

博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年中期报告 2020 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：二〇二〇年八月三十一日

§ 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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 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	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43

7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 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	426,372,226.48 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	309,124,881.20 份	117,247,345.28 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，包括（一）股票投资策略、（二）债券投资策略、（三）股指期货投资策略、（四）权证投资策略、（五）融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	本基金的标的指数为：中证 500 指数。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)×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	孙麒麟	许俊
	联系电话	0755-83169999	010-66594319
	电子邮箱	service@bosera.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594942

注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	江向阳	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 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	41,207,322.72	19,513,296.07
本期利润	54,720,473.58	26,389,148.17
加权平均基金份额本期利润	0.1879	0.1664
本期加权平均净值利润率	17.39%	15.57%
本期基金份额净值增长率	18.08%	17.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 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	52,561,331.92	18,791,447.15
期末可供分配基金份额利润	0.1700	0.1603
期末基金资产净值	376,546,222.68	141,577,543.60
期末基金份额净值	1.2181	1.2075
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 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	21.81%	23.35%

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

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于

所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	11.51%	0.85%	8.04%	0.84%	3.47%	0.01%
过去三个月	21.81%	1.07%	15.47%	1.08%	6.34%	-0.01%
过去六个月	18.08%	1.70%	10.84%	1.70%	7.24%	0.00%
过去一年	39.15%	1.38%	17.63%	1.39%	21.52%	-0.01%
自基金合同生效起至今	21.81%	1.43%	-8.80%	1.43%	30.61%	0.00%

博时中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	11.46%	0.85%	8.04%	0.84%	3.42%	0.01%
过去三个月	21.69%	1.07%	15.47%	1.08%	6.22%	-0.01%
过去六个月	17.84%	1.70%	10.84%	1.70%	7.00%	0.00%
过去一年	38.59%	1.38%	17.63%	1.39%	20.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	23.35%	1.47%	-3.65%	1.48%	27.00%	-0.01%

注：博时中证 500 指数增强 C 类自 2018 年 4 月 3 日起有份额。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

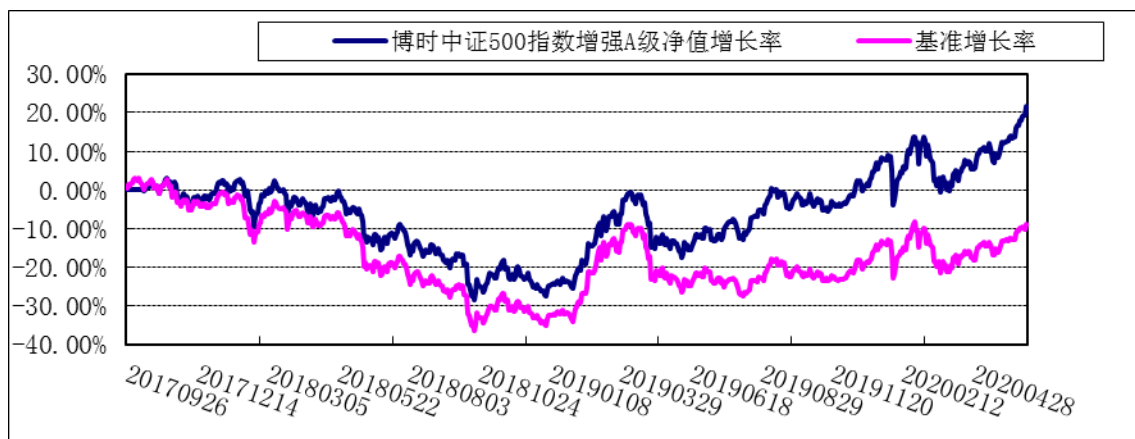
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

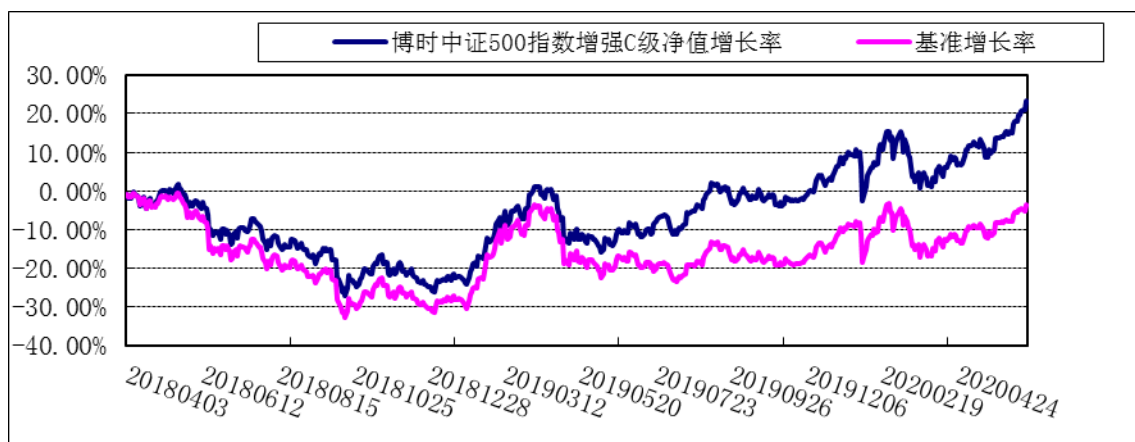
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 9 月 26 日至 2020 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”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 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 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债

