

博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告 2023 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：二〇二四年三月二十九日

§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 2024 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。普华永道中天会计师事务所（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 2023 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	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	12
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	15
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	15
§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	16
6.1 审计意见	16
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	17
§7 年度财务报表	18
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
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	56
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73

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	73
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	73
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	73
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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
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	75
§10 开放式基金份额变动	75
§11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§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	362,148,989.40 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	273,146,173.67 份	89,002,815.73 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。

	<p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	许俊
	联系电话	0755-83169999	010-66596688
	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		江向阳	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	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-21,763,158.15	-7,078,517.68	-64,614,877.58	-20,909,835.49	61,430,832.44	10,393,962.06
本期利润	-18,222,039.15	-5,748,711.73	-76,677,503.42	-21,030,481.79	39,057,504.19	11,024,715.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0660	-0.0650	-0.2699	-0.2364	0.0907	0.1456
本期加权平均净值利润率	-5.26%	-5.29%	-20.38%	-18.24%	6.07%	9.87%
本期基金份额净值增长率	-5.43%	-5.81%	-16.90%	-17.23%	8.08%	7.64%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	46,885,512.17	12,920,512.56	66,200,939.00	19,907,541.19	162,986,631.73	38,126,145.50
期末可供分配基金份额利润	0.1716	0.1452	0.2389	0.2158	0.4909	0.4689
期末基金资产净值	320,031,685.84	101,923,328.29	343,296,176.58	112,173,088.65	494,970,831.87	119,431,792.79
期末基金份额净值	1.1716	1.1452	1.2389	1.2158	1.4909	1.4689
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	17.16%	16.99%	23.89%	24.20%	49.09%	50.06%

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	-4.43%	0.77%	-4.36%	0.82%	-0.07%	-0.05%
过去六个月	-7.51%	0.77%	-9.01%	0.81%	1.50%	-0.04%
过去一年	-5.43%	0.74%	-7.01%	0.78%	1.58%	-0.04%
过去三年	-15.07%	1.04%	-13.83%	1.03%	-1.24%	0.01%
过去五年	58.99%	1.22%	29.29%	1.22%	29.70%	0.00%
自基金合同生效起至今	17.16%	1.25%	-14.96%	1.25%	32.12%	0.00%

2. 博时中证 500 指数增强 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.52%	0.77%	-4.36%	0.82%	-0.16%	-0.05%
过去六个月	-7.69%	0.77%	-9.01%	0.81%	1.32%	-0.04%
过去一年	-5.81%	0.74%	-7.01%	0.78%	1.20%	-0.04%
过去三年	-16.08%	1.04%	-13.83%	1.03%	-2.25%	0.01%
过去五年	55.83%	1.22%	29.29%	1.22%	26.54%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.99%	1.25%	-10.16%	1.26%	27.15%	-0.01%

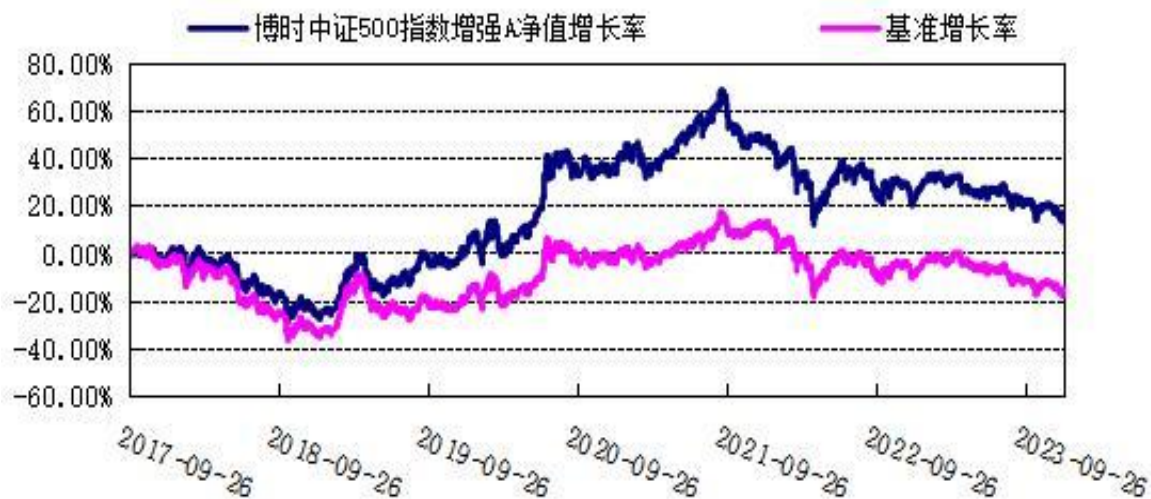
注：自 2018 年 3 月 31 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2018 年 4 月 3 日，相关数据按实际存续期计算。

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 2023 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



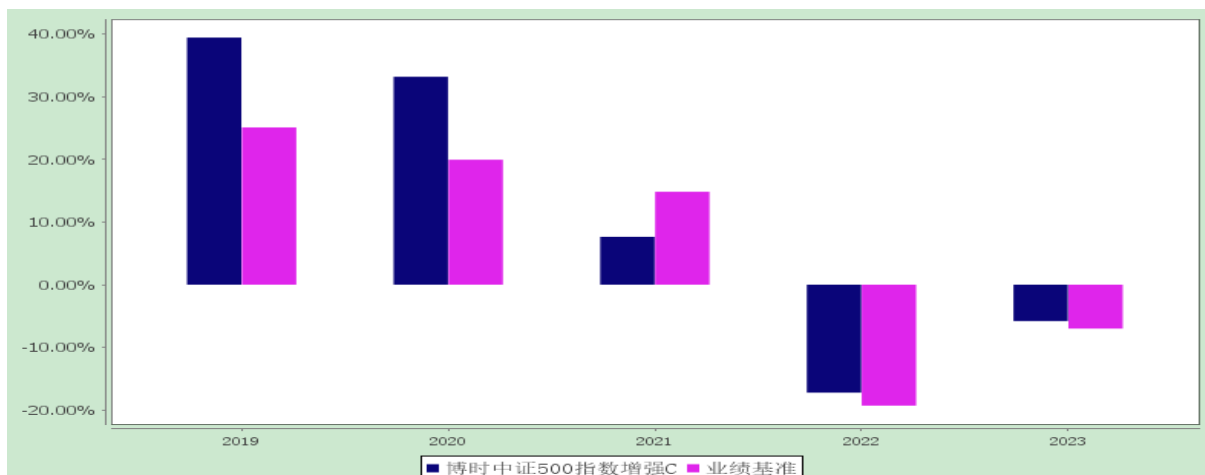
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 367 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 14668 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5478 亿元人民币，累计分红逾 1936 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

深圳证券交易所发布 2023 年度基金市场优秀机构和个人评选结果，博时基金荣获“优秀 ETF 研究支持奖”。

中债金融估值中心有限公司发布 2023 年度中债指数用户综合评价结果，博时基金管理有限公司荣获“行业发展领军机构”。

12 月 28 日，中国证券报第二十届中国基金业金牛奖榜单出炉，博时基金凭借领先的综合实力，

荣膺“海外投资金牛基金公司”“金牛奖 20 周年特别贡献公司”两个奖项。

10 月 25 日，中央国债登记结算有限责任公司重磅揭晓中债指数“20 周年 20 人”行业领军人物。博时基金董事长江向阳荣获中债指数“20 周年 20 人”行业领军人物。

9 月，中国保险资产管理业协会公布 2022 年度中国保险资产管理业“最受险资欢迎投资业务合作机构”基金公司推介结果，博时基金荣获“中国保险资产管理行业 20 年突出贡献合作机构”“最受险资欢迎公募基金公司——固收类公募产品业务”“最受险资欢迎公募基金公司——单一资产管理计划业务”三项推介。

8 月 17 日，由上海证券报主办的第二十届“金基金”奖出炉，博时基金凭借优秀的资产管理能力荣获“金基金 债券投资回报基金管理公司奖”，体现出行业和专业评价机构对公司的高度认可。此外，博时基金凭借《固收的夏日海边茶会》精彩投教案例斩获上海证券报举办的首届投教类奖项“上证 中国基金投教最佳案例奖”。

6 月 7 日，第十八届中国基金业明星基金奖出炉，博时基金荣获三项大奖。博时基金管理有限公司荣获“三年量化投资明星基金公司”，博时新收益灵活配置混合荣获“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”，博时安盈债券荣获“五年持续回报普通债券型明星基金奖”。

5 月 26 日，由北京济安金信科技有限公司主办的第四届济安“群星汇”评选结果揭晓，博时基金凭借卓越的综合资产管理能力荣获基金公司综合奖济安群星汇“五星奖”、“众星奖”，基金公司单项奖“一级债基金管理奖”。博时旗下产品博时合惠货币市场基金获得了“货币型基金”产品奖，博时稳健回报债券（LOF）获得了“一级债基金”产品奖。

4 月 6 日，中国人民银行公布了“2021 年度金融科技发展奖”的获奖名单，博时基金的“云原生信创注册登记（TA）系统”和“基于超自动化的新一代基金运营管理平台”双双荣获二等奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2020-12-23	-	17.3	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。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金

					(2020 年 12 月 30 日—至今)、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)的基金经理。
刘玉强	基金经理助理	2020-02-21	2023-02-06	8.4	刘玉强先生，硕士。2015 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任研究员、基金经理助理。现任博时专精特新主题混合型证券投资基金(2023 年 2 月 1 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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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 195 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

2023 是市场结构分化的一年，成长、价值、大盘、小盘、微盘，不同特点的个股走出了迥异的趋势。机构重仓的大盘、成长类个股普遍回调，而机构参与度不高的小微盘、价值类个股则普遍向上。此外，行业也出现了较大分化，通信、传媒等涨幅超过或接近 20%，消费者服务、房地产、电力设备及新能源板则跌幅超过 20%。

