

博时中证 500 指数增强型证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 1 重要提示及目录

---

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50

7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 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	350,330,559.83 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	265,085,706.82 份	85,244,853.01 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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>4、股票组合调整。包括定期和不定期调整。</li> <li>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，</li> </ol>

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强

		<b>C</b>
本期已实现收益	-6, 293, 013. 14	-2, 364, 563. 89
本期利润	-14, 206, 628. 05	-4, 419, 006. 91
加权平均基金份额本期利润	-0. 0531	-0. 0509
本期加权平均净值利润率	-4. 58%	-4. 50%
本期基金份额净值增长率	-4. 51%	-4. 71%
<b>3. 1. 2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>	
	<b>博时中证 500 指数增强 A</b>	<b>博时中证 500 指数增强 C</b>
期末可供分配利润	31, 493, 821. 83	7, 786, 819. 02
期末可供分配基金份额利润	0. 1188	0. 0913
期末基金资产净值	296, 579, 528. 65	93, 031, 672. 03
期末基金份额净值	1. 1188	1. 0913
<b>3. 1. 3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>	
	<b>博时中证 500 指数增强 A</b>	<b>博时中证 500 指数增强 C</b>
基金份额累计净值增长率	11. 88%	11. 48%

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

#### 博时中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5. 22%	0. 94%	-6. 55%	0. 91%	1. 33%	0. 03%
过去三个月	-4. 02%	1. 03%	-6. 16%	1. 09%	2. 14%	-0. 06%
过去六个月	-4. 51%	1. 47%	-8. 46%	1. 53%	3. 95%	-0. 06%
过去一年	-11. 68%	1. 16%	-16. 71%	1. 21%	5. 03%	-0. 05%
过去三年	-27. 08%	1. 12%	-26. 00%	1. 14%	-1. 08%	-0. 02%
自基金合同生效起至今	11. 88%	1. 27%	-22. 15%	1. 27%	34. 03%	0. 00%

#### 博时中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-5.25%	0.94%	-6.55%	0.91%	1.30%	0.03%
过去三个月	-4.11%	1.04%	-6.16%	1.09%	2.05%	-0.05%
过去六个月	-4.71%	1.47%	-8.46%	1.53%	3.75%	-0.06%
过去一年	-12.03%	1.16%	-16.71%	1.21%	4.68%	-0.05%
过去三年	-27.96%	1.12%	-26.00%	1.14%	-1.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	11.48%	1.27%	-17.76%	1.28%	29.24%	-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。

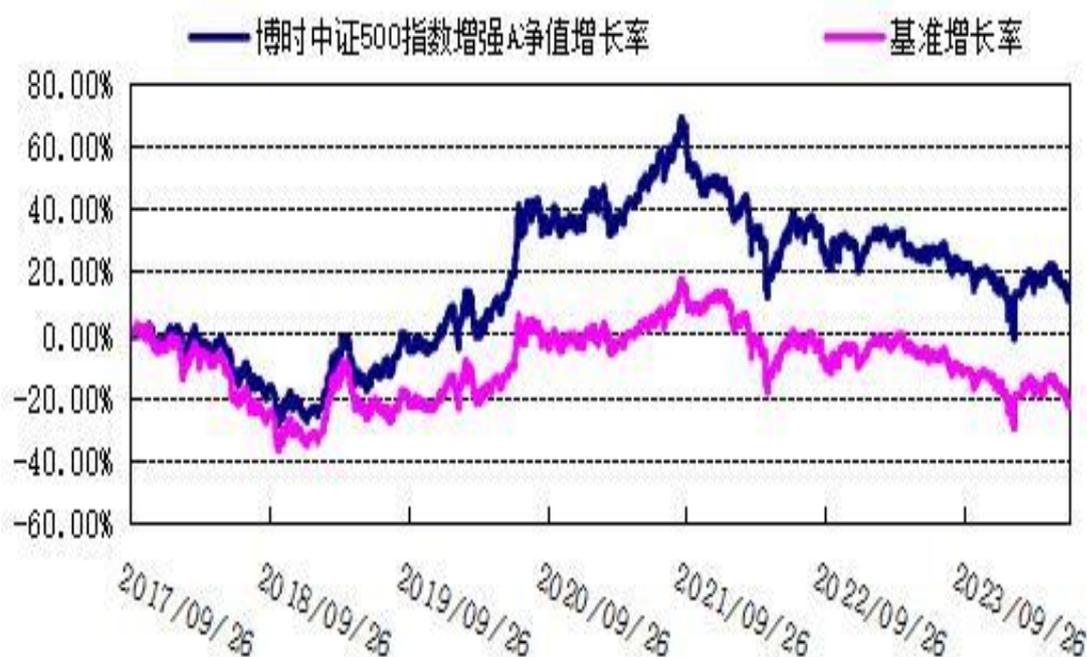
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

