

博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告 2020 年 12 月 31 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：二〇二一年三月三十一日

§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。本年度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 2021 年 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66

8.6 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	66
8.7 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	67
8.8 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	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.3 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	69
§10 开放式基金份额变动	69
§11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 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
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§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	588,969,646.43 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	472,102,289.41 份	116,867,357.02 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。 （一）股票投资策略。 1、指数化投资策略。本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。 2、投资组合构建和优化。本基金将以博时数量化模型对股票的回报预测为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。 3、指数增强策略。本基金主要通过博时数量化模型对股票进行综合评定，结合风险控制模型，在控制投资组合风险预算下，对股票组合进行优化，力争获得超越业绩比较基准的回报。 4、股票组合调整。包括定期和不定期调整。

	5、存托凭证投资策略。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
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	孙麒清	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
------------	--------	--------	--------

和指标	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	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	117,575,820.31	43,252,597.55	36,131,399.18	16,748,290.15	-16,965,880.55	-3,766,003.00
本期利润	108,579,185.59	44,976,388.13	65,690,661.03	27,308,022.98	-32,815,793.61	-3,965,653.01
加权平均基金份额本期利润	0.2908	0.3246	0.2994	0.2740	-0.2392	-0.1673
本期加权平均净值利润率	23.11%	27.16%	32.54%	29.38%	-26.96%	-20.54%
本期基金份额净值增长率	33.72%	33.18%	39.99%	39.43%	-25.51%	-24.93%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	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	175,615,835.34	41,802,825.80	9,173,000.97	3,726,545.49	-42,347,845.20	-9,660,952.44
期末可供分配基金份额利润	0.3720	0.3577	0.0309	0.0244	-0.2631	-0.2651
期末基金资产净值	651,262,530.86	159,493,406.72	306,385,133.76	156,784,927.06	118,622,003.76	26,780,754.08
期末基金份额净值	1.3795	1.3647	1.0316	1.0247	0.7369	0.7349
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	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	37.95%	39.41%	3.15%	4.68%	-26.31%	-24.93%

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

1. 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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	3.35%	1.09%	2.70%	1.10%	0.65%	-0.01%
过去六个月	13.25%	1.38%	8.20%	1.38%	5.05%	0.00%
过去一年	33.72%	1.54%	19.94%	1.54%	13.78%	0.00%
过去三年	39.44%	1.45%	2.25%	1.46%	37.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	37.95%	1.42%	-1.31%	1.42%	39.26%	0.00%

2. 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	3.24%	1.09%	2.70%	1.10%	0.54%	-0.01%
过去六个月	13.02%	1.38%	8.20%	1.38%	4.82%	0.00%
过去一年	33.18%	1.54%	19.94%	1.54%	13.24%	0.00%
自基金合同生效起至今	39.41%	1.45%	4.25%	1.46%	35.16%	-0.01%

注：自 2018 年 4 月 3 日起，本基金新增 C 类新增份额。

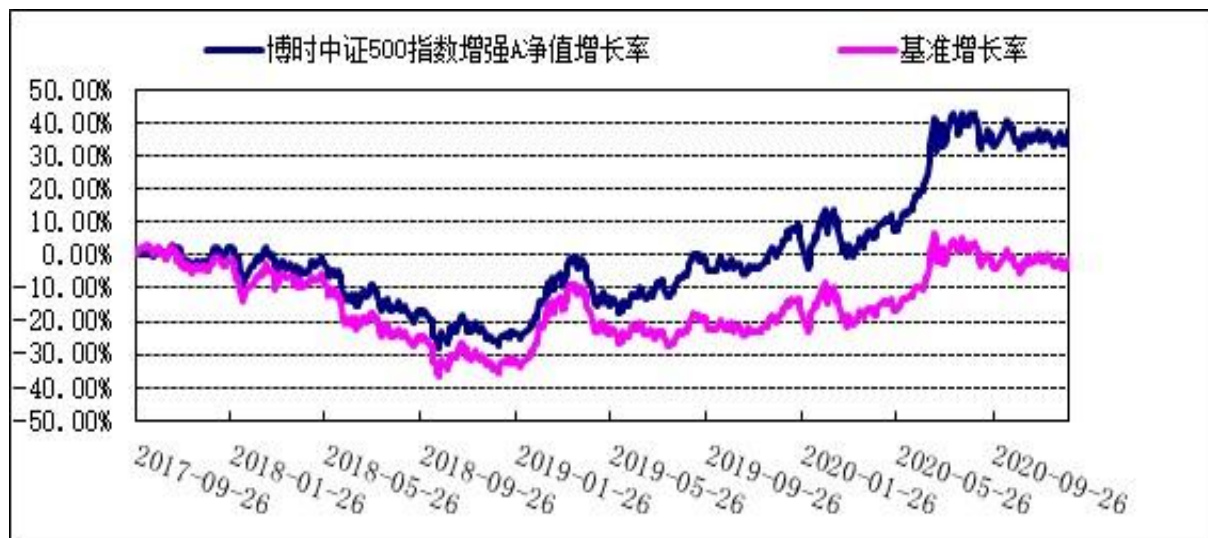
本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

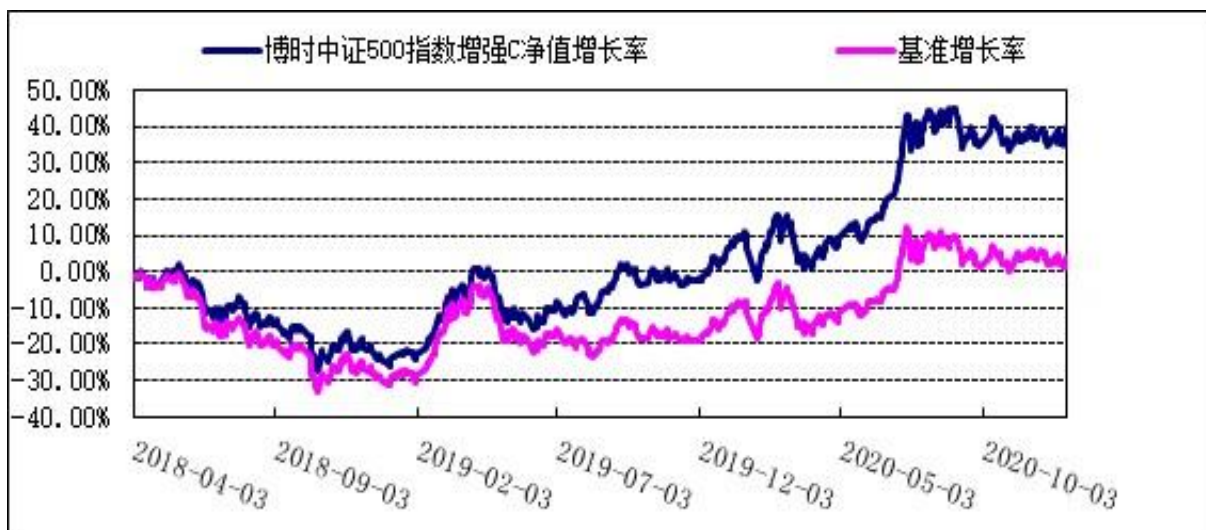
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 9 月 26 日至 2020 年 12 月 31 日)

1、博时中证 500 指数增强 A



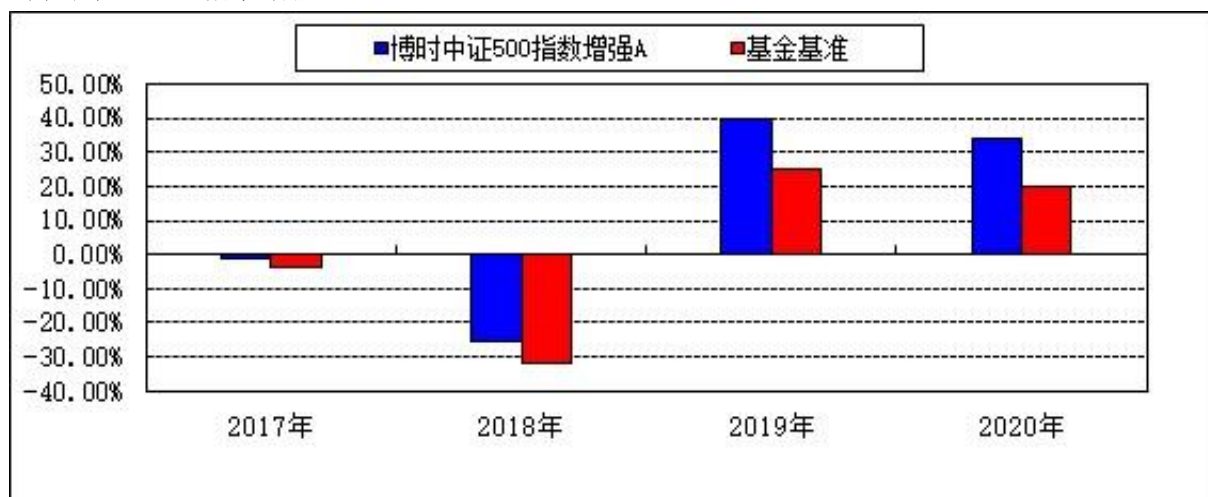
2、博时中证 500 指数增强 C



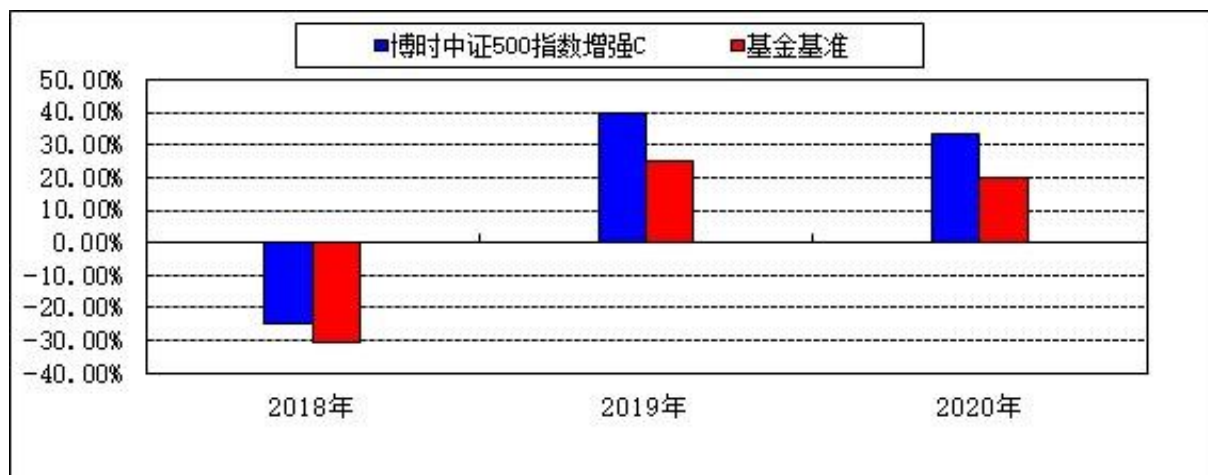
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时中证 500 指数增强 A