各类资产股价表现的差异，不再仅由基本面驱动，而更多来自估值的变化、体现了市场博弈的结果。特别是小微盘公司，不管是哪个行业，也不管公司基本面如何，2023 年的股价表现普遍较好。重仓小微公司的基金业绩良好，吸引了更多的资金申购；增量资金配置到这些资产中，又进一步推升了小微公司的估值，形成了“正反馈”。到了四季度，这种博弈特征进一步强化，小微公司相对其它公司的股价出现了较大的超额收益，脱离了基本面的核心逻辑。

在上述背景下，A 股市场的投资难度大幅增加，传统的基金投资逻辑面临挑战。

不过即便市场多有变化，本基金仍然坚持了相对稳定且偏长期的因子配置逻辑：以业绩基准指数中证 500 指数为锚，不做仓位择时，只追求超额收益；在因子的配置上，坚持成长、分析师、价值、动量、反转等因子的协同互补，坚持模型逻辑的合理性和一致性；控制跟踪误差，限制市值敞口的一定偏离，略有放松对行业偏离的限制。本基金综合使用了部门多种类别的增强模型，也包括人工智能模型。我们尝试对一类模型的投资逻辑和经济学含义都进行分析理解，并在此基础上对模型分配权重。多类模型的综合使用，有效的降低了产品的跟踪误差，加强了超额收益的稳定性。

从全年实际投资效果来看，本基金相对于业绩比较基准，取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1716 元，份额累计净值为 1.1716 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1452 元，份额累计净值为 1.1452 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-5.43%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-5.81%，同期业绩基准增长率为-7.01%。

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 2024 年，我们认为 A 股市场大概率仍以震荡为主基调，结构性机会始终存在。

首先，中国经济依旧韧性十足。据最新统计数据，2024 年春节假期 8 天，全社会跨区域人员流动量累计 22.93 亿人次；国内旅游出游 4.74 亿人次，同比增长 34.3%，按可比口径较 2019 年同期增长 19.0%；国内游客出游总花费 6326.87 亿元，同比增长 47.3%，按可比口径较 2019 年同期增长 7.7%。从出行人数和总体开支来看，今年春节期间的数据不仅较去年有爆发性增长，也都高于疫情之前的水平。此外，回看 2023 年，我国国际收支保持基本平衡，经常账户顺差 2642 亿美元，顺差规模与同期国内生产总值之比为 1.5%；国际收支口径的货物贸易顺差 6080 亿美元，仅次于 2022 年顺差规模，为历年次高；外商股权性质直接投资全年净流入 621 亿美元，经初步测算，2023 年四季度，外商来华证券投资净流入规模达到近两年高位。国家外汇管理局相关负责人表示，展望 2024 年，我国经济回升向好、长期向好的基本趋势没有改变，随着内外部环境总体改善，我国国际收支更有基础和条件保持基本平衡。

但是，全球产业链脱钩仍在继续，美债收益率也仍处于高位，为全球资产定价带来压力。近年来，经济全球化遭遇逆流，贸易保护主义及地缘政治博弈持续加剧，深刻改变了全球产业链供应链格局。各国产业链供应链布局从以成本、效率、科技为侧重转向以安全、稳定和政治为侧重，呈现多元化、区域化等演进特征，并存在进一步碎片化的趋势。世界经济增长动能因此受到遏制，也给经济复苏增添了更多不确定性。美债方面，2024 年 1 月美国通胀超预期，房租增速反弹，核心通胀韧性强，市场对 Fed 降息的预期后移。美国 10 年期国债收益率重新回到 4.3% 上方。同时，日本 GDP 环比连续两个季度负增长，日本央行退出宽松的预期也进一步消减。外部经济环境不定，为中国经济复苏和资产定价带来了不小的压力。

但无论外部如何变化，我们都应当对 A 股投资具有“底线思维”，对行情的长期表现持乐观态度。国家的货币政策、财政政策等工具始终握在我们自己手里。从更宏观的视角来看，目前 A 股的上市公司是中国经济社会中最活跃、最能创造价值的经济体，股票市值则是它们的货币化表现。只要 M1、M2 增速仍为正，企业的估值水平就将维持在一定的水准。即便企业的业绩增速下降，估值水平反倒有可能上升，从而对股价起到一定的托底作用。这就是 A 股投资的“底线思维”。因此，我们对证券市场的长期趋势必然是乐观的。

综合而言，我们判断，2024 年 A 股市场长期向好趋势不变，短期维持震荡，以结构性机会为主。对于机构投资者来说，是继续比拼选股能力的一年。在此情况下，量化基金具备一定的技术优势。

本基金将始终坚持科学投资的方法论不动摇，以跑赢中证 500 指数为目标，以量化模型为工具，以科学投资思想为指引，努力做好资产配置，为基金持有人争取合理的超额回报。

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，进一步健全内控体系，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，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告。

报告期内，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全投资管理相关的管理机制，完善了《信用评级管理办法》、《个人养老金业务管理制度》、《风险事件管理制度》、《股票池管理办法》、《交易管理制度》、《交易监督管理制度》、《基金资产估值委员会制度》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”等管理平台进行迭代更新，搭建了“博时合规管理及审计系统”，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》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，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市

场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合

报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 26802 号

博时中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“博时中证 500 指数增强”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了博时中证 500 指数增强 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

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

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时中证 500 指数增强的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估博时中证 500 指数增强的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算博时中证

500 指数增强、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时中证 500 指数增强的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
叶尔甸 陈轶杰
上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2024 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	25,770,174.40	25,550,044.55
结算备付金		4,040,766.04	5,611,334.85
存出保证金		53,943.61	74,971.68
交易性金融资产	7.4.7.2	394,437,291.82	425,539,618.12
其中：股票投资		394,437,291.82	425,539,618.12
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	7.4.7.5	-	-
应收清算款		2,691,729.35	12,266,645.11
应收股利		-	-
应收申购款		317,409.72	439,899.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		427,311,314.94	469,482,514.01
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		2,531,476.52	11,311,427.15
应付赎回款		743,546.56	480,667.62
应付管理人报酬		358,532.72	393,044.78
应付托管费		71,706.57	78,608.93
应付销售服务费		34,472.47	38,911.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,616,565.97	1,710,588.64
负债合计		5,356,300.81	14,013,248.78
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	362,148,989.40	369,360,785.04
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	59,806,024.73	86,108,480.19
净资产合计		421,955,014.13	455,469,265.23
负债和净资产总计		427,311,314.94	469,482,514.01

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 362,148,989.40 份。其中 A 类基金份额净值 1.1716 元，基金份额总额 273,146,173.67 份；C 类基金份额净值 1.1452 元，基金份额总额 89,002,815.73 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-17,696,389.42	-90,953,030.98
1.利息收入		190,871.24	238,585.25
其中：存款利息收入	7.4.7.10	190,871.24	238,585.25
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）		-22,769,151.22	-79,038,067.59
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-29,518,667.86	-84,495,099.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	171,790.15
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-58,054.75	-1,238,724.35
股利收益	7.4.7.15	6,807,571.39	6,523,965.65
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）	7.4.7.16	4,870,924.95	-12,183,272.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,965.61	29,723.50
减：二、营业总支出		6,274,361.46	6,754,954.23
1. 管理人报酬		4,552,256.89	4,920,412.20
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		910,451.39	984,082.40
3. 销售服务费		434,893.85	460,518.50
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	8.86
8. 其他费用	7.4.7.19	376,759.33	389,932.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,970,750.88	-97,707,985.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,970,750.88	-97,707,985.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-23,970,750.88	-97,707,985.21

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	369,360,785.04	86,108,480.19	455,469,265.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	369,360,785.04	86,108,480.19	455,469,265.2

产			3
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,211,795.64	-26,302,455.46	-33,514,251.10
（一）、综合收益总额	-	-23,970,750.88	-23,970,750.88
（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）	-7,211,795.64	-2,331,704.58	-9,543,500.22
其中：1.基金申购款	88,223,363.27	21,515,588.32	109,738,951.59
2.基金赎回款	-95,435,158.91	-23,847,292.90	-119,282,451.81
（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	362,148,989.40	59,806,024.73	421,955,014.13
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	413,289,847.43	201,112,777.23	614,402,624.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	413,289,847.43	201,112,777.23	614,402,624.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,929,062.39	-115,004,297.04	-158,933,359.43
（一）、综合收益总额	-	-97,707,985.21	-97,707,985.21
（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）	-43,929,062.39	-17,296,311.83	-61,225,374.22

填列)			
其中：1.基金申购款	176,412,638.71	54,549,334.56	230,961,973.27
2.基金赎回款	-220,341,701.10	-71,845,646.39	-292,187,347.49
(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	369,360,785.04	86,108,480.19	455,469,265.23

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

根据基金管理人博时基金管理有限公司 2018 年 3 月 24 日《博时基金管理有限公司关于博时中证 500 指数增强型证券投资基金增加基金份额类别并修改法律文件的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2018 年 3 月 31 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不

从本类别基金资产中计提销售服务费（原基金份额自动转入 A 类基金份额）；C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证 500 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的标的指数为：中证 500 指数。本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2024 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“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和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) 金融资产的分类

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。

债务工具

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：

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。

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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

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

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包

括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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(例如它们都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由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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。

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。

本基金参与的转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息,以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的

个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。

(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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	25,770,174.40	25,550,044.55
等于：本金	25,767,485.51	25,547,228.17
加：应计利息	2,688.89	2,816.38
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	25,770,174.40	25,550,044.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	405,049,231.29	-	394,437,291.82	-10,611,939.47
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		405,049,231.29	-	394,437,291.82	-10,611,939.47
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		441,022,482.54	-	425,539,618.12	-15,482,864.42
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		441,022,482.54	-	425,539,618.12	-15,482,864.42

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

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 其他权益工具投资

7.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	41.63	19.96
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,047,524.34	1,330,568.68
其中：交易所市场	1,047,524.34	1,330,568.68
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	169,000.00	180,000.00
应付指数使用费	400,000.00	200,000.00
合计	1,616,565.97	1,710,588.64

