

# 贝莱德沪深 300 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：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况	50

8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	52
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	59
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12	投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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情况 .....	61
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4	基金投资策略的改变 .....	63
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	63
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8	其他重大事件 .....	64
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
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 .....	65
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
13.1	备查文件目录 .....	65
13.2	存放地点 .....	65
13.3	查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	贝莱德沪深 300 指数增强	
基金主代码	022366	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 11 月 26 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	631,668,991.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德沪深 300 指数增强 A	贝莱德沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022366	022367
报告期末下属分级基金的份额总额	297,998,783.01 份	333,670,208.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，通过量化选择股票的投资方法与严格的投资纪律约束，平衡预期收益、风险以及成本，优化管理组合，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金作为指数增强型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券投资策略</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>6、金融衍生品投资策略</p> <p>7、参与融资、转融通证券出借业务策略</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		贝莱德基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	杨军智
	联系电话	021-80225188	010-60834299
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		400-002-6655	010-60836588
传真		021-80225288	010-60834004
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		200120	100125
法定代表人		郁蓓华	张佑君

## 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	www.blackrock.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年 11 月 26 日(基金合同生效日)-2024 年 12 月 31 日	
	贝莱德沪深 300 指数增强 A	贝莱德沪深 300 指数增强 C	贝莱德沪深 300 指数增强 A	贝莱德沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	41,147,620.85	32,068,738.81	2,496,487.26	1,827,329.75
本期利润	53,764,322.91	36,418,993.81	12,892,825.41	9,917,571.84
加权平均基金份额本期利润	0.1883	0.1602	0.0343	0.0339
本期加权平均净值利润率	17.00%	14.50%	3.34%	3.30%

本期基金份额净值增长率	16.58%	16.12%	3.43%	3.39%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末	
期末可供分配利润	44,047,303.64	47,607,130.64	2,496,487.26	1,827,329.75
期末可供分配基金份额利润	0.1478	0.1427	0.0066	0.0062
期末基金资产净值	359,336,925.11	400,591,564.45	389,155,293.41	302,727,558.56
期末基金份额净值	1.2058	1.2006	1.0343	1.0339
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末	
基金份额累计净值增长率	20.58%	20.06%	3.43%	3.39%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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

贝莱德沪深 300 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	-0.02%	0.89%	-0.20%	0.90%	0.18%	-0.01%
过去六个月	14.39%	0.83%	16.72%	0.86%	-2.33%	-0.03%
过去一年	16.58%	0.90%	16.79%	0.91%	-0.21%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	20.58%	0.89%	19.30%	0.91%	1.28%	-0.02%

贝莱德沪深 300 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	-0.12%	0.89%	-0.20%	0.90%	0.08%	-0.01%
过去六个月	14.17%	0.83%	16.72%	0.86%	-2.55%	-0.03%
过去一年	16.12%	0.90%	16.79%	0.91%	-0.67%	-0.01%
自基金合同生效 日起至今	20.06%	0.89%	19.30%	0.91%	0.76%	-0.02%

### 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

贝莱德沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



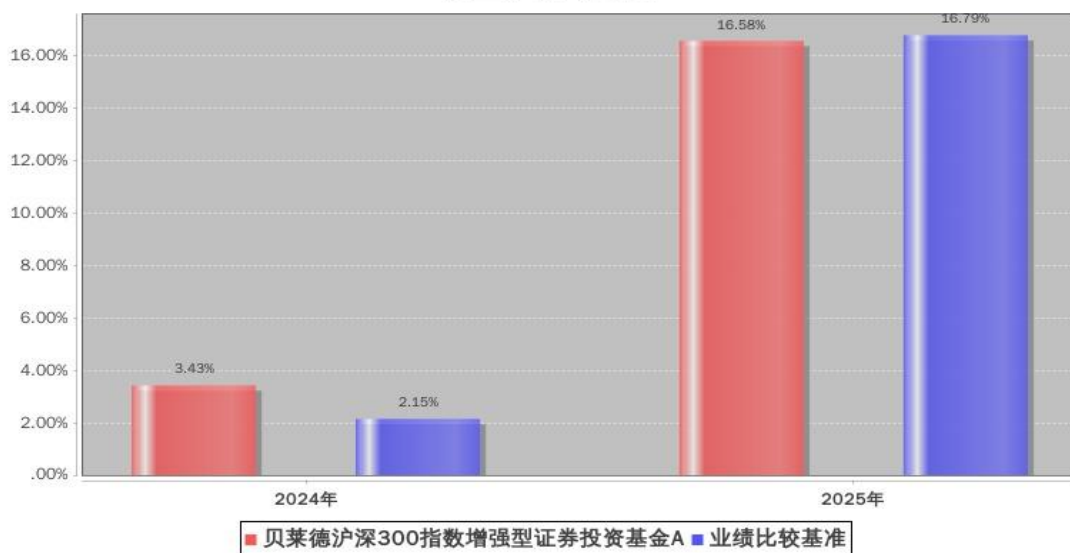
贝莱德沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



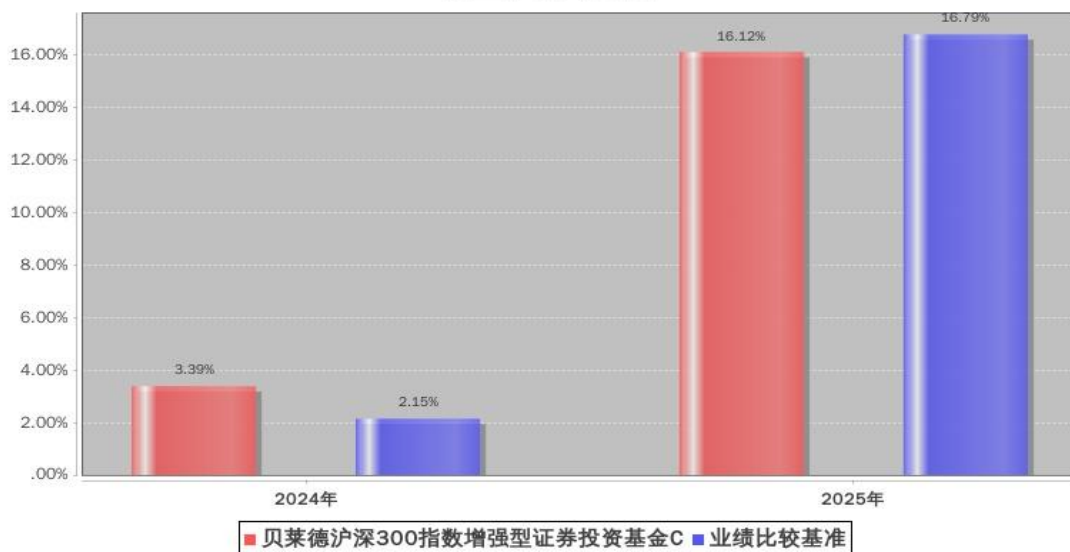
注：本基金的基金合同于 2024 年 11 月 26 日生效，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日期为 2024 年 11 月 26 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自2024年11月26日(基金合同生效日)至2025年12月31日未进行利润分配。