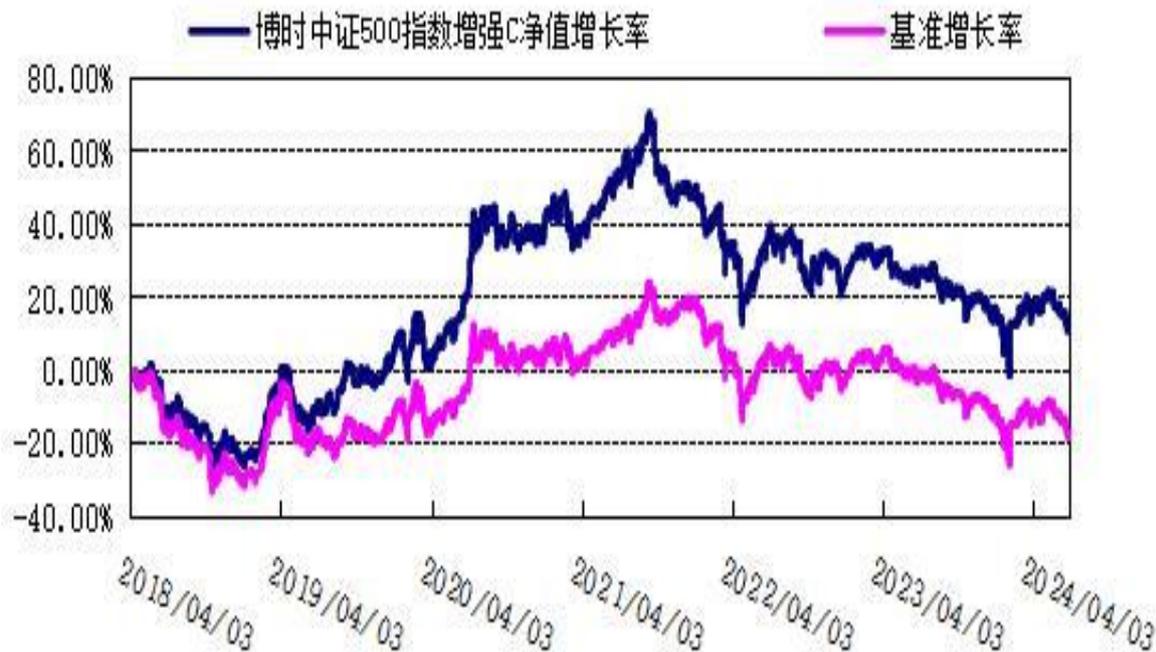
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 9 月 26 日至 2024 年 6 月 30 日)

#### 博时中证 500 指数增强 A



#### 博时中证 500 指数增强 C



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 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 16037 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 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 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。

#### 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	-	17.8	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沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日一至今)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日一至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日一至今)、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 日一至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日一至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日一至今)的基金经理。
--	--	--	--	---

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 81 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

2024 年上半年，A 股市场首先迎来了一波流动性冲击，随后在宏观调控和基本面修复的背景下强势反弹，但好景不长，进入到二季度后，市场冲高回落。整个上半年，A 股市场博弈程度增强，选股难度加大。中信一级行业中 8 个行业上涨，22 个行业下跌，行业涨跌幅中位数约为-11%。如何在纷繁复杂的市场变化情况下，跑赢业绩基准，成为本基金首要考虑的问题。

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，控制行业风险敞口的偏离。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1188 元，份额累计净值为 1.1188 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0913 元，份额累计净值为 1.0913 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-4.51%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-4.71%，同期业绩基准增长率为-8.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，A 股市场仍不失机会。宏观层面，虽然 GDP、PMI 等经济数据不尽如人意，但随着美联储降息预期的增强，央行货币政策调整的空间已经具备。二十大三中全会公告也为新的经济增长点提供了坚实的政策保障和制度支持，为长期的资产配置指明了方向。微观层面，结构性增长的行业和个股仍广泛存在。在已经披露了上半年业绩预告的公司中，有 600 余家公司预喜，主要集中在电子、通信、汽车、化工、有色等行业，其中元器件、存储、AI 下游、消费电子等细分行业格外亮眼，部分食品饮料、航空交运板块也有转暖趋势。当然，部分行业如房地产、光伏等业绩仍然不佳，表明市场将继续呈现出分化的走势。除此之外，我们也看到外部环境还存在诸多的不确定性，俄乌冲突和巴以危机没有平息，全球产业链脱钩的风险也并没有减少，证券市场的结构化行情还将持续。

本基金将继续坚持量化多因子模型的框架，紧扣长期表现稳定、逻辑清晰的因子，坚持控制基金与业绩基准中证 500 指数的跟踪误差，适当暴露一定的行业偏离，根据模型结果配置股票组合，

争取获得一定的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

---

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.3.1	26,022,323.10	25,770,174.40
结算备付金		3,803,284.39	4,040,766.04
存出保证金		63,333.79	53,943.61
交易性金融资产	6.4.3.2	361,439,787.58	394,437,291.82
其中：股票投资		361,439,787.58	394,437,291.82
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		1,948,979.93	2,691,729.35
应收股利		-	-

应收申购款		335,606.23	317,409.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		393,613,315.02	427,311,314.94
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,039,209.05	2,531,476.52
应付赎回款		363,958.64	743,546.56
应付管理人报酬		328,679.11	358,532.72
应付托管费		65,735.80	71,706.57
应付销售服务费		31,243.28	34,472.47
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	6.4.3.7	1,173,288.46	1,616,565.97
负债合计		4,002,114.34	5,356,300.81
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	350,330,559.83	362,148,989.40
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	39,280,640.85	59,806,024.73
净资产合计		389,611,200.68	421,955,014.13
<b>负债和净资产总计</b>		<b>393,613,315.02</b>	<b>427,311,314.94</b>

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 350,330,559.83 份。其中 A 类基金份额净值 1.1188 元，基金份额总额 265,085,706.82 份；C 类基金份额净值 1.0913 元，基金份额总额 85,244,853.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		-15,802,643.51	13,594,812.64
1. 利息收入		72,946.03	96,032.12
其中：存款利息收入	6.4.3.10	72,946.03	96,032.12

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）		-5,914,045.92	6,858,967.23
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-11,048,475.26	2,007,982.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-11,181.52	-
股利收益	6.4.3.15	5,145,610.86	4,850,984.91
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）	6.4.3.16	-9,968,057.93	6,632,560.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	6,514.31	7,252.95
<b>减：二、营业总支出</b>		2,822,991.45	3,228,068.72
1. 管理人报酬		2,032,787.90	2,340,748.83
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		406,557.55	468,149.73
3. 销售服务费		195,922.04	226,205.25
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	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.3.19	187,723.96	192,964.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,625,634.96	10,366,743.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,625,634.96	10,366,743.92
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-18,625,634.96	10,366,743.92