7.4.7.8 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	277,095,237.58	277,095,237.58
本期申购	41,887,871.09	41,887,871.09
本期赎回（以“-”号填列）	-45,836,935.00	-45,836,935.00
本期末	273,146,173.67	273,146,173.67

博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	92,265,547.46	92,265,547.46
本期申购	46,335,492.18	46,335,492.18
本期赎回（以“-”号填列）	-49,598,223.91	-49,598,223.91
本期末	89,002,815.73	89,002,815.73

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)。

7.4.7.9 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	75,905,139.54	-9,704,200.54	66,200,939.00
本期期初	75,905,139.54	-9,704,200.54	66,200,939.00

本期利润	-21,763,158.15	3,541,119.00	-18,222,039.15
本期基金份额交易产生的变动数	-1,112,986.21	19,598.53	-1,093,387.68
其中：基金申购款	11,523,080.36	-630,280.78	10,892,799.58
基金赎回款	-12,636,066.57	649,879.31	-11,986,187.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,028,995.18	-6,143,483.01	46,885,512.17

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	23,129,598.96	-3,222,057.77	19,907,541.19
本期期初	23,129,598.96	-3,222,057.77	19,907,541.19
本期利润	-7,078,517.68	1,329,805.95	-5,748,711.73
本期基金份额交易产生的变动数	-1,119,010.89	-119,306.01	-1,238,316.90
其中：基金申购款	11,307,883.78	-685,095.04	10,622,788.74
基金赎回款	-12,426,894.67	565,789.03	-11,861,105.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,932,070.39	-2,011,557.83	12,920,512.56

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	102,668.55	133,459.45
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	87,004.53	101,679.43
其他	1,198.16	3,446.37
合计	190,871.24	238,585.25

7.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,410,416,345.15	3,698,453,760.59
减：卖出股票成本总额	3,431,518,302.25	3,773,227,572.84
减：交易费用	8,416,710.76	9,721,286.79
买卖股票差价收入	-29,518,667.86	-84,495,099.04

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	-	3,909.91
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	167,880.24
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	-	171,790.15

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到 期兑付)成交总额	-	3,047,292.56
减: 卖出债券(债转股及债 券到期兑付)成本总额	-	2,827,439.80
减: 应计利息总额	-	51,969.49
减: 交易费用	-	3.03
买卖债券差价收入	-	167,880.24

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.14.2 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-58,054.75	-1,238,724.35

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,807,571.39	6,523,965.65
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	6,807,571.39	6,523,965.65

7.4.7.16 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	4,870,924.95	-12,079,560.14
——股票投资	4,870,924.95	-12,079,560.14
——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	-	-103,712.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-	-103,712.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	4,870,924.95	-12,183,272.14

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	10,618.89	28,209.04

基金转换费收入	346.72	1,514.46
合计	10,965.61	29,723.50

7.4.7.18 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	49,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	37.27	-
银行汇划费	7,722.06	9,932.27
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	376,759.33	389,932.27

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
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
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	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 经基金管理人 2023 年第三次临时股东大会决议，股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。于 2023 年 8 月 29 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，本次股东变更完成后，基金管理人股权结构为：

招商证券股份有限公司 49%，中国长城资产管理股份有限公司 25%，上海汇华实业有限公司 12%，天津港(集团)有限公司 6%，上海盛业股权投资基金有限公司 6%和浙江省国贸集团资产经营有限公司 2%。

2. 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,951,905,975.91	28.75%	3,714,711,266.80	50.79%

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 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	1,435,053.91	28.74%	305,098.18	29.13%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	2,716,570.91	50.79%	1,238,082.63	93.05%

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,552,256.89	4,920,412.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,538,468.89	1,537,448.34
应支付基金管理人的净管理费	3,013,788.00	3,382,963.86

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	910,451.39	984,082.40

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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	65,078.25	65,078.25
合计	-	65,078.25	65,078.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	74,478.23	74,478.23
合计	-	74,478.23	74,478.23

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其

计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	25,770,174.40	102,668.55	25,550,044.55	133,459.45

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	6,185.00	156,171.25
招商证券股份有限公司	001378	德冠新材	网下发行	2,044.00	64,753.92
招商证券股份有限公司	688653	康希通信	网下发行	6,478.00	68,019.00
上年度可比期间					

2022 年 1 月 1 日至 2022 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	002948	青岛银行	配股	267,660.00	856,512.00
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	4,622.00	172,077.06
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

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(2023 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	首次公开发行股票限售	18.08	44.57	613.00	11,083.04	27,321.41	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	首次公开发行股票限售	2.66	4.45	6,018.00	16,007.88	26,780.10	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	首次公开发行股票限售	78.99	60.49	333.00	26,303.67	20,143.17	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	首次公开发行股票限售	9.87	12.75	1,570.00	15,495.90	20,017.50	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6 个月	首次公开发行股票限售	13.39	16.01	1,240.00	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023-08-16	6 个月	首次公开发行股票限售	29.38	59.37	332.00	9,754.16	19,710.84	-
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	首次公开发行股票限售	7.33	13.40	1,458.00	10,687.14	19,537.20	-

688627	精智达	2023-07-11	6 个月	首次公开发行限售	46.77	87.72	222.00	10,382.94	19,473.84	-
300904	威力传动	2023-08-02	6 个月	首次公开发行限售	35.41	61.53	304.00	10,764.64	18,705.12	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	首次公开发行限售	5.18	8.09	2,302.00	11,924.36	18,623.18	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	首次公开发行限售	39.78	69.09	262.00	10,422.36	18,101.58	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	38.13	28.36	620.00	23,640.60	17,583.20	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	26.74	38.67	450.00	12,033.00	17,401.50	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	首次公开发行限售	20.45	29.69	571.00	11,676.95	16,952.99	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	首次公开发行限售	31.95	52.25	302.00	9,648.90	15,779.50	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	首次公开发行限售	24.98	28.02	537.00	13,414.26	15,046.74	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6 个月	首次公开发行限售	39.99	38.81	373.00	14,916.27	14,476.13	-
301510	固高科技	2023-08-04	6 个月	首次公开发行限售	12.00	35.01	396.00	4,752.00	13,863.96	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	首次公开发行限售	80.80	77.75	174.00	14,059.20	13,528.50	-
301507	民生健康	2023-08-24	6 个月	首次公开发行限售	10.00	15.85	851.00	8,510.00	13,488.35	-
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	首次公开发行限售	28.00	22.67	594.00	16,632.00	13,465.98	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	首次公开发行	57.66	47.25	272.00	15,683.52	12,852.00	-

				限售							
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	57.88	45.48	281.00	16,264.28	12,779.88	-	
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	首次公开发行限售	8.90	22.14	576.00	5,126.40	12,752.64	-	
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	首次公开发行限售	8.66	11.06	1,066.00	9,231.56	11,789.96	-	
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	首次公开发行限售	42.66	48.18	237.00	10,110.42	11,418.66	-	
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	首次公开发行限售	37.56	43.57	260.00	9,765.60	11,328.20	-	
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	首次公开发行限售	19.99	19.35	583.00	11,654.17	11,281.05	-	
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	首次公开发行限售	16.82	26.68	419.00	7,047.58	11,178.92	-	
301251	威尔高	2023-08-30	6 个月	首次公开发行限售	28.88	34.59	321.00	9,270.48	11,103.39	-	
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	首次公开发行限售	50.50	50.53	216.00	10,908.00	10,914.48	-	
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	首次公开发行限售	67.68	59.37	182.00	12,317.76	10,805.34	-	
301499	维科精密	2023-07-13	6 个月	首次公开发行限售	19.50	28.93	371.00	7,234.50	10,733.03	-	
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	首次公开发行限售	10.50	15.99	648.00	6,804.00	10,361.52	-	
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	首次公开发行限售	71.80	68.91	148.00	10,626.40	10,198.68	-	
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	首次公开发行限售	21.00	22.23	458.00	9,618.00	10,181.34	-	
301261	恒工	2023-0	6 个月	首次公	36.90	50.85	198.00	7,306.20	10,068.30	-	

	精密	6-29		开发行 限售							
688719	爱科 赛博	2023-0 9-20	6 个月	首次公 开发行 限售	69.98	60.10	165.00	11,546.70	9,916.50	-	
301202	朗威 股份	2023-0 6-28	6 个月	首次公 开发行 限售	25.82	31.80	306.00	7,900.92	9,730.80	-	
301395	仁信 新材	2023-0 6-21	6 个月	首次公 开发行 限售	26.68	18.69	520.00	13,873.60	9,718.80	-	
688716	中研 股份	2023-0 9-13	6 个月	首次公 开发行 限售	29.66	36.39	267.00	7,919.22	9,716.13	-	
301413	安培 龙	2023-1 2-11	6 个月	首次公 开发行 限售	33.25	58.19	164.00	5,453.00	9,543.16	-	
301500	飞南 资源	2023-0 9-13	6 个月	首次公 开发行 限售	23.97	20.89	455.00	10,906.35	9,504.95	-	
301418	协昌 科技	2023-0 8-10	6 个月	首次公 开发行 限售	51.88	50.20	189.00	9,805.32	9,487.80	-	
301516	中远 通	2023-1 2-01	6 个月	首次公 开发行 限售	6.87	15.51	604.00	4,149.48	9,368.04	-	
301371	敷尔 佳	2023-0 7-24	6 个月	首次公 开发行 限售	55.68	37.58	248.00	13,808.64	9,319.84	-	
301469	恒达 新材	2023-0 8-10	6 个月	首次公 开发行 限售	36.58	33.09	275.00	10,059.50	9,099.75	-	
301519	舜禹 股份	2023-0 7-19	6 个月	首次公 开发行 限售	20.93	20.21	442.00	9,251.06	8,932.82	-	
301518	长华 化学	2023-0 7-26	6 个月	首次公 开发行 限售	25.75	23.01	385.00	9,913.75	8,858.85	-	
301568	思泰 克	2023-1 1-21	6 个月	首次公 开发行 限售	23.23	35.58	246.00	5,714.58	8,752.68	-	
301559	中集 环科	2023-0 9-26	6 个月	首次公 开发行 限售	24.22	18.24	466.00	11,286.52	8,499.84	-	

