644.00	0.08
247	002244	滨江集团	17,500	133,000.00	0.08
248	688331	荣昌生物	1,000	130,260.00	0.08
249	300677	英科医疗	3,300	129,261.00	0.08
250	601577	长沙银行	14,700	128,037.00	0.08
251	601799	星宇股份	1,400	126,868.00	0.07
252	600685	中船防务	4,900	124,656.00	0.07
253	603699	纽威股份	2,400	120,720.00	0.07
254	002673	西部证券	18,500	120,065.00	0.07
255	601212	白银有色	23,500	119,380.00	0.07
256	600763	通策医疗	3,500	118,580.00	0.07
257	601179	中国西电	7,900	117,868.00	0.07
258	600435	北方导航	10,500	117,600.00	0.07
259	600602	云赛智联	7,200	115,776.00	0.07
260	600563	法拉电子	600	114,480.00	0.07
261	688343	云天励飞	1,400	114,324.00	0.07
262	603338	浙江鼎力	2,600	110,500.00	0.06
263	601233	桐昆股份	5,000	108,250.00	0.06
264	601156	东航物流	6,600	106,392.00	0.06
265	002984	森麒麟	7,900	103,253.00	0.06
266	002223	鱼跃医疗	4,000	102,640.00	0.06
267	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.06
268	601990	南京证券	15,300	100,521.00	0.06
269	688281	华秦科技	2,000	100,460.00	0.06
270	002461	珠江啤酒	13,100	99,167.00	0.06
271	300957	贝泰妮	3,100	97,681.00	0.06
272	002265	建设工业	5,600	97,440.00	0.06
273	688375	国博电子	900	93,870.00	0.06
274	600927	永安期货	7,500	93,375.00	0.05
275	600521	华海药业	6,400	92,160.00	0.05
276	688322	奥比中光	700	91,385.00	0.05

277	603225	新凤鸣	4,600	90,390.00	0.05
278	688387	信科移动	4,500	89,280.00	0.05
279	600486	扬农化工	1,700	86,190.00	0.05
280	601696	中银证券	6,700	84,755.00	0.05
281	601162	天风证券	24,700	83,239.00	0.05
282	600171	上海贝岭	2,600	83,044.00	0.05
283	601108	财通证券	9,600	83,040.00	0.05
284	603688	石英股份	1,000	82,610.00	0.05
285	688538	和辉光电	31,600	82,160.00	0.05
286	001203	大中矿业	2,700	80,865.00	0.05
287	601399	国机重装	22,300	78,050.00	0.05
288	002203	海亮股份	3,300	75,405.00	0.04
289	002926	华西证券	9,200	75,164.00	0.04
290	601216	君正集团	16,700	74,482.00	0.04
291	600642	申能股份	8,200	71,586.00	0.04
292	601865	福莱特	6,300	66,213.00	0.04
293	002939	长城证券	7,700	64,218.00	0.04
294	300724	捷佳伟创	900	63,540.00	0.04
295	603920	世运电路	1,300	62,452.00	0.04
296	688709	成都华微	1,600	60,944.00	0.04
297	000400	许继电气	2,800	60,760.00	0.04
298	601666	平煤股份	8,100	57,915.00	0.03
299	600098	广州发展	9,600	56,736.00	0.03
300	300953	震裕科技	420	56,154.00	0.03
301	600021	上海电力	3,600	54,252.00	0.03
302	600873	梅花生物	6,900	50,715.00	0.03
303	002153	石基信息	6,500	46,995.00	0.03
304	002410	广联达	5,700	46,512.00	0.03

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	605376	博迁新材	3,800	1,030,940.00	0.60
2	300408	三环集团	5,300	884,570.00	0.52
3	600061	国投资本	111,700	731,635.00	0.43
4	300975	商络电子	12,300	636,525.00	0.37
5	600150	中国船舶	18,700	631,873.00	0.37
6	688368	晶丰明源	2,760	597,595.20	0.35
7	600183	生益科技	3,400	589,560.00	0.35
8	688182	灿勤科技	12,900	555,603.00	0.33
9	688766	普冉股份	700	536,620.00	0.31

