

# 博时中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## § 1 重要提示及目录

---

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58

7.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>63</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	博时中证 500 指数增强	
基金主代码	005062	
交易代码	005062	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	361,353,378.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005062	005795
报告期末下属分级基金的份额总额	275,521,331.96 份	85,832,046.50 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。</p>
投资策略	<p>本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金的股票投资策略包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、指数化投资策略。本基金将运用指数化的投资方法，通过控制对各成份股在标的指数中权重的偏离，实现跟踪误差控制目标，达到对标的指数的跟踪目标。</li> <li>2、投资组合构建和优化。本基金将以博时数量化模型对股票的回报预测为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。</li> <li>3、指数增强策略。本基金主要通过博时数量化模型对股票进行综合评定，结合风险控制模型，在控制投资组合风险预算下，对股票组合进行优化，力争获得超越业绩比较基准的回报。</li> <li>4、股票组合调整。包括定期和不定期调整。</li> <li>5、存托凭证投资策略。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，</li> </ol>

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	许俊
	联系电话	0755-83169999	010-66596688
	电子邮箱	service@bosera.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594942
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		江向阳	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	2,955,108.72	779,074.86
本期利润	7,896,452.36	2,470,291.56
加权平均基金份额本期利润	0.0285	0.0275
本期加权平均净值利润率	2.20%	2.17%
本期基金份额净值增长率	2.25%	2.04%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	73,497,126.55	20,653,332.58
期末可供分配基金份额利润	0.2668	0.2406
期末基金资产净值	349,018,458.51	106,485,379.08
期末基金份额净值	1.2668	1.2406
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	26.68%	26.73%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 博时中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.17%	0.80%	-0.77%	0.89%	1.94%	-0.09%
过去三个月	-3.78%	0.72%	-5.10%	0.78%	1.32%	-0.06%
过去六个月	2.25%	0.70%	2.20%	0.75%	0.05%	-0.05%
过去一年	-7.53%	0.90%	-6.65%	0.91%	-0.88%	-0.01%
过去三年	4.00%	1.14%	2.48%	1.13%	1.52%	0.01%
自基金合同生效起至今	26.68%	1.29%	-6.53%	1.28%	33.21%	0.01%

##### 博时中证 500 指数增强 C

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



过去一个月	1.13%	0.80%	-0.77%	0.89%	1.90%	-0.09%
过去三个月	-3.88%	0.72%	-5.10%	0.78%	1.22%	-0.06%
过去六个月	2.04%	0.70%	2.20%	0.75%	-0.16%	-0.05%
过去一年	-7.91%	0.90%	-6.65%	0.91%	-1.26%	-0.01%
过去三年	2.74%	1.14%	2.48%	1.13%	0.26%	0.01%
自基金合同生效起至今	26.73%	1.29%	-1.26%	1.29%	27.99%	0.00%

