

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：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：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 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	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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	68
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	68
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	68
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68

7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
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	72
10.8 其他重大事件	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§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	173,244,737.56 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	126,383,120.58 份	46,861,616.98 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	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。本基金的股票投资策略包括：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

	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		张东	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 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	41,435,515.48	16,947,490.72
本期利润	41,492,332.87	15,616,082.55
加权平均基金份额本期利润	0.2868	0.2452
本期加权平均净值利润率	15.56%	13.77%
本期基金份额净值增长率	16.79%	16.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 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	119,768,337.01	41,482,457.52
期末可供分配基金份额利润	0.9477	0.8852
期末基金资产净值	250,163,971.31	89,761,339.96

期末基金份额净值	1.9794	1.9155
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 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	97.94%	95.68%

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
过去三个月	16.15%	1.47%	17.61%	1.56%	-1.46%	-0.09%
过去六个月	16.79%	1.48%	19.93%	1.58%	-3.14%	-0.10%
过去一年	45.30%	1.27%	49.68%	1.35%	-4.38%	-0.08%
过去三年	56.25%	1.36%	48.15%	1.41%	8.10%	-0.05%
过去五年	29.02%	1.26%	31.61%	1.30%	-2.59%	-0.04%
过去七年	126.11%	1.27%	78.59%	1.29%	47.52%	-0.02%
自基金合同生效起至今	97.94%	1.31%	38.47%	1.33%	59.47%	-0.02%

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
过去三个月	16.03%	1.47%	17.61%	1.56%	-1.58%	-0.09%
过去六个月	16.56%	1.48%	19.93%	1.58%	-3.37%	-0.10%
过去一年	44.72%	1.27%	49.68%	1.35%	-4.96%	-0.08%
过去三年	54.40%	1.36%	48.15%	1.41%	6.25%	-0.05%
过去五年	26.45%	1.26%	31.61%	1.30%	-5.16%	-0.04%

过去七年	119.84%	1.27%	78.59%	1.29%	41.25%	-0.02%
自基金合同生效起至今	95.68%	1.31%	46.28%	1.34%	49.40%	-0.03%

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。

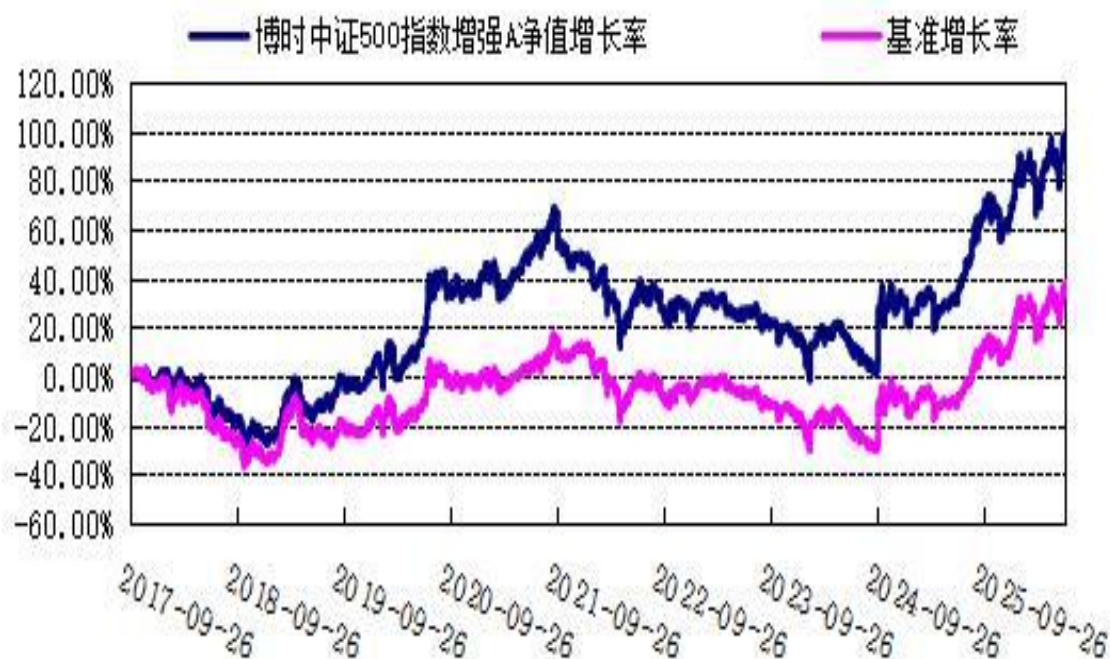
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2026 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 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 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 17,353 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 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 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	2020-12-23	-	19.8	刘钊先生，博士。2006 年起

	资部投资副总监/基金经理				先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、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—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—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—至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日—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—至今)的基金经理。
--	--------------	--	--	--	--

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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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 18 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

2026 年上半年，海内外权益市场整体呈现先抑后扬、极致结构化分化特征。

海外，中东地缘冲突是上半年核心外部扰动。伊朗地缘冲突爆发推升国际油价大幅上行，打破市场美联储降息预期，甚至引发加息定价，全球风险偏好显著回落。目前市场对 2026 年下半年的预期是一到两次加息，幅度在 0.25% 到 0.5% 之间。

国内宏观经济整体处于政策托底、市场筑底修复阶段，上半年国内持续实施积极财政叠加适度宽松货币的双宽松政策，通过全年 4% 左右赤字率、超长期特别国债与专项债发力夯实基建底盘，叠加汽车、家电、智能数码等领域以旧换新消费补贴提振内需，有效对冲外部输入性通胀、地缘冲击及产业分化带来的下行压力；货币政策持续保持流动性合理充裕，加强财政货币协同、压降实体融资成本、助力产业转型升级，政策托底成效持续落地，6 月制造业 PMI、非制造业商务活动指数、综合 PMI 产出指数分别录得 50.3%、50.2%、50.6%，三大指标全线站稳荣枯线上方，供需同步回暖，经济景气水平稳步修复。

产业方面，大 AI 产业链较为突出。一季度开源 AI 智能体框架“龙虾”（OpenClaw）快速普及，低门槛、开源开放的特性打破行业发展壁垒，带动算力、存储等 AI 硬件需求大幅扩容，AI 全产业链景气度全面激活，为科技板块提供持续结构性机会。二季度 AI 产业景气度进一步向高端赛道集中，结构性分化加剧。但随着 HBM 高端存储需求爆发，头部晶圆厂优先保障算力订单、压降成熟制程产能，挤压手机、PC 等消费电子芯片供给。上游零部件涨价推升终端成本，叠加居民消费意愿偏弱，消费电子及下游传统行业需求持续走弱，形成 AI 算力上游高景气、终端消费偏弱的割裂格局。

在上述背景下，A 股行业表现较为分化。整个上半年，全市场仅 9 个中信一级行业上涨。其中，电子、通信行业断崖式领先，分别上涨 85.49%、74.54%，建材、基础化工、机械亦录得两位数涨幅，分别为 43.7%、18.56%、16.17%，其它上涨行业涨幅仅为个位数。21 个行业下跌。消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔、商贸零售跌幅居前，涨跌幅分别为 -31.88%、-29.58%、-25.09%、-24.76%、-22.18%。行业首尾收益差超 120%。宽基方面，依托 AI 产业爆发行情，科创 50 上涨 64.25%，科创

100 上涨 62.07%。沪深 300、中证 500、中证 1000 分别上涨 7.55%、20.97%、15.99%。港股表现偏弱，恒生指数、恒生科技指数分别下跌 10.73%、18.92%。

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 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.9794 元，份额累计净值为 1.9794 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.9155 元，份额累计净值为 1.9155 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 16.79%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 16.56%，同期业绩基准增长率为 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

