

贝莱德中证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：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至06月30日止。

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	6
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	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
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	48
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	50
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	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
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	52
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	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金	
基金简称	贝莱德中证A500指数增强	
基金主代码	022715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年1月23日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	79,433,995.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德中证A500指数增强A	贝莱德中证A500指数增强C
下属分级基金的交易代码	022715	022716
报告期末下属分级基金的份额总额	33,893,459.21份	45,540,536.48份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		贝莱德基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	帅芳
	联系电话	021-80225188	021-38677947
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	tgrxp@tg.gtth.com
客户服务电话		400-002-6655	021-38917599-5
传真		021-80225288	021-50872603
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	上海市静安区新闸路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		郁蓓华	朱健

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.blackrock.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	贝莱德中证A500指数增强A	贝莱德中证A500指数增强C
本期已实现收益	6,572,559.32	7,733,005.55
本期利润	5,954,275.93	9,749,975.55
加权平均基金份 额本期利润	0.1571	0.1872
本期加权平均净 值利润率	12.34%	14.71%
本期基金份额净	11.82%	11.60%

值增长率		
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	12, 033, 399. 99	15, 809, 248. 47
期末可供分配基 金份额利润	0. 3550	0. 3471
期末基金资产净 值	45, 926, 859. 20	61, 349, 784. 95
期末基金份额净 值	1. 3550	1. 3471
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	35. 50%	34. 71%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

贝莱德中证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. 47%	1. 31%	13. 54%	1. 34%	-0. 07%	-0. 03%
过去六个月	11. 82%	1. 20%	11. 34%	1. 22%	0. 48%	-0. 02%
过去一年	30. 31%	1. 06%	34. 41%	1. 09%	-4. 10%	-0. 03%
自基金合同生效 日起至今	35. 50%	1. 04%	39. 14%	1. 07%	-3. 64%	-0. 03%

贝莱德中证A500指数增强C

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

	率①	准差②	率③	④		
过去三个月	13.35%	1.31%	13.54%	1.34%	-0.19%	-0.03%
过去六个月	11.60%	1.20%	11.34%	1.22%	0.26%	-0.02%
过去一年	29.79%	1.06%	34.41%	1.09%	-4.62%	-0.03%
自基金合同生效 日起至今	34.71%	1.04%	39.14%	1.07%	-4.43%	-0.03%

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

贝莱德中证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



贝莱德中证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：本基金的基金合同于2025年01月23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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

贝莱德基金管理有限公司成立于2020年9月10日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了19只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金、贝莱德先进制造一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金、贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金、贝莱德行业优选混合型证券投资基金、贝莱德安睿30天持有期债券型证券投资基金、贝莱德卓越远航混合型证券投资基金、贝莱德中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、贝莱德安裕90天持有期债券型证券投资基金、贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金、贝莱德中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、贝莱德和悦利率债债券型证券投资基金、贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金、贝莱德富元添益债券型证券投资基金、贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金、贝莱德中债投资优选绿色债券指数证券投资基金、贝莱德中证500指数增强型证券投资基金、贝莱德富元金利混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓京	本基金的基金经理，首席权益、多资产及指数投资官	2025年1月23日		15年	王晓京先生，首席权益、多资产及指数投资官，基金经理，曾受雇于贝莱德英国（BlackRock Investment Management (UK) Limited）以及贝莱德建信理财有限责任公司，历任研究员、基金经理等职务。加入贝莱德之前，王晓京先生曾就职于花旗银行（伦敦），任投资银行部分析员。王晓京先生是特许金融分析师（CFA）持证人，拥有清华大学电子信息工程学士学位、英国伯明翰大学电子工程硕士学位、伦敦大学电子工程博士学位。
邹立波	本基金的基金经理	2025年2月27日		9年	邹立波先生，基金经理及基金经理助理，曾任专户投资部投资经理。曾就职

	助理				于信银理财有限责任公司、中信银行总行资产管理业务中心、中信银行上海分行、南瑞集团有限公司。邹立波先生拥有新西兰奥克兰理工大学硕士学位、奥克兰大学学士学位。
--	----	--	--	--	---

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 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。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在产品运作层面，截至2026年6月30日，本基金上半年取得了收益率11.82%（A类）及11.60%（C类），相较于业绩比较基准的超额收益分别为0.48%（A类）及0.26%（C类）。其中行业维度，上半年相较于业绩比较基准超额收益贡献居前的行业板块为医药生物、汽车、银行，主要贡献来自个股选择；而通信、电子及有色金属板块对组合的超额收益拖累居前，核心拖累来自于行业配置。本基金上半年继续运用了股指期货优化组合的现金管理、灵活调节股票的风险敞口，股

