

博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告 2024 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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。安永华明会计师事务所（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 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 审计报告	14
6.1 审计意见	14
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 其他信息	15
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	15
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	65
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	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
§10 开放式基金份额变动	67
§11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	博时中证 1000 指数增强	
基金主代码	016936	
交易代码	016936	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 13 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	277,474,689.33 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 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016936	016937
报告期末下属分级基金的份额总额	170,050,252.67 份	107,424,436.66 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数中证 1000 有效跟踪的基础上，力争实现超越基准的投资收益，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。</p> <p>基金管理人借鉴国际定量分析的经验，以对中国市场的长期研究为基础，综合来自公司财务报表、分析师预测和市场行情趋势等方面的信息，构建博时数量化模型。该模型从价值、成长、盈利、质量、行情趋势等方面，从长期和短期角度，对股票进行综合评估，得到股票未来回报能力的判断。投资经理以数量化模型为基础，根据自身经验对市场状况作出前瞻性判断，优化投资组合。基金管理人将根据历史回测数据和市场状况，对博时数量化模型进行检验和改进，力争保持模型的有效和稳定，为投资决策提供支持。</p> <p>本基金的其他投资策略还包括债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券的投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略等。</p>

业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 1000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	朱萍
	联系电话	0755-83169999	021-31888888
	电子邮箱	service@bosera.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		95105568	95528
传真		0755-83195140	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		518040	200126
法定代表人		江向阳	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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	2024 年	2023 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至
---------------	--------	---------------------------

			2023 年 12 月 31 日	
	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	19,926,399.33	19,383,469.52	-2,348,031.18	-1,369,124.75
本期利润	13,258,821.85	21,075,137.40	-3,993,552.35	-1,795,393.85
加权平均基金份额本期利润	0.1494	0.3058	-0.0401	-0.0421
本期加权平均净值利润率	15.37%	31.42%	-4.05%	-4.26%
本期基金份额净值增长率	16.12%	15.77%	-4.74%	-4.94%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C
期末可供分配利润	13,683,230.99	8,043,956.00	-3,591,369.15	-1,639,194.57
期末可供分配基金份额利润	0.0805	0.0749	-0.0474	-0.0494
期末基金资产净值	188,110,393.28	118,218,212.44	72,232,642.48	31,545,897.84
期末基金份额净值	1.1062	1.1005	0.9526	0.9506
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	10.62%	10.05%	-4.74%	-4.94%

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 1000 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	7.55%	2.13%	4.23%	2.28%	3.32%	-0.15%
过去六个月	24.74%	2.00%	20.68%	2.13%	4.06%	-0.13%
过去一年	16.12%	1.95%	1.41%	2.01%	14.71%	-0.06%
自基金合同生效起至今	10.62%	1.57%	-14.17%	1.64%	24.79%	-0.07%

2. 博时中证 1000 指数增强 C:

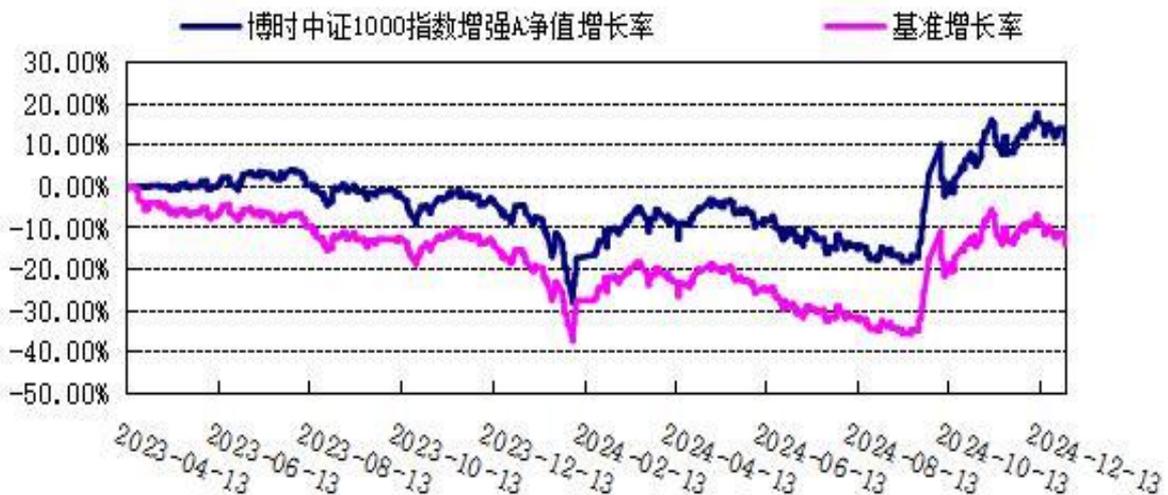
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.47%	2.13%	4.23%	2.28%	3.24%	-0.15%
过去六个月	24.56%	2.00%	20.68%	2.13%	3.88%	-0.13%
过去一年	15.77%	1.94%	1.41%	2.01%	14.36%	-0.07%
自基金合同生效起至今	10.05%	1.57%	-14.17%	1.64%	24.22%	-0.07%

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

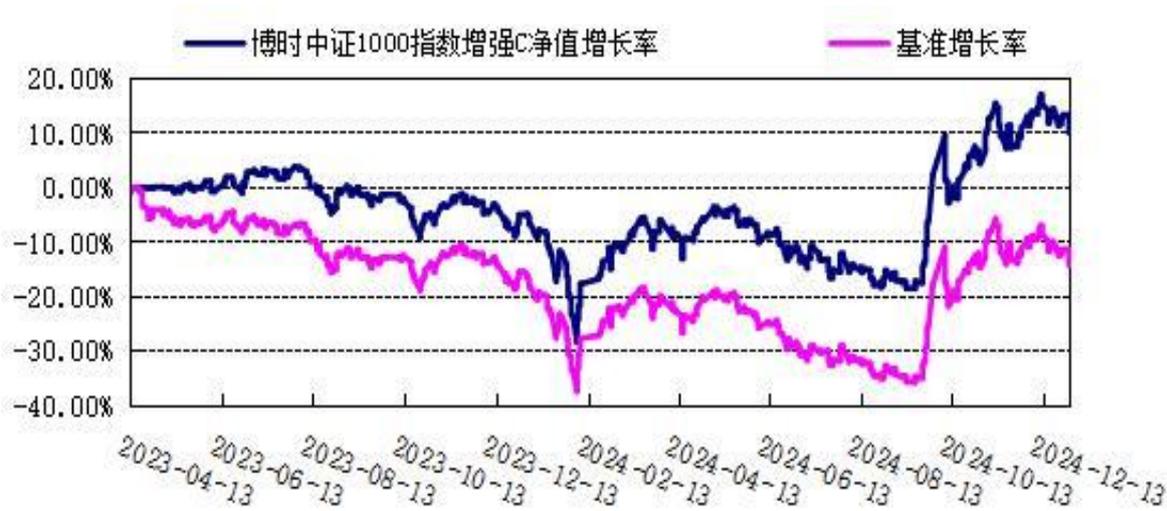
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 4 月 13 日至 2024 年 12 月 31 日)