券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获 “中国年度最佳 CEO” (Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang)，博时基金(国际)有限公司荣获 “香港最佳中资基金公司” (Winner, Hong Kong Best China Fund House)，博时信用债基金荣获 “中国在岸人民币债券最佳业绩 (5 年)” (Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund)。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获 “七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星 “2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报 “开放 普惠 科技” 2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获 “2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获 “2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

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		
桂征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2017-09-26	-	10.9	桂征辉先生，硕士。2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日一至今)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日一至今)、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资

					基金(2016 年 5 月 20 日一至今)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日一至今)的基金经理。
刘玉强	基金经理助理	2020-02-17	-	5.0	2015 年 7 月硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任指数与量化投资部研究员, 现任指数与量化投资部基金经理助理。

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 93 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

2020 年上半年, A 股市场先抑后扬, 最终收于 2980 点左右。风格方面, 大中小盘中成长均好于价值。行业方面消费者服务、食品饮料、医药、电子等行业大幅跑赢市场, 建筑、纺织服装、煤炭等周期行业表现落后。本基金利用数量化手段对组合进行管理, 严格控制与指数跟踪偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日,本基金博时中证 500A 类基金份额净值为 1.2181 元,份额累计净值为 1.2181 元,本基金博时中证 500C 类基金份额净值为 1.2075 元,份额累计净值为 1.2075 元。报告期内,本基金博时中证 500A 类基金份额净值增长率为 18.08%,本基金博时中证 500C 类基金份额净值增长率为 17.84%,同期业绩基准增长率 10.84%。

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 2020 年下半年,宏观层面,全球范围复工复产正在进行,经济衰退风险继续上升,美国国内骚乱频起,不确定性事件增多。随着美国大选临近,中美关系恶化的概率依然很大。国内经济数据短期有所好转,货币政策重心从宽货币转向宽信用,北上资金持续流入,流动性总体宽裕,投资者情绪比较稳定。

结合技术面和资金的情况看,预计 A 股指数整体维持震荡格局,建议保持谨慎,重视选股,积极把握结构性机会。建议以抗风性能力更强的内需核心资产为主线,保持对医药、大消费的基础性配置,增配受益于疫情后的内需恢复的可选消费行业,包括新能源汽车、家电等。适当提升科技股板块的仓位,如消费电子、云计算等,对科技方向长期看好。但仍需关注中美关系恶化,疫情反复影响程度高于预期的风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,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副总经理、督察长、投资总监、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有 5 年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;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等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。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,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,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签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	34,727,659.53	23,092,397.15
结算备付金		11,720,867.34	2,803,577.84
存出保证金		621,355.68	109,802.81
交易性金融资产	6.4.3.2	479,162,320.15	441,167,502.88
其中：股票投资		478,651,444.93	436,538,727.28
基金投资		-	-
债券投资		510,875.22	4,628,775.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	12,837.60
应收利息	6.4.3.5	8,540.23	110,783.42
应收股利		-	-
应收申购款		6,161,983.83	1,394,396.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		532,402,726.76	468,691,297.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
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		-	-
应付证券清算款		7,579,617.05	-
应付赎回款		4,500,560.42	4,004,592.38
应付管理人报酬		414,697.12	392,983.08
应付托管费		82,939.43	78,596.62
应付销售服务费		49,509.23	58,114.95
应付交易费用	6.4.3.7	1,322,519.91	734,616.01
应交税费		16,106.47	30,523.16
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	313,010.85	221,810.96
负债合计		14,278,960.48	5,521,237.16
所有者权益：			

实收基金	6.4.3.9	426,372,226.48	450,012,178.76
未分配利润	6.4.3.10	91,751,539.80	13,157,882.06
所有者权益合计		518,123,766.28	463,170,060.82
负债和所有者权益总计		532,402,726.76	468,691,297.98

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 426,372,226.48 份。其中 A 类基金份额净值 1.2181 元，基金份额总额 309,124,881.20 份；C 类基金份额净值 1.2075 元，基金份额总额 117,247,345.28 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至2020 年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年6月30日
一、收入		88,743,553.17	30,695,526.01
1. 利息收入		175,296.45	67,340.15
其中：存款利息收入	6.4.3.11	170,266.71	67,149.93
债券利息收入		5,029.74	190.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		68,035,243.19	17,343,881.37
其中：股票投资收益	6.4.3.12	63,124,639.50	15,780,019.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	146,616.73	57,320.32
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	479,223.30	6,679.61
股利收益	6.4.3.15	4,284,763.66	1,499,861.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	20,389,002.96	13,217,540.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	144,010.57	66,763.82
减：二、费用		7,633,931.42	2,347,192.54
1. 管理人报酬		2,418,120.07	913,690.78
2. 托管费		483,623.98	182,738.19
3. 销售服务费		336,413.55	78,585.49
4. 交易费用	6.4.3.18	4,197,998.80	993,708.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		1,726.40	24.07
7. 其他费用	6.4.3.19	196,048.62	178,445.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		81,109,621.75	28,348,333.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		81,109,621.75	28,348,333.47

6.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	450,012,178.76	13,157,882.06	463,170,060.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	81,109,621.75	81,109,621.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-23,639,952.28	-2,515,964.01	-26,155,916.29
其中：1. 基金申购款	401,348,574.00	28,278,932.24	429,627,506.24
2. 基金赎回款	-424,988,526.28	-30,794,896.25	-455,783,422.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	426,372,226.48	91,751,539.80	518,123,766.28
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	197,411,555.48	-52,008,797.64	145,402,757.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,348,333.47	28,348,333.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	42,903,353.75	-6,531,543.80	36,371,809.95
其中：1. 基金申购款	165,010,136.94	-18,718,753.09	146,291,383.85