指期货的投资在本季度对整体组合管理及超额收益均有积极拉动。

回顾上半年权益市场的表现，中证A500指数在开年短暂延续了春季躁动后陷入震荡，市场在等待政策及更多经济数据确认的过程中年初的涨幅被部分消化。基于此背景，本基金在1月降低了主动风险敞口，但仍将主要的主动风险暴露放在个股选择上，在市场震荡调整过程中，组合的累积超额收益逐渐修复。随后伴随中东冲突的爆发，投资者风险偏好剧烈收缩，全球权益资产不同程度受挫，A股市场也经历了较为剧烈的风格切换，本基金在偏成长板块上的布局下跌明显，超额收益也出现了一定幅度回撤，但模型中更具防御性的质量信号及逆向情绪信号发挥了作用，在市场环境转变中取得了一定积极效果。4月停火协议初步达成以来，地缘冲突的烈度降低，全球风险资产、尤其A股市场的情绪重新升温。在海外映射、产业趋势催化及盈利确定性等多重因素共振下，二季度市场进入了科技类行业大幅引领其他行业的结构性牛市态势。市场风格也展现出了强劲的大盘成长偏向，资产间的表现分化显著，其中科创50指数表现亮眼，而中证红利指数仅二季度出现了双位数回撤。基于市场上行但分化加剧的背景，本基金在4月小幅增加了主动风险敞口，伴随市场的上行，组合的累积超额收益逐渐修复，其中情绪类信号是推动4月超额表现的主要驱动力。但5月至6月，因A股市场增量注意力窄幅聚焦于科技主题，情绪及基本面类的信号在这种极致行情下表现有所拖累，且本基金配置相对分散，组合的超额收益出现了一定幅度的回撤，但组合个股选择部分的表现仍相对有韧性。基于去年以来全球出现的AI结构性行情，贝莱德全球平台不断加强在主题行情方面的探索：充分运用大语言模型及前沿Agentic（自主的）科技去辨识符合特定主题的个股，进而生成该主题下的股票篮子并定义潜在受益、受损资产，从而构建适应特定主题行情的信号。我们认为模型及策略的长期有效性并未改变，仍对量化选股的投资方法论抱有信心。

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1.3550元，本报告期内净值增长率11.82%，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1.3471元，本报告期内净值增长率11.60%，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

后市我们仍坚持看好中国资产的观点不变，核心原因有三：一、宏观经济韧性十足，中国经济在复杂的地缘政治格局和国际油价波动中展现出超预期的抗压能力，未过多受外部冲击拖累。从增长动能来看，出口保持韧性，制造业投资维持高位，为整体经济提供了坚实支撑。上市公司盈利也正式进入兑现阶段：一季度全A整体盈利同比增长7%左右，进入二季度，尽管完整财报尚未披露，但目前已公布的业绩预告和先行指标均指向盈利将进一步改善，市场一致预期二季度同

比增速有望继续上行。

二、中国在科技和高端制造业具备全球优势。AI领域中美是全球唯二在五层分类上均有显著布局的国家，中国科技企业有望在成本、技术和商业模式上以综合实力参与全球竞争，部分半导体和发电储能企业基于蓝海定位和高门槛，基本面持续向好。近期海内外科技板块短期表现有所波动，但拉长至24-36个月维度，我们认为科技的牛市并未结束。全球科技股动量回调源于前期拥挤度过高和部分市场杠杆过高，而非头部公司基本面减速。AI需求仍在指数级上升，浪潮刚刚兴起，优质资产近期回调后估值吸引力进一步增强，配置价值显现。

三、我们注意到，近年来A股市场在投资者回报机制方面发生了积极的结构性变化，分红率持续提升是最直观的体现。投资者回报和对投资者的保护均有实质性提升，这为中长期资金入市创造了更友好的制度环境。叠加估值层面，无论是和近十年的历史相比还是横向对比其他市场，大中盘股票均有吸引力，共同支撑我们对市场的看好。

此外，我们关注出口高增速掩盖的投资和内需的弱复苏，以及政策面或有的刺激投资和内需的措施。目前市场对此期待值不高，若出台强有力的刺激内需政策，泛消费类股票可能迎来修复性机会，比如现金流充沛的一些服务行业目前估值处于相对较低水平。

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，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在贝莱德中证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、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，尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为其真实、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： 贝莱德中证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	1,107,795.65	5,027,812.29
结算备付金		5,154,142.68	2,726,707.73
存出保证金		745,108.80	676,257.60
交易性金融资产	6.4.7.2	101,702,337.10	117,947,224.23
其中：股票投资		95,259,661.53	111,880,823.13
基金投资		-	-
债券投资		6,442,675.57	6,066,401.10
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	-	-
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		314,966.71	1,573,565.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		109,024,350.94	127,951,567.36
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		1,539,063.77	2,605,631.36
应付管理人报酬		84,104.82	89,157.79
应付托管费		15,769.62	16,717.10
应付销售服务费		27,611.72	17,532.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		204.53	6,610.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	80,952.33	42,400.00
负债合计		1,747,706.79	2,778,049.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	79,433,995.69	103,456,322.36
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	27,842,648.46	21,717,195.60
净资产合计		107,276,644.15	125,173,517.96
负债和净资产总计		109,024,350.94	127,951,567.36

注： 报告截止日2026年06月30日，基金份额总额79,433,995.69份，其中A类基金份额净值1.3550元，基金份额33,893,459.21份；C类基金份额净值1.3471元，基金份额45,540,536.48份。

