

路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：路博迈基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	49
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	49

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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
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情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
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	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
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	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金		
基金简称	路博迈中证 A500 指数增强		
基金主代码	023325		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2025 年 3 月 20 日		
基金管理人	路博迈基金管理（中国）有限公司		
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	597,758,856.47 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	路博迈中证 A500 指数增 强 A	路博迈中证 A500 指数增 强 B	路博迈中证 A500 指数增 强 C
下属分级基金的交 易代码	023325	025935	023326
报告期末下属分级 基金的份额总额	584,241,589.54 份	1,411,520.40 份	12,105,746.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越业绩比较基准的投资收益，力求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 A500 指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.50%，年化跟踪误差不超过 8%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度、年化跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 本基金的投资策略主要包括股票投资策略（包括指数化投资策略、指数增强策略、港股通标的股票投资策略和存托凭证投资策略）、债券投资策略、流动性管理策略、衍生产品投资策略以及参与融资和转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		路博迈基金管理（中国）有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘铮	张立学
	联系电话	4008755888	010-68858126
	电子邮箱	cs@nbchina.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4008755888	95580
传真		021-32063700	010-86353609
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		200041	100808
法定代表人		阎小庆	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.nbchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	路博迈基金管理（中国）有限公司	中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室

§ 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
	路博迈中证 A500 指数增强 A	路博迈中证 A500 指数增强 B	路博迈中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	88,802,181.45	2,777,838.65	1,893,709.37
本期利润	87,499,743.63	4,800,902.89	2,469,904.86
加权平均基金份额本期利润	0.1508	0.2598	0.2062
本期加权平均净值利润	11.66%	20.45%	16.00%

率			
本期基金份额净值增长率	11.97%	11.95%	11.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
期末可供分配利润	220,953,836.99	533,564.16	4,492,670.67
期末可供分配基金份额利润	0.3782	0.3780	0.3711
期末基金资产净值	805,195,426.53	1,945,084.56	16,598,417.20
期末基金份额净值	1.3782	1.3780	1.3711
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	37.82%	15.25%	37.11%

注：1、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。

2、所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（例如，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

路博迈中证 A500 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	13.61%	1.36%	13.54%	1.34%	0.07%	0.02%

过去六个月	11.97%	1.24%	11.34%	1.22%	0.63%	0.02%
过去一年	36.78%	1.04%	34.41%	1.09%	2.37%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	37.82%	1.05%	30.99%	1.09%	6.83%	-0.04%

路博迈中证 A500 指数增强 B

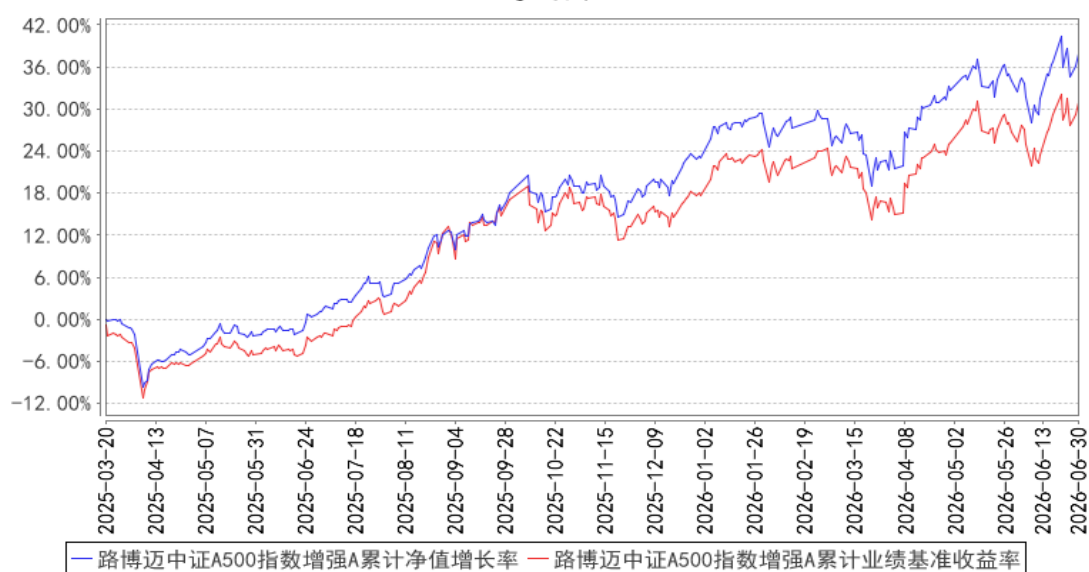
阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	13.59%	1.37%	13.54%	1.34%	0.05%	0.03%
过去六个月	11.95%	1.24%	11.34%	1.22%	0.61%	0.02%
自基金合同生效 起至今	15.25%	1.14%	13.16%	1.14%	2.09%	0.00%

路博迈中证 A500 指数增强 C

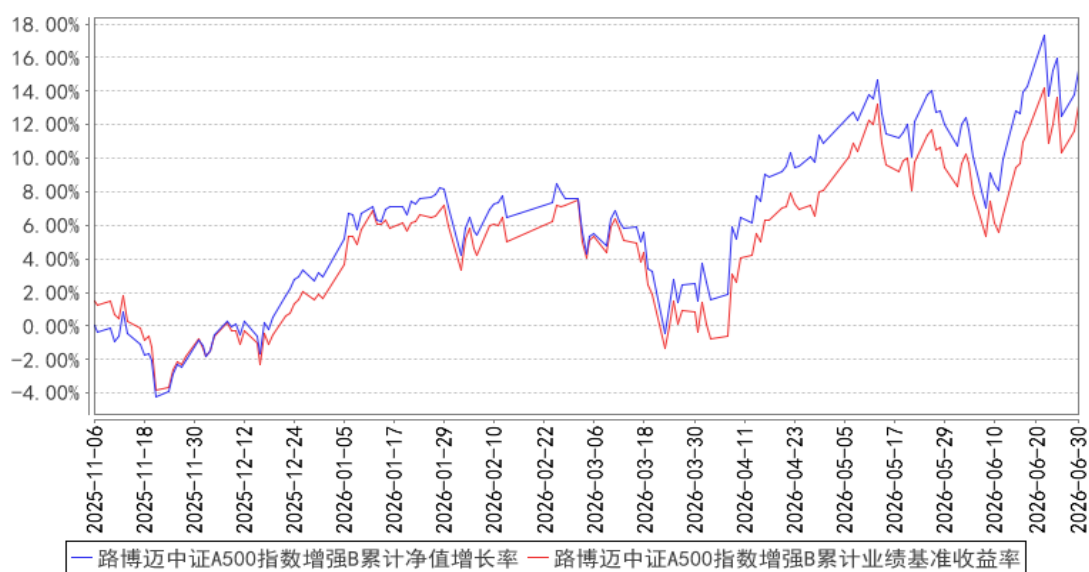
阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	13.49%	1.36%	13.54%	1.34%	-0.05%	0.02%
过去六个月	11.74%	1.24%	11.34%	1.22%	0.40%	0.02%
过去一年	36.22%	1.04%	34.41%	1.09%	1.81%	-0.05%
自基金合同生效 起至今	37.11%	1.05%	30.99%	1.09%	6.12%	-0.04%