2. 基金赎回款	-122, 106, 783. 19	12, 187, 209. 29	-109, 919, 573. 90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	240, 314, 909. 23	-30, 192, 007. 97	210, 122, 901. 26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年

12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	34,727,659.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	34,727,659.53

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	432,925,090.03	478,651,444.93	45,726,354.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	345,600.00	510,875.22
	银行间市场	-	-
	合计	345,600.00	510,875.22
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	433,270,690.03	479,162,320.15	45,891,630.12

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,577,360.00	-	-	-
---股指期货	4,577,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,577,360.00	-	-	-

注 1: 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资, 净额为 0。在当日无负债结算制度下, 结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益, 则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2020 年 06 月 30 日, 本基金持有的股指期货合约情况如下:

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2007	中证 500 股指期货 2007 合约	2	2,319,760.00	122,720.00
IF2007	沪深 300 期货 2007 合约	2	2,470,800.00	90,480.00
减: 可抵销期货暂收款		-	-	213,200.00
股指期货投资净额		-	-	-

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金未持有的股指期货合约

注 2: 买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,255.08
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	5,147.86
应收债券利息	96.29
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	41.00
合计	8,540.23

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,322,519.91
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,322,519.91

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	3,503.25
应付证券出借违约金	—
其他应付款	—
应付指数使用费	100,000.00
预提费用	209,507.60
合计	313,010.85

6.4.3.9 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	297,003,514.86	297,003,514.86
本期申购	254,065,659.61	254,065,659.61
本期赎回（以“-”号填列）	-241,944,293.27	-241,944,293.27
本期末	309,124,881.20	309,124,881.20

博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	153,008,663.90	153,008,663.90
本期申购	147,282,914.39	147,282,914.39
本期赎回（以“-”号填列）	-183,044,233.01	-183,044,233.01
本期末	117,247,345.28	117,247,345.28

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 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	9,173,000.97	208,617.93	9,381,618.90
本期利润	41,207,322.72	13,513,150.86	54,720,473.58
本期基金份额交易产生的变动数	2,181,008.23	1,138,240.77	3,319,249.00
其中：基金申购款	23,836,352.32	-4,072,200.27	19,764,152.05
基金赎回款	-21,655,344.09	5,210,441.04	-16,444,903.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,561,331.92	14,860,009.56	67,421,341.48

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	3,726,545.49	49,717.67	3,776,263.16
本期利润	19,513,296.07	6,875,852.10	26,389,148.17
本期基金份额交易产生的变动数	-4,448,394.41	-1,386,818.60	-5,835,213.01
其中：基金申购款	12,620,435.54	-4,105,655.35	8,514,780.19
基金赎回款	-17,068,829.95	2,718,836.75	-14,349,993.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,791,447.15	5,538,751.17	24,330,198.32

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	116,275.93	
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	51,667.74	
其他	2,323.04	

合计	170,266.71
----	------------

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,586,880,260.25
减：卖出股票成本总额	1,523,755,620.75
买卖股票差价收入	63,124,639.50

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,443,874.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,190,138.20
减：应收利息总额	107,119.86
买卖债券差价收入	146,616.73

6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	479,223.30

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,284,763.66
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	4,284,763.66

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	20,175,802.96
——股票投资	20,010,065.14
——债券投资	165,737.82
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	213,200.00
——权证投资	-
——股指期货	213,200.00
4. 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	20,389,002.96

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	136,278.12
基金转换费收入	7,732.45
合计	144,010.57

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 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，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,197,998.80
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	4,197,998.80

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,541.02
指数使用费	100,000.00
合计	196,048.62

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	1,433,696,200.54	45.92%	539,883,387.81	71.38%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
招商证券	196,763.35	27.67%	770,693.60	100.00%

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	1,048,473.58	45.92%	527,027.26	39.85%
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	394,808.08	71.38%	159,960.87	59.68%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,418,120.07	913,690.78
其中：支付销售机构的客户维护费	497,996.69	211,892.23

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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	483,623.98	182,738.19

注：支付基金托管人中国银行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。

6.4.6.2.3 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	202,551.22	202,551.22
合计	-	202,551.22	202,551.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	55,427.00	55,427.00
合计	-	55,427.00	55,427.00

注：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 C 类按前一日基金资产净值 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：

$C \text{ 类日销售服务费} = \text{前一日 } C \text{ 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	34,727,659.53	116,275.93	27,831,938.31	59,304.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688200	华峰测控	2020-02-11	2020-08-18	首次公开发行限售	107.41	270.02	3,444.00	369,920.04	929,948.88	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-07-06	首次公开发行限售	28.21	42.01	3,153.00	88,946.13	132,457.53	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股未上市	11.33	11.33	8,337.00	94,458.21	94,458.21	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
6.4.8.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

		日								
128112	歌尔转 2	2020-06-12	2020-07-13	新债未上市	100.00	100.00	150.00	15,000.00	15,000.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%(根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定)；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600317	营口港	2020-06-22	重大事项	2.21	2020-07-08	2.43	175,300.00	369,938.00	387,413.00	-

注：本基金截至 2020 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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、监察法律部、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；监察法律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与绩效分析工作，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。

6.4.9.2 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中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持