1、博时中证 1000 指数增强 A



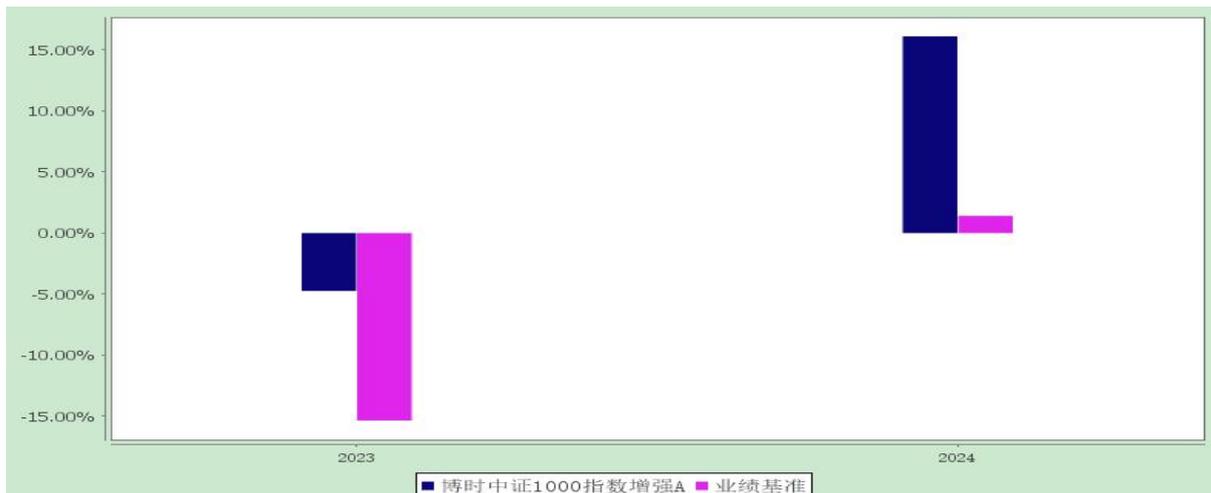
2、博时中证 1000 指数增强 C



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

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时中证 1000 指数增强 A



2、博时中证 1000 指数增强 C



注：本基金的基金合同于 2023 年 4 月 13 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 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 16089 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 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 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

12 月，国家开发银行授予博时基金“优秀投资机构合作奖”，表彰公司在国家开发银行 2024 年银行间市场金融债券投资工作中表现突出。

11 月，深证投资者服务中心联合全景投教基地召开《股东来了》（2024）投资者权益知识竞赛深圳片区总结交流会，授予博时基金《股东来了》（2024）深圳片区突出贡献团体奖。

10 月，中国人民银行 2023 年度金融科技发展奖获奖项目名单出炉，博时基金“新一代资管业务资金清算系统”荣获三等奖。

4 月，深圳市人工智能学会公布 2023 年度第三届“深圳人工智能奖”获奖名单，博时基金“智能量化因子投研系统”荣获人工智能行业应用奖。

1 月，中国人民银行公布 2022 年度金融科技发展奖获奖项目名单，博时基金“陪伴服务平台项目”荣获三等奖。

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		
桂征辉	指数与量化投	2023-04-13	-	15.3	桂征辉先生，硕士。2006 年起先

	资部投资副 监/基金经理			后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2020 年 12 月 23 日)、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日-2024 年 7 月 5 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)、博时中证 1000 指数增强型证券投资基金(2023 年 4 月 13 日—至今)、博时恒享债券型证券投资基金(2023 年 9 月 26 日—至今)、博时恒鑫稳健一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时中证 A50 指数型发起式证券投资基金(2024 年 8 月 27 日—至今)的基金经理。
--	-----------------	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 132 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 A 股市场整体呈现“先抑后扬”的走势，市场活跃度显著提升。9 月底开始，受一揽子政策利好刺激，市场信心修复，指数大幅反弹，沪深两市成交额显著放大。从指数表现来看，大盘股指数如沪深 300 指数，科创 50，上证指数等涨幅均超 10%。行业方面，银行、非银金融等红利板块表现突出，通信、电子等科技板块也跑出明显超额收益。

报告期内，本基金采用量化投资策略，通过量化模型对组合进行精细化管理，适当控制控制与指数的跟踪误差，精选个股，优化投资组合，在 2024 年度实现了超越基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1062 元，份额累计净值为 1.1062 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1005 元，份额累计净值为 1.1005 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 16.12%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 15.77%，同期业绩基准增长率为 1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年，国内经济有望在政策支持下延续弱复苏态势，消费温和增长，制造业投资企稳，但出口有可能所波动。财政政策和货币政策的协同发力将为市场提供流动性支持。经过去年的国债收益率大幅下行，当前股票市场整体估值水平处于历史上相对较低的位置，看好 A 股长期配置价值。中证 1000 指数作为反映中小市值公司表现的重要指标，其成分股大部分是新兴产业。在经济转型和产业升级，鼓励科技创新的背景下，人工智能，信息技术、生物医药、电子等领域的企业有望凭借新技术实现业绩快速增长。

基金管理人将继续优化量化模型，精选个股，把握市场结构性机会，力争为投资者创造超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，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。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《制度管理规范》、《合规管理制度》、《全面风险管理制度》、《内部稽核审计制度》、《投资者适当性管理制度》、《公募基金证券交易佣金分配管理办法》、《货币市场基金投资管理制度》、《对外信息发布管理制度》、《公募基金法定信息披露管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，完善“博时合规管理及审计系统”中制度库应用、合规报告生成等模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并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

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对博时中证 1000 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对博时中证 1000 指数增强型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由博时基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

安永华明（2025）审字第 70019484_A175 号

博时中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的博时中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

博时中证 1000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估博时中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督博时中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对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 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致博时中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。

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

我们与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。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

楼坚 朱燕

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2025 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 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日:2024 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产:			

货币资金	7.4.7.1	46,668,836.89	3,209,428.47
结算备付金		3,850,537.53	3,092,793.75
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	287,539,001.59	97,674,771.01
其中：股票投资		287,539,001.59	97,674,771.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,138,087.65	70,595.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		341,196,463.66	104,047,588.61
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		-	-
应付赎回款		34,431,121.75	142,588.63
应付管理人报酬		226,516.90	71,288.17
应付托管费		28,314.60	8,911.02
应付销售服务费		36,904.69	8,260.47
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	7.4.7.6	145,000.00	38,000.00
负债合计		34,867,857.94	269,048.29
净资产：			

实收基金	7.4.7.7	277,474,689.33	109,009,104.04
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	28,853,916.39	-5,230,563.72
净资产合计		306,328,605.72	103,778,540.32
负债和净资产总计		341,196,463.66	104,047,588.61

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 277,474,689.33 份。其中 A 类基金份额净值 1.1062 元，基金份额总额 170,050,252.67 份；C 类基金份额净值 1.1005 元，基金份额总额 107,424,436.66 份。

7.2 利润表

会计主体：博时中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 13 日(基金 合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		36,047,343.98	-4,732,004.41
1.利息收入		41,103.80	202,289.91
其中：存款利息收入	7.4.7.9	41,103.80	90,701.49
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		-	111,588.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,847,241.81	-2,871,750.21
其中：股票投资收益	7.4.7.10	39,101,630.53	-5,539,267.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,060.81	32,398.26
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	193,891.99
股利收益	7.4.7.14	1,744,550.47	2,441,226.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-4,975,909.60	-2,071,790.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	134,907.97	9,246.16
减：二、营业总支出		1,713,384.73	1,056,941.79
1. 管理人报酬		1,213,622.19	818,400.69
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-

2. 托管费		151,702.75	102,300.10
3. 销售服务费		199,626.28	92,376.00
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	703.00
8. 其他费用	7.4.7.18	148,433.51	43,162.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,333,959.25	-5,788,946.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,333,959.25	-5,788,946.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,333,959.25	-5,788,946.20

7.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	109,009,104.04	-5,230,563.72	103,778,540.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	109,009,104.04	-5,230,563.72	103,778,540.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	168,465,585.29	34,084,480.11	202,550,065.40
（一）、综合收益总额	-	34,333,959.25	34,333,959.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	168,465,585.29	-249,479.14	168,216,106.15
其中：1.基金申购款	514,307,799.13	23,097,606.29	537,405,405.42

2.基金赎回款	-345,842,213.84	-23,347,085.43	-369,189,299.27
(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	277,474,689.33	28,853,916.39	306,328,605.72
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 13 日 (基金合同生效日) 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	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	280,277,081.15	-	280,277,081.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-171,267,977.11	-5,230,563.72	-176,498,540.83
(一)、综合收益总额	-	-5,788,946.20	-5,788,946.20
(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)	-171,267,977.11	558,382.48	-170,709,594.63
其中: 1.基金申购款	116,877,108.96	-1,335,262.97	115,541,845.99
2.基金赎回款	-288,145,086.07	1,893,645.45	-286,251,440.62
(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	109,009,104.04	-5,230,563.72	103,778,540.32
-----------	----------------	---------------	----------------

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：王德英，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 1000 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[2022]2217 号核准，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 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 280,250,759.11 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 60669135_A06 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 280,277,081.15 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,322.04 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《博时中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证），为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会部分投资于依法发行上市的非成份股（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）、债券回购、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）以及法律法规或中国证监会允