## § 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

贝莱德基金管理有限公司成立于 2020 年 9 月 10 日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917 号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了 18 只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金、贝莱德先进制造一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金、贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金、贝莱德行业优选混合型证券投资基金、贝莱德安睿 30 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德卓越远航混合型证券投资基金、贝莱德中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、贝莱德安裕 90 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金、贝莱德中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、贝莱德和悦利率债债券型证券投资基金、贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金、贝莱德富元添益债券型证券投资基金、贝莱德安泽 60 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德中债投资优选绿色债券指数证券投资基金、贝莱德中证 500 指数增强型证

券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓京	本基金的基金经理，权益、量化及多资产首席投资官	2024年11月26日	-	15年	王晓京先生，权益、量化及多资产首席投资官，基金经理。曾受雇于贝莱德英国（BlackRock Investment Management (UK) Limited）以及贝莱德建信理财有限责任公司，历任研究员、基金经理等职务。加入贝莱德之前，王晓京先生曾就职于花旗银行（伦敦），任投资银行部分析员。王晓京先生是特许金融分析师（CFA）持证人，拥有清华大学电子信息工程学士学位、英国伯明翰大学电子工程硕士学位、伦敦大学电子工程博士学位。
邹立波	本基金的基金经理助理	2025年2月27日	-	8年	邹立波先生，固定收益投资部基金经理及基金经理助理，曾任专户投资部投资经理。曾就职于信银理财有限责任公司、中信银行总行资产管理业务中心、中信银行上海分行、南瑞集团有限公司。邹立波先生拥有新西兰奥克兰理工大学硕士学位、奥克兰大学学士学位。

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

2、证券从业的含义遵从《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》及行业协会的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《贝莱德

基金管理有限公司公平交易管理流程》。公司通过严谨科学的投资决策体系、内控制度和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和内部审计等对公平交易过程和结果进行监督。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在产品运作层面，截至 2025 年 12 月 31 日，本基金全年取得了收益率 16.58%(A 类)及 16.12%(C 类)，但相较于业绩比较基准小幅跑输，超额收益分别为-0.21%(A 类)及-0.67%(C 类)。其中行业维度，相较于业绩比较基准，非银金融、计算机、银行板块对组合的超额收益贡献居前；而有色金属、通信及电力设备板块为组合超额收益的主要拖累。此外，本基金运用了股指期货对组合的现金管理进行优化、灵活调节股票的风险敞口，本年度股指期货的投资对于整体组合管理带来了积极贡献，并对超额收益带来正向拉动。

回顾本年度的运作，本基金于 2025 年 1 月初结束封闭期，我们增加了主动风险敞口，并将主要的主动风险预算置于个股选择上，整体一季度内组合超额收益累积超过 2%，且个股选择是超额收益的主要贡献来源。4 月 7 日美国对等关税造成股票市场大幅回撤，投资者情绪也随之波动，随后大量宽基 ETF 资金托底。我们也做出了积极应对：减少了组合的主动风险敞口，增加了对指数权重股的配置，以减少自由选股部分未受到市场托举造成的拖累。此外，短暂增持适量现金以应对投资者申赎需求。本基金超额收益在 4 月小幅回撤后由 5 月开始显著修复，策略在二季度整体表现稳定。2025 年三季度，市场的高斜率窄幅上涨对本基金选股效果带来明显影响，尤其是通信板块。叠加三季度 A 股展现为情绪主导的牛市，模型端质量类信号和价值类信号的表现欠佳也对超额收益形成负贡献，因此整体三季度本基金的相对表现不理想。进入四季度，市场的涨速有所缓和，波动开始放大，且 10 月地缘政治的博弈再现，投资者趋于谨慎，情绪类信号表现开始回撤。我们再次降低了主动风险敞口，并在模型层面对信号集进行了一系列改进。此外，在现有模

型的基础上我们亦增加了若干新的优化措施，例如补充了新的另类数据信号，增加了机器学习模型的敏感性，运用主题机器人强化对市场主题的识别等，上述努力取得了一定效果，本基金在选股上的有效性也逐步增强，组合的超额收益也自 11 月开始显著修复，四季度整体跑赢了业绩比较基准。整体而言，2025 年组合虽小幅跑输业绩比较基准，但我们对于系统化模型的方法论，以及中长期量化选股的投资逻辑仍抱有坚定信心。未来我们将保持对市场的紧密跟踪，积极应对，力争为投资者获取持续的超额回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 1.2058 元，本报告期内净值增长率 16.58%，同期业绩比较基准收益率 16.79%。截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.2006 元，本报告期内净值增长率 16.12%，同期业绩比较基准收益率 16.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年，我们对股票市场维持积极观点：沪深 300 指数当前市净率在近 10 年均值附近，市盈率也仍有上行空间，长期权益风险溢价仍比理论中枢便宜，投资者风险偏好的逐步上升也可能促使长期风险溢价降低。此外，低利率市场环境大概率延续，这也使得权益资产以及股票的现金流价值进一步凸显，增量资金可期。拉长时间线，我们认为当前若得到下述几个因素助推，A 股有望迎来全面牛市：

1) 流动性充沛。美国持续降息带来流动性外溢，我国的货币政策进一步放开，进行降息以及继续增量购买国债（QE）。流动性极度充沛的低利率环境下，股票会成为投资者不得不追逐现金流价值的资产类别。