2、博时中证 500 指数增强 C



注：本基金的基金合同于 2017 年 9 月 26 日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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，“做投资价值的发现者”是博时的理念。截至 2020 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 246 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 13294 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 4012 亿元人民币，累计分红逾 1373 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。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2020 年 4 季末：

博时旗下权益类基金业绩表现优异，参与银河证券 2020 年业绩排名的 112 只主动权益类基金全年平均收益 32.86%，其中 28 只基金年内收益超过 50%，16 只收益超过 60%，7 只超过 70%，2 只收益超过 80%，1 只产品收益超过 104%。从业绩同类排名来看，52 只基金业绩同类排名在前 2/3，36 只基金业绩同类排名在前 1/2，8 只基金业绩同类排名前 10，1 只基金业绩同类排名第 1。

其中，博时丝路主题股票(C 类)2020 年净值增长率同类排名第 1，博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类)同类排名第 3，博时军工主题股票同类排名第 5，博时汇悦回报混合、博时新兴成长混合、博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时回报灵活配置混合、博时弘泰定期开放混合、博时丝路主题股票(A 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)同类排名均在前 1/4。

博时固定收益类基金表现同样可圈可点，参与银河证券 2020 年度业绩排名的 136 只债券基金全年平均收益 3.48%，超过中证全债及中证综合债指数的涨幅。25 只基金 2020 年全年收益超过 4%，19 只基金年内收益超过 5%，5 只基金年内收益超过 10%，2 只基金年内收益超过 20%。从相对排名来看，70 只基金 2020 年业绩同类排名前 1/2，44 只基金同类排名前 1/4，19 只基金同类排名前 1/10，12 只基金同类排名前 10，1 只基金同类排名第 1。

其中，博时安丰 18 个月定期开放债券(A 类-LOF)同类排名第 1，博时双月薪定期支付债券、博时月月薪定期支付债券同类排名第 2，博时安瑞 18 个月定期开放债券(A 类)第 4，博时信用债券、博时稳健回报债券(LOF)、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时富祥纯债债券(A 类)、博时安泰 18 个月定期开放债券(A 类)、博时裕泰纯债债券、博时裕腾纯债债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时聚盈纯债债券、博时聚源纯债债券(A 类)等产品同类排名均在前 1/10。

博时大中华亚太精选股票(QDII)(美元) (000927)、博时大中华亚太精选股票(QDII) (050015) 2020 年分别实现收益 28.68%、20.48%。博时亚洲票息收益债券(QDII)(美元)同类排名前 1/4。

指数型基金当中，参与银河证券 2020 年业绩排名的 56 只被动指数型基金全年平均收益 17.24%，对各类指数实现了有效地跟踪。

2、 其他大事件

2020 年 12 月 31 日，在中国证券业协会主办，中国期货业协会、中国证券投资基金业协会协办的第七届证券期货科学技术奖中，博时基金、金证财富《新一代投资决策支持系统》荣获证券期货科学技术奖三等奖。

2020 年 12 月，大众证券报“2020 中国基金风云榜”揭晓，博时基金获“2020 年度十大风云基金公司”，博时医疗保健行业获“2020 年度十大风云基金产品”。

2020 年 12 月 23 日，在信息时报“金狮奖”中，博时基金荣获“年度最具核心竞争力基金公司”。

2020 年 12 月 15 日，“聚中国 投未来 2021 新财富资产管理年会”在深圳举办，博时基金荣获 2020 新财富最智慧投资机构。

2020 年 12 月 11 日，由证券时报 券商中国主办的“2020 中国金融科技先锋榜”隆重揭晓，博时基金荣登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2020 年 12 月 10 日，金融界“第五届智能金融国际论坛暨 2020 金融界领航中国年度盛典”，博时基金荣获四项大奖。博时基金董事长江向阳获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金荣获“杰出年度创新基金公司奖”、“杰出年度基金公司奖”、“杰出年度海外投资基金公司奖”。

2020 年 12 月 10 日，香港中资基金业协会（HKCAMA）和彭博（Bloomberg）2020 年度“离岸中资基金大奖”中，博时国际荣膺“最佳跨境业务”大奖，“博时-东方红大中华债券基金”荣膺“最佳总回报-大中华区固定收益（1 年）”亚军。

2020 年 12 月 8 日，北京商报社主办的“数字金融 争渡未来 2020 年度北京金融论坛”在北京举办，博时基金荣获 2020 年度北京金融业十大品牌 产品创新卓越奖。

2020 年 12 月 2 日，经济观察报举办的 2020 卓越金融企业盛典举行，博时基金荣获“年度卓越

综合实力基金公司”称号。

2020 年 11 月 28 日，由 21 世纪经济报道主办的第五届财经“金帆奖”评选中，博时基金荣获“2020 年度卓越基金管理公司”。

2020 年 11 月 27 日，国际金融报“第三届 CSR 先锋论坛暨 2020 先锋奖项颁奖典礼”在北京举办，凭借在社会责任方面的贡献，博时基金荣获 2020 年度社会责任先锋案例。

2020 年 11 月 20 日，2020 第一财经金融价值榜 颁奖典礼在上海举办，博时基金获选“2020 年度第一财经金融价值榜”年度基金公司管理人。

2020 年 11 月 19 日，由思维财经&投资者网主办的思维财经投资者年会暨“金桥奖”颁奖盛典上，博时基金荣获“金桥奖 年度最具投资价值基金公司”。

2020 年 11 月，联合国负责任投资原则组织(UN PRI)发布 2020 年度签署方评估报告。博时基金在衡量公司整体 ESG 管理水平的“战略与治理”模块，获得了首批最高评价“A+”评定。

2020 年 10 月 28 日，由《中国基金报》主办的“2020 中国机构投资者峰会”在上海浦东香格里拉酒店举行。第七届中国基金业英华奖中，博时基金陈凯杨荣获“五年期纯债投资最佳基金经理”，过均荣获“五年期二级债投资最佳基金经理”，何凯荣获“三年期海外固收投资最佳基金经理”及“五年期海外固收投资最佳基金经理”。第二届中国公募基金英华奖中，博时基金荣获“2019 年度最佳营销策划案例（最佳创意）”、“2019 年度最佳社会公益实践案例”、“2019 年度最佳电商业务发展基金公司”、“2019 年度最佳创新基金产品”、“2019 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”、“2019 年度最佳指数增强基金”奖项。

2020 年 10 月 23 日，国际金融报主办的“2020 国际先锋金融机构高峰论坛暨颁奖典礼”在上海举办，博时基金董事长江向阳荣获“金融行业先锋领袖”、博时基金荣获“先锋证券投资机构”。

2020 年 10 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2020 中国金融每经峰会资本市场高峰论坛暨 2020 中国金鼎奖颁奖典礼”在上海举行，博时基金成功斩获“固收+最具人气基金公司奖”和“最具影响力基金公司-专户一对多”奖项，博时基金投资经理王晓冬荣获“最具实力权益类专户基金经理”奖项。

2020 年 9 月 22 日，由《投资时报》及标点财经研究院联合主办的“见未来 2020 第三届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典”在京举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获三项大奖。博时获评“金禧奖 2020 卓越公募基金公司”、“金禧奖 2020 优秀固收类基金团队”、“金禧奖 2020 大湾区特别贡献奖”。

2020 年 9 月 15 日，《上海证券报》第十七届“金基金”奖颁奖典礼在上海隆重举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金及子公司博时资本共荣获三项大奖。博时基金荣获 2019 年度金基金•海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资

基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。博时资本张存相荣获“金阳光·三年卓越私募基金经理（MOM 类）”奖项。

2020 年 8 月 6 日，《经济观察报》“见圳四十年---深圳经济特区成立 40 周年特别盛典”在深圳举办，博时基金荣获“致敬深圳经济特区成立四十周年卓越企业”奖项。

2020 年 7 月 9 日，新浪财经“2020 中国基金业开放与发展高峰论坛暨基金业致敬资本市场 30 周年峰会”在云端举办，届时公布了 2020 中国基金业金麒麟奖，博时基金荣获“2020 十大风云基金公司”，此外，博时基金王俊荣获“2020 最受青睐股票基金经理”奖项，博时基金赵云阳、桂征辉、王祥均荣获“2020 最受青睐指数与 ETF 基金经理”奖项。

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	2017-09-26	2020-12-23	11.5	桂征辉先生，硕士。2006 年起

	资部投资副总监/基金经理				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)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2020 年 12 月 23 日)的基金经理。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—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—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—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)的基金经理。
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2020-12-23	-	14.4	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、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。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)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)的基金经理。
刘玉强	基金经理助理	2020-02-21	-	5.5	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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 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 111 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 年全年，A 股市场震荡上行，最终收于 3473 点左右。就风格而言，大盘风格好于中小盘风格，其中沪深 300 指数上涨 27.21%，本基金跟踪的中证 500 指数则上涨了 20.87%。