688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	首次公开发行限售	47.29	37.97	222.00	10,498.38	8,429.34	-
688638	誉辰智能	2023-07-04	6 个月	首次公开发行限售	83.90	59.68	141.00	11,829.90	8,414.88	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	首次公开发行限售	99.57	81.46	103.00	10,255.71	8,390.38	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	首次公开发行限售	31.90	39.84	208.00	6,635.20	8,286.72	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	首次公开发行限售	67.88	52.74	157.00	10,657.16	8,280.18	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	首次公开发行限售	28.03	49.84	165.00	4,624.95	8,223.60	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	首次公开发行限售	23.68	28.80	285.00	6,748.80	8,208.00	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	首次公开发行限售	41.66	64.11	128.00	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦安全	2023-07-19	6 个月	首次公开发行限售	39.90	46.05	178.00	7,102.20	8,196.90	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	首次公开发行限售	26.87	43.69	185.00	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	首次公开发行限售	48.94	68.32	118.00	5,774.92	8,061.76	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	首次公开发行限售	46.80	36.07	219.00	10,249.20	7,899.33	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	首次公开发行限售	36.12	34.30	226.00	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	首次公开发行限售	40.83	43.41	178.00	7,267.74	7,726.98	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	首次公开发行	29.50	33.16	225.00	6,637.50	7,461.00	-

				限售							
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	首次公开发行限售	66.80	58.99	125.00	8,350.00	7,373.75	-	
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	首次公开发行限售	22.88	32.44	224.00	5,125.12	7,266.56	-	
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	首次公开发行限售	11.25	11.07	655.00	7,368.75	7,250.85	-	
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	首次公开发行限售	103.40	78.23	92.00	9,512.80	7,197.16	-	
301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	首次公开发行限售	26.35	35.81	194.00	5,111.90	6,947.14	-	
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	首次公开发行限售	36.60	37.88	182.00	6,661.20	6,894.16	-	
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	首次公开发行限售	31.16	28.27	230.00	7,166.80	6,502.10	-	
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	首次公开发行限售	15.18	21.43	303.00	4,599.54	6,493.29	-	
001378	德冠新材	2023-10-23	6 个月	首次公开发行限售	31.68	31.27	205.00	6,494.40	6,410.35	-	
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	首次公开发行限售	53.09	36.42	167.00	8,866.03	6,082.14	-	
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	首次公开发行限售	16.80	31.19	195.00	3,276.00	6,082.05	-	
603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	首次公开发行限售	21.77	29.58	195.00	4,245.15	5,768.10	-	
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	首次公开发行限售	15.32	23.87	226.00	3,462.32	5,394.62	-	
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	首次公开发行限售	14.23	18.19	270.00	3,842.10	4,911.30	-	
001306	夏厦	2023-11	6 个月	首次公	53.63	75.36	64.00	3,432.32	4,823.04	-	

	精密	1-09		开发行 限售							
001326	联域 股份	2023-1 1-01	6 个月	首次公 开发行 限售	41.18	48.64	99.00	4,076.82	4,815.36	-	
603193	润本 股份	2023-1 0-09	6 个月	首次公 开发行 限售	17.38	16.66	266.00	4,623.08	4,431.56	-	
603062	麦加 芯彩	2023-1 0-31	6 个月	首次公 开发行 限售	58.08	57.81	71.00	4,123.68	4,104.51	-	
603075	热威 股份	2023-0 9-01	6 个月	首次公 开发行 限售	23.10	23.31	166.00	3,834.60	3,869.46	-	
001358	兴欣 新材	2023-1 2-14	6 个月	首次公 开发行 限售	41.00	44.16	87.00	3,567.00	3,841.92	-	
001239	永达 股份	2023-1 2-04	6 个月	首次公 开发行 限售	12.05	19.92	189.00	2,277.45	3,764.88	-	
603231	索宝 蛋白	2023-1 2-06	6 个月	首次公 开发行 限售	21.29	21.53	161.00	3,427.69	3,466.33	-	
603276	恒兴 新材	2023-0 9-18	6 个月	首次公 开发行 限售	25.73	24.88	134.00	3,447.82	3,333.92	-	
603373	安邦 护卫	2023-1 2-13	6 个月	首次公 开发行 限售	19.10	34.75	88.00	1,680.80	3,058.00	-	

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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

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时间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 2023 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	25,770,174.40	-	-	-	25,770,174.40
结算备付金	4,040,766.04	-	-	-	4,040,766.04
存出保证金	53,943.61	-	-	-	53,943.61
交易性金融资产	-	-	-	394,437,291.82	394,437,291.82
应收清算款	-	-	-	2,691,729.35	2,691,729.35
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	317,409.72	317,409.72
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	29,864,884.05	-	-	397,446,430.89	427,311,314.94
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	743,546.56	743,546.56
应付清算款	-	-	-	2,531,476.52	2,531,476.52
应付管理人报酬	-	-	-	358,532.72	358,532.72
应付托管费	-	-	-	71,706.57	71,706.57
应付销售服务费	-	-	-	34,472.47	34,472.47
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,616,565.97	1,616,565.97
负债总计	-	-	-	5,356,300.81	5,356,300.81
利率敏感度缺口	29,864,884.05	-	-	392,090,130.08	421,955,014.13
上年度末 2022 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	25,550,044.55	-	-	25,550,044.55
结算备付金	5,611,334.85	-	-	5,611,334.85
存出保证金	74,971.68	-	-	74,971.68
交易性金融资产	-	-	425,539,618.12	425,539,618.12
应收清算款	-	-	12,266,645.11	12,266,645.11
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收申购款	-	-	439,899.70	439,899.70
应收股利	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	31,236,351.08	-	438,246,162.93	469,482,514.01
负债				
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	480,667.62	480,667.62
应付清算款	-	-	11,311,427.15	11,311,427.15
应付管理人报酬	-	-	393,044.78	393,044.78
应付托管费	-	-	78,608.93	78,608.93
应付销售服务费	-	-	38,911.66	38,911.66
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	1,710,588.64	1,710,588.64
负债总计	-	-	14,013,248.78	14,013,248.78
利率敏感度缺口	31,236,351.08	-	424,232,914.15	455,469,265.23

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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	394,437,291.82	93.48	425,539,618.12	93.43
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	394,437,291.82	93.48	425,539,618.12	93.43

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，期货投资于相关的期货暂收款(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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,918	增加约 2,075
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,918	减少约 2,075

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	393,495,539.13	424,418,516.08
第二层次	-	-
第三层次	941,752.69	1,121,102.04
合计	394,437,291.82	425,539,618.12

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	1,121,102.04	1,121,102.04
当期购买	-	1,752,681.17	1,752,681.17
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,310,309.34	2,310,309.34
当期利得或损失总额	-	378,278.82	378,278.82
其中：计入损益的利得或损失	-	378,278.82	378,278.82
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	941,752.69	941,752.69
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	-	137,160.73	137,160.73

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-	-
当期购买	-	1,013,215.91	1,013,215.91
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	107,886.13	107,886.13
其中：计入损益的利得或损失	-	107,886.13	107,886.13
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,121,102.04	1,121,102.04
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	-	107,886.13	107,886.13

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	941,752.69	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.55%-217.52%	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	1,121,102.04	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	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	394,437,291.82	92.31
	其中：股票	394,437,291.82	92.31
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	29,810,940.44	6.98
8	其他各项资产	3,063,082.68	0.72
9	合计	427,311,314.94	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	1,214,904.00	0.29
B	采矿业	16,252,077.00	3.85
C	制造业	248,091,349.15	58.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,855,367.00	3.76
E	建筑业	4,124,316.00	0.98
F	批发和零售业	16,475,741.95	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	3,644,004.85	0.86
H	住宿和餐饮业	4,159,606.00	0.99
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,517,007.74	7.00
J	金融业	27,619,306.40	6.55
K	房地产业	6,123,752.00	1.45
L	租赁和商务服务业	4,731,349.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	2,963,557.91	0.70

N	水利、环境和公共设施管理业	3,938,790.82	0.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	543,555.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,142,880.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	8,038,261.00	1.91
S	综合	1,466.00	0.00
	合计	394,437,291.82	93.48

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	002373	千方科技	460,300	5,159,963.00	1.22
2	600582	天地科技	947,700	5,155,488.00	1.22
3	603866	桃李面包	671,800	5,145,988.00	1.22
4	601568	北元集团	1,080,100	5,119,674.00	1.21
5	002138	顺络电子	173,300	4,680,833.00	1.11
6	600066	宇通客车	342,100	4,532,825.00	1.07
7	600529	山东药玻	171,900	4,400,640.00	1.04
8	600153	建发股份	446,600	4,300,758.00	1.02
9	000887	中鼎股份	344,200	4,257,754.00	1.01
10	600258	首旅酒店	266,300	4,159,606.00	0.99
11	600704	物产中大	930,800	4,123,444.00	0.98
12	000598	兴蓉环境	719,300	4,092,817.00	0.97
13	600637	东方明珠	543,800	4,089,376.00	0.97
14	600390	五矿资本	872,300	4,082,364.00	0.97
15	600737	中粮糖业	492,700	4,059,848.00	0.96
16	601958	金钼股份	428,500	4,049,325.00	0.96
17	601608	中信重工	1,039,400	4,012,084.00	0.95
18	600517	国网英大	837,100	3,992,967.00	0.95
19	600959	江苏有线	1,261,100	3,959,854.00	0.94
20	002558	巨人网络	350,800	3,907,912.00	0.93
21	000959	首钢股份	1,117,100	3,865,166.00	0.92
22	600901	江苏金租	790,140	3,824,277.60	0.91
23	603688	石英股份	41,800	3,631,584.00	0.86
24	300866	安克创新	40,000	3,544,000.00	0.84
25	601058	赛轮轮胎	292,300	3,434,525.00	0.81
26	300017	网宿科技	419,100	3,289,935.00	0.78
27	688169	石头科技	11,300	3,197,335.00	0.76
28	600497	驰宏锌锗	599,600	3,027,980.00	0.72