证券占基金资产净值的比例为 0.10%(2019 年 12 月 31 日: 0.00%)。

6.4.9.3 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可随时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, 有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日, 本基金所承担的全部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(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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。

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上市公司发行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该比例限制)。

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 6.4.8。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 2020 年 6 月 30 日, 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%。

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 2020 年 6 月 30 日，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,727,659.53	-	-	-	34,727,659.53

结算备付金	11,720,867.34	-	-	-	11,720,867.34
存出保证金	621,355.68	-	-	-	621,355.68
交易性金融资产	-	-	510,875.22	478,651,444.93	479,162,320.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	8,540.23	8,540.23
应收申购款	-	-	-	6,161,983.83	6,161,983.83
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	47,069,882.55	-	510,875.22	484,821,968.99	532,402,726.76
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,500,560.42	4,500,560.42
应付证券清算款	-	-	-	7,579,617.05	7,579,617.05
应付管理人报酬	-	-	-	414,697.12	414,697.12
应付托管费	-	-	-	82,939.43	82,939.43
应付销售服务费	-	-	-	49,509.23	49,509.23
应交税费	-	-	-	16,106.47	16,106.47
应付交易费用	-	-	-	1,322,519.91	1,322,519.91
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	313,010.85	313,010.85
负债总计	-	-	-	14,278,960.48	14,278,960.48
利率敏感度缺口	47,069,882.55	-	510,875.22	470,543,008.51	518,123,766.28
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,092,397.15	-	-	-	23,092,397.15
结算备付金	2,803,577.84	-	-	-	2,803,577.84
存出保证金	109,802.81	-	-	-	109,802.81
交易性金融资产	4,628,775.60	-	-	436,538,727.28	441,167,502.88
应收证券清算款	-	-	-	12,837.60	12,837.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	110,783.42	110,783.42
应收申购款	-	-	-	1,394,396.28	1,394,396.28
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,634,553.40	-	-	438,056,744.58	468,691,297.98
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,004,592.38	4,004,592.38
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	392,983.08	392,983.08
应付托管费	-	-	-	78,596.62	78,596.62

应付销售服务费	-	-	-	58,114.95	58,114.95
应交税费	-	-	-	30,523.16	30,523.16
应付交易费用	-	-	-	734,616.01	734,616.01
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	221,810.96	221,810.96
负债总计	-	-	-	5,521,237.16	5,521,237.16
利率敏感度缺口	30,634,553.40	-	-	432,535,507.42	463,170,060.82

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值比例为 0.10%（2019 年 12 月 31 日：1.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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

		(%)		例 (%)
交易性金融资产—股票投资	478,651,444.93	92.38	436,538,727.28	94.25
交易性金融资产—债券投资	510,875.22	0.10	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
合计	479,162,320.15	92.48	436,538,727.28	94.25

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 6.4.3.3)。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)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.9.4.3.2 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,336	增加约 2,183
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,336	减少约 2,183

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 477,049,811.33 元，属于第二层次的余额为 2,112,508.82 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 425,465,762.57 元，第二层次 15,701,740.31 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及

限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	478,651,444.93	89.90
	其中：股票	478,651,444.93	89.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	510,875.22	0.10
	其中：债券	510,875.22	0.10
	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	46,448,526.87	8.72
8	其他各项资产	6,791,879.74	1.28
9	合计	532,402,726.76	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,200.00	0.00
B	采矿业	7,530,758.00	1.45

C	制造业	304,378,031.01	58.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,196,126.32	2.16
E	建筑业	7,172,531.00	1.38
F	批发和零售业	20,130,370.96	3.89
G	交通运输、仓储和邮政业	15,241,560.00	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,950,572.04	11.38
J	金融业	20,227,439.00	3.90
K	房地产业	12,643,063.60	2.44
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,017,640.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	8,153,102.00	1.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,217,770.00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	6,274,948.00	1.21
S	综合	3,509,333.00	0.68
	合计	478,651,444.93	92.38

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601799	星宇股份	64,300	8,166,100.00	1.58
2	603338	浙江鼎力	100,040	7,580,030.80	1.46
3	600862	中航高科	443,000	7,495,560.00	1.45
4	600298	安琪酵母	141,900	7,021,212.00	1.36
5	002439	启明星辰	158,948	6,686,942.36	1.29
6	002414	高德红外	219,530	6,427,838.40	1.24
7	002124	天邦股份	477,200	6,132,020.00	1.18
8	002511	中顺洁柔	274,800	6,128,040.00	1.18
9	002353	杰瑞股份	195,400	6,057,400.00	1.17
10	600845	宝信软件	101,670	6,006,663.60	1.16
11	002128	露天煤业	773,700	5,996,175.00	1.16
12	300253	卫宁健康	259,350	5,949,489.00	1.15
13	600486	扬农化工	71,300	5,882,250.00	1.14
14	002242	九阳股份	156,203	5,821,685.81	1.12
15	600167	联美控股	399,800	5,733,132.00	1.11
16	002557	洽洽食品	105,200	5,700,788.00	1.10
17	601233	桐昆股份	438,600	5,596,536.00	1.08
18	601066	中信建投	141,000	5,552,580.00	1.07
19	300618	寒锐钴业	88,100	5,463,962.00	1.05
20	000090	天健集团	777,100	5,369,761.00	1.04
21	002920	德赛西威	87,100	5,341,843.00	1.03