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

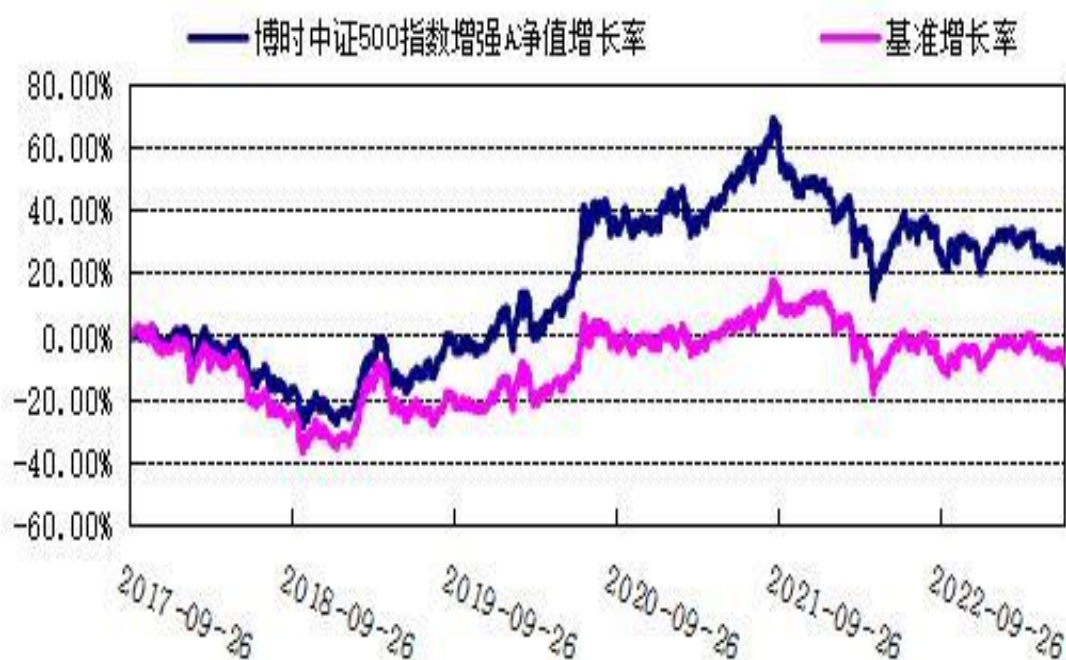
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

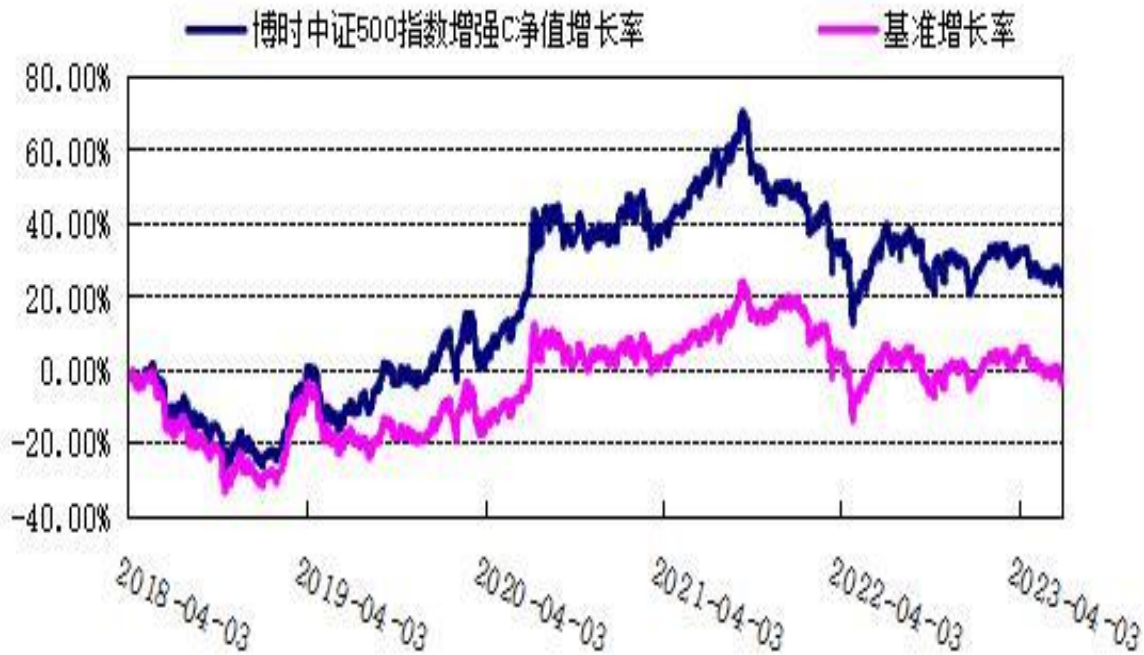
(2017 年 9 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日)

#### 博时中证 500 指数增强 A



#### 博时中证 500 指数增强 C





## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 14767 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2020-12-23	-	16.8	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基