许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：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%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债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% 的现金或者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、存出保证金和应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产

或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

(2)不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策

的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
活期存款	46,668,836.89	3,209,428.47
等于：本金	46,666,283.84	3,209,066.56
加：应计利息	2,553.05	361.91
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	46,668,836.89	3,209,428.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	294,586,701.46	-	287,539,001.59	-7,047,699.87
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	294,586,701.46	-	287,539,001.59	-7,047,699.87
项目	上年度末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	99,746,561.28	-	97,674,771.01	-2,071,790.27
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		99,746,561.28	-	97,674,771.01	-2,071,790.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	145,000.00	38,000.00
合计	145,000.00	38,000.00

7.4.7.7 实收基金

博时中证 1000 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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	75,824,011.63	75,824,011.63
本期申购	200,848,047.79	200,848,047.79
本期赎回（以“-”号填列）	-106,621,806.75	-106,621,806.75

本期末	170,050,252.67	170,050,252.67
-----	----------------	----------------

博时中证 1000 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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	33,185,092.41	33,185,092.41
本期申购	313,459,751.34	313,459,751.34
本期赎回（以“-”号填列）	-239,220,407.09	-239,220,407.09
本期末	107,424,436.66	107,424,436.66

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转出、级别调整出份额(如适用)。

7.4.7.8 未分配利润
博时中证 1000 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	-2,994,476.72	-596,892.43	-3,591,369.15
本期期初	-2,994,476.72	-596,892.43	-3,591,369.15
本期利润	19,926,399.33	-6,667,577.48	13,258,821.85
本期基金份额交易产生的变动数	-3,248,691.62	11,641,379.53	8,392,687.91
其中：基金申购款	-7,316,870.43	20,674,715.42	13,357,844.99
基金赎回款	4,068,178.81	-9,033,335.89	-4,965,157.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,683,230.99	4,376,909.62	18,060,140.61

博时中证 1000 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	-1,377,425.35	-261,769.22	-1,639,194.57
本期期初	-1,377,425.35	-261,769.22	-1,639,194.57
本期利润	19,383,469.52	1,691,667.88	21,075,137.40
本期基金份额交易产生的变动数	-9,962,088.17	1,319,921.12	-8,642,167.05
其中：基金申购款	-12,030,724.81	21,770,486.11	9,739,761.30
基金赎回款	2,068,636.64	-20,450,564.99	-18,381,928.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,043,956.00	2,749,819.78	10,793,775.78

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	23,192.17	50,990.89
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	17,651.41	39,710.60
其他	260.22	-
合计	41,103.80	90,701.49

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,056,906,688.67	444,301,353.39
减：卖出股票成本总额	1,016,332,790.23	448,653,768.92
减：交易费用	1,472,267.91	1,186,851.50
买卖股票差价收入	39,101,630.53	-5,539,267.03

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	1,417.81	2,847.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-357.00	29,550.83
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	1,060.81	32,398.26

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	102,300.00	2,345,913.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,356.00	2,276,110.00
减：应计利息总额	2,300.00	40,241.88

减：交易费用	1.00	10.72
买卖债券差价收入	-357.00	29,550.83

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-	193,891.99

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,744,550.47	2,441,226.57
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	1,744,550.47	2,441,226.57

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-4,975,909.60	-2,071,790.27
——股票投资	-4,975,909.60	-2,071,790.27
——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	-4,975,909.60	-2,071,790.27

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年4月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	113,821.65	9,246.16
基金转换费收入	21,086.32	-
合计	134,907.97	9,246.16

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年4月13日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	25,000.00	38,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,433.51	4,762.00
其他	-	400.00
合计	148,433.51	43,162.00

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人

招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

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

2.经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议，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。经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。于 2024 年 12 月 24 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，上述股东变更完成后，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% 和浙江省国际贸易集团有限公司 2%。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,213,622.19	818,400.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	476,714.48	387,134.55
应支付基金管理人的净管理费	736,907.71	431,266.14

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 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	151,702.75	102,300.10

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C	合计
招商证券	-	367.27	367.27
浦发银行	-	3,094.92	3,094.92
博时基金	-	8,240.45	8,240.45
博时财富	-	109.71	109.71
合计	-	11,812.35	11,812.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）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 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C	合计
招商证券	-	3,434.03	3,434.03
博时财富	-	2,122.12	2,122.12
浦发银行	-	706.44	706.44
博时基金	-	35.19	35.19
合计	-	6,297.78	6,297.78

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 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况
7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 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
浦发银行-活期存款	46,668,836.89	23,192.17	3,209,428.47	50,990.89

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301631	壹连科技	网下发行	745.00	54,377.55
上年度可比期间 2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）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
-	-	-	-	-	-

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（2024 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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月	首次公开发行限售	21.23	65.78	658.00	13,969.34	43,283.24	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6个月	首次公开发行限售	11.25	29.44	1,004.00	11,295.00	29,557.76	-
603072	天和磁材	2024-12-24	7个交易日	新股未上市	12.30	12.30	2,029.00	24,956.70	24,956.70	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月	首次公开发行限售	9.40	43.23	576.00	5,414.40	24,900.48	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6个月	首次公开发行限售	27.08	48.95	442.00	11,969.36	21,635.90	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6个月	首次公开发行限售	8.00	56.10	380.00	3,040.00	21,318.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月	首次公开发行限售	17.58	33.06	625.00	10,987.50	20,662.50	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6个月	首次公开发行限售	7.16	15.44	1,226.00	8,778.16	18,929.44	-
301556	托普云农	2024-10-10	6个月	首次公开发行限售	14.50	59.05	267.00	3,871.50	15,766.35	-
001391	国货航	2024-12-23	6个月	首次公开发行	2.30	6.80	2,302.00	5,294.60	15,653.60	-

				限售						
301622	英思特	2024-11-26	6个月	首次公开发行限售	22.36	44.92	306.00	6,842.16	13,745.52	-
301522	上大股份	2024-10-09	6个月	首次公开发行限售	6.88	24.84	511.00	3,515.68	12,693.24	-
301571	国科天成	2024-08-14	6个月	首次公开发行限售	11.14	40.83	258.00	2,874.12	10,534.14	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月	首次公开发行限售	18.09	53.14	193.00	3,491.37	10,256.02	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6个月	首次公开发行限售	27.76	39.79	238.00	6,606.88	9,470.02	-
301607	富特科技	2024-08-28	6个月	首次公开发行限售	14.00	36.14	254.00	3,556.00	9,179.56	-
301631	壹连科技	2024-11-12	6个月	首次公开发行限售	72.99	101.96	75.00	5,474.25	7,647.00	-
001279	强邦新材	2024-09-27	6个月	首次公开发行限售	9.68	27.91	265.00	2,565.20	7,396.15	-
603194	中力股份	2024-12-17	6个月	首次公开发行限售	20.32	28.13	228.00	4,632.96	6,413.64	-
603395	红四方	2024-11-19	6个月	首次公开发行限售	7.98	35.77	154.00	1,228.92	5,508.58	-
301608	博实结	2024-07-25	6个月	首次公开发行	44.50	65.38	62.00	2,759.00	4,053.56	-

				限售						
603205	健尔康	2024-10-29	6个月	首次公开发行限售	14.65	27.35	128.00	1,875.20	3,500.80	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	首次公开发行限售	12.30	12.30	226.00	2,779.80	2,779.80	-

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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，跟踪中证 1000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。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

主要目标是本基金通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数中证 1000 有效跟踪的基础上，力争实现超越基准的投资收益，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%。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	46,668,836.89	-	-	-	46,668,836.89
结算备付金	3,850,537.53	-	-	-	3,850,537.53
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	287,539,001.59	287,539,001.59
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,138,087.65	3,138,087.65
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	50,519,374.42	-	-	290,677,089.24	341,196,463.66
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	34,431,121.75	34,431,121.75
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	226,516.90	226,516.90
应付托管费	-	-	-	28,314.60	28,314.60
应付销售服务费	-	-	-	36,904.69	36,904.69
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	145,000.00	145,000.00
负债总计	-	-	-	34,867,857.94	34,867,857.94
利率敏感度缺口	50,519,374.42	-	-	255,809,231.30	306,328,605.72
上年度末					
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	3,209,428.47	-	-	-	3,209,428.47
结算备付金	3,092,793.75	-	-	-	3,092,793.75
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	97,674,771.01	97,674,771.01
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	70,595.38	70,595.38
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,302,222.22	-	-	97,745,366.39	104,047,588.61
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	142,588.63	142,588.63
应付清算款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	71,288.17	71,288.17
应付托管费	-	-	8,911.02	8,911.02
应付销售服务费	-	-	8,260.47	8,260.47
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	38,000.00	38,000.00
负债总计	-	-	269,048.29	269,048.29
利率敏感度缺口	6,302,222.22	-	97,476,318.10	103,778,540.32

