

博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告 2025 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：二〇二六年三月三十一日

§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 2026 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所(特殊普通合伙)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 2025 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 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 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 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 15 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| §6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计意见 | 15 |
| 6.2 形成审计意见的基础 | 16 |
| 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任 | 16 |
| 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任 | 16 |
| §7 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 资产负债表 | 17 |
| 7.2 利润表 | 19 |
| 7.3 净资产变动表 | 20 |
| 7.4 报表附注 | 22 |
| §8 投资组合报告 | 51 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 51 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 52 |
| 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 | 53 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 65 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 71 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 71 |
| 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 | 71 |
| 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 | 71 |
| 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 | 71 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 71 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 71 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 72 |
| §9 基金份额持有人信息 | 72 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 72 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 73 |
| 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 | 73 |
| §10 开放式基金份额变动 | 73 |
| §11 重大事件揭示 | 73 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 74 |
| 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 | 74 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 74 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 74 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 74 |
| 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 | 74 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 75 |
| 11.8 其他重大事件 | 77 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 79 |
| 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 | 80 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 80 |
| §13 备查文件目录 | 80 |
| 13.1 备查文件目录 | 80 |
| 13.2 存放地点 | 80 |
| 13.3 查阅方式 | 80 |

§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 | 238,979,440.95 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 | 164,239,613.26 份 | 74,739,827.69 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | <p>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%。</p> |
| 投资策略 | <p>本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>本基金的股票投资策略包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、指数化投资策略。本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。 2、投资组合构建和优化。本基金将以博时数量化模型对股票的回报预测为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。 3、指数增强策略。本基金主要通过博时数量化模型对股票进行综合评定，结合风险控制模型，在控制投资组合风险预算下，对股票组合进行优化，力争获得超越业绩比较基准的回报。 4、股票组合调整。包括定期和不定期调整。 |

| | |
|--------|--|
| | 5、存托凭证投资策略。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 其他投资策略包括：债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略以及融资及转融通证券出借业务投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | https://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 | 容诚会计师事务所(特殊普通合伙) | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26 |
| 注册登记机构 | 博时基金管理有限公司 | 北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301 |

§3 主要财务指标、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

1. 博时中证 500 指数增强 A:

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2025 年 | 2024 年 | 2023 年 |
|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 博时中证 500 指数增强 A | 博时中证 500 指数增强 A | 博时中证 500 指数增强 A |
| 本期已实现收益 | 69,703,280.60 | 29,770,765.42 | -21,763,158.15 |
| 本期利润 | 88,949,281.22 | 28,086,627.36 | -18,222,039.15 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4046 | 0.1059 | -0.0660 |
| 本期加权平均净值利润率 | 28.44% | 9.04% | -5.26% |
| 本期基金份额净值增长率 | 32.51% | 9.17% | -5.43% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末 | 2024 年末 | 2023 年末 |
| | 博时中证 500 指数增强 A | 博时中证 500 指数增强 A | 博时中证 500 指数增强 A |
| 期末可供分配利润 | 109,193,704.25 | 74,361,660.17 | 46,885,512.17 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6648 | 0.2790 | 0.1716 |
| 期末基金资产净值 | 278,349,563.52 | 340,857,515.11 | 320,031,685.84 |
| 期末基金份额净值 | 1.6948 | 1.2790 | 1.1716 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2025 年末 | 2024 年末 | 2023 年末 |
| | 博时中证 500 指数增强 A | 博时中证 500 指数增强 A | 博时中证 500 指数增强 A |
| 基金份额累计净值增长率 | 69.48% | 27.90% | 17.16% |

2. 博时中证 500 指数增强 C:

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2025 年 | 2024 年 | 2023 年 |
|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 博时中证 500 指数增强 C | 博时中证 500 指数增强 C | 博时中证 500 指数增强 C |
| 本期已实现收益 | 25,889,635.43 | 9,000,770.45 | -7,078,517.68 |
| 本期利润 | 29,543,467.07 | 10,017,224.97 | -5,748,711.73 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3747 | 0.1163 | -0.0650 |
| 本期加权平均净值利润率 | 26.67% | 10.18% | -5.29% |
| 本期基金份额净值增长率 | 31.98% | 8.72% | -5.81% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末 | 2024 年末 | 2023 年末 |
| | 博时中证 500 指数增强 C | 博时中证 500 指数增强 C | 博时中证 500 指数增强 C |
| 期末可供分配利润 | 45,946,543.14 | 20,782,742.73 | 12,920,512.56 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6148 | 0.2451 | 0.1452 |
| 期末基金资产净值 | 122,818,264.20 | 105,560,698.34 | 101,923,328.29 |
| 期末基金份额净值 | 1.6433 | 1.2451 | 1.1452 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2025 年末 | 2024 年末 | 2023 年末 |
| | 博时中证 500 指数增强 C | 博时中证 500 指数增强 C | 博时中证 500 指数增强 C |

| | | | |
|-------------|--------|--------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | 67.87% | 27.19% | 16.99% |
|-------------|--------|--------|--------|

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 | -1.42% | 1.11% | 0.71% | 1.18% | -2.13% | -0.07% |
| 过去六个月 | 24.41% | 1.06% | 24.81% | 1.11% | -0.40% | -0.05% |
| 过去一年 | 32.51% | 1.16% | 28.81% | 1.20% | 3.70% | -0.04% |
| 过去三年 | 36.80% | 1.25% | 26.25% | 1.30% | 10.55% | -0.05% |
| 过去五年 | 22.86% | 1.22% | 16.99% | 1.23% | 5.87% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 69.48% | 1.30% | 15.46% | 1.31% | 54.02% | -0.01% |

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 | -1.52% | 1.11% | 0.71% | 1.18% | -2.23% | -0.07% |
| 过去六个月 | 24.15% | 1.06% | 24.81% | 1.11% | -0.66% | -0.05% |
| 过去一年 | 31.98% | 1.16% | 28.81% | 1.20% | 3.17% | -0.04% |
| 过去三年 | 35.16% | 1.25% | 26.25% | 1.30% | 8.91% | -0.05% |
| 过去五年 | 20.41% | 1.22% | 16.99% | 1.23% | 3.42% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 67.87% | 1.30% | 21.97% | 1.32% | 45.90% | -0.02% |

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

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

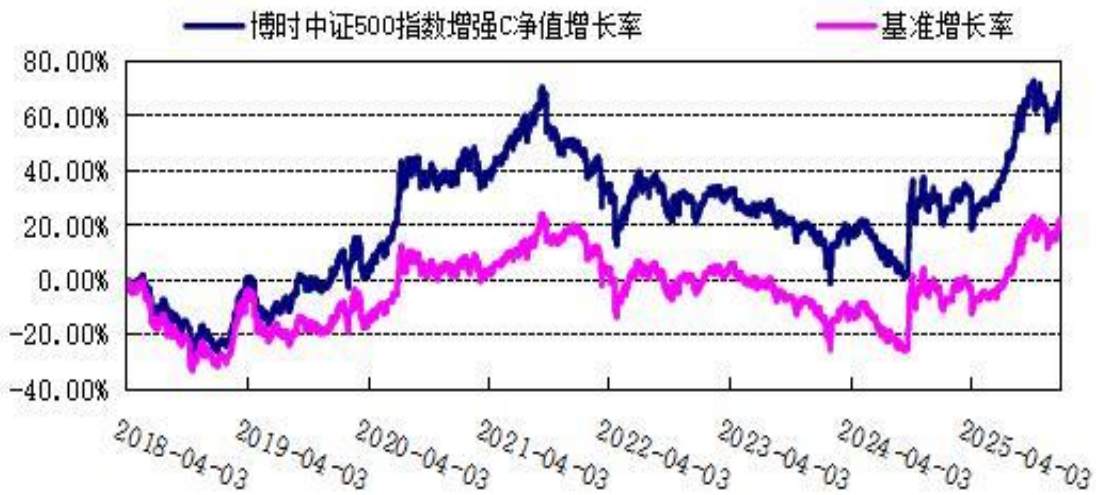
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 9 月 26 日至 2025 年 12 月 31 日)

1、博时中证 500 指数增强 A



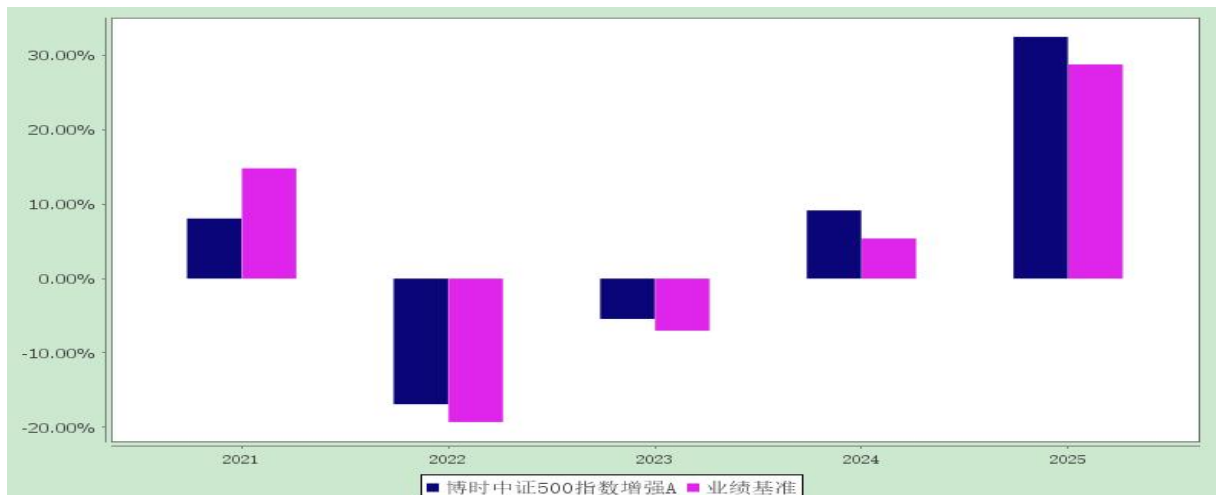
2、博时中证 500 指数增强 C



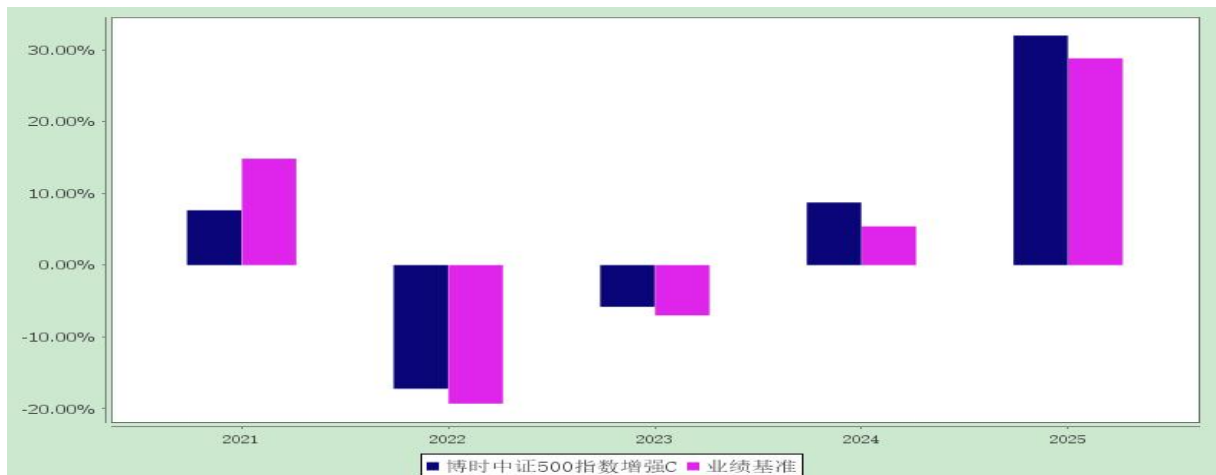
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年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



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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 403 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 16746 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6938 亿元人民币，累计分红逾 2258 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

9 月，深圳市证券业协会召开深圳资本市场投教讲师工作交流会，举行投教讲师聘任仪式，博时基金 16 位员工获颁“深圳资本市场投资者教育讲师”聘书。

12 月，深圳市证券业协会授予博时基金“突出贡献单位”荣誉证书，授予博时基金投教基地“优秀投资者教育基地”荣誉证书，表彰公司在 2025 年度投资者教育工作中积极有为，表现优异。2025 年度，博时基金共四位员工获得“优秀投教讲师”荣誉证书。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--------------------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘钊 | 指数与量化投资部投资副总监/基金经理 | 2020-12-23 | - | 19.3 | 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。曾任博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日-2024 年 7 月 10 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日—至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日—至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日—至今)的基金经理。 |

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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机制，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 37 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年，在货币政策精准发力、经济高质量发展稳步推进、外围降息预期逐步兑现等因素的协同作用下，A 股市场延续结构性行情，呈现“成长领跑、分化加剧”的特点，成为产业升级与流动性宽松共振下的结构性收获之年。

首先是货币政策，2025 年央行坚持“总量增长、结构优化”的导向，精准实施流动性调节，全年下调一次存款准备金率、两次 LPR，持续释放长期流动性，助力金融体系加大对实体经济的支持力度。同时，央行货币政策表述延续“适度宽松”基调，进一步强化“宽货币”向“宽信用”的传导效能，明确聚焦实体经济重点领域和薄弱环节，推动社会综合融资成本稳步下行，2025 年 12 月新发放企业贷款和新发放个人住房贷款加权平均利率均降至约 3.1%。伴随着政策发力，银行净息差逐步企稳，10 年期国债利率稳中有降，流动性充裕的格局持续巩固。

其次是财政政策及其他宏观调控，2025 年实施了更积极有为的财政政策，与货币政策协同发力。财政赤字率按 4% 左右安排，新增政府债务 11.86 万亿元，发行超长期等各类特别国债，加大税费减免力度，同时强化民生与促消费投入，推进地方化债、激发民间投资活力，稳定房地产市场，为经济基本面回升筑牢政策支撑，推动财政与产业、区域政策融合，提升调控精准度。

在货币、财政等宏观调控政策协同赋能下，2025 年经济基本面稳步回升。根据国家统计局的数据，2025 年全年 GDP 首次跃上 140 万亿元新台阶，同比增长 5.0%，分季度呈现“前高后稳”态势。物价回升、核心 CPI 温和上行，规模以上工业企业利润转正，出口同时发力。据海关总署及中国汽车工业协会数据，2025 年新能源汽车出口同比增长 100%，表现亮眼。居民收入与经济增长同步，