					金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日一至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日一至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日一至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日一至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日一至今)的基金经理。
刘玉强	基金经理助理	2020-02-21	2023-02-06	7.9	刘玉强先生，硕士。2015 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任研究员、基金经理助理。现任博时专精特新主题混合型证券投资基金(2023 年 2 月 1 日一至今)的基金经理。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 89 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，人工智能和中特估是市场关注的热点，冲高回落的态势进一步印证了 A 股整体上的宽幅震荡趋势；“结构化”和“反转”则是行情演绎的另两个特征。在这一背景下，A 股各行业赛道之间的差异较大，之前一年表现不佳的计算机、传媒、通讯、电子等人工智能相关行业和央企主题在 2023 年上半年仍然是整体上行；而消费者服务、食品饮料、房地产和 2021 年风光无限的电力设备及新能源等行业则为负收益。资金场内博弈的态势得以延续，“反转”特征也将继续延续。

从因子角度来看，上半年价值类因子维持上升通道；成长、分析师等因子则整体上呈现下跌趋势，并有所企稳；风险因子中的小市值等因子十分突出，延续了去年下半年以来的强趋势。

不过即便市场多有变化，本基金仍然坚持了相对稳定且偏长期的因子配置逻辑：以业绩基准指数中证 500 指数为锚，不做仓位择时，只追求超额收益；在因子的配置上，坚持成长、分析师、价值、动量、反转等因子的协同互补，坚持模型逻辑的合理性和一致性；控制跟踪误差，限制市值敞口的一定偏离，控制行业风险敞口的偏离。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2668 元，份额累计净值为 1.2668 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2406 元，份额累计净值为 1.2406 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 2.25%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 2.04%，同期业绩基准增长率为 2.20%。

## 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，宏观层面，A 股大结构见底的概率日益增强。近日召开的政治局会议在分析研究当前经济形势时作出了明确判断。疫情防控平稳转段后，我国经济逐步向常态化运行轨道回归，综合优势仍然突出，作为世界第二大经济体、第二大消费市场、制造业第一大国、货物贸易第一大国、服务贸易第二大国、外汇储备第一大国的地位继续巩固，为我们抵御各种风险挑战、跃上更高发展阶段筑牢了基石。随着宏观调控的继续开展，A 股从底部回升的概率日益增强。

在因子层面，随着市场炒作热度的降温，上市公司的股价终将回归基本面：相对景气的行业、有扎实的业绩增长的公司将会表现略好。因此，成长、分析师等因子迟早将回归上升通道。

本基金将继续坚持量化多因子模型的框架，紧扣长期表现稳定、逻辑清晰的因子，坚持控制基金与业绩基准中证 500 指数的跟踪误差，适当暴露一定的行业偏离，根据模型结果配置股票组合，争取获得一定的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

无。

---

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	23,890,279.78	25,550,044.55
结算备付金		5,484,763.54	5,611,334.85
存出保证金		53,121.62	74,971.68
交易性金融资产	6.4.3.2	428,129,302.10	425,539,618.12
其中：股票投资		428,129,302.10	425,539,618.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		1,493,219.10	12,266,645.11
应收股利		-	-
应收申购款		352,464.12	439,899.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		459,403,150.26	469,482,514.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,359,717.94	11,311,427.15
应付赎回款		369,088.55	480,667.62
应付管理人报酬		373,005.91	393,044.78
应付托管费		74,601.16	78,608.93
应付销售服务费		35,351.45	38,911.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	1,687,547.66	1,710,588.64
负债合计		3,899,312.67	14,013,248.78
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	361,353,378.46	369,360,785.04
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	94,150,459.13	86,108,480.19
净资产合计		455,503,837.59	455,469,265.23
<b>负债和净资产总计</b>		<b>459,403,150.26</b>	<b>469,482,514.01</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 361,353,378.46 份。其中 A 类基金份额净值 1.2668 元，基金份额总额 275,521,331.96 份；C 类基金份额净值 1.2406 元，基金份额总额 85,832,046.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金