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 2024 年 12 月 31 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	287,539,001.59	93.87	97,674,771.01	94.12
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	287,539,001.59	93.87	97,674,771.01	94.12

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,516	增加约 513
业绩比较基准下降 5%	减少约 1,516	减少约 513	

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	287,199,159.59	97,613,364.71
第二层次	27,736.50	-
第三层次	312,105.50	61,406.30
合计	287,539,001.59	97,674,771.01

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	61,406.30	61,406.30
当期购买	-	120,041.60	120,041.60
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	56,224.49	56,224.49
当期利得或损失总额	-	186,882.09	186,882.09
其中：计入损益的利得或损失	-	186,882.09	186,882.09
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	312,105.50	312,105.50
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	-	192,063.90	192,063.90
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 13 日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	52,579.62	52,579.62
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	-	8,826.68	8,826.68
其中：计入损益的利得或损失	-	8,826.68	8,826.68
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	61,406.30	61,406.30
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	-	8,826.68	8,826.68

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	312,105.50	平均价格亚式期权模型	预期波动率	46.07%-574.44%	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	61,406.30	平均价格亚式期权模型	预期波动率	19.62%-217.52%	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	287,539,001.59	84.27
	其中：股票	287,539,001.59	84.27
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	50,519,374.42	14.81
8	其他各项资产	3,138,087.65	0.92
9	合计	341,196,463.66	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	3,456,660.00	1.13
B	采矿业	4,688,520.00	1.53
C	制造业	193,553,951.15	63.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,476,869.00	1.14
E	建筑业	3,412,388.00	1.11
F	批发和零售业	8,256,793.00	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	6,946,601.60	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,949,716.90	13.69
J	金融业	2,845,963.00	0.93
K	房地产业	3,182,646.00	1.04
L	租赁和商务服务业	1,567,644.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	5,865,819.94	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	1,567,152.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,397,710.00	1.11
R	文化、体育和娱乐业	3,370,567.00	1.10
S	综合	-	-
	合计	287,539,001.59	93.87

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	000528	柳工	211790	2,554,187.40	0.83
2	002706	良信股份	310700	2,386,176.00	0.78
3	600602	云赛智联	150300	2,377,746.00	0.78
4	600718	东软集团	217500	2,342,475.00	0.76
5	002139	拓邦股份	168600	2,294,646.00	0.75
6	688347	华虹公司	44900	2,086,503.00	0.68

7	603766	隆鑫通用	224000	2,038,400.00	0.67
8	300035	中科电气	135700	2,028,715.00	0.66
9	300232	洲明科技	293500	2,016,345.00	0.66
10	600216	浙江医药	126500	2,006,290.00	0.65
11	301078	孩子王	175500	1,997,190.00	0.65
12	000682	东方电子	186000	1,992,060.00	0.65
13	300115	长盈精密	122300	1,986,152.00	0.65
14	688007	光峰科技	133306	1,971,595.74	0.64
15	603236	移远通信	28800	1,971,072.00	0.64
16	300623	捷捷微电	57700	1,971,032.00	0.64
17	002745	木林森	226000	1,970,720.00	0.64
18	002396	星网锐捷	103400	1,963,566.00	0.64
19	300570	太辰光	27000	1,962,900.00	0.64
20	002705	新宝股份	129800	1,947,000.00	0.64
21	300083	创世纪	297800	1,938,678.00	0.63
22	300827	上能电气	44000	1,931,600.00	0.63
23	002249	大洋电机	328900	1,930,643.00	0.63
24	300674	宇信科技	98700	1,926,624.00	0.63
25	002036	联创电子	203535	1,913,229.00	0.62
26	300438	鹏辉能源	67600	1,900,236.00	0.62
27	300181	佐力药业	123300	1,893,888.00	0.62
28	603612	索通发展	140100	1,892,751.00	0.62
29	002906	华阳集团	61400	1,888,050.00	0.62
30	300101	振芯科技	87000	1,884,420.00	0.62
31	600552	凯盛科技	164100	1,872,381.00	0.61
32	600269	赣粤高速	332700	1,866,447.00	0.61
33	002550	千红制药	297300	1,843,260.00	0.60
34	600428	中远海特	250800	1,830,840.00	0.60
35	300772	运达股份	138248	1,830,403.52	0.60
36	301039	中集车辆	201200	1,820,860.00	0.59
37	300682	朗新集团	149000	1,817,800.00	0.59
38	601369	陕鼓动力	207600	1,806,120.00	0.59
39	603118	共进股份	202600	1,803,140.00	0.59
40	300170	汉得信息	145300	1,801,720.00	0.59
41	688183	生益电子	45729	1,795,320.54	0.59
42	300180	华峰超纤	284600	1,792,980.00	0.59
43	688313	仕佳光子	109240	1,790,443.60	0.58
44	300151	昌红科技	104900	1,783,300.00	0.58
45	301050	雷电微力	34500	1,779,510.00	0.58
46	003006	百亚股份	74100	1,777,659.00	0.58
47	600572	康恩贝	380700	1,774,062.00	0.58
48	600645	中源协和	91900	1,773,670.00	0.58
49	002567	唐人神	347000	1,769,700.00	0.58

50	601137	博威合金	86800	1,762,040.00	0.58
51	688409	富创精密	34100	1,758,537.00	0.57
52	000686	东北证券	220700	1,752,358.00	0.57
53	300850	新强联	91400	1,746,654.00	0.57
54	002100	天康生物	265700	1,740,335.00	0.57
55	688019	安集科技	12481	1,739,352.16	0.57
56	002649	博彦科技	143200	1,735,584.00	0.57
57	000603	盛达资源	144100	1,727,759.00	0.56
58	601886	江河集团	319900	1,727,460.00	0.56
59	688798	艾为电子	24600	1,717,572.00	0.56
60	600531	豫光金铅	267000	1,714,140.00	0.56
61	300244	迪安诊断	150600	1,709,310.00	0.56
62	300433	蓝思科技	78000	1,708,200.00	0.56
63	002237	恒邦股份	168700	1,703,870.00	0.56
64	002461	珠江啤酒	172000	1,701,080.00	0.56
65	600267	海正药业	204101	1,694,038.30	0.55
66	002446	盛路通信	258600	1,693,830.00	0.55
67	301239	普瑞眼科	36000	1,688,400.00	0.55
68	600248	陕建股份	376100	1,684,928.00	0.55
69	000156	华数传媒	233900	1,684,080.00	0.55
70	600266	城建发展	329200	1,678,920.00	0.55
71	002043	兔宝宝	141200	1,677,456.00	0.55
72	601126	四方股份	98500	1,670,560.00	0.55
73	000030	富奥股份	324900	1,666,737.00	0.54
74	300303	聚飞光电	244300	1,666,126.00	0.54
75	688362	甬矽电子	49255	1,658,908.40	0.54
76	002483	润邦股份	318000	1,656,780.00	0.54
77	600420	国药现代	138600	1,654,884.00	0.54
78	002212	天融信	255600	1,648,620.00	0.54
79	688372	伟测科技	28152	1,647,455.04	0.54
80	688066	航天宏图	80505	1,642,302.00	0.54
81	002697	红旗连锁	277700	1,641,207.00	0.54
82	603383	顶点软件	43700	1,638,750.00	0.53
83	601801	皖新传媒	222700	1,634,618.00	0.53
84	300363	博腾股份	103300	1,629,041.00	0.53
85	300967	晓鸣股份	138500	1,627,375.00	0.53
86	603162	海通发展	176500	1,623,800.00	0.53
87	688348	昱能科技	33266	1,623,380.80	0.53
88	688337	普源精电	41590	1,622,010.00	0.53
89	002967	广电计量	98700	1,618,680.00	0.53
90	002003	伟星股份	114000	1,615,380.00	0.53
91	000672	上峰水泥	211100	1,614,915.00	0.53
92	605507	国邦医药	77500	1,614,325.00	0.53