2) 股票盈利以及现金流的实际提升和兑现。2025 年 A 股市场的上涨中，涨幅大部分来自于估值拔升，盈利增长的驱动有限，因此业绩的兑现对于 2026 年牛市的持续性以及是否能超越前高非常重要。

3) 增量刺激政策适时推出、且力度达到甚至超过市场预期。2026 作为十五五规划的开局之年，各类政策力度值得期待。并且经济基本面仍处于修复过程中，现金流及 GDP 的增长也需要政策的提振。

4) 中美以及其他有重要经贸往来的国家地区，地缘政治缓和且减少黑天鹅事件。当然，这类风险无法完全避免，所以要求投资组合在各类风险敞口上有分散性，出现风险事件后可以快速、灵活应对。

具体方向上而言，我们认为科技仍是重要领域，近年来中国科技行业在模型以及应用端均树

立了自主创新能力,尽管 2025 年部分标的已有明显涨幅,但 AI 浪潮对各行各业的改造远未完成,产业进展及创新预计仍将活跃,且部分资产相较于美国科技股估值仍有明显折价;此外,全球产业链重构下,供需格局的边际变化叠加宏观层面的多重驱动因素也为资源品带来投资机遇。另外,扩内需政策的托举、消费活力的修复及具备吸引力的估值水平也使得 A 股中的消费板块值得关注。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人有效落实合规管理、风险防控及监察稽核工作。合规管理方面,公司制定了一系列合规管理制度,建立健全合规管理机制,并对投资交易等重点领域强化合规风险防控。公司建立了投资监督机制,对基金投资交易过程中的合规风险进行把控。公司积极开展合规培训,强化员工合规意识,培育合规文化,促进廉洁从业。公司严格落实信息披露要求,按期完成信息披露工作。风险防控方面,公司秉承风险管理为核心的管理理念,搭建了内部风险管理系统并持续完善,对投资、流动性、信用、集中度、赎回和可持续性等相关风险进行度量,保障基金承担的风险审慎、适当。同时,动态监测并与基金经理密切沟通基金风险水平,力争确保投资组合预期与业绩的一致性。监察稽核方面,公司定期和不定期开展内部稽核及合规检查,对发现的问题积极完善,为公司业务合规运作和稳健经营保驾护航。

报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将持续加强监察稽核管理,坚持基金份额持有人利益优先,切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值,本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程,定期评估估值技术的合理性,基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况,本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，贝莱德基金管理有限公司在贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本报告期，由贝莱德基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(26)第 P02066 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日及 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2025 年度及 2024 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制公允反映了贝莱德沪深 300 指数增强型</p>

	<p>证券投资基金 2025 年 12 月 31 日及 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度及 2024 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则,我们独立于贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>贝莱德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,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而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金的持续经营能力,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贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责	<p>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</p>

任	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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,就可能对贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金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贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	胡小骏   周月洁
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：贝莱德沪深 300 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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	51,957,639.01	3,908,697.43
结算备付金		18,643,789.36	-
存出保证金		4,576,276.80	-
交易性金融资产	7.4.7.2	689,984,988.18	688,630,583.92
其中：股票投资		670,778,335.03	653,242,595.40
基金投资		-	-
债券投资		19,206,653.15	35,387,988.52
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,870,410.29	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		775,033,103.64	692,539,281.35
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		14,237,592.50	-

应付管理人报酬		475,466.07	466,780.21
应付托管费		89,149.88	87,521.29
应付销售服务费		110,088.39	102,127.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,617.24	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	167,700.00	-
负债合计		15,104,614.08	656,429.38
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	631,668,991.01	669,072,454.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	128,259,498.55	22,810,397.25
净资产合计		759,928,489.56	691,882,851.97
负债和净资产总计		775,033,103.64	692,539,281.35

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 631,668,991.01 份，其中 A 类基金份额净值 1.2058 元，基金份额 297,998,783.01 份；C 类基金份额净值 1.2006 元，基金份额 333,670,208.00 份。

2、本基金合同于 2024 年 11 月 26 日生效，本财务报表的实际编制期间为 2025 年度和 2024 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：贝莱德沪深 300 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 11 月 26 日（基 金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		96,788,240.28	23,570,004.68
1. 利息收入		453,184.27	34,707.56
其中：存款利息收入	7.4.7.9	440,863.17	34,707.56
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		12,321.10	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		79,072,576.49	5,048,716.88
其中：股票投资收益	7.4.7.10	58,826,859.71	4,238,754.35

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	309,477.69	41,418.38
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	5,367,237.82	-
股利收益	7.4.7.13	14,569,001.27	768,544.15
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.14	16,966,957.06	18,486,580.24
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.15	295,522.46	-
<b>减：二、营业总支出</b>		6,604,923.56	759,607.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,555,064.40	525,616.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	854,074.56	98,553.13
3. 销售服务费		1,008,576.15	115,002.23
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. 税金及附加		19,420.98	-
8. 其他费用	7.4.7.16	167,787.47	20,435.41
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		90,183,316.72	22,810,397.25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		90,183,316.72	22,810,397.25
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		90,183,316.72	22,810,397.25

### 7.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德沪深 300 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	669,072,454.72	22,810,397.25	691,882,851.97
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	669,072,454.72	22,810,397.25	691,882,851.97
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-37,403,463.71	105,449,101.30	68,045,637.59
(一)、综合收益总额	-	90,183,316.72	90,183,316.72
(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)	-37,403,463.71	15,265,784.58	-22,137,679.13
其中：1. 基金申购款	2,226,413,189.44	259,109,580.07	2,485,522,769.51
2. 基金赎回款	-2,263,816,653.15	-243,843,795.49	-2,507,660,448.64
(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	631,668,991.01	128,259,498.55	759,928,489.56
项目	上年度可比期间		
	2024 年 11 月 26 日(基金合同生效日)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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	669,072,454.72	-	669,072,454.72
三、本期增减变动额	-	22,810,397.25	22,810,397.25

(减少以“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	22,810,397.25	22,810,397.25
(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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
(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	669,072,454.72	22,810,397.25	691,882,851.97

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:

郁蓓华

杨怡

徐菱莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

贝莱德沪深 300 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[2024]1383 号《关于准予贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由贝莱德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《贝莱德沪深 300 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人民币 668,901,399.41 元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(24)第 00233 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 669,072,454.72 份基金份额,其中认购资金利息折合