本基金采用量化多因子的方法配置股票组合，在合理控制跟踪误差的基础上取得了一定的超额收益：其中 A 份额净值上涨了 33.72%，超额收益 13.9%，跟踪误差控制在 3.7% 左右，信息比率 3.48 左右。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.3795 元，份额累计净值为 1.3795 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.3647 元，份额累计净值为 1.3647 元，报告期内，本基金 A 类基金份

额净值增长率为 33.72%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 33.18%，同期业绩基准增长率为 19.94%。

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 2021 年，宏观层面，国际市场，美国经济和就业复苏乏力，但随着财政刺激法案落地，疫苗接种加快，市场的风险偏好反而会得到提升；国内市场，伴随着 11 月贸易顺差创下历史最高水平，券商分析师纷纷上调了中国 4 季度 GDP 的预期，同时，RCEP、中欧全面投资协定相继签署，体现出领导层保持中国高水平开放的决心，我们认为，2021 年将继续 2020 年下半年以来的经济复苏态势。

货币层面，央行等五部委明确两项直达实体经济货币政策工具均延期至 3 月 31 日，股市流动性自 12 月初以来边际宽松的趋势明显；在最近的国务院全体会议上，李克强总理也强调要保持宏观政策连续性、稳定性和可持续性，保持对经济恢复的必要支持力度。但从边际上看，货币政策已开始逐步回归常态，利率边际上升，未来估值的驱动力有限，盈利影响权重提升。

综合而言，2021 年 A 股市场仍将继续结构性牛市的行情，期间或有波动，但整体仍偏乐观。本基金将继续使用量化多因子模型配置股票组合，结合经济修复和货币回归常态的预期，持续重视“风格再均衡”，适当增减风格因子的暴露，并持续挖掘具有稳定选股能力的 Alpha 因子。在投资目标上，我们也将继续合理控制跟踪误差，力争获取相对应的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告。

2020 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《博时基金定向增发投资管理制度》、《衍生品投资及风险管理制度》等制度文件，修订了《科创板投资管理制度》、《黄金租赁业务管理制度》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设和完善“博时产品管理系统”、“新一代决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 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 托管人对本年度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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 23609 号

博时中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“博时中证 500 指数增强”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时中证 500 指数增强 2020 年 12

月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时中证 500 指数增强，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时中证 500 指数增强的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时中证 500 指数增强的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时中证 500 指数增强、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时中证 500 指数增强的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表

意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时中证 500 指数增强持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时中证 500 指数增强不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天

注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)

张 振 波

中国·上海市

注册会计师

2021 年 3 月 30 日

沈 兆 杰

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	35,834,890.16	23,092,397.15
结算备付金		23,958,494.86	2,803,577.84
存出保证金		2,090,999.56	109,802.81
交易性金融资产	7.4.7.2	755,837,286.57	441,167,502.88

其中：股票投资		747,826,986.57	436,538,727.28
基金投资		-	-
债券投资		8,010,300.00	4,628,775.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,245,546.69	12,837.60
应收利息	7.4.7.5	137,067.13	110,783.42
应收股利		-	-
应收申购款		832,147.32	1,394,396.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		822,936,432.29	468,691,297.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,403,290.12	-
应付赎回款		5,758,455.10	4,004,592.38
应付管理人报酬		695,034.68	392,983.08
应付托管费		139,006.91	78,596.62
应付销售服务费		57,509.59	58,114.95
应付交易费用	7.4.7.7	1,871,634.89	734,616.01
应交税费		20,478.39	30,523.16
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	235,085.03	221,810.96
负债合计		12,180,494.71	5,521,237.16
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	588,969,646.43	450,012,178.76
未分配利润	7.4.7.10	221,786,291.15	13,157,882.06
所有者权益合计		810,755,937.58	463,170,060.82
负债和所有者权益总计		822,936,432.29	468,691,297.98

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 588,969,646.43 份。其中 A 类基金份额净值 1.3795 元，基金份额总额 472,102,289.41 份；C 类基金份额净值 1.3647 元，基金份额总额 116,867,357.02 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		173,399,535.08	100,875,994.64
1.利息收入		433,234.38	255,086.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	426,173.23	254,739.56
债券利息收入		7,061.15	347.23
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）		179,668,410.90	60,352,454.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	169,919,406.29	55,031,308.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	750,740.22	132,022.51
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	3,230,679.61	2,420,621.35
股利收益	7.4.7.15	5,767,584.78	2,768,502.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-7,272,844.14	40,118,994.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	570,733.94	149,459.07
减：二、费用		19,843,961.36	7,877,310.63
1. 管理人报酬		6,330,382.78	2,941,500.78
2. 托管费		1,266,076.46	588,300.22
3. 销售服务费		662,536.27	370,757.79
4. 交易费用	7.4.7.18	11,177,935.34	3,591,145.60
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		11,633.03	8,714.39
7. 其他费用	7.4.7.19	395,397.48	376,891.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		153,555,573.72	92,998,684.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		153,555,573.72	92,998,684.01

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	153,555,573.72	153,555,573.72
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）	138,957,467.67	55,072,835.37	194,030,303.04
其中：1.基金申购款	945,630,368.83	222,647,687.30	1,168,278,056.13
2.基金赎回款	-806,672,901.16	-167,574,851.93	-974,247,753.09
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）	588,969,646.43	221,786,291.15	810,755,937.58
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	-	92,998,684.01	92,998,684.01
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）	252,600,623.28	-27,832,004.31	224,768,618.97
其中：1.基金申购款	582,809,495.30	-48,036,921.22	534,772,574.08
2.基金赎回款	-330,208,872.02	20,204,916.91	-310,003,955.11
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）	450,012,178.76	13,157,882.06	463,170,060.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 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: 孙献, 会计机构负责人: 成江

7.4 报表附注

7.4.1 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》核准, 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。

根据基金管理人博时基金管理有限公司 2018 年 3 月 24 日《博时基金管理有限公司关于博时中证 500 指数增强型证券投资基金增加基金份额类别并修改法律文件的公告》的规定, 经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案, 自 2018 年 3 月 31 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 但不从本类别基金资产中计提销售服务费(原基金份额自动转入 A 类基金份额); C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码, 分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别, 但不同基金份额类别之间不得互相转换。

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。为更好地实现投资目标, 本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为: 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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2021 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”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。

7.4.3 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基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行

调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

活期存款	35,834,890.16	23,092,397.15
定期存款	-	-
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	-	-
合计	35,834,890.16	23,092,397.15

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		729,350,623.55	747,826,986.57	18,476,363.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,008,400.00	8,010,300.00	1,900.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,008,400.00	8,010,300.00	1,900.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		737,359,023.55	755,837,286.57	18,478,263.02
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		410,822,437.52	436,538,727.28	25,716,289.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,629,238.20	4,628,775.60	-462.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,629,238.20	4,628,775.60	-462.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		415,451,675.72	441,167,502.88	25,715,827.16

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	13,991,640.00	-	-	-
股指期货	13,991,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,991,640.00	-	-	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：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 12 月 31 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
IC2101	IC2101	11	13,956,360.00	-35,280.00
减：可抵销期货暂收款				-35,280.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,921.74	6,670.96
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	11,836.23	1,881.82
应收债券利息	120,248.22	102,176.30
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	60.94	54.34
合计	137,067.13	110,783.42

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,871,634.89	734,616.01
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,871,634.89	734,616.01

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,085.03	1,810.96
应付证券出借违约金	-	-
其他应付款	-	-
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
预提费用	180,000.00	170,000.00
合计	235,085.03	221,810.96

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	297,003,514.86	297,003,514.86
本期申购	657,367,559.94	657,367,559.94
本期赎回（以“-”号填列）	-482,268,785.39	-482,268,785.39
本期末	472,102,289.41	472,102,289.41

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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	153,008,663.90	153,008,663.90
本期申购	288,262,808.89	288,262,808.89

本期赎回（以“-”号填列）	-324,404,115.77	-324,404,115.77
本期末	116,867,357.02	116,867,357.02

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)。

7.4.7.10 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	117,575,820.31	-8,996,634.72	108,579,185.59
本期基金份额交易产生的变动数	48,867,014.06	12,332,422.90	61,199,436.96
其中：基金申购款	149,843,388.34	14,965,088.78	164,808,477.12
基金赎回款	-100,976,374.28	-2,632,665.88	-103,609,040.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	175,615,835.34	3,544,406.11	179,160,241.45

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	43,252,597.55	1,723,790.58	44,976,388.13
本期基金份额交易产生的变动数	-5,176,317.24	-950,284.35	-6,126,601.59
其中：基金申购款	57,824,242.03	14,968.15	57,839,210.18
基金赎回款	-63,000,559.27	-965,252.50	-63,965,811.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,802,825.80	823,223.90	42,626,049.70

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	246,190.71	211,822.47
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	172,221.84	39,420.00
其他	7,760.68	3,497.09
合计	426,173.23	254,739.56

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

	31 日	日
卖出股票成交总额	4,147,851,849.35	1,274,113,182.94
减：卖出股票成本总额	3,977,932,443.06	1,219,081,874.80
买卖股票差价收入	169,919,406.29	55,031,308.14

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,345,374.68	2,161,456.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,487,038.20	2,027,900.00
减：应收利息总额	107,596.26	1,534.39
买卖债券差价收入	750,740.22	132,022.51

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

7.4.7.14 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	3,230,679.61	2,420,621.35

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,767,584.78	2,768,502.10
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	5,767,584.78	2,768,502.10

7.4.7.16 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 12 月	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月
------	-----------------------------------	--