消费潜力持续释放。

外围方面，美联储于 2025 年 9 月、10 月、12 月先后三次降息，全年合计降息 75 个基点，并于 12 月 1 日起结束缩表。随着外围利率实际下行、美元走弱，新兴市场资本外流的压力有所缓解，为国内货币政策调整打开空间。但临近 2025 年底，受美国 12 月非农数据、通胀数据边际变化及美联储内部意见分歧等因素影响，市场对 2026 年美联储降息的时点和幅度预期降温，回归理性。

在上述背景下，A 股市场延续牛市格局，但结构性特征明显，主要宽基指数涨幅并不统一，呈现“小盘领跑、大盘跟涨”的特征，与 2024 年大盘指数涨幅居前的格局形成鲜明对比。全年沪深 300 指数上涨 17.66%，本基金业绩基准跟踪的中证 500 指数上涨 30.39%，中证 1000 指数上涨 27.49%，中证 2000 指数上涨 36.42%，小盘股的成长性优势得到充分释放。

2025 年全年，本基金坚持以风险控制为前提，严格限制行业和个股的风险暴露，控制基金与中证 500 指数的跟踪误差，立足量化多因子模型，平衡配置各因子，适度调高了成长因子的比重，取得了相对稳定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.6948 元，份额累计净值为 1.6948 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.6433 元，份额累计净值为 1.6433 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 32.51%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 31.98%，同期业绩基准增长率为 28.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，我们认为 A 股市场仍将延续结构性行情，市场风格虽较 2025 年适度偏向均衡，但成长或仍是核心主线，整体呈现“稳中有进、分化收敛”的格局，投资机会与挑战并存。国内宏观环境持续向好，经济正从温和复苏稳步转向提质增效，“十五五”开局之年的政策红利将逐步释放，货币与财政政策协同发力，重点推动物价合理回升、化解供强需弱矛盾。国际层面，美联储降息节奏回归理性，降息预期较 2025 年底有所缓和，但地区冲突、逆全球化趋势以及全球经济复苏动能分化等因素，仍将为全年宏观走势增添不确定性。无论外部环境如何波动，中国经济结构转型与产业升级的步伐不会停滞，新质生产力培育将成为驱动经济增长的核心力量。2025 年 AI、人形机器人等领域积累的技术突破与产业基础，将在 2026 年持续释放发展动能，新能源、新材料等新兴增长点也蓄势待发。其中，人工智能技术的深度应用将持续渗透全产业链，不断带动全社会生产效率提升，为国民经济高质量增长提供强劲支撑。在政策环境稳定、经济提质增效预期增强的背景下，2026 年 A 股市场投资机会大于风险，市场流动性有望保持充裕。其中居民储蓄资金稳步入市，机构长期资金的配置力度进一步加大，叠加宏观政策持续注入基础流动性、海外资金对 A 股配置需求提升，多

重力量有望共同支撑市场流动性宽松的格局。具体到风格特征，我们认为，2026 年或将继续以成长为主导，虽然相较 2025 年的程度有所下降，但仍是首要布局方向。其中，AI 及相关产业链作为新质生产力的核心载体，需置于重点关注。行业配置可围绕这一核心主线展开：一是深耕以 AI 及产业链为核心的科技高端制造赛道，挖掘细分领域投资机遇；二是关注受益于扩内需政策的消费板块；三是布局传统产业优化升级受益领域，同时需警惕估值陷阱，适度回避虽然低估值但低成长甚至负增长标的。综上所述，我们将以积极的心态看待 2026 年 A 股市场的投资机会。2026 年本基金将继续严格限制行业和个股的风险暴露，控制跟踪误差，坚持暴露长期有效的因子，平衡配置各因子权重，适度超配成长类因子，力争持续跑赢业绩基准。

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，持续健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；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、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规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，发现违规隐患及时提示有关业务人员并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出独立客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《博时基金风险管理与内部控制管理制度》《博时基金合规管理制度》《博时基金问责管理制度》《博时基金关联交易管理制度》《博时基金洗钱风险管理制度》《博时基金销售管理制度》《博时基金私募资产管理业务基本制度》《博时基金信息技术管理制度》《博时基金管理有限责任公司交易管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，探索完善“合规管理平台”中应用模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，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《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并积极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

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本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）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

容诚审字[2026]200Z1558 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

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”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

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。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则,我们独立于博时中证 500 指数增强,并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定,同时履行了职业道德方面的其他责任。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。

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:

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 评价财务报表的总体列报、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。

容诚会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
 张振波 吴琳杰
 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
 2026 年 3 月 27 日

§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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 23,505,615.40 | 26,230,970.79 |
| 结算备付金 | | 3,792,044.12 | 4,287,365.72 |
| 存出保证金 | | 75,257.32 | 73,812.02 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 374,097,132.99 | 417,306,846.81 |
| 其中：股票投资 | | 374,097,132.99 | 417,306,846.81 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | 135,330.02 | 3,678,328.53 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,237,252.73 | 675,543.66 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 403,842,632.58 | 452,252,867.53 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 308.10 | 3,773,373.85 |
| 应付赎回款 | | 1,726,094.35 | 865,390.16 |
| 应付管理人报酬 | | 333,705.42 | 383,473.30 |
| 应付托管费 | | 66,741.09 | 76,694.68 |
| 应付销售服务费 | | 40,428.87 | 36,850.90 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 0.53 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 507,527.03 | 698,870.66 |
| 负债合计 | | 2,674,804.86 | 5,834,654.08 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 238,979,440.95 | 351,273,810.55 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | 162,188,386.77 | 95,144,402.90 |
| 净资产合计 | | 401,167,827.72 | 446,418,213.45 |
| 负债和净资产总计 | | 403,842,632.58 | 452,252,867.53 |

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 238,979,440.95 份。其中 A 类基金份额净值 1.6948 元，基金份额总额 164,239,613.26 份；C 类基金份额净值 1.6433 元，基金份额总额 74,739,827.69

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------------------|----------|---|--|
| 一、营业总收入 | | 124,241,936.45 | 43,778,165.98 |
| 1.利息收入 | | 119,975.32 | 152,711.64 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 119,975.32 | 152,711.64 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 101,106,852.89 | 44,258,420.65 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | 94,645,318.16 | 36,818,440.76 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | 219,147.16 | 33,185.67 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.13 | - | -11,181.52 |
| 股利收益 | 7.4.7.14 | 6,242,387.57 | 7,417,975.74 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有） | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.15 | 22,899,832.26 | -667,683.54 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 115,275.98 | 34,717.23 |
| 减：二、营业总支出 | | 5,749,188.16 | 5,674,313.65 |
| 1. 管理人报酬 | | 4,243,898.26 | 4,095,230.30 |
| 其中：暂估管理人报酬（若有） | | - | - |
| 2. 托管费 | | 848,779.72 | 819,046.05 |
| 3. 销售服务费 | | 443,798.30 | 394,702.68 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.17 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 0.12 | 0.05 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.18 | 212,711.76 | 365,334.57 |

| | | | |
|---------------------|--|-----------------------|----------------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 118,492,748.29 | 38,103,852.33 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 118,492,748.29 | 38,103,852.33 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 118,492,748.29 | 38,103,852.33 |

7.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|--|--|-----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 351,273,810.55 | 95,144,402.90 | 446,418,213.45 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 351,273,810.55 | 95,144,402.90 | 446,418,213.45 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -112,294,369.60 | 67,043,983.87 | -45,250,385.73 |
| （一）、综合收益总额 | - | 118,492,748.29 | 118,492,748.29 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -112,294,369.60 | -51,448,764.42 | -163,743,134.02 |
| 其中：1.基金申购款 | 136,876,989.01 | 65,183,518.86 | 202,060,507.87 |
| 2.基金赎回款 | -249,171,358.61 | -116,632,283.28 | -365,803,641.89 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - |
| （四）、其他综合 | - | - | - |

| | | | |
|--|----------------------------------|----------------|-----------------|
| 收益结转留存收益 | | | |
| 四、本期期末净资产 | 238,979,440.95 | 162,188,386.77 | 401,167,827.72 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 362,148,989.40 | 59,806,024.73 | 421,955,014.13 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 362,148,989.40 | 59,806,024.73 | 421,955,014.13 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -10,875,178.85 | 35,338,378.17 | 24,463,199.32 |
| （一）、综合收益总额 | - | 38,103,852.33 | 38,103,852.33 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -10,875,178.85 | -2,765,474.16 | -13,640,653.01 |
| 其中：1.基金申购款 | 128,254,195.82 | 25,954,703.15 | 154,208,898.97 |
| 2.基金赎回款 | -139,129,374.67 | -28,720,177.31 | -167,849,551.98 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 351,273,810.55 | 95,144,402.90 | 446,418,213.45 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

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》准予注册，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 383,070,076.74 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2017）第 344 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 383,128,088.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 58,011.66 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证 500 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×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 2026 年 3 月 27 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：(i) 以摊余成本计量：本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。(ii) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为

交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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。由于基金

份额拆分/合并/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/合并/折算日根据拆分/合并/折算前的基金份额数及确定的拆分/合并/折算比例计算认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；（2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；（3）该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；（4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，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净资产转出。

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，对于流通受限股票、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）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《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）》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于

国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----------------|------------------|------------------|
| | 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 12 月 31 日 |
| 活期存款 | 23,505,615.40 | 26,230,970.79 |
| 等于：本金 | 23,503,328.00 | 26,227,625.61 |
| 加：应计利息 | 2,287.40 | 3,345.18 |
| 定期存款 | - | - |
| 等于：本金 | - | - |
| 加：应计利息 | - | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 等于：本金 | - | - |
| 加：应计利息 | - | - |
| 合计 | 23,505,615.40 | 26,230,970.79 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|---------------|------------------|------|----------------|----------------|
| | 2025 年 12 月 31 日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 362,476,923.74 | - | 374,097,132.99 | 11,620,209.25 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 362,476,923.74 | - | 374,097,132.99 | 11,620,209.25 |
| 项目 | 上年度末 | | | |
| | 2024 年 12 月 31 日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 428,586,469.82 | - | 417,306,846.81 | -11,279,623.01 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |

| | | | | | |
|--------|-------|----------------|---|----------------|----------------|
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 428,586,469.82 | - | 417,306,846.81 | -11,279,623.01 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 1,420.06 | 186.49 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 304,217.73 | 340,684.17 |
| 其中：交易所市场 | 304,217.73 | 340,684.17 |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 158,000.00 | 158,000.00 |
| 应付指数使用费 | 43,889.24 | 200,000.00 |
| 合计 | 507,527.03 | 698,870.66 |

7.4.7.7 实收基金

博时中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|------|--|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 266,495,854.94 | 266,495,854.94 |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期申购 | 69,090,576.43 | 69,090,576.43 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -171,346,818.11 | -171,346,818.11 |
| 本期末 | 164,239,613.26 | 164,239,613.26 |

博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 84,777,955.61 | 84,777,955.61 |
| 本期申购 | 67,786,412.58 | 67,786,412.58 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -77,824,540.50 | -77,824,540.50 |
| 本期末 | 74,739,827.69 | 74,739,827.69 |

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)。

7.4.7.8 未分配利润
博时中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 83,036,921.32 | -8,675,261.15 | 74,361,660.17 |
| 本期期初 | 83,036,921.32 | -8,675,261.15 | 74,361,660.17 |
| 本期利润 | 69,703,280.60 | 19,246,000.62 | 88,949,281.22 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -43,546,497.67 | -5,654,493.46 | -49,200,991.13 |
| 其中：基金申购款 | 28,926,153.50 | 2,583,080.19 | 31,509,233.69 |
| 基金赎回款 | -72,472,651.17 | -8,237,573.65 | -80,710,224.82 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 109,193,704.25 | 4,916,246.01 | 114,109,950.26 |

博时中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 23,519,861.37 | -2,737,118.64 | 20,782,742.73 |
| 本期期初 | 23,519,861.37 | -2,737,118.64 | 20,782,742.73 |
| 本期利润 | 25,889,635.43 | 3,653,831.64 | 29,543,467.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,462,953.66 | 1,215,180.37 | -2,247,773.29 |
| 其中：基金申购款 | 29,253,337.21 | 4,420,947.96 | 33,674,285.17 |
| 基金赎回款 | -32,716,290.87 | -3,205,767.59 | -35,922,058.46 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 45,946,543.14 | 2,131,893.37 | 48,078,436.51 |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 87,156.28 | 89,570.09 |
| 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 | 32,008.25 | 61,997.47 |
| 其他 | 810.79 | 1,144.08 |
| 合计 | 119,975.32 | 152,711.64 |

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 卖出股票成交总额 | 3,065,244,772.86 | 2,652,000,733.81 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,967,456,453.25 | 2,611,085,875.93 |
| 减：交易费用 | 3,143,001.45 | 4,096,417.12 |
| 买卖股票差价收入 | 94,645,318.16 | 36,818,440.76 |

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 35.60 | 19.94 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 219,111.56 | 33,165.73 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 219,147.16 | 33,185.67 |

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 656,874.46 | 206,194.45 |
| 减：卖出债券（债转股及债 | 437,700.00 | 173,000.00 |

| | | |
|-------------|------------|-----------|
| 券到期兑付) 成本总额 | | |
| 减: 应计利息总额 | 36.62 | 20.48 |
| 减: 交易费用 | 26.28 | 8.24 |
| 买卖债券差价收入 | 219,111.56 | 33,165.73 |

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 股指期货投资收益 | - | -11,181.52 |

7.4.7.14 股利收益

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 6,242,387.57 | 7,417,975.74 |
| 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 | 6,242,387.57 | 7,417,975.74 |

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位: 人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 22,899,832.26 | -667,683.54 |
| ——股票投资 | 22,899,832.26 | -667,683.54 |
| ——债券投资 | - | - |
| ——资产支持证券投资 | - | - |

| | | |
|------------------------|---------------|-------------|
| ——基金投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | 22,899,832.26 | -667,683.54 |

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 基金赎回费收入 | 81,569.60 | 27,809.37 |
| 基金转换费收入 | 33,706.38 | 6,907.86 |
| 合计 | 115,275.98 | 34,717.23 |

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 审计费用 | 38,000.00 | 38,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 其他 | 634.04 | 299.57 |
| 银行汇划费 | 10,188.48 | 7,035.00 |
| 指数使用费 | 43,889.24 | 200,000.00 |
| 合计 | 212,711.76 | 365,334.57 |

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 |
| 浙江省国际贸易集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 浙江省国贸集团资产经营有限公司 | 基金管理人的原股东 |
| 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（“博时资本”） | 基金管理人的子公司 |
| 博时财富基金销售有限公司（“博时财富”） | 基金管理人的子公司 |
| 博时基金（国际）有限公司（“博时国际”） | 基金管理人的子公司 |
| 海南博时创新管理有限公司（“博时创新”） | 基金管理人的子公司 |

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，基金管理人原股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的 2%股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。上述股东变更事项已于 2024 年 12 月 24 日完成工商变更登记。

3.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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 237,275,888.48 | 3.98% | 618,586,480.34 | 11.71% |