93	002852	道道全	195000	1,610,700.00	0.53
94	600037	歌华有线	215200	1,605,392.00	0.52
95	688550	瑞联新材	51284	1,604,676.36	0.52
96	300602	飞荣达	83400	1,602,948.00	0.52
97	600640	国脉文化	133900	1,598,766.00	0.52
98	000550	江铃汽车	68000	1,594,600.00	0.52
99	601083	锦江航运	167400	1,593,648.00	0.52
100	000725	京东方 A	362500	1,591,375.00	0.52
101	600648	外高桥	133400	1,588,794.00	0.52
102	301090	华润材料	228900	1,588,566.00	0.52
103	600869	远东股份	334400	1,588,400.00	0.52
104	600710	苏美达	169700	1,578,210.00	0.52
105	002777	久远银海	91600	1,577,352.00	0.51
106	603132	金徽股份	140200	1,574,446.00	0.51
107	600662	外服控股	309200	1,567,644.00	0.51
108	601096	宏盛华源	360200	1,566,870.00	0.51
109	688083	中望软件	18279	1,564,134.03	0.51
110	688772	珠海冠宇	97050	1,560,564.00	0.51
111	300132	青松股份	316000	1,557,880.00	0.51
112	600320	振华重工	396200	1,553,104.00	0.51
113	002651	利君股份	211500	1,550,295.00	0.51
114	002716	湖南白银	457200	1,549,908.00	0.51
115	301327	华宝新能	20100	1,541,871.00	0.50
116	600633	浙数文化	147300	1,540,758.00	0.50
117	001322	箭牌家居	190300	1,539,527.00	0.50
118	002023	海特高新	151500	1,537,725.00	0.50
119	001328	登康口腔	48300	1,534,008.00	0.50
120	300752	隆利科技	90200	1,533,400.00	0.50
121	300972	万辰集团	19000	1,527,790.00	0.50
122	002020	京新药业	119000	1,523,200.00	0.50
123	300207	欣旺达	68200	1,521,542.00	0.50
124	002970	锐明技术	31900	1,519,397.00	0.50
125	600780	通宝能源	269200	1,515,596.00	0.49
126	300564	筑博设计	122500	1,514,100.00	0.49
127	301025	读客文化	158800	1,513,364.00	0.49
128	301180	万祥科技	97800	1,512,966.00	0.49
129	002226	江南化工	278900	1,511,638.00	0.49
130	002214	大立科技	135500	1,510,825.00	0.49
131	300770	新媒股份	37100	1,499,211.00	0.49
132	301326	捷邦科技	20500	1,498,550.00	0.49
133	300533	冰川网络	75500	1,491,880.00	0.49
134	688326	经纬恒润	17594	1,479,655.40	0.48
135	301175	中科环保	272100	1,469,340.00	0.48

136	601116	三江购物	133400	1,451,392.00	0.47
137	603876	鼎胜新材	163900	1,450,515.00	0.47
138	003015	日久光电	101300	1,449,603.00	0.47
139	600665	天地源	462800	1,448,564.00	0.47
140	600623	华谊集团	205400	1,437,800.00	0.47
141	301500	飞南资源	78600	1,414,800.00	0.46
142	603888	新华网	62900	1,405,186.00	0.46
143	002539	云图控股	178600	1,396,652.00	0.46
144	688392	骄成超声	34191	1,394,992.80	0.46
145	600301	华锡有色	81500	1,386,315.00	0.45
146	300549	优德精密	84100	1,377,558.00	0.45
147	300684	中石科技	61200	1,372,716.00	0.45
148	688588	凌志软件	99263	1,369,829.40	0.45
149	600096	云天化	59900	1,335,770.00	0.44
150	300502	新易盛	11400	1,317,612.00	0.43
151	600452	涪陵电力	123700	1,309,983.00	0.43
152	300705	九典制药	68500	1,229,575.00	0.40
153	002250	联化科技	208500	1,148,835.00	0.38
154	688658	悦康药业	78158	1,126,256.78	0.37
155	300088	长信科技	169000	1,105,260.00	0.36
156	605376	博迁新材	37900	1,097,205.00	0.36
157	688131	皓元医药	29917	1,068,036.90	0.35
158	688200	华峰测控	9800	1,024,100.00	0.33
159	000970	中科三环	95100	986,187.00	0.32
160	603566	普莱柯	77100	983,796.00	0.32
161	601311	骆驼股份	111600	925,164.00	0.30
162	300366	创意信息	96700	899,310.00	0.29
163	000039	中集集团	114500	889,665.00	0.29
164	000680	山推股份	89900	872,030.00	0.28
165	300283	温州宏丰	151100	829,539.00	0.27
166	002204	大连重工	137600	685,248.00	0.22
167	601528	瑞丰银行	117900	663,777.00	0.22
168	300415	伊之密	32800	657,968.00	0.21
169	300079	数码视讯	117000	632,970.00	0.21
170	002206	海利得	146000	626,340.00	0.20
171	601222	林洋能源	86800	613,676.00	0.20
172	600050	中国联通	114500	607,995.00	0.20
173	603386	骏亚科技	53000	589,360.00	0.19
174	603171	税友股份	17100	521,550.00	0.17
175	688336	三生国健	22750	487,305.00	0.16
176	300579	数字认证	14500	455,590.00	0.15
177	601728	中国电信	62500	451,250.00	0.15
178	002202	金风科技	41600	429,728.00	0.14

179	600969	郴电国际	66200	425,666.00	0.14
180	603538	美诺华	31500	400,365.00	0.13
181	300627	华测导航	8900	372,020.00	0.12
182	002558	巨人网络	27900	354,051.00	0.12
183	300638	广和通	15000	302,250.00	0.10
184	002315	焦点科技	6800	283,424.00	0.09
185	002585	双星新材	46800	249,912.00	0.08
186	688206	概伦电子	12770	241,480.70	0.08
187	002479	富春环保	47600	225,624.00	0.07
188	601999	出版传媒	35500	222,585.00	0.07
189	603881	数据港	9800	221,970.00	0.07
190	300618	寒锐钴业	6500	219,505.00	0.07
191	002130	沃尔核材	8500	214,625.00	0.07
192	600268	国电南自	29600	198,912.00	0.06
193	002825	纳尔股份	23300	182,206.00	0.06
194	603811	诚意药业	23300	179,876.00	0.06
195	688663	新风光	8200	178,022.00	0.06
196	002909	集泰股份	34700	172,459.00	0.06
197	002871	伟隆股份	17000	164,730.00	0.05
198	002164	宁波东力	32600	163,326.00	0.05
199	300761	立华股份	8200	159,572.00	0.05
200	301332	德尔玛	15000	150,300.00	0.05
201	301158	德石股份	10700	150,121.00	0.05
202	002991	甘源食品	1600	149,632.00	0.05
203	601319	中国人保	19300	147,066.00	0.05
204	001380	华纬科技	6700	146,730.00	0.05
205	688005	容百科技	4600	145,130.00	0.05
206	002073	软控股份	17400	143,724.00	0.05
207	600419	天润乳业	15400	143,374.00	0.05
208	688468	科美诊断	20900	143,165.00	0.05
209	688387	信科移动	24000	143,040.00	0.05
210	000166	申万宏源	26700	142,845.00	0.05
211	603680	今创集团	17100	141,930.00	0.05
212	300511	雪榕生物	40900	141,923.00	0.05
213	002801	微光股份	5800	141,868.00	0.05
214	300987	川网传媒	10000	141,600.00	0.05
215	300281	金明精机	25200	140,868.00	0.05
216	300871	回盛生物	14000	140,840.00	0.05
217	300988	津荣天宇	7800	140,712.00	0.05
218	000404	长虹华意	19000	140,600.00	0.05
219	688280	精进电动	32000	140,480.00	0.05
220	300371	汇中股份	14600	140,014.00	0.05
221	300410	正业科技	26000	139,880.00	0.05