### 6.3 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	362,148,989.40	-	59,806,024.73	421,955,014.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	362,148,989.40	-	59,806,024.73	421,955,014.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,818,429.57	-	-20,525,383.88	-32,343,813.45
（一）、综合收益总额	-	-	-18,625,634.96	-18,625,634.96
（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）	-11,818,429.57	-	-1,899,748.92	-13,718,178.49
其中：1. 基金申购款	45,757,925.69	-	6,182,382.20	51,940,307.89
2. 基金赎回款	-57,576,355.26	-	-8,082,131.12	-65,658,486.38
（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	350,330,559.83	-	39,280,640.85	389,611,200.68
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 （若有）	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	455,469,265.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,007,406.58	-	8,041,978.94	34,572.36
（一）、综合收益总额	-	-	10,366,743.92	10,366,743.92
（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）	-8,007,406.58	-	-2,324,764.98	-10,332,171.56
其中：1. 基金申购款	45,744,764.59	-	12,933,738.55	58,678,503.14
2. 基金赎回款	-53,752,171.17	-	-15,258,503.53	-69,010,674.70
（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	361,353,378.46	-	94,150,459.13	455,503,837.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。(5) 本基金的城维护建设税、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。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	26,022,323.10
等于：本金	26,019,851.69
加：应计利息	2,471.41

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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	26,022,323.10

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	382,019,784.98	-	361,439,787.58	-20,579,997.40
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	382,019,784.98	-	361,439,787.58	-20,579,997.40

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.3.5 其他权益工具投资

##### 6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.3.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18.57
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	989,231.39
其中：交易所市场	989,231.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,038.50
应付指数使用费	100,000.00
合计	1,173,288.46

#### 6.4.3.8 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	273,146,173.67	273,146,173.67
本期申购	16,386,174.65	16,386,174.65
本期赎回（以“-”号填列）	-24,446,641.50	-24,446,641.50
本期末	265,085,706.82	265,085,706.82

##### 博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	89,002,815.73	89,002,815.73

本期申购	29,371,751.04	29,371,751.04
本期赎回（以“-”号填列）	-33,129,713.76	-33,129,713.76
本期末	85,244,853.01	85,244,853.01

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）。

#### 6.4.3.9 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	53,028,995.18	-6,143,483.01	46,885,512.17
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	53,028,995.18	-6,143,483.01	46,885,512.17
本期利润	-6,293,013.14	-7,913,614.91	-14,206,628.05
本期基金份额交易产生的变动数	-1,349,346.08	164,283.79	-1,185,062.29
其中：基金申购款	2,706,540.45	-346,494.07	2,360,046.38
基金赎回款	-4,055,886.53	510,777.86	-3,545,108.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,386,635.96	-13,892,814.13	31,493,821.83

##### 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	14,932,070.39	-2,011,557.83	12,920,512.56
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	14,932,070.39	-2,011,557.83	12,920,512.56
本期利润	-2,364,563.89	-2,054,443.02	-4,419,006.91
本期基金份额交易产生的变动数	-368,978.21	-345,708.42	-714,686.63
其中：基金申购款	4,031,593.51	-209,257.69	3,822,335.82
基金赎回款	-4,400,571.72	-136,450.73	-4,537,022.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,198,528.29	-4,411,709.27	7,786,819.02

#### 6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	41,564.47

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,773.31
其他	608.25
合计	72,946.03

#### 6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,252,090,242.91
减：卖出股票成本总额	1,260,497,173.10
减：交易费用	2,641,545.07
买卖股票差价收入	-11,048,475.26

#### 6.4.3.12 债券投资收益

##### 6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

#### 6.4.3.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.3.13.2 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。

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

##### 6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-11,181.52

#### 6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,145,610.86

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,145,610.86

#### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-9,968,057.93
——股票投资	-9,968,057.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-9,968,057.93

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,342.76
基金转换费收入	171.55
合计	6,514.31

#### 6.4.3.18 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,366.16
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	165.01
银行汇划费	3,520.45
指数使用费	100,000.00
合计	187,723.96

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	565,271,200.54	22.72%	1,144,202,104.11	30.73%

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	421,641.82	22.72%	218,680.81	22.11%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	836,767.19	30.73%	383,776.99	29.56%

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。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,032,787.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	705,943.31	786,710.43
应支付基金管理人的净管理费	1,326,844.59	1,554,038.40

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：

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

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的托管费	406,557.55

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：

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

##### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	24,275.65	24,275.65
合计	-	24,275.65	24,275.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	34,070.56	34,070.56
合计	-	34,070.56	34,070.56

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。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.6.4.1 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。

##### 6.4.6.4.2 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。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国银行-活期存款	26,022,323.10	41,564.47	23,890,279.78	47,248.72
-----------	---------------	-----------	---------------	-----------

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。

#### 6.4.6.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	1,326.00	115,308.96
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	首次公开	70.49	188.01	711.00	50,121.55	133,675.11	-

				发行限售						
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	首次公开发 行限售	86.96	174.93	133.00	11,565.68	23,265.69	-
603285	键邦股份	2024-06-28	5 个交易 日	新股未上 市	18.65	18.65	1,158.00	21,596.70	21,596.70	-
603350	安乃达	2024-06-26	5 个交易 日	新股未上 市	20.56	20.56	945.00	19,429.20	19,429.20	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6 个月	首次公开发 行限售	16.16	32.27	481.00	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	首次公开发 行限售	39.82	91.24	150.00	5,972.74	13,686.00	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	首次公开发 行	11.88	18.98	711.00	8,446.68	13,494.78	-