10	002958	青农商行	175,500	480,870.00	0.28
11	600589	大位科技	46,200	473,088.00	0.28
12	000975	山金国际	27,800	472,600.00	0.28
13	000422	湖北宜化	33,600	472,080.00	0.28
14	300661	圣邦股份	3,200	459,136.00	0.27
15	601918	新集能源	50,800	436,372.00	0.26
16	688700	东威科技	4,300	384,420.00	0.23
17	300308	中际旭创	300	381,000.00	0.22
18	301175	中科环保	74,400	368,280.00	0.22
19	301071	力量钻石	3,900	360,750.00	0.21
20	002625	光启技术	11,400	345,648.00	0.20
21	603099	长白山	9,400	335,298.00	0.20
22	603927	中科软	26,300	334,273.00	0.20
23	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.19
24	600971	恒源煤电	43,200	298,080.00	0.17
25	600116	三峡水利	53,200	297,920.00	0.17
26	002558	巨人网络	10,600	292,136.00	0.17
27	688627	精智达	400	286,000.00	0.17
28	600959	江苏有线	98,900	285,821.00	0.17
29	688222	成都先导	8,900	285,779.00	0.17
30	300184	力源信息	15,900	279,045.00	0.16
31	600755	厦门国贸	49,600	268,832.00	0.16
32	688333	铂力特	2,600	266,240.00	0.16
33	688183	生益电子	2,000	264,800.00	0.16
34	002859	洁美科技	2,400	262,824.00	0.15
35	688041	海光信息	700	259,210.00	0.15
36	002701	奥瑞金	60,000	255,600.00	0.15
37	688536	思瑞浦	700	254,863.00	0.15
38	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.14
39	300442	润泽科技	2,900	240,903.00	0.14
40	002916	深南电路	500	228,950.00	0.13
41	603799	华友钴业	4,700	226,822.00	0.13
42	301389	隆扬电子	2,600	225,654.00	0.13
43	688185	康希诺	4,400	224,356.00	0.13
44	002928	华夏航空	32,000	223,680.00	0.13
45	688372	伟测科技	1,200	223,200.00	0.13
46	688321	微芯生物	8,400	221,172.00	0.13
47	688630	芯碁微装	400	219,756.00	0.13
48	600176	中国巨石	2,800	204,064.00	0.12
49	300450	先导智能	5,000	203,600.00	0.12
50	600552	凯盛科技	6,000	195,480.00	0.11

51	600233	圆通速递	12,000	189,000.00	0.11
52	688001	华兴源创	2,200	188,540.00	0.11
53	688025	杰普特	400	188,000.00	0.11
54	603002	宏昌电子	7,700	186,109.00	0.11
55	688008	澜起科技	600	185,940.00	0.11
56	300033	同花顺	740	178,340.00	0.10
57	600048	保利发展	38,300	177,329.00	0.10
58	300191	潜能恒信	6,200	171,430.00	0.10
59	300277	汽轮科技	10,500	157,920.00	0.09
60	000958	电投产融	27,800	156,792.00	0.09
61	688443	智翔金泰	6,700	155,775.00	0.09
62	603612	索通发展	8,400	152,292.00	0.09
63	600415	小商品城	14,900	151,384.00	0.09
64	688016	心脉医疗	1,700	150,688.00	0.09
65	600795	国电电力	32,100	149,907.00	0.09
66	600502	安徽建工	33,300	144,855.00	0.08
67	600928	西安银行	43,800	143,226.00	0.08
68	300438	鹏辉能源	1,700	140,845.00	0.08
69	600549	厦门钨业	1,600	136,320.00	0.08
70	002985	北摩高科	4,900	135,730.00	0.08
71	002941	新疆交建	14,000	132,160.00	0.08
72	002384	东山精密	500	131,175.00	0.08
73	002294	信立泰	4,100	130,749.00	0.08
74	301095	广立微	1,100	129,855.00	0.08
75	603629	利通电子	700	125,167.00	0.07
76	300843	胜蓝股份	800	125,000.00	0.07
77	002497	雅化集团	6,000	122,220.00	0.07
78	688062	迈威生物	4,300	121,475.00	0.07
79	301297	富乐德	1,900	116,356.00	0.07
80	600641	先导基电	2,900	115,594.00	0.07
81	300738	奥飞数据	5,600	113,232.00	0.07
82	300357	我武生物	4,700	109,604.00	0.06
83	688141	杰华特	700	107,450.00	0.06
84	688717	艾罗能源	1,300	107,341.00	0.06
85	002463	沪电股份	700	106,960.00	0.06
86	003018	金富科技	1,400	106,722.00	0.06
87	603067	振华股份	2,200	101,838.00	0.06
88	603997	继峰股份	8,600	101,738.00	0.06
89	002222	福晶科技	1,100	101,508.00	0.06
90	688097	博众精工	1,600	100,880.00	0.06
91	002891	中宠股份	3,700	98,864.00	0.06