	31 日	31 日
1.交易性金融资产	-7,237,564.14	40,118,994.68
——股票投资	-7,239,926.74	40,131,205.28
——债券投资	2,362.60	-12,210.60
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-35,280.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货	-35,280.00	-
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	-7,272,844.14	40,118,994.68

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	546,779.62	128,257.24
基金转换费收入	23,954.32	21,201.83
合计	570,733.94	149,459.07

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	11,177,935.34	3,591,145.60
银行间市场交易费用	-	-
合计	11,177,935.34	3,591,145.60

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	15,397.48	6,891.85
指数使用费	200,000.00	200,000.00

开户费	-	-
合计	395,397.48	376,891.85

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	2,036,296,192.55	24.21%	1,639,164,691.19	60.23%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	359,923.88	3.10%	6,661,642.90	98.10%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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 12 月 31 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	1,489,158.08	24.21%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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	1,198,723.81	60.23%	485,234.08	66.05%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,330,382.78	2,941,500.78
其中：支付销售机构的客户维护费	1,489,138.49	589,978.09

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,266,076.46	588,300.22

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	-	336,407.91	336,407.91
合计	-	336,407.91	336,407.91
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 12 月 31 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	-	243,237.14	243,237.14
合计	-	243,237.14	243,237.14

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	35,834,890.16	246,190.71	23,092,397.15	211,822.47

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
688185	康希诺	2020-08-04	2021-02-18	首次公开发行股票限售	209.71	355.68	2,893.00	606,691.03	1,028,982.24	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	首次公开发行股票限售	25.70	88.29	3,967.00	101,951.90	350,246.43	-
688595	芯海科技	2020-09-18	2021-03-29	首次公开发行股票限售	22.82	60.59	3,190.00	72,795.80	193,282.10	-
688559	海目星	2020-08-28	2021-03-09	首次公开发行股票限售	14.56	30.97	5,924.00	86,253.44	183,466.28	-
688513	苑东生物	2020-08-21	2021-03-02	首次公开发行股票限售	44.36	46.25	3,847.00	170,652.92	177,923.75	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	首次公开发行股票限售	118.27	603.36	289.00	34,180.03	174,371.04	-
688617	惠泰	2020-1	2021-	新股未	74.46	74.46	1,673.00	124,571.58	124,571.58	-

	医疗	2-30	01-07	上市						
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	首次公开发行限售	10.16	110.88	862.00	8,757.92	95,578.56	-
688571	杭华股份	2020-12-02	2021-06-11	首次公开发行限售	5.33	7.92	8,200.00	43,706.00	64,944.00	-
688618	三旺通信	2020-12-23	2021-06-30	首次公开发行限售	34.08	46.16	1,117.00	38,067.36	51,560.72	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	首次公开发行限售	19.34	31.97	1,498.00	28,971.32	47,891.06	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	首次公开发行限售	43.76	51.10	865.00	37,852.40	44,201.50	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	首次公开发行限售	138.02	126.67	298.00	41,129.96	37,747.66	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	首次公开发行限售	24.60	61.51	610.00	15,006.00	37,521.10	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225.00	34,701.00	34,701.00	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	首次公开发行限售	21.34	37.84	871.00	18,587.14	32,958.64	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	首次公开发行限售	36.81	65.67	478.00	17,595.18	31,390.26	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946.00	26,056.94	26,056.94	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	首次公开发行限售	41.26	43.28	593.00	24,467.18	25,665.04	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	首次公开发行限售	33.61	38.70	618.00	20,770.98	23,916.60	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-07-01	首次公开发行限售	14.07	36.97	628.00	8,835.96	23,217.16	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	首次公开发行限售	30.26	47.87	474.00	14,343.24	22,690.38	-

300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	首次公开发行限售	30.72	41.32	484.00	14,868.48	19,998.88	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	首次公开发行限售	3.64	16.40	1,143.00	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	首次公开发行限售	39.74	60.44	285.00	11,325.90	17,225.40	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	首次公开发行限售	26.66	60.01	272.00	7,251.52	16,322.72	-
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	首次公开发行限售	29.57	40.67	386.00	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	首次公开发行限售	44.47	74.52	210.00	9,338.70	15,649.20	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	首次公开发行限售	71.71	90.85	166.00	11,903.86	15,081.10	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	首次公开发行限售	27.97	30.12	479.00	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	首次公开发行限售	14.69	48.85	286.00	4,201.34	13,971.10	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	首次公开发行限售	20.09	36.62	350.00	7,031.50	12,817.00	-
300907	康平科技	2020-11-11	2021-05-18	首次公开发行限售	14.30	26.85	473.00	6,763.90	12,700.05	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	首次公开发行限售	10.58	27.12	466.00	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	首次公开发行限售	10.33	25.79	440.00	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	首次公开发行限售	24.35	33.06	309.00	7,524.15	10,215.54	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	首次公开发行	13.47	35.08	276.00	3,717.72	9,682.08	-

				限售						
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	首次公开发行限售	4.97	8.94	1,063.00	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	首次公开发行限售	14.17	32.31	291.00	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	首次公开发行限售	16.05	31.58	287.00	4,606.35	9,063.46	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507.00	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480.00	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	首次公开发行限售	18.59	45.67	147.00	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387.00	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行限售	10.76	10.76	359.00	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行限售	13.39	13.39	217.00	2,905.63	2,905.63	-

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》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，基金减持持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》的有关规定)；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，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。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、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承

销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、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、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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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，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债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，对不同的债券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且债券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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。

7.4.13.2.1 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,010,300.00	4,628,775.60
合计	8,010,300.00	4,628,775.60

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于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(所有者权益)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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	35,834,890.16	-	-	-	35,834,890.16
结算备付金	23,958,494.86	-	-	-	23,958,494.86
存出保证金	123,152.80	-	-	1,967,846.76	2,090,999.56
交易性金融资产	8,010,300.00	-	-	747,826,986.57	755,837,286.57
应收证券清算款	-	-	-	4,245,546.69	4,245,546.69

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	137,067.13	137,067.13
应收申购款	-	-	-	832,147.32	832,147.32
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	67,926,837.82	-	-	755,009,594.47	822,936,432.29
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,758,455.10	5,758,455.10
应付证券清算款	-	-	-	3,403,290.12	3,403,290.12
应付管理人报酬	-	-	-	695,034.68	695,034.68
应付托管费	-	-	-	139,006.91	139,006.91
应付销售服务费	-	-	-	57,509.59	57,509.59
应交税费	-	-	-	20,478.39	20,478.39
应付交易费用	-	-	-	1,871,634.89	1,871,634.89
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	235,085.03	235,085.03
负债总计	-	-	-	12,180,494.71	12,180,494.71
利率敏感度缺口	67,926,837.82	-	-	742,829,099.76	810,755,937.58
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。

7.4.13.4.1.2 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	增加约 1	增加约 0
	2.市场利率上升 25 个基点	减少约 1	减少约 0

注：上述金额为四舍五入后的结果。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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（%）
交易性金融资产—股票投资	747,826,986.57	92.24	436,538,727.28	94.25
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	747,826,986.57	92.24	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“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)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 3,699	增加约 2,183
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 3,699	减少约 2,183

7.4.14 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

于本期末，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 744,714,342.25 元，属于第二层次的余额为 11,122,944.32 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 425,465,762.57 元，第二层次 15,701,740.31 元，第三层次 0.00 元）。

(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（上年度末：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。

§8 投资组合报告

8.1 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	747,826,986.57	90.87
	其中：股票	747,826,986.57	90.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,010,300.00	0.97
	其中：债券	8,010,300.00	0.97
	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	59,793,385.02	7.27
8	其他各项资产	7,305,760.70	0.89
9	合计	822,936,432.29	100.00

8.2 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	347,904.00	0.04
B	采矿业	24,462,740.20	3.02
C	制造业	500,616,331.19	61.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,684,219.00	2.06
E	建筑业	8,064,142.00	0.99
F	批发和零售业	18,863,850.12	2.33

G	交通运输、仓储和邮政业	20,177,352.52	2.49
H	住宿和餐饮业	1,474,790.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,326,346.64	6.45
J	金融业	40,087,367.78	4.94
K	房地产业	19,103,420.58	2.36
L	租赁和商务服务业	5,036,304.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	7,553,461.20	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	5,805,096.16	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,771,199.16	2.32
R	文化、体育和娱乐业	8,405,683.02	1.04
S	综合	46,779.00	0.01
	合计	747,826,986.57	92.24

8.3 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	300274	阳光电源	230,700	16,674,996.00	2.06
2	603882	金域医学	109,293	14,002,619.16	1.73
3	601966	玲珑轮胎	355,308	12,496,182.36	1.54
4	601799	星宇股份	57,400	11,508,700.00	1.42
5	601615	明阳智能	562,818	10,682,285.64	1.32
6	002372	伟星新材	532,900	9,965,230.00	1.23
7	600862	中航高科	309,600	9,318,960.00	1.15
8	603486	科沃斯	105,100	9,300,299.00	1.15
9	002138	顺络电子	374,000	9,170,480.00	1.13
10	600782	新钢股份	1,964,182	9,015,595.38	1.11
11	300496	中科创达	76,500	8,950,500.00	1.10
12	600717	天津港	1,860,688	8,894,088.64	1.10
13	002244	滨江集团	1,895,362	8,699,711.58	1.07
14	300088	长信科技	934,600	8,308,594.00	1.02
15	600779	水井坊	88,700	7,363,874.00	0.91
16	000600	建投能源	1,310,900	7,354,149.00	0.91
17	603806	福斯特	85,700	7,318,780.00	0.90
18	000690	宝新能源	971,900	7,094,870.00	0.88
19	300699	光威复材	77,400	6,892,470.00	0.85
20	002124	天邦股份	470,800	6,873,680.00	0.85
21	600038	中直股份	105,700	6,628,447.00	0.82
22	000932	华菱钢铁	1,380,600	6,599,268.00	0.81
23	300012	华测检测	239,500	6,555,115.00	0.81
24	002557	洽洽食品	119,700	6,445,845.00	0.80
25	000983	西山煤电	1,128,400	6,364,176.00	0.78