222	605058	澳弘电子	7000	138,810.00	0.05
223	600120	浙江东方	29100	135,606.00	0.04
224	601827	三峰环境	11400	97,812.00	0.03
225	301112	信邦智能	4000	93,480.00	0.03
226	002534	西子洁能	6800	75,548.00	0.02
227	600366	宁波韵升	9700	71,392.00	0.02
228	600684	珠江股份	16200	53,460.00	0.02
229	301626	苏州天脉	658	43,283.24	0.01
230	300462	华铭智能	4800	42,816.00	0.01
231	688128	中国电研	1963	41,242.63	0.01
232	603609	禾丰股份	4700	40,514.00	0.01
233	301321	翰博高新	2600	37,440.00	0.01
234	688449	联芸科技	1004	29,557.76	0.01
235	688118	普元信息	1386	29,147.58	0.01
236	603072	天和磁材	2255	27,736.50	0.01
237	301551	无线传媒	576	24,900.48	0.01
238	688708	佳驰科技	442	21,635.90	0.01
239	301611	珂玛科技	380	21,318.00	0.01
240	688726	拉普拉斯	625	20,662.50	0.01
241	688750	金天钛业	1226	18,929.44	0.01
242	601107	四川成渝	3100	16,213.00	0.01
243	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
244	001391	国货航	2302	15,653.60	0.01
245	002811	郑中设计	1800	15,426.00	0.01
246	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
247	301522	上大股份	511	12,693.24	0.00
248	301571	国科天成	258	10,534.14	0.00
249	301586	佳力奇	193	10,256.02	0.00
250	301617	博苑股份	238	9,470.02	0.00
251	301607	富特科技	254	9,179.56	0.00
252	688591	泰凌微	265	8,321.00	0.00
253	688023	安恒信息	197	8,037.60	0.00
254	301631	壹连科技	75	7,647.00	0.00
255	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
256	001283	豪鹏科技	119	6,888.91	0.00
257	603194	中力股份	228	6,413.64	0.00
258	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
259	002961	瑞达期货	300	4,311.00	0.00
260	301608	博实结	62	4,053.56	0.00
261	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
262	600458	时代新材	200	2,562.00	0.00
263	300500	启迪设计	200	2,122.00	0.00
264	603506	南都物业	200	1,702.00	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	300674	宇信科技	4,688,133.00	4.52
2	300476	胜宏科技	4,578,725.00	4.41
3	000528	柳工	4,567,913.30	4.40
4	002036	联创电子	4,548,232.15	4.38
5	000725	京东方 A	4,528,893.00	4.36
6	603118	共进股份	4,469,796.00	4.31
7	003006	百亚股份	4,353,112.00	4.19
8	000682	东方电子	4,308,583.00	4.15
9	601728	中国电信	4,261,766.00	4.11
10	300113	顺网科技	4,230,799.00	4.08
11	300170	汉得信息	4,219,468.00	4.07
12	300035	中科电气	4,152,599.00	4.00
13	002649	博彦科技	4,116,142.00	3.97
14	300034	钢研高纳	4,042,967.00	3.90
15	300623	捷捷微电	4,014,445.00	3.87
16	688083	中望软件	3,967,923.55	3.82
17	000090	天健集团	3,962,830.00	3.82
18	002332	仙琚制药	3,932,215.00	3.79
19	600037	歌华有线	3,906,604.00	3.76
20	601609	金田股份	3,905,391.00	3.76
21	600602	云赛智联	3,878,349.00	3.74
22	300533	冰川网络	3,826,655.00	3.69
23	002970	锐明技术	3,785,013.00	3.65
24	300180	华峰超纤	3,780,397.00	3.64
25	002226	江南化工	3,751,285.40	3.61
26	601886	江河集团	3,720,927.00	3.59
27	002706	良信股份	3,704,924.00	3.57
28	603876	鼎胜新材	3,666,464.00	3.53
29	601801	皖新传媒	3,664,844.00	3.53
30	301078	孩子王	3,656,029.00	3.52
31	688088	虹软科技	3,630,391.60	3.50
32	603132	金徽股份	3,598,978.58	3.47
33	600710	苏美达	3,598,500.00	3.47
34	002043	兔宝宝	3,585,214.00	3.45
35	002651	利君股份	3,569,803.00	3.44
36	002745	木林森	3,547,257.00	3.42
37	300206	理邦仪器	3,521,118.04	3.39
38	300570	太辰光	3,510,805.00	3.38

39	000913	钱江摩托	3,480,309.00	3.35
40	300772	运达股份	3,474,035.50	3.35
41	600718	东软集团	3,453,658.00	3.33
42	002139	拓邦股份	3,443,029.00	3.32
43	600662	外服控股	3,422,598.00	3.30
44	002697	红旗连锁	3,421,423.00	3.30
45	000415	渤海租赁	3,383,531.00	3.26
46	600266	城建发展	3,364,231.00	3.24
47	300233	金城医药	3,361,153.00	3.24
48	300369	绿盟科技	3,345,712.00	3.22
49	000550	江铃汽车	3,342,057.00	3.22
50	688800	瑞可达	3,337,756.97	3.22
51	688183	生益电子	3,328,126.02	3.21
52	002020	京新药业	3,296,465.00	3.18
53	300303	聚飞光电	3,261,873.00	3.14
54	002402	和而泰	3,260,272.00	3.14
55	002961	瑞达期货	3,248,866.00	3.13
56	002396	星网锐捷	3,231,043.00	3.11
57	001322	箭牌家居	3,229,852.00	3.11
58	688798	艾为电子	3,229,012.16	3.11
59	000030	富奥股份	3,222,180.00	3.10
60	603236	移远通信	3,204,235.00	3.09
61	000555	神州信息	3,195,729.00	3.08
62	300770	新媒股份	3,192,976.00	3.08
63	300415	伊之密	3,165,487.00	3.05
64	601311	骆驼股份	3,159,954.00	3.04
65	601126	四方股份	3,147,208.00	3.03
66	600572	康恩贝	3,139,506.00	3.03
67	600312	平高电气	3,129,265.10	3.02
68	600320	振华重工	3,112,444.00	3.00
69	002237	恒邦股份	3,103,494.00	2.99
70	601318	中国平安	3,089,672.00	2.98
71	002100	天康生物	3,082,706.00	2.97
72	002534	西子洁能	3,076,087.40	2.96
73	002906	华阳集团	3,066,718.00	2.96
74	002212	天融信	3,053,393.00	2.94
75	688313	仕佳光子	3,044,950.19	2.93
76	600216	浙江医药	3,042,027.00	2.93
77	300602	飞荣达	3,036,671.00	2.93
78	601369	陕鼓动力	3,035,876.00	2.93
79	300115	长盈精密	3,029,588.00	2.92
80	688372	伟测科技	2,979,207.83	2.87
81	300638	广和通	2,975,578.00	2.87

82	600050	中国联通	2,958,456.00	2.85
83	002558	巨人网络	2,954,602.00	2.85
84	301291	明阳电气	2,930,333.98	2.82
85	603083	剑桥科技	2,898,587.00	2.79
86	688550	瑞联新材	2,858,386.41	2.75
87	002250	联化科技	2,855,035.00	2.75
88	002550	千红制药	2,849,767.00	2.75
89	002283	天润工业	2,849,029.00	2.75
90	002847	盐津铺子	2,835,539.00	2.73
91	002249	大洋电机	2,833,102.00	2.73
92	688658	悦康药业	2,825,377.90	2.72
93	601137	博威合金	2,809,254.00	2.71
94	300049	福瑞股份	2,783,096.00	2.68
95	688380	中微半导	2,771,720.19	2.67
96	300762	上海瀚讯	2,753,833.00	2.65
97	002003	伟星股份	2,745,638.00	2.65
98	002351	漫步者	2,740,035.00	2.64
99	600993	马应龙	2,738,882.00	2.64
100	000498	山东路桥	2,724,198.52	2.63
101	688772	珠海冠宇	2,717,792.84	2.62
102	600623	华谊集团	2,673,643.00	2.58
103	603171	税友股份	2,672,851.00	2.58
104	002635	安洁科技	2,659,649.00	2.56
105	002446	盛路通信	2,650,128.00	2.55
106	600267	海正药业	2,623,335.32	2.53
107	688158	优刻得	2,612,408.22	2.52
108	301050	雷电微力	2,605,855.76	2.51
109	688007	光峰科技	2,605,070.84	2.51
110	301015	百洋医药	2,592,149.00	2.50
111	600552	凯盛科技	2,581,968.00	2.49
112	603866	桃李面包	2,576,558.08	2.48
113	000672	上峰水泥	2,576,488.80	2.48
114	600649	城投控股	2,576,377.00	2.48
115	603129	春风动力	2,571,123.00	2.48
116	600531	豫光金铅	2,562,239.00	2.47
117	002483	润邦股份	2,562,050.00	2.47
118	300226	上海钢联	2,560,248.00	2.47
119	300232	洲明科技	2,549,066.00	2.46
120	002023	海特高新	2,546,518.00	2.45
121	002539	云图控股	2,546,040.00	2.45
122	002125	湘潭电化	2,543,862.60	2.45
123	688362	甬矽电子	2,535,337.91	2.44
124	600869	远东股份	2,530,524.00	2.44