92	300133	华策影视	13,900	98,412.00	0.06
93	301369	联动科技	400	98,000.00	0.06
94	002284	亚太股份	10,300	97,747.00	0.06
95	300166	东方国信	5,500	97,405.00	0.06
96	603887	城地香江	10,400	97,136.00	0.06
97	601899	紫金矿业	3,800	95,532.00	0.06
98	600325	华发股份	40,900	94,479.00	0.06
99	603906	龙蟠科技	3,400	90,202.00	0.05
100	603300	海南华铁	19,700	89,635.00	0.05
101	600710	苏美达	9,200	87,952.00	0.05
102	002759	天际股份	3,500	85,365.00	0.05
103	300502	新易盛	140	84,980.00	0.05
104	600986	浙文互联	12,100	84,458.00	0.05
105	688382	益方生物	4,600	82,800.00	0.05
106	601107	四川成渝	16,800	81,984.00	0.05
107	002202	金风科技	3,400	81,260.00	0.05
108	601138	工业富联	1,100	79,365.00	0.05
109	000563	陕国投 A	28,400	78,384.00	0.05
110	002416	爱施德	8,700	77,952.00	0.05
111	002217	ST 合力泰	40,400	75,144.00	0.04
112	603228	景旺电子	1,000	72,410.00	0.04
113	601872	招商轮船	4,100	72,037.00	0.04
114	002460	赣锋锂业	1,000	65,400.00	0.04
115	603888	新华网	3,800	64,714.00	0.04
116	002310	东方新能	26,900	64,291.00	0.04
117	001267	汇绿生态	1,200	64,200.00	0.04
118	601069	西部黄金	2,800	61,600.00	0.04
119	002448	中原内配	4,700	57,810.00	0.03
120	002466	天齐锂业	900	55,188.00	0.03
121	600266	城建发展	14,100	55,131.00	0.03
122	000410	沈阳机床	11,600	53,824.00	0.03
123	002345	潮宏基	5,600	51,352.00	0.03
124	003010	若羽臣	2,100	51,030.00	0.03
125	600375	汉马科技	13,800	50,922.00	0.03
126	300772	运达股份	4,100	50,430.00	0.03
127	605599	菜百股份	3,000	41,100.00	0.02

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	688498	源杰科技	3,416,921.57	0.78
2	300604	长川科技	3,289,109.00	0.75
3	603979	金诚信	3,135,850.00	0.71
4	002414	高德红外	3,064,314.00	0.70
5	300207	欣旺达	3,063,756.00	0.70
6	002409	雅克科技	3,049,542.00	0.69
7	600549	厦门钨业	3,037,406.00	0.69
8	300395	菲利华	2,882,739.00	0.66
9	688361	中科飞测	2,849,547.55	0.65
10	688525	佰维存储	2,476,293.20	0.56
11	600497	驰宏锌锗	2,380,079.00	0.54
12	600118	中国卫星	2,345,069.00	0.53
13	002080	中材科技	2,317,079.00	0.53
14	002837	英维克	2,269,997.00	0.52
15	002008	大族激光	2,246,234.50	0.51
16	301308	江波龙	2,235,055.00	0.51
17	002402	和而泰	2,233,226.00	0.51
18	600601	方正科技	2,153,462.00	0.49
19	600487	亨通光电	2,094,986.00	0.48
20	001309	德明利	2,023,383.00	0.46