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

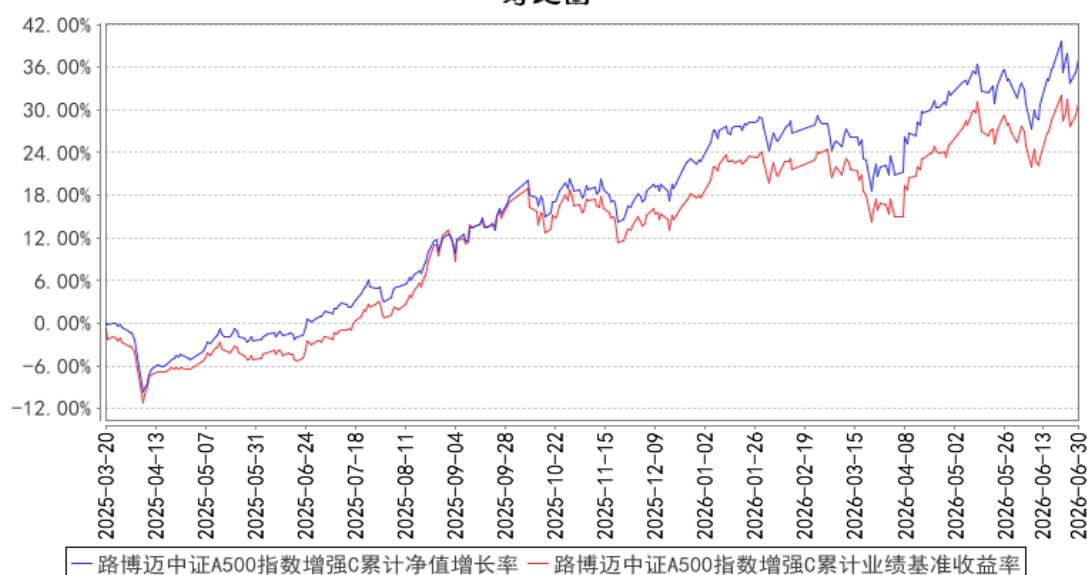
路博迈中证A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



路博迈中证A500指数增强B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



路博迈中证A500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同于 2025 年 03 月 20 日生效，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

2、本基金 2025 年 11 月 06 日起新增 B 类基金份额。

§ 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

路博迈基金管理（中国）有限公司于 2021 年 9 月 22 日经中国证券监督管理委员会《关于核准设立路博迈基金管理（中国）有限公司的批复》（证监许可[2021]3094 号）批准设立，由路博迈投资顾问有限公司（Neuberger Berman Investment Advisers LLC）全资持有。截至报告期末，公司共管理 20 只公开募集证券投资基金：路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金、路博迈中国机遇混合型证券投资基金、路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金、路博迈中国医疗健康股票型发起式证券投资基金、路博迈中国精选利率债债券型证券投资基金、路博迈安航 90 天持有期债券型证券投资基金、路博迈中高等级信用债债券型证券投资基金、路博迈资源精选股票型发起式证券投资基金、路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金、路博迈 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合指数证券投资基金、路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金、路博迈兴航 60 天滚动持有债券型证券投资基金、路博迈旭航债券型证券投资基金、路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金、路博迈中债优选投资级信用债指数证券投资基金、路博迈港股通科技股票型证券投资基金、路博迈中证 A 股指数增强型证券投资基金、路博迈添航债券型证券投资基金、路博迈卓越优选混合型证券投资基金、路博迈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基

金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩羽辰	本基金现任基金经理	2025 年 7 月 23 日	-	9 年	韩羽辰，中国国籍，纽约大学金融工程专业硕士。于 2025 年 1 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任公募多资产投资部基金经理。曾任职于光大保德信基金管理有限公司，历任研究助理、量化研究员、投资经理、基金经理职务，负责量化产品的投资研究等工作。
魏晓雪	本基金前任基金经理	2025 年 3 月 20 日	2026 年 3 月 26 日	20 年	魏晓雪，中国国籍，复旦大学经济学硕士。于 2022 年 10 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司。现担任路博迈基金管理（中国）有限公司副总经理、CIO、基金经理、投资经理，负责公司公募投资、研究及交易业务，分管公募股票投资一部、公募固收投资部、公募多资产投资部、研究部和交易部，兼公募股票投资一部总经理、公募多资产投资部总经理及研究部总经理。曾任西南证券高级客户经理；鹏远（北京）管理咨询上海分公司研究员；光大保德信基金管理有限公司总经理助理、研究总监及基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

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

2026 年上半年，宏观经济在结构优化中彰显韧性。高技术制造业与科技相关产业保持强劲增长，成为支撑经济的重要引擎，传统消费与制造业则在政策呵护下逐步积蓄修复动能。GDP 运行于年度目标区间，二季度价格指数迎来标志性改善，名义增速边际回暖，内生增长活力持续释放。A 股市场在牛市格局中演绎出鲜明的结构分化特征，以科创板和创业板为代表的科技板块大幅领涨，传统蓝筹指数则有所调整。风格层面，成长显著跑赢价值，科技成长赛道走出独立行情，大小盘、成长与价值之间的分化达到历史极值。市场成交极为活跃，但赚钱效应高度集中，全市场近七成个股下跌，多数个股并未跟上指数涨幅，行业间首尾差距悬殊，电子、通信等 AI 相关行业表现耀眼，而商贸零售、农林牧渔、食品饮料等传统板块持续承压。资金面同样折射出极端偏好，杠杆资金持续加码，但新增融资高度集中于科技行业，对其他板块形成明显的流动性“虹吸”效应。总体而言，上半年是科技主线引领的结构性牛市，更是中国经济转型升级在资本市场的生动映射，分化中蕴藏着丰富的结构性机遇。