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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 | 48,915.46 | 3.98% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 432,620.76 | 17.79% | - | - |

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

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|---|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,243,898.26 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,586,845.60 | 1,431,754.66 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 2,657,052.66 | 2,663,475.64 |

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
|----|--|---|
| | 当期发生的基金应支付的托管费 | 848,779.72 |

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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 |
| 招商证券 | - | 536.91 | 536.91 |
| 博时基金 | - | 36,862.10 | 36,862.10 |
| 合计 | - | 37,399.01 | 37,399.01 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 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 |
| 招商证券 | - | 18.68 | 18.68 |
| 博时基金 | - | 44,814.51 | 44,814.51 |
| 合计 | - | 44,833.19 | 44,833.19 |

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：

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 23,505,615.40 | 87,156.28 | 26,230,970.79 | 89,570.09 |

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

金额单位：人民币元

| 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | | | | |
|---|--------|------|------|------------|------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 招商证券股份有限公司 | 001388 | 信通电子 | 网下发行 | 937.00 | 15,385.54 |
| 招商证券股份有限公司 | 301632 | 广东建科 | 网下发行 | 6,557.00 | 43,013.92 |
| 招商证券股份有限公司 | 001386 | 马可波罗 | 网下发行 | 3,705.00 | 50,943.75 |
| 招商证券股份有限公司 | 301638 | 南网数字 | 网下发行 | 15,508.00 | 88,240.52 |
| 招商证券股份有限公司 | 301449 | 天溯计量 | 网下发行 | 1,118.00 | 41,142.40 |
| 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 招商证券股份有限公司 | 688692 | 达梦数据 | 网下发行 | 1,326.00 | 115,308.96 |
| 招商证券股份有限公司 | 301631 | 壹连科技 | 网下发行 | 1,525.00 | 111,309.75 |

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（2025 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 | 证 | 成功 | 受 | 流通 | 认购 | 期末 | 数量(单 | 期末 | 期末 | 备 |

| 代码 | 券名称 | 认购日 | 限期 | 受限类型 | 价格 | 估值单价 | 位：股) | 成本总额 | 估值总额 | 注 |
|--------|------|------------|------|----------|--------|--------|-----------|------------|------------|---|
| 688802 | 沐曦股份 | 2025-12-09 | 9 个月 | 首次公开发售限售 | 104.66 | 399.40 | 1,032.00 | 108,009.12 | 412,180.80 | - |
| 600930 | 华电新能 | 2025-07-09 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 3.18 | 6.24 | 65,821.00 | 209,310.78 | 410,723.04 | - |
| 301656 | 联合动力 | 2025-09-17 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 12.48 | 25.46 | 2,598.00 | 32,423.04 | 66,145.08 | - |
| 001280 | 中国铀业 | 2025-11-25 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 17.89 | 45.36 | 1,442.00 | 25,797.38 | 65,409.12 | - |
| 688729 | 屹唐股份 | 2025-07-01 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 8.45 | 24.28 | 1,817.00 | 15,353.65 | 44,116.76 | - |
| 688809 | 强一股份 | 2025-12-23 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 85.09 | 203.31 | 112.00 | 9,530.08 | 22,770.72 | - |
| 301638 | 南网数字 | 2025-11-11 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 5.69 | 14.21 | 1,551.00 | 8,825.19 | 22,039.71 | - |
| 001386 | 马可波罗 | 2025-10-15 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 13.75 | 18.53 | 1,112.00 | 15,290.00 | 20,605.36 | - |
| 688727 | 恒坤新材 | 2025-11-11 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 14.99 | 34.87 | 563.00 | 8,439.37 | 19,631.81 | - |
| 688807 | 优迅股份 | 2025-12-10 | 6 个月 | 首次公开发售限售 | 51.66 | 135.56 | 131.00 | 6,767.46 | 17,758.36 | - |
| 301632 | 广 | 2025-08-05 | 6 个月 | 首次 | 6.56 | 23.68 | 656.00 | 4,303.36 | 15,534.08 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------------|-------|--------|--------|-----------|-----------|---|--|
| | 东建科 | | 月 | 公开发 行限售 | | | | | | | |
| 301563 | 云汉芯城 | 2025-09-23 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 27.00 | 133.69 | 110.00 | 2,970.00 | 14,705.90 | - | |
| 688796 | 百奥赛图 | 2025-12-02 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 26.68 | 42.25 | 338.00 | 9,017.84 | 14,280.50 | - | |
| 301491 | 汉桑科技 | 2025-07-29 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 28.91 | 55.11 | 245.00 | 7,082.95 | 13,501.95 | - | |
| 001233 | 海安集团 | 2025-11-18 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 48.00 | 51.88 | 246.00 | 11,808.00 | 12,762.48 | - | |
| 301584 | 建发致新 | 2025-09-18 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 7.05 | 26.82 | 447.00 | 3,151.35 | 11,988.54 | - | |
| 301609 | 山大电力 | 2025-07-16 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 14.66 | 40.99 | 277.00 | 4,060.82 | 11,354.23 | - | |
| 301687 | 新广益 | 2025-12-24 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 21.93 | 54.39 | 195.00 | 4,276.35 | 10,606.05 | - | |
| 001221 | 悍高集团 | 2025-07-23 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 15.43 | 56.94 | 160.00 | 2,468.80 | 9,110.40 | - | |
| 301667 | 纳百川 | 2025-12-10 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 22.63 | 57.07 | 151.00 | 3,417.13 | 8,617.57 | - | |
| 688805 | 健信超导 | 2025-12-17 | 6个月 | 首次公开发 行限售 | 18.58 | 32.37 | 265.00 | 4,923.70 | 8,578.05 | - | |
| 603175 | 超 | 2025-10-17 | 6个月 | 首次 | 17.08 | 48.56 | 169.00 | 2,886.52 | 8,206.64 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|--------|----------|----------|---|
| | 颖电子 | | 月 | 公开发售 | | | | | | |
| 001369 | 双欣环保 | 2025-12-23 | 6个月 | 首次公开发售 | 6.85 | 12.89 | 611.00 | 4,185.35 | 7,875.79 | - |
| 301449 | 天溯计量 | 2025-12-16 | 6个月 | 首次公开发售 | 36.80 | 65.23 | 112.00 | 4,121.60 | 7,305.76 | - |
| 601026 | 道生天合 | 2025-10-09 | 6个月 | 首次公开发售 | 5.98 | 14.28 | 451.00 | 2,696.98 | 6,440.28 | - |
| 301575 | 艾芬达 | 2025-09-03 | 6个月 | 首次公开发售 | 27.69 | 49.55 | 126.00 | 3,488.94 | 6,243.30 | - |
| 603406 | 天富龙 | 2025-07-30 | 6个月 | 首次公开发售 | 23.60 | 40.16 | 153.00 | 3,610.80 | 6,144.48 | - |
| 603418 | 友升股份 | 2025-09-16 | 6个月 | 首次公开发售 | 46.36 | 59.06 | 102.00 | 4,728.72 | 6,024.12 | - |
| 603092 | 德力佳 | 2025-10-30 | 6个月 | 首次公开发售 | 46.68 | 55.66 | 104.00 | 4,854.72 | 5,788.64 | - |
| 001285 | 瑞立科密 | 2025-09-23 | 6个月 | 首次公开发售 | 42.28 | 56.08 | 101.00 | 4,270.28 | 5,664.08 | - |
| 603262 | 技源集团 | 2025-07-16 | 6个月 | 首次公开发售 | 10.88 | 28.10 | 155.00 | 1,686.40 | 4,355.50 | - |
| 603248 | 锡华科技 | 2025-12-16 | 6个月 | 首次公开发售 | 10.10 | 16.30 | 260.00 | 2,626.00 | 4,238.00 | - |
| 001388 | 信 | 2025-06-24 | 6个月 | 首次 | 16.42 | 42.94 | 94.00 | 1,543.48 | 4,036.36 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|--------|----------|----------|---|
| | 通电子 | | 月 | 公开发售 | | | | | | |
| 603370 | 华新精科 | 2025-08-27 | 6个月 | 首次公开发售 | 18.60 | 46.35 | 82.00 | 1,525.20 | 3,800.70 | - |
| 603376 | 大明电子 | 2025-10-28 | 6个月 | 首次公开发售 | 12.55 | 26.21 | 111.00 | 1,393.05 | 2,909.31 | - |
| 603334 | 丰倍生物 | 2025-10-29 | 6个月 | 首次公开发售 | 24.49 | 32.82 | 88.00 | 2,155.12 | 2,888.16 | - |
| 001396 | 誉帆科技 | 2025-12-23 | 6个月 | 首次公开发售 | 22.29 | 35.39 | 69.00 | 1,538.01 | 2,441.91 | - |

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

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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

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

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

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主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金

管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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 2025 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------------|----------------------|-------|-------|-----------------------|-----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 23,505,615.40 | - | - | - | 23,505,615.40 |
| 结算备付金 | 3,792,044.12 | - | - | - | 3,792,044.12 |
| 存出保证金 | 75,257.32 | - | - | - | 75,257.32 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 374,097,132.99 | 374,097,132.99 |
| 应收清算款 | - | - | - | 135,330.02 | 135,330.02 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,237,252.73 | 2,237,252.73 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 27,372,916.84 | - | - | 376,469,715.74 | 403,842,632.58 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,726,094.35 | 1,726,094.35 |
| 应付清算款 | - | - | - | 308.10 | 308.10 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 333,705.42 | 333,705.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | 66,741.09 | 66,741.09 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 40,428.87 | 40,428.87 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 507,527.03 | 507,527.03 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,674,804.86 | 2,674,804.86 |
| 利率敏感度缺口 | 27,372,916.84 | - | - | 373,794,910.88 | 401,167,827.72 |
| 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 26,230,970.79 | - | - | - | 26,230,970.79 |
| 结算备付金 | 4,287,365.72 | - | - | - | 4,287,365.72 |
| 存出保证金 | 73,812.02 | - | - | - | 73,812.02 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 417,306,846.81 | 417,306,846.81 |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,678,328.53 | 3,678,328.53 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 675,543.66 | 675,543.66 |

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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|--------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------|

| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|---------------|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 374,097,132.99 | 93.25 | 417,306,846.81 | 93.48 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 374,097,132.99 | 93.25 | 417,306,846.81 | 93.48 |

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

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 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 2,339 | 增加约 2,167 |
| 业绩比较基准下降 5% | 减少约 2,339 | 减少约 2,167 | |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 372,780,349.45 | 416,724,594.39 |
| 第二层次 | - | 27,736.50 |
| 第三层次 | 1,316,783.54 | 554,515.92 |

| | | |
|----|----------------|----------------|
| 合计 | 374,097,132.99 | 417,306,846.81 |
|----|----------------|----------------|

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|--|---|--------------|--------------|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | 554,515.92 | 554,515.92 |
| 当期购买 | - | 728,893.29 | 728,893.29 |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | 1,185,448.09 | 1,185,448.09 |
| 当期利得或损失总额 | - | 1,218,822.42 | 1,218,822.42 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 1,218,822.42 | 1,218,822.42 |
| 计入其他综合收益的利得或损失（若有） | - | - | - |
| 期末余额 | - | 1,316,783.54 | 1,316,783.54 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 772,246.00 | 772,246.00 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | | |
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | 941,752.69 | 941,752.69 |
| 当期购买 | - | 427,577.30 | 427,577.30 |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | 1,168,838.25 | 1,168,838.25 |
| 当期利得或损失总额 | - | 354,024.18 | 354,024.18 |

| | | | |
|--|---|------------|------------|
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 354,024.18 | 354,024.18 |
| 计入其他综合收益的利得或损失（若有） | - | - | - |
| 期末余额 | - | 554,515.92 | 554,515.92 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 326,856.91 | 326,856.91 |

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|------|--------------|------------|---------|----------------|------------|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 股票投资 | 1,316,783.54 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 16.28%-307.91% | 负相关 |
| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 股票投资 | 554,515.92 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 26.65%-574.44% | 负相关 |