171,055.31 份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《贝莱德沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德沪深 300 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，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会

计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日及 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度及 2024 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上年度可比期间为 2024 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且

保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，

不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后

的差额确认。

转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

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。

(3) 公允价值变动收益公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失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信用减值准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 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任一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；

(4) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

## 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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复缴纳增值税;取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、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,继续免征增值税直至债券到期。

(3) 对证券投资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,股权的股息、红

利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(4)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。对基金通过港股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。基金通过港股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。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、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。

(6)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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	51,263,058.53	991,880.31
等于：本金	51,246,242.90	991,528.16
加：应计利息	16,815.63	352.15
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	694,580.48	2,916,817.12
等于：本金	694,536.35	2,916,727.95

加：应计利息	44.13	89.17
减：坏账准备	-	-
合计	51,957,639.01	3,908,697.43

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易结算资金。

#### 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		635,315,931.06	-	670,778,335.03	35,462,403.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,975,460.00	205,153.15	19,206,653.15	26,040.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	18,975,460.00	205,153.15	19,206,653.15	26,040.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		654,291,391.06	205,153.15	689,984,988.18	35,488,443.97
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		634,812,175.16	-	653,242,595.40	18,430,420.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	35,107,690.00	224,138.52	35,387,988.52	56,160.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	35,107,690.00	224,138.52	35,387,988.52	56,160.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		669,919,865.16	224,138.52	688,630,583.92	18,486,580.24

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	38,170,546.67	-	-	
其中： 股指期货	38,170,546.67	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	38,170,546.67	-	-	
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/ 卖）	合约市值	公允价值变动
IM2606	IM2606	3.00	4,322,760.00	-42,240.00
IC2606	IC2606	12.00	17,237,760.00	16,693.33
IF2602	IF2602	12.00	16,575,120.00	-9,360.00
合计				-34,906.67
减：可抵销期货暂收款				-34,906.67
净额				0.00

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率\权益衍生工具为国债\股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债\股指期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债\股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

#### 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	167,700.00	0.00
其他	0.00	0.00
合计	167,700.00	-

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 贝莱德沪深 300 指数增强 A

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	376,262,468.00	376,262,468.00
本期申购	828,492,415.40	828,492,415.40
本期赎回（以“-”号填列）	-906,756,100.39	-906,756,100.39
本期末	297,998,783.01	297,998,783.01

##### 贝莱德沪深 300 指数增强 C

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	292,809,986.72	292,809,986.72
本期申购	1,397,920,774.04	1,397,920,774.04
本期赎回（以“-”号填列）	-1,357,060,552.76	-1,357,060,552.76
本期末	333,670,208.00	333,670,208.00

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金基金合同于 2024 年 11 月 26 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 668,901,399.41 元,折合基金份额 668,901,399.41 份;募集资金在募集期间产生的活期存款利息为人民币 171,055.31 元,折合基金份额 171,055.31 份;以上收到的实收基金(本息)共计人民币 669,072,454.72 元,折合基金份额 669,072,454.72 份。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位:人民币元

贝莱德沪深 300 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,496,487.26	10,396,338.15	12,892,825.41
加:会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,496,487.26	10,396,338.15	12,892,825.41
本期利润	41,147,620.85	12,616,702.06	53,764,322.91
本期基金份额交易产生的变动数	403,195.53	-5,722,201.75	-5,319,006.22
其中:基金申购款	67,255,672.55	26,440,610.45	93,696,283.00
基金赎回款	-66,852,477.02	-32,162,812.20	-99,015,289.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,047,303.64	17,290,838.46	61,338,142.10

贝莱德沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,827,329.75	8,090,242.09	9,917,571.84
加:会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,827,329.75	8,090,242.09	9,917,571.84
本期利润	32,068,738.81	4,350,255.00	36,418,993.81
本期基金份额交易产生的变动数	13,711,062.08	6,873,728.72	20,584,790.80
其中:基金申购款	113,577,915.13	51,835,381.94	165,413,297.07
基金赎回款	-99,866,853.05	-44,961,653.22	-144,828,506.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,607,130.64	19,314,225.81	66,921,356.45

#### 7.4.7.9 存款利息收入

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 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	302,759.27	32,563.43

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	2,361.94	2,139.33
结算备付金利息收入	126,263.16	-
其他	9,478.80	4.80
合计	440,863.17	34,707.56

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

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11月26日（基金合 同生效日）至2024年12月 31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	58,826,859.71	4,238,754.35
股票投资收益——赎回 差价收入	-	-
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	58,826,859.71	4,238,754.35

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

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11月26日（基金 合同生效日）至2024年12月31 日
卖出股票成交总 额	1,621,230,604.69	117,757,412.69
减：卖出股票成本 总额	1,560,746,717.26	113,229,216.68
减：交易费用	1,657,027.72	289,441.66
买卖股票差价收 入	58,826,859.71	4,238,754.35

##### 7.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年11月26日（基金合同 生效日）至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	316,686.37	44,947.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,208.68	-3,528.71
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	309,477.69	41,418.38

#### 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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年11月26日（基金合同 生效日）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	35,513,622.21	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,107,690.00	-
减：应计利息总额	409,622.21	-
减：交易费用	3,518.68	3,528.71
买卖债券差价收入	-7,208.68	-3,528.71

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

##### 7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

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11月26日（基金合同 生效日）至2024年12月 31日
----	---------------------------------	-----------------------------------------------------

股指期货投资收益	5,367,237.82	-
----------	--------------	---

## 7.4.7.13 股利收益

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 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	14,569,001.27	768,544.15
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	14,569,001.27	768,544.15

## 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	17,001,863.73	18,486,580.24
股票投资	17,031,983.73	18,430,420.24
债券投资	-30,120.00	56,160.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-34,906.67	-
权证投资	-	-
黄金递延合约	-	-
远期投资	-	-
股指期货	-34,906.67	-
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	16,966,957.06	18,486,580.24

## 7.4.7.15 其他收入

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 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	295,483.62	-

基金转出费收入	38.84	-
合计	295,522.46	-

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

#### 7.4.7.16 其他费用

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 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	47,700.00	-
信息披露费	120,000.00	20,000.00
证券出借违约金	-	-
存托服务费	87.47	35.41
开户费	0.00	400.00
合计	167,787.47	20,435.41