本基金以中证 A500 指数为基准，选股模型采用机器学习框架，依托高性能算力对海量历史数据进行深度挖掘，构建符合长期市场逻辑的综合选股指标，并在控制风格行业偏离和跟踪误差的

基础上优选个股构建指数增强组合，力争实现长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 1.3782 元，本报告期内净值增长率 11.97%，同期业绩比较基准收益率 11.34%；截至本报告期末，本基金 B 类份额净值 1.3780 元，本报告期内净值增长率 11.95%，同期业绩比较基准收益率 11.34%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.3711 元，本报告期内净值增长率 11.74%，同期业绩比较基准收益率 11.34%。

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，积极因素正在积聚，宏观经济有望在政策加力下保持平稳向好态势。“十五五”开局之年的产业政策持续发力，新质生产力加速培育，出口依托完备产业链保持韧性，内需修复将成为政策重点发力方向，财政与货币协同发力可期，经济增速有望在筑底后温和回升，物价水平也将在需求端支撑下趋于改善，三季度将是观察名义增速修复成色的重要窗口，前景值得期待。证券市场方面，科技仍是贯穿全年的核心主线，但行情驱动力或将从估值扩张稳步切换至业绩兑现，中报季将成为验证企业盈利成色的试金石，真正具备产业趋势支撑的优质龙头将在优胜劣汰中脱颖而出，市场风格也有望从极致分化向均衡收敛，成长与价值各展所长。尽管地缘政治和通胀扰动等外部不确定性犹存，但国内政策工具箱充足，产业升级趋势不可逆转，科技板块的高景气具备基本面支撑，交易拥挤将在市场自我调节中逐步消化。行业配置上，关注 AI 产业链上业绩确定性强的硬件环节，侧重海外供应链受益方向，同时关注 AI 资本开支外溢带来的电力设备、机器人、商业航天等衍生机会；锂电池、化工、券商、创新药等处于盈利复苏通道的板块也值得密切跟踪；消费与红利板块经过持续调整后估值渐具吸引力，可逐步左侧布局。整体而言，下半年 A 股结构性机会丰富，市场有望在分化中逐步走向均衡，产业变迁与资产重估的主线清晰，值得积极把握。总的来说，2026 年或将是连接短期复苏与中长期高质量发展的重要一年。资本市场有望在盈利驱动下，呈现出机会更为多元、风格更趋均衡的特征。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未

进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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、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：路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	45,063,158.65	38,226,995.57
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	770,171,113.18	554,619,849.70
其中：股票投资		770,171,113.18	552,195,618.25
基金投资		-	-
债券投资		-	2,424,231.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,984,708.03	11,401,884.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		825,218,979.86	604,248,729.50
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		700,120.78	4,443,031.89
应付管理人报酬		580,641.65	496,704.09
应付托管费		108,870.31	93,132.02
应付销售服务费		6,116.27	43,902.84
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	6.4.7.6	84,302.56	97,375.15
负债合计		1,480,051.57	5,174,145.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	597,758,856.47	486,730,006.20
未分配利润	6.4.7.8	225,980,071.82	112,344,577.31
净资产合计		823,738,928.29	599,074,583.51
负债和净资产总计		825,218,979.86	604,248,729.50

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 597,758,856.47 份，其中 A 类基金份额净值 1.3782 元，基金份额 584,241,589.54 份；B 类基金份额净值 1.3780 元，基金份额 1,411,520.40 份；C 类基金份额净值 1.3711 元，基金份额 12,105,746.53 份。

6.2 利润表

会计主体：路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		98,605,791.77	17,223,801.78
1. 利息收入		82,269.46	160,336.86
其中：存款利息收入	6.4.7.9	82,269.46	65,682.86
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		-	94,654.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		95,068,298.38	8,914,389.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	88,213,084.49	-7,429,097.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	221,377.44	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	6,633,836.45	16,343,487.70
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,296,821.91	8,149,018.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,158,402.02	56.72
减：二、营业总支出		3,835,240.39	3,635,623.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,125,519.10	3,031,981.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	586,034.91	568,496.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	30,383.68	3,899.04
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. 7. 17	-	-
7. 税金及附加		0. 14	340. 75
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	93, 302. 56	30, 905. 51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		94, 770, 551. 38	13, 588, 178. 33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		94, 770, 551. 38	13, 588, 178. 33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		94, 770, 551. 38	13, 588, 178. 33

注：本基金合同生效日为 2025 年 03 月 20 日，本期财务报表的上年度可比期间为 2025 年 03 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止。

6.3 净资产变动表

会计主体：路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	486, 730, 006. 20	112, 344, 577. 31	599, 074, 583. 51
二、本期期初净资产	486, 730, 006. 20	112, 344, 577. 31	599, 074, 583. 51
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	111, 028, 850. 27	113, 635, 494. 51	224, 664, 344. 78
（一）、综合收益总额	-	94, 770, 551. 38	94, 770, 551. 38
（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）	111, 028, 850. 27	18, 864, 943. 13	129, 893, 793. 40
其中：1. 基金申购款	1, 194, 873, 649. 13	366, 303, 651. 34	1, 561, 177, 300. 47
2. 基金赎回款	-1, 083, 844, 798. 86	-347, 438, 708. 21	-1, 431, 283, 507. 07
（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、本期期末净资产	597,758,856.47	225,980,071.82	823,738,928.29
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	1,398,744,658.16	-	1,398,744,658.16
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-11,942,862.80	10,508,140.43	-1,434,722.37
（一）、综合收益总额	-	13,588,178.33	13,588,178.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-11,942,862.80	-3,080,037.90	-15,022,900.70
其中：1. 基金申购款	275,944,446.98	-3,828,052.06	272,116,394.92
2. 基金赎回款	-287,887,309.78	748,014.16	-287,139,295.62
（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、本期期末净资产	1,386,801,795.36	10,508,140.43	1,397,309,935.79

注：本基金合同生效日为 2025 年 03 月 20 日，本期财务报表的上年度可比期间为 2025 年 03 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止。