22	002233	塔牌集团	439,200	5,283,576.00	1.02
23	002028	思源电气	255,500	5,227,530.00	1.01
24	000807	云铝股份	1,198,800	5,226,768.00	1.01
25	600026	中远海能	797,700	5,153,142.00	0.99
26	600125	铁龙物流	921,400	5,141,412.00	0.99
27	601615	明阳智能	411,800	5,126,910.00	0.99
28	002709	天赐材料	146,200	4,940,098.00	0.95
29	002734	利民股份	327,770	4,906,716.90	0.95
30	600195	中牧股份	302,100	4,903,083.00	0.95
31	603659	璞泰来	46,900	4,831,638.00	0.93
32	300482	万孚生物	45,800	4,763,200.00	0.92
33	603444	吉比特	8,531	4,683,604.31	0.90
34	002416	爱施德	607,100	4,358,978.00	0.84
35	300418	昆仑万维	173,600	4,333,056.00	0.84
36	600201	生物股份	151,300	4,212,192.00	0.81
37	300435	中泰股份	415,400	4,066,766.00	0.78
38	000750	国海证券	923,700	4,008,858.00	0.77
39	002273	水晶光电	227,400	3,897,636.00	0.75
40	300192	科斯伍德	228,900	3,863,832.00	0.75
41	601865	福莱特	204,800	3,850,240.00	0.74
42	603233	大参林	47,268	3,839,106.96	0.74
43	002212	南洋股份	139,600	3,710,568.00	0.72
44	002697	红旗连锁	335,500	3,663,660.00	0.71
45	601966	玲珑轮胎	181,200	3,660,240.00	0.71
46	002138	顺络电子	143,800	3,587,810.00	0.69
47	002434	万里扬	413,000	3,584,840.00	0.69
48	300496	中科创达	45,400	3,527,580.00	0.68
49	300558	贝达药业	24,600	3,443,508.00	0.66
50	603983	丸美股份	39,700	3,415,391.00	0.66
51	600731	湖南海利	479,900	3,407,290.00	0.66
52	002531	天顺风能	507,300	3,033,654.00	0.59
53	601200	上海环境	252,000	3,024,000.00	0.58
54	300133	华策影视	412,200	2,988,450.00	0.58
55	002223	鱼跃医疗	80,500	2,930,200.00	0.57
56	600633	浙数文化	298,700	2,921,286.00	0.56
57	300770	新媒股份	12,900	2,885,214.00	0.56
58	000513	丽珠集团	58,400	2,803,784.00	0.54
59	002013	中航机电	354,600	2,801,340.00	0.54
60	300502	新易盛	44,240	2,792,428.80	0.54
61	601098	中南传媒	260,100	2,751,858.00	0.53
62	300010	立思辰	134,800	2,638,036.00	0.51
63	002821	凯莱英	10,800	2,624,400.00	0.51
64	300070	碧水源	317,800	2,580,536.00	0.50

65	300088	长信科技	223,900	2,507,680.00	0.48
66	000488	晨鸣纸业	507,000	2,504,580.00	0.48
67	002185	华天科技	175,700	2,377,221.00	0.46
68	601128	常熟银行	312,300	2,345,373.00	0.45
69	300115	长盈精密	102,400	2,339,840.00	0.45
70	601688	华泰证券	123,700	2,325,560.00	0.45
71	603866	桃李面包	44,900	2,284,961.00	0.44
72	603416	信捷电气	56,300	2,244,118.00	0.43
73	000581	威孚高科	104,600	2,163,128.00	0.42
74	300607	拓斯达	52,560	2,138,666.40	0.41
75	603228	景旺电子	57,400	2,019,906.00	0.39
76	600770	综艺股份	412,700	1,980,960.00	0.38
77	002174	游族网络	75,300	1,963,824.00	0.38
78	600717	天津港	444,000	1,962,480.00	0.38
79	603939	益丰药房	21,480	1,954,680.00	0.38
80	600161	天坛生物	42,600	1,931,058.00	0.37
81	300207	欣旺达	101,200	1,912,680.00	0.37
82	603786	科博达	24,300	1,831,005.00	0.35
83	600901	江苏租赁	350,000	1,823,500.00	0.35
84	600426	华鲁恒升	102,800	1,817,504.00	0.35
85	600584	长电科技	57,100	1,785,517.00	0.34
86	002019	亿帆医药	77,700	1,784,769.00	0.34
87	300009	安科生物	99,310	1,777,649.00	0.34
88	600521	华海药业	51,440	1,745,359.20	0.34
89	603707	健友股份	26,800	1,730,476.00	0.33
90	600060	海信视像	140,800	1,710,720.00	0.33
91	603882	金域医学	19,100	1,709,450.00	0.33
92	000988	华工科技	68,500	1,673,455.00	0.32
93	002624	完美世界	28,600	1,648,504.00	0.32
94	600643	爱建集团	205,700	1,635,315.00	0.32
95	002368	太极股份	37,100	1,620,899.00	0.31
96	300166	东方国信	129,900	1,612,059.00	0.31
97	002075	沙钢股份	127,400	1,592,500.00	0.31
98	002603	以岭药业	50,700	1,581,333.00	0.31
99	600216	浙江医药	81,900	1,577,394.00	0.30
100	600079	人福医药	56,800	1,546,096.00	0.30
101	002030	达安基因	56,320	1,536,409.60	0.30
102	600529	山东药玻	26,000	1,508,000.00	0.29
103	600563	法拉电子	24,400	1,507,920.00	0.29
104	603568	伟明环保	63,440	1,471,808.00	0.28
105	300731	科创新源	43,900	1,448,700.00	0.28
106	002382	蓝帆医疗	47,900	1,442,269.00	0.28
107	300497	富祥药业	72,000	1,409,040.00	0.27