#### 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，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大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
贝莱德基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
贝莱德金融管理公司	基金管理人的股东
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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11月26日（基金 合同生效日）至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,555,064.40	525,616.66
其中：应支付销售机构的客户维护 费	2,011,317.53	257,193.56
应支付基金管理人的净管理费	2,543,746.87	268,423.10

注：支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%÷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11月26日（基金 合同生效日）至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	854,074.56	98,553.13

注：支付基金托管人中信证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷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		
	贝莱德沪深 300 指数 增强 A	贝莱德沪深 300 指数 增强 C	合计
中信证券	0.00	97,359.31	97,359.31
贝莱德基金	0.00	4,087.63	4,087.63

合计	0.00	101,446.94	101,446.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德沪深 300 指数 增强 A	贝莱德沪深 300 指数 增强 C	合计
中信证券	0.00	1,227.02	1,227.02
贝莱德基金	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	1,227.02	1,227.02

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设 A、C 两类基金份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：销售服务费=前一日 C 类基金份额对应的资产净值×0.40%÷当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025年12月30日	重大事项停牌	78.81	2026年01月15日	86.69	4,000	347,324.76	315,240.00	-
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年01月05日	278.00	15,528	3,309,986.65	4,234,796.16	-

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

## 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

本基金为股票指数增强型基金，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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

本基金在日常投资管理中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人致力于全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度出发，判断风险的种类、风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频率。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的金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，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。

本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用评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。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司；在银行间同业市场根据交易类型采取白名单和黑名单相

结合的方式防范交易对手风险。

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2025 年 12 月 31 日，本基金

持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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 2025 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

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

##### 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	51,957,639.01	-	-	-	51,957,639.01
结算备付金	18,643,789.36	-	-	-	18,643,789.36
存出保证金	-	-	-	4,576,276.80	4,576,276.80
交易性金融资产	19,206,653.15	-	-	-670,778,335.03	689,984,988.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,870,410.29	9,870,410.29
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	89,808,081.52	-	-	685,225,022.12	775,033,103.64
负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,237,592.50	14,237,592.50
应付管理人报酬	-	-	-	475,466.07	475,466.07
应付托管费	-	-	-	89,149.88	89,149.88
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	110,088.39	110,088.39
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	24,617.24	24,617.24
其他负债	-	-	-	167,700.00	167,700.00
负债总计	-	-	-	15,104,614.08	15,104,614.08
利率敏感度缺口	89,808,081.52	-	-	670,120,408.04	759,928,489.56
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	3,908,697.43	-	-	-	3,908,697.43
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	35,387,988.52	-	-	653,242,595.40	688,630,583.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,296,685.95	-	-	653,242,595.40	692,539,281.35
负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	466,780.21	466,780.21
应付托管费	-	-	-	87,521.29	87,521.29
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	102,127.88	102,127.88

应付投资顾问费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债总计	-	-	656,429.38	656,429.38
利率敏感度缺口	39,296,685.95	-	-652,586,166.02	691,882,851.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	5,075.96	49,880.80
市场利率上升 25 个基点	-5,070.47	-49,724.82	

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净

值的 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。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，以识别和测算本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	670,778,335.03	88.27	653,242,595.40	94.42
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	670,778,335.03	88.27	653,242,595.40	94.42

#### 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%	39,122,022.73	-
业绩比较基准下降 5%	-39,122,022.73	-	

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

## 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	666,228,298.87	653,242,595.40
第二层次	23,756,689.31	35,387,988.52
第三层次	-	-
合计	689,984,988.18	688,630,583.92

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

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	670,778,335.03	86.55
	其中：股票	670,778,335.03	86.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,206,653.15	2.48
	其中：债券	19,206,653.15	2.48
	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	70,601,428.37	9.11
8	其他各项资产	14,446,687.09	1.86
9	合计	775,033,103.64	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,974,398.00	0.39
B	采矿业	33,236,079.00	4.37
C	制造业	362,605,274.34	47.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,572,974.00	1.26
E	建筑业	5,125,703.00	0.67
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,090,193.00	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,874,052.00	3.80

J	金融业	152,670,692.29	20.09
K	房地产业	2,928,387.00	0.39
L	租赁和商务服务业	7,457,882.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	8,528,396.40	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	478,296.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	621,542,327.03	81.79

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	557,282.00	0.07
C	制造业	37,842,805.00	4.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	267,824.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,272,154.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,048,564.00	0.80
J	金融业	1,144,759.00	0.15
K	房地产业	838,395.00	0.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	264,225.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,236,008.00	6.48

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	104,900	38,525,574.00	5.07
2	601318	中国平安	485,100	33,180,840.00	4.37
3	600036	招商银行	564,200	23,752,820.00	3.13
4	000333	美的集团	286,300	22,374,345.00	2.94
5	600519	贵州茅台	15,400	21,208,572.00	2.79
6	300308	中际旭创	30,900	18,849,000.00	2.48
7	601166	兴业银行	864,400	18,204,264.00	2.40
8	601899	紫金矿业	449,200	15,483,924.00	2.04
9	600276	恒瑞医药	256,752	15,294,716.64	2.01
10	601995	中金公司	355,500	12,442,500.00	1.64
11	600031	三一重工	569,300	12,029,309.00	1.58
12	600660	福耀玻璃	183,000	11,852,910.00	1.56
13	300274	阳光电源	69,200	11,835,968.00	1.56
14	002142	宁波银行	396,781	11,145,578.29	1.47
15	300502	新易盛	24,600	10,599,648.00	1.39
16	000725	京东方 A	2,488,100	10,474,901.00	1.38
17	600019	宝钢股份	1,381,200	10,289,940.00	1.35
18	600690	海尔智家	367,800	9,595,902.00	1.26
19	601688	华泰证券	389,500	9,188,305.00	1.21
20	002415	海康威视	300,700	8,972,888.00	1.18
21	002475	立讯精密	158,100	8,965,851.00	1.18
22	688256	寒武纪	6,200	8,404,410.00	1.11
23	002001	新和成	324,524	8,174,759.56	1.08
24	601857	中国石油	780,300	8,122,923.00	1.07
25	600887	伊利股份	261,200	7,470,320.00	0.98
26	000338	潍柴动力	404,200	6,952,240.00	0.91
27	603259	药明康德	73,260	6,640,286.40	0.87
28	601138	工业富联	106,000	6,577,300.00	0.87