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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 | 374,097,132.99 | 92.63 |
| | 其中：股票 | 374,097,132.99 | 92.63 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 27,297,659.52 | 6.76 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,447,840.07 | 0.61 |
| 9 | 合计 | 403,842,632.58 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 | 331,193.00 | 0.08 |
| B | 采矿业 | 18,554,266.02 | 4.63 |
| C | 制造业 | 241,218,975.00 | 60.13 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,811,126.44 | 3.94 |
| E | 建筑业 | 476,018.00 | 0.12 |
| F | 批发和零售业 | 19,618,282.22 | 4.89 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,373,581.00 | 0.59 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 28,484,620.26 | 7.10 |
| J | 金融业 | 26,292,782.00 | 6.55 |
| K | 房地产业 | 5,828,698.60 | 1.45 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,743,433.00 | 0.43 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,665,519.25 | 1.41 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,303,821.00 | 0.33 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 91,975.00 | 0.02 |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,118,642.20 | 0.28 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,184,200.00 | 1.29 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 374,097,132.99 | 93.25 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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 | 000783 | 长江证券 | 700,700 | 5,710,705.00 | 1.42 |
| 2 | 600909 | 华安证券 | 793,200 | 5,377,896.00 | 1.34 |
| 3 | 600549 | 厦门钨业 | 128,900 | 5,292,634.00 | 1.32 |
| 4 | 000887 | 中鼎股份 | 212,600 | 4,934,446.00 | 1.23 |
| 5 | 603233 | 大参林 | 279,600 | 4,926,552.00 | 1.23 |
| 6 | 002281 | 光迅科技 | 66,700 | 4,665,665.00 | 1.16 |
| 7 | 600098 | 广州发展 | 708,200 | 4,631,628.00 | 1.15 |
| 8 | 002436 | 兴森科技 | 218,700 | 4,629,879.00 | 1.15 |
| 9 | 600988 | 赤峰黄金 | 147,100 | 4,595,404.00 | 1.15 |
| 10 | 000060 | 中金岭南 | 778,400 | 4,553,640.00 | 1.14 |
| 11 | 600873 | 梅花生物 | 447,100 | 4,529,123.00 | 1.13 |
| 12 | 002414 | 高德红外 | 303,320 | 4,449,704.40 | 1.11 |
| 13 | 002008 | 大族激光 | 104,600 | 4,308,474.00 | 1.07 |
| 14 | 002841 | 视源股份 | 108,200 | 4,287,966.00 | 1.07 |
| 15 | 600848 | 上海临港 | 351,000 | 4,106,700.00 | 1.02 |
| 16 | 603379 | 三美股份 | 67,300 | 4,086,456.00 | 1.02 |
| 17 | 600998 | 九州通 | 798,100 | 4,086,272.00 | 1.02 |
| 18 | 000733 | 振华科技 | 77,300 | 4,051,293.00 | 1.01 |
| 19 | 300017 | 网宿科技 | 390,900 | 4,006,725.00 | 1.00 |
| 20 | 002410 | 广联达 | 315,900 | 3,974,022.00 | 0.99 |
| 21 | 603444 | 吉比特 | 9,331 | 3,954,944.35 | 0.99 |
| 22 | 601168 | 西部矿业 | 142,900 | 3,949,756.00 | 0.98 |
| 23 | 600704 | 物产中大 | 670,000 | 3,731,900.00 | 0.93 |
| 24 | 600096 | 云天化 | 110,300 | 3,685,123.00 | 0.92 |
| 25 | 300373 | 扬杰科技 | 53,600 | 3,644,800.00 | 0.91 |
| 26 | 600517 | 国网英大 | 602,800 | 3,622,828.00 | 0.90 |
| 27 | 688295 | 中复神鹰 | 107,600 | 3,530,356.00 | 0.88 |
| 28 | 688002 | 睿创微纳 | 34,900 | 3,517,920.00 | 0.88 |
| 29 | 300073 | 当升科技 | 58,900 | 3,404,420.00 | 0.85 |
| 30 | 600166 | 福田汽车 | 1,115,700 | 3,257,844.00 | 0.81 |
| 31 | 300146 | 汤臣倍健 | 260,300 | 3,126,203.00 | 0.78 |
| 32 | 002156 | 通富微电 | 81,100 | 3,057,470.00 | 0.76 |
| 33 | 600378 | 昊华科技 | 94,600 | 3,023,416.00 | 0.75 |
| 34 | 000933 | 神火股份 | 109,800 | 3,016,206.00 | 0.75 |
| 35 | 688183 | 生益电子 | 31,500 | 3,014,235.00 | 0.75 |
| 36 | 002340 | 格林美 | 359,100 | 3,002,076.00 | 0.75 |
| 37 | 603486 | 科沃斯 | 36,600 | 2,952,888.00 | 0.74 |
| 38 | 601958 | 金钼股份 | 188,900 | 2,943,062.00 | 0.73 |
| 39 | 688017 | 绿的谐波 | 15,300 | 2,939,130.00 | 0.73 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 40 | 601108 | 财通证券 | 329,800 | 2,875,856.00 | 0.72 |
| 41 | 688778 | 厦钨新能 | 37,100 | 2,870,427.00 | 0.72 |
| 42 | 603659 | 璞泰来 | 102,200 | 2,794,148.00 | 0.70 |
| 43 | 300735 | 光弘科技 | 110,500 | 2,747,030.00 | 0.68 |
| 44 | 601555 | 东吴证券 | 297,100 | 2,691,726.00 | 0.67 |
| 45 | 002273 | 水晶光电 | 106,100 | 2,665,232.00 | 0.66 |
| 46 | 601865 | 福莱特 | 168,700 | 2,643,529.00 | 0.66 |
| 47 | 600487 | 亨通光电 | 103,400 | 2,557,082.00 | 0.64 |
| 48 | 002138 | 顺络电子 | 71,900 | 2,554,607.00 | 0.64 |
| 49 | 002517 | 恺英网络 | 115,100 | 2,517,237.00 | 0.63 |
| 50 | 300972 | 万辰集团 | 12,400 | 2,493,268.00 | 0.62 |
| 51 | 002056 | 横店东磁 | 127,800 | 2,492,100.00 | 0.62 |
| 52 | 301200 | 大族数控 | 20,500 | 2,434,785.00 | 0.61 |
| 53 | 002299 | 圣农发展 | 146,700 | 2,426,418.00 | 0.60 |
| 54 | 600332 | 白云山 | 91,900 | 2,365,506.00 | 0.59 |
| 55 | 601921 | 浙版传媒 | 297,000 | 2,322,540.00 | 0.58 |
| 56 | 300496 | 中科创达 | 33,300 | 2,247,750.00 | 0.56 |
| 57 | 002624 | 完美世界 | 137,100 | 2,247,069.00 | 0.56 |
| 58 | 000951 | 中国重汽 | 132,300 | 2,235,870.00 | 0.56 |
| 59 | 601019 | 山东出版 | 255,800 | 2,210,112.00 | 0.55 |
| 60 | 301308 | 江波龙 | 9,000 | 2,203,560.00 | 0.55 |
| 61 | 002152 | 广电运通 | 157,300 | 2,172,313.00 | 0.54 |
| 62 | 002532 | 天山铝业 | 130,800 | 2,116,344.00 | 0.53 |
| 63 | 002850 | 科达利 | 13,100 | 2,067,966.00 | 0.52 |
| 64 | 603341 | 龙旗科技 | 47,800 | 2,020,028.00 | 0.50 |
| 65 | 688772 | 珠海冠宇 | 93,695 | 2,017,253.35 | 0.50 |
| 66 | 600126 | 杭钢股份 | 245,800 | 2,005,728.00 | 0.50 |
| 67 | 600038 | 中直股份 | 55,400 | 2,001,602.00 | 0.50 |
| 68 | 300012 | 华测检测 | 145,400 | 1,970,170.00 | 0.49 |
| 69 | 000598 | 兴蓉环境 | 274,600 | 1,968,882.00 | 0.49 |
| 70 | 600808 | 马钢股份 | 464,400 | 1,959,768.00 | 0.49 |
| 71 | 688819 | 天能股份 | 57,900 | 1,923,438.00 | 0.48 |
| 72 | 600739 | 辽宁成大 | 170,900 | 1,910,662.00 | 0.48 |
| 73 | 002236 | 大华股份 | 97,400 | 1,844,756.00 | 0.46 |
| 74 | 002608 | 江苏国信 | 249,000 | 1,840,110.00 | 0.46 |
| 75 | 000750 | 国海证券 | 410,600 | 1,740,944.00 | 0.43 |
| 76 | 603259 | 药明康德 | 19,000 | 1,722,160.00 | 0.43 |
| 77 | 300003 | 乐普医疗 | 108,200 | 1,710,642.00 | 0.43 |
| 78 | 300458 | 全志科技 | 39,800 | 1,672,794.00 | 0.42 |
| 79 | 688235 | 百济神州 | 6,200 | 1,665,320.00 | 0.42 |
| 80 | 601717 | 中创智领 | 66,800 | 1,639,940.00 | 0.41 |
| 81 | 300450 | 先导智能 | 32,700 | 1,634,346.00 | 0.41 |
| 82 | 600583 | 海油工程 | 292,700 | 1,606,923.00 | 0.40 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 83 | 000050 | 深天马 A | 177,800 | 1,605,534.00 | 0.40 |
| 84 | 600801 | 华新建材 | 63,600 | 1,560,744.00 | 0.39 |
| 85 | 300207 | 欣旺达 | 58,500 | 1,529,775.00 | 0.38 |
| 86 | 000021 | 深科技 | 59,900 | 1,514,272.00 | 0.38 |
| 87 | 300409 | 道氏技术 | 66,100 | 1,486,589.00 | 0.37 |
| 88 | 002023 | 海特高新 | 105,200 | 1,424,408.00 | 0.36 |
| 89 | 000650 | 仁和药业 | 250,900 | 1,417,585.00 | 0.35 |
| 90 | 600546 | 山煤国际 | 138,200 | 1,394,438.00 | 0.35 |
| 91 | 000623 | 吉林敖东 | 70,200 | 1,371,006.00 | 0.34 |
| 92 | 600032 | 浙江新能 | 182,700 | 1,353,807.00 | 0.34 |
| 93 | 688301 | 奕瑞科技 | 13,300 | 1,344,763.00 | 0.34 |
| 94 | 002993 | 奥海科技 | 30,100 | 1,315,671.00 | 0.33 |
| 95 | 002027 | 分众传媒 | 178,100 | 1,312,597.00 | 0.33 |
| 96 | 688213 | 思特威 | 13,700 | 1,302,733.00 | 0.32 |
| 97 | 600499 | 科达制造 | 93,800 | 1,301,006.00 | 0.32 |
| 98 | 603077 | 和邦生物 | 573,600 | 1,296,336.00 | 0.32 |
| 99 | 300001 | 特锐德 | 49,600 | 1,273,728.00 | 0.32 |
| 100 | 600578 | 京能电力 | 249,700 | 1,273,470.00 | 0.32 |
| 101 | 600959 | 江苏有线 | 368,180 | 1,266,539.20 | 0.32 |
| 102 | 600011 | 华能国际 | 169,500 | 1,264,470.00 | 0.32 |
| 103 | 300140 | 节能环保 | 184,100 | 1,246,357.00 | 0.31 |
| 104 | 002558 | 巨人网络 | 28,700 | 1,242,423.00 | 0.31 |
| 105 | 600867 | 通化东宝 | 150,700 | 1,231,219.00 | 0.31 |
| 106 | 003035 | 南网能源 | 263,900 | 1,208,662.00 | 0.30 |
| 107 | 600572 | 康恩贝 | 266,900 | 1,190,374.00 | 0.30 |
| 108 | 603858 | 步长制药 | 76,000 | 1,188,640.00 | 0.30 |
| 109 | 300573 | 兴齐眼药 | 16,854 | 1,184,667.66 | 0.30 |
| 110 | 600143 | 金发科技 | 60,400 | 1,180,216.00 | 0.29 |
| 111 | 002312 | 川发龙蟒 | 106,900 | 1,168,417.00 | 0.29 |
| 112 | 600210 | 紫江企业 | 158,100 | 1,162,035.00 | 0.29 |
| 113 | 688612 | 威迈斯 | 35,200 | 1,160,544.00 | 0.29 |
| 114 | 600763 | 通策医疗 | 27,820 | 1,118,642.20 | 0.28 |
| 115 | 300604 | 长川科技 | 11,000 | 1,114,410.00 | 0.28 |
| 116 | 603979 | 金诚信 | 14,300 | 1,088,945.00 | 0.27 |
| 117 | 603328 | 依顿电子 | 99,000 | 1,085,040.00 | 0.27 |
| 118 | 000848 | 承德露露 | 127,400 | 1,082,900.00 | 0.27 |
| 119 | 300415 | 伊之密 | 40,700 | 1,060,642.00 | 0.26 |
| 120 | 603920 | 世运电路 | 21,800 | 1,055,338.00 | 0.26 |
| 121 | 000997 | 新大陆 | 35,000 | 991,200.00 | 0.25 |
| 122 | 000776 | 广发证券 | 44,600 | 982,092.00 | 0.24 |
| 123 | 601857 | 中国石油 | 92,900 | 967,089.00 | 0.24 |
| 124 | 002202 | 金风科技 | 47,322 | 965,368.80 | 0.24 |
| 125 | 002100 | 天康生物 | 130,200 | 959,574.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 126 | 000987 | 越秀资本 | 114,000 | 927,960.00 | 0.23 |