29	002092	中泰化学	489,800	2,987,780.00	0.71
30	600707	彩虹股份	437,900	2,955,825.00	0.70
31	002064	华峰化学	439,500	2,949,045.00	0.70
32	300558	贝达药业	57,100	2,943,505.00	0.70
33	600038	中直股份	76,000	2,928,280.00	0.69
34	688516	奥特维	32,296	2,922,788.00	0.69
35	603893	瑞芯微	46,100	2,922,740.00	0.69
36	601168	西部矿业	201,600	2,876,832.00	0.68
37	002653	海思科	123,900	2,868,285.00	0.68
38	000563	陕国投 A	940,300	2,858,512.00	0.68
39	688276	百克生物	51,868	2,842,885.08	0.67
40	000729	燕京啤酒	325,900	2,812,517.00	0.67
41	600808	马钢股份	1,032,000	2,807,040.00	0.67
42	002423	中粮资本	415,600	2,776,208.00	0.66
43	000967	盈峰环境	582,400	2,766,400.00	0.66
44	600339	中油工程	907,000	2,748,210.00	0.65
45	002065	东华软件	443,500	2,736,395.00	0.65
46	600879	航天电子	347,100	2,676,141.00	0.63
47	002025	航天电器	55,400	2,660,308.00	0.63
48	600177	雅戈尔	391,700	2,565,635.00	0.61
49	601717	郑煤机	201,300	2,546,445.00	0.60
50	000878	云南铜业	233,630	2,544,230.70	0.60
51	000728	国元证券	372,300	2,542,809.00	0.60
52	000591	太阳能	452,000	2,522,160.00	0.60
53	600820	隧道股份	433,700	2,498,112.00	0.59
54	002925	盈趣科技	128,200	2,496,054.00	0.59
55	601231	环旭电子	163,900	2,476,529.00	0.59
56	605358	立昂微	89,600	2,454,144.00	0.58
57	002572	索菲亚	153,500	2,448,325.00	0.58
58	002563	森马服饰	422,500	2,437,825.00	0.58
59	300207	欣旺达	164,900	2,433,924.00	0.58
60	600998	九州通	345,436	2,421,506.36	0.57
61	000739	普洛药业	156,600	2,410,074.00	0.57
62	600655	豫园股份	387,600	2,406,996.00	0.57
63	603228	景旺电子	106,300	2,398,128.00	0.57
64	600271	航天信息	219,100	2,331,224.00	0.55
65	000559	万向钱潮	446,900	2,319,411.00	0.55
66	601098	中南传媒	221,400	2,251,638.00	0.53
67	000156	华数传媒	297,200	2,190,364.00	0.52
68	300026	红日药业	507,000	2,149,680.00	0.51
69	002600	领益智造	301,900	2,040,844.00	0.48
70	000930	中粮科技	303,800	2,017,232.00	0.48
71	002032	苏泊尔	37,900	2,009,079.00	0.48

72	601128	常熟银行	299,400	1,913,166.00	0.45
73	601778	晶科科技	543,300	1,901,550.00	0.45
74	000883	湖北能源	425,700	1,800,711.00	0.43
75	002683	广东宏大	86,900	1,744,952.00	0.41
76	603127	昭衍新药	70,800	1,678,668.00	0.40
77	300595	欧普康视	73,100	1,650,598.00	0.39
78	300001	特锐德	81,900	1,646,190.00	0.39
79	600535	天士力	96,000	1,633,920.00	0.39
80	603317	天味食品	117,500	1,561,575.00	0.37
81	603530	神马电力	75,100	1,557,574.00	0.37
82	000636	风华高科	113,500	1,550,410.00	0.37
83	600161	天坛生物	50,100	1,550,094.00	0.37
84	600380	健康元	124,200	1,543,806.00	0.37
85	601016	节能风电	508,360	1,525,080.00	0.36
86	000933	神火股份	90,500	1,520,400.00	0.36
87	601555	东吴证券	207,600	1,517,556.00	0.36
88	002010	传化智联	325,100	1,501,962.00	0.36
89	300850	新强联	47,100	1,499,193.00	0.36
90	001914	招商积余	122,300	1,462,708.00	0.35
91	600967	内蒙一机	176,500	1,457,890.00	0.35
92	000960	锡业股份	100,500	1,439,160.00	0.34
93	000932	华菱钢铁	279,100	1,437,365.00	0.34
94	002273	水晶光电	105,700	1,431,178.00	0.34
95	600096	云天化	90,200	1,407,120.00	0.33
96	300699	光威复材	52,000	1,386,840.00	0.33
97	002152	广电运通	111,200	1,363,312.00	0.32
98	688234	天岳先进	20,550	1,357,738.50	0.32
99	600867	通化东宝	123,000	1,332,090.00	0.32
100	601179	中国西电	265,500	1,308,915.00	0.31
101	300073	当升科技	34,100	1,302,620.00	0.31
102	000513	丽珠集团	37,100	1,298,871.00	0.31
103	600764	中国海防	51,400	1,282,430.00	0.30
104	000830	鲁西化工	126,300	1,266,789.00	0.30
105	002831	裕同科技	45,700	1,257,207.00	0.30
106	600373	中文传媒	95,200	1,254,736.00	0.30
107	300638	广和通	65,900	1,254,077.00	0.30
108	002422	科伦药业	43,100	1,252,055.00	0.30
109	688778	厦钨新能	31,551	1,250,681.64	0.30
110	002407	多氟多	82,000	1,248,040.00	0.30
111	600325	华发股份	172,600	1,244,446.00	0.29
112	002384	东山精密	68,400	1,243,512.00	0.29
113	000050	深天马 A	116,700	1,242,855.00	0.29
114	002936	郑州银行	618,000	1,242,180.00	0.29

115	600143	金发科技	155,400	1,241,646.00	0.29
116	001872	招商港口	77,500	1,236,900.00	0.29
117	300373	扬杰科技	33,700	1,236,790.00	0.29
118	300529	健帆生物	55,200	1,227,096.00	0.29
119	688349	三一重能	42,800	1,224,936.00	0.29
120	688510	航亚科技	69,509	1,224,748.58	0.29
121	300296	利亚德	204,000	1,224,000.00	0.29
122	002568	百润股份	49,600	1,220,656.00	0.29
123	600528	中铁工业	163,900	1,219,416.00	0.29
124	002083	孚日股份	241,400	1,216,656.00	0.29
125	002171	楚江新材	162,500	1,215,500.00	0.29
126	000612	焦作万方	211,200	1,214,400.00	0.29
127	600299	安迪苏	151,400	1,211,200.00	0.29
128	601928	凤凰传媒	137,400	1,210,494.00	0.29
129	688425	铁建重工	304,600	1,209,262.00	0.29
130	000990	诚志股份	147,200	1,208,512.00	0.29
131	688226	威腾电气	64,100	1,205,080.00	0.29
132	002753	永东股份	145,900	1,203,675.00	0.29
133	002340	格林美	219,700	1,199,562.00	0.28
134	600598	北大荒	100,200	1,199,394.00	0.28
135	000970	中科三环	115,500	1,195,425.00	0.28
136	601298	青岛港	193,000	1,192,740.00	0.28
137	600500	中化国际	269,700	1,192,074.00	0.28
138	600008	首创环保	442,800	1,191,132.00	0.28
139	000898	鞍钢股份	478,000	1,190,220.00	0.28
140	002294	信立泰	36,400	1,188,824.00	0.28
141	000709	河钢股份	556,400	1,185,132.00	0.28
142	300363	博腾股份	47,100	1,184,565.00	0.28
143	002008	大族激光	57,100	1,183,112.00	0.28
144	600801	华新水泥	95,000	1,180,850.00	0.28
145	601216	君正集团	314,900	1,177,726.00	0.28
146	600597	光明乳业	134,600	1,175,058.00	0.28
147	688208	道通科技	49,262	1,169,972.50	0.28
148	002266	浙富控股	341,900	1,162,460.00	0.28
149	600827	百联股份	122,200	1,159,678.00	0.27
150	601158	重庆水务	204,400	1,158,948.00	0.27
151	688006	杭可科技	49,336	1,158,409.28	0.27
152	000785	居然之家	350,800	1,157,640.00	0.27
153	601866	中远海发	493,800	1,155,492.00	0.27
154	601992	金隅集团	602,900	1,151,539.00	0.27
155	000402	金融街	315,800	1,146,354.00	0.27
156	300244	迪安诊断	48,000	1,142,880.00	0.27
157	000401	冀东水泥	178,800	1,142,532.00	0.27