展望 2026 年下半年，中东地缘扰动仍可能阶段性存在，但短期脉冲影响将逐步消退，油价有望向合理区间回归，全球风险偏好持续修复。国内稳增长政策持续落地，经济复苏态势稳步巩固，经济转型与新质生产力发展的长期逻辑不变，A 股结构性行情延续，科技与高端制造赛道仍具备突出配置价值。

流动性层面，海外加息预期已充分定价，下半年全球流动性收紧压力边际缓解，利好权益估值修复。国内财政与货币政策持续协同，消费、基建政策红利持续释放，内需复苏动能稳步增强，为市场提供基本面支撑。产业层面，AI 智能体、高端算力、先进制造等新质生产力赛道景气度延续上行，仍是市场核心主线；传统行业随经济复苏逐步修复，市场结构性分化有望逐步收敛。

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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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的真实、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）、投资组合报告等财务数据真实、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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	5,148,009.55	23,505,615.40
结算备付金		4,051,163.11	3,792,044.12
存出保证金		150,547.16	75,257.32
交易性金融资产	6.4.6.2	325,934,001.27	374,097,132.99
其中：股票投资		313,654,921.87	374,097,132.99
基金投资		-	-
债券投资		12,279,079.40	-
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		9,761,633.06	135,330.02

应收股利		-	-
应收申购款		407,656.77	2,237,252.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		345,453,010.92	403,842,632.58
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,361,000.00	-
应付清算款		-	308.10
应付赎回款		1,428,114.89	1,726,094.35
应付管理人报酬		276,528.30	333,705.42
应付托管费		55,305.66	66,741.09
应付销售服务费		28,993.90	40,428.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		256.37	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	377,500.53	507,527.03
负债合计		5,527,699.65	2,674,804.86
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	173,244,737.56	238,979,440.95
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	166,680,573.71	162,188,386.77
净资产合计		339,925,311.27	401,167,827.72
负债和净资产总计		345,453,010.92	403,842,632.58

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 173,244,737.56 份。其中 A 类基金份额净值 1.9794 元，基金份额总额 126,383,120.58 份；C 类基金份额净值 1.9155 元，基金份额总额 46,861,616.98 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		59,683,277.56	30,279,846.12
1.利息收入		54,557.97	59,595.21
其中：存款利息收入	6.4.6.9	54,557.97	59,595.21
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）		60,864,592.91	2,597,271.90
其中：股票投资收益	6.4.6.10	58,142,244.51	-1,158,244.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	7,632.58	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	-	-
股利收益	6.4.6.14	2,714,715.82	3,744,806.60
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	-1,274,590.78	27,566,724.76
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	38,717.46	56,254.25
减：二、营业总支出		2,574,862.14	2,888,462.25
1. 管理人报酬		1,886,446.39	2,132,293.22
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		377,289.28	426,458.66
3. 销售服务费		225,459.79	202,988.20
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,282.81	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,282.81	-
6. 信用减值损失	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		27.47	0.04
8. 其他费用	6.4.6.18	83,356.40	126,722.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57,108,415.42	27,391,383.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		57,108,415.42	27,391,383.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		57,108,415.42	27,391,383.87

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产	238,979,440.95	-	162,188,386.77	401,167,827.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	238,979,440.95	-	162,188,386.77	401,167,827.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65,734,703.39	-	4,492,186.94	-61,242,516.45
（一）、综合收益总额	-	-	57,108,415.42	57,108,415.42
（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）	-65,734,703.39	-	-52,616,228.48	-118,350,931.87
其中：1.基金申购款	58,302,301.59	-	47,518,136.52	105,820,438.11
2.基金赎回款	-124,037,004.98	-	-100,134,365.00	-224,171,369.98
（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	173,244,737.56	-	166,680,573.71	339,925,311.27

项目	上年度可比期间			
	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

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：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，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”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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 6.4.4 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[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	5,148,009.55
等于：本金	5,147,252.56
加：应计利息	756.99
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	5,148,009.55

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	303,309,355.40	-	313,654,921.87	10,345,566.47
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	12,210,928.00	68,099.40	12,279,079.40	52.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,210,928.00	68,099.40	12,279,079.40	52.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		315,520,283.40	68,099.40	325,934,001.27	10,345,618.47

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 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,475.34

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	297,673.91
其中：交易所市场	297,673.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	78,351.28
合计	377,500.53

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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	164,239,613.26	164,239,613.26
本期申购	29,565,989.98	29,565,989.98
本期赎回（以“-”号填列）	-67,422,482.66	-67,422,482.66
本期末	126,383,120.58	126,383,120.58

博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	74,739,827.69	74,739,827.69
本期申购	28,736,311.61	28,736,311.61
本期赎回（以“-”号填列）	-56,614,522.32	-56,614,522.32
本期末	46,861,616.98	46,861,616.98

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	109,193,704.25	4,916,246.01	114,109,950.26
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	109,193,704.25	4,916,246.01	114,109,950.26
本期利润	41,435,515.48	56,817.39	41,492,332.87
本期基金份额交易产生的变动数	-30,860,882.72	-960,549.68	-31,821,432.40
其中：基金申购款	24,121,412.49	983,199.22	25,104,611.71
基金赎回款	-54,982,295.21	-1,943,748.90	-56,926,044.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	119,768,337.01	4,012,513.72	123,780,850.73

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	45,946,543.14	2,131,893.37	48,078,436.51
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	45,946,543.14	2,131,893.37	48,078,436.51
本期利润	16,947,490.72	-1,331,408.17	15,616,082.55
本期基金份额交易产生的变动数	-21,411,576.34	616,780.26	-20,794,796.08
其中：基金申购款	21,693,785.80	719,739.01	22,413,524.81
基金赎回款	-43,105,362.14	-102,958.75	-43,208,320.89
本期已分配利润	-	-	-

本期末	41,482,457.52	1,417,265.46	42,899,722.98
-----	---------------	--------------	---------------

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,767.75
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	15,459.53
其他	330.69
合计	54,557.97

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	1,479,850,569.99
减：卖出股票成本总额	1,420,201,751.10
减：交易费用	1,506,574.38
买卖股票差价收入	58,142,244.51

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
	2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,632.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,632.58

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,714,715.82
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,714,715.82

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-1,274,590.78

——股票投资	-1,274,642.78
——债券投资	52.00
——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	-1,274,590.78

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	31,586.16
基金转换费收入	7,131.30
合计	38,717.46

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
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	31.36

银行汇划费	4,973.76
合计	83,356.40

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

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方、关联关系

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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 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	122,001,050.76	4.30%	72,635,625.28	2.48%

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			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	25,124.20	4.30%	9,714.22	3.26%
关联方名称	上年度可比期间			
	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%

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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6

	6 月 30 日	月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,886,446.39	2,132,293.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	781,730.36	780,436.26
应支付基金管理人的净管理费	1,104,716.03	1,351,856.96

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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	377,289.28	426,458.66

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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	-	1,745.97	1,745.97
博时基金	-	11,424.68	11,424.68
合计	-	13,170.65	13,170.65
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间		
	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

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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收	期末余额	当期利息收

		入		入
中国银行-活期存款	5,148,009.55	38,767.75	21,149,553.14	42,474.15

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	001365	天海电子	网下发行	1,360.00	36,978.40
上年度可比期间 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

6.4.9.8 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（2026 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	成功 认购日	受 限 期	流 通 受	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

	称			限 类 型						
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	首次公开发 行限售	104.66	768.89	1,032.00	108,009.12	793,494.48	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	首次公开发 行限售	46.08	463.33	593.00	27,325.44	274,754.69	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	首次公开发 行限售	22.68	42.16	3,733.00	84,664.44	157,383.28	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	首次公开发 行限售	81.88	1,584.33	96.00	7,860.48	152,095.68	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	首次公开发 行限售	10.11	10.11	10,951.00	110,714.61	110,714.61	-