| 127 | 000338 | 潍柴动力 | 52,600 | 904,720.00 | 0.23 |
| 128 | 600435 | 北方导航 | 58,600 | 903,612.00 | 0.23 |
| 129 | 001286 | 陕西能源 | 96,500 | 898,415.00 | 0.22 |
| 130 | 002039 | 黔源电力 | 49,400 | 897,598.00 | 0.22 |
| 131 | 603456 | 九洲药业 | 48,900 | 875,310.00 | 0.22 |
| 132 | 300474 | 景嘉微 | 12,100 | 869,627.00 | 0.22 |
| 133 | 601333 | 广深铁路 | 285,100 | 866,704.00 | 0.22 |
| 134 | 002821 | 凯莱英 | 8,900 | 827,077.00 | 0.21 |
| 135 | 002475 | 立讯精密 | 14,500 | 822,295.00 | 0.20 |
| 136 | 600060 | 海信视像 | 33,400 | 810,952.00 | 0.20 |
| 137 | 300857 | 协创数据 | 4,800 | 809,664.00 | 0.20 |
| 138 | 603699 | 纽威股份 | 15,100 | 784,747.00 | 0.20 |
| 139 | 000157 | 中联重科 | 89,200 | 769,796.00 | 0.19 |
| 140 | 002261 | 拓维信息 | 23,000 | 761,300.00 | 0.19 |
| 141 | 603565 | 中谷物流 | 75,600 | 759,024.00 | 0.19 |
| 142 | 688525 | 佰维存储 | 6,541 | 750,841.39 | 0.19 |
| 143 | 300136 | 信维通信 | 12,100 | 750,200.00 | 0.19 |
| 144 | 601231 | 环旭电子 | 24,800 | 744,000.00 | 0.19 |
| 145 | 002595 | 豪迈科技 | 8,700 | 735,237.00 | 0.18 |
| 146 | 688677 | 海泰新光 | 17,000 | 733,720.00 | 0.18 |
| 147 | 300759 | 康龙化成 | 25,500 | 724,965.00 | 0.18 |
| 148 | 689009 | 九号公司 | 12,500 | 694,875.00 | 0.17 |
| 149 | 000426 | 兴业银锡 | 19,300 | 687,080.00 | 0.17 |
| 150 | 001389 | 广合科技 | 8,400 | 685,692.00 | 0.17 |
| 151 | 688702 | 盛科通信 | 4,800 | 680,112.00 | 0.17 |
| 152 | 603236 | 移远通信 | 7,000 | 667,870.00 | 0.17 |
| 153 | 301608 | 博实结 | 7,300 | 660,942.00 | 0.16 |
| 154 | 300919 | 中伟股份 | 14,200 | 657,886.00 | 0.16 |
| 155 | 301606 | 绿联科技 | 11,196 | 657,653.04 | 0.16 |
| 156 | 600329 | 达仁堂 | 14,400 | 656,928.00 | 0.16 |
| 157 | 002293 | 罗莱生活 | 63,400 | 651,118.00 | 0.16 |
| 158 | 603049 | 中策橡胶 | 11,600 | 649,020.00 | 0.16 |
| 159 | 600007 | 中国国贸 | 32,600 | 646,132.00 | 0.16 |
| 160 | 300442 | 润泽科技 | 12,100 | 638,880.00 | 0.16 |
| 161 | 000589 | 贵州轮胎 | 123,200 | 638,176.00 | 0.16 |
| 162 | 300219 | 鸿利智汇 | 88,000 | 634,480.00 | 0.16 |
| 163 | 600927 | 永安期货 | 39,100 | 628,337.00 | 0.16 |
| 164 | 301219 | 腾远钴业 | 9,200 | 628,176.00 | 0.16 |
| 165 | 000543 | 皖能电力 | 79,000 | 628,050.00 | 0.16 |
| 166 | 601138 | 工业富联 | 10,100 | 626,705.00 | 0.16 |
| 167 | 002091 | 江苏国泰 | 69,400 | 626,682.00 | 0.16 |
| 168 | 001218 | 丽臣实业 | 27,500 | 626,450.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 169 | 001696 | 宗申动力 | 28,800 | 624,672.00 | 0.16 |
| 170 | 688599 | 天合光能 | 37,700 | 623,935.00 | 0.16 |
| 171 | 600361 | 创新新材 | 147,000 | 623,280.00 | 0.16 |
| 172 | 601928 | 凤凰传媒 | 61,500 | 617,460.00 | 0.15 |
| 173 | 000009 | 中国宝安 | 61,600 | 606,760.00 | 0.15 |
| 174 | 002409 | 雅克科技 | 8,100 | 600,210.00 | 0.15 |
| 175 | 002612 | 朗姿股份 | 29,000 | 592,760.00 | 0.15 |
| 176 | 601061 | 中信金属 | 40,900 | 588,960.00 | 0.15 |
| 177 | 600183 | 生益科技 | 8,200 | 585,562.00 | 0.15 |
| 178 | 301345 | 涛涛车业 | 2,300 | 578,036.00 | 0.14 |
| 179 | 600295 | 鄂尔多斯 | 46,400 | 573,504.00 | 0.14 |
| 180 | 688578 | 艾力斯 | 5,400 | 562,410.00 | 0.14 |
| 181 | 600649 | 城投控股 | 125,708 | 559,400.60 | 0.14 |
| 182 | 300383 | 光环新网 | 44,400 | 555,444.00 | 0.14 |
| 183 | 002335 | 科华数据 | 9,900 | 549,747.00 | 0.14 |
| 184 | 002271 | 东方雨虹 | 40,400 | 549,036.00 | 0.14 |
| 185 | 002074 | 国轩高科 | 13,900 | 543,629.00 | 0.14 |
| 186 | 000938 | 紫光股份 | 20,700 | 509,220.00 | 0.13 |
| 187 | 002706 | 良信股份 | 46,900 | 505,582.00 | 0.13 |
| 188 | 300274 | 阳光电源 | 2,900 | 496,016.00 | 0.12 |
| 189 | 603939 | 益丰药房 | 22,500 | 488,700.00 | 0.12 |
| 190 | 300395 | 菲利华 | 4,800 | 481,440.00 | 0.12 |
| 191 | 688608 | 恒玄科技 | 2,100 | 476,574.00 | 0.12 |
| 192 | 600642 | 申能股份 | 59,100 | 459,798.00 | 0.11 |
| 193 | 603156 | 养元饮品 | 15,900 | 457,125.00 | 0.11 |
| 194 | 600141 | 兴发集团 | 13,100 | 452,998.00 | 0.11 |
| 195 | 600497 | 驰宏锌锗 | 60,700 | 443,717.00 | 0.11 |
| 196 | 300674 | 宇信科技 | 17,700 | 429,402.00 | 0.11 |
| 197 | 600398 | 海澜之家 | 70,900 | 428,945.00 | 0.11 |
| 198 | 600392 | 盛和资源 | 19,500 | 419,835.00 | 0.10 |
| 199 | 000828 | 东莞控股 | 38,800 | 417,488.00 | 0.10 |
| 200 | 600062 | 华润双鹤 | 22,800 | 417,012.00 | 0.10 |
| 201 | 688802 | 沐曦股份 | 1,032 | 412,180.80 | 0.10 |
| 202 | 002126 | 银轮股份 | 10,900 | 412,020.00 | 0.10 |
| 203 | 600930 | 华电新能 | 65,821 | 410,723.04 | 0.10 |
| 204 | 603927 | 中科软 | 21,500 | 410,435.00 | 0.10 |
| 205 | 002080 | 中材科技 | 10,700 | 388,838.00 | 0.10 |
| 206 | 300866 | 安克创新 | 3,116 | 356,439.24 | 0.09 |
| 207 | 603529 | 爱玛科技 | 11,700 | 347,490.00 | 0.09 |
| 208 | 002867 | 周大生 | 27,800 | 338,604.00 | 0.08 |
| 209 | 600967 | 内蒙一机 | 19,900 | 334,320.00 | 0.08 |
| 210 | 002772 | 众兴菌业 | 22,700 | 331,193.00 | 0.08 |
| 211 | 688220 | 翱捷科技 | 4,000 | 330,440.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 212 | 000898 | 鞍钢股份 | 127,000 | 321,310.00 | 0.08 |
| 213 | 600352 | 浙江龙盛 | 29,900 | 318,734.00 | 0.08 |
| 214 | 300363 | 博腾股份 | 13,500 | 313,740.00 | 0.08 |
| 215 | 601990 | 南京证券 | 39,400 | 312,048.00 | 0.08 |
| 216 | 688380 | 中微半导 | 9,700 | 311,855.00 | 0.08 |
| 217 | 002195 | 岩山科技 | 42,700 | 302,743.00 | 0.08 |
| 218 | 600884 | 杉杉股份 | 22,200 | 299,922.00 | 0.07 |
| 219 | 600132 | 重庆啤酒 | 5,700 | 297,768.00 | 0.07 |
| 220 | 600004 | 白云机场 | 30,900 | 292,314.00 | 0.07 |
| 221 | 002897 | 意华股份 | 5,400 | 291,978.00 | 0.07 |
| 222 | 601628 | 中国人寿 | 6,400 | 291,200.00 | 0.07 |
| 223 | 600663 | 陆家嘴 | 36,500 | 288,715.00 | 0.07 |
| 224 | 000893 | 亚钾国际 | 5,900 | 283,023.00 | 0.07 |
| 225 | 300119 | 瑞普生物 | 14,900 | 279,673.00 | 0.07 |
| 226 | 600339 | 中油工程 | 83,000 | 278,050.00 | 0.07 |
| 227 | 688636 | 智明达 | 6,400 | 274,176.00 | 0.07 |
| 228 | 600562 | 国睿科技 | 9,600 | 271,296.00 | 0.07 |
| 229 | 603160 | 汇顶科技 | 3,400 | 268,600.00 | 0.07 |
| 230 | 002484 | 江海股份 | 8,700 | 258,390.00 | 0.06 |
| 231 | 688591 | 泰凌微 | 6,000 | 255,360.00 | 0.06 |
| 232 | 688088 | 虹软科技 | 5,000 | 247,500.00 | 0.06 |
| 233 | 301607 | 富特科技 | 6,100 | 244,671.00 | 0.06 |
| 234 | 300681 | 英搏尔 | 9,700 | 243,082.00 | 0.06 |
| 235 | 600188 | 兖矿能源 | 18,300 | 240,645.00 | 0.06 |
| 236 | 600970 | 中材国际 | 22,900 | 237,931.00 | 0.06 |
| 237 | 603816 | 顾家家居 | 7,700 | 236,698.00 | 0.06 |
| 238 | 000034 | 神州数码 | 5,900 | 229,569.00 | 0.06 |
| 239 | 600118 | 中国卫星 | 2,400 | 227,880.00 | 0.06 |
| 240 | 301656 | 联合动力 | 8,657 | 226,345.04 | 0.06 |
| 241 | 688439 | 振华风光 | 3,400 | 219,640.00 | 0.05 |
| 242 | 001337 | 四川黄金 | 7,500 | 208,950.00 | 0.05 |
| 243 | 600498 | 烽火通信 | 6,300 | 202,104.00 | 0.05 |
| 244 | 600415 | 小商品城 | 12,200 | 194,590.00 | 0.05 |
| 245 | 603606 | 东方电缆 | 3,200 | 191,200.00 | 0.05 |
| 246 | 688629 | 华丰科技 | 1,900 | 190,114.00 | 0.05 |
| 247 | 300037 | 新宙邦 | 3,600 | 188,640.00 | 0.05 |
| 248 | 300454 | 深信服 | 1,600 | 184,256.00 | 0.05 |
| 249 | 603929 | 亚翔集成 | 1,900 | 181,450.00 | 0.05 |
| 250 | 600601 | 方正科技 | 14,400 | 168,768.00 | 0.04 |
| 251 | 002690 | 美亚光电 | 7,900 | 162,503.00 | 0.04 |
| 252 | 600879 | 航天电子 | 7,500 | 159,900.00 | 0.04 |
| 253 | 601020 | 华钰矿业 | 5,900 | 158,474.00 | 0.04 |
| 254 | 600064 | 南京高科 | 17,900 | 155,372.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 255 | 600480 | 凌云股份 | 12,500 | 153,625.00 | 0.04 |
| 256 | 688019 | 安集科技 | 700 | 152,544.00 | 0.04 |
| 257 | 000915 | 华特达因 | 4,500 | 148,680.00 | 0.04 |
| 258 | 002155 | 湖南黄金 | 7,010 | 147,840.90 | 0.04 |
| 259 | 600989 | 宝丰能源 | 7,500 | 147,225.00 | 0.04 |
| 260 | 688519 | 南亚新材 | 1,800 | 145,548.00 | 0.04 |
| 261 | 600120 | 浙江东方 | 22,900 | 141,293.00 | 0.04 |
| 262 | 600262 | 北方股份 | 5,300 | 137,959.00 | 0.03 |
| 263 | 601918 | 新集能源 | 20,300 | 134,183.00 | 0.03 |
| 264 | 301283 | 聚胶股份 | 2,800 | 133,784.00 | 0.03 |
| 265 | 600580 | 卧龙电驱 | 2,700 | 132,570.00 | 0.03 |
| 266 | 601399 | 国机重装 | 27,700 | 132,406.00 | 0.03 |
| 267 | 600885 | 宏发股份 | 4,300 | 130,720.00 | 0.03 |
| 268 | 688498 | 源杰科技 | 200 | 128,398.00 | 0.03 |
| 269 | 688297 | 中无人机 | 2,600 | 124,852.00 | 0.03 |
| 270 | 600057 | 厦门象屿 | 14,300 | 121,836.00 | 0.03 |
| 271 | 601212 | 白银有色 | 20,700 | 121,095.00 | 0.03 |
| 272 | 300008 | 天海防务 | 15,100 | 119,139.00 | 0.03 |
| 273 | 603118 | 共进股份 | 10,200 | 117,300.00 | 0.03 |
| 274 | 605305 | 中际联合 | 2,800 | 116,648.00 | 0.03 |
| 275 | 603737 | 三棵树 | 2,516 | 116,415.32 | 0.03 |
| 276 | 603728 | 鸣志电器 | 1,600 | 115,760.00 | 0.03 |
| 277 | 600131 | 国网信通 | 7,100 | 114,594.00 | 0.03 |
| 278 | 600369 | 西南证券 | 25,200 | 112,896.00 | 0.03 |
| 279 | 301358 | 湖南裕能 | 1,700 | 109,922.00 | 0.03 |
| 280 | 600082 | 海泰发展 | 26,900 | 109,214.00 | 0.03 |
| 281 | 600312 | 平高电气 | 6,100 | 105,835.00 | 0.03 |
| 282 | 002583 | 海能达 | 9,100 | 103,012.00 | 0.03 |
| 283 | 603296 | 华勤技术 | 1,100 | 99,814.00 | 0.02 |
| 284 | 688022 | 瀚川智能 | 6,500 | 99,450.00 | 0.02 |
| 285 | 688322 | 奥比中光 | 1,100 | 98,637.00 | 0.02 |