158	600739	辽宁成大	96,900	1,141,482.00	0.27
159	603927	中科软	38,000	1,139,240.00	0.27
160	600131	国网信通	74,700	1,131,705.00	0.27
161	600977	中国电影	92,100	1,127,304.00	0.27
162	601828	美凯龙	289,700	1,121,139.00	0.27
163	300383	光环新网	115,100	1,118,772.00	0.27
164	688819	天能股份	39,700	1,108,424.00	0.26
165	002244	滨江集团	150,100	1,091,227.00	0.26
166	000553	安道麦 A	156,600	1,086,804.00	0.26
167	300532	今天国际	65,400	1,073,868.00	0.25
168	600968	海油发展	374,700	1,067,895.00	0.25
169	300888	稳健医疗	28,600	1,065,350.00	0.25
170	000060	中金岭南	245,900	1,062,288.00	0.25
171	000783	长江证券	195,800	1,053,404.00	0.25
172	002483	润邦股份	200,300	1,045,566.00	0.25
173	002367	康力电梯	138,800	1,043,776.00	0.25
174	000928	中钢国际	177,800	1,036,574.00	0.25
175	601162	天风证券	329,000	1,016,610.00	0.24
176	301257	普蕊斯	16,000	1,016,000.00	0.24
177	603589	口子窖	21,800	987,540.00	0.23
178	000027	深圳能源	149,400	963,630.00	0.23
179	600663	陆家嘴	109,000	953,750.00	0.23
180	002027	分众传媒	149,000	941,680.00	0.22
181	603156	养元饮品	43,600	926,936.00	0.22
182	600166	福田汽车	328,000	895,440.00	0.21
183	002443	金洲管道	129,900	889,815.00	0.21
184	603920	世运电路	48,200	881,096.00	0.21
185	002056	横店东磁	62,900	851,666.00	0.20
186	002414	高德红外	115,300	841,690.00	0.20
187	000519	中兵红箭	57,900	812,916.00	0.19
188	603551	奥普家居	74,100	784,719.00	0.19
189	603611	诺力股份	40,200	760,986.00	0.18
190	000700	模塑科技	104,000	728,000.00	0.17
191	300772	运达股份	67,400	717,136.00	0.17
192	002409	雅克科技	12,200	679,906.00	0.16
193	300682	朗新集团	40,900	670,351.00	0.16
194	603218	日月股份	52,237	646,171.69	0.15
195	002706	良信股份	69,200	611,036.00	0.14
196	002249	大洋电机	122,900	610,813.00	0.14
197	000589	贵州轮胎	95,000	581,400.00	0.14
198	002465	海格通信	44,800	575,680.00	0.14
199	600970	中材国际	60,700	566,938.00	0.13
200	002519	银河电子	89,300	550,981.00	0.13

201	605098	行动教育	14,100	543,555.00	0.13
202	600351	亚宝药业	78,600	542,340.00	0.13
203	300724	捷佳伟创	7,300	540,273.00	0.13
204	002030	达安基因	54,196	524,617.28	0.12
205	688002	睿创微纳	11,401	504,152.22	0.12
206	000731	四川美丰	65,000	481,000.00	0.11
207	601126	四方股份	33,900	480,024.00	0.11
208	600546	山煤国际	27,400	479,774.00	0.11
209	002745	木林森	55,000	476,300.00	0.11
210	601857	中国石油	64,700	456,782.00	0.11
211	600563	法拉电子	4,800	444,480.00	0.11
212	600167	联美控股	75,800	429,786.00	0.10
213	600141	兴发集团	22,900	417,925.00	0.10
214	300389	艾比森	22,100	383,214.00	0.09
215	002697	红旗连锁	75,400	375,492.00	0.09
216	600909	华安证券	74,600	364,048.00	0.09
217	603339	四方科技	30,000	356,700.00	0.08
218	002997	瑞鹄模具	10,700	356,524.00	0.08
219	002532	天山铝业	56,600	340,166.00	0.08
220	688292	浩瀚深度	12,100	332,992.00	0.08
221	000682	东方电子	38,000	305,900.00	0.07
222	300533	冰川网络	10,800	299,160.00	0.07
223	300390	天华新能	11,010	279,103.50	0.07
224	600157	永泰能源	195,900	268,383.00	0.06
225	601108	财通证券	31,480	244,284.80	0.06
226	688248	南网科技	9,711	242,483.67	0.06
227	600583	海油工程	40,300	239,382.00	0.06
228	603338	浙江鼎力	4,500	230,265.00	0.05
229	600482	中国动力	12,600	226,926.00	0.05
230	300698	万马科技	5,900	215,350.00	0.05
231	688772	珠海冠宇	9,591	211,097.91	0.05
232	300771	智莱科技	19,100	207,617.00	0.05
233	000718	苏宁环球	76,500	198,135.00	0.05
234	002043	兔宝宝	21,500	190,490.00	0.05
235	002430	杭氧股份	6,500	189,865.00	0.04
236	000650	仁和药业	26,700	177,021.00	0.04
237	603639	海利尔	11,100	174,270.00	0.04
238	603758	秦安股份	12,700	145,288.00	0.03
239	603529	爱玛科技	5,300	132,712.00	0.03
240	688435	英方软件	2,728	130,998.56	0.03
241	600329	达仁堂	3,800	127,870.00	0.03
242	601077	渝农商行	28,000	114,240.00	0.03
243	688028	沃尔德	4,500	112,005.00	0.03

244	601138	工业富联	6,400	96,768.00	0.02
245	002588	史丹利	14,100	89,958.00	0.02
246	002624	完美世界	6,900	81,696.00	0.02
247	600699	均胜电子	3,600	64,656.00	0.02
248	603737	三棵树	1,200	57,132.00	0.01
249	600155	华创云信	6,300	52,542.00	0.01
250	601000	唐山港	14,300	50,050.00	0.01
251	300474	景嘉微	700	49,497.00	0.01
252	300308	中际旭创	400	45,164.00	0.01
253	000400	许继电气	2,000	43,920.00	0.01
254	603225	新凤鸣	2,900	41,180.00	0.01
255	689009	九号公司	1,300	38,558.00	0.01
256	600372	中航机载	2,300	30,314.00	0.01
257	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
258	300109	新开源	1,500	27,060.00	0.01
259	301526	国际复材	6,018	26,780.10	0.01
260	688563	航材股份	333	20,143.17	0.00
261	600848	上海临港	2,000	20,100.00	0.00
262	688548	广钢气体	1,570	20,017.50	0.00
263	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
264	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
265	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
266	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
267	301139	元道通信	566	19,136.46	0.00
268	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
269	688549	中巨芯	2,302	18,623.18	0.00
270	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
271	000997	新大陆	900	17,649.00	0.00
272	301291	明阳电气	620	17,583.20	0.00
273	688582	芯动联科	450	17,401.50	0.00
274	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
275	603650	彤程新材	500	16,650.00	0.00
276	000937	冀中能源	2,300	16,422.00	0.00
277	000039	中集集团	2,100	16,065.00	0.00
278	688652	京仪装备	302	15,779.50	0.00
279	000998	隆平高科	1,100	15,510.00	0.00
280	688591	泰凌微	537	15,046.74	0.00
281	301498	乖宝宠物	373	14,476.13	0.00
282	002073	软控股份	2,200	14,454.00	0.00
283	600489	中金黄金	1,400	13,944.00	0.00
284	002985	北摩高科	400	13,872.00	0.00
285	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
286	603296	华勤技术	174	13,528.50	0.00

287	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
288	301511	德福科技	594	13,465.98	0.00
289	301486	致尚科技	272	12,852.00	0.00
290	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
291	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
292	601611	中国核建	1,800	12,474.00	0.00
293	688080	映翰通	299	12,133.42	0.00
294	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
295	688702	盛科通信	237	11,418.66	0.00
296	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
297	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
298	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
299	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
300	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
301	301393	昊帆生物	182	10,805.34	0.00
302	301298	东利机械	634	10,778.00	0.00
303	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
304	300155	安居宝	1,800	10,656.00	0.00
305	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
306	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
307	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
308	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
309	002203	海亮股份	900	10,035.00	0.00
310	688719	爱科赛博	165	9,916.50	0.00
311	600667	太极实业	1,400	9,842.00	0.00
312	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
313	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
314	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
315	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
316	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
317	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
318	300212	易华录	300	9,435.00	0.00
319	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
320	301371	敷尔佳	248	9,319.84	0.00
321	300394	天孚通信	100	9,152.00	0.00
322	002867	周大生	600	9,108.00	0.00
323	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
324	000768	中航西飞	400	8,948.00	0.00
325	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
326	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
327	600409	三友化工	1,600	8,784.00	0.00
328	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
329	301125	腾亚精工	458	8,665.36	0.00

330	301559	中集环科	466	8,499.84	0.00
331	688612	威迈斯	222	8,429.34	0.00
332	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
333	301525	儒竞科技	103	8,390.38	0.00
334	600498	烽火通信	500	8,320.00	0.00
335	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
336	301520	万邦医药	157	8,280.18	0.00
337	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
338	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
339	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
340	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
341	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
342	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
343	603517	绝味食品	300	8,058.00	0.00
344	688596	正帆科技	200	7,926.00	0.00
345	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
346	688693	锆威特	181	7,860.27	0.00
347	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
348	600765	中航重机	400	7,644.00	0.00
349	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
350	301548	崇德科技	125	7,373.75	0.00
351	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
352	601083	锦江航运	655	7,250.85	0.00
353	688657	浩辰软件	92	7,197.16	0.00
354	300232	洲明科技	800	7,040.00	0.00
355	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
356	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
357	300800	力合科技	500	6,835.00	0.00
358	002215	诺普信	800	6,608.00	0.00
359	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
360	000778	新兴铸管	1,700	6,494.00	0.00
361	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
362	600718	东软集团	700	6,475.00	0.00
363	600479	千金药业	600	6,462.00	0.00
364	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
365	002939	长城证券	800	6,400.00	0.00
366	300004	南风股份	1,000	6,180.00	0.00
367	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
368	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
369	300672	国科微	100	5,894.00	0.00
370	002326	永太科技	500	5,810.00	0.00
371	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
372	002518	科士达	200	5,520.00	0.00