6.2 利润表

会计主体：贝莱德中证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1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日
一、营业总收入		16,460,748.70	17,848,876.58
1. 利息收入		53,670.52	115,549.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	52,989.67	115,264.27
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		680.85	285.40
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,987,672.63	16,343,861.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	12,703,670.91	13,957,520.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	31,757.17	27,618.01
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	1,300,642.69	-
股利收益	6.4.7.13	951,601.86	2,358,723.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,398,686.61	1,340,587.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	20,718.94	48,877.14
减：二、营业总支出		756,497.22	1,238,037.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	454,310.55	838,896.90
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,183.17	157,293.19
3. 销售服务费		130,614.43	165,355.69
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		5,841.86	1.03

8. 其他费用	6. 4. 7. 16	80, 547. 21	76, 490. 43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15, 704, 251. 48	16, 610, 839. 34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15, 704, 251. 48	16, 610, 839. 34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15, 704, 251. 48	16, 610, 839. 34

6.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德中证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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	103, 456, 322. 36	-	21, 717, 195. 60	125, 173, 517. 96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	103, 456, 322. 36	-	21, 717, 195. 60	125, 173, 517. 96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24, 022, 326. 67	-	6, 125, 452. 86	-17, 896, 873. 81
（一）、综合收益总额	-	-	15, 704, 251. 48	15, 704, 251. 48
（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）	-24, 022, 326. 67	-	-9, 578, 798. 62	-33, 601, 125. 29
其中：1. 基金申购款	117, 261, 244. 67	-	30, 116, 954. 50	147, 378, 199. 17
2. 基金赎回款	- 141, 283, 571. 34	-	-39, 695, 753. 12	-180, 979, 324. 46
（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	79,433,995.69	-	27,842,648.46	107,276,644.15
项目	上年度可比期间 2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	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	396,383,188.47	-	-	396,383,188.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 224,409,387.87	-	6,729,905.51	-217,679,482.36
（一）、综合收益总额	-	-	16,610,839.34	16,610,839.34
（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）	- 224,409,387.87	-	-9,880,933.83	-234,290,321.70
其中：1. 基金申购款	174,484,888.03	-	6,172,748.73	180,657,636.76
2. 基金赎回款	- 398,894,275.90	-	-16,053,682.56	-414,947,958.46
（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	171,973,800.60	-	6,729,905.51	178,703,706.11

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：

<u>郁蓓华</u>	<u>杨怡</u>	<u>徐菱莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]1601号《关于准予贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由贝莱德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中证A500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396,335,467.83元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(25)第00030号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年1月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为396,383,188.47份基金份额，其中认购资金利息折合47,720.64份基金份额。基金管理人为贝莱德基金管理有限公司。经中国证监会于2025年1月17日批复核准，国泰君安证券股份有限公司自吸收合并交割日(2025年3月14日)起吸收合并海通证券股份有限公司，合并后的公司名称于2025年4月3日变更为国泰海通证券股份有限公司。本基金管理人于2025年4月4日发布相关公告，更新基金托管人名称为国泰海通证券股份有限公司。

根据《贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》和《贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金基金

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年上半年度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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号

《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]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》、国务院令第826号《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》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027年12月31日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

- (3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。
- (5)对于证券投资基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。
- (6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	977,705.14
等于：本金	975,675.69
加：应计利息	2,029.45
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	130,090.51
等于：本金	130,071.71
加：应计利息	18.80
减：坏账准备	-
合计	1,107,795.65

注：其他存款为存放在证券经纪商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		86,235,192.09	-	95,259,661.53	9,024,469.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,402,395.74	37,695.57	6,442,675.57	2,584.26
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,402,395.74	37,695.57	6,442,675.57	2,584.26
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		92,637,587.83	37,695.57	101,702,337.10	9,027,053.70

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,087,990.00	-	-	-
其中：股指期货	6,087,990.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,087,990.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2612	IM2612	1.00	1,643,920.00	9,320.00
IF2612	IF2612	2.00	2,856,840.00	5,160.00
IC2612	IC2612	1.00	1,708,480.00	106,770.00
合计				121,250.00
减：可抵销期货暂收款				121,250.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	80,532.33
其他	420.00
合计	80,952.33

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德中证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	62,245,856.46	62,245,856.46
本期申购	18,364,500.47	18,364,500.47
本期赎回（以“-”号填列）	-46,716,897.72	-46,716,897.72
本期末	33,893,459.21	33,893,459.21

贝莱德中证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	41,210,465.90	41,210,465.90
本期申购	98,896,744.20	98,896,744.20
本期赎回（以“-”号填列）	-94,566,673.62	-94,566,673.62
本期末	45,540,536.48	45,540,536.48

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

贝莱德中证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	12,594,549.73	587,278.44	13,181,828.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,594,549.73	587,278.44	13,181,828.17
本期利润	6,572,559.32	-618,283.39	5,954,275.93
本期基金份额交易产生的变动数	-6,567,009.99	-535,694.12	-7,102,704.11
其中：基金申购款	5,301,720.81	-184,894.78	5,116,826.03
基金赎回款	-11,868,730.80	-350,799.34	-12,219,530.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,600,099.06	-566,699.07	12,033,399.99

贝莱德中证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	8,148,139.60	387,227.83	8,535,367.43
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,148,139.60	387,227.83	8,535,367.43

本期利润	7,733,005.55	2,016,970.00	9,749,975.55
本期基金份额交易产生的变动数	686,196.39	-3,162,290.90	-2,476,094.51
其中：基金申购款	29,218,708.71	-4,218,580.24	25,000,128.47
基金赎回款	-28,532,512.32	1,056,289.34	-27,476,222.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,567,341.54	-758,093.07	15,809,248.47