688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	首次公开发 行限售	9.47	70.14	1,239.00	11,733.33	86,903.46	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	首次公开发 行限售	19.68	141.49	591.00	11,630.88	83,620.59	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	首次公开发 行限售	44.56	468.67	140.00	6,238.40	65,613.80	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	首次公开发 行限售	69.66	160.06	381.00	26,540.46	60,982.86	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	首次公开发 行限售	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	首次公开	10.12	27.73	1,758.00	17,790.96	48,749.34	-

				发行 限售						
001248	华 润 新 能 源	2026-06-24	6 个 交 易 日	新 股 未 上 市	10.11	10.11	4,692.00	47,436.12	47,436.12	-
688785	恒 运 昌	2026-01-20	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	92.18	463.15	93.00	8,572.74	43,072.95	-
688813	泰 金 新 能	2026-03-24	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长 进 光 子	2026-05-20	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛 龙 股 份	2026-03-24	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	7.82	20.74	1,648.00	12,887.36	34,179.52	-
603459	红 板 科	2026-03-31	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	17.70	84.32	254.00	4,495.80	21,417.28	-

	技			开发 行 限 售						
688811	有研 复材	2026-04-01	6 个月	首次公 开发 行 限 售	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞 智能	2026-03-31	6 个月	首次公 开发 行 限 售	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特 电子	2026-06-02	6 个月	首次公 开发 行 限 售	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广 益	2025-12-24	6 个月	首次公 开发 行 限 售	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光 集团	2026-04-28	6 个月	首次公 开发 行 限	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-

				售						
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	首次公开发 行限售	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	首次公开发 行限售	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	首次公开发 行限售	27.19	31.31	408.00	11,093.52	12,774.48	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	首次公开发 行限售	30.38	38.99	289.00	8,779.82	11,268.11	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	首次公开发 行限售	78.38	121.77	90.00	7,054.20	10,959.30	-
603407	长裕集	2026-04-29	6 个月	首次公	13.86	73.46	137.00	1,898.82	10,064.02	-

	团			开发 行 限 售						
001237	惠 康 科 技	2026-05-15	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	53.26	58.74	166.00	8,841.16	9,750.84	-
688816	易 思 维	2026-02-04	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	55.95	57.10	164.00	9,175.80	9,364.40	-
301513	尚 水 智 能	2026-04-10	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
601112	振 石 股 份	2026-01-21	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	11.18	17.59	357.00	3,991.26	6,279.63	-
603435	嘉 德 利	2026-05-15	6 个 月	首次公 开发 行 限	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-

				售						
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	首次公开发 行限售	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	首次公开发 行限售	33.49	33.93	69.00	2,310.81	2,341.17	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	首次公开发 行限售	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	首次公开发 行限售	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	首次公开发 行限售	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-

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

无。

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

截至本报告 2026 年 06 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,361,000.00 元,于 2026 年 07 月 02 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,279,079.40	-
合计	12,279,079.40	-

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。

6.4.12.2.2 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

无。

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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,148,009.55	-	-	-	5,148,009.55
结算备付金	4,051,163.11	-	-	-	4,051,163.11
存出保证金	150,547.16	-	-	-	150,547.16
交易性金融资产	12,279,079.40	-	-	-313,654,921.87	325,934,001.27
应收清算款	-	-	-	9,761,633.06	9,761,633.06
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	407,656.77	407,656.77
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,628,799.22	-	-	-323,824,211.70	345,453,010.92
负债					
卖出回购金融资产款	3,361,000.00	-	-	-	3,361,000.00
应付赎回款	-	-	-	1,428,114.89	1,428,114.89
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	276,528.30	276,528.30
应付托管费	-	-	-	55,305.66	55,305.66
应付销售服务费	-	-	-	28,993.90	28,993.90
应交税费	-	-	-	256.37	256.37
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	377,500.53	377,500.53
负债总计	3,361,000.00	-	-	2,166,699.65	5,527,699.65
利率敏感度缺口	18,267,799.22	-	-	-321,657,512.05	339,925,311.27
上年度末 2025 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	23,505,615.40	-	-	-	23,505,615.40
结算备付金	3,792,044.12	-	-	-	3,792,044.12
存出保证金	75,257.32	-	-	-	75,257.32
交易性金融资产	-	-	-	-374,097,132.99	374,097,132.99
应收清算款	-	-	-	135,330.02	135,330.02
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,237,252.73	2,237,252.73
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,372,916.84	-	-	-376,469,715.74	403,842,632.58
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,726,094.35	1,726,094.35
应付清算款	-	-	-	308.10	308.10
应付管理人报酬	-	-	-	333,705.42	333,705.42
应付托管费	-	-	-	66,741.09	66,741.09
应付销售服务费	-	-	-	40,428.87	40,428.87
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	507,527.03	507,527.03
负债总计	-	-	-	2,674,804.86	2,674,804.86
利率敏感度缺口	27,372,916.84	-	-	-373,794,910.88	401,167,827.72

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

假设	除市场利率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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 2	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 2	-

注：上年度末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(不包括可转债和可交换债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	313,654,921.87	92.27	374,097,132.99	93.25
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	313,654,921.87	92.27	374,097,132.99	93.25

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，期货投资与相关的期货暂收款(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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,614	增加约 2,339
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,614	减少约 2,339

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 2026年6月30日
第一层次	311,336,237.97
第二层次	12,437,230.13
第三层次	2,160,533.17
合计	325,934,001.27

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	313,654,921.87	90.80
	其中：股票	313,654,921.87	90.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,279,079.40	3.55
	其中：债券	12,279,079.40	3.55
	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	9,199,172.66	2.66
8	其他各项资产	10,319,836.99	2.99
9	合计	345,453,010.92	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	941,996.00	0.28
B	采矿业	6,598,000.00	1.94
C	制造业	191,846,592.73	56.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,911,309.00	1.44
E	建筑业	1,450,429.00	0.43
F	批发和零售业	16,268,094.00	4.79
G	交通运输、仓储和邮政业	3,608,644.00	1.06
H	住宿和餐饮业	419,167.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,925,369.99	2.33
J	金融业	16,103,469.00	4.74
K	房地产业	969,933.00	0.29
L	租赁和商务服务业	2,332,002.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	3,331,370.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	5,007,474.00	1.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	13,552.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,768,368.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	263,495,769.72	77.52

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	369,987.20	0.11
B	采矿业	3,885,698.52	1.14
C	制造业	34,953,186.47	10.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,562,387.73	0.46
E	建筑业	4,816.00	0.00
F	批发和零售业	1,722,056.43	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	1,333,316.86	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,343,895.34	1.28
J	金融业	152,671.00	0.04
K	房地产业	98,029.60	0.03
L	租赁和商务服务业	857,745.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	409,200.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	451,200.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,542.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,420.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	50,159,152.15	14.76

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

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	占基金资产净值比
----	------	------	-------	------	----------