				限售						
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	首次公开发 行限售	44.95	65.93	202.00	9,079.90	13,317.86	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	首次公开发 行限售	15.69	18.79	655.00	10,276.95	12,307.45	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	首次公开发 行限售	19.86	42.51	247.00	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	首次公开发 行限售	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	首次公开发 行限售	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
688584	上海	2024-02-01	6 个月	首次	22.66	15.89	571.00	12,938.86	9,073.19	-

	合晶			公开发 行限售						
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	首次公开发 行限售	16.20	15.96	535.00	8,667.00	8,538.60	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	首次公开发 行限售	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	首次公开发 行限售	21.73	25.26	306.00	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	首次公开发 行限售	17.43	34.56	222.00	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	首次公开发 行	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-

				限售						
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	首次公开发 行限售	26.00	37.49	190.00	4,940.00	7,123.10	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	首次公开发 行限售	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	首次公开发 行限售	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	首次公开发 行限售	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	首次公开发 行限售	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
603344	星德	2024-03-13	6 个月	首次	19.18	22.66	182.00	3,490.76	4,124.12	-

	胜			公开发 行限售						
603325	博隆 技术	2024-01-03	6 个 月	首次公 开发 行限售	72.46	68.06	57.00	4,130.22	3,879.42	-
603381	永臻 股份	2024-06-19	6 个 月	首次公 开发 行限售	23.35	25.13	154.00	3,595.90	3,870.02	-
001359	平安 电工	2024-03-19	6 个 月	首次公 开发 行限售	17.39	20.60	184.00	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典 新能	2024-01-04	6 个 月	首次公 开发 行限售	29.02	25.36	130.00	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自 科技	2024-01-23	6 个 月	首次公 开发 行	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-

				限售						
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	首次公开发 行限售	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	首次公开发 行限售	38.18	38.90	72.00	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电 气	2024-01-04	6 个月	首次公开发 行限售	11.82	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-
603285	键邦股 份	2024-06-28	6 个月	首次公开发 行限售	18.65	18.65	129.00	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	首次公开发 行限售	20.56	20.56	106.00	2,179.36	2,179.36	-

金额单位：人民币元

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。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.9 金融工具风险及管理

##### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%,年跟踪误差不超过 7.5%,实现对中证 500 指数的有效跟踪。本基金的基金管理人建立了董事会领导,以风险管理委员会为核心的,由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,董事会负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任;在董事会下设立风险管理委员会,负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别,以及负责解决重大的突发的风险;督察长独立行使督察权利,直接对董事会负责,向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议;监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险

管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	26,022,323.10	-	-	-	26,022,323.10
结算备付金	3,803,284.39	-	-	-	3,803,284.39
存出保证金	63,333.79	-	-	-	63,333.79
交易性金融资产	-	-	-	361,439,787.58	361,439,787.58
应收清算款	-	-	-	1,948,979.93	1,948,979.93
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	335,606.23	335,606.23
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

<b>资产总计</b>	<b>29,888,941.28</b>			<b>-363,724,373.74</b>	<b>393,613,315.02</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	363,958.64	363,958.64
应付清算款	-	-	-	2,039,209.05	2,039,209.05
应付管理人报酬	-	-	-	328,679.11	328,679.11
应付托管费	-	-	-	65,735.80	65,735.80
应付销售服务费	-	-	-	31,243.28	31,243.28
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,173,288.46	1,173,288.46
<b>负债总计</b>				<b>4,002,114.34</b>	<b>4,002,114.34</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>29,888,941.28</b>			<b>-359,722,259.40</b>	<b>389,611,200.68</b>
<b>上年度末</b>					
<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
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	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>29,864,884.05</b>			<b>-397,446,430.89</b>	<b>427,311,314.94</b>
<b>负债</b>					
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
<b>负债总计</b>				<b>5,356,300.81</b>	<b>5,356,300.81</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>29,864,884.05</b>			<b>-392,090,130.08</b>	<b>421,955,014.13</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰

早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	361,439,787.58	92.77	394,437,291.82	93.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>361,439,787.58</b>	<b>92.77</b>	<b>394,437,291.82</b>	<b>93.48</b>

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。

##### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,877	增加约 1,918
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,877	减少约 1,918

#### 6.4.10 公允价值

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.10.2.1 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 2024年6月30日
第一层次	361,031,604.10
第二层次	45,611.11
第三层次	362,572.37
合计	361,439,787.58

###### 6.4.10.2.2 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。

##### 6.4.10.3 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。

##### 6.4.10.4 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。

#### 6.4.11 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	361,439,787.58	91.83
	其中：股票	361,439,787.58	91.83
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	29,825,607.49	7.58
8	其他各项资产	2,347,919.95	0.60
9	合计	393,613,315.02	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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	1,671,388.00	0.43
B	采矿业	8,904,761.00	2.29
C	制造业	249,618,683.17	64.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,398,701.40	2.67
E	建筑业	6,412,274.00	1.65
F	批发和零售业	5,600,840.52	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	5,833,341.00	1.50
H	住宿和餐饮业	1,543,380.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,575,492.16	6.05
J	金融业	29,631,348.80	7.61
K	房地产业	3,895,560.00	1.00
L	租赁和商务服务业	1,467,354.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	672,979.93	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	5,678,627.60	1.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	335,110.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	6,199,946.00	1.59
S	综合	-	-
	合计	361,439,787.58	92.77