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	30,247.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,060.79
结算备付金利息收入	21,681.79
其他	-
合计	52,989.67

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,703,670.91
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	12,703,670.91

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	165,836,427.74
减：卖出股票成本总额	152,970,347.64
减：交易费用	162,409.19
买卖股票差价收入	12,703,670.91

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

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	21,038.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,718.58
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	31,757.17

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	9,081,500.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,989,644.26
减：应计利息总额	81,079.05
减：交易费用	58.16
买卖债券差价收入	10,718.58

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投资收益-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投资收益-申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	1,300,642.69

6.4.7.13 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	951,601.86

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	951,601.86

6.4.7.14 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	1,272,876.61
股票投资	1,281,423.35
债券投资	-8,546.74
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	125,810.00
权证投资	-
股指期货	125,810.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,398,686.61

6.4.7.15 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	20,694.25
基金转换费收入	24.69
合计	20,718.94

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

6.4.7.16 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	21,024.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	14.88
合计	80,547.21

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

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
贝莱德基金管理有限公司（“贝莱德基金”）	基金管理人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。原关联方国泰君安证券股份有限公司于2025年3月14日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自2025年4月3日起更名为国泰海通证券股份有限公司。

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

金额单位：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1月23日（基金合同生效日）至2025 年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额 的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国泰海通	62,664,266.37	20.83	1,128,902,241.09	100.00

注：上表中上年度可比期间列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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1月23日（基金合同生效日）至 2025年6月30日
-------	--------------------------------	---

	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 成交总额的比例（%）
国泰海通	4,998,771.00	38.74	13,479,516.00	100.00

注：上表中上年度可比期间列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：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1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
国泰海通	4,300,000.00	20.67	2,800,000.00	100.00

注：上表中上年度可比期间列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

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均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国泰海通	12,330.38	20.40	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国泰海通	221,296.28	100.00	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

3、上表中上年度可比期间列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

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1月23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	454,310.55	838,896.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	213,918.62	372,533.58
应支付基金管理人的净管理费	240,391.93	466,363.32

注：支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

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1月23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	85,183.17	157,293.19

注：支付基金托管人国泰海通的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

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		
	贝莱德中证A500指数 增强A	贝莱德中证A500指数 增强C	合计
国泰海通	—	3,584.56	3,584.56
合计	—	3,584.56	3,584.56
获得销售服务费的各关	上年度可比期间 2025年1月23日（基金合同生效日）至2025年6月30日		

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德中证A500指数 增强A	贝莱德中证A500指数 增强C	合计
国泰海通	—	42,369.75	42,369.75
合计	—	42,369.75	42,369.75

注：1、本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额。本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金的销售服务费按前一日C类基金份额对应的资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.40%÷当年天数。

2、上表中上年度可比期间列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

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均无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均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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均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

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

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均未发生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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026年06月29日	重大事项停牌	832.00	2026年07月13日	890.99	700	319,816.91	582,400.00	-

注：本基金截至2026年06月30日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

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

本基金为指数增强型基金，其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在日常投资管理中面临的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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风

险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度出发，判断风险的种类、风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度触发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，或者基金所投资证券发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用评级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算，对手为中国证券登记结算有限责任公司；在银行间同业市场根据交易类型采取白名单和黑名单相结合的方式防范交易对手风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的固定收益品种占基金资产净值的比例为0.00%(上年度末：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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

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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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存在相应的利率风险。本期持有银行存款和债券投资等利率敏感性资产。

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	1,107,795.65	-	-	-	1,107,795.65
结算备付金	5,154,142.68	-	-	-	5,154,142.68
存出保证金	-	-	-	745,108.80	745,108.80
交易性金融资产	6,442,675.57	-	-	95,259,661.53	101,702,337.10
应收申购款	-	-	-	314,966.71	314,966.71
资产总计	12,704,613.90	-	-	96,319,737.04	109,024,350.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,539,063.77	1,539,063.77
应付管理人报酬	-	-	-	84,104.82	84,104.82
应付托管费	-	-	-	15,769.62	15,769.62
应付销售服务费	-	-	-	27,611.72	27,611.72
应交税费	-	-	-	204.53	204.53
其他负债	-	-	-	80,952.33	80,952.33
负债总计	-	-	-	1,747,706.79	1,747,706.79
利率敏感度缺口	12,704,613.90	-	-	94,572,030.25	107,276,644.15
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	5,027,812.29	-	-	-	5,027,812.29
结算备付金	2,726,707.73	-	-	-	2,726,707.73
存出保证金	-	-	-	676,257.60	676,257.60
交易性金融资产	6,066,401.10	-	-	-111,880,823.13	117,947,224.23
应收申购款	-	-	-	1,573,565.51	1,573,565.51
资产总计	13,820,921.12	-	-	-114,130,646.24	127,951,567.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,605,631.36	2,605,631.36
应付管理人报酬	-	-	-	89,157.79	89,157.79
应付托管费	-	-	-	16,717.10	16,717.10
应付销售服务费	-	-	-	17,532.77	17,532.77
应交税费	-	-	-	6,610.38	6,610.38
其他负债	-	-	-	42,400.00	42,400.00
负债总计	-	-	-	2,778,049.40	2,778,049.40
利率敏感度缺口	13,820,921.12	-	-	-111,352,596.84	125,173,517.96