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：

阎小庆

基金管理人负责人

阎小庆

主管会计工作负责人

黄恩典

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2025 年 1 月 9 日证监许可【2025】42 号《关于准予路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》准

予注册，本基金由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规以及《路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。基金管理人和注册登记机构均为路博迈基金管理（中国）有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。有关基金募集文件已按规定向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 3 月 20 日正式生效，生效日的基金份额总额为 1,398,744,658.16 份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验字第 2500265 号验资报告予以验证。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金还可投资于部分非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、信用衍生品、股指期货、国债期货、股票期权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。本基金可以根据有关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（包括但不限于股指期货等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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[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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税[2017]2号文《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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主

要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	10,032,879.61
等于：本金	10,027,151.11
加：应计利息	5,728.50
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	35,030,279.04
等于：本金	35,028,987.11
加：应计利息	1,291.93
减：坏账准备	-
合计	45,063,158.65

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		748,177,093.87	-	770,171,113.18	21,994,019.31
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		748,177,093.87	-	770,171,113.18	21,994,019.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	84,302.56

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

路博迈中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	377,523,796.48	377,523,796.48
本期申购	1,113,221,210.94	1,113,221,210.94
本期赎回（以“-”号填列）	-906,503,417.88	-906,503,417.88

本期末	584,241,589.54	584,241,589.54
-----	----------------	----------------

路博迈中证 A500 指数增强 B

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	100,125,088.68	100,125,088.68
本期申购	30,152,824.38	30,152,824.38
本期赎回（以“-”号填列）	-128,866,392.66	-128,866,392.66
本期末	1,411,520.40	1,411,520.40

路博迈中证 A500 指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,081,121.04	9,081,121.04
本期申购	51,499,613.81	51,499,613.81
本期赎回（以“-”号填列）	-48,474,988.32	-48,474,988.32
本期末	12,105,746.53	12,105,746.53

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

路博迈中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	91,269,707.36	-4,106,570.04	87,163,137.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	91,269,707.36	-4,106,570.04	87,163,137.32
本期利润	88,802,181.45	-1,302,437.82	87,499,743.63
本期基金份额交易产生的变动数	61,129,964.77	-14,839,008.73	46,290,956.04
其中：基金申购款	367,086,110.78	-23,909,535.38	343,176,575.40
基金赎回款	-305,956,146.01	9,070,526.65	-296,885,619.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,201,853.58	-20,248,016.59	220,953,836.99

路博迈中证 A500 指数增强 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,209,118.02	-1,088,901.09	23,120,216.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	24,209,118.02	-1,088,901.09	23,120,216.93
本期利润	2,777,838.65	2,023,064.24	4,800,902.89

本期基金份额交易产生的变动数	-26,404,482.89	-983,072.77	-27,387,555.66
其中：基金申购款	8,378,944.46	-55,651.75	8,323,292.71
基金赎回款	-34,783,427.35	-927,421.02	-35,710,848.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	582,473.78	-48,909.62	533,564.16

路博迈中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,159,950.61	-98,727.55	2,061,223.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,159,950.61	-98,727.55	2,061,223.06
本期利润	1,893,709.37	576,195.49	2,469,904.86
本期基金份额交易产生的变动数	857,524.34	-895,981.59	-38,457.25
其中：基金申购款	16,382,678.23	-1,578,895.00	14,803,783.23
基金赎回款	-15,525,153.89	682,913.41	-14,842,240.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,911,184.32	-418,513.65	4,492,670.67

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	55,957.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	20,985.40
结算备付金利息收入	-
其他	5,326.12
合计	82,269.46

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,064,360,803.37
减：卖出股票成本总额	1,973,737,215.48
减：交易费用	2,410,503.40
买卖股票差价收入	88,213,084.49

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	9,406.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	211,970.97
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	221,377.44

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,051,016.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,806,040.00
减：应计利息总额	32,919.02
减：交易费用	86.54
买卖债券差价收入	211,970.97

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,633,836.45
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,633,836.45

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,296,821.91
股票投资	1,296,101.91
债券投资	720.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	1,296,821.91

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,158,331.93
转换费收入	70.09
合计	2,158,402.02

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
账户维护费_中债登	9,000.00
合计	93,302.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
路博迈基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6
----	--	---

		月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3, 125, 519. 10	3, 031, 981. 59
其中：应支付销售机构的客户维护费	1, 043, 184. 27	1, 475, 493. 27
应支付基金管理人的净管理费	2, 082, 334. 83	1, 556, 488. 32

注：支付基金管理人的基金管理费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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	586, 034. 91	568, 496. 56

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	路博迈中证 A500 指数增强 A	路博迈中证 A500 指数增强 B	路博迈中证 A500 指数增强 C	合计
路博迈基金管理（中国）有限公司	-	-	5, 128. 10	5, 128. 10
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	14, 356. 16	14, 356. 16
合计	-	-	19, 484. 26	19, 484. 26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	路博迈中证 A500 指数增强 A	路博迈中证 A500 指数增强 B	路博迈中证 A500 指数增强 C	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	3, 549. 13	3, 549. 13

合计	-	-	3,549.13	3,549.13
----	---	---	----------	----------

注：本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额不收取销售服务费。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。其计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2025 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	10,032,879.61	55,957.94	17,764,953.96	37,581.40

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
301666	大普微	2026 年 04 月 08 日	6 个月	创业板打新限售	46.08	571.99	1,220	56,217.60	697,827.80	-
688808	联讯仪器	2026 年 04 月 16 日	6 个月	科创板打新限售	81.88	2,086.66	163	13,346.44	340,125.58	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	科创板打新限售	19.68	170.81	1,226	24,127.68	209,413.06	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	35.24	4,528	45,823.36	159,566.72	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	科创板打新限售	44.56	642.06	207	9,223.92	132,906.42	-
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	科创板打新限售	9.47	70.09	1,717	16,259.99	120,344.53	-
301682	宏明电子	2026 年 03 月 18 日	6 个月	创业板打新限售	69.66	159.94	714	49,737.24	114,197.16	-
688785	恒运	2026 年 01 月	6 个月	科创板打	92.18	462.56	116	10,692.88	53,656.96	-