| 286 | 002603 | 以岭药业 | 5,700 | 97,299.00 | 0.02 |
| 287 | 002402 | 和而泰 | 2,400 | 93,888.00 | 0.02 |
| 288 | 300101 | 振芯科技 | 3,300 | 93,819.00 | 0.02 |
| 289 | 688557 | 兰剑智能 | 2,500 | 91,075.00 | 0.02 |
| 290 | 300394 | 天孚通信 | 448 | 90,957.44 | 0.02 |
| 291 | 002130 | 沃尔核材 | 3,400 | 89,488.00 | 0.02 |
| 292 | 002773 | 康弘药业 | 2,900 | 86,913.00 | 0.02 |
| 293 | 000960 | 锡业股份 | 3,100 | 86,428.00 | 0.02 |
| 294 | 300058 | 蓝色光标 | 7,500 | 86,400.00 | 0.02 |
| 295 | 688018 | 乐鑫科技 | 506 | 86,020.00 | 0.02 |
| 296 | 002837 | 英维克 | 800 | 85,512.00 | 0.02 |
| 297 | 600699 | 均胜电子 | 2,700 | 84,672.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 298 | 605098 | 行动教育 | 2,000 | 83,520.00 | 0.02 |
| 299 | 603799 | 华友钴业 | 1,200 | 81,912.00 | 0.02 |
| 300 | 688499 | 利元亨 | 1,400 | 80,808.00 | 0.02 |
| 301 | 600382 | 广东明珠 | 11,200 | 79,856.00 | 0.02 |
| 302 | 000729 | 燕京啤酒 | 7,100 | 79,733.00 | 0.02 |
| 303 | 600869 | 远东股份 | 9,900 | 79,695.00 | 0.02 |
| 304 | 002747 | 埃斯顿 | 3,200 | 75,840.00 | 0.02 |
| 305 | 002185 | 华天科技 | 6,800 | 74,596.00 | 0.02 |
| 306 | 300850 | 新强联 | 1,800 | 74,466.00 | 0.02 |
| 307 | 688280 | 精进电动 | 8,200 | 71,340.00 | 0.02 |
| 308 | 600363 | 联创光电 | 1,100 | 69,366.00 | 0.02 |
| 309 | 300083 | 创世纪 | 7,500 | 69,075.00 | 0.02 |
| 310 | 688425 | 铁建重工 | 13,500 | 68,445.00 | 0.02 |
| 311 | 688188 | 柏楚电子 | 500 | 67,945.00 | 0.02 |
| 312 | 301031 | 中熔电气 | 600 | 67,314.00 | 0.02 |
| 313 | 002246 | 北化股份 | 3,700 | 66,674.00 | 0.02 |
| 314 | 688072 | 拓荆科技 | 200 | 66,000.00 | 0.02 |
| 315 | 001280 | 中国铀业 | 1,442 | 65,409.12 | 0.02 |
| 316 | 688180 | 君实生物 | 1,900 | 64,904.00 | 0.02 |
| 317 | 300033 | 同花顺 | 200 | 64,436.00 | 0.02 |
| 318 | 601878 | 浙商证券 | 5,900 | 63,779.00 | 0.02 |
| 319 | 601388 | 怡球资源 | 20,300 | 61,103.00 | 0.02 |
| 320 | 300045 | 华力创通 | 2,100 | 60,711.00 | 0.02 |
| 321 | 002151 | 北斗星通 | 1,300 | 59,059.00 | 0.01 |
| 322 | 002463 | 沪电股份 | 800 | 58,456.00 | 0.01 |
| 323 | 600021 | 上海电力 | 2,900 | 58,058.00 | 0.01 |
| 324 | 601608 | 中信重工 | 8,800 | 57,992.00 | 0.01 |
| 325 | 600019 | 宝钢股份 | 7,000 | 52,150.00 | 0.01 |
| 326 | 603185 | 弘元绿能 | 1,600 | 48,800.00 | 0.01 |
| 327 | 603629 | 利通电子 | 1,800 | 47,970.00 | 0.01 |
| 328 | 688266 | 泽璟制药 | 500 | 46,350.00 | 0.01 |
| 329 | 688236 | 春立医疗 | 2,000 | 45,760.00 | 0.01 |
| 330 | 688615 | 合合信息 | 200 | 45,516.00 | 0.01 |
| 331 | 688729 | 屹唐股份 | 1,817 | 44,116.76 | 0.01 |
| 332 | 002085 | 万丰奥威 | 2,700 | 43,227.00 | 0.01 |
| 333 | 601233 | 桐昆股份 | 2,500 | 43,025.00 | 0.01 |
| 334 | 600736 | 苏州高新 | 6,300 | 42,588.00 | 0.01 |
| 335 | 600737 | 中粮糖业 | 2,300 | 39,583.00 | 0.01 |
| 336 | 002266 | 浙富控股 | 9,500 | 39,520.00 | 0.01 |
| 337 | 000800 | 一汽解放 | 5,700 | 38,646.00 | 0.01 |
| 338 | 002941 | 新疆交建 | 2,400 | 38,040.00 | 0.01 |
| 339 | 002048 | 宁波华翔 | 1,200 | 37,752.00 | 0.01 |
| 340 | 688234 | 天岳先进 | 424 | 37,685.12 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 341 | 688545 | 兴福电子 | 994 | 37,324.70 | 0.01 |
| 342 | 600428 | 中远海特 | 5,100 | 36,210.00 | 0.01 |
| 343 | 601336 | 新华保险 | 500 | 34,850.00 | 0.01 |
| 344 | 605589 | 圣泉集团 | 1,200 | 33,960.00 | 0.01 |
| 345 | 300072 | 海新能科 | 7,300 | 33,580.00 | 0.01 |
| 346 | 300100 | 双林股份 | 840 | 33,280.80 | 0.01 |
| 347 | 000657 | 中钨高新 | 1,200 | 33,252.00 | 0.01 |
| 348 | 300358 | 楚天科技 | 3,300 | 32,307.00 | 0.01 |
| 349 | 300627 | 华测导航 | 840 | 29,324.40 | 0.01 |
| 350 | 600027 | 华电国际 | 5,900 | 29,264.00 | 0.01 |
| 351 | 000878 | 云南铜业 | 1,400 | 28,714.00 | 0.01 |
| 352 | 600157 | 永泰能源 | 18,100 | 28,417.00 | 0.01 |
| 353 | 603129 | 春风动力 | 100 | 27,868.00 | 0.01 |
| 354 | 300390 | 天华新能 | 510 | 27,851.10 | 0.01 |
| 355 | 002803 | 吉宏股份 | 1,700 | 27,812.00 | 0.01 |
| 356 | 002315 | 焦点科技 | 600 | 27,456.00 | 0.01 |
| 357 | 688208 | 道通科技 | 700 | 25,760.00 | 0.01 |
| 358 | 601600 | 中国铝业 | 2,000 | 24,440.00 | 0.01 |
| 359 | 001227 | 兰州银行 | 10,500 | 24,360.00 | 0.01 |
| 360 | 603612 | 索通发展 | 1,000 | 23,500.00 | 0.01 |
| 361 | 300182 | 捷成股份 | 4,200 | 23,184.00 | 0.01 |
| 362 | 000600 | 建投能源 | 2,700 | 23,031.00 | 0.01 |
| 363 | 300772 | 运达股份 | 1,200 | 22,872.00 | 0.01 |
| 364 | 600863 | 内蒙华电 | 5,100 | 22,848.00 | 0.01 |
| 365 | 688809 | 强一股份 | 112 | 22,770.72 | 0.01 |
| 366 | 301603 | 乔锋智能 | 300 | 22,710.00 | 0.01 |
| 367 | 600282 | 南钢股份 | 4,300 | 22,618.00 | 0.01 |
| 368 | 301638 | 南网数字 | 1,551 | 22,039.71 | 0.01 |
| 369 | 603228 | 景旺电子 | 300 | 21,927.00 | 0.01 |
| 370 | 000932 | 华菱钢铁 | 3,780 | 21,243.60 | 0.01 |
| 371 | 688148 | 芳源股份 | 2,400 | 21,048.00 | 0.01 |
| 372 | 002487 | 大金重工 | 400 | 20,772.00 | 0.01 |
| 373 | 001386 | 马可波罗 | 1,112 | 20,605.36 | 0.01 |
| 374 | 601636 | 旗滨集团 | 3,400 | 20,162.00 | 0.01 |
| 375 | 000519 | 中兵红箭 | 1,100 | 20,031.00 | 0.00 |
| 376 | 002294 | 信立泰 | 400 | 19,820.00 | 0.00 |
| 377 | 688727 | 恒坤新材 | 563 | 19,631.81 | 0.00 |
| 378 | 002926 | 华西证券 | 2,100 | 19,488.00 | 0.00 |
| 379 | 300724 | 捷佳伟创 | 200 | 19,120.00 | 0.00 |
| 380 | 000709 | 河钢股份 | 8,000 | 18,480.00 | 0.00 |
| 381 | 002244 | 滨江集团 | 1,800 | 18,090.00 | 0.00 |
| 382 | 688069 | 德林海 | 800 | 17,944.00 | 0.00 |
| 383 | 000683 | 博源化工 | 2,400 | 17,856.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 384 | 688807 | 优迅股份 | 131 | 17,758.36 | 0.00 |
| 385 | 600095 | 湘财股份 | 1,600 | 17,696.00 | 0.00 |
| 386 | 600694 | 大商股份 | 946 | 16,961.78 | 0.00 |
| 387 | 600861 | 北京人力 | 900 | 16,506.00 | 0.00 |
| 388 | 000930 | 中粮科技 | 2,800 | 16,156.00 | 0.00 |
| 389 | 300098 | 高新兴 | 2,600 | 15,860.00 | 0.00 |
| 390 | 600566 | 济川药业 | 600 | 15,780.00 | 0.00 |
| 391 | 002465 | 海格通信 | 1,000 | 15,750.00 | 0.00 |
| 392 | 301632 | 广东建科 | 656 | 15,534.08 | 0.00 |
| 393 | 301563 | 云汉芯城 | 110 | 14,705.90 | 0.00 |
| 394 | 600482 | 中国动力 | 700 | 14,490.00 | 0.00 |
| 395 | 300763 | 锦浪科技 | 200 | 14,282.00 | 0.00 |
| 396 | 688796 | 百奥赛图 | 338 | 14,280.50 | 0.00 |
| 397 | 301602 | 超研股份 | 658 | 14,173.32 | 0.00 |
| 398 | 601567 | 三星医疗 | 600 | 13,812.00 | 0.00 |
| 399 | 000513 | 丽珠集团 | 400 | 13,784.00 | 0.00 |
| 400 | 301491 | 汉桑科技 | 245 | 13,501.95 | 0.00 |
| 401 | 001233 | 海安集团 | 246 | 12,762.48 | 0.00 |
| 402 | 300776 | 帝尔激光 | 200 | 12,428.00 | 0.00 |
| 403 | 600114 | 东睦股份 | 400 | 12,220.00 | 0.00 |
| 404 | 301584 | 建发致新 | 447 | 11,988.54 | 0.00 |
| 405 | 600827 | 百联股份 | 1,300 | 11,687.00 | 0.00 |
| 406 | 601077 | 渝农商行 | 1,800 | 11,628.00 | 0.00 |
| 407 | 600755 | 厦门国贸 | 1,600 | 11,504.00 | 0.00 |
| 408 | 301609 | 山大电力 | 277 | 11,354.23 | 0.00 |
| 409 | 603766 | 隆鑫通用 | 700 | 11,277.00 | 0.00 |
| 410 | 601456 | 国联民生 | 1,100 | 11,187.00 | 0.00 |
| 411 | 603596 | 伯特利 | 218 | 11,176.86 | 0.00 |
| 412 | 002895 | 川恒股份 | 300 | 10,998.00 | 0.00 |
| 413 | 002756 | 永兴材料 | 200 | 10,850.00 | 0.00 |
| 414 | 301687 | 新广益 | 195 | 10,606.05 | 0.00 |
| 415 | 001339 | 智微智能 | 200 | 10,222.00 | 0.00 |
| 416 | 000423 | 东阿阿胶 | 200 | 9,816.00 | 0.00 |
| 417 | 600380 | 健康元 | 800 | 9,240.00 | 0.00 |
| 418 | 300682 | 朗新集团 | 600 | 9,126.00 | 0.00 |
| 419 | 001221 | 悍高集团 | 160 | 9,110.40 | 0.00 |
| 420 | 000156 | 华数传媒 | 1,200 | 9,084.00 | 0.00 |
| 421 | 600872 | 中炬高新 | 500 | 8,775.00 | 0.00 |
| 422 | 301667 | 纳百川 | 151 | 8,617.57 | 0.00 |
| 423 | 688805 | 健信超导 | 265 | 8,578.05 | 0.00 |
| 424 | 600820 | 隧道股份 | 1,300 | 8,437.00 | 0.00 |
| 425 | 002385 | 大北农 | 2,100 | 8,400.00 | 0.00 |
| 426 | 601601 | 中国太保 | 200 | 8,382.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 427 | 603175 | 超颖电子 | 169 | 8,206.64 | 0.00 |
| 428 | 688522 | 纳睿雷达 | 200 | 7,986.00 | 0.00 |
| 429 | 001369 | 双欣环保 | 611 | 7,875.79 | 0.00 |
| 430 | 600985 | 淮北矿业 | 700 | 7,777.00 | 0.00 |
| 431 | 688097 | 博众精工 | 200 | 7,550.00 | 0.00 |
| 432 | 688478 | 晶升股份 | 200 | 7,482.00 | 0.00 |
| 433 | 300492 | 华图山鼎 | 100 | 7,430.00 | 0.00 |
| 434 | 301449 | 天溯计量 | 112 | 7,305.76 | 0.00 |
| 435 | 601698 | 中国卫通 | 200 | 7,146.00 | 0.00 |
| 436 | 002925 | 盈趣科技 | 400 | 6,776.00 | 0.00 |
| 437 | 600008 | 首创环保 | 2,250 | 6,750.00 | 0.00 |
| 438 | 000027 | 深圳能源 | 1,020 | 6,650.40 | 0.00 |
| 439 | 601026 | 道生天合 | 451 | 6,440.28 | 0.00 |
| 440 | 301575 | 艾芬达 | 126 | 6,243.30 | 0.00 |
| 441 | 601901 | 方正证券 | 800 | 6,240.00 | 0.00 |
| 442 | 603406 | 天富龙 | 153 | 6,144.48 | 0.00 |
| 443 | 603418 | 友升股份 | 102 | 6,024.12 | 0.00 |
| 444 | 000090 | 天健集团 | 1,600 | 5,920.00 | 0.00 |
| 445 | 603092 | 德力佳 | 104 | 5,788.64 | 0.00 |
| 446 | 300365 | 恒华科技 | 900 | 5,688.00 | 0.00 |
| 447 | 001285 | 瑞立科密 | 101 | 5,664.08 | 0.00 |
| 448 | 600050 | 中国联通 | 1,100 | 5,621.00 | 0.00 |
| 449 | 002936 | 郑州银行 | 2,700 | 5,211.00 | 0.00 |
| 450 | 000400 | 许继电气 | 200 | 5,142.00 | 0.00 |
| 451 | 688348 | 昱能科技 | 100 | 5,039.00 | 0.00 |
| 452 | 002167 | 东方锆业 | 400 | 4,940.00 | 0.00 |