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

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		
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）
	市场利率上升25个基点	-8,492.64	-932.98
	市场利率下降25个基点	8,516.25	933.61

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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标

相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，以识别和测算本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	95,259,661.53	88.80	111,880,823.13	89.38
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	95,259,661.53	88.80	111,880,823.13	89.38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）

			日)
	业绩比较基准上升 5%	6,024,823.94	-
	业绩比较基准下降 5%	-6,024,823.94	-

注：于上年度末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值； 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 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	94,677,261.53	111,015,377.13
第二层次	7,025,075.57	6,931,847.10
第三层次	-	-
合计	101,702,337.10	117,947,224.23

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

次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

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	95,259,661.53	87.37
	其中：股票	95,259,661.53	87.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,442,675.57	5.91
	其中：债券	6,442,675.57	5.91
	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	6,261,938.33	5.74
8	其他各项资产	1,060,075.51	0.97
9	合计	109,024,350.94	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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	-	-

B	采矿业	3,024,589.00	2.82
C	制造业	64,038,244.95	59.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,419,358.00	2.26
E	建筑业	40,117.00	0.04
F	批发和零售业	276,357.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	998,288.00	0.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,999,316.60	4.66
J	金融业	6,626,300.00	6.18
K	房地产业	559,008.98	0.52
L	租赁和商务服务业	572,915.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	2,917,031.00	2.72
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	47,687.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	86,519,212.53	80.65

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	209,393.00	0.20
C	制造业	5,687,864.00	5.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	99,915.00	0.09
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	40,536.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	194,983.00	0.18
J	金融业	2,507,758.00	2.34
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,740,449.00	8.15

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	3,600	4,572,000.00	4.26
2	300750	宁德时代	11,300	4,441,013.00	4.14
3	601318	中国平安	55,700	2,659,118.00	2.48
4	600036	招商银行	69,200	2,456,600.00	2.29
5	600900	长江电力	91,400	2,419,358.00	2.26
6	300502	新易盛	3,940	2,391,580.00	2.23
7	600309	万华化学	27,800	1,901,798.00	1.77
8	603259	药明康德	13,400	1,668,434.00	1.56
9	603986	兆易创新	2,000	1,630,000.00	1.52
10	688256	寒武纪	992	1,582,785.60	1.48
11	600031	三一重工	86,900	1,501,632.00	1.40
12	002271	东方雨虹	118,500	1,406,595.00	1.31
13	002415	海康威视	39,600	1,354,320.00	1.26
14	688012	中微公司	2,576	1,206,856.00	1.12
15	002475	立讯精密	17,100	1,203,840.00	1.12

16	688008	澜起科技	3,800	1,177,620.00	1.10
17	002371	北方华创	1,300	1,149,928.00	1.07
18	601899	紫金矿业	45,100	1,133,814.00	1.06
19	002384	东山精密	4,100	1,075,635.00	1.00
20	600519	贵州茅台	900	1,066,941.00	0.99
21	600741	华域汽车	68,600	1,064,672.00	0.99
22	600150	中国船舶	31,300	1,057,627.00	0.99
23	000338	潍柴动力	38,300	1,043,675.00	0.97
24	300012	华测检测	75,100	1,040,886.00	0.97
25	688041	海光信息	2,800	1,036,840.00	0.97
26	688981	中芯国际	6,400	1,016,448.00	0.95
27	002353	杰瑞股份	6,500	991,250.00	0.92
28	688396	华润微	9,500	926,725.00	0.86
29	002001	新和成	32,300	917,966.00	0.86
30	600183	生益科技	5,200	901,680.00	0.84
31	000100	TCL科技	149,600	870,672.00	0.81
32	600030	中信证券	30,000	861,900.00	0.80
33	002028	思源电气	4,700	813,100.00	0.76
34	000333	美的集团	10,600	800,618.00	0.75
35	000792	盐湖股份	25,800	778,902.00	0.73
36	600276	恒瑞医药	14,720	766,028.80	0.71
37	002463	沪电股份	4,700	718,160.00	0.67
38	600018	上港集团	146,900	693,368.00	0.65
39	600885	宏发股份	19,800	682,902.00	0.64
40	601857	中国石油	77,700	674,436.00	0.63
41	688111	金山办公	3,100	660,455.00	0.62
42	300476	胜宏科技	1,900	658,217.00	0.61
43	300394	天孚通信	2,140	647,735.20	0.60
44	688002	睿创微纳	4,100	634,229.00	0.59
45	300408	三环集团	3,800	634,220.00	0.59
46	300604	长川科技	1,800	614,556.00	0.57
47	002603	以岭药业	39,700	595,500.00	0.56
48	688235	百济神州	2,300	585,603.00	0.55
49	688072	拓荆科技	700	582,400.00	0.54
50	688521	芯原股份	1,500	556,710.00	0.52
51	002916	深南电路	1,200	549,480.00	0.51
52	000408	藏格矿业	7,900	547,628.00	0.51
53	688525	佰维存储	1,100	544,203.00	0.51
54	002008	大族激光	3,500	525,385.00	0.49
55	600887	伊利股份	21,800	522,328.00	0.49
56	601233	桐昆股份	23,500	508,775.00	0.47
57	002460	赣锋锂业	7,600	497,040.00	0.46
58	300450	先导智能	11,500	468,280.00	0.44