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300207	欣旺达	393,500	5,969,395.00	1.53
2	601717	郑煤机	382,200	5,656,560.00	1.45
3	002340	格林美	886,100	5,644,457.00	1.45
4	002008	大族激光	238,500	4,960,800.00	1.27
5	688029	南微医学	78,800	4,850,928.00	1.25
6	600038	中直股份	117,700	4,838,647.00	1.24
7	603228	景旺电子	149,080	4,740,744.00	1.22
8	300724	捷佳伟创	86,600	4,677,266.00	1.20
9	002558	巨人网络	487,200	4,599,168.00	1.18
10	601636	旗滨集团	688,900	4,443,405.00	1.14
11	002532	天山铝业	543,700	4,409,407.00	1.13
12	600707	彩虹股份	641,900	4,371,339.00	1.12
13	603160	汇顶科技	63,500	4,365,625.00	1.12
14	002557	洽洽食品	154,200	4,346,898.00	1.12
15	601198	东兴证券	543,800	4,328,648.00	1.11
16	601058	赛轮轮胎	304,100	4,257,400.00	1.09
17	000887	中鼎股份	346,500	4,241,160.00	1.09
18	688516	奥特维	101,418	4,240,286.58	1.09
19	300529	健帆生物	155,600	4,233,876.00	1.09
20	002984	森麒麟	169,900	4,092,891.00	1.05
21	600177	雅戈尔	560,900	3,993,608.00	1.03
22	300251	光线传媒	471,000	3,961,110.00	1.02
23	600839	四川长虹	872,600	3,917,974.00	1.01
24	603893	瑞芯微	63,300	3,745,461.00	0.96
25	000703	恒逸石化	523,700	3,713,033.00	0.95
26	600066	宇通客车	142,800	3,684,240.00	0.95
27	002958	青农商行	1,351,400	3,621,752.00	0.93
28	300253	卫宁健康	592,800	3,497,520.00	0.90
29	002019	亿帆医药	282,800	3,495,408.00	0.90
30	300070	碧水源	831,400	3,483,566.00	0.89

31	000563	陕国投 A	1,257,500	3,458,125.00	0.89
32	600339	中油工程	1,101,900	3,437,928.00	0.88
33	600521	华海药业	198,710	3,388,005.50	0.87
34	600315	上海家化	188,600	3,353,308.00	0.86
35	688281	华秦科技	40,199	3,349,380.68	0.86
36	600299	安迪苏	341,800	3,315,460.00	0.85
37	600517	国网英大	760,200	3,291,666.00	0.84
38	603786	科博达	51,100	3,278,065.00	0.84
39	002065	东华软件	708,000	3,200,160.00	0.82
40	002273	水晶光电	184,000	3,124,320.00	0.80
41	300383	光环新网	367,300	3,103,685.00	0.80
42	000883	湖北能源	494,100	2,969,541.00	0.76
43	600909	华安证券	690,800	2,908,268.00	0.75
44	000738	航发控制	137,300	2,755,611.00	0.71
45	000967	盈峰环境	632,600	2,675,898.00	0.69
46	300296	利亚德	572,900	2,578,050.00	0.66
47	601216	君正集团	661,300	2,440,197.00	0.63
48	001872	招商港口	125,000	2,406,250.00	0.62
49	002563	森马服饰	411,100	2,388,491.00	0.61
50	600699	均胜电子	158,400	2,347,488.00	0.60
51	601997	贵阳银行	427,100	2,250,817.00	0.58
52	688778	厦钨新能	71,400	2,230,536.00	0.57
53	002266	浙富控股	783,700	2,186,523.00	0.56
54	300054	鼎龙股份	88,400	2,004,912.00	0.51
55	300677	英科医疗	71,600	1,919,596.00	0.49
56	000060	中金岭南	443,300	1,879,592.00	0.48
57	000050	深天马 A	257,000	1,870,960.00	0.48
58	600399	抚顺特钢	329,300	1,853,959.00	0.48
59	000155	川能动力	170,600	1,837,362.00	0.47
60	002465	海格通信	177,200	1,835,792.00	0.47
61	000878	云南铜业	147,330	1,835,731.80	0.47
62	002507	涪陵榨菜	148,400	1,817,900.00	0.47
63	002215	诺普信	243,200	1,811,840.00	0.47
64	601168	西部矿业	100,600	1,805,770.00	0.46
65	600959	江苏有线	677,400	1,788,336.00	0.46
66	600928	西安银行	540,400	1,767,108.00	0.45
67	000728	国元证券	291,200	1,764,672.00	0.45
68	600582	天地科技	255,300	1,759,017.00	0.45
69	600282	南钢股份	352,000	1,752,960.00	0.45
70	600827	百联股份	235,500	1,737,990.00	0.45
71	000513	丽珠集团	46,600	1,733,986.00	0.45
72	688779	长远锂科	371,200	1,718,656.00	0.44
73	600737	中粮糖业	179,200	1,718,528.00	0.44