| 453 | 300820 | 英杰电气 | 100 | 4,795.00 | 0.00 |
| 454 | 600483 | 福能股份 | 500 | 4,735.00 | 0.00 |
| 455 | 600536 | 中国软件 | 100 | 4,630.00 | 0.00 |
| 456 | 002016 | 世荣兆业 | 800 | 4,624.00 | 0.00 |
| 457 | 688516 | 奥特维 | 100 | 4,526.00 | 0.00 |
| 458 | 000825 | 太钢不锈 | 900 | 4,401.00 | 0.00 |
| 459 | 600298 | 安琪酵母 | 100 | 4,374.00 | 0.00 |
| 460 | 603262 | 技源集团 | 155 | 4,355.50 | 0.00 |
| 461 | 600170 | 上海建工 | 1,600 | 4,240.00 | 0.00 |
| 462 | 603248 | 锡华科技 | 260 | 4,238.00 | 0.00 |
| 463 | 002469 | 三维化学 | 500 | 4,175.00 | 0.00 |
| 464 | 000560 | 我爱我家 | 1,400 | 4,088.00 | 0.00 |
| 465 | 300777 | 中简科技 | 100 | 4,080.00 | 0.00 |
| 466 | 600551 | 时代出版 | 500 | 4,060.00 | 0.00 |
| 467 | 001388 | 信通电子 | 94 | 4,036.36 | 0.00 |
| 468 | 603370 | 华新精科 | 82 | 3,800.70 | 0.00 |
| 469 | 300888 | 稳健医疗 | 100 | 3,784.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----|----------|------|
| 470 | 300054 | 鼎龙股份 | 100 | 3,760.00 | 0.00 |
| 471 | 600177 | 雅戈尔 | 492 | 3,739.20 | 0.00 |
| 472 | 000528 | 柳工 | 300 | 3,561.00 | 0.00 |
| 473 | 000403 | 派林生物 | 260 | 3,559.40 | 0.00 |
| 474 | 600795 | 国电电力 | 700 | 3,528.00 | 0.00 |
| 475 | 600582 | 天地科技 | 600 | 3,498.00 | 0.00 |
| 476 | 002534 | 西子洁能 | 200 | 3,354.00 | 0.00 |
| 477 | 300251 | 光线传媒 | 200 | 3,276.00 | 0.00 |
| 478 | 300696 | 爱乐达 | 100 | 3,191.00 | 0.00 |
| 479 | 600171 | 上海贝岭 | 100 | 3,125.00 | 0.00 |
| 480 | 300499 | 高澜股份 | 100 | 3,068.00 | 0.00 |
| 481 | 600683 | 京投发展 | 700 | 2,989.00 | 0.00 |
| 482 | 600637 | 东方明珠 | 300 | 2,955.00 | 0.00 |
| 483 | 603376 | 大明电子 | 111 | 2,909.31 | 0.00 |
| 484 | 603334 | 丰倍生物 | 88 | 2,888.16 | 0.00 |
| 485 | 600713 | 南京医药 | 500 | 2,730.00 | 0.00 |
| 486 | 301029 | 怡合达 | 100 | 2,652.00 | 0.00 |
| 487 | 603866 | 桃李面包 | 500 | 2,630.00 | 0.00 |
| 488 | 001396 | 誉帆科技 | 69 | 2,441.91 | 0.00 |
| 489 | 601098 | 中南传媒 | 200 | 2,252.00 | 0.00 |
| 490 | 002249 | 大洋电机 | 200 | 2,180.00 | 0.00 |
| 491 | 000738 | 航发控制 | 100 | 2,131.00 | 0.00 |
| 492 | 002372 | 伟星新材 | 200 | 2,086.00 | 0.00 |
| 493 | 600420 | 国药现代 | 200 | 2,020.00 | 0.00 |
| 494 | 002758 | 浙农股份 | 200 | 2,014.00 | 0.00 |
| 495 | 600728 | 佳都科技 | 300 | 2,004.00 | 0.00 |
| 496 | 603966 | 法兰泰克 | 168 | 1,999.20 | 0.00 |
| 497 | 600521 | 华海药业 | 110 | 1,866.70 | 0.00 |
| 498 | 601156 | 东航物流 | 100 | 1,841.00 | 0.00 |
| 499 | 600079 | ST 人福 | 100 | 1,811.00 | 0.00 |
| 500 | 300369 | 绿盟科技 | 200 | 1,496.00 | 0.00 |
| 501 | 300595 | 欧普康视 | 100 | 1,469.00 | 0.00 |
| 502 | 601966 | 玲珑轮胎 | 100 | 1,453.00 | 0.00 |
| 503 | 000410 | 沈阳机床 | 200 | 1,430.00 | 0.00 |
| 504 | 600372 | 中航机载 | 100 | 1,342.00 | 0.00 |
| 505 | 601801 | 皖新传媒 | 200 | 1,316.00 | 0.00 |
| 506 | 600901 | 江苏金租 | 200 | 1,224.00 | 0.00 |
| 507 | 002373 | 千方科技 | 100 | 1,177.00 | 0.00 |
| 508 | 002153 | 石基信息 | 100 | 1,083.00 | 0.00 |
| 509 | 600320 | 振华重工 | 200 | 1,030.00 | 0.00 |
| 510 | 600661 | 昂立教育 | 100 | 1,025.00 | 0.00 |
| 511 | 002228 | 合兴包装 | 200 | 924.00 | 0.00 |
| 512 | 600150 | 中国船舶 | 27 | 898.02 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|--------|------|
| 513 | 600299 | 安迪苏 | 100 | 897.00 | 0.00 |
| 514 | 601319 | 中国人保 | 100 | 895.00 | 0.00 |
| 515 | 601158 | 重庆水务 | 200 | 894.00 | 0.00 |
| 516 | 000401 | 金隅冀东 | 200 | 882.00 | 0.00 |
| 517 | 002387 | 维信诺 | 100 | 862.00 | 0.00 |
| 518 | 601568 | 北元集团 | 200 | 744.00 | 0.00 |
| 519 | 002546 | 新联电子 | 100 | 699.00 | 0.00 |
| 520 | 300168 | 万达信息 | 100 | 646.00 | 0.00 |
| 521 | 600390 | 五矿资本 | 100 | 555.00 | 0.00 |
| 522 | 601216 | 君正集团 | 100 | 482.00 | 0.00 |
| 523 | 600968 | 海油发展 | 100 | 384.00 | 0.00 |
| 524 | 002958 | 青农商行 | 100 | 310.00 | 0.00 |
| 525 | 600688 | 上海石化 | 100 | 278.00 | 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 | 688213 | 思特威 | 24,202,472.44 | 5.42 |
| 2 | 688778 | 厦钨新能 | 21,837,299.07 | 4.89 |
| 3 | 600517 | 国网英大 | 19,717,214.00 | 4.42 |
| 4 | 002138 | 顺络电子 | 19,102,393.28 | 4.28 |
| 5 | 600909 | 华安证券 | 18,192,709.36 | 4.08 |
| 6 | 000050 | 深天马 A | 17,165,160.00 | 3.85 |
| 7 | 300803 | 指南针 | 17,111,866.35 | 3.83 |
| 8 | 000783 | 长江证券 | 17,066,976.00 | 3.82 |
| 9 | 300604 | 长川科技 | 16,950,900.47 | 3.80 |
| 10 | 002414 | 高德红外 | 16,741,243.80 | 3.75 |
| 11 | 600998 | 九州通 | 16,625,455.00 | 3.72 |
| 12 | 600704 | 物产中大 | 16,275,661.00 | 3.65 |
| 13 | 603233 | 大参林 | 16,264,242.00 | 3.64 |
| 14 | 688469 | 芯联集成 | 16,193,703.72 | 3.63 |
| 15 | 300476 | 胜宏科技 | 16,191,862.86 | 3.63 |
| 16 | 600499 | 科达制造 | 16,071,287.00 | 3.60 |
| 17 | 300573 | 兴齐眼药 | 15,920,984.00 | 3.57 |
| 18 | 601168 | 西部矿业 | 15,886,568.07 | 3.56 |
| 19 | 002056 | 横店东磁 | 15,499,577.00 | 3.47 |
| 20 | 002958 | 青农商行 | 15,474,339.00 | 3.47 |
| 21 | 600873 | 梅花生物 | 15,135,942.00 | 3.39 |
| 22 | 600578 | 京能电力 | 14,980,581.00 | 3.36 |
| 23 | 600329 | 达仁堂 | 14,928,045.00 | 3.34 |
| 24 | 300496 | 中科创达 | 14,822,016.00 | 3.32 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 25 | 688188 | 柏楚电子 | 14,489,974.06 | 3.25 |
| 26 | 002299 | 圣农发展 | 14,358,470.52 | 3.22 |
| 27 | 000893 | 亚钾国际 | 14,126,165.00 | 3.16 |
| 28 | 000825 | 太钢不锈 | 13,736,101.00 | 3.08 |
| 29 | 603444 | 吉比特 | 13,657,373.86 | 3.06 |
| 30 | 300677 | 英科医疗 | 13,531,236.00 | 3.03 |
| 31 | 002432 | 九安医疗 | 13,515,368.00 | 3.03 |
| 32 | 002410 | 广联达 | 13,338,967.00 | 2.99 |
| 33 | 603379 | 三美股份 | 13,336,877.00 | 2.99 |
| 34 | 600098 | 广州发展 | 13,270,744.00 | 2.97 |
| 35 | 688099 | 晶晨股份 | 13,253,049.07 | 2.97 |
| 36 | 601019 | 山东出版 | 13,245,190.00 | 2.97 |
| 37 | 002624 | 完美世界 | 13,178,854.00 | 2.95 |
| 38 | 300003 | 乐普医疗 | 13,147,389.00 | 2.95 |
| 39 | 600959 | 江苏有线 | 12,937,988.00 | 2.90 |
| 40 | 688183 | 生益电子 | 12,893,369.14 | 2.89 |
| 41 | 600435 | 北方导航 | 12,834,210.00 | 2.87 |
| 42 | 301165 | 锐捷网络 | 12,820,825.40 | 2.87 |
| 43 | 601456 | 国联民生 | 12,663,847.00 | 2.84 |
| 44 | 000750 | 国海证券 | 12,584,729.00 | 2.82 |
| 45 | 689009 | 九号公司 | 12,553,117.90 | 2.81 |
| 46 | 688002 | 睿创微纳 | 12,420,217.24 | 2.78 |
| 47 | 603816 | 顾家家居 | 12,338,115.00 | 2.76 |
| 48 | 000636 | 风华高科 | 12,277,544.00 | 2.75 |
| 49 | 600352 | 浙江龙盛 | 12,269,142.00 | 2.75 |
| 50 | 300373 | 扬杰科技 | 12,188,675.26 | 2.73 |
| 51 | 603786 | 科博达 | 12,153,220.00 | 2.72 |
| 52 | 002281 | 光迅科技 | 12,059,284.00 | 2.70 |
| 53 | 000988 | 华工科技 | 12,041,834.00 | 2.70 |
| 54 | 603486 | 科沃斯 | 11,965,380.00 | 2.68 |
| 55 | 000060 | 中金岭南 | 11,899,665.20 | 2.67 |
| 56 | 600582 | 天地科技 | 11,855,826.00 | 2.66 |
| 57 | 002080 | 中材科技 | 11,848,588.00 | 2.65 |
| 58 | 600271 | 航天信息 | 11,847,886.00 | 2.65 |
| 59 | 002797 | 第一创业 | 11,847,777.00 | 2.65 |
| 60 | 002202 | 金风科技 | 11,831,729.00 | 2.65 |
| 61 | 002841 | 视源股份 | 11,708,507.00 | 2.62 |
| 62 | 688772 | 珠海冠宇 | 11,685,785.84 | 2.62 |
| 63 | 688281 | 华秦科技 | 11,608,929.52 | 2.60 |
| 64 | 600038 | 中直股份 | 11,597,878.00 | 2.60 |
| 65 | 603737 | 三棵树 | 11,557,025.00 | 2.59 |
| 66 | 603893 | 瑞芯微 | 11,484,354.00 | 2.57 |
| 67 | 688017 | 绿的谐波 | 11,148,768.77 | 2.50 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 68 | 000039 | 中集集团 | 11,099,184.00 | 2.49 |
| 69 | 600763 | 通策医疗 | 11,076,770.80 | 2.48 |
| 70 | 000709 | 河钢股份 | 11,056,494.00 | 2.48 |
| 71 | 603565 | 中谷物流 | 11,023,397.00 | 2.47 |
| 72 | 603077 | 和邦生物 | 10,803,060.00 | 2.42 |
| 73 | 603858 | 步长制药 | 10,791,832.85 | 2.42 |
| 74 | 600361 | 创新新材 | 10,657,404.00 | 2.39 |
| 75 | 002500 | 山西证券 | 10,596,678.30 | 2.37 |
| 76 | 600008 | 首创环保 | 10,565,978.50 | 2.37 |
| 77 | 603979 | 金诚信 | 10,539,586.00 | 2.36 |
| 78 | 688387 | 信科移动 | 10,474,418.64 | 2.35 |
| 79 | 600848 | 上海临港 | 10,455,071.00 | 2.34 |
| 80 | 300627 | 华测导航 | 10,233,862.00 | 2.29 |
| 81 | 688578 | 艾力斯 | 10,202,227.32 | 2.29 |
| 82 | 601991 | 大唐发电 | 10,169,543.00 | 2.28 |
| 83 | 002532 | 天山铝业 | 10,164,901.00 | 2.28 |
| 84 | 600879 | 航天电子 | 10,040,996.00 | 2.25 |
| 85 | 603659 | 璞泰来 | 9,925,997.00 | 2.22 |
| 86 | 002340 | 格林美 | 9,892,769.00 | 2.22 |
| 87 | 600867 | 通化东宝 | 9,857,052.00 | 2.21 |
| 88 | 002203 | 海亮股份 | 9,829,876.97 | 2.20 |
| 89 | 002850 | 科达利 | 9,779,834.00 | 2.19 |
| 90 | 002353 | 杰瑞股份 | 9,732,249.00 | 2.18 |
| 91 | 603129 | 春风动力 | 9,683,991.00 | 2.17 |
| 92 | 600299 | 安迪苏 | 9,664,493.11 | 2.16 |
| 93 | 001696 | 宗申动力 | 9,650,040.00 | 2.16 |
| 94 | 000623 | 吉林敖东 | 9,630,369.00 | 2.16 |
| 95 | 600060 | 海信视像 | 9,618,188.00 | 2.15 |
| 96 | 000987 | 越秀资本 | 9,544,970.67 | 2.14 |
| 97 | 002266 | 浙富控股 | 9,336,945.00 | 2.09 |
| 98 | 300866 | 安克创新 | 9,257,619.88 | 2.07 |
| 99 | 601636 | 旗滨集团 | 9,171,542.00 | 2.05 |
| 100 | 300395 | 菲利华 | 9,149,889.00 | 2.05 |
| 101 | 002939 | 长城证券 | 8,964,268.91 | 2.01 |
| 102 | 000543 | 皖能电力 | 8,934,166.00 | 2.00 |
| 103 | 002831 | 裕同科技 | 8,928,466.00 | 2.00 |