					例(%)
1	300857	协创数据	19,200	6,526,080.00	1.92
2	300223	北京君正	25,500	6,346,950.00	1.87
3	688002	睿创微纳	36,212	5,601,634.28	1.65
4	300054	鼎龙股份	52,700	5,584,619.00	1.64
5	300604	长川科技	16,224	5,539,198.08	1.63
6	002271	东方雨虹	418,566	4,968,378.42	1.46
7	002414	高德红外	373,620	4,954,201.20	1.46
8	001389	广合科技	20,300	4,816,175.00	1.42
9	002008	大族激光	31,400	4,713,454.00	1.39
10	301536	星辰科技	35,800	4,607,818.00	1.36
11	300475	香农芯创	14,800	4,440,000.00	1.31
12	002266	浙富控股	819,500	4,146,670.00	1.22
13	600499	科达制造	296,300	4,088,940.00	1.20
14	600885	宏发股份	113,100	3,900,819.00	1.15
15	688498	源杰科技	2,042	3,851,212.00	1.13
16	301358	湖南裕能	48,500	3,679,695.00	1.08
17	688266	泽璟制药	31,335	3,655,541.10	1.08
18	601233	桐昆股份	166,200	3,598,230.00	1.06
19	001309	德明利	3,600	3,394,440.00	1.00
20	000951	中国重汽	167,700	3,271,827.00	0.96
21	300972	万辰集团	18,600	3,225,426.00	0.95
22	002120	韵达股份	496,700	3,159,012.00	0.93
23	600546	山煤国际	286,500	3,131,445.00	0.92
24	603345	安井食品	38,800	3,111,372.00	0.92
25	300919	中伟新材	67,200	2,940,000.00	0.86
26	300012	华测检测	209,800	2,907,828.00	0.86
27	603699	纽威股份	55,700	2,801,710.00	0.82
28	000060	中金岭南	334,100	2,529,137.00	0.74
29	000034	神州数码	88,940	2,468,085.00	0.73
30	600711	盛屯矿业	223,400	2,450,698.00	0.72
31	603233	大参林	158,900	2,388,267.00	0.70
32	300073	当升科技	49,500	2,377,980.00	0.70
33	000750	国海证券	633,900	2,332,752.00	0.69
34	600685	中船防务	89,300	2,271,792.00	0.67
35	002281	光迅科技	8,700	2,235,378.00	0.66
36	000683	博源化工	373,500	2,151,360.00	0.63
37	000783	长江证券	215,300	2,099,175.00	0.62
38	000703	恒逸石化	154,500	2,096,565.00	0.62
39	000415	渤海租赁	514,600	2,094,422.00	0.62
40	600105	永鼎股份	30,500	2,058,140.00	0.61
41	002273	水晶光电	57,600	2,043,648.00	0.60
42	600497	驰宏锌锗	162,300	1,965,453.00	0.58

43	300458	全志科技	49,440	1,950,902.40	0.57
44	002841	视源股份	56,400	1,947,492.00	0.57
45	600816	建元信托	777,700	1,897,588.00	0.56
46	300395	菲利华	14,100	1,885,593.00	0.55
47	688469	芯联集成	176,180	1,869,269.80	0.55
48	002064	华峰化学	195,000	1,850,550.00	0.54
49	600601	方正科技	132,300	1,831,032.00	0.54
50	603077	和邦生物	787,500	1,827,000.00	0.54
51	300037	新宙邦	19,600	1,819,860.00	0.54
52	000629	钒钛股份	539,900	1,803,266.00	0.53
53	601019	山东出版	276,000	1,766,400.00	0.52
54	688220	翱捷科技	14,003	1,740,852.96	0.51
55	002738	中矿资源	29,000	1,710,710.00	0.50
56	600109	国金证券	191,300	1,679,614.00	0.49
57	000987	越秀资本	209,200	1,635,944.00	0.48
58	300548	长芯博创	5,700	1,584,600.00	0.47
59	002340	格林美	233,900	1,546,079.00	0.45
60	688778	厦钨新能	28,354	1,542,457.60	0.45
61	688599	天合光能	107,916	1,523,773.92	0.45
62	000709	河钢股份	784,100	1,521,154.00	0.45
63	688475	萤石网络	54,669	1,495,197.15	0.44
64	600390	五矿资本	327,100	1,491,576.00	0.44
65	300957	贝泰妮	47,200	1,487,272.00	0.44
66	600595	中孚实业	263,800	1,482,556.00	0.44
67	301606	绿联科技	24,296	1,482,541.92	0.44
68	002410	广联达	179,800	1,467,168.00	0.43
69	600008	首创环保	536,150	1,458,328.00	0.43
70	600655	豫园股份	353,000	1,450,830.00	0.43
71	600535	天士力	109,000	1,442,070.00	0.42
72	600606	绿地控股	1,185,500	1,434,455.00	0.42
73	688347	华虹宏力	4,100	1,378,830.00	0.41
74	300953	震裕科技	9,800	1,310,260.00	0.39
75	002299	圣农发展	86,100	1,305,276.00	0.38
76	600566	济川药业	56,900	1,262,611.00	0.37
77	600927	永安期货	97,400	1,212,630.00	0.36
78	000423	东阿阿胶	26,200	1,188,432.00	0.35
79	603308	应流股份	19,100	1,153,640.00	0.34
80	688313	仕佳光子	5,815	1,073,739.75	0.32
81	603338	浙江鼎力	24,900	1,058,250.00	0.31
82	603816	顾家家居	46,932	1,049,399.52	0.31
83	600166	福田汽车	359,300	1,045,563.00	0.31
84	600312	平高电气	58,000	1,024,280.00	0.30
85	600998	九州通	214,200	1,004,598.00	0.30

86	600688	上海石化	341,000	999,130.00	0.29
87	002436	兴森科技	19,000	968,050.00	0.28
88	600598	北大荒	86,900	941,996.00	0.28
89	001286	陕西能源	90,400	916,656.00	0.27
90	688213	思特威	8,121	869,515.47	0.26
91	300140	节能环保	173,200	860,804.00	0.25
92	002500	山西证券	162,000	835,920.00	0.25
93	601155	新城控股	80,300	823,878.00	0.24
94	603156	养元饮品	16,600	814,562.00	0.24
95	002926	华西证券	98,000	800,660.00	0.24
96	688615	合合信息	6,903	780,729.30	0.23
97	002078	太阳纸业	61,700	770,633.00	0.23
98	600177	雅戈尔	101,692	765,740.76	0.23
99	300620	光库科技	2,000	756,400.00	0.22
100	688349	三一重能	49,400	749,892.00	0.22
101	601108	财通证券	85,800	742,170.00	0.22
102	600642	申能股份	82,200	717,606.00	0.21
103	600098	广州发展	121,100	715,701.00	0.21
104	688120	华海清科	2,200	708,796.00	0.21
105	600704	物产中大	145,500	686,760.00	0.20
106	600332	白云山	33,900	679,356.00	0.20
107	600583	海油工程	131,000	658,930.00	0.19
108	002126	银轮股份	13,200	657,360.00	0.19
109	603444	吉比特	1,831	656,267.02	0.19
110	000960	锡业股份	15,300	653,157.00	0.19
111	688099	晶晨股份	6,200	637,980.00	0.19
112	688019	安集科技	1,800	611,028.00	0.18
113	603256	宏和科技	2,300	610,259.00	0.18
114	603939	益丰药房	33,600	604,128.00	0.18
115	002185	华天科技	26,900	600,139.00	0.18
116	300285	国瓷材料	5,800	598,444.00	0.18
117	003031	中瓷电子	3,200	576,960.00	0.17
118	688018	乐鑫科技	4,485	573,721.20	0.17
119	600380	健康元	58,900	554,838.00	0.16
120	600801	华新建材	35,500	553,800.00	0.16
121	300699	光威复材	19,000	544,350.00	0.16
122	300623	捷捷微电	11,900	535,381.00	0.16
123	600369	西南证券	130,700	525,414.00	0.15
124	300373	扬杰科技	3,300	518,859.00	0.15
125	688192	迪哲医药	12,828	512,222.04	0.15
126	002152	广电运通	54,400	510,272.00	0.15
127	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.15
128	300136	信维通信	4,000	477,000.00	0.14