	昌	月 20 日		新限售						
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	科创板打新限售	40.98	405.52	128	5,245.44	51,906.56	-
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	科创板打新限售	26.28	182.77	234	6,149.52	42,768.18	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	36.79	719	19,549.61	26,452.01	-
301696	三瑞智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	创业板打新限售	24.68	104.80	216	5,330.88	22,636.80	-
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	创业板打新限售	7.08	37.52	546	3,865.68	20,485.92	-
001237	惠康科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	65.85	285	15,179.10	18,767.25	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股锁定	30.38	48.48	387	11,757.06	18,761.76	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	创业板打新限售	13.91	40.66	433	6,023.03	17,605.78	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	创业板打新限售	21.93	76.74	195	4,276.35	14,964.30	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	96.45	137	1,898.82	13,213.65	-
301680	固德	2026 年 02 月	6 个月	创业板打	58.00	112.13	117	6,786.00	13,119.21	-

	电材	月 27 日		新限售						
301683	慧谷新材	2026 年 03 月 24 日	6 个月	创业板打新限售	78.38	129.27	96	7,524.48	12,409.92	-
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	6 个月	科创板打新限售	22.68	47.60	217	4,921.56	10,329.20	-
688816	易思维	2026 年 02 月 04 日	6 个月	科创板打新限售	55.95	57.08	177	9,903.15	10,103.16	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.57	510	5,701.80	8,960.70	-
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	创业板打新限售	26.66	63.44	138	3,679.08	8,754.72	-
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	科创板打新限售	17.52	35.90	234	4,099.68	8,400.60	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	60.62	104	1,639.04	6,304.48	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.50	112	2,450.56	2,856.00	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	新股锁定	33.49	38.45	72	2,411.28	2,768.40	-
001312	福恩股份	2026 年 04 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	18.20	134	2,462.92	2,438.80	-
603284	林平	2026 年 02 月	6 个月	新股锁定	37.88	34.86	46	1,742.48	1,603.56	-

	发 展	月 03 日								
001220	世 盟 股 份	2026 年 01 月 27 日	6 个 月	新股 锁定	28.00	27.77	57	1,596.00	1,582.89	-

注：1、根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

2、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数增强基金，以中证 A500 指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的投资收益。其预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人制定了内部管理制度和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险管理机构由董事

会及风险控制委员会、总经理及风险管理委员会、督察长、风控负责人、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。公司各部门或岗位之间的监督制约,构成风险控制的第一道监控防线;由公司总经理负责,风险管理委员会、投资决策委员会、督察长、风控负责人、法律合规部和风险管理部构成风险控制的第二道监控防线;在董事会领导下,风险控制委员会负责内部控制和风险管理的决策,构成了风险控制的第三道监控防线。

6.4.13.2 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,导致基金资产损失和收益变化的风险。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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	2,424,231.45
合计	-	2,424,231.45

注: 1、债券评级取自第三方评级机构。

2、债券投资以全价列示。

3、未评级债券为国债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

流动性风险发生时，本基金的基金管理人按流动性风险处置预案处理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

6.4.13.3.1 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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价

日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	45,063,158.65	-	-	-	45,063,158.65
交易性金融资产	-	-	-	770,171,113.18	770,171,113.18
应收申购款	-	-	-	9,984,708.03	9,984,708.03
资产总计	45,063,158.65	-	-	780,155,821.21	825,218,979.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	700,120.78	700,120.78
应付管理人报酬	-	-	-	580,641.65	580,641.65
应付托管费	-	-	-	108,870.31	108,870.31
应付销售服务费	-	-	-	6,116.27	6,116.27
其他负债	-	-	-	84,302.56	84,302.56
负债总计	-	-	-	1,480,051.57	1,480,051.57
利率敏感度缺口	45,063,158.65	-	-	778,675,769.64	823,738,928.29
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	38,226,995.57	-	-	-	38,226,995.57
交易性金融资产	2,424,231.45	-	-	552,195,618.25	554,619,849.70
应收申购款	-	-	-	11,401,884.23	11,401,884.23
资产总计	40,651,227.02	-	-	563,597,502.48	604,248,729.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,443,031.89	4,443,031.89
应付管理人报酬	-	-	-	496,704.09	496,704.09
应付托管费	-	-	-	93,132.02	93,132.02
应付销售服务费	-	-	-	43,902.84	43,902.84
其他负债	-	-	-	97,375.15	97,375.15
负债总计	-	-	-	5,174,145.99	5,174,145.99
利率敏感度缺口	40,651,227.02	-	-	558,423,356.49	599,074,583.51

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变；此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-1,735.72
	市场利率下降 25 个基点	-	1,738.21

注：本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行利率的敏感性分析。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	770,171,113.18	93.50	552,195,618.25	92.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	770, 171, 113. 18	93. 50	552, 195, 618. 25	92. 17

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准之外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	40, 630, 788. 91	26, 459, 288. 39
	业绩比较基准下降 5%	-40, 630, 788. 91	-26, 459, 288. 39

6. 4. 14 公允价值

6. 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 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到的输入值； 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

6. 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	768, 005, 881. 10	543, 943, 178. 02
第二层次	-	8, 736, 912. 45
第三层次	2, 165, 232. 08	1, 939, 759. 23
合计	770, 171, 113. 18	554, 619, 849. 70

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	770,171,113.18	93.33
	其中：股票	770,171,113.18	93.33
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	45,063,158.65	5.46
8	其他各项资产	9,984,708.03	1.21
9	合计	825,218,979.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	1,413,596.00	0.17
B	采矿业	39,959,852.00	4.85
C	制造业	455,835,533.18	55.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,570.00	0.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	621,600.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	21,556,888.00	2.62
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,976,952.50	2.43
J	金融业	74,592,750.00	9.06
K	房地产业	7,234,046.00	0.88
L	租赁和商务服务业	9,009,629.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	15,339,632.00	1.86
N	水利、环境和公共设施管理业	7,822,760.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	653,468,808.68	79.33

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,411,270.00	0.41
C	制造业	86,085,245.05	10.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,021,595.00	0.49
E	建筑业	1,196,340.00	0.15
F	批发和零售业	2,735,866.00	0.33
G	交通运输、仓储	1,582.89	0.00

	和邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,913,769.56	0.72
J	金融业	4,445,208.00	0.54
K	房地产业	3,266,406.00	0.40
L	租赁和商务服务业	289,706.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	147,280.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	5,188,036.00	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	116,702,304.50	14.17