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

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 | 688213 | 思特威 | 24,694,841.52 | 5.53 |
| 2 | 300803 | 指南针 | 22,475,433.15 | 5.03 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 3 | 688778 | 厦钨新能 | 22,213,511.62 | 4.98 |
| 4 | 300604 | 长川科技 | 21,621,551.00 | 4.84 |
| 5 | 300476 | 胜宏科技 | 21,549,120.36 | 4.83 |
| 6 | 601168 | 西部矿业 | 19,893,162.00 | 4.46 |
| 7 | 000050 | 深天马 A | 18,843,917.00 | 4.22 |
| 8 | 688469 | 芯联集成 | 18,420,792.58 | 4.13 |
| 9 | 002958 | 青农商行 | 18,014,768.00 | 4.04 |
| 10 | 600499 | 科达制造 | 17,651,476.00 | 3.95 |
| 11 | 002138 | 顺络电子 | 17,425,670.00 | 3.90 |
| 12 | 688188 | 柏楚电子 | 17,328,387.00 | 3.88 |
| 13 | 300573 | 兴齐眼药 | 17,156,115.89 | 3.84 |
| 14 | 600517 | 国网英大 | 17,138,353.00 | 3.84 |
| 15 | 600959 | 江苏有线 | 16,929,196.00 | 3.79 |
| 16 | 000783 | 长江证券 | 16,847,275.00 | 3.77 |
| 17 | 600578 | 京能电力 | 16,794,984.00 | 3.76 |
| 18 | 002432 | 九安医疗 | 16,649,921.00 | 3.73 |
| 19 | 688002 | 睿创微纳 | 16,510,207.27 | 3.70 |
| 20 | 600704 | 物产中大 | 16,428,783.00 | 3.68 |
| 21 | 600008 | 首创环保 | 16,161,215.00 | 3.62 |
| 22 | 002414 | 高德红外 | 15,975,234.34 | 3.58 |
| 23 | 002500 | 山西证券 | 15,910,419.80 | 3.56 |
| 24 | 002266 | 浙富控股 | 15,903,011.00 | 3.56 |
| 25 | 000893 | 亚钾国际 | 15,845,940.00 | 3.55 |
| 26 | 603786 | 科博达 | 15,673,197.00 | 3.51 |
| 27 | 688578 | 艾力斯 | 15,356,498.54 | 3.44 |
| 28 | 688099 | 晶晨股份 | 15,269,118.64 | 3.42 |
| 29 | 000825 | 太钢不锈 | 15,007,914.00 | 3.36 |
| 30 | 600329 | 达仁堂 | 14,962,142.20 | 3.35 |
| 31 | 300677 | 英科医疗 | 14,798,870.00 | 3.32 |
| 32 | 002202 | 金风科技 | 14,649,900.00 | 3.28 |
| 33 | 688183 | 生益电子 | 14,618,971.57 | 3.27 |
| 34 | 688281 | 华秦科技 | 14,617,804.70 | 3.27 |
| 35 | 000988 | 华工科技 | 14,518,786.70 | 3.25 |
| 36 | 002850 | 科达利 | 14,359,774.00 | 3.22 |
| 37 | 000039 | 中集集团 | 14,343,927.00 | 3.21 |
| 38 | 603893 | 瑞芯微 | 14,300,793.00 | 3.20 |
| 39 | 000060 | 中金岭南 | 14,277,140.00 | 3.20 |
| 40 | 600879 | 航天电子 | 14,076,050.00 | 3.15 |
| 41 | 688425 | 铁建重工 | 13,834,441.72 | 3.10 |
| 42 | 600909 | 华安证券 | 13,593,647.00 | 3.05 |
| 43 | 600998 | 九州通 | 13,341,057.07 | 2.99 |
| 44 | 002080 | 中材科技 | 13,334,063.00 | 2.99 |
| 45 | 689009 | 九号公司 | 13,315,320.34 | 2.98 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 46 | 002056 | 横店东磁 | 13,312,121.00 | 2.98 |
| 47 | 603596 | 伯特利 | 13,252,967.00 | 2.97 |
| 48 | 301165 | 锐捷网络 | 13,166,825.00 | 2.95 |
| 49 | 600380 | 健康元 | 13,053,944.60 | 2.92 |
| 50 | 002624 | 完美世界 | 12,998,142.12 | 2.91 |
| 51 | 603816 | 顾家家居 | 12,926,435.00 | 2.90 |
| 52 | 601456 | 国联民生 | 12,897,094.00 | 2.89 |
| 53 | 000997 | 新大陆 | 12,796,670.00 | 2.87 |
| 54 | 600352 | 浙江龙盛 | 12,757,618.00 | 2.86 |
| 55 | 000636 | 风华高科 | 12,594,907.00 | 2.82 |
| 56 | 002517 | 恺英网络 | 12,589,313.00 | 2.82 |
| 57 | 603737 | 三棵树 | 12,563,316.60 | 2.81 |
| 58 | 600271 | 航天信息 | 12,526,490.00 | 2.81 |
| 59 | 688122 | 西部超导 | 12,504,152.37 | 2.80 |
| 60 | 600582 | 天地科技 | 12,478,393.00 | 2.80 |
| 61 | 002281 | 光迅科技 | 12,437,565.73 | 2.79 |
| 62 | 600435 | 北方导航 | 12,418,064.00 | 2.78 |
| 63 | 002273 | 水晶光电 | 12,395,297.15 | 2.78 |
| 64 | 601399 | 国机重装 | 12,309,457.00 | 2.76 |
| 65 | 002299 | 圣农发展 | 12,057,415.00 | 2.70 |
| 66 | 002939 | 长城证券 | 11,773,987.00 | 2.64 |
| 67 | 603233 | 大参林 | 11,743,020.00 | 2.63 |
| 68 | 300496 | 中科创达 | 11,683,356.00 | 2.62 |
| 69 | 688772 | 珠海冠宇 | 11,628,454.88 | 2.60 |
| 70 | 600361 | 创新新材 | 11,578,833.00 | 2.59 |
| 71 | 603979 | 金诚信 | 11,524,196.00 | 2.58 |
| 72 | 603379 | 三美股份 | 11,399,878.00 | 2.55 |
| 73 | 688093 | 世华科技 | 11,260,227.73 | 2.52 |
| 74 | 603087 | 甘李药业 | 11,226,740.00 | 2.51 |
| 75 | 300003 | 乐普医疗 | 11,224,142.68 | 2.51 |
| 76 | 002797 | 第一创业 | 11,190,249.00 | 2.51 |
| 77 | 600038 | 中直股份 | 11,184,051.88 | 2.51 |
| 78 | 300866 | 安克创新 | 11,072,077.00 | 2.48 |
| 79 | 600583 | 海油工程 | 11,038,246.00 | 2.47 |
| 80 | 000709 | 河钢股份 | 11,028,559.00 | 2.47 |
| 81 | 002410 | 广联达 | 11,020,540.00 | 2.47 |
| 82 | 002507 | 涪陵榨菜 | 10,968,144.19 | 2.46 |
| 83 | 600663 | 陆家嘴 | 10,950,742.36 | 2.45 |
| 84 | 600339 | 中油工程 | 10,877,670.00 | 2.44 |
| 85 | 002368 | 太极股份 | 10,856,434.00 | 2.43 |
| 86 | 000401 | 金隅冀东 | 10,803,644.00 | 2.42 |
| 87 | 603077 | 和邦生物 | 10,797,802.00 | 2.42 |
| 88 | 603565 | 中谷物流 | 10,769,108.00 | 2.41 |

| | | | | |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 89 | 603129 | 春风动力 | 10,750,783.00 | 2.41 |
| 90 | 601019 | 山东出版 | 10,648,869.00 | 2.39 |
| 91 | 000750 | 国海证券 | 10,643,278.20 | 2.38 |
| 92 | 002353 | 杰瑞股份 | 10,608,249.00 | 2.38 |
| 93 | 603444 | 吉比特 | 10,596,717.00 | 2.37 |
| 94 | 600299 | 安迪苏 | 10,458,898.00 | 2.34 |
| 95 | 002487 | 大金重工 | 10,317,670.00 | 2.31 |
| 96 | 001227 | 兰州银行 | 10,307,460.00 | 2.31 |
| 97 | 002557 | 洽洽食品 | 10,266,878.00 | 2.30 |
| 98 | 601991 | 大唐发电 | 10,250,255.00 | 2.30 |
| 99 | 002203 | 海亮股份 | 10,249,691.41 | 2.30 |
| 100 | 600763 | 通策医疗 | 10,232,866.00 | 2.29 |
| 101 | 600325 | 华发股份 | 10,133,465.00 | 2.27 |
| 102 | 688387 | 信科移动 | 10,131,980.95 | 2.27 |
| 103 | 601555 | 东吴证券 | 10,107,962.00 | 2.26 |
| 104 | 600873 | 梅花生物 | 10,106,223.00 | 2.26 |
| 105 | 300002 | 神州泰岳 | 10,070,834.00 | 2.26 |
| 106 | 300373 | 扬杰科技 | 10,050,234.00 | 2.25 |
| 107 | 002532 | 天山铝业 | 10,031,832.00 | 2.25 |
| 108 | 600208 | 衢州发展 | 10,020,410.00 | 2.24 |
| 109 | 603858 | 步长制药 | 9,972,821.89 | 2.23 |
| 110 | 688588 | 凌志软件 | 9,958,875.47 | 2.23 |
| 111 | 300395 | 菲利华 | 9,772,178.00 | 2.19 |
| 112 | 003022 | 联泓新科 | 9,756,281.00 | 2.19 |
| 113 | 300627 | 华测导航 | 9,753,659.20 | 2.18 |
| 114 | 688582 | 芯动联科 | 9,690,123.59 | 2.17 |
| 115 | 601568 | 北元集团 | 9,676,519.40 | 2.17 |
| 116 | 601997 | 贵阳银行 | 9,668,791.84 | 2.17 |
| 117 | 688676 | 金盘科技 | 9,609,307.91 | 2.15 |
| 118 | 600109 | 国金证券 | 9,510,854.75 | 2.13 |
| 119 | 001696 | 宗申动力 | 9,473,139.00 | 2.12 |
| 120 | 000878 | 云南铜业 | 9,444,386.00 | 2.12 |
| 121 | 600655 | 豫园股份 | 9,281,164.22 | 2.08 |
| 122 | 600867 | 通化东宝 | 9,255,721.50 | 2.07 |
| 123 | 002821 | 凯莱英 | 9,252,116.20 | 2.07 |
| 124 | 000537 | 中绿电 | 9,242,249.00 | 2.07 |
| 125 | 000959 | 首钢股份 | 9,208,756.00 | 2.06 |
| 126 | 601636 | 旗滨集团 | 9,121,024.85 | 2.04 |
| 127 | 603486 | 科沃斯 | 9,091,656.00 | 2.04 |
| 128 | 600096 | 云天化 | 9,050,865.54 | 2.03 |
| 129 | 000623 | 吉林敖东 | 9,026,229.39 | 2.02 |
| 130 | 688017 | 绿的谐波 | 9,008,564.31 | 2.02 |
| 131 | 002385 | 大北农 | 9,006,605.00 | 2.02 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 132 | 600739 | 辽宁成大 | 8,958,824.00 | 2.01 |
| 133 | 600885 | 宏发股份 | 8,943,064.30 | 2.00 |

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 | 2,901,346,907.17 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 3,065,244,772.86 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，长江证券股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局湖北省分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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 | 75,257.32 |
| 2 | 应收清算款 | 135,330.02 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,237,252.73 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,447,840.07 |

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 | 10,752 | 15,275.26 | 4,722,857.07 | 2.88% | 159,516,756.19 | 97.12% |
| 博时中证 500 指数增 强 C | 8,149 | 9,171.66 | 11,396,408.40 | 15.25% | 63,343,419.29 | 84.75% |
| 合计 | 18,738 | 12,753.73 | 16,119,265.47 | 6.75% | 222,860,175.48 | 93.25% |

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 | 158,236.40 | 0.10% |
| | 博时中证 500 指 数增强 C | 8,135.52 | 0.01% |
| | 合计 | 166,371.92 | 0.07% |

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

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§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 | 266,495,854.94 | 84,777,955.61 |
| 本报告期基金总申购份额 | 69,090,576.43 | 67,786,412.58 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 171,346,818.11 | 77,824,540.50 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 164,239,613.26 | 74,739,827.69 |

§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

基金管理人于 2025 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》，张东先生任公司董事长（法定代表人）、代任公司总经理，离任公司总经理。江向阳先生离任公司董事长。

基金管理人于 2025 年 11 月 12 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》，陈宇先生任公司总经理。

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 38000 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

| 管理人受调查或处罚等情况 | 内容 |
|---------------|--|
| 受到调查或处罚等措施的主体 | 博时基金管理有限公司 |
| 受到调查或处罚等措施的时间 | 2025 年 10 月 31 日 |
| 采取调查或处罚等措施的机构 | 中国证监会深圳监管局 |
| 受到调查或处罚等措施类型 | 行政监管措施 |
| 受到的具体措施类型 | 责令改正、暂停部分业务 |
| 受到调查或处罚等措施的原因 | 合规内控 |
| 受到处罚的依据 | 《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、 |

| | |
|-----------------------|---|
| | 《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收 |
| 其他 | - |

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

| 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 | 内容 |
|-----------------------|--|
| 受到调查或处罚等措施的主体 | 高级管理人员 1；高级管理人员 2 |
| 受到调查或处罚等措施的时间 | 2025 年 10 月 28 日；2025 年 10 月 28 日 |
| 采取调查或处罚等措施的机构 | 中国证监会深圳监管局；中国证监会深圳监管局 |
| 受到调查或处罚等措施类型 | 行政监管措施；行政监管措施 |
| 受到的具体措施类型 | 出具警示函；出具警示函 |
| 受到调查或处罚等措施的原因 | 合规内控；合规内控 |
| 受到处罚的依据 | 《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》；《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收；公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收 |
| 其他 | - |

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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 | |
| 财通证券 | 1 | 981,092,921.75 | 16.45% | 202,129.13 | 16.46% | - |
| 东兴证券 | 2 | 967,500,272.24 | 16.23% | 199,238.47 | 16.22% | - |
| 方正证券 | 1 | 848,773,763.34 | 14.23% | 174,769.24 | 14.23% | - |
| 广发证券 | 2 | 772,804,123.46 | 12.96% | 159,217.44 | 12.96% | - |
| 东吴证券 | 2 | 485,747,618.14 | 8.15% | 100,120.78 | 8.15% | - |

| | | | | | | |
|------------|---|----------------|-------|-----------|-------|--------|
| 长江证券 | 3 | 478,916,331.61 | 8.03% | 98,614.13 | 8.03% | - |
| 银河证券 | 2 | 372,060,057.99 | 6.24% | 76,633.69 | 6.24% | - |
| 中信建投 | 1 | 242,363,249.61 | 4.06% | 49,929.92 | 4.07% | - |
| 招商证券 | 5 | 237,275,888.48 | 3.98% | 48,915.46 | 3.98% | - |
| 西部证券 | 1 | 203,709,559.28 | 3.42% | 41,962.57 | 3.42% | - |
| 国泰海通 | 5 | 176,264,002.63 | 2.96% | 36,305.18 | 2.96% | 增加 5 个 |
| 中金公司 | 2 | 141,186,859.47 | 2.37% | 29,071.97 | 2.37% | - |
| 中信证券 | 2 | 54,917,028.06 | 0.92% | 11,306.79 | 0.92% | 减少 1 个 |
| 国新证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | 减少 2 个 |
| 第一创业 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富 证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

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

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

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

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 |
| 财通证券 | 1,519.22 | 0.23% | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 30,673.68 | 4.67% | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 550,020.00 | 83.73% | - | - | - | - |
| 长江证券 | 57,711.30 | 8.79% | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|-----------|-------|---|---|---|---|
| 银河证券 | 16,950.26 | 2.58% | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海通 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国新证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |

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暂停使用富友支付提供的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站 | 2025-12-31 |
| 2 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-12-18 |
| 3 | 博时基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-12-06 |
| 4 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子 | 2025-11-13 |

| | | 披露网站 | |
|----|--|--------------------------|------------|
| 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站 | 2025-11-12 |
| 6 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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站 | 2025-10-28 |
| 7 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-10-17 |
| 8 | 博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-10-16 |
| 9 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-09-30 |
| 10 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-09-04 |
| 11 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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站 | 2025-08-29 |
| 12 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-08-07 |
| 13 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 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站 | 2025-07-21 |
| 14 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-26 |
| 15 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金(博时中证 500 指数增强 C) 基金产品资料概要更新 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-26 |
| 16 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金(博时中证 500 指数增强 A) 基金产品资料概要更新 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-26 |
| 17 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250606 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-06 |
| 18 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250603 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-06-03 |
| 19 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 | 证券日报、基金管理人 | 2025-04-22 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|------------|
| | 1 季度报告 | 网站、证监会基金电子披露网站 | |
| 20 | 博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-04-08 |
| 21 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250408 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-04-08 |
| 22 | 博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度） | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-31 |
| 23 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-31 |
| 24 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-25 |
| 25 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金(博时中证 500 指数增强 C) 基金产品资料概要更新 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-22 |
| 26 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金(博时中证 500 指数增强 A) 基金产品资料概要更新 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-22 |
| 27 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-21 |
| 28 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-19 |
| 29 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-19 |
| 30 | 关于博时基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-03-19 |
| 31 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-02-27 |
| 32 | 博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告 | 证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2025-01-22 |

§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

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

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询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日