129	600602	云赛智联	29,200	469,536.00	0.14
130	300454	深信服	4,700	452,140.00	0.13
131	000893	亚钾国际	11,000	449,790.00	0.13
132	600352	浙江龙盛	37,100	449,281.00	0.13
133	002409	雅克科技	2,000	449,000.00	0.13
134	600765	中航重机	34,000	439,280.00	0.13
135	000021	深科技	6,700	430,609.00	0.13
136	300759	康龙化成	14,600	422,378.00	0.12
137	600995	南网储能	34,200	420,660.00	0.12
138	600754	锦江酒店	23,300	419,167.00	0.12
139	000155	川能动力	34,700	415,706.00	0.12
140	002195	岩山科技	62,900	411,366.00	0.12
141	603920	世运电路	8,500	408,340.00	0.12
142	002025	航天电器	5,300	403,966.00	0.12
143	688027	国盾量子	800	403,208.00	0.12
144	002262	恩华药业	21,300	399,375.00	0.12
145	603290	斯达半导	2,600	397,644.00	0.12
146	600884	杉杉股份	29,200	395,660.00	0.12
147	603659	璞泰来	13,600	393,448.00	0.12
148	002568	百润股份	22,800	385,776.00	0.11
149	002335	科华数据	8,965	380,564.25	0.11
150	601608	中信重工	78,700	375,399.00	0.11
151	002138	顺络电子	5,000	365,500.00	0.11
152	603606	东方电缆	8,740	362,797.40	0.11
153	688578	艾力斯	3,300	360,360.00	0.11
154	603858	步长制药	23,600	344,560.00	0.10
155	600737	中粮糖业	27,500	339,075.00	0.10
156	601156	东航物流	20,500	330,460.00	0.10
157	002444	巨星科技	10,600	329,660.00	0.10
158	601869	长飞光纤	600	327,540.00	0.10
159	603298	杭叉集团	13,500	322,110.00	0.09
160	688561	奇安信	13,100	314,138.00	0.09
161	600808	马钢股份	123,000	307,500.00	0.09
162	600038	中直股份	11,900	300,951.00	0.09
163	000513	丽珠集团	10,000	288,900.00	0.08
164	600298	安琪酵母	7,900	285,980.00	0.08
165	002429	兆驰股份	27,400	284,686.00	0.08
166	600329	达仁堂	7,500	279,150.00	0.08
167	688385	复旦微电	3,900	278,031.00	0.08
168	000967	盈峰环境	26,403	278,023.59	0.08
169	600517	国网英大	58,900	275,652.00	0.08
170	688676	金盘科技	3,000	253,920.00	0.07
171	600131	国网信通	17,200	251,120.00	0.07

172	002423	中粮资本	29,500	242,785.00	0.07
173	688629	华丰科技	1,200	225,012.00	0.07
174	300567	精测电子	700	222,320.00	0.07
175	002155	湖南黄金	9,200	219,604.00	0.06
176	300017	网宿科技	16,700	217,267.00	0.06
177	688361	中科飞测	500	215,000.00	0.06
178	603596	伯特利	8,623	214,195.32	0.06
179	688563	航材股份	4,104	210,247.92	0.06
180	300115	长盈精密	7,300	203,962.00	0.06
181	688052	纳芯微	700	201,817.00	0.06
182	000591	太阳能	43,600	200,560.00	0.06
183	002603	以岭药业	12,900	193,500.00	0.06
184	603379	三美股份	2,400	182,136.00	0.05
185	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.05
186	000739	普洛药业	9,900	164,934.00	0.05
187	002517	恺英网络	9,900	160,875.00	0.05
188	601099	太平洋	47,500	160,075.00	0.05
189	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.05
190	003022	联泓新科	5,800	150,220.00	0.04
191	600848	上海临港	19,500	146,055.00	0.04
192	603766	隆鑫通用	12,200	145,546.00	0.04
193	300058	蓝色光标	10,500	144,480.00	0.04
194	600988	赤峰黄金	4,700	123,704.00	0.04
195	002432	九安医疗	1,700	120,156.00	0.04
196	603565	中谷物流	12,000	117,720.00	0.03
197	603658	安图生物	4,000	116,080.00	0.03
198	603806	福斯特	6,800	114,172.00	0.03
199	300666	江丰电子	300	110,580.00	0.03
200	300496	中科创达	1,700	105,043.00	0.03
201	002624	完美世界	8,300	103,086.00	0.03
202	600143	金发科技	6,600	101,970.00	0.03
203	300146	汤臣倍健	11,000	99,440.00	0.03
204	601399	国机重装	27,700	96,950.00	0.03
205	688180	君实生物	2,822	95,440.04	0.03
206	002131	利欧股份	19,600	93,100.00	0.03
207	600486	扬农化工	1,800	91,260.00	0.03
208	603688	石英股份	1,100	90,871.00	0.03
209	002673	西部证券	13,400	86,966.00	0.03
210	688234	天岳先进	424	73,568.24	0.02
211	000738	航发控制	3,900	71,331.00	0.02
212	000528	柳工	8,100	61,155.00	0.02
213	000009	中国宝安	9,800	61,054.00	0.02
214	600699	均胜电子	2,800	60,508.00	0.02

215	002812	恩捷股份	900	60,219.00	0.02
216	688425	铁建重工	13,400	53,868.00	0.02
217	300570	太辰光	200	49,342.00	0.01
218	002465	海格通信	3,800	48,526.00	0.01
219	300390	天华新能	510	47,690.10	0.01
220	300339	润和软件	1,200	46,212.00	0.01
221	600498	烽火通信	600	44,160.00	0.01
222	002487	大金重工	700	40,579.00	0.01
223	688708	佳驰科技	700	35,560.00	0.01
224	000400	许继电气	1,600	34,720.00	0.01
225	603129	春风动力	100	25,580.00	0.01
226	002065	东华软件	3,400	24,276.00	0.01
227	600863	华能蒙电	5,100	23,970.00	0.01
228	600578	京能电力	3,300	21,285.00	0.01
229	600282	南钢股份	4,500	20,655.00	0.01
230	300100	双林股份	740	20,557.20	0.01
231	605589	圣泉集团	300	19,071.00	0.01
232	000878	云南铜业	1,200	19,056.00	0.01
233	300383	光环新网	1,500	18,660.00	0.01
234	300763	锦浪科技	200	18,070.00	0.01
235	300627	华测导航	540	15,336.00	0.00
236	300724	捷佳伟创	200	14,120.00	0.00
237	600763	通策医疗	400	13,552.00	0.00
238	000932	华菱钢铁	3,780	13,116.60	0.00
239	300474	景嘉微	200	12,096.00	0.00
240	600095	湘财股份	1,600	12,048.00	0.00
241	600582	天地科技	2,700	12,015.00	0.00
242	601615	明阳智能	1,000	11,570.00	0.00
243	002756	永兴材料	200	11,328.00	0.00
244	601555	东吴证券	1,300	10,296.00	0.00
245	600985	淮北矿业	700	9,835.00	0.00
246	601567	三星电气	600	8,964.00	0.00
247	600820	隧道股份	1,700	8,857.00	0.00
248	000027	深圳能源	1,020	6,324.00	0.00
249	601112	振石股份	357	6,279.63	0.00
250	601139	深圳燃气	1,100	6,226.00	0.00
251	000729	燕京啤酒	500	5,065.00	0.00
252	600141	兴发集团	100	4,697.00	0.00
253	600021	上海电力	300	4,521.00	0.00
254	689009	九号公司	100	3,815.00	0.00
255	600970	中材国际	500	3,565.00	0.00
256	600170	上海建工	1,600	3,552.00	0.00
257	000997	新大陆	200	3,260.00	0.00