373	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
374	000031	大悦城	1,800	5,346.00	0.00
375	300487	蓝晓科技	100	5,306.00	0.00
376	300118	东方日升	300	5,295.00	0.00
377	603858	步长制药	300	5,103.00	0.00
378	300442	润泽科技	200	5,074.00	0.00
379	600985	淮北矿业	300	4,989.00	0.00
380	603107	上海汽配	270	4,911.30	0.00
381	000021	深科技	300	4,863.00	0.00
382	002533	金杯电工	600	4,848.00	0.00
382	300003	乐普医疗	300	4,848.00	0.00
383	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
384	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
385	600927	永安期货	300	4,713.00	0.00
386	300515	三德科技	400	4,616.00	0.00
387	603026	胜华新材	100	4,586.00	0.00
388	603193	润本股份	266	4,431.56	0.00
389	600826	兰生股份	500	4,420.00	0.00
390	603062	麦加芯彩	71	4,104.51	0.00
391	300088	长信科技	600	4,014.00	0.00
392	688219	会通股份	359	3,938.23	0.00
393	603075	热威股份	166	3,869.46	0.00
394	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
395	002673	西部证券	600	3,822.00	0.00
396	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
397	300418	昆仑万维	100	3,740.00	0.00
398	600757	长江传媒	500	3,725.00	0.00
399	600435	北方导航	300	3,522.00	0.00
400	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
401	002085	万丰奥威	700	3,458.00	0.00
401	002223	鱼跃医疗	100	3,458.00	0.00
402	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
403	603328	依顿电子	400	3,260.00	0.00
404	002666	德联集团	600	3,240.00	0.00
405	002500	山西证券	600	3,234.00	0.00
406	002966	苏州银行	500	3,230.00	0.00
407	300230	永利股份	800	3,224.00	0.00
408	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
409	000948	南天信息	200	3,014.00	0.00
410	603883	老百姓	100	2,989.00	0.00
411	002815	崇达技术	300	2,874.00	0.00
412	002128	电投能源	200	2,854.00	0.00
413	600171	上海贝岭	200	2,844.00	0.00

414	000419	通程控股	500	2,810.00	0.00
415	601869	长飞光纤	100	2,746.00	0.00
416	300115	长盈精密	200	2,650.00	0.00
417	600050	中国联通	600	2,628.00	0.00
418	002017	东信和平	250	2,602.50	0.00
419	002737	葵花药业	100	2,598.00	0.00
420	000807	云铝股份	200	2,444.00	0.00
421	603456	九洲药业	100	2,421.00	0.00
422	601377	兴业证券	400	2,348.00	0.00
423	600580	卧龙电驱	200	2,346.00	0.00
424	600197	伊力特	100	2,175.00	0.00
425	300741	华宝股份	100	2,141.00	0.00
426	600315	上海家化	100	2,118.00	0.00
427	600348	华阳股份	200	1,952.00	0.00
428	603949	雪龙集团	100	1,873.00	0.00
429	600480	凌云股份	200	1,822.00	0.00
430	600481	双良节能	200	1,692.00	0.00
431	600694	大商股份	100	1,689.00	0.00
432	600416	湘电股份	100	1,588.00	0.00
433	601598	中国外运	300	1,572.00	0.00
434	002909	集泰股份	200	1,526.00	0.00
435	002625	光启技术	100	1,478.00	0.00
436	600673	东阳光	200	1,466.00	0.00
437	002956	西麦食品	100	1,433.00	0.00
438	600089	特变电工	100	1,380.00	0.00
439	000822	山东海化	200	1,368.00	0.00
440	000951	中国重汽	100	1,336.00	0.00
441	002048	宁波华翔	100	1,301.00	0.00
442	600623	华谊集团	200	1,288.00	0.00
443	600487	亨通光电	100	1,194.00	0.00
444	301028	东亚机械	100	1,173.00	0.00
445	600863	内蒙华电	300	1,170.00	0.00
446	002531	天顺风能	100	1,160.00	0.00
447	002022	科华生物	100	1,138.00	0.00
448	603289	泰瑞机器	100	1,104.00	0.00
449	000014	沙河股份	100	1,101.00	0.00
450	603121	华培动力	100	1,087.00	0.00
451	600858	银座股份	200	1,064.00	0.00
452	300009	安科生物	100	1,022.00	0.00
453	300070	碧水源	200	998.00	0.00
454	300022	吉峰科技	200	986.00	0.00
455	603987	康德莱	100	954.00	0.00
456	301039	中集车辆	100	938.00	0.00

457	603660	苏州科达	100	879.00	0.00
458	300193	佳士科技	100	777.00	0.00
459	688571	杭华股份	100	748.00	0.00
460	600415	小商品城	100	732.00	0.00
461	000906	浙商中拓	100	731.00	0.00
462	300058	蓝色光标	100	718.00	0.00
463	002250	联化科技	100	713.00	0.00
464	002429	兆驰股份	100	558.00	0.00
464	600028	中国石化	100	558.00	0.00
465	002361	神剑股份	100	393.00	0.00
466	601665	齐鲁银行	100	391.00	0.00
467	002081	金螳螂	100	376.00	0.00
468	600716	凤凰股份	100	368.00	0.00
469	600782	新钢股份	100	349.00	0.00
470	000629	钒钛股份	100	328.00	0.00
471	600208	新湖中宝	100	217.00	0.00
472	601005	重庆钢铁	100	139.00	0.00
473	600022	山东钢铁	100	137.00	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	002625	光启技术	19,925,155.32	4.37
2	600258	首旅酒店	18,386,122.00	4.04
3	603688	石英股份	18,106,467.40	3.98
4	000997	新大陆	17,821,372.00	3.91
5	601717	郑煤机	16,621,966.00	3.65
6	603737	三棵树	16,459,171.80	3.61
7	600390	五矿资本	15,744,128.00	3.46
8	600655	豫园股份	15,579,813.00	3.42
9	601058	赛轮轮胎	15,305,800.76	3.36
10	688777	中控技术	15,218,023.09	3.34
11	601958	金钼股份	15,209,651.54	3.34
12	002373	千方科技	15,194,942.00	3.34
13	688006	杭可科技	15,170,489.29	3.33
14	000739	普洛药业	15,100,941.00	3.32
15	600879	航天电子	14,831,697.00	3.26
16	600528	中铁工业	14,284,845.50	3.14
17	688002	睿创微纳	14,273,533.16	3.13
18	002081	金螳螂	13,758,167.64	3.02
19	600418	江淮汽车	13,727,849.00	3.01

20	600066	宇通客车	13,700,166.00	3.01
21	688390	固德威	13,648,938.74	3.00
22	603127	昭衍新药	13,647,655.13	3.00
23	002384	东山精密	13,586,941.64	2.98
24	002056	横店东磁	13,556,317.12	2.98
25	600582	天地科技	13,461,937.29	2.96
26	301029	怡合达	13,407,548.20	2.94
27	002025	航天电器	13,385,356.00	2.94
28	000967	盈峰环境	13,187,279.00	2.90
29	300866	安克创新	13,154,141.86	2.89
30	002422	科伦药业	13,104,732.00	2.88
31	600060	海信视像	13,016,867.00	2.86
32	600637	东方明珠	12,884,537.81	2.83
33	002065	东华软件	12,878,080.00	2.83
34	002683	广东宏大	12,858,116.23	2.82
35	000027	深圳能源	12,592,389.00	2.76
36	002985	北摩高科	12,511,191.20	2.75
37	600580	卧龙电驱	12,487,315.00	2.74
38	600038	中直股份	12,418,409.70	2.73
39	300308	中际旭创	12,381,493.00	2.72
40	600517	国网英大	12,372,690.13	2.72
41	601966	玲珑轮胎	12,354,752.25	2.71
42	002745	木林森	12,263,920.00	2.69
43	688516	奥特维	12,126,020.50	2.66
44	603883	老百姓	11,933,616.00	2.62
45	002572	索菲亚	11,838,767.51	2.60
46	000728	国元证券	11,811,280.60	2.59
47	600535	天士力	11,807,542.00	2.59
48	688029	南微医学	11,794,506.93	2.59
49	600901	江苏金租	11,736,650.60	2.58
50	603218	日月股份	11,695,154.26	2.57
51	002249	大洋电机	11,688,783.00	2.57
52	300017	网宿科技	11,629,082.01	2.55
53	000887	中鼎股份	11,552,681.51	2.54
54	002673	西部证券	11,542,167.92	2.53
55	600563	法拉电子	11,503,691.00	2.53
56	600704	物产中大	11,463,988.25	2.52
57	600959	江苏有线	11,433,163.80	2.51
58	601098	中南传媒	11,413,092.00	2.51
59	000156	华数传媒	11,403,159.00	2.50
60	688208	道通科技	11,316,791.10	2.48
61	600623	华谊集团	11,220,620.97	2.46
62	603228	景旺电子	11,138,236.50	2.45

63	002223	鱼跃医疗	11,134,295.00	2.44
64	000869	张裕 A	11,115,777.08	2.44
65	688188	柏楚电子	11,094,466.83	2.44
66	002429	兆驰股份	11,040,143.00	2.42
67	000729	燕京啤酒	11,013,601.00	2.42
68	601108	财通证券	11,004,158.43	2.42
69	002867	周大生	10,950,548.00	2.40
70	600699	均胜电子	10,872,792.00	2.39
71	002128	电投能源	10,865,681.00	2.39
72	603233	大参林	10,808,434.80	2.37
73	600329	达仁堂	10,752,227.00	2.36
74	601128	常熟银行	10,630,379.00	2.33
75	600435	北方导航	10,582,767.00	2.32
76	000400	许继电气	10,561,535.00	2.32
77	001914	招商积余	10,517,297.00	2.31
78	002430	杭氧股份	10,376,957.16	2.28
79	600529	山东药玻	10,339,920.00	2.27
80	600153	建发股份	10,325,711.36	2.27
81	000012	南玻 A	10,317,468.00	2.27
82	603444	吉比特	10,093,312.04	2.22
83	000591	太阳能	9,941,940.76	2.18
84	002444	巨星科技	9,939,169.80	2.18
85	000783	长江证券	9,871,387.94	2.17
86	600968	海油发展	9,855,421.00	2.16
87	002563	森马服饰	9,847,477.00	2.16
88	603866	桃李面包	9,757,594.60	2.14
89	600927	永安期货	9,728,173.43	2.14
90	600143	金发科技	9,704,401.00	2.13
91	600737	中粮糖业	9,676,637.00	2.12
92	688772	珠海冠宇	9,614,394.71	2.11
93	600339	中油工程	9,595,274.00	2.11
94	601162	天风证券	9,581,323.00	2.10
95	000630	铜陵有色	9,275,345.00	2.04

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	688390	固德威	21,129,614.32	4.64
2	300308	中际旭创	20,313,021.71	4.46
3	002625	光启技术	19,919,068.22	4.37
4	603737	三棵树	18,472,668.96	4.06
5	000997	新大陆	18,030,508.00	3.96