125	601022	宁波远洋	2,528,155.00	2.44
126	600096	云天化	2,523,099.00	2.43
127	601101	昊华能源	2,520,502.00	2.43
128	002852	道道全	2,514,151.00	2.42
129	600461	洪城环境	2,508,918.00	2.42
130	600248	陕建股份	2,503,890.00	2.41
131	601677	明泰铝业	2,499,325.00	2.41
132	603766	隆鑫通用	2,491,718.00	2.40
133	000821	京山轻机	2,487,226.00	2.40
134	001338	永顺泰	2,485,665.00	2.40
135	300777	中简科技	2,480,436.00	2.39
136	002292	奥飞娱乐	2,470,380.00	2.38
137	002384	东山精密	2,457,532.00	2.37
138	300973	立高食品	2,449,884.00	2.36
139	688326	经纬恒润	2,447,819.90	2.36
140	688023	安恒信息	2,447,622.01	2.36
141	003015	日久光电	2,445,497.00	2.36
142	600120	浙江东方	2,431,026.00	2.34
143	002461	珠江啤酒	2,422,199.67	2.33
144	603162	海通发展	2,419,869.00	2.33
145	300705	九典制药	2,414,090.68	2.33
146	300363	博腾股份	2,409,264.00	2.32
147	002567	唐人神	2,401,310.00	2.31
148	600452	涪陵电力	2,389,512.40	2.30
149	301239	普瑞眼科	2,382,990.00	2.30
150	603296	华勤技术	2,374,520.20	2.29
151	603612	索通发展	2,365,180.00	2.28
152	000034	神州数码	2,362,591.00	2.28
153	688037	芯源微	2,346,172.33	2.26
154	600761	安徽合力	2,343,447.00	2.26
155	600835	上海机电	2,334,642.00	2.25
156	300922	天秦装备	2,324,376.00	2.24
157	600428	中远海特	2,323,552.00	2.24
158	002815	崇达技术	2,317,919.00	2.23
159	301025	读客文化	2,316,667.00	2.23
160	601921	浙版传媒	2,308,207.00	2.22
161	300573	兴齐眼药	2,307,143.00	2.22
162	300207	欣旺达	2,302,829.00	2.22
163	000686	东北证券	2,272,905.00	2.19
164	001914	招商积余	2,272,395.00	2.19
165	603383	顶点软件	2,269,193.00	2.19
166	002416	爱施德	2,266,625.00	2.18
167	300083	创世纪	2,262,342.00	2.18

168	300482	万孚生物	2,258,584.00	2.18
169	301175	中科环保	2,257,289.00	2.18
170	300682	朗新集团	2,257,199.00	2.18
171	603113	金能科技	2,252,598.00	2.17
172	600480	凌云股份	2,246,116.00	2.16
173	600420	国药现代	2,231,000.00	2.15
174	688347	华虹公司	2,230,183.75	2.15
175	002204	大连重工	2,226,259.00	2.15
176	603583	捷昌驱动	2,211,933.00	2.13
177	300151	昌红科技	2,211,713.00	2.13
178	002967	广电计量	2,202,249.00	2.12
179	002980	华盛昌	2,189,811.00	2.11
180	301165	锐捷网络	2,187,806.00	2.11
181	301090	华润材料	2,185,631.00	2.11
182	688578	艾力斯	2,183,812.41	2.10
183	300743	天地数码	2,182,168.70	2.10
184	301500	飞南资源	2,181,282.00	2.10
185	600633	浙数文化	2,173,728.00	2.09
186	603888	新华网	2,171,981.00	2.09
187	688588	凌志软件	2,161,770.70	2.08
188	688337	普源精电	2,161,543.41	2.08
189	600961	株冶集团	2,160,384.00	2.08
190	603588	高能环境	2,148,944.00	2.07
191	605376	博迁新材	2,146,864.00	2.07
192	688123	聚辰股份	2,144,029.69	2.07
193	600665	天地源	2,138,745.00	2.06
194	002410	广联达	2,137,690.00	2.06
195	002245	蔚蓝锂芯	2,120,312.00	2.04
196	300244	迪安诊断	2,119,824.00	2.04
197	603328	依顿电子	2,111,072.00	2.03
198	600648	外高桥	2,110,823.00	2.03
199	600645	中源协和	2,104,039.00	2.03
200	002946	新乳业	2,090,607.00	2.01
201	688127	蓝特光学	2,089,384.64	2.01
202	300101	振芯科技	2,075,790.00	2.00

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	5,804,194.00	5.59
2	300113	顺网科技	5,189,366.00	5.00
3	300206	理邦仪器	4,881,110.00	4.70

4	000415	渤海租赁	4,716,637.00	4.54
5	002402	和而泰	4,714,563.00	4.54
6	002332	仙琚制药	4,209,150.00	4.06
7	300638	广和通	4,199,628.00	4.05
8	600312	平高电气	4,151,724.00	4.00
9	300034	钢研高纳	4,129,496.00	3.98
10	688800	瑞可达	4,111,288.66	3.96
11	002283	天润工业	3,944,517.00	3.80
12	000090	天健集团	3,915,979.00	3.77
13	601728	中国电信	3,903,188.00	3.76
14	601609	金田股份	3,798,923.00	3.66
15	002416	爱施德	3,742,966.60	3.61
16	300762	上海瀚讯	3,598,918.00	3.47
17	000913	钱江摩托	3,588,934.00	3.46
18	300226	上海钢联	3,568,124.00	3.44
19	300170	汉得信息	3,481,837.00	3.36
20	300233	金城医药	3,475,285.00	3.35
21	688088	虹软科技	3,462,018.56	3.34
22	603583	捷昌驱动	3,404,780.56	3.28
23	002649	博彦科技	3,394,798.00	3.27
24	300369	绿盟科技	3,367,322.79	3.24
25	002351	漫步者	3,307,093.00	3.19
26	002961	瑞达期货	3,306,239.00	3.19
27	300409	道氏技术	3,264,555.00	3.15
28	600480	凌云股份	3,222,172.00	3.10
29	603328	依顿电子	3,205,608.00	3.09
30	600458	时代新材	3,156,278.42	3.04
31	002292	奥飞娱乐	3,141,616.00	3.03
32	688380	中微半导	3,135,892.95	3.02
33	600761	安徽合力	3,123,227.00	3.01
34	002946	新乳业	3,108,472.30	3.00
35	000555	神州信息	3,103,977.00	2.99
36	688158	优刻得	3,091,181.66	2.98
37	601677	明泰铝业	3,088,520.00	2.98
38	001338	永顺泰	3,087,363.00	2.97
39	301291	明阳电气	3,051,581.96	2.94
40	002651	利君股份	3,051,552.00	2.94
41	603083	剑桥科技	3,042,667.00	2.93
42	002558	巨人网络	3,007,061.00	2.90
43	601318	中国平安	2,994,321.00	2.89
44	000951	中国重汽	2,970,760.00	2.86
45	000725	京东方 A	2,940,834.00	2.83
46	688023	安恒信息	2,936,074.18	2.83