29	002371	北方华创	13,800	6,335,304.00	0.83
30	600919	江苏银行	600,700	6,247,280.00	0.82
31	600016	民生银行	1,620,200	6,205,366.00	0.82
32	000708	中信特钢	370,800	6,069,996.00	0.80
33	688981	中芯国际	46,600	5,723,878.00	0.75
34	603986	兆易创新	24,800	5,313,400.00	0.70
35	601728	中国电信	832,900	5,247,270.00	0.69
36	600104	上汽集团	343,600	5,229,592.00	0.69
37	300033	同花顺	14,300	4,607,174.00	0.61
38	300059	东方财富	195,700	4,536,326.00	0.60
39	300124	汇川技术	60,000	4,519,800.00	0.59
40	002594	比亚迪	44,900	4,387,628.00	0.58
41	600926	杭州银行	279,300	4,267,704.00	0.56
42	688012	中微公司	15,528	4,234,796.16	0.56
43	600028	中国石化	652,900	4,034,922.00	0.53
44	688041	海光信息	17,600	3,949,616.00	0.52
45	600795	国电电力	777,800	3,920,112.00	0.52
46	601377	兴业证券	523,900	3,887,338.00	0.51
47	600941	中国移动	38,100	3,850,005.00	0.51
48	688111	金山办公	11,500	3,531,305.00	0.46
49	603993	洛阳钼业	175,400	3,508,000.00	0.46
50	300476	胜宏科技	11,900	3,422,202.00	0.45
51	603501	豪威集团	26,400	3,323,760.00	0.44
52	002241	歌尔股份	112,300	3,226,379.00	0.42
53	601601	中国太保	76,500	3,206,115.00	0.42
54	002236	大华股份	167,200	3,166,768.00	0.42
55	002916	深南电路	13,200	3,066,228.00	0.40
56	601117	中国化学	403,200	3,036,096.00	0.40
57	688008	澜起科技	25,700	3,027,460.00	0.40
58	601628	中国人寿	64,800	2,948,400.00	0.39
59	601298	青岛港	351,200	2,929,008.00	0.39
60	002027	分众传媒	394,100	2,904,517.00	0.38
61	002463	沪电股份	39,500	2,886,265.00	0.38
62	600900	长江电力	104,000	2,827,760.00	0.37
63	600011	华能国际	378,700	2,825,102.00	0.37
64	600406	国电南瑞	125,200	2,814,496.00	0.37
65	600741	华域汽车	139,600	2,792,000.00	0.37
66	000858	五粮液	26,217	2,777,428.98	0.37
67	000157	中联重科	321,200	2,771,956.00	0.36
68	002714	牧原股份	53,900	2,726,262.00	0.36
69	600183	生益科技	37,300	2,663,593.00	0.35
70	600066	宇通客车	81,300	2,658,510.00	0.35
71	002311	海大集团	48,000	2,658,240.00	0.35

72	000001	平安银行	223,200	2,546,712.00	0.34
73	601012	隆基绿能	139,500	2,538,900.00	0.33
74	002230	科大讯飞	49,200	2,474,268.00	0.33
75	300433	蓝思科技	80,100	2,424,627.00	0.32
76	000100	TCL 科技	532,500	2,417,550.00	0.32
77	601888	中国中免	25,500	2,411,280.00	0.32
78	603019	中科曙光	27,600	2,363,664.00	0.31
79	300760	迈瑞医疗	11,400	2,171,130.00	0.29
80	300408	三环集团	47,100	2,154,825.00	0.28
81	600415	小商品城	134,300	2,142,085.00	0.28
82	300394	天孚通信	10,400	2,111,512.00	0.28
83	600999	招商证券	126,500	2,104,960.00	0.28
84	000651	格力电器	49,500	1,990,890.00	0.26
85	000063	中兴通讯	51,400	1,944,976.00	0.26
86	300347	泰格医药	33,300	1,888,110.00	0.25
87	001979	招商蛇口	215,500	1,861,920.00	0.25
88	601668	中国建筑	356,500	1,828,845.00	0.24
89	600061	国投资本	232,900	1,781,685.00	0.23
90	605499	东鹏饮料	6,400	1,711,296.00	0.23
91	000568	泸州老窖	13,400	1,557,348.00	0.20
92	002384	东山精密	17,500	1,481,375.00	0.19
93	600233	圆通速递	75,700	1,242,994.00	0.16
94	601766	中国中车	177,400	1,209,868.00	0.16
95	601919	中远海控	72,000	1,092,960.00	0.14
96	601100	恒立液压	9,600	1,055,136.00	0.14
97	603296	华勤技术	10,700	970,918.00	0.13
98	300418	昆仑万维	23,000	959,100.00	0.13
99	600547	山东黄金	24,400	944,524.00	0.12
100	600309	万华化学	11,700	897,156.00	0.12
101	300014	亿纬锂能	12,900	848,304.00	0.11
102	600050	中国联通	164,400	840,084.00	0.11
103	600515	海南机场	149,400	796,302.00	0.10
104	600176	中国巨石	44,300	757,530.00	0.10
105	600009	上海机场	23,100	756,756.00	0.10
106	601633	长城汽车	33,300	753,579.00	0.10
107	601816	京沪高铁	138,500	713,275.00	0.09
108	002938	鹏鼎控股	13,500	682,830.00	0.09
109	300832	新产业	11,900	669,375.00	0.09
110	000975	山金国际	25,000	608,250.00	0.08
111	300413	芒果超媒	19,600	478,632.00	0.06
112	300251	光线传媒	29,200	478,296.00	0.06
113	600438	通威股份	19,700	404,244.00	0.05
114	600111	北方稀土	8,700	401,244.00	0.05