258	600171	上海贝岭	100	3,194.00	0.00
259	000825	太钢不锈	900	3,069.00	0.00
260	601179	中国西电	200	2,984.00	0.00
261	600873	梅花生物	400	2,940.00	0.00
262	002508	老板电器	200	2,924.00	0.00
263	600536	中国软件	100	2,812.00	0.00
264	601958	金钼股份	100	2,811.00	0.00
265	600060	海信视像	100	2,787.00	0.00
266	600879	航天电子	126	2,682.54	0.00
267	600483	福能股份	200	2,038.00	0.00
268	601098	中南传媒	200	1,968.00	0.00
269	000883	湖北能源	400	1,728.00	0.00
270	600637	东方明珠	200	1,662.00	0.00
271	600062	华润双鹤	100	1,604.00	0.00
272	600521	华海药业	110	1,584.00	0.00
273	600004	白云机场	200	1,452.00	0.00
274	003035	南网能源	200	1,164.00	0.00
275	600901	江苏金租	200	1,150.00	0.00
276	601966	玲珑轮胎	100	1,019.00	0.00
277	600299	安迪苏	100	785.00	0.00
278	002153	石基信息	100	723.00	0.00
279	600968	海油发展	200	666.00	0.00
280	600398	海澜之家	100	523.00	0.00
281	601216	君正集团	100	446.00	0.00
282	600339	中油工程	100	307.00	0.00

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	占基金资产净值比例(%)
1	002532	天山铝业	202,300.00	2,170,679.00	0.64
2	002558	巨人网络	69,400.00	1,912,664.00	0.56
3	688525	佰维存储	3,710.00	1,835,448.30	0.54
4	000933	神火股份	72,500.00	1,537,000.00	0.45
5	603986	兆易创新	1,800.00	1,467,000.00	0.43
6	601168	西部矿业	48,200.00	1,308,148.00	0.38
7	600150	中国船舶	36,454.00	1,231,780.66	0.36
8	000685	中山公用	110,000.00	1,227,600.00	0.36
9	000426	兴业银锡	36,900.00	1,216,224.00	0.36
10	601061	中信金属	105,300.00	1,134,081.00	0.33
11	688327	云从科技	87,869.00	1,094,847.74	0.32
12	600233	圆通速递	64,700.00	1,019,025.00	0.30

13	600487	亨通光电	9,200.00	1,005,928.00	0.30
14	301308	江波龙	1,400.00	985,320.00	0.29
15	000657	中钨高新	10,200.00	976,344.00	0.29
16	300590	移为通信	62,600.00	898,310.00	0.26
17	002154	报喜鸟	242,800.00	864,368.00	0.25
18	601231	环旭电子	26,100.00	845,640.00	0.25
19	688802	沐曦股份	1,032.00	793,494.48	0.23
20	002353	杰瑞股份	5,000.00	762,500.00	0.22
21	601225	陕西煤业	36,900.00	750,915.00	0.22
22	002111	威海广泰	82,400.00	741,600.00	0.22
23	001218	丽臣实业	33,520.00	739,451.20	0.22
24	688059	华锐精密	3,600.00	718,956.00	0.21
25	002396	星网锐捷	35,130.00	673,442.10	0.20
26	600309	万华化学	7,400.00	506,234.00	0.15
27	603317	天味食品	38,600.00	502,186.00	0.15
28	605117	德业股份	4,660.00	494,798.80	0.15
29	601600	中国铝业	58,400.00	480,048.00	0.14
30	300750	宁德时代	1,200.00	471,612.00	0.14
31	600577	精达股份	47,900.00	468,462.00	0.14
32	002249	大洋电机	60,700.00	455,250.00	0.13
33	603588	高能环境	23,500.00	451,200.00	0.13
34	002463	沪电股份	2,900.00	443,120.00	0.13
35	002400	省广集团	69,000.00	435,390.00	0.13
36	688372	伟测科技	2,200.00	409,200.00	0.12
37	000792	盐湖股份	13,500.00	407,565.00	0.12
38	002956	西麦食品	18,200.00	377,832.00	0.11
39	300970	华绿生物	20,240.00	369,987.20	0.11
40	000676	智度股份	72,300.00	369,453.00	0.11
41	002384	东山精密	1,300.00	341,055.00	0.10
42	600211	西藏药业	9,100.00	340,249.00	0.10
43	002838	道恩股份	10,700.00	327,634.00	0.10
44	001287	中电港	10,500.00	327,075.00	0.10
45	300866	安克创新	3,116.00	325,622.00	0.10
46	688388	嘉元科技	7,300.00	321,200.00	0.09
47	000650	仁和药业	62,300.00	317,107.00	0.09
48	600026	中远海能	17,200.00	308,568.00	0.09
49	002922	伊戈尔	9,400.00	308,320.00	0.09
50	600887	伊利股份	12,700.00	304,292.00	0.09
51	002222	福晶科技	3,200.00	295,296.00	0.09
52	600480	凌云股份	34,600.00	287,526.00	0.08
53	603118	共进股份	23,300.00	282,163.00	0.08
54	603083	剑桥科技	1,100.00	280,357.00	0.08
55	002170	芭田股份	25,500.00	276,930.00	0.08

56	000988	华工科技	1,500.00	276,915.00	0.08
57	301666	大普微	593.00	274,754.69	0.08
58	300098	高新兴	55,600.00	255,204.00	0.08
59	300573	兴齐眼药	6,203.00	252,834.28	0.07
60	688208	道通科技	10,000.00	251,900.00	0.07
61	000977	浪潮信息	3,400.00	238,000.00	0.07
62	603013	亚普股份	14,800.00	233,692.00	0.07
63	300184	力源信息	13,300.00	233,415.00	0.07
64	002006	精工科技	15,400.00	226,534.00	0.07
65	000555	神州信息	21,900.00	225,570.00	0.07
66	000338	潍柴动力	8,200.00	223,450.00	0.07
67	688257	新锐股份	2,100.00	213,990.00	0.06
68	300415	伊之密	10,700.00	213,037.00	0.06
69	002043	兔宝宝	18,900.00	209,412.00	0.06
70	600508	上海能源	26,400.00	194,568.00	0.06
71	300394	天孚通信	627.00	189,780.36	0.06
72	603556	海兴电力	8,500.00	187,000.00	0.06
73	688486	龙迅股份	2,800.00	178,024.00	0.05
74	000612	焦作万方	16,600.00	175,794.00	0.05
75	000543	皖能电力	22,800.00	172,596.00	0.05
76	002063	远光软件	33,300.00	169,830.00	0.05
77	600089	特变电工	7,300.00	164,250.00	0.05
78	300738	奥飞数据	8,000.00	161,760.00	0.05
79	688559	海目星	1,900.00	159,448.00	0.05
80	001248	华润新能源	15,643.00	158,150.73	0.05
81	688781	视涯科技	3,733.00	157,383.28	0.05
82	600183	生益科技	900.00	156,060.00	0.05
83	688808	联讯仪器	96.00	152,095.68	0.04
84	000603	盛达资源	6,500.00	150,150.00	0.04
85	600389	江山股份	7,500.00	146,400.00	0.04
86	300045	华力创通	8,000.00	137,920.00	0.04
87	600867	通化东宝	16,900.00	135,876.00	0.04
88	000581	威孚高科	7,900.00	134,458.00	0.04
89	601088	中国神华	3,400.00	132,736.00	0.04
90	600196	复星医药	5,900.00	132,573.00	0.04
91	688545	兴福电子	994.00	132,261.64	0.04
92	002338	奥普光电	2,300.00	131,560.00	0.04
93	603045	福达合金	1,800.00	128,502.00	0.04
94	300693	盛弘股份	2,600.00	126,750.00	0.04
95	603279	景津装备	9,800.00	117,600.00	0.03
96	000686	东北证券	11,800.00	99,120.00	0.03
97	600361	创新新材	25,900.00	93,240.00	0.03
98	688008	澜起科技	300.00	92,970.00	0.03