本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		13,594,812.64	-47,244,073.67
1. 利息收入		96,032.12	123,369.21
其中：存款利息收入	6.4.3.10	96,032.12	123,369.21
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,858,967.23	-67,619,071.92
其中：股票投资收益	6.4.3.11	2,007,982.32	-71,061,518.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	171,790.15
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-1,116,132.80
股利收益	6.4.3.15	4,850,984.91	4,386,789.38
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	6,632,560.34	20,230,782.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	7,252.95	20,846.62
<b>减：二、营业总支出</b>		3,228,068.72	3,477,045.12
1. 管理人报酬		2,340,748.83	2,547,361.03
2. 托管费		468,149.73	509,472.19
3. 销售服务费		226,205.25	227,858.29
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		-	8.86
8. 其他费用	6.4.3.19	192,964.91	192,344.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,366,743.92	-50,721,118.79
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,366,743.92	-50,721,118.79
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-



六、综合收益总额		10,366,743.92	-50,721,118.79
----------	--	---------------	----------------

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	369,360,785.04	-	86,108,480.19	455,469,265.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	369,360,785.04	-	86,108,480.19	455,469,265.23
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-8,007,406.58	-	8,041,978.94	34,572.36
（一）、综合收益总额	-	-	10,366,743.92	10,366,743.92
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-8,007,406.58	-	-2,324,764.98	-10,332,171.56
其中：1. 基金申购款	45,744,764.59	-	12,933,738.55	58,678,503.14
2. 基金赎回款	-53,752,171.17	-	-15,258,503.53	-69,010,674.70
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	361,353,378.46	-	94,150,459.13	455,503,837.59
项目	上年度可比期间			

	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	413,289,847.43	-	201,112,777.23	614,402,624.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	413,289,847.43	-	201,112,777.23	614,402,624.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-57,343,564.06	-	-71,425,788.58	-128,769,352.64
(一)、综合收益总额	-	-	-50,721,118.79	-50,721,118.79
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-57,343,564.06	-	-20,704,669.79	-78,048,233.85
其中：1. 基金申购款	106,298,680.54	-	33,961,008.33	140,259,688.87
2. 基金赎回款	-163,642,244.60	-	-54,665,678.12	-218,307,922.72
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	355,946,283.37	-	129,686,988.65	485,633,272.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：侣方方

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.2 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、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。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	23,890,279.78
等于：本金	23,887,995.59
加：应计利息	2,284.19
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	23,890,279.78

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	436,979,606.18	-	428,129,302.10	-8,850,304.08
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	436,979,606.18	-	428,129,302.10	-8,850,304.08
----	----------------	---	----------------	---------------

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.3.5 其他权益工具投资

##### 6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.3.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	59.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,298,228.50
其中：交易所市场	1,298,228.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	300,000.00
合计	1,687,547.66

#### 6.4.3.8 实收基金

博时中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	277,095,237.58	277,095,237.58
本期申购	22,533,442.91	22,533,442.91
本期赎回（以“-”号填列）	-24,107,348.53	-24,107,348.53
本期末	275,521,331.96	275,521,331.96

**博时中证 500 指数增强 C**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	92,265,547.46	92,265,547.46
本期申购	23,211,321.68	23,211,321.68
本期赎回（以“-”号填列）	-29,644,822.64	-29,644,822.64
本期末	85,832,046.50	85,832,046.50

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

**6.4.3.9 未分配利润**
**博时中证 500 指数增强 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75,905,139.54	-9,704,200.54	66,200,939.00
本期利润	2,955,108.72	4,941,343.64	7,896,452.36
本期基金份额交易产生的变动数	-617,804.21	17,539.40	-600,264.81
其中：基金申购款	6,692,885.00	-55,155.40	6,637,729.60
基金赎回款	-7,310,689.21	72,694.80	-7,237,994.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,242,444.05	-4,745,317.50	73,497,126.55

**博时中证 500 指数增强 C**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,129,598.96	-3,222,057.77	19,907,541.19
本期利润	779,074.86	1,691,216.70	2,470,291.56
本期基金份额交易产生的变动数	-1,759,069.43	34,569.26	-1,724,500.17
其中：基金申购款	6,285,230.13	10,778.82	6,296,008.95
基金赎回款	-8,044,299.56	23,790.44	-8,020,509.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,149,604.39	-1,496,271.81	20,653,332.58