59	000725	京东方A	53,700	466,116.00	0.43
60	600487	亨通光电	4,100	448,294.00	0.42
61	300124	汇川技术	6,700	444,411.00	0.41
62	002738	中矿资源	7,500	442,425.00	0.41
63	300223	北京君正	1,700	423,130.00	0.39
64	603288	海天味业	12,600	417,816.00	0.39
65	000807	云铝股份	18,600	411,804.00	0.38
66	002064	华峰化学	42,900	407,121.00	0.38
67	300274	阳光电源	2,500	397,550.00	0.37
68	605117	德业股份	3,620	384,371.60	0.36
69	688390	固德威	3,500	379,785.00	0.35
70	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.35
71	002532	天山铝业	34,200	366,966.00	0.34
72	600111	北方稀土	7,300	350,765.00	0.33
73	002410	广联达	41,600	339,456.00	0.32
74	300073	当升科技	6,700	321,868.00	0.30
75	688347	华虹宏力	900	302,670.00	0.28
76	002558	巨人网络	10,900	300,404.00	0.28
77	001979	招商蛇口	46,700	300,281.00	0.28
78	002602	世纪华通	20,300	286,230.00	0.27
79	600489	中金黄金	15,600	281,580.00	0.26
80	002273	水晶光电	7,800	276,744.00	0.26
81	600549	厦门钨业	3,200	272,640.00	0.25
82	600196	复星医药	11,715	263,236.05	0.25
83	000657	中钨高新	2,700	258,444.00	0.24
84	601628	中国人寿	7,300	258,055.00	0.24
85	603019	中科曙光	2,400	257,352.00	0.24
86	002236	大华股份	15,500	255,595.00	0.24
87	300567	精测电子	800	254,080.00	0.24
88	300438	鹏辉能源	3,000	248,550.00	0.23
89	002821	凯莱英	1,500	243,000.00	0.23
90	688099	晶晨股份	2,300	236,670.00	0.22
91	300442	润泽科技	2,800	232,596.00	0.22
92	300751	迈为股份	800	225,968.00	0.21
93	603993	洛阳钼业	12,800	224,640.00	0.21
94	688271	联影医疗	2,200	222,706.00	0.21
95	600460	士兰微	4,000	218,640.00	0.20
96	300661	圣邦股份	1,500	215,220.00	0.20
97	600176	中国巨石	2,900	211,352.00	0.20
98	300972	万辰集团	1,200	208,092.00	0.19
99	300033	同花顺	860	207,260.00	0.19
100	600233	圆通速递	13,000	204,750.00	0.19
101	600316	洪都航空	6,400	178,816.00	0.17

102	601888	中国中免	3,300	177,243.00	0.17
103	002027	分众传媒	35,600	172,304.00	0.16
104	000063	中兴通讯	4,700	170,093.00	0.16
105	300136	信维通信	1,400	166,950.00	0.16
106	300458	全志科技	4,180	164,942.80	0.15
107	688599	天合光能	11,500	162,380.00	0.15
108	000933	神火股份	7,500	159,000.00	0.15
109	000975	山金国际	9,300	158,100.00	0.15
110	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.14
111	603799	华友钴业	3,100	149,606.00	0.14
112	601398	工商银行	20,900	147,763.00	0.14
113	600010	包钢股份	65,300	145,619.00	0.14
114	300058	蓝色光标	10,400	143,104.00	0.13
115	002938	鹏鼎控股	1,300	136,994.00	0.13
116	601633	长城汽车	8,800	132,792.00	0.12
117	300347	泰格医药	2,700	129,600.00	0.12
118	600875	东方电气	4,500	129,465.00	0.12
119	300418	昆仑万维	3,200	129,152.00	0.12
120	688180	君实生物-U	3,800	128,516.00	0.12
121	600426	华鲁恒升	5,300	126,776.00	0.12
122	002497	雅化集团	6,100	124,257.00	0.12
123	603979	金诚信	2,100	123,963.00	0.12
124	000831	中国稀土	2,200	122,078.00	0.11
125	600392	盛和资源	4,100	122,057.00	0.11
126	600096	云天化	3,700	112,480.00	0.10
127	002195	岩山科技	16,400	107,256.00	0.10
128	688213	思特威	1,000	107,070.00	0.10
129	601155	新城控股	9,923	101,809.98	0.09
130	600221	海航控股	74,200	100,170.00	0.09
131	600362	江西铜业	2,300	99,590.00	0.09
132	600893	航发动力	2,500	95,850.00	0.09
133	300017	网宿科技	7,300	94,973.00	0.09
134	300432	富临精工	4,700	94,423.00	0.09
135	688676	金盘科技	1,100	93,104.00	0.09
136	000988	华工科技	500	92,305.00	0.09
137	600988	赤峰黄金	3,500	92,120.00	0.09
138	000426	兴业银锡	2,700	88,992.00	0.08
139	600038	中直股份	3,500	88,515.00	0.08
140	600547	山东黄金	3,800	87,742.00	0.08
141	002812	恩捷股份	1,300	86,983.00	0.08
142	002555	三七互娱	4,500	84,915.00	0.08
143	600438	通威股份	6,900	83,559.00	0.08
144	688122	西部超导	1,300	81,653.00	0.08