99	600875	东方电气	3,200.00	92,064.00	0.03
100	000923	河钢资源	7,400.00	91,834.00	0.03
101	688262	国芯科技	2,100.00	90,783.00	0.03
102	688818	电科蓝天	1,239.00	86,903.46	0.03
103	002484	江海股份	800.00	84,000.00	0.02
104	688820	盛合晶微	591.00	83,620.59	0.02
105	000408	藏格矿业	1,200.00	83,184.00	0.02
106	688503	聚和材料	600.00	79,620.00	0.02
107	600388	龙净环保	5,400.00	78,570.00	0.02
108	001914	招商积余	9,400.00	76,704.00	0.02
109	601311	骆驼股份	9,200.00	71,668.00	0.02
110	002701	奥瑞金	16,600.00	70,716.00	0.02
111	000902	新洋丰	6,100.00	70,516.00	0.02
112	688797	臻宝科技	140.00	65,613.80	0.02
113	002518	科士达	1,200.00	64,308.00	0.02
114	301682	宏明电子	381.00	60,982.86	0.02
115	301589	诺瓦星云	400.00	59,592.00	0.02
116	002493	荣盛石化	5,500.00	59,125.00	0.02
117	600478	科力远	11,300.00	56,952.00	0.02
118	688612	威迈斯	1,900.00	56,221.00	0.02
119	000807	云铝股份	2,500.00	55,350.00	0.02
120	688712	北芯生命	1,500.00	53,880.00	0.02
121	301631	壹连科技	700.00	50,302.00	0.01
122	601208	东材科技	700.00	49,553.00	0.01
123	001399	惠科股份	1,758.00	48,749.34	0.01
124	601877	正泰电器	1,900.00	47,633.00	0.01
125	688700	东威科技	500.00	44,700.00	0.01
126	600845	宝信软件	2,600.00	43,238.00	0.01
127	688785	恒运昌	93.00	43,072.95	0.01
128	300776	帝尔激光	200.00	42,992.00	0.01
129	688813	泰金新能	234.00	40,269.06	0.01
130	688635	长进光子	128.00	39,448.32	0.01
131	002315	焦点科技	1,670.00	38,877.60	0.01
132	300008	天海防务	6,300.00	38,178.00	0.01
133	300034	钢研高纳	2,200.00	37,708.00	0.01
134	603124	江南新材	200.00	37,396.00	0.01
135	301029	怡合达	1,300.00	35,113.00	0.01
136	601636	旗滨集团	3,400.00	34,782.00	0.01
137	300770	新媒股份	1,100.00	34,639.00	0.01
138	001257	盛龙股份	1,648.00	34,179.52	0.01
139	000534	万泽股份	1,200.00	32,832.00	0.01
140	002270	华明装备	1,600.00	30,160.00	0.01
141	600933	爱柯迪	2,000.00	29,560.00	0.01

142	002048	宁波华翔	1,200.00	27,600.00	0.01
143	300773	拉卡拉	1,800.00	27,540.00	0.01
144	001339	智微智能	260.00	26,592.80	0.01
145	600482	中国动力	700.00	22,960.00	0.01
146	601360	三六零	2,600.00	22,594.00	0.01
147	603459	红板科技	254.00	21,417.28	0.01
148	001227	兰州银行	10,500.00	21,000.00	0.01
149	600584	长电科技	200.00	20,710.00	0.01
150	300450	先导智能	500.00	20,360.00	0.01
151	688811	有研复材	834.00	20,124.42	0.01
152	300841	康华生物	400.00	19,024.00	0.01
153	600654	中安科	7,100.00	18,886.00	0.01
154	301696	三瑞智能	216.00	18,748.80	0.01
155	600640	国脉文化	1,900.00	18,373.00	0.01
156	603629	利通电子	100.00	17,881.00	0.01
157	688478	晶升股份	200.00	17,710.00	0.01
158	600416	湘电股份	1,700.00	16,660.00	0.00
159	603612	索通发展	900.00	16,317.00	0.00
160	600037	歌华有线	2,600.00	16,302.00	0.00
161	688045	必易微	200.00	16,156.00	0.00
162	301669	高特电子	546.00	15,506.40	0.00
163	301687	新广益	195.00	15,167.10	0.00
164	301531	春光集团	290.00	14,952.40	0.00
165	300772	运达股份	1,200.00	14,760.00	0.00
166	301599	理奇智能	433.00	14,059.51	0.00
167	600694	大商股份	1,041.00	13,772.43	0.00
168	301680	固德电材	117.00	13,122.72	0.00
169	600572	康恩贝	3,300.00	12,936.00	0.00
170	001365	天海电子	408.00	12,774.48	0.00
171	000930	中粮科技	2,800.00	11,900.00	0.00
172	001393	维通利	289.00	11,268.11	0.00
173	601077	渝农商行	1,800.00	10,998.00	0.00
174	600861	北京人力	900.00	10,980.00	0.00
175	301683	慧谷新材	90.00	10,959.30	0.00
176	600649	城投控股	3,008.00	10,377.60	0.00
177	603407	长裕集团	137.00	10,064.02	0.00
178	002925	盈趣科技	400.00	9,864.00	0.00
179	001237	惠康科技	166.00	9,750.84	0.00
180	601456	国联民生	1,100.00	9,724.00	0.00
181	600827	百联股份	1,300.00	9,633.00	0.00
182	688816	易思维	164.00	9,364.40	0.00
183	301602	超研股份	658.00	9,040.92	0.00
184	300820	英杰电气	100.00	9,023.00	0.00

185	688779	五矿新能	1,100.00	8,921.00	0.00
186	002167	东方锆业	400.00	8,828.00	0.00
187	600872	中炬高新	500.00	8,680.00	0.00
188	600755	厦门国贸	1,600.00	8,672.00	0.00
189	600683	京投发展	700.00	8,050.00	0.00
190	600057	厦门象屿	1,400.00	7,588.00	0.00
191	000156	华数传媒	1,200.00	7,572.00	0.00
192	601138	工业富联	100.00	7,215.00	0.00
193	301513	尚水智能	138.00	7,032.48	0.00
194	601857	中国石油	800.00	6,944.00	0.00
195	000589	贵州轮胎	1,700.00	6,902.00	0.00
196	002027	分众传媒	1,400.00	6,776.00	0.00
197	601698	中国卫通	200.00	6,050.00	0.00
198	300682	朗新科技	600.00	5,940.00	0.00
199	002385	大北农	2,100.00	5,796.00	0.00
200	688516	奥特维	100.00	5,739.00	0.00
201	601601	中国太保	200.00	5,704.00	0.00
202	688522	纳睿雷达	280.00	5,605.60	0.00
203	002837	英维克	70.00	5,569.20	0.00
204	605098	行动教育	100.00	5,416.00	0.00
205	301608	博实结	100.00	5,026.00	0.00
206	603435	嘉德利	104.00	4,857.84	0.00
207	000090	天健集团	1,600.00	4,816.00	0.00
208	002936	郑州银行	2,700.00	4,455.00	0.00
209	600050	中国联通	1,100.00	4,400.00	0.00
210	300365	恒华科技	900.00	4,122.00	0.00
211	300499	高澜股份	100.00	3,870.00	0.00
212	601872	招商轮船	220.00	3,865.40	0.00
213	002148	北纬科技	600.00	3,486.00	0.00
214	688348	昱能科技	100.00	3,478.00	0.00
215	300492	华图山鼎	100.00	3,435.00	0.00
216	600551	时代出版	500.00	3,325.00	0.00
217	600795	国电电力	700.00	3,269.00	0.00
218	600096	云天化	100.00	3,040.00	0.00
219	603296	华勤技术	40.00	2,970.80	0.00
220	000560	我爱我家	1,400.00	2,898.00	0.00
221	002469	三维化学	500.00	2,860.00	0.00
222	603352	至信股份	112.00	2,858.24	0.00
223	605138	盛泰集团	500.00	2,760.00	0.00
224	300777	中简科技	100.00	2,628.00	0.00
225	300696	爱乐达	100.00	2,603.00	0.00
226	600713	南京医药	500.00	2,500.00	0.00
227	300074	华平股份	700.00	2,380.00	0.00