26	603444	吉比特	14,931	6,360,606.00	0.78
27	603345	安井食品	31,600	6,094,692.00	0.75
28	601233	桐昆股份	278,900	5,742,551.00	0.71
29	601000	唐山港	2,295,800	5,693,584.00	0.70
30	600879	航天电子	742,600	5,554,648.00	0.69
31	603260	合盛硅业	165,100	5,520,944.00	0.68
32	600143	金发科技	318,300	5,455,662.00	0.67
33	000060	中金岭南	1,124,900	5,422,018.00	0.67
34	600155	华创阳安	393,700	5,192,903.00	0.64
35	000686	东北证券	526,900	5,174,158.00	0.64
36	002867	周大生	193,400	5,154,110.00	0.64
37	600064	南京高科	501,300	5,148,351.00	0.64
38	600567	山鹰国际	1,691,200	5,107,424.00	0.63
39	300474	景嘉微	70,600	4,935,646.00	0.61
40	000563	陕国投 A	1,301,000	4,904,770.00	0.60
41	000581	威孚高科	210,300	4,876,857.00	0.60
42	002139	拓邦股份	600,400	4,869,244.00	0.60
43	002281	光迅科技	167,200	4,855,488.00	0.60
44	600426	华鲁恒升	130,100	4,852,730.00	0.60
45	300463	迈克生物	103,200	4,809,120.00	0.59
46	600195	中牧股份	374,650	4,799,266.50	0.59
47	300737	科顺股份	217,100	4,658,966.00	0.57
48	600409	三友化工	452,346	4,636,546.50	0.57
49	603056	德邦股份	352,200	4,469,418.00	0.55
50	600985	淮北矿业	385,700	4,315,983.00	0.53
51	688002	睿创微纳	38,880	4,315,680.00	0.53
52	600867	通化东宝	322,000	4,308,360.00	0.53
53	000778	新兴铸管	1,167,000	4,294,560.00	0.53
54	600039	四川路桥	920,400	4,151,004.00	0.51
55	002249	大洋电机	903,300	4,064,850.00	0.50
56	603927	中科软	100,800	4,041,072.00	0.50
57	002056	横店东磁	261,300	3,969,147.00	0.49
58	002223	鱼跃医疗	140,400	3,960,684.00	0.49
59	600804	鹏博士	576,400	3,873,408.00	0.48
60	000807	云铝股份	514,100	3,871,173.00	0.48
61	300618	寒锐钴业	40,700	3,862,837.00	0.48
62	603605	珀莱雅	21,600	3,844,800.00	0.47
63	000513	丽珠集团	90,800	3,677,400.00	0.45
64	002155	湖南黄金	428,300	3,644,833.00	0.45
65	300244	迪安诊断	105,900	3,630,252.00	0.45
66	300009	安科生物	242,010	3,552,706.80	0.44
67	601128	常熟银行	480,000	3,542,400.00	0.44
68	002821	凯莱英	11,800	3,529,852.00	0.44

69	300726	宏达电子	48,100	3,480,035.00	0.43
70	603866	桃李面包	58,500	3,457,350.00	0.43
71	300010	豆神教育	352,100	3,436,496.00	0.42
72	000050	深天马 A	233,000	3,434,420.00	0.42
73	600339	中油工程	1,109,800	3,418,184.00	0.42
74	603883	老百姓	54,180	3,404,129.40	0.42
75	600315	上海家化	96,500	3,351,445.00	0.41
76	601677	明泰铝业	236,600	3,345,524.00	0.41
77	000750	国海证券	566,300	3,318,518.00	0.41
78	300058	蓝色光标	544,600	3,267,600.00	0.40
79	002382	蓝帆医疗	152,800	3,222,552.00	0.40
80	600535	天士力	209,900	3,104,421.00	0.38
81	600884	杉杉股份	171,400	3,090,342.00	0.38
82	002110	三钢闽光	455,900	3,068,207.00	0.38
83	002030	达安基因	89,420	3,067,106.00	0.38
84	002572	索菲亚	114,900	2,975,910.00	0.37
85	002423	中粮资本	305,800	2,960,144.00	0.37
86	601222	林洋能源	370,300	2,932,776.00	0.36
87	300630	普利制药	69,700	2,919,733.00	0.36
88	000568	泸州老窖	12,800	2,894,848.00	0.36
89	603678	火炬电子	39,700	2,870,310.00	0.35
90	002508	老板电器	68,900	2,809,742.00	0.35
91	603816	顾家家居	39,300	2,771,043.00	0.34
92	000528	柳工	374,800	2,758,528.00	0.34
93	000623	吉林敖东	167,200	2,753,784.00	0.34
94	600056	中国医药	191,600	2,745,628.00	0.34
95	601200	上海环境	251,700	2,743,530.00	0.34
96	002925	盈趣科技	42,500	2,734,025.00	0.34
97	600563	法拉电子	25,400	2,731,770.00	0.34
98	601098	中南传媒	281,100	2,678,883.00	0.33
99	002013	中航机电	232,900	2,666,705.00	0.33
100	002317	众生药业	241,500	2,661,330.00	0.33
101	002081	金螳螂	279,800	2,627,322.00	0.32
102	600894	广日股份	325,100	2,626,808.00	0.32
103	601689	拓普集团	68,200	2,620,926.00	0.32
104	002709	天赐材料	25,000	2,595,000.00	0.32
105	002705	新宝股份	60,700	2,564,575.00	0.32
106	300166	东方国信	231,400	2,533,830.00	0.31
107	002419	天虹股份	326,600	2,495,224.00	0.31
108	002648	卫星石化	94,800	2,476,176.00	0.31
109	600885	宏发股份	45,600	2,472,432.00	0.30
110	000630	铜陵有色	955,600	2,455,892.00	0.30
111	300482	万孚生物	27,500	2,453,275.00	0.30

112	300415	伊之密	183,200	2,453,048.00	0.30
113	002258	利尔化学	117,100	2,447,390.00	0.30
114	600755	厦门国贸	355,000	2,371,400.00	0.29
115	000026	飞亚达	205,200	2,345,436.00	0.29
116	002839	张家港行	378,300	2,307,630.00	0.28
117	300788	中信出版	54,300	2,302,863.00	0.28
118	600201	生物股份	110,000	2,297,900.00	0.28
119	002233	塔牌集团	179,000	2,280,460.00	0.28
120	600079	人福医药	67,100	2,273,348.00	0.28
121	603686	龙马环卫	138,400	2,225,472.00	0.27
122	300133	华策影视	353,452	2,184,333.36	0.27
123	601997	贵阳银行	271,600	2,159,220.00	0.27
124	002609	捷顺科技	231,800	2,158,058.00	0.27
125	300673	佩蒂股份	67,900	2,124,591.00	0.26
126	601860	紫金银行	503,718	2,120,652.78	0.26
127	002156	通富微电	83,900	2,117,636.00	0.26
128	002158	汉钟精机	136,700	2,061,436.00	0.25
129	002465	海格通信	190,300	2,060,949.00	0.25
130	600120	浙江东方	340,900	2,035,173.00	0.25
131	600739	辽宁成大	82,900	2,016,128.00	0.25
132	000547	航天发展	73,100	2,010,250.00	0.25
133	300593	新雷能	66,500	1,999,655.00	0.25
134	600699	均胜电子	78,600	1,993,296.00	0.25
135	300723	一品红	49,000	1,968,820.00	0.24
136	002408	齐翔腾达	232,800	1,946,208.00	0.24
137	688099	晶晨股份	24,700	1,944,631.00	0.24
138	000878	云南铜业	134,300	1,943,321.00	0.24
139	300014	亿纬锂能	23,800	1,939,700.00	0.24
140	300316	晶盛机电	63,100	1,898,048.00	0.23
141	600893	航发动力	31,700	1,881,395.00	0.23
142	600633	浙数文化	230,200	1,873,828.00	0.23
143	002797	第一创业	187,400	1,864,630.00	0.23
144	600461	洪城水业	271,300	1,833,988.00	0.23
145	300395	菲利华	30,600	1,830,798.00	0.23
146	300207	欣旺达	58,500	1,796,535.00	0.22
147	600466	蓝光发展	388,000	1,796,440.00	0.22
148	300418	昆仑万维	90,000	1,795,500.00	0.22
149	300146	汤臣倍健	74,200	1,791,930.00	0.22
150	300639	凯普生物	47,500	1,785,050.00	0.22
151	002027	分众传媒	179,200	1,768,704.00	0.22
152	002322	理工环科	154,400	1,732,368.00	0.21
153	002130	沃尔核材	312,600	1,728,678.00	0.21
154	300770	新媒股份	24,520	1,723,756.00	0.21