115	000807	云铝股份	11,000	361,240.00	0.05
116	600115	中国东航	59,200	355,200.00	0.05
117	002493	荣盛石化	29,700	347,787.00	0.05
118	601319	中国人保	35,900	321,305.00	0.04
119	002049	紫光国微	4,000	315,240.00	0.04
120	601877	正泰电器	11,200	312,368.00	0.04
121	601600	中国铝业	24,500	299,390.00	0.04
122	002709	天赐材料	6,000	277,980.00	0.04
123	688223	晶科能源	49,200	277,488.00	0.04
124	300866	安克创新	2,400	274,536.00	0.04
125	600588	用友网络	20,700	274,482.00	0.04
126	600989	宝丰能源	13,900	272,857.00	0.04
127	601336	新华保险	3,900	271,830.00	0.04
128	002736	国信证券	20,700	271,584.00	0.04
129	000002	万科 A	58,100	270,165.00	0.04
130	002074	国轩高科	6,900	269,859.00	0.04
131	000166	申万宏源	51,200	269,824.00	0.04
132	601808	中海油服	19,200	269,568.00	0.04
133	002600	领益智造	17,300	268,842.00	0.04
134	000776	广发证券	12,200	268,644.00	0.04
135	600584	长电科技	7,300	268,494.00	0.04
136	603893	瑞芯微	1,500	267,420.00	0.04
137	600489	中金黄金	11,300	263,968.00	0.03
138	002028	思源电气	1,700	262,803.00	0.03
139	601211	国泰海通	12,700	260,985.00	0.03
140	601390	中国中铁	48,200	260,762.00	0.03
141	000977	浪潮信息	3,900	259,740.00	0.03
142	601881	中国银河	16,200	254,664.00	0.03
143	688047	龙芯中科	1,900	251,009.00	0.03
144	688271	联影医疗	2,000	251,000.00	0.03
145	601398	工商银行	31,500	249,795.00	0.03
146	600015	华夏银行	36,200	248,694.00	0.03
147	300498	温氏股份	14,700	248,136.00	0.03

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002008	大族激光	105,800	4,357,902.00	0.57
2	300003	乐普医疗	193,200	3,054,492.00	0.40
3	688235	百济神州	11,300	3,035,180.00	0.40
4	002624	完美世界	150,700	2,469,973.00	0.33
5	300073	当升科技	38,800	2,242,640.00	0.30
6	002271	东方雨虹	144,600	1,965,114.00	0.26

7	603129	春风动力	5,600	1,560,608.00	0.21
8	600282	南钢股份	290,800	1,529,608.00	0.20
9	603160	汇顶科技	18,500	1,461,500.00	0.19
10	603737	三棵树	30,500	1,411,235.00	0.19
11	002821	凯莱英	15,100	1,403,243.00	0.18
12	688002	睿创微纳	13,400	1,350,720.00	0.18
13	688772	珠海冠宇	62,400	1,343,472.00	0.18
14	601333	广深铁路	345,700	1,050,928.00	0.14
15	002299	圣农发展	59,800	989,092.00	0.13
16	300454	深信服	8,400	967,344.00	0.13
17	600004	白云机场	102,100	965,866.00	0.13
18	603444	吉比特	2,200	932,470.00	0.12
19	601155	新城控股	60,100	838,395.00	0.11
20	601865	福莱特	53,000	830,510.00	0.11
21	000050	深天马 A	86,300	779,289.00	0.10
22	002129	TCL 中环	89,200	764,444.00	0.10
23	002080	中材科技	18,400	668,656.00	0.09
24	688521	芯原股份	4,500	616,365.00	0.08
25	300146	汤臣倍健	51,000	612,510.00	0.08
26	002372	伟星新材	58,600	611,198.00	0.08
27	002138	顺络电子	12,900	458,337.00	0.06
28	603345	安井食品	5,100	404,328.00	0.05
29	002353	杰瑞股份	5,600	396,648.00	0.05
30	002156	通富微电	10,400	392,080.00	0.05
31	601555	东吴证券	40,200	364,212.00	0.05
32	000729	燕京啤酒	30,500	342,515.00	0.05
33	002436	兴森科技	15,600	330,252.00	0.04
34	300207	欣旺达	12,400	324,260.00	0.04
35	600096	云天化	9,100	304,031.00	0.04
36	002603	以岭药业	17,400	297,018.00	0.04
37	688072	拓荆科技	900	297,000.00	0.04
38	603979	金诚信	3,800	289,370.00	0.04
39	688599	天合光能	17,400	287,970.00	0.04
40	600873	梅花生物	28,200	285,666.00	0.04
41	300450	先导智能	5,700	284,886.00	0.04
42	002850	科达利	1,800	284,148.00	0.04
43	002410	广联达	21,800	274,244.00	0.04
44	002555	三七互娱	11,600	273,760.00	0.04
45	002841	视源股份	6,900	273,447.00	0.04
46	002281	光迅科技	3,900	272,805.00	0.04
47	300037	新宙邦	5,200	272,480.00	0.04
48	688331	荣昌生物	3,500	272,265.00	0.04
49	300373	扬杰科技	4,000	272,000.00	0.04

50	002223	鱼跃医疗	7,100	271,291.00	0.04
51	688052	纳芯微	1,700	268,906.00	0.04
52	600109	国金证券	28,900	268,770.00	0.04
53	600583	海油工程	48,800	267,912.00	0.04
54	603233	大参林	15,200	267,824.00	0.04
55	688220	翱捷科技	3,200	264,352.00	0.03
56	300012	华测检测	19,500	264,225.00	0.03
57	600535	天士力	17,500	263,725.00	0.03
58	600332	白云山	10,200	262,548.00	0.03
59	601231	环旭电子	8,700	261,000.00	0.03
60	601108	财通证券	29,700	258,984.00	0.03
61	601000	唐山港	66,500	255,360.00	0.03
62	600906	财达证券	37,900	252,793.00	0.03
63	002056	横店东磁	12,800	249,600.00	0.03
64	000951	中国重汽	14,600	246,740.00	0.03
65	688561	奇安信	6,900	245,502.00	0.03