6	300017	网宿科技	17,601,903.87	3.86
7	601717	郑煤机	17,435,145.32	3.83
8	000012	南玻 A	16,922,683.10	3.72
9	002985	北摩高科	15,990,508.50	3.51
10	600879	航天电子	15,947,289.00	3.50
11	600418	江淮汽车	15,921,450.00	3.50
12	600901	江苏金租	15,827,531.00	3.47
13	300136	信维通信	15,464,249.08	3.40
14	600699	均胜电子	14,970,400.45	3.29
15	600959	江苏有线	14,969,751.80	3.29
16	002081	金螳螂	14,904,140.67	3.27
17	000156	华数传媒	14,859,851.07	3.26
18	002429	兆驰股份	14,590,277.00	3.20
19	688777	中控技术	14,574,880.68	3.20
20	002249	大洋电机	14,572,760.70	3.20
21	600008	首创环保	14,375,446.00	3.16
22	600060	海信视像	14,372,138.00	3.16
23	601098	中南传媒	14,263,535.86	3.13
24	000869	张裕 A	14,180,730.50	3.11
25	300009	安科生物	14,159,074.36	3.11
26	000967	盈峰环境	13,843,545.27	3.04
27	600258	首旅酒店	13,837,832.63	3.04
28	600563	法拉电子	13,836,766.00	3.04
29	603868	飞科电器	13,779,803.81	3.03
30	000878	云南铜业	13,679,214.00	3.00
31	688002	睿创微纳	13,640,594.49	2.99
32	002444	巨星科技	13,367,049.10	2.93
33	603688	石英股份	13,224,713.00	2.90
34	600927	永安期货	13,109,512.77	2.88
35	688006	杭可科技	13,108,067.57	2.88
36	603127	昭衍新药	13,092,899.88	2.87
37	002273	水晶光电	12,800,148.80	2.81
38	601128	常熟银行	12,733,606.58	2.80
39	600580	卧龙电驱	12,659,483.46	2.78
40	600566	济川药业	12,616,623.00	2.77
41	688301	奕瑞科技	12,586,468.51	2.76
42	600528	中铁工业	12,568,231.00	2.76
43	002250	联化科技	12,463,131.78	2.74
44	600998	九州通	12,279,783.54	2.70
45	301029	怡合达	12,240,241.80	2.69
46	600598	北大荒	12,151,221.00	2.67
47	601966	玲珑轮胎	11,923,100.81	2.62
48	688029	南微医学	11,876,863.36	2.61

49	603444	吉比特	11,866,017.31	2.61
50	000729	燕京啤酒	11,847,391.00	2.60
51	600500	中化国际	11,837,978.00	2.60
52	000739	普洛药业	11,788,939.00	2.59
53	600655	豫园股份	11,753,574.61	2.58
54	601058	赛轮轮胎	11,703,049.00	2.57
55	601869	长飞光纤	11,628,770.90	2.55
56	688188	柏楚电子	11,608,572.88	2.55
57	002745	木林森	11,592,605.00	2.55
58	002673	西部证券	11,567,231.34	2.54
59	002422	科伦药业	11,534,108.00	2.53
60	000027	深圳能源	11,451,780.00	2.51
61	002056	横店东磁	11,421,582.00	2.51
62	002384	东山精密	11,414,704.00	2.51
63	600623	华谊集团	11,319,526.00	2.49
64	603883	老百姓	11,281,959.00	2.48
65	002867	周大生	11,219,038.00	2.46
66	300866	安克创新	11,084,957.00	2.43
67	002223	鱼跃医疗	11,080,277.00	2.43
68	002128	电投能源	11,053,701.00	2.43
69	601108	财通证券	11,005,631.30	2.42
70	600718	东软集团	10,992,954.00	2.41
71	600390	五矿资本	10,888,622.71	2.39
72	002244	滨江集团	10,627,613.00	2.33
73	603233	大参林	10,616,494.84	2.33
74	601231	环旭电子	10,603,857.44	2.33
75	002048	宁波华翔	10,575,394.39	2.32
76	600967	内蒙一机	10,569,178.00	2.32
77	603218	日月股份	10,555,766.74	2.32
78	600329	达仁堂	10,432,139.07	2.29
79	601997	贵阳银行	10,419,898.47	2.29
80	002025	航天电器	10,368,203.00	2.28
81	601958	金钼股份	10,339,500.28	2.27
82	002430	杭氧股份	10,291,447.36	2.26
83	601298	青岛港	10,276,206.74	2.26
84	000400	许继电气	10,254,074.55	2.25
85	600535	天士力	10,212,862.40	2.24
86	600435	北方导航	10,169,136.00	2.23
87	002683	广东宏大	10,168,301.00	2.23
88	688819	天能股份	10,128,097.09	2.22
89	603355	莱克电气	9,837,038.39	2.16
90	600398	海澜之家	9,768,081.00	2.14
91	002373	千方科技	9,744,129.37	2.14

92	600820	隧道股份	9,732,394.83	2.14
93	603228	景旺电子	9,577,960.00	2.10
94	002065	东华软件	9,531,926.00	2.09
95	002595	豪迈科技	9,506,920.84	2.09
96	688772	珠海冠宇	9,503,512.19	2.09
97	600038	中直股份	9,462,110.00	2.08
98	600064	南京高科	9,441,566.50	2.07
99	688063	派能科技	9,363,039.26	2.06
100	300861	美畅股份	9,359,039.77	2.05
101	600895	张江高科	9,338,052.19	2.05
102	000630	铜陵有色	9,252,370.00	2.03
103	000728	国元证券	9,235,053.55	2.03
104	002497	雅化集团	9,213,738.00	2.02
105	600970	中材国际	9,191,249.08	2.02
106	600739	辽宁成大	9,169,299.78	2.01
107	688208	道通科技	9,162,287.65	2.01
108	603317	天味食品	9,154,238.40	2.01
109	002192	融捷股份	9,132,073.00	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	3,395,545,051.00
卖出股票的收入（成交）总额	3,410,416,345.15

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的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内受到公开谴责、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。

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	53,943.61
2	应收清算款	2,691,729.35
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	317,409.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,063,082.68

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	17,787	15,356.51	14,108,579.02	5.17%	259,037,594.65	94.83%
博时中证 500 指数增强 C	12,538	7,098.65	3,243,242.28	3.64%	85,759,573.45	96.36%
合计	30,043	12,054.36	17,351,821.30	4.79%	344,797,168.10	95.21%

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	233,872.23	0.09%
	博时中证 500 指数增强 C	134,700.96	0.15%
	合计	368,573.19	0.10%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本 开放式基金	博时中证 500 指数增强 A	-
	博时中证 500 指数增强 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持 有本开放式基金	博时中证 500 指数增强 A	-
	博时中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 26 日）基金份额总额	383,128,088.40	-
本报告期初基金份额总额	277,095,237.58	92,265,547.46
本报告期基金总申购份额	41,887,871.09	46,335,492.18
减：本报告期基金总赎回份额	45,836,935.00	49,598,223.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	273,146,173.67	89,002,815.73

§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

2023 年 2 月 18 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,邵凯先生不再担任公司副总经理。

2023 年 5 月 27 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,吴慧峰先生任公司副总经理、财务负责人,孙献女士不再担任公司财务负责人。

2023 年 11 月 1 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,高阳先生不再担任公司总经理,江向阳先生代任公司总经理。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 49000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	5	1,951,905,975.91	28.75%	1,435,053.91	28.74%	-
中金公司	2	1,168,381,053.38	17.21%	861,800.62	17.26%	-
华泰证券	3	677,906,588.68	9.99%	498,209.14	9.98%	-
广发证券	2	608,994,490.88	8.97%	447,408.62	8.96%	-
第一创业	1	377,883,494.23	5.57%	276,337.72	5.53%	增加 1 个
中信证券	3	337,080,824.56	4.97%	246,514.14	4.94%	-
海通证券	6	322,338,852.42	4.75%	237,148.67	4.75%	-
东兴证券	2	309,405,451.55	4.56%	226,272.55	4.53%	增加 1 个
东方财富证券	1	212,440,821.02	3.13%	158,453.71	3.17%	-
长江证券	3	182,530,628.14	2.69%	134,382.48	2.69%	增加 1 个
国新证券	2	168,392,245.82	2.48%	123,618.99	2.48%	-
银河证券	2	163,768,997.24	2.41%	121,562.30	2.43%	-
江海证券	2	151,952,514.03	2.24%	113,009.48	2.26%	增加 1 个
方正证券	1	127,350,315.45	1.88%	93,132.92	1.87%	-
东吴证券	2	28,365,230.66	0.42%	20,743.20	0.42%	增加 1 个
中泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，

能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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与上海富友支付服务有限公司合作开通平安银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-22
2	博时基金管理有限公司关于暂停使用平安银行直联快捷	证券日报、基金	2023-11-22

	支付服务办理直销网上交易部分业务的公告	管理人网站、证监会基金电子披露网站	
3	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	2023-11-14
4	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	2023-11-11
5	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	2023-10-25
6	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 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	2023-10-25
7	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	2023-09-28
8	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 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	2023-08-31
9	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	2023-08-25
10	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	2023-08-25
11	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-22
12	博时基金管理有限公司关于与银联商务股份有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-03
13	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有	证券日报、基金	2023-08-03

	限公司合作开通的华夏银行借记卡网上支付服务迁移的公告	管理人网站、证监会基金电子披露网站	
14	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 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	2023-07-21
15	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-20230601	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
16	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	2023-05-27
17	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	2023-05-17
18	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	2023-05-12
19	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
20	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 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	2023-03-30
21	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	2023-02-18
22	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
23	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 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	2023-01-20
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	证券日报、基金	2023-01-04

	票调整估值方法的公告-20230104	管理人网站、证监会基金电子披露网站	
--	---------------------	-------------------	--

§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
二〇二四年三月二十九日