108	001914	招商积余	45,800	1,407,434.00	0.27
109	002568	百润股份	30,900	1,400,388.00	0.27
110	300630	普利制药	18,900	1,397,655.00	0.27
111	000600	建投能源	271,800	1,383,462.00	0.27
112	600885	宏发股份	34,200	1,372,104.00	0.26
113	603883	老百姓	13,600	1,360,544.00	0.26
114	600325	华发股份	191,600	1,352,696.00	0.26
115	603113	金能科技	112,900	1,342,381.00	0.26
116	002661	克明面业	57,300	1,328,214.00	0.26
117	300274	阳光电源	92,100	1,325,319.00	0.26
118	300767	震安科技	19,880	1,311,086.00	0.25
119	601808	中海油服	97,200	1,277,208.00	0.25
120	600004	白云机场	83,700	1,275,588.00	0.25
121	600062	华润双鹤	96,060	1,269,913.20	0.25
122	002745	木林森	82,000	1,263,620.00	0.24
123	603605	珀莱雅	7,000	1,260,140.00	0.24
124	000970	中科三环	128,600	1,257,708.00	0.24
125	600970	中材国际	238,100	1,257,168.00	0.24
126	601021	春秋航空	35,500	1,251,020.00	0.24
127	600380	健康元	76,200	1,237,488.00	0.24
128	002803	吉宏股份	49,520	1,235,028.80	0.24
129	603501	韦尔股份	6,100	1,231,895.00	0.24
130	002640	跨境通	172,400	1,118,876.00	0.22
131	603208	江山欧派	11,420	1,112,308.00	0.21
132	002396	星网锐捷	31,400	1,109,362.00	0.21
133	000987	越秀金控	94,500	1,101,870.00	0.21
134	002156	通富微电	43,600	1,092,180.00	0.21
135	002635	安洁科技	43,800	1,090,620.00	0.21
136	600064	南京高科	110,000	1,069,200.00	0.21
137	000778	新兴铸管	304,400	1,044,092.00	0.20
138	600466	蓝光发展	193,100	1,040,809.00	0.20
139	300012	华测检测	51,500	1,017,640.00	0.20
140	600410	华胜天成	73,400	998,240.00	0.19
141	600808	马钢股份	383,900	990,462.00	0.19
142	000009	中国宝安	116,100	988,011.00	0.19
143	600132	重庆啤酒	13,500	985,500.00	0.19
144	002912	中新赛克	6,000	981,540.00	0.19
145	002078	太阳纸业	102,100	971,992.00	0.19
146	000021	深科技	43,300	945,239.00	0.18
147	002869	金溢科技	14,300	944,944.00	0.18
148	000997	新大陆	58,600	936,428.00	0.18
149	688200	华峰测控	3,444	929,948.88	0.18
150	000932	华菱钢铁	246,400	928,928.00	0.18

151	002244	滨江集团	216,000	922,320.00	0.18
152	300017	网宿科技	107,200	910,128.00	0.18
153	300007	汉威科技	53,300	881,049.00	0.17
154	000739	普洛药业	37,500	873,375.00	0.17
155	600895	张江高科	42,000	855,540.00	0.17
156	300552	万集科技	20,000	851,600.00	0.16
157	600639	浦东金桥	52,500	838,950.00	0.16
158	000898	鞍钢股份	342,000	837,900.00	0.16
159	300002	神州泰岳	134,900	835,031.00	0.16
160	603708	家家悦	16,700	822,642.00	0.16
161	002221	东华能源	89,300	784,947.00	0.15
162	002897	意华股份	22,800	780,900.00	0.15
163	000718	苏宁环球	246,400	761,376.00	0.15
164	600748	上实发展	148,500	758,835.00	0.15
165	600557	康缘药业	54,200	754,464.00	0.15
166	000999	华润三九	25,600	747,264.00	0.14
167	002390	信邦制药	162,800	742,368.00	0.14
168	000717	韶钢松山	194,600	739,480.00	0.14
169	603816	顾家家居	16,300	733,663.00	0.14
170	002797	第一创业	105,600	730,752.00	0.14
171	600126	杭钢股份	70,200	730,080.00	0.14
172	300026	红日药业	129,200	713,184.00	0.14
173	002373	千方科技	29,600	710,104.00	0.14
174	000967	盈峰环境	85,700	707,025.00	0.14
175	600511	国药股份	17,200	699,524.00	0.14
176	002312	三泰控股	153,100	696,605.00	0.13
177	300357	我武生物	11,100	690,975.00	0.13
178	002925	盈趣科技	11,800	683,692.00	0.13
179	002408	齐翔腾达	107,500	667,575.00	0.13
180	002399	海普瑞	26,600	666,064.00	0.13
181	300212	易华录	11,500	644,000.00	0.12
182	300595	欧普康视	8,900	617,126.00	0.12
183	600566	济川药业	23,800	605,948.00	0.12
184	600908	无锡银行	122,500	601,475.00	0.12
185	002555	三七互娱	12,100	566,280.00	0.11
186	601003	柳钢股份	126,300	559,509.00	0.11
187	600572	康恩贝	100,600	553,300.00	0.11
188	300462	华铭智能	24,300	551,124.00	0.11
189	600673	东阳光	78,200	540,362.00	0.10
190	601512	中新集团	46,500	534,750.00	0.10
191	300413	芒果超媒	8,200	534,640.00	0.10
192	300256	星星科技	80,700	511,638.00	0.10
193	300244	迪安诊断	14,400	508,320.00	0.10