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	31,200	39,624,000.00	4.81
2	300750	宁德时代	81,400	31,991,014.00	3.88
3	603986	兆易创新	21,800	17,767,000.00	2.16
4	601318	中国平安	363,300	17,343,942.00	2.11
5	002371	北方华创	18,600	16,452,816.00	2.00
6	601899	紫金矿业	654,100	16,444,074.00	2.00
7	688008	澜起科技	52,929	16,402,697.10	1.99
8	688012	中微公司	34,908	16,354,398.00	1.99
9	000333	美的集团	210,500	15,899,065.00	1.93
10	603259	药明康德	123,200	15,339,632.00	1.86
11	688041	海光信息	40,980	15,174,894.00	1.84
12	688981	中芯国际	94,867	15,066,776.94	1.83
13	600030	中信证券	486,300	13,971,399.00	1.70

14	600183	生益科技	75,500	13,091,700.00	1.59
15	601398	工商银行	1,815,200	12,833,464.00	1.56
16	300502	新易盛	19,340	11,739,380.00	1.43
17	600150	中国船舶	335,700	11,343,303.00	1.38
18	000338	潍柴动力	378,800	10,322,300.00	1.25
19	600519	贵州茅台	8,600	10,195,214.00	1.24
20	300857	协创数据	29,500	10,027,050.00	1.22
21	601288	农业银行	1,617,400	9,817,618.00	1.19
22	300014	亿纬锂能	145,700	9,474,871.00	1.15
23	000063	中兴通讯	260,000	9,409,400.00	1.14
24	002415	海康威视	273,300	9,346,860.00	1.13
25	601988	中国银行	1,598,000	9,140,560.00	1.11
26	000792	盐湖股份	302,700	9,138,513.00	1.11
27	688002	睿创微纳	58,010	8,973,566.90	1.09
28	000977	浪潮信息	126,200	8,834,000.00	1.07
29	600941	中国移动	101,200	8,716,356.00	1.06
30	301358	湖南裕能	112,100	8,505,027.00	1.03
31	601225	陕西煤业	413,200	8,408,620.00	1.02
32	600115	中国东航	2,098,500	7,995,285.00	0.97
33	000415	渤海租赁	1,936,800	7,882,776.00	0.96
34	000408	藏格矿业	113,100	7,840,092.00	0.95
35	002266	浙富控股	1,546,000	7,822,760.00	0.95
36	603993	洛阳钼业	440,900	7,737,795.00	0.94
37	600026	中远海能	431,200	7,735,728.00	0.94
38	688180	君实生物	225,322	7,620,390.04	0.93
39	601328	交通银行	1,181,500	7,597,045.00	0.92
40	000807	云铝股份	333,300	7,379,262.00	0.90
41	002475	立讯精密	101,600	7,152,640.00	0.87
42	600312	平高电气	400,300	7,069,298.00	0.86
43	002384	东山精密	26,900	7,057,215.00	0.86
44	002493	荣盛石化	639,100	6,870,325.00	0.83
45	603019	中科曙光	63,000	6,755,490.00	0.82
46	002049	紫光国微	75,700	6,718,375.00	0.82
47	601689	拓普集团	116,500	6,572,930.00	0.80
48	688005	容百科技	212,610	6,505,866.00	0.79
49	002179	中航光电	135,500	6,260,100.00	0.76
50	300919	中伟新材	137,200	6,002,500.00	0.73
51	002532	天山铝业	521,900	5,599,987.00	0.68
52	601233	桐昆股份	257,300	5,570,545.00	0.68
53	000425	徐工机械	654,700	5,296,523.00	0.64
54	603799	华友钴业	107,500	5,187,950.00	0.63
55	002340	格林美	745,900	4,930,399.00	0.60
56	601018	宁波港	1,461,900	4,604,985.00	0.56

57	002916	深南电路	8,200	3,754,780.00	0.46
58	002544	普天科技	200,600	3,654,932.00	0.44
59	688256	寒武纪	2,250	3,589,987.50	0.44
60	600938	中国海油	120,400	3,268,860.00	0.40
61	300782	卓胜微	29,800	3,265,484.00	0.40
62	300458	全志科技	82,600	3,259,396.00	0.40
63	000069	华侨城 A	1,920,200	3,149,128.00	0.38
64	600036	招商银行	81,100	2,879,050.00	0.35
65	000002	万科 A	968,600	2,867,056.00	0.35
66	000426	兴业银锡	86,100	2,837,856.00	0.34
67	002602	世纪华通	171,000	2,411,100.00	0.29
68	002028	思源电气	13,100	2,266,300.00	0.28
69	600887	伊利股份	85,200	2,041,392.00	0.25
70	600166	福田汽车	635,900	1,850,469.00	0.22
71	002738	中矿资源	29,800	1,757,902.00	0.21
72	601600	中国铝业	207,100	1,702,362.00	0.21
73	002714	牧原股份	40,400	1,413,596.00	0.17
74	688578	艾力斯	11,726	1,280,479.20	0.16
75	600711	盛屯矿业	115,100	1,262,647.00	0.15
76	601111	中国国航	201,800	1,220,890.00	0.15
77	601155	新城控股	118,700	1,217,862.00	0.15
78	002466	天齐锂业	19,200	1,177,344.00	0.14
79	600153	建发股份	142,100	1,126,853.00	0.14
80	300661	圣邦股份	7,300	1,047,404.00	0.13
81	600816	建元信托	413,800	1,009,672.00	0.12
82	601728	中国电信	183,300	951,327.00	0.12
83	002517	恺英网络	40,200	653,250.00	0.08
84	000034	神州数码	22,400	621,600.00	0.08
85	002273	水晶光电	13,700	486,076.00	0.06
86	600346	恒力石化	9,200	162,932.00	0.02
87	301308	江波龙	200	140,760.00	0.02
88	000933	神火股份	5,600	118,720.00	0.01
89	003816	中国广核	27,000	105,570.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002379	宏桥控股	508,500	7,510,545.00	0.91
2	301246	宏源药业	270,100	7,265,690.00	0.88
3	688275	万润新能	55,856	7,124,432.80	0.86
4	688081	兴图新科	148,024	6,051,221.12	0.73
5	688378	奥来德	95,522	5,922,364.00	0.72
6	688279	峰岬科技	26,349	5,913,769.56	0.72