155	000975	银泰黄金	200,020	1,722,172.20	0.21
156	688088	虹软科技	24,400	1,706,048.00	0.21
157	603568	伟明环保	89,700	1,698,021.00	0.21
158	601168	西部矿业	136,400	1,688,632.00	0.21
159	600704	物产中大	385,000	1,682,450.00	0.21
160	002273	水晶光电	144,300	1,672,437.00	0.21
161	002568	百润股份	15,000	1,564,350.00	0.19
162	600094	大名城	385,800	1,550,916.00	0.19
163	002191	劲嘉股份	164,400	1,517,412.00	0.19
164	603708	家家悦	70,200	1,495,260.00	0.18
165	001914	招商积余	69,400	1,494,182.00	0.18
166	600258	首旅酒店	69,500	1,474,790.00	0.18
167	600497	驰宏锌锗	305,600	1,466,880.00	0.18
168	002335	科华恒盛	65,300	1,458,802.00	0.18
169	300378	鼎捷软件	53,300	1,452,425.00	0.18
170	600760	中航沈飞	18,400	1,438,512.00	0.18
171	600456	宝钛股份	27,500	1,432,475.00	0.18
172	601636	旗滨集团	111,800	1,431,040.00	0.18
173	600507	方大特钢	201,400	1,397,716.00	0.17
174	300324	旋极信息	327,000	1,383,210.00	0.17
175	300578	会畅通讯	33,800	1,354,028.00	0.17
176	300394	天孚通信	24,700	1,317,251.00	0.16
177	600388	龙净环保	143,200	1,271,616.00	0.16
178	688122	西部超导	15,800	1,256,258.00	0.15
179	600811	东方集团	339,200	1,238,080.00	0.15
180	000501	鄂武商 A	104,300	1,215,095.00	0.15
181	000967	盈峰环境	147,400	1,199,836.00	0.15
182	600901	江苏租赁	217,500	1,198,425.00	0.15
183	002179	中航光电	15,300	1,197,837.00	0.15
184	688036	传音控股	7,700	1,171,478.00	0.14
185	603187	海容冷链	19,500	1,170,000.00	0.14
186	600809	山西汾酒	3,100	1,163,399.00	0.14
187	300015	爱尔眼科	15,200	1,138,328.00	0.14
188	002926	华西证券	90,000	1,123,200.00	0.14
189	000758	中色股份	218,400	1,109,472.00	0.14
190	600909	华安证券	136,400	1,091,200.00	0.13
191	000538	云南白药	9,500	1,079,200.00	0.13
192	300002	神州泰岳	207,200	1,058,792.00	0.13
193	000895	双汇发展	22,500	1,056,150.00	0.13
194	603939	益丰药房	11,700	1,055,223.00	0.13
195	002396	星网锐捷	45,400	1,046,924.00	0.13
196	600273	嘉化能源	112,000	1,034,880.00	0.13
197	002241	歌尔股份	27,700	1,033,764.00	0.13

198	300271	华宇软件	43,300	1,033,571.00	0.13
199	600282	南钢股份	331,200	1,033,344.00	0.13
200	603043	广州酒家	26,600	1,030,218.00	0.13
201	688185	康希诺	2,893	1,028,982.24	0.13
202	300491	通合科技	64,800	1,027,080.00	0.13
203	300595	欧普康视	12,400	1,015,808.00	0.13
204	002353	杰瑞股份	28,900	1,011,500.00	0.12
205	002603	以岭药业	38,700	986,850.00	0.12
206	688139	海尔生物	15,000	979,350.00	0.12
207	002957	科瑞技术	46,900	959,105.00	0.12
208	002901	大博医疗	13,000	958,490.00	0.12
209	002940	昂利康	22,900	947,144.00	0.12
210	600820	隧道股份	170,400	921,864.00	0.11
211	300115	长盈精密	37,100	914,515.00	0.11
212	002028	思源电气	45,500	912,730.00	0.11
213	002864	盘龙药业	35,000	879,200.00	0.11
214	688029	南微医学	4,745	873,127.45	0.11
215	002444	巨星科技	27,900	867,969.00	0.11
216	600967	内蒙一机	68,900	837,824.00	0.10
217	600529	山东药玻	16,500	827,475.00	0.10
218	600435	北方导航	90,800	817,200.00	0.10
219	300119	瑞普生物	42,800	808,064.00	0.10
220	300445	康斯特	52,700	769,947.00	0.09
221	002315	焦点科技	45,900	758,268.00	0.09
222	603218	日月股份	24,700	747,175.00	0.09
223	600141	兴发集团	67,300	742,319.00	0.09
224	600643	爱建集团	97,400	732,448.00	0.09
225	002185	华天科技	53,600	730,032.00	0.09
226	300136	信维通信	20,300	728,364.00	0.09
227	002048	宁波华翔	46,300	720,891.00	0.09
228	600372	中航电子	36,600	719,190.00	0.09
229	002434	万里扬	80,400	717,168.00	0.09
230	300357	我武生物	9,300	713,310.00	0.09
231	002985	北摩高科	3,600	695,880.00	0.09
232	603466	风语筑	28,200	650,856.00	0.08
233	600728	佳都科技	84,000	637,560.00	0.08
234	600556	天下秀	50,300	636,295.00	0.08
235	000008	神州高铁	246,900	627,126.00	0.08
236	300502	新易盛	10,900	604,732.00	0.07
237	300285	国瓷材料	13,400	604,474.00	0.07
238	600710	苏美达	106,800	598,080.00	0.07
239	600580	卧龙电驱	37,800	589,680.00	0.07
240	603712	七一二	14,100	587,265.00	0.07

241	603198	迎驾贡酒	16,800	586,320.00	0.07
242	002655	共达电声	80,400	582,900.00	0.07
243	000887	中鼎股份	47,400	555,054.00	0.07
244	601801	皖新传媒	116,000	551,000.00	0.07
245	600277	亿利洁能	173,200	517,868.00	0.06
246	603886	元祖股份	29,600	504,384.00	0.06
247	300580	贝斯特	24,600	499,626.00	0.06
248	601919	中远海控	40,100	489,621.00	0.06
249	600171	上海贝岭	33,100	464,062.00	0.06
250	300113	顺网科技	26,800	459,620.00	0.06
251	600968	海油发展	192,000	458,880.00	0.06
252	603185	上机数控	3,200	443,040.00	0.05
253	300450	先导智能	5,200	436,748.00	0.05
254	600690	海尔智家	14,800	432,308.00	0.05
255	600584	长电科技	10,100	429,957.00	0.05
256	002373	千方科技	22,200	424,464.00	0.05
257	300124	汇川技术	4,500	419,850.00	0.05
258	002430	杭氧股份	14,300	415,987.00	0.05
259	600531	豫光金铅	70,100	414,291.00	0.05
260	000537	广宇发展	66,000	413,820.00	0.05
261	601311	骆驼股份	44,000	411,400.00	0.05
262	688111	金山办公	1,000	411,000.00	0.05
263	002015	协鑫能科	64,400	401,212.00	0.05
264	603236	移远通信	2,100	392,574.00	0.05
265	603208	江山欧派	3,700	389,425.00	0.05
266	603035	常熟汽饰	28,400	382,832.00	0.05
267	603859	能科股份	10,800	381,780.00	0.05
268	000089	深圳机场	46,600	380,722.00	0.05
269	688202	美迪西	2,400	377,352.00	0.05
270	300142	沃森生物	9,700	374,032.00	0.05
271	002661	克明面业	20,800	370,240.00	0.05
272	000970	中科三环	38,800	366,660.00	0.05
273	600970	中材国际	52,900	363,952.00	0.04
274	002847	盐津铺子	3,300	363,726.00	0.04
275	601099	太平洋	88,700	361,896.00	0.04
276	300999	金龙鱼	3,967	350,246.43	0.04
277	002679	福建金森	30,200	347,904.00	0.04
278	601865	福莱特	8,100	323,190.00	0.04
279	300400	劲拓股份	25,500	320,025.00	0.04
280	300567	精测电子	5,400	296,676.00	0.04
281	601678	滨化股份	53,600	281,400.00	0.03
282	600338	西藏珠峰	26,100	273,528.00	0.03
283	002599	盛通股份	67,200	262,752.00	0.03

284	002369	卓翼科技	43,400	226,114.00	0.03
285	300687	赛意信息	9,800	224,812.00	0.03
286	002967	广电计量	6,100	223,565.00	0.03
287	001872	招商港口	12,300	195,816.00	0.02
288	600380	健康元	13,900	193,349.00	0.02
289	688595	芯海科技	3,190	193,282.10	0.02
290	603256	宏和科技	21,300	188,079.00	0.02
291	688559	海目星	5,924	183,466.28	0.02
292	688513	苑东生物	3,847	177,923.75	0.02
293	002064	华峰氨纶	17,400	175,566.00	0.02
294	300896	爱美客	289	174,371.04	0.02
295	300212	易华录	5,000	153,250.00	0.02
296	002595	豪迈科技	4,900	145,285.00	0.02
297	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
298	002131	利欧股份	38,300	116,049.00	0.01
299	002970	锐明技术	2,000	106,020.00	0.01
300	603359	东珠生态	6,300	100,737.00	0.01
301	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.01
302	600546	山煤国际	10,600	90,206.00	0.01
303	600511	国药股份	1,600	78,896.00	0.01
304	603937	丽岛新材	7,100	70,432.00	0.01
305	000999	华润三九	2,800	69,832.00	0.01
306	688571	杭华股份	8,200	64,944.00	0.01
307	300017	网宿科技	8,700	59,943.00	0.01
308	603010	万盛股份	2,400	53,520.00	0.01
309	688618	三旺通信	1,117	51,560.72	0.01
310	002690	美亚光电	1,100	48,708.00	0.01
311	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
312	600673	东阳光	9,300	46,779.00	0.01
313	300861	美畅股份	865	44,201.50	0.01
314	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
315	603661	恒林股份	700	38,038.00	0.00
316	300860	锋尚文化	298	37,747.66	0.00
317	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
318	600575	淮河能源	14,700	34,104.00	0.00
319	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
320	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
321	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
322	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
323	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
324	600668	尖峰集团	1,700	23,766.00	0.00
325	300894	火星号	628	23,217.16	0.00
326	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00

327	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
328	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
329	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
330	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
331	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
332	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
333	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
334	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
335	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
336	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
337	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
338	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
339	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
340	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
341	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
342	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
343	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
344	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
345	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
346	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
347	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
348	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
349	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
350	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
351	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	35,458,109.72	7.66
2	601966	玲珑轮胎	32,722,714.67	7.06
3	002557	洽洽食品	28,340,370.84	6.12
4	002353	杰瑞股份	28,191,793.52	6.09
5	601799	星宇股份	27,503,572.38	5.94
6	002028	思源电气	27,029,327.91	5.84
7	603338	浙江鼎力	25,641,907.31	5.54
8	603866	桃李面包	24,802,491.85	5.35
9	000690	宝新能源	24,755,272.27	5.34
10	300274	阳光电源	24,544,695.19	5.30
11	600885	宏发股份	22,866,185.00	4.94
12	000581	威孚高科	22,839,617.44	4.93