74	002683	广东宏大	84,500	1,700,985.00	0.44
75	600566	济川药业	52,600	1,667,946.00	0.43
76	600535	天士力	132,500	1,666,850.00	0.43
77	600208	新湖中宝	1,028,300	1,624,714.00	0.42
78	000156	华数传媒	257,700	1,618,356.00	0.42
79	601598	中国外运	286,100	1,610,743.00	0.41
80	601568	北元集团	433,640	1,608,804.40	0.41
81	601555	东吴证券	265,100	1,564,090.00	0.40
82	002408	齐翔腾达	274,680	1,538,208.00	0.39
83	601231	环旭电子	95,800	1,537,590.00	0.39
84	300307	慈星股份	256,300	1,524,985.00	0.39
85	002534	西子洁能	152,300	1,524,523.00	0.39
86	000758	中色股份	299,900	1,523,492.00	0.39
87	300428	立中集团	81,400	1,513,226.00	0.39
88	001206	依依股份	116,140	1,512,142.80	0.39
89	688616	西力科技	133,235	1,510,884.90	0.39
90	000990	诚志股份	202,400	1,505,856.00	0.39
91	300005	探路者	289,500	1,450,395.00	0.37
92	300396	迪瑞医疗	69,800	1,417,638.00	0.36
93	600901	江苏金租	276,640	1,397,032.00	0.36
94	300394	天孚通信	15,520	1,372,278.40	0.35
95	000825	太钢不锈	395,600	1,337,128.00	0.34
96	600867	通化东宝	152,200	1,273,914.00	0.33
97	000027	深圳能源	174,000	1,270,200.00	0.33
98	000932	华菱钢铁	284,500	1,260,335.00	0.32
99	002080	中材科技	97,600	1,259,040.00	0.32
100	300502	新易盛	11,900	1,256,045.00	0.32
101	300699	光威复材	48,607	1,206,911.81	0.31
102	600549	厦门钨业	65,500	1,129,875.00	0.29
103	601108	财通证券	167,780	1,109,025.80	0.28
104	688525	佰维存储	16,900	1,084,135.00	0.28
105	600863	内蒙华电	231,400	1,073,696.00	0.28
106	300474	景嘉微	16,900	1,068,587.00	0.27
107	600529	山东药玻	41,900	1,061,746.00	0.27
108	300595	欧普康视	67,300	1,055,264.00	0.27
109	600583	海油工程	175,200	1,035,432.00	0.27
110	600096	云天化	53,300	1,035,086.00	0.27
111	600380	健康元	92,300	1,030,991.00	0.26
112	600325	华发股份	158,300	1,028,950.00	0.26
113	002152	广电运通	96,400	1,008,344.00	0.26
114	002429	兆驰股份	209,500	1,007,695.00	0.26
115	601567	三星医疗	28,300	990,500.00	0.25
116	000818	航锦科技	44,600	984,768.00	0.25

117	000997	新大陆	68,900	958,399.00	0.25
118	600598	北大荒	76,700	957,983.00	0.25
119	300009	安科生物	111,880	955,455.20	0.25
120	600390	五矿资本	234,200	948,510.00	0.24
121	688234	天岳先进	19,821	930,001.32	0.24
122	600258	首旅酒店	73,800	911,430.00	0.23
123	300679	电连技术	22,600	909,198.00	0.23
124	002608	江苏国信	116,900	905,975.00	0.23
125	600848	上海临港	99,200	903,712.00	0.23
126	300390	天华新能	52,110	895,249.80	0.23
127	688425	铁建重工	242,669	893,021.92	0.23
128	600998	九州通	179,709	876,979.92	0.23
129	300002	神州泰岳	107,300	871,276.00	0.22
130	600170	上海建工	396,300	852,045.00	0.22
131	601000	唐山港	179,300	842,710.00	0.22
132	002384	东山精密	39,400	815,580.00	0.21
133	002140	东华科技	105,100	814,525.00	0.21
134	000630	铜陵有色	224,300	809,723.00	0.21
135	601298	青岛港	84,600	808,776.00	0.21
136	600210	紫江企业	151,000	803,320.00	0.21
137	601318	中国平安	19,300	798,248.00	0.20
138	600873	梅花生物	79,200	793,584.00	0.20
139	002519	银河电子	161,100	791,001.00	0.20
140	600801	华新水泥	57,200	786,500.00	0.20
141	000598	兴蓉环境	104,000	782,080.00	0.20
142	603897	长城科技	44,500	780,975.00	0.20
143	601991	大唐发电	258,600	778,386.00	0.20
144	300136	信维通信	39,400	771,452.00	0.20
145	300772	运达股份	78,700	755,520.00	0.19
146	600373	中文传媒	50,800	753,872.00	0.19
147	600820	隧道股份	115,200	752,256.00	0.19
148	600755	厦门国贸	104,300	747,831.00	0.19
149	600704	物产中大	172,000	746,480.00	0.19
150	000778	新兴铸管	213,400	742,632.00	0.19
151	601958	金钼股份	71,200	741,192.00	0.19
152	002064	华峰化学	103,300	740,661.00	0.19
153	002249	大洋电机	156,400	739,772.00	0.19
154	600511	国药股份	23,900	735,881.00	0.19
155	300088	长信科技	156,200	734,140.00	0.19
156	600637	东方明珠	120,300	731,424.00	0.19
157	000709	河钢股份	374,500	726,530.00	0.19
158	601019	山东出版	61,400	725,748.00	0.19
159	000559	万向钱潮	162,200	723,412.00	0.19