145	600372	中航机载	7,500	81,375.00	0.08
146	600415	小商品城	7,900	80,264.00	0.07
147	002517	恺英网络	4,900	79,625.00	0.07
148	002241	歌尔股份	3,500	78,855.00	0.07
149	300759	康龙化成	2,700	78,111.00	0.07
150	000630	铜陵有色	12,200	77,592.00	0.07
151	600941	中国移动	900	77,517.00	0.07
152	603606	东方电缆	1,800	74,718.00	0.07
153	688303	大全能源	4,100	71,463.00	0.07
154	000034	神州数码	2,460	68,265.00	0.06
155	300496	中科创达	1,100	67,969.00	0.06
156	000423	东阿阿胶	1,400	63,504.00	0.06
157	000002	万科A	21,100	62,456.00	0.06
158	601168	西部矿业	2,300	62,422.00	0.06
159	300748	金力永磁	2,000	61,700.00	0.06
160	688036	传音控股	1,000	58,950.00	0.05
161	002155	湖南黄金	2,400	57,288.00	0.05
162	601728	中国电信	10,700	55,533.00	0.05
163	000738	航发控制	3,000	54,870.00	0.05
164	600515	海南机场	19,300	52,882.00	0.05
165	600584	长电科技	500	51,775.00	0.05
166	688608	恒玄科技	300	50,157.00	0.05
167	000039	中集集团	6,100	49,471.00	0.05
168	300251	光线传媒	4,300	47,687.00	0.04
169	000960	锡业股份	1,100	46,959.00	0.04
170	300003	乐普医疗	3,900	46,215.00	0.04
171	000878	云南铜业	2,900	46,052.00	0.04
172	002156	通富微电	600	45,522.00	0.04
173	601100	恒立液压	400	43,024.00	0.04
174	000977	浪潮信息	600	42,000.00	0.04
175	600325	华发股份	18,000	41,580.00	0.04
176	600820	隧道股份	7,700	40,117.00	0.04
177	002414	高德红外	3,000	39,780.00	0.04
178	600711	盛屯矿业	3,600	39,492.00	0.04
179	601166	兴业银行	2,150	35,604.00	0.03
180	600486	扬农化工	700	35,490.00	0.03
181	600660	福耀玻璃	700	35,308.00	0.03
182	000157	中联重科	5,050	35,198.50	0.03
183	300001	特锐德	900	34,047.00	0.03
184	601600	中国铝业	4,100	33,702.00	0.03
185	600219	南山铝业	7,300	29,127.00	0.03

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	600109	国金证券	176,200	1,547,036.00	1.44
2	603345	安井食品	12,000	962,280.00	0.90
3	000729	燕京啤酒	57,600	583,488.00	0.54
4	002487	大金重工	7,500	434,775.00	0.41
5	601077	渝农商行	64,300	392,873.00	0.37
6	300957	贝泰妮	12,100	381,271.00	0.36
7	001389	广合科技	1,300	308,425.00	0.29
8	002841	视源股份	8,600	296,958.00	0.28
9	600764	中国海防	15,300	266,679.00	0.25
10	002142	宁波银行	8,400	249,396.00	0.23
11	688301	奕瑞科技	2,000	248,000.00	0.23
12	300487	蓝晓科技	3,800	223,630.00	0.21
13	603699	纽威股份	3,800	191,140.00	0.18
14	689009	九号公司	4,500	171,675.00	0.16
15	688475	萤石网络	6,000	164,100.00	0.15
16	600184	光电股份	4,800	153,648.00	0.14
17	603160	汇顶科技	2,300	141,933.00	0.13
18	601666	平煤股份	19,100	136,565.00	0.13
19	000708	中信特钢	10,300	129,986.00	0.12
20	301536	星宸科技	1,000	128,710.00	0.12
21	688220	翱捷科技	1,000	124,320.00	0.12
22	600919	江苏银行	10,800	116,424.00	0.11
23	688778	厦钨新能	2,100	114,240.00	0.11
24	601995	中金公司	2,900	104,835.00	0.10
25	688385	复旦微电	1,400	99,806.00	0.09
26	603198	迎驾贡酒	3,200	94,720.00	0.09
27	002850	科达利	500	94,650.00	0.09
28	002299	圣农发展	5,000	75,800.00	0.07
29	688369	致远互联	3,500	73,535.00	0.07
30	601699	潞安环能	5,100	72,828.00	0.07
31	603444	吉比特	200	71,684.00	0.07
32	688311	盟升电子	2,600	68,094.00	0.06
33	000050	深天马A	6,000	59,460.00	0.06
34	600098	广州发展	9,700	57,327.00	0.05
35	688615	合合信息	440	49,764.00	0.05
36	600369	西南证券	12,200	49,044.00	0.05
37	601865	福莱特	4,600	48,346.00	0.05
38	601939	建设银行	5,000	48,150.00	0.04
39	000951	中国重汽	2,400	46,824.00	0.04
40	001286	陕西能源	4,200	42,588.00	0.04
41	603900	莱绅通灵	7,200	40,536.00	0.04
42	688183	生益电子	300	39,720.00	0.04