194	603328	依顿电子	48,300	503,769.00	0.10
195	300168	万达信息	22,700	500,989.00	0.10
196	002375	亚厦股份	48,600	496,692.00	0.10
197	002241	歌尔股份	13,900	408,104.00	0.08
198	002876	三利谱	7,600	402,040.00	0.08
199	000078	海王生物	95,900	401,821.00	0.08
200	002443	金洲管道	58,800	400,428.00	0.08
201	000656	金科股份	49,000	399,840.00	0.08
202	300451	创业慧康	21,200	391,988.00	0.08
203	300454	深信服	1,900	391,324.00	0.08
204	002317	众生药业	22,700	389,532.00	0.08
205	600317	营口港	175,300	387,413.00	0.07
206	600077	宋都股份	137,700	386,937.00	0.07
207	002038	双鹭药业	30,100	385,581.00	0.07
208	000897	津滨发展	173,300	381,260.00	0.07
209	000965	天保基建	116,900	379,925.00	0.07
210	600094	大名城	63,600	378,420.00	0.07
211	002410	广联达	5,400	376,380.00	0.07
212	603359	东珠生态	22,100	369,733.00	0.07
213	002938	鹏鼎控股	7,300	365,438.00	0.07
214	601005	重庆钢铁	241,300	359,537.00	0.07
215	300686	智动力	14,800	356,088.00	0.07
216	002214	大立科技	12,600	355,068.00	0.07
217	300078	思创医惠	26,000	351,780.00	0.07
218	300659	中孚信息	5,840	350,516.80	0.07
219	600282	南钢股份	108,100	349,163.00	0.07
220	000629	攀钢钒钛	157,900	317,379.00	0.06
221	600056	中国医药	22,100	312,715.00	0.06
222	600058	五矿发展	51,300	309,852.00	0.06
223	002815	崇达技术	15,000	303,450.00	0.06
224	002589	瑞康医药	55,100	295,336.00	0.06
225	002110	三钢闽光	43,500	289,710.00	0.06
226	603079	圣达生物	9,700	287,411.00	0.06
227	603290	斯达半导	1,300	272,740.00	0.05
228	002475	立讯精密	5,250	269,587.50	0.05
229	300559	佳发教育	12,700	269,494.00	0.05
230	300271	华宇软件	9,300	262,353.00	0.05
231	603727	博迈科	14,500	257,375.00	0.05
232	000402	金融街	38,200	253,648.00	0.05
233	300476	胜宏科技	10,400	250,120.00	0.05
234	688366	昊海生科	2,711	246,809.44	0.05
235	000100	TCL 科技	39,600	245,520.00	0.05
236	002600	领益智造	23,000	244,490.00	0.05

237	603267	鸿远电子	5,640	243,930.00	0.05
238	603083	剑桥科技	6,200	243,226.00	0.05
239	600382	广东明珠	36,900	241,326.00	0.05
240	600755	厦门国贸	36,500	240,900.00	0.05
241	000725	京东方 A	51,500	240,505.00	0.05
242	002118	紫鑫药业	53,800	238,872.00	0.05
243	300383	光环新网	9,100	237,237.00	0.05
244	300738	奥飞数据	4,100	236,488.00	0.05
245	603986	兆易创新	1,000	235,910.00	0.05
246	002402	和而泰	14,400	233,424.00	0.05
247	300308	中际旭创	3,700	233,100.00	0.04
248	000825	太钢不锈	69,800	231,736.00	0.04
249	300735	光弘科技	12,420	229,149.00	0.04
250	000063	中兴通讯	5,700	228,741.00	0.04
251	600183	生益科技	7,800	228,306.00	0.04
252	000158	常山北明	21,400	223,416.00	0.04
253	600376	首开股份	37,500	219,750.00	0.04
254	300782	卓胜微	540	219,115.80	0.04
255	300603	立昂技术	7,300	214,109.00	0.04
256	002916	深南电路	1,200	201,024.00	0.04
257	600022	山东钢铁	152,500	196,725.00	0.04
258	600565	迪马股份	70,000	195,300.00	0.04
259	600649	城投控股	30,500	181,170.00	0.03
260	600266	城建发展	35,280	178,869.60	0.03
261	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.03
262	000959	首钢股份	41,200	177,160.00	0.03
263	000790	华神科技	33,443	162,198.55	0.03
264	002901	大博医疗	1,300	155,077.00	0.03
265	603189	网达软件	6,200	146,134.00	0.03
266	000813	德展健康	23,400	145,080.00	0.03
267	600782	新钢股份	35,200	143,616.00	0.03
268	000031	大悦城	27,900	142,011.00	0.03
269	688081	兴图新科	3,153	132,457.53	0.03
270	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
271	600055	万东医疗	7,400	118,474.00	0.02
272	600459	贵研铂业	3,700	110,297.00	0.02
273	600222	太龙药业	18,300	107,970.00	0.02
274	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
275	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.02
276	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
277	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
278	300059	东方财富	3,660	73,932.00	0.01
279	601975	招商南油	29,500	70,505.00	0.01