注：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	002353	杰瑞股份	8,166,540.00	1.86
2	002738	中矿资源	7,317,113.00	1.67
3	002558	巨人网络	6,567,894.00	1.50
4	300058	蓝色光标	5,319,783.00	1.21
5	688525	佰维存储	5,219,771.92	1.19
6	000987	越秀资本	5,176,204.00	1.18
7	002340	格林美	4,937,866.00	1.12
8	601958	金钼股份	4,713,135.00	1.07
9	000426	兴业银锡	4,697,774.27	1.07
10	300604	长川科技	4,692,395.00	1.07
11	002156	通富微电	4,409,205.29	1.00
12	688235	百济神州	4,355,622.58	0.99
13	600392	盛和资源	4,335,455.00	0.99
14	601168	西部矿业	4,122,339.00	0.94

15	600487	亨通光电	4,037,300.00	0.92
16	300017	网宿科技	4,007,036.00	0.91
17	688213	思特威	3,962,765.50	0.90
18	300207	欣旺达	3,848,414.00	0.88
19	002318	久立特材	3,798,651.00	0.87
20	002281	光迅科技	3,798,108.00	0.86

注：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	322,269,545.67
卖出股票收入（成交）总额	641,639,920.67

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，并充分考虑股指期货的流动性与收益及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险与特殊情况下的流动性风险，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并充分考虑国债期货的流动性与收益及风险特征，运用国债期货对冲系统性风险与特殊情况下的流动性风险。本基金也将结合对宏观形势的判断、对债券市场进行研究分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性与波动性等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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、处罚说明

本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

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	266,819.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	266,819.13

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

本基金本报告期末持有的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

本基金本报告期末持有的积极投资前五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

由于四舍五入原因，投资组合报告中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
联博中证 500 指数增 强 A	683	148,836.29	5,605,171.11	5.51%	96,050,012.20	94.49%
联博中证 500 指数增 强 C	465	68,954.57	—	—	32,063,873.97	100.00%
合计	1,148	116,480.02	5,605,171.11	4.19%	128,113,886.17	95.81%

注：1、机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	联博中证 500 指 数增强 A	1,084,135.91	1.07%
	联博中证 500 指 数增强 C	50,014.88	0.16%
	合计	1,134,150.79	0.85%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	联博中证 500 指数增强 A	>100
	联博中证 500 指数增强 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	联博中证 500 指数增强 A	>100
	联博中证 500 指数增强 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	联博中证 500 指数增强 A	联博中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 09 日）基金份额总额	260,195,571.31	168,846,450.53
本报告期期初基金份额总额	260,195,571.31	168,846,450.53
本报告期基金总申购份额	76,299,335.82	38,365,774.82
减：本报告期基金总赎回份额	234,839,723.82	175,148,351.38
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	101,655,183.31	32,063,873.97

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。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，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动情况如下：

2026 年 3 月 26 日，AJAI MOHAN KAUL 先生离任公司董事长，MICHAEL FRAZIER THOMPSON 先生新任前述职务。

自 2026 年 6 月 29 日起，王玲女士担任公司督察长，总经理罗登攀先生不再代行督察长职务。

本基金管理人已在规定的信息披露媒介登载了以上重大人事变动公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

本基金自基金合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

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，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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	
国泰海通 证券	2	545,743,462.28	56.62%	101,438.86	55.91%	—
湘财证券	2	418,166,004.06	43.38%	79,981.75	44.09%	—

注：1. 此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而

支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2. 根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14 号）及《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）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行相关分仓规定。
3. 本基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。
4. 本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。
5. 本基金本报告期内证券经纪商无变更。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰海通证券	-	-	124,158,000.00	48.49%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	131,899,000.00	51.51%	-	-	-	-

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	联博基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026年01月01日
2	联博中证 500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换转入、转换转出、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2026年01月09日
3	联博基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会规定媒介	2026年03月28日
4	联博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(2025 年度)	中国证监会规定媒介	2026年03月30日
5	联博基金管理有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年04月21日

6	联博中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026年04月21日
7	2025 年度联博基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026年04月29日
8	关于警惕冒用联博基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证监会规定媒介	2026年05月18日
9	联博基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
10	联博中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
11	联博中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
12	联博中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026年05月22日
13	联博基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	中国证监会规定媒介	2026年05月28日
14	联博基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026年06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
个人	1	20260101-20260212	102,014,280.00	-	102,014,280.00	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额。赎回份额含转换出份额、因份额合并而减少的份额。

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、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《托管协议》
- 4、本基金的《招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金在规定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站 <https://www.alliancebernstein.com.cn/> 查阅。

联博基金管理有限公司

2026 年 08 月 28 日