47	603118	共进股份	2,934,075.00	2.83
48	300777	中简科技	2,903,250.00	2.80
49	600050	中国联通	2,898,820.00	2.79
50	300674	宇信科技	2,896,640.00	2.79
51	601921	浙版传媒	2,893,567.00	2.79
52	600835	上海机电	2,876,771.00	2.77
53	300623	捷捷微电	2,864,104.00	2.76
54	000795	英洛华	2,846,891.00	2.74
55	002384	东山精密	2,844,179.00	2.74
56	300458	全志科技	2,838,426.00	2.74
57	300922	天秦装备	2,828,200.00	2.73
58	002534	西子洁能	2,820,833.00	2.72
59	688083	中望软件	2,813,252.56	2.71
60	002847	盐津铺子	2,804,493.80	2.70
61	002036	联创电子	2,791,311.00	2.69
62	002635	安洁科技	2,787,227.00	2.69
63	600993	马应龙	2,786,790.00	2.69
64	300415	伊之密	2,777,649.00	2.68
65	002815	崇达技术	2,772,847.00	2.67
66	600710	苏美达	2,761,991.00	2.66
67	600556	天下秀	2,754,342.00	2.65
68	301171	易点天下	2,748,143.00	2.65
69	000498	山东路桥	2,742,353.34	2.64
70	300973	立高食品	2,741,798.00	2.64
71	000821	京山轻机	2,741,296.00	2.64
72	300049	福瑞股份	2,735,769.00	2.64
73	600285	羚锐制药	2,724,656.00	2.63
74	603296	华勤技术	2,723,883.00	2.62
75	603171	税友股份	2,699,499.00	2.60
76	000600	建投能源	2,692,731.00	2.59
77	603129	春风动力	2,680,388.00	2.58
78	600037	歌华有线	2,680,332.00	2.58
79	002125	湘潭电化	2,672,989.00	2.58
80	300303	聚飞光电	2,660,678.00	2.56
81	002410	广联达	2,649,587.00	2.55
82	603866	桃李面包	2,629,345.00	2.53
83	600120	浙江东方	2,629,149.00	2.53
84	688183	生益电子	2,623,820.77	2.53
85	600649	城投控股	2,600,428.00	2.51
86	601801	皖新传媒	2,592,370.00	2.50
87	002895	川恒股份	2,589,689.00	2.50
88	002970	锐明技术	2,572,335.00	2.48
89	002773	康弘药业	2,571,146.00	2.48

90	003006	百亚股份	2,566,716.00	2.47
91	301015	百洋医药	2,531,402.00	2.44
92	000682	东方电子	2,528,252.00	2.44
93	300035	中科电气	2,520,030.00	2.43
94	600461	洪城环境	2,509,132.00	2.42
95	002245	蔚蓝锂芯	2,500,065.00	2.41
96	603533	掌阅科技	2,491,733.00	2.40
97	300570	太辰光	2,491,269.00	2.40
98	688578	艾力斯	2,468,417.61	2.38
99	002048	宁波华翔	2,459,058.21	2.37
100	002139	拓邦股份	2,445,065.62	2.36
101	603236	移远通信	2,427,342.20	2.34
102	601022	宁波远洋	2,424,176.00	2.34
103	600055	万东医疗	2,417,054.00	2.33
104	688127	蓝特光学	2,407,630.39	2.32
105	300743	天地数码	2,405,579.00	2.32
106	600667	太极实业	2,396,183.00	2.31
107	688018	乐鑫科技	2,372,682.52	2.29
108	600266	城建发展	2,370,793.00	2.28
109	000034	神州数码	2,367,713.00	2.28
110	300772	运达股份	2,367,149.88	2.28
111	688037	芯源微	2,360,233.68	2.27
112	600797	浙大网新	2,350,287.00	2.26
113	601126	四方股份	2,347,387.00	2.26
114	001914	招商积余	2,346,379.00	2.26
115	601101	昊华能源	2,340,074.00	2.25
116	688123	聚辰股份	2,324,037.81	2.24
117	002043	兔宝宝	2,315,552.00	2.23
118	001308	康冠科技	2,301,693.54	2.22
119	000528	柳工	2,296,557.00	2.21
120	688208	道通科技	2,293,870.97	2.21
121	603588	高能环境	2,291,732.00	2.21
122	601311	骆驼股份	2,284,854.00	2.20
123	002171	楚江新材	2,276,146.00	2.19
124	002226	江南化工	2,273,549.00	2.19
125	002130	沃尔核材	2,262,837.00	2.18
126	300482	万孚生物	2,247,989.00	2.17
127	002396	星网锐捷	2,229,746.00	2.15
128	002980	华盛昌	2,204,149.00	2.12
129	301165	锐捷网络	2,201,632.00	2.12
130	600717	天津港	2,182,559.00	2.10
131	603876	鼎胜新材	2,180,713.00	2.10
132	002745	木林森	2,174,938.00	2.10

133	002097	山河智能	2,166,031.00	2.09
134	603113	金能科技	2,164,242.00	2.09
135	002206	海利得	2,142,504.00	2.06
136	002698	博实股份	2,127,220.00	2.05
137	002826	易明医药	2,116,888.00	2.04
138	600572	康恩贝	2,115,585.00	2.04
139	000422	湖北宜化	2,109,700.00	2.03
140	301187	欧圣电气	2,109,057.00	2.03
141	002697	红旗连锁	2,101,565.00	2.03
142	603565	中谷物流	2,101,174.00	2.02
143	601137	博威合金	2,096,195.00	2.02
144	603995	甬金股份	2,094,850.13	2.02
145	603660	苏州科达	2,087,748.00	2.01
146	002913	奥士康	2,079,138.00	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	1,211,172,930.41
卖出股票的收入（成交）总额	1,056,906,688.67

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东软集团股份有限公司在报告编制前一年受到潜江市市场监督管理局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

8.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,138,087.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,138,087.65

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 1000 指数增 强 A	4883	34,824.95	69,254,777.92	40.73%	100,795,474.75	59.27%
博时中证 1000 指数增 强 C	4118	26,086.56	22,844,301.47	21.27%	84,580,135.19	78.73%
合计	8904	31,162.93	92,099,079.39	33.19%	185,375,609.94	66.81%

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 1000 指数增强 A	435,080.00	0.26%
	博时中证 1000 指数增强 C	1,298.34	0.00%
	合计	436,378.34	0.16%

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 1000 指数增强 A	-
	博时中证 1000 指数增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持 有本开放式基金	博时中证 1000 指数增强 A	10~50
	博时中证 1000 指数增强 C	-
	合计	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 1000 指数增强 A	博时中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 4 月 13 日）基金份额总额	174,832,102.91	105,444,978.24
本报告期初基金份额总额	75,824,011.63	33,185,092.41
本报告期基金总申购份额	200,848,047.79	313,459,751.34
减：本报告期基金总赎回份额	106,621,806.75	239,220,407.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	170,050,252.67	107,424,436.66

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 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。

基金管理人于 2024 年 12 月 7 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》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

本报告期内，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 2024 年起改聘安永华明会计师事务所（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 25000 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，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	
华西证券	2	2,266,946,628.34	100.00%	798,332.93	100.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；

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；

4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下估值的时效性要求。

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
华西证券	100,356.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下 78 只基金改聘会计师事	中国证券报、基	2024-12-27

	务所的公告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-12-07
3	博时基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司 办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-11-18
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期 内承销证券的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-11-14
5	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-20241106	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-11-06
6	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度 报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-10-25
7	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-09-30
8	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-20240925	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-09-25
9	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-09-21
10	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-30
11	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上 海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-23
12	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开	中国证券报、基	2024-08-22

	展费率优惠活动的公告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
13	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换等业务费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-17
14	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-20
15	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-19
16	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金（博时中证 1000 指数增强 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-06-26
17	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金（博时中证 1000 指数增强 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-06-26
18	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-05-25
19	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	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-05-15
20	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	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-29
21	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	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-29
22	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-22
23	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基	2024-04-13

		金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
24	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-03-29
25	博时中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度 报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-01-22

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证 1000 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 1000 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 1000 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 1000 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、基金托管人处

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
二〇二五年三月三十一日