280	600496	精工钢构	14,600	48,910.00	0.01
281	300390	天华超净	2,800	39,004.00	0.01
282	600648	外高桥	2,700	38,178.00	0.01
283	002001	新和成	1,100	32,010.00	0.01
284	002839	张家港行	4,900	28,224.00	0.01
285	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
286	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
287	603138	海量数据	720	13,874.40	0.00
288	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
289	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
290	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
291	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
292	002714	牧原股份	100	8,200.00	0.00
293	300102	乾照光电	1,700	7,650.00	0.00
294	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
295	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
296	600823	世茂股份	900	4,023.00	0.00
297	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	600862	中航高科	19,226,616.32	4.15
2	002353	杰瑞股份	17,056,277.22	3.68
3	002028	思源电气	13,237,340.88	2.86
4	000400	许继电气	11,885,105.12	2.57
5	002128	露天煤业	11,522,636.78	2.49
6	000025	特力 A	11,346,565.95	2.45
7	601099	太平洋	10,522,253.00	2.27
8	600745	闻泰科技	10,466,255.12	2.26
9	000690	宝新能源	9,595,240.10	2.07
10	603338	浙江鼎力	9,530,829.18	2.06
11	603983	丸美股份	9,523,948.09	2.06
12	601799	星宇股份	9,495,702.86	2.05
13	600486	扬农化工	9,474,792.82	2.05
14	002414	高德红外	9,072,322.00	1.96
15	603866	桃李面包	8,800,460.85	1.90
16	603659	璞泰来	8,777,565.92	1.90
17	002127	南极电商	8,733,442.73	1.89
18	600291	西水股份	8,704,969.35	1.88
19	600885	宏发股份	8,581,618.38	1.85

20	002174	游族网络	8,540,314.00	1.84
----	--------	------	--------------	------

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002028	思源电气	17,395,501.26	3.76
2	600745	闻泰科技	16,905,212.00	3.65
3	600862	中航高科	14,979,115.88	3.23
4	300014	亿纬锂能	13,698,524.36	2.96
5	000400	许继电气	12,886,289.40	2.78
6	600466	蓝光发展	12,632,574.53	2.73
7	002463	沪电股份	12,366,501.00	2.67
8	000686	东北证券	12,252,994.78	2.65
9	002048	宁波华翔	11,627,833.37	2.51
10	002127	南极电商	11,613,232.63	2.51
11	000581	威孚高科	11,258,026.24	2.43
12	000848	承德露露	11,226,984.89	2.42
13	300498	温氏股份	11,196,004.00	2.42
14	000025	特力 A	11,148,333.30	2.41
15	002353	杰瑞股份	10,889,784.22	2.35
16	601099	太平洋	10,836,864.00	2.34
17	601677	明泰铝业	10,630,795.24	2.30
18	600779	水井坊	10,195,875.39	2.20
19	002371	北方华创	9,825,350.55	2.12
20	600704	物产中大	9,522,168.00	2.06

注：本项的“卖出金额”均按成交金额（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	1,545,858,273.26
卖出股票的收入（成交）总额	1,586,880,260.25

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	510,875.22	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	510,875.22	0.10

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	128108	蓝帆转债	2,306	362,895.22	0.07
2	113583	益丰转债	1,000	132,980.00	0.03
3	128112	歌尔转 2	150	15,000.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2007	IF2007	2.00	2,470,800.00	90,480.00	-
IC2007	IC2007	2.00	2,319,760.00	122,720.00	-
公允价值变动总额合计					213,200.00
股指期货投资本期收益					479,223.30
股指期货投资本期公允价值变动					213,200.00

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	621,355.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,540.23
5	应收申购款	6,161,983.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,791,879.74

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债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时中证 500 指数增强 A	15,435	20,027.53	109,847,158.40	35.53%	199,277,722.80	64.47%
博时中证 500 指数增强 C	6,381	18,374.45	52,380,099.02	44.67%	64,867,246.26	55.33%
合计	21,607	19,733.06	162,227,257.42	38.05%	264,144,969.06	61.95%

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	2,234,362.22	0.72%
	博时中证 500 指数增强 C	211,450.66	0.18%
	合计	2,445,812.88	0.57%

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

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	博时中证 500 指数增强 A	>100
	博时中证 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	博时中证 500 指数增强 A	0
	博时中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

注：本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 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	297,003,514.86	153,008,663.90
本报告期基金总申购份额	254,065,659.61	147,282,914.39
减：本报告期基金总赎回份额	241,944,293.27	183,044,233.01
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	309,124,881.20	117,247,345.28

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 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》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总

经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 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》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	1,433,696,200.54	45.92%	1,048,473.58	45.92%	新增 1 个
广发证券	2	1,075,616,760.84	34.45%	786,594.72	34.45%	新增 1 个
第一创业	1	293,865,541.49	9.41%	214,902.93	9.41%	-
长江证券	1	260,818,036.23	8.35%	190,737.95	8.35%	新增 1 个
海通证券	3	58,320,870.14	1.87%	42,655.50	1.87%	新增 1 个

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	196,763.35	27.67%	-	-	-	-
广发证券	514,250.84	72.33%	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 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	2020-04-22
5	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	2020-04-17
6	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 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	2020-03-27

7	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
8	博时中证 500 指数增强型证券投资基金恢复大额 申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-21
9	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 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	2020-01-17

§ 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

- 12.1.1 中国证监会批准博时中证 500 指数增强型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 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
- 12.1.6 报告期内博时中证 500 指数增强型证券投资基金在制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阅，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
二〇二〇年八月三十一日