13	603882	金域医学	21,678,361.97	4.68
14	002127	南极电商	21,111,540.29	4.56
15	002511	中顺洁柔	21,005,198.47	4.54
16	601615	明阳智能	20,939,056.51	4.52
17	603983	丸美股份	20,605,404.99	4.45
18	601128	常熟银行	20,078,621.53	4.34
19	000932	华菱钢铁	19,406,933.60	4.19
20	300558	贝达药业	19,238,136.08	4.15
21	300253	卫宁健康	19,094,596.74	4.12
22	300618	寒锐钴业	18,786,291.97	4.06
23	002281	光迅科技	18,595,756.21	4.01
24	603659	璞泰来	18,582,871.16	4.01
25	000686	东北证券	18,244,033.01	3.94
26	600845	宝信软件	18,215,894.75	3.93
27	002439	启明星辰	18,154,301.93	3.92
28	002821	凯莱英	17,957,786.64	3.88
29	600298	安琪酵母	17,735,103.91	3.83
30	002797	第一创业	17,631,563.77	3.81
31	300496	中科创达	17,424,920.77	3.76
32	601677	明泰铝业	17,417,312.90	3.76
33	000400	许继电气	17,365,228.85	3.75
34	601233	桐昆股份	16,686,050.21	3.60
35	600039	四川路桥	16,656,189.36	3.60
36	601688	华泰证券	16,478,087.12	3.56
37	600195	中牧股份	16,421,752.23	3.55
38	601000	唐山港	16,244,511.00	3.51
39	600770	综艺股份	16,148,327.60	3.49
40	600486	扬农化工	16,112,408.24	3.48
41	002414	高德红外	16,001,921.90	3.45
42	002244	滨江集团	15,924,069.71	3.44
43	000807	云铝股份	15,761,453.00	3.40
44	002138	顺络电子	15,756,415.52	3.40
45	601717	郑煤机	15,680,019.47	3.39
46	600717	天津港	15,651,256.56	3.38
47	002709	天赐材料	15,252,188.50	3.29
48	603806	福斯特	15,200,490.52	3.28
49	300207	欣旺达	14,908,066.20	3.22
50	002124	天邦股份	14,504,926.72	3.13
51	002233	塔牌集团	14,480,303.13	3.13
52	300244	迪安诊断	14,474,097.41	3.13
53	603444	吉比特	14,389,876.85	3.11
54	002078	太阳纸业	14,351,264.13	3.10
55	600132	重庆啤酒	14,300,058.54	3.09

56	002572	索菲亚	14,256,303.60	3.08
57	000988	华工科技	14,197,768.55	3.07
58	002382	蓝帆医疗	14,184,476.71	3.06
59	300502	新易盛	14,067,081.03	3.04
60	002174	游族网络	13,958,567.92	3.01
61	300088	长信科技	13,881,891.71	3.00
62	000778	新兴铸管	13,876,436.00	3.00
63	603939	益丰药房	13,734,682.29	2.97
64	002507	涪陵榨菜	13,710,466.23	2.96
65	300482	万孚生物	13,498,598.76	2.91
66	300012	华测检测	13,461,333.49	2.91
67	002002	鸿达兴业	13,375,140.00	2.89
68	600064	南京高科	13,301,304.80	2.87
69	600745	闻泰科技	13,293,898.42	2.87
70	002372	伟星新材	13,261,994.58	2.86
71	002867	周大生	13,213,214.55	2.85
72	600339	中油工程	13,151,829.45	2.84
73	002920	德赛西威	13,119,261.11	2.83
74	603056	德邦股份	13,030,936.87	2.81
75	300474	景嘉微	13,011,471.56	2.81
76	603517	绝味食品	12,994,928.51	2.81
77	000547	航天发展	12,948,750.43	2.80
78	002048	宁波华翔	12,884,657.11	2.78
79	601139	深圳燃气	12,877,273.60	2.78
80	002249	大洋电机	12,818,085.00	2.77
81	600779	水井坊	12,721,456.75	2.75
82	002223	鱼跃医疗	12,707,664.54	2.74
83	600704	物产中大	12,680,073.78	2.74
84	603486	科沃斯	12,669,032.80	2.74
85	002128	露天煤业	12,656,251.78	2.73
86	600155	华创阳安	12,633,302.65	2.73
87	603708	家家悦	12,498,202.64	2.70
88	002434	万里扬	12,383,834.00	2.67
89	600985	淮北矿业	12,283,548.60	2.65
90	001914	招商积余	12,209,975.63	2.64
91	300607	拓斯达	12,198,570.62	2.63
92	000513	丽珠集团	12,155,440.70	2.62
93	002013	中航机电	12,137,810.60	2.62
94	601689	拓普集团	12,033,967.51	2.60
95	600026	中远海能	12,026,885.23	2.60
96	600782	新钢股份	11,912,400.91	2.57
97	600273	嘉化能源	11,815,936.66	2.55
98	000050	深天马 A	11,773,907.58	2.54

99	603605	珀莱雅	11,770,455.90	2.54
100	600466	蓝光发展	11,688,077.59	2.52
101	300133	华策影视	11,633,286.70	2.51
102	002080	中材科技	11,548,659.55	2.49
103	600167	联美控股	11,428,419.81	2.47
104	000025	特力 A	11,346,565.95	2.45
105	600811	东方集团	11,267,054.19	2.43
106	600143	金发科技	11,219,035.28	2.42
107	603881	数据港	11,195,821.26	2.42
108	600141	兴发集团	11,144,891.78	2.41
109	603328	依顿电子	11,128,865.69	2.40
110	600426	华鲁恒升	11,092,134.68	2.39
111	000983	山西焦煤	11,091,853.15	2.39
112	000528	柳工	11,031,130.55	2.38
113	002155	湖南黄金	11,010,487.84	2.38
114	600315	上海家化	10,982,196.77	2.37
115	000600	建投能源	10,919,266.20	2.36
116	601099	太平洋	10,886,152.00	2.35
117	002250	联化科技	10,874,316.44	2.35
118	601098	中南传媒	10,849,325.16	2.34
119	000717	韶钢松山	10,759,883.95	2.32
120	600909	华安证券	10,662,318.00	2.30
121	603317	天味食品	10,632,842.60	2.30
122	300308	中际旭创	10,632,580.33	2.30
123	000060	中金岭南	10,567,690.00	2.28
124	300418	昆仑万维	10,491,765.14	2.27
125	000543	皖能电力	10,482,583.63	2.26
126	000750	国海证券	10,281,975.50	2.22
127	600755	厦门国贸	10,261,533.84	2.22
128	603260	合盛硅业	10,251,058.57	2.21
129	300009	安科生物	10,247,876.78	2.21
130	002258	利尔化学	10,189,890.68	2.20
131	300316	晶盛机电	10,174,187.81	2.20
132	002056	横店东磁	10,123,913.73	2.19
133	300010	豆神教育	10,054,150.11	2.17
134	603233	大参林	9,984,258.94	2.16
135	002839	张家港行	9,816,153.50	2.12
136	300014	亿纬锂能	9,762,658.97	2.11
137	000090	天健集团	9,749,775.66	2.11
138	000878	云南铜业	9,746,187.99	2.10
139	601200	上海环境	9,726,149.90	2.10
140	000563	陕国投 A	9,713,741.82	2.10
141	600563	法拉电子	9,675,518.50	2.09

142	300435	中泰股份	9,609,196.00	2.07
143	002273	水晶光电	9,584,852.14	2.07
144	600521	华海药业	9,570,085.60	2.07
145	000758	中色股份	9,529,415.68	2.06
146	002648	卫星石化	9,519,882.78	2.06
147	600038	中直股份	9,446,538.51	2.04
148	600757	长江传媒	9,386,488.00	2.03
149	600325	华发股份	9,334,529.63	2.02
150	002156	通富微电	9,292,922.59	2.01

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。

8.4.2 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	34,930,560.52	7.54
2	600862	中航高科	33,531,923.90	7.24
3	002353	杰瑞股份	27,890,837.03	6.02
4	603338	浙江鼎力	27,824,919.96	6.01
5	601966	玲珑轮胎	26,230,570.35	5.66
6	000581	威孚高科	25,135,867.97	5.43
7	300253	卫宁健康	23,649,195.63	5.11
8	002127	南极电商	23,525,186.22	5.08
9	603866	桃李面包	22,656,283.03	4.89
10	000807	云铝股份	22,176,382.37	4.79
11	600885	宏发股份	21,672,663.43	4.68
12	600486	扬农化工	21,405,719.50	4.62
13	002557	洽洽食品	21,376,011.26	4.62
14	000547	航天发展	21,353,324.85	4.61
15	603659	璞泰来	21,067,940.55	4.55
16	002414	高德红外	20,660,196.79	4.46
17	600845	宝信软件	20,591,982.66	4.45
18	603983	丸美股份	20,488,402.77	4.42
19	002511	中顺洁柔	19,796,208.55	4.27
20	601233	桐昆股份	19,621,159.40	4.24
21	002048	宁波华翔	19,533,669.87	4.22
22	600745	闻泰科技	19,531,288.60	4.22
23	600298	安琪酵母	19,339,752.42	4.18
24	002128	露天煤业	19,291,280.62	4.17
25	002439	启明星辰	18,742,664.76	4.05
26	300558	贝达药业	18,724,324.48	4.04
27	601799	星宇股份	18,660,452.98	4.03
28	000400	许继电气	18,416,244.40	3.98
29	601677	明泰铝业	18,200,553.24	3.93