7	301536	星宸科技	43,700	5,624,627.00	0.68
8	603156	养元饮品	113,400	5,564,538.00	0.68
9	688155	先惠技术	67,007	5,420,196.23	0.66
10	688215	瑞晟智能	133,780	5,372,604.80	0.65
11	600292	电投水电	430,900	5,188,036.00	0.63
12	002169	智光电气	309,300	4,528,152.00	0.55
13	601939	建设银行	461,600	4,445,208.00	0.54
14	601138	工业富联	56,200	4,054,830.00	0.49
15	000605	渤海股份	751,700	4,021,595.00	0.49
16	002653	海思科	56,100	3,721,674.00	0.45
17	600773	西藏城投	253,800	3,266,406.00	0.40
18	600348	华阳股份	371,100	2,838,915.00	0.34
19	002154	报喜鸟	613,500	2,184,060.00	0.27
20	002338	奥普光电	34,300	1,961,960.00	0.24
21	603268	松发股份	12,900	1,796,712.00	0.22
22	002216	三全食品	150,100	1,730,653.00	0.21
23	600685	中船防务	64,400	1,638,336.00	0.20
24	601061	中信金属	132,800	1,430,256.00	0.17
25	002284	亚太股份	144,500	1,371,305.00	0.17
26	605599	菜百股份	95,300	1,305,610.00	0.16
27	000629	钒钛股份	372,300	1,243,482.00	0.15
28	300517	海波重科	127,000	1,196,340.00	0.15
29	603345	安井食品	13,100	1,050,489.00	0.13
30	002947	恒铭达	9,300	707,265.00	0.09
31	301666	大普微	1,220	697,827.80	0.08
32	603317	天味食品	51,100	664,811.00	0.08
33	688311	盟升电子	22,684	594,093.96	0.07
34	688309	恒誉环保	9,604	584,691.52	0.07
35	300191	潜能恒信	20,700	572,355.00	0.07
36	688808	联讯仪器	163	340,125.58	0.04
37	301169	零点有数	4,100	289,706.00	0.04
38	688779	五矿新能	28,713	232,862.43	0.03
39	688820	盛合晶微	1,226	209,413.06	0.03
40	001399	惠科股份	4,528	159,566.72	0.02
41	301024	霍普股份	4,000	147,280.00	0.02
42	688797	臻宝科技	207	132,906.42	0.02
43	688818	电科蓝天	1,717	120,344.53	0.01
44	301682	宏明电子	714	114,197.16	0.01
45	688785	恒运昌	116	53,656.96	0.01
46	688635	长进光子	128	51,906.56	0.01
47	688813	泰金新能	234	42,768.18	0.01
48	001365	天海电子	719	26,452.01	0.00
49	301696	三瑞智能	216	22,636.80	0.00

50	301669	高特电子	546	20,485.92	0.00
51	001237	惠康科技	285	18,767.25	0.00
52	001393	维通利	387	18,761.76	0.00
53	301599	理奇智能	433	17,605.78	0.00
54	301687	新广益	195	14,964.30	0.00
55	603407	长裕集团	137	13,213.65	0.00
56	301680	固德电材	117	13,119.21	0.00
57	301683	慧谷新材	96	12,409.92	0.00
58	688781	视涯科技	217	10,329.20	0.00
59	688816	易思维	177	10,103.16	0.00
60	601112	振石股份	510	8,960.70	0.00
61	301513	尚水智能	138	8,754.72	0.00
62	688712	北芯生命	234	8,400.60	0.00
63	603435	嘉德利	104	6,304.48	0.00
64	603352	至信股份	112	2,856.00	0.00
65	603293	埃泰克	72	2,768.40	0.00
66	001312	福恩股份	134	2,438.80	0.00
67	603284	林平发展	46	1,603.56	0.00
68	001220	世盟股份	57	1,582.89	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	300308	中际旭创	48,085,359.56	8.03
2	300750	宁德时代	43,791,658.95	7.31
3	688012	中微公司	31,064,887.55	5.19
4	601318	中国平安	30,637,864.00	5.11
5	601899	紫金矿业	30,263,942.00	5.05
6	300502	新易盛	26,584,734.96	4.44
7	000333	美的集团	24,701,043.20	4.12
8	600150	中国船舶	23,848,908.97	3.98
9	000977	浪潮信息	23,653,350.96	3.95
10	688008	澜起科技	23,529,034.51	3.93
11	002371	北方华创	23,484,603.30	3.92
12	600519	贵州茅台	22,774,694.80	3.80
13	600030	中信证券	21,611,404.96	3.61
14	000792	盐湖股份	20,447,444.42	3.41
15	688981	中芯国际	20,112,808.25	3.36
16	300014	亿纬锂能	20,001,007.42	3.34
17	603259	药明康德	19,553,492.53	3.26
18	600292	电投水电	19,175,504.00	3.20
19	601398	工商银行	18,767,510.70	3.13

20	600941	中国移动	18,041,475.40	3.01
21	601225	陕西煤业	17,864,534.00	2.98
22	688180	君实生物	17,263,686.68	2.88
23	603986	兆易创新	16,909,039.00	2.82
24	600026	中远海能	16,778,147.00	2.80
25	600115	中国东航	16,264,684.00	2.71
26	603799	华友钴业	16,240,082.89	2.71
27	000807	云铝股份	16,168,354.07	2.70
28	600183	生益科技	16,077,571.00	2.68
29	601288	农业银行	15,866,143.00	2.65
30	000408	藏格矿业	15,781,502.00	2.63
31	002916	深南电路	15,535,209.70	2.59
32	688002	睿创微纳	15,498,302.09	2.59
33	000338	潍柴动力	15,459,580.00	2.58
34	688041	海光信息	15,415,057.48	2.57
35	603993	洛阳钼业	14,326,042.00	2.39
36	000063	中兴通讯	14,256,097.00	2.38
37	002532	天山铝业	14,175,391.00	2.37
38	301246	宏源药业	14,090,161.00	2.35
39	600309	万华化学	13,634,896.95	2.28
40	002415	海康威视	13,614,488.90	2.27
41	002493	荣盛石化	13,505,369.00	2.25
42	601988	中国银行	13,296,497.00	2.22
43	601689	拓普集团	13,144,771.00	2.19
44	002379	宏桥控股	12,975,194.00	2.17
45	601328	交通银行	12,944,674.00	2.16
46	000425	徐工机械	12,103,208.00	2.02