43	603737	三棵树	1,460	35,186.00	0.03
----	--------	-----	-------	-----------	------

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	300750	宁德时代	3,390,291.00	2.71
2	600900	长江电力	2,881,369.00	2.30
3	600309	万华化学	2,821,378.00	2.25
4	300308	中际旭创	2,625,584.00	2.10
5	601318	中国平安	2,359,580.00	1.89
6	600036	招商银行	2,052,551.00	1.64
7	600276	恒瑞医药	1,912,793.00	1.53
8	600109	国金证券	1,801,576.00	1.44
9	002271	东方雨虹	1,801,068.00	1.44
10	300012	华测检测	1,654,022.00	1.32
11	000157	中联重科	1,638,786.50	1.31
12	601166	兴业银行	1,609,392.00	1.29
13	300502	新易盛	1,586,033.00	1.27
14	600150	中国船舶	1,548,632.00	1.24
15	603345	安井食品	1,522,222.00	1.22
16	600519	贵州茅台	1,489,909.00	1.19
17	000792	盐湖股份	1,447,114.00	1.16
18	002028	思源电气	1,409,047.00	1.13
19	600741	华域汽车	1,329,830.00	1.06
20	002460	赣锋锂业	1,290,644.00	1.03

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

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	300750	宁德时代	5,237,048.00	4.18
2	000333	美的集团	3,741,593.00	2.99
3	300308	中际旭创	3,729,947.00	2.98
4	601318	中国平安	3,612,576.00	2.89
5	600276	恒瑞医药	3,433,465.00	2.74
6	600690	海尔智家	3,404,093.00	2.72
7	600519	贵州茅台	3,163,874.75	2.53
8	601166	兴业银行	3,054,550.00	2.44
9	000725	京东方A	2,935,181.00	2.34
10	600036	招商银行	2,730,867.00	2.18
11	002001	新和成	2,640,293.00	2.11

12	601899	紫金矿业	2,258,047.00	1.80
13	300502	新易盛	2,240,256.80	1.79
14	300274	阳光电源	2,102,139.00	1.68
15	000338	潍柴动力	2,020,089.00	1.61
16	000157	中联重科	1,858,378.00	1.48
17	002008	大族激光	1,805,280.00	1.44
18	600660	福耀玻璃	1,788,773.00	1.43
19	600019	宝钢股份	1,757,844.00	1.40
20	002299	圣农发展	1,556,293.00	1.24

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	135,067,762.69
卖出股票收入（成交）总额	165,836,427.74

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,442,675.57	6.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,442,675.57	6.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26国债01	50,000	5,032,409.59	4.69
2	019792	25国债19	9,000	909,443.10	0.85
3	019835	26国债09	5,000	500,822.88	0.47

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

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	745,108.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	314,966.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,060,075.51

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
贝莱德中 证A500指 数增强A	3,369	10,060.39	2,153,374.33	6.35 %	31,740,084.88	93.65 %
贝莱德中 证A500指 数增强C	5,999	7,591.35	600,031.11	1.32 %	44,940,505.37	98.68 %
合计	9,368	8,479.29	2,753,405.44	3.47 %	76,680,590.25	96.53 %

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	贝莱德中证A500指数增强A	99,519.29	0.2936 %
	贝莱德中证A500指数增强C	21,000.90	0.0461 %
	合计	120,520.19	0.1517 %

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	贝莱德中证A500指数增强A	0~10
	贝莱德中证A500指数增强C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德中证A500指数增强A	0
	贝莱德中证A500指数增强C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德中证A500指数增强A	贝莱德中证A500指数增强C
基金合同生效日 （2025年1月23日） 基金份额总额	216,665,228.96	179,717,959.51
本报告期期初基金份额总额	62,245,856.46	41,210,465.90
本报告期基金总申购份额	18,364,500.47	98,896,744.20
减：本报告期基金总赎回份额	46,716,897.72	94,566,673.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,893,459.21	45,540,536.48

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

基金管理人：2026年上半年，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人：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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及影响基金管理人经营或基金运营业务，或与基金财产相关的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

本报告期内管理人无受调查或处罚等情况。

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，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

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无受调查或处罚等情况。

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(%)	
中国中金财富证券有限公司	2	226,929,053.25	75.42	45,815.60	75.82	-
国泰海通证券股份有限公司	2	62,664,266.37	20.83	12,330.38	20.40	-
中信证券股份有限公司	2	11,310,885.69	3.76	2,282.67	3.78	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如

有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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

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

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

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(%)
中国中金财富证券有限公司	7,104,428.00	55.06	16,500,000.00	79.33	-	-
国泰海通证券股份有限公司	4,998,771.00	38.74	4,300,000.00	20.67	-	-
中信证券股份有限公司	800,243.00	6.20	-	-	-	-

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	贝莱德基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026年3月31日
2	贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026年4月22日
3	贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金（A类份额）产品资料概要更新（2026年第1号）	中国证监会规定媒介	2026年6月27日
4	贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金（C类份额）产品资料概要更	中国证监会规定媒介	2026年6月27日

	新（2026年第1号）		
5	贝莱德中证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年6月27日

§ 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

贝莱德基金管理有限公司

2026年8月31日