228	603293	埃泰克	69.00	2,341.17	0.00
229	002595	豪迈科技	50.00	2,330.00	0.00
230	000403	派林生物	260.00	2,285.40	0.00
231	001312	福恩股份	134.00	2,248.52	0.00
232	002534	西子洁能	100.00	1,855.00	0.00
233	603866	桃李面包	500.00	1,840.00	0.00
234	603966	法兰泰克	219.00	1,784.85	0.00
235	600252	中恒集团	1,000.00	1,760.00	0.00
236	603185	弘元绿能	100.00	1,669.00	0.00
237	600079	ST 人福	100.00	1,644.00	0.00
238	002372	伟星新材	200.00	1,638.00	0.00
239	603284	林平发展	46.00	1,604.02	0.00
240	600420	国药现代	200.00	1,590.00	0.00
241	001220	世盟股份	57.00	1,583.46	0.00
242	002758	浙农股份	200.00	1,580.00	0.00
243	002023	海特高新	100.00	1,296.00	0.00
244	600728	佳都科技	300.00	1,278.00	0.00
245	300251	光线传媒	100.00	1,109.00	0.00
246	300369	绿盟科技	200.00	1,088.00	0.00
247	300595	欧普康视	100.00	1,053.00	0.00
248	601801	皖新传媒	200.00	986.00	0.00
249	000410	沈阳机床	200.00	928.00	0.00
250	002387	维信诺	100.00	900.00	0.00
251	601158	重庆水务	200.00	772.00	0.00
252	002546	新联电子	100.00	728.00	0.00
253	601901	方正证券	100.00	720.00	0.00
254	002373	千方科技	100.00	718.00	0.00
255	600661	昂立教育	100.00	691.00	0.00
256	601568	北元化工	200.00	680.00	0.00
257	601319	中国人保	100.00	676.00	0.00
258	000401	金隅冀东	200.00	668.00	0.00
259	002228	合兴包装	200.00	588.00	0.00
260	300168	万达信息	100.00	459.00	0.00
261	601333	广深铁路	100.00	275.00	0.00
262	002958	青农商行	100.00	274.00	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	688525	佰维存储	15,641,167.99	3.90
2	002558	巨人网络	11,521,202.00	2.87
3	000426	兴业银锡	11,122,656.00	2.77
4	300857	协创数据	10,074,020.60	2.51
5	002271	东方雨虹	10,002,038.04	2.49
6	002532	天山铝业	9,789,560.00	2.44
7	600499	科达制造	9,758,376.00	2.43
8	000933	神火股份	9,749,768.00	2.43
9	601233	桐昆股份	9,376,710.00	2.34
10	603816	顾家家居	9,325,077.72	2.32
11	301308	江波龙	9,137,095.00	2.28
12	300054	鼎龙股份	8,894,291.66	2.22
13	300604	长川科技	8,777,500.12	2.19
14	300223	北京君正	8,693,980.00	2.17
15	603699	纽威股份	8,281,500.00	2.06
16	603345	安井食品	8,118,476.00	2.02
17	600487	亨通光电	8,076,812.00	2.01
18	002603	以岭药业	7,976,026.80	1.99
19	300450	先导智能	7,909,280.00	1.97
20	601168	西部矿业	7,744,519.00	1.93

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	688525	佰维存储	18,915,597.61	4.72
2	600487	亨通光电	13,292,483.57	3.31
3	301308	江波龙	13,125,238.00	3.27
4	002008	大族激光	11,934,879.00	2.98
5	600096	云天化	11,268,004.00	2.81
6	601168	西部矿业	11,056,580.00	2.76
7	603659	璞泰来	10,829,010.00	2.70
8	300604	长川科技	10,672,938.00	2.66
9	000933	神火股份	10,657,767.00	2.66
10	600549	厦门钨业	10,381,313.00	2.59
11	000426	兴业银锡	9,907,397.94	2.47
12	002281	光迅科技	9,895,018.86	2.47
13	000783	长江证券	9,768,754.00	2.44
14	600988	赤峰黄金	9,451,313.00	2.36
15	002558	巨人网络	9,334,066.00	2.33

16	600909	华安证券	9,326,265.00	2.32
17	300450	先导智能	9,163,179.00	2.28
18	603444	吉比特	9,040,330.60	2.25
19	300373	扬杰科技	9,025,493.08	2.25
20	300857	协创数据	8,896,023.00	2.22
21	002156	通富微电	8,842,422.00	2.20
22	002436	兴森科技	8,735,805.63	2.18
23	002532	天山铝业	8,408,214.00	2.10
24	600166	福田汽车	8,375,956.00	2.09
25	000060	中金岭南	8,284,823.00	2.07

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	1,361,034,182.76
卖出股票的收入（成交）总额	1,479,850,569.99

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	12,279,079.40	3.61
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,279,079.40	3.61

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	019827	26 国债 01	122,000	12,279,079.40	3.61

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京东方雨虹防水技术股份有限公司在报告编制前一年受到深圳证券交易所的通报批评。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券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约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	150,547.16
2	应收清算款	9,761,633.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	407,656.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,319,836.99

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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
博时中证 500 指数增强 A	9,612	13,148.47	305,655.60	0.24%	126,077,464.98	99.76%
博时中证 500 指数增强 C	7,435	6,302.84	540,171.22	1.15%	46,321,445.76	98.85%
合计	16,908	10,246.32	845,826.82	0.49%	172,398,910.74	99.51%

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	173,037.91	0.14%
	博时中证 500 指数增强 C	11,443.75	0.02%
	合计	184,481.66	0.11%

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	164,239,613.26	74,739,827.69
本报告期基金总申购份额	29,565,989.98	28,736,311.61
减：本报告期基金总赎回份额	67,422,482.66	56,614,522.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,383,120.58	46,861,616.98

§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

基金管理人于 2026 年 02 月 14 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生代任公司首席信息官，王德英先生离任公司副总经理、公司首席信息官。

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。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

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

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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	
方正证券	1	1,077,734,846.05	37.96%	221,911.07	37.96%	-
中信建投	1	504,935,959.41	17.79%	103,969.98	17.79%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	355,149,127.21	12.51%	73,139.13	12.51%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	147,544,189.59	5.20%	30,390.38	5.20%	-
广发证券	2	459,261,902.67	16.18%	94,570.83	16.18%	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	5	122,001,050.76	4.30%	25,124.20	4.30%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	6	172,216,588.23	6.07%	35,462.19	6.07%	增加 1 个
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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) 本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服

务协议。

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		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
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	12,210,928.00	100.00%	3,361,000.00	28.34%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	8,500,000.00	71.66%	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	2026-06-26
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 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	2026-06-26

3	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
4	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	2026-05-13
5	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
6	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2026 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	2026-04-22
7	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（2025 年度）	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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	2026-03-31
9	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
10	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
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-20260124	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
12	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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	2026-01-22

§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
二〇二六年八月三十一日