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

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	300308	中际旭创	44,903,571.00	7.50
2	300750	宁德时代	40,092,522.00	6.69
3	300502	新易盛	29,232,879.20	4.88
4	600519	贵州茅台	27,112,114.92	4.53
5	601318	中国平安	25,595,233.00	4.27
6	601899	紫金矿业	24,928,072.21	4.16
7	688008	澜起科技	23,337,956.93	3.90
8	688012	中微公司	22,978,431.41	3.84
9	002916	深南电路	21,284,489.00	3.55
10	000333	美的集团	20,543,748.46	3.43
11	603259	药明康德	17,649,137.00	2.95

12	603296	华勤技术	17,432,852.00	2.91
13	600276	恒瑞医药	17,340,112.40	2.89
14	300408	三环集团	16,821,942.50	2.81
15	002414	高德红外	16,487,030.84	2.75
16	600183	生益科技	15,978,592.00	2.67
17	002371	北方华创	15,661,387.00	2.61
18	688981	中芯国际	15,415,368.69	2.57
19	601601	中国太保	15,264,478.08	2.55
20	601398	工商银行	15,183,035.00	2.53
21	300124	汇川技术	14,802,259.00	2.47
22	000977	浪潮信息	14,568,785.00	2.43
23	600941	中国移动	14,244,965.00	2.38
24	603986	兆易创新	13,921,479.00	2.32
25	601600	中国铝业	13,853,246.00	2.31
26	600030	中信证券	13,748,610.34	2.29
27	600309	万华化学	13,718,025.00	2.29
28	601288	农业银行	13,561,532.00	2.26
29	002517	恺英网络	13,422,073.09	2.24
30	688002	睿创微纳	13,378,287.00	2.23
31	600938	中国海油	13,085,187.00	2.18
32	688110	东芯股份	12,917,010.52	2.16
33	002409	雅克科技	12,429,783.00	2.07
34	601328	交通银行	12,247,200.00	2.04
35	688180	君实生物	12,182,719.01	2.03
36	000425	徐工机械	12,131,191.32	2.02
37	600150	中国船舶	12,085,105.07	2.02
38	603659	璞泰来	12,023,988.00	2.01
39	600292	电投水电	12,004,568.90	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

买入股票成本（成交）总额	2,190,416,608.50
卖出股票收入（成交）总额	2,064,360,803.37

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

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金将结合对宏观经济形势和证券趋势的判断，通过对债券市场进行定性和定量的分析，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货来提高投资组合的运作效率。在国债期货投资过程中，本基金将对国债期货和现货基差、国债期货的流动性水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,984,708.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,984,708.03

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
路博迈 中证 A500 指 数增强 A	13,271	44,023.93	208,649,594.69	35.7129	375,591,994.85	64.2871
路博迈 中证 A500 指 数增强 B	116	12,168.28	-	-	1,411,520.40	100.0000
路博迈	905	13,376.52	4,764,060.74	39.3537	7,341,685.79	60.6463

中 证 A500 指 数增强 C						
合 计	14,216	42,048.32	213,413,655.43	35.7023	384,345,201.04	64.2977

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

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	路博迈中证 A500 指数增强 A	455,606.84	0.0780
	路博迈中证 A500 指数增强 B	—	—
	路博迈中证 A500 指数增强 C	—	—
	合 计	455,606.84	0.0762

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

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	路博迈中证 A500 指数增强 A	10~50
	路博迈中证 A500 指数增强 B	0
	路博迈中证 A500 指数增强 C	0
	合 计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	路博迈中证 A500 指数增强 A	0~10
	路博迈中证 A500 指数增强 B	0
	路博迈中证 A500 指数增强 C	0
	合 计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	路博迈中证 A500 指数增强 A	路博迈中证 A500 指数增强 B	路博迈中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 03 月 20 日） 基金份额总额	1,395,185,846.33	—	3,558,811.83
本报告期期初 基金份额总额	377,523,796.48	100,125,088.68	9,081,121.04
本报告期基金 总申购份额	1,113,221,210.94	30,152,824.38	51,499,613.81
减：本报告期 基金总赎回份 额	906,503,417.88	128,866,392.66	48,474,988.32
本报告期基金 拆分变动份额	—	—	—
本报告期末 基金份额总额	584,241,589.54	1,411,520.40	12,105,746.53

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2、本基金 2025 年 11 月 06 日起新增 B 类基金份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

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以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内管理人无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
东北证券	2	4,252,659,576.60	100.00	1,105,754.34	100.00	-

注：1、交易单元的选择标准：

(1) 公司实力雄厚，信誉良好；

(2) 公司研究实力较强，研究机构和专门的研究人员能为基金提供高质量的资讯服务, 包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专门研究报告；

(3) 公司财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(4) 公司经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，可以为公司开展交易提供必要的交易终端，若交易终端无法满足基金产品正常交易需求的，可在确保合规与风险可控的前提下接入公司的信息系统, 并能为基金提供全面的信息服务。

2、交易单元的选择流程：

各相关部门按照研究能力、运营能力、交易服务和合规情况对拟进行合作的证券公司进行打分后建立白名单，在白名单中选定合作的证券公司。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东北证券	618,136.53	100.00	-	-	-	-

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	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分权益类公募基金在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-23
3	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-13
4	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2026-03-26
5	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-30
6	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-03-30
7	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书更新（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026-03-30
8	路博迈基金管理（中国）有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-30
9	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金（B 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-03-30
10	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026-03-30
11	路博迈中证 A500 指数增强型证券投资	中国证监会规定媒介	2026-04-22

	资基金 2026 年第 1 季度报告		
12	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-23
13	2025 年度路博迈基金管理（中国）有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-24
14	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增汇添富基金销售（上海）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-23

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
产品	1	20260108-20260108	77,065,643.27	-	-	77,065,643.27	12.89
	2	20260107-20260112	85,185,279.84	-	-	85,185,279.84	14.25
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告截止日至报告送出日之间，基金管理人发生如下高级管理人员变动：基金管理人于 2026 年 8 月 1 日发布《路博迈基金管理（中国）有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2026 年 7 月 30 日起，刘铮女士担任公司督察长，林海中先生因个人原因不再担任公司督察长。
--

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集本基金的文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的托管协议
- 4、本基金的招募说明书
- 5、本基金的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人路博迈基金管理（中国）有限公司。

咨询电话：400-875-5888

公司网址：www.nbchina.com

路博迈基金管理（中国）有限公司

2026 年 8 月 28 日