#### 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	300750	宁德时代	40,287,331.10	5.82
2	601318	中国平安	33,080,344.00	4.78
3	600036	招商银行	30,880,885.00	4.46
4	600519	贵州茅台	28,819,530.00	4.17
5	000333	美的集团	27,214,613.00	3.93
6	600276	恒瑞医药	25,994,016.72	3.76
7	601166	兴业银行	23,801,146.00	3.44
8	600690	海尔智家	23,733,937.00	3.43
9	000001	平安银行	22,800,202.00	3.30
10	000651	格力电器	22,501,121.70	3.25
11	600019	宝钢股份	20,900,126.00	3.02
12	000725	京东方 A	20,252,193.00	2.93
13	600941	中国移动	19,890,770.00	2.87
14	002475	立讯精密	19,333,139.60	2.79
15	300308	中际旭创	19,301,188.20	2.79
16	601995	中金公司	18,972,094.00	2.74
17	600104	上汽集团	17,505,167.00	2.53
18	002415	海康威视	17,226,249.83	2.49
19	600660	福耀玻璃	17,097,131.00	2.47
20	600031	三一重工	17,018,580.82	2.46
21	002001	新和成	16,762,027.68	2.42
22	601899	紫金矿业	15,911,881.37	2.30

23	600016	民生银行	15,627,505.00	2.26
24	002142	宁波银行	14,734,347.81	2.13
25	600887	伊利股份	14,044,552.00	2.03

注：“买入金额”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	300750	宁德时代	46,517,133.00	6.72
2	600519	贵州茅台	38,993,714.30	5.64
3	601318	中国平安	35,442,485.00	5.12
4	002594	比亚迪	32,132,061.63	4.64
5	600036	招商银行	29,073,206.50	4.20
6	000858	五粮液	28,609,655.99	4.14
7	600690	海尔智家	26,219,026.00	3.79
8	000333	美的集团	25,208,253.00	3.64
9	000001	平安银行	22,395,845.29	3.24
10	600000	浦发银行	22,061,166.70	3.19
11	600941	中国移动	21,605,491.00	3.12
12	000063	中兴通讯	21,506,519.64	3.11
13	600219	南山铝业	21,000,243.00	3.04
14	002352	顺丰控股	20,641,354.00	2.98
15	688012	中微公司	20,398,595.25	2.95
16	000538	云南白药	19,948,877.20	2.88
17	000651	格力电器	19,529,904.28	2.82
18	000725	京东方 A	19,363,638.00	2.80
19	601688	华泰证券	18,812,594.00	2.72
20	600887	伊利股份	18,048,641.00	2.61
21	603501	豪威集团	17,883,694.20	2.58
22	603259	药明康德	17,637,596.00	2.55
23	601555	东吴证券	17,502,760.00	2.53
24	000338	潍柴动力	17,393,487.90	2.51
25	300760	迈瑞医疗	16,948,897.00	2.45
26	600276	恒瑞医药	16,649,261.86	2.41
27	002001	新和成	16,341,438.00	2.36
28	601166	兴业银行	16,222,237.00	2.34
29	600585	海螺水泥	15,730,676.00	2.27
30	601288	农业银行	15,185,527.00	2.19
31	603893	瑞芯微	14,865,134.00	2.15
32	601857	中国石油	14,844,959.00	2.15
33	600900	长江电力	14,482,062.16	2.09

注：“卖出金额”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

买入股票成本（成交）总额	1,561,250,473.16
卖出股票收入（成交）总额	1,621,230,604.69

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	19,206,653.15	2.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,206,653.15	2.53

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019766	25 国债 01	140,000	14,156,170.96	1.86
2	019773	25 国债 08	50,000	5,050,482.19	0.66

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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序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

本基金以套期保值与风险敞口管理为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，运用股指期货管理现金流、减少系统性风险以及降低特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到处罚。上述证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	4,576,276.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,870,410.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,446,687.09

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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，投资组合报告中市值占净值比例的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 (%)
贝莱德沪深 300 指数增强 A	2,527	117,925.91	97,311,838.43	32.66	200,686,944.58	67.34
贝莱德沪深 300 指数增强 C	39,365	8,476.32	45,934,549.91	13.77	287,735,658.09	86.23
合计	41,892	15,078.51	143,246,388.34	22.68	488,422,602.67	77.32

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

### 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	贝莱德沪深 300 指数增强 A	202,892.39	0.0681
	贝莱德沪深 300 指数增强 C	152,321.10	0.0457
	合计	355,213.49	0.0562

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	贝莱德沪深 300 指数增强 A	10~50
	贝莱德沪深 300 指数增强 C	0~10
	合计	10~50

本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德沪深 300 指数增强 A	0~10
	贝莱德沪深 300 指数增强 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德沪深 300 指数增强 A	贝莱德沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2024 年 11 月 26 日) 基金份额总额	376,262,468.00	292,809,986.72
本报告期期初基金份额总额	376,262,468.00	292,809,986.72
本报告期基金总申购份额	828,492,415.40	1,397,920,774.04
减：本报告期基金总赎回份额	906,756,100.39	1,357,060,552.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	297,998,783.01	333,670,208.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

2025 年，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、2025 年 2 月 14 日起，洪霞女士离任副总经理；
- 2、2025 年 3 月 14 日起，郁蓓华女士担任总经理，陈剑先生离任总经理；
- 3、2025 年 7 月 4 日起，刘映洲先生担任副总经理。

2025 年，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 47,700.00 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

本报告期内管理人无受调查或处罚等情况。

##### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

##### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无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

本报告期内托管人相关人员无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 (%)	
中国中金财富证券有限公司	2	3,182,257,236.20	100.00	647,410.62	100.00	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金采用券商交易模式。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的采用券商交易模式的基金，不适用有关交易佣金集中度限制的规定。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

## 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中国中金财富证券有限公司	34,979,460.00	100.00	133,100,000.00	100.00	-	-

## 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	贝莱德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025年2月15日
2	贝莱德基金管理有限公司关于聘任贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金基金经理助理的公告	中国证监会规定媒介	2025年2月28日
3	贝莱德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025年3月15日
4	贝莱德基金管理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)	中国证监会规定媒介	2025年3月31日
5	贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金2025年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2025年4月22日
6	贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书更新(2025年第1号)	中国证监会规定媒介	2025年6月27日
7	贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新(2025年第1号)	中国证监会规定媒介	2025年6月27日
8	贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新(2025年第1号)	中国证监会规定媒介	2025年6月27日
9	贝莱德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025年7月5日
10	贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金2025年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2025年7月21日
11	贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金2025年中期报告	中国证监会规定媒介	2025年8月30日
12	贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金2025年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2025年10月28日

## § 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的招募说明书
- 4、本基金的托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.blackrock.com.cn](http://www.blackrock.com.cn)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

贝莱德基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日