30	002709	天赐材料	18,175,723.71	3.92
31	002821	凯莱英	18,094,829.07	3.91
32	000690	宝新能源	17,761,149.57	3.83
33	300618	寒锐钴业	17,731,517.57	3.83
34	601717	郑煤机	17,391,068.98	3.75
35	000686	东北证券	17,147,938.33	3.70
36	600704	物产中大	16,909,128.90	3.65
37	000988	华工科技	16,888,866.55	3.65
38	601688	华泰证券	16,186,746.63	3.49
39	002078	太阳纸业	15,925,386.86	3.44
40	600132	重庆啤酒	15,755,559.85	3.40
41	002797	第一创业	15,741,039.00	3.40
42	300207	欣旺达	15,706,962.94	3.39
43	600770	综艺股份	15,631,596.09	3.37
44	300014	亿纬锂能	15,527,199.71	3.35
45	300502	新易盛	15,150,588.40	3.27
46	600466	蓝光发展	15,022,600.01	3.24
47	300274	阳光电源	15,012,488.18	3.24
48	000543	皖能电力	14,773,033.79	3.19
49	601615	明阳智能	14,631,702.33	3.16
50	601128	常熟银行	14,621,510.88	3.16
51	000090	天健集团	14,494,896.59	3.13
52	002920	德赛西威	14,030,714.09	3.03
53	002242	九阳股份	13,774,986.43	2.97
54	600125	铁龙物流	13,714,406.14	2.96
55	600039	四川路桥	13,694,713.38	2.96
56	601139	深圳燃气	13,564,730.63	2.93
57	603233	大参林	13,441,871.34	2.90
58	600273	嘉化能源	13,432,699.88	2.90
59	002174	游族网络	13,239,403.06	2.86
60	600584	长电科技	13,215,029.12	2.85
61	000528	柳工	13,103,413.28	2.83
62	000932	华菱钢铁	13,066,492.00	2.82
63	603882	金域医学	13,063,947.32	2.82
64	603444	吉比特	13,040,287.23	2.82
65	601098	中南传媒	12,961,837.00	2.80
66	600985	淮北矿业	12,898,541.33	2.78
67	600643	爱建集团	12,810,293.83	2.77
68	603939	益丰药房	12,715,310.57	2.75
69	600373	中文传媒	12,579,264.30	2.72
70	002434	万里扬	12,566,904.00	2.71
71	002233	塔牌集团	12,515,008.22	2.70
72	603517	绝味食品	12,468,260.56	2.69

73	002463	沪电股份	12,366,501.00	2.67
74	603328	依顿电子	12,361,801.83	2.67
75	002818	富森美	12,344,958.24	2.67
76	002281	光迅科技	12,235,089.40	2.64
77	002002	鸿达兴业	12,062,217.14	2.60
78	600195	中牧股份	11,959,316.41	2.58
79	300607	拓斯达	11,859,009.80	2.56
80	002507	涪陵榨菜	11,647,880.17	2.51
81	601000	唐山港	11,647,843.40	2.51
82	000513	丽珠集团	11,645,582.37	2.51
83	002080	中材科技	11,566,401.33	2.50
84	000848	承德露露	11,542,726.89	2.49
85	300496	中科创达	11,485,284.43	2.48
86	603317	天味食品	11,475,869.00	2.48
87	002572	索菲亚	11,445,175.56	2.47
88	002250	联化科技	11,439,454.00	2.47
89	002416	爱施德	11,268,278.11	2.43
90	600026	中远海能	11,254,435.00	2.43
91	300498	温氏股份	11,238,575.00	2.43
92	600779	水井坊	11,232,229.39	2.43
93	000025	特力 A	11,148,333.30	2.41
94	000717	韶钢松山	11,113,172.50	2.40
95	600757	长江传媒	11,086,931.00	2.39
96	600325	华发股份	11,063,983.00	2.39
97	600970	中材国际	10,997,661.05	2.37
98	603881	数据港	10,883,158.40	2.35
99	601099	太平洋	10,836,864.00	2.34
100	600908	无锡银行	10,690,888.96	2.31
101	600380	健康元	10,676,174.95	2.31
102	002382	蓝帆医疗	10,580,417.67	2.28
103	603556	海兴电力	10,533,289.42	2.27
104	002013	中航机电	10,500,859.33	2.27
105	600141	兴发集团	10,489,093.16	2.26
106	600521	华海药业	10,482,101.66	2.26
107	300308	中际旭创	10,355,442.26	2.24
108	600167	联美控股	10,344,494.00	2.23
109	300435	中泰股份	10,282,710.00	2.22
110	000987	越秀金控	10,242,629.50	2.21
111	002124	天邦股份	10,212,836.92	2.20
112	002249	大洋电机	10,210,195.00	2.20
113	002371	北方华创	10,159,119.55	2.19
114	000060	中金岭南	10,137,213.47	2.19
115	600737	中粮糖业	9,994,365.28	2.16

116	002110	三钢闽光	9,899,479.06	2.14
117	300482	万孚生物	9,821,940.98	2.12
118	601689	拓普集团	9,789,639.25	2.11
119	002221	东华能源	9,747,970.86	2.10
120	600909	华安证券	9,736,350.75	2.10
121	601066	中信建投	9,656,017.58	2.08
122	600811	东方集团	9,622,707.30	2.08
123	002223	鱼跃医疗	9,572,104.06	2.07
124	600901	江苏租赁	9,553,588.00	2.06
125	300244	迪安诊断	9,508,514.10	2.05
126	300418	昆仑万维	9,397,559.17	2.03
127	000750	国海证券	9,377,329.11	2.02
128	601200	上海环境	9,314,691.71	2.01

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。

8.4.3 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	4,296,460,629.09
卖出股票的收入（成交）总额	4,147,851,849.35

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。

8.5 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	8,010,300.00	0.99
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	8,010,300.00	0.99

8.6 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	019627	20 国债 01	50,000	4,999,500.00	0.62
2	019645	20 国债 15	30,000	3,010,800.00	0.37

8.7 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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2101	IC2101	11.00	13,956,360.00	-35,280.00	-
公允价值变动总额合计					-35,280.00
股指期货投资本期收益					3,230,679.61
股指期货投资本期公允价值变动					-35,280.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	2,090,999.56
2	应收证券清算款	4,245,546.69
3	应收股利	-
4	应收利息	137,067.13
5	应收申购款	832,147.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,305,760.70

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	24,896	18,962.98	182,972,867.91	38.76%	289,129,421.50	61.24%
博时中证 500 指数增强 C	8,209	14,236.49	40,251,389.91	34.44%	76,615,967.11	65.56%
合计	32,800	17,956.39	223,224,257.82	37.90%	365,745,388.61	62.10%

9.2 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	1,500,745.88	0.32%
	博时中证 500 指数增强 C	130,241.66	0.11%
	合计	1,630,987.54	0.28%

9.3 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	-
	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	-
	博时中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§10 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	657,367,559.94	288,262,808.89
减：本报告期基金总赎回份额	482,268,785.39	324,404,115.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	472,102,289.41	116,867,357.02

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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；3、基金管理人于 2020 年 10 月 16 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》，江向阳先生不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英先生代任博时基金管理有限公司总经理职务；

4、基金管理人于 2021 年 2 月 6 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》，高阳先生任博时基金管理有限公司总经理。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。本报告期内本基金应付审计费 60,000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券	2	911,805,509.11	10.84%	666,804.00	10.84%	增加 2 个
中泰证券	1	885,271,768.04	10.52%	647,405.95	10.52%	增加 1 个
第一创业	1	655,716,869.24	7.80%	479,512.70	7.79%	-
长江证券	1	415,846,622.17	4.94%	304,111.51	4.94%	增加 1 个
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	2,036,296,192.55	24.21%	1,489,158.08	24.21%	增加 1 个
海通证券	4	311,594,213.11	3.70%	227,852.98	3.70%	增加 2 个
华泰证券	1	65,919,123.78	0.78%	48,207.31	0.78%	增加 1 个
银河证券	2	2,053,699,904.99	24.41%	1,501,977.27	24.42%	增加 2 个
广发证券	2	1,075,616,760.84	12.79%	786,594.72	12.79%	增加 1 个
方正证券	1	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 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
中信证券	1,283,681.05	11.05%	-	-	-	-
中泰证券	370,717.89	3.19%	-	-	-	-
第一创业	411,678.10	3.54%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	359,923.88	3.10%	-	-	-	-
海通证券	131,704.20	1.13%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	8,548,958.12	73.57%	-	-	-	-
广发证券	514,250.84	4.43%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	2020-12-28
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	2020-12-24
3	博时中证 500 指数增强型证券投资基金（博时中证 500 指数增强 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	2020-12-24
4	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-12-24

5	博时基金管理有限公司关于博时中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-12-24
6	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的上海银行快捷支付通道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	2020-12-22
7	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-12-10
8	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	2020-11-04
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 20201103	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-11-03
10	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年第 3 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	2020-10-28
11	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	2020-10-19
12	博时中证 500 指数增强型证券投资基金（博时中证 500 指数增强 C）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-19
13	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	2020-10-16
14	博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-14
15	博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-14
16	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-14
17	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-14
18	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通中信银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-12
19	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-09-30
20	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	2020-09-25
21	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 20200901	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-09-01
22	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年中期报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-08-31
23	博时中证 500 指数增强型证券投资基金	证券日报、基金管理人网站、证监会	2020-08-27

	(博时中证 500 指数增强 A) 基金产品资料概要更新	会基金电子披露网	
24	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	2020-08-27
25	博时基金管理有限公司关于暂停使用银联支付提供的中信银行、中国银行快捷支付通道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	2020-08-05
26	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国农业银行非快捷支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	2020-07-23
27	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年第 2 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	2020-07-21
28	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联提供的光大银行通道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	2020-07-09
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 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

13.1.2 《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》

13.1.3 《博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 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

13.1.6 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

13.3 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
二〇二一年三月三十一日