160	600499	科达制造	85,700	722,451.00	0.19
161	300146	汤臣倍健	53,200	720,860.00	0.19
162	600967	内蒙一机	100,000	720,000.00	0.18
163	001203	大中矿业	74,900	719,789.00	0.18
164	603927	中科软	39,780	719,620.20	0.18
165	000785	居然之家	296,100	719,523.00	0.18
166	600141	兴发集团	37,300	711,684.00	0.18
167	600062	华润双鹤	36,300	710,754.00	0.18
168	002195	岩山科技	282,900	710,079.00	0.18
169	000739	普洛药业	52,200	708,354.00	0.18
170	002572	索菲亚	46,100	706,713.00	0.18
171	600642	申能股份	79,800	704,634.00	0.18
172	000933	神火股份	34,600	699,958.00	0.18
173	002625	光启技术	40,200	697,470.00	0.18
174	603218	日月股份	67,600	694,252.00	0.18
175	002373	千方科技	76,300	692,041.00	0.18
176	688122	西部超导	18,000	689,760.00	0.18
177	688006	杭可科技	39,100	682,295.00	0.18
178	600872	中炬高新	30,000	680,700.00	0.17
179	603658	安图生物	14,700	677,229.00	0.17
180	002299	圣农发展	49,000	668,360.00	0.17
181	601127	赛力斯	7,300	665,176.00	0.17
182	688408	中信博	7,200	662,976.00	0.17
183	002430	杭氧股份	29,400	654,150.00	0.17
184	002315	焦点科技	23,900	644,344.00	0.17
185	600754	锦江酒店	27,500	631,950.00	0.16
186	688506	百利天恒	3,400	616,760.00	0.16
187	688819	天能股份	25,100	598,886.00	0.15
188	601666	平煤股份	52,300	585,760.00	0.15
189	002756	永兴材料	15,400	551,012.00	0.14
190	600985	淮北矿业	31,800	532,332.00	0.14
191	002161	远望谷	107,800	498,036.00	0.13
192	600916	中国黄金	51,100	491,582.00	0.13
193	688276	百克生物	17,230	488,815.10	0.13
194	300735	光弘科技	22,600	488,160.00	0.13
195	002414	高德红外	81,600	480,624.00	0.12
196	000032	深桑达 A	31,500	471,870.00	0.12
197	002462	嘉事堂	43,100	471,514.00	0.12
198	300144	宋城演艺	58,200	467,346.00	0.12
199	002078	太阳纸业	32,500	453,375.00	0.12
200	601952	苏垦农发	49,300	444,686.00	0.11
201	688571	杭华股份	80,100	423,729.00	0.11
202	688248	南网科技	13,811	409,219.93	0.11

203	002028	思源电气	6,100	408,090.00	0.10
204	300776	帝尔激光	8,300	381,468.00	0.10
205	002409	雅克科技	5,600	352,296.00	0.09
206	600895	张江高科	18,300	338,184.00	0.09
207	600763	通策医疗	6,200	335,110.00	0.09
208	000400	许继电气	9,600	330,336.00	0.08
209	000568	泸州老窖	2,200	315,678.00	0.08
210	603629	利通电子	16,200	299,052.00	0.08
211	601098	中南传媒	23,500	291,870.00	0.07
212	300017	网宿科技	36,800	290,720.00	0.07
213	688578	艾力斯	4,500	286,830.00	0.07
214	300857	协创数据	4,700	267,900.00	0.07
215	301308	江波龙	2,800	265,272.00	0.07
216	300492	华图山鼎	2,800	263,760.00	0.07
217	300820	英杰电气	6,700	263,578.00	0.07
218	600694	大商股份	14,560	244,753.60	0.06
219	000623	吉林敖东	17,800	238,520.00	0.06
220	600988	赤峰黄金	13,600	222,224.00	0.06
221	603345	安井食品	2,700	200,637.00	0.05
222	002138	顺络电子	6,900	189,474.00	0.05
223	601500	通用股份	35,300	188,502.00	0.05
224	002203	海亮股份	23,300	185,934.00	0.05
225	002939	长城证券	26,500	177,550.00	0.05
226	600887	伊利股份	6,400	165,376.00	0.04
227	002120	韵达股份	21,300	164,862.00	0.04
228	000550	江铃汽车	7,500	162,825.00	0.04
229	000921	海信家电	4,500	145,080.00	0.04
230	601615	明阳智能	14,300	134,992.00	0.03
231	300926	博俊科技	6,700	134,134.00	0.03
232	301589	诺瓦星云	711	133,675.11	0.03
233	600580	卧龙电驱	11,000	133,650.00	0.03
234	002318	久立特材	5,400	125,982.00	0.03
235	300441	鲍斯股份	20,200	119,786.00	0.03
236	688798	艾为电子	2,100	118,902.00	0.03
237	603939	益丰药房	4,800	117,840.00	0.03
238	688188	柏楚电子	600	110,730.00	0.03
239	001309	德明利	1,100	95,040.00	0.02
240	601163	三角轮胎	6,200	94,364.00	0.02
241	301015	百洋医药	4,000	94,120.00	0.02
242	688772	珠海冠宇	6,302	93,899.80	0.02
243	688036	传音控股	1,180	90,317.20	0.02
244	601665	齐鲁银行	18,100	88,871.00	0.02
245	688208	道通科技	3,486	84,152.04	0.02

246	600739	辽宁成大	10,000	83,700.00	0.02
247	603929	亚翔集成	3,500	83,650.00	0.02
248	600095	湘财股份	14,000	83,440.00	0.02
249	603156	养元饮品	3,500	74,445.00	0.02
250	688128	中国电研	4,300	74,003.00	0.02
251	600016	民生银行	19,400	73,526.00	0.02
252	603080	新疆火炬	5,300	71,338.00	0.02
253	002387	维信诺	8,200	49,856.00	0.01
254	301219	腾远钴业	1,300	49,738.00	0.01
255	601118	海南橡胶	9,900	45,045.00	0.01
256	688253	英诺特	1,000	38,110.00	0.01
257	689009	九号公司	800	29,448.00	0.01
258	002463	沪电股份	800	29,200.00	0.01
259	000975	银泰黄金	1,500	24,435.00	0.01
260	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
261	688692	达梦数据	133	23,265.69	0.01
262	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
263	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
264	300308	中际旭创	100	13,788.00	0.00
265	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
266	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
267	600497	驰宏锌锗	2,500	13,350.00	0.00
268	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
269	688709	成都华微	655	12,307.45	0.00
270	002023	海特高新	1,300	11,895.00	0.00
271	601138	工业富联	400	10,960.00	0.00
272	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
273	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
274	600482	中国动力	500	9,740.00	0.00
275	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
276	688584	上海合晶	571	9,073.19	0.00
277	601033	永兴股份	535	8,538.60	0.00
278	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
279	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
280	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
281	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
282	603341	龙旗科技	190	7,123.10	0.00
283	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
284	688478	晶升股份	200	5,824.00	0.00
285	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
286	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
287	600157	永泰能源	4,500	5,310.00	0.00
288	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00

289	002925	盈趣科技	400	5,068.00	0.00
290	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
291	603325	博隆技术	57	3,879.42	0.00
292	603381	永臻股份	154	3,870.02	0.00
293	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
294	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
295	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
296	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
297	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
298	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
299	002056	横店东磁	200	2,494.00	0.00
300	601966	玲珑轮胎	100	1,837.00	0.00
301	600171	上海贝岭	100	1,668.00	0.00
302	600372	中航机载	100	1,197.00	0.00
303	601016	节能风电	60	179.40	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600482	中国动力	10,752,032.89	2.55
2	002532	天山铝业	10,271,368.00	2.43
3	600038	中直股份	9,795,391.00	2.32
4	601717	郑煤机	9,671,710.33	2.29
5	300383	光环新网	9,666,632.00	2.29
6	603160	汇顶科技	9,588,450.00	2.27
7	601568	北元集团	8,933,052.50	2.12
8	688516	奥特维	8,839,775.90	2.09
9	600339	中油工程	8,833,736.00	2.09
10	300253	卫宁健康	8,702,285.54	2.06
11	002683	广东宏大	8,532,093.00	2.02
12	600166	福田汽车	8,106,017.00	1.92
13	603893	瑞芯微	8,100,641.00	1.92
14	600535	天士力	7,898,233.00	1.87
15	601058	赛轮轮胎	7,851,357.00	1.86
16	002563	森马服饰	7,801,746.00	1.85
17	002138	顺络电子	7,762,960.99	1.84
18	600066	宇通客车	7,592,930.00	1.80
19	601598	中国外运	7,572,595.00	1.79
20	002065	东华软件	7,567,864.00	1.79

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002138	顺络电子	12,167,407.51	2.88
2	600482	中国动力	11,602,891.00	2.75
3	601568	北元集团	11,585,371.80	2.75
4	600066	宇通客车	10,704,756.00	2.54
5	600582	天地科技	10,671,871.00	2.53
6	601958	金钼股份	9,531,212.16	2.26
7	002422	科伦药业	8,787,968.00	2.08
8	600166	福田汽车	8,704,102.00	2.06
9	002683	广东宏大	8,677,096.01	2.06
10	601608	中信重工	8,412,150.42	1.99
11	600339	中油工程	8,280,685.02	1.96
12	600038	中直股份	8,000,551.00	1.90
13	601058	赛轮轮胎	7,845,703.40	1.86
14	600739	辽宁成大	7,814,860.76	1.85
15	002563	森马服饰	7,556,893.00	1.79
16	688208	道通科技	7,534,158.08	1.79
17	600529	山东药玻	7,457,964.56	1.77
18	600704	物产中大	7,431,875.46	1.76
19	600968	海油发展	7,418,345.00	1.76
20	600497	驰宏锌锗	7,346,979.00	1.74

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,237,467,726.79
卖出股票的收入（成交）总额	1,252,090,242.91

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，深圳市景旺电子股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,333.79
2	应收清算款	1,948,979.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	335,606.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,347,919.95

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时中证 500 指数增强 A	16,640	15,930.63	14,108,579.02	5.32%	250,977,127.80	94.68%
博时中证 500 指数增强 C	11,614	7,339.84	101,713.02	0.12%	85,143,139.99	99.88%
合计	27,979	12,521.20	14,210,292.04	4.06%	336,120,267.79	95.94%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	博时中证 500 指数增强 A	204,478.35	0.08%
	博时中证 500 指数增强 C	134,700.96	0.16%
	合计	339,179.31	0.10%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时中证 500 指数增强 A	-
	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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 26 日）基金份额总额	383,128,088.40	-
本报告期期初基金份额总额	273,146,173.67	89,002,815.73
本报告期基金总申购份额	16,386,174.65	29,371,751.04
减：本报告期基金总赎回份额	24,446,641.50	33,129,713.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	265,085,706.82	85,244,853.01

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2024 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生任公司总经理。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	168,373,095.70	6.77%	125,591.09	6.77%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	31,243,220.62	1.26%	23,306.96	1.26%	增加 1 个
招商证券	5	565,271,200.54	22.72%	421,641.82	22.72%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	75,237,330.93	3.02%	56,119.58	3.02%	-

东吴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	497,309,927.96	19.99%	370,984.89	19.99%	-
中信证券	3	50,157,003.32	2.02%	37,412.81	2.02%	-
平安证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
海通证券	5	-	-	-	-	减少 1 个
华泰证券	3	105,934,695.07	4.26%	79,032.90	4.26%	-
方正证券	1	255,945,706.46	10.29%	190,912.10	10.29%	-
中信建投	1	24,144,776.91	0.97%	18,009.88	0.97%	-
长江证券	3	29,305,334.20	1.18%	21,859.14	1.18%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	61,669,681.95	2.48%	46,003.65	2.48%	-
广发证券	2	623,325,239.01	25.05%	465,016.07	25.06%	-
国新证券	2	-	-	-	-	-

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；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时中证 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	2024-06-26
2	博时中证 500 指数增强型证券投资基金（博时中证 500 指数增强 A）基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
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	2024-06-06
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	2024-05-25
5	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
6	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京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	2024-04-29
7	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上海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	2024-04-29
8	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 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	2024-04-22
9	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	2024-04-13

10	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 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	2024-03-29
11	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 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	2024-01-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，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  
二〇二四年八月三十日