**6.4.3.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	47,248.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	48,157.83
其他	625.57
合计	96,032.12

**6.4.3.11 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,872,133,417.08
减：卖出股票成本总额	1,865,234,936.02
减：交易费用	4,890,498.74
买卖股票差价收入	2,007,982.32

**6.4.3.12 债券投资收益**
**6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无发生额。

**6.4.3.13 资产支持证券投资收益**
**6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无发生额。

**6.4.3.14 衍生工具收益**
**6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无发生额。

**6.4.3.15 股利收益**

单位：人民币元



项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,850,984.91
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	4,850,984.91

#### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,632,560.34
——股票投资	6,632,560.34
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	6,632,560.34

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,934.40
基金转换费收入	318.55
合计	7,252.95

#### 6.4.3.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	36.65

指数使用费	100,000.00
银行汇划费	3,668.11
合计	192,964.91

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	1,144,202,104.11	30.73%	1,117,433,405.76	29.48%

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	836,767.19	30.73%	383,776.99	29.56%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	817,186.13	29.48%	-	-

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

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

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,340,748.83
其中：支付销售机构的客户维护费	786,710.43	749,569.28

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的托管费	468,149.73

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

**6.4.6.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	34,070.56	34,070.56
合计	-	34,070.56	34,070.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	35,705.11	35,705.11
合计	-	35,705.11	35,705.11

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

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

**6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**
**6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

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

无。

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

无。

**6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	23,890,279.78	47,248.72	31,150,269.41	73,720.60

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	6,185.00	156,171.25
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	002948	青岛银行	网下发行	267,660.00	856,512.00
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	4,622.00	172,077.06
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票
---------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688435	英方软件	2023-01-12	6 个月	首次公开发行限售	38.66	73.03	2,728.00	105,64.48	199,225.84	-
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	2,445.00	140,978.70	140,978.70	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,676.00	124,755.68	124,755.68	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241.00	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	5 个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,754.00	71,108.28	71,108.28	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7 个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	2,826.00	56,124.36	51,037.56	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	首次公开发行限售	5.00	8.96	3,423.00	17,115.00	30,670.08	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	1,767.00	19,613.70	30,109.68	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	首次公开发行限售	5.69	5.41	5,017.00	28,546.73	27,141.97	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	首次公开	76.80	107.95	250.00	19,200.00	26,987.50	-

				发行 限售							
68836 1	中科 飞测	2023- 05-12	6 个月	首次 公开发 行 限售	23.60	64.67	409.0 0	9,652 .40	26,45 0.03	-	
30129 3	三博 脑科	2023- 04-25	6 个月	首次 公开发 行 限售	29.60	71.42	333.0 0	9,856 .80	23,78 2.86	-	
30135 8	湖南 裕能	2023- 02-01	6 个月	首次 公开发 行 限售	23.77	42.89	535.0 0	12,71 6.95	22,94 6.15	-	
68857 6	西山 科技	2023- 05-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	135.8 0	120.4 1	171.0 0	23,22 1.80	20,59 0.11	-	
68844 3	智翔 金泰	2023- 06-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	37.88	29.49	676.0 0	25,60 6.88	19,93 5.24	-	
30129 1	明阳 电气	2023- 06-21	6 个月	首次 公开发 行 限售	38.13	31.03	620.0 0	23,64 0.60	19,23 8.60	-	
30130 7	美利 信	2023- 04-14	6 个月	首次 公开发 行 限售	32.34	31.86	591.0 0	19,11 2.94	18,82 9.26	-	
68848 4	南芯 科技	2023- 03-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	39.99	36.71	504.0 0	20,15 4.96	18,50 1.84	-	
68858 2	芯动 联科	2023- 06-21	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.74	40.68	450.0 0	12,03 3.00	18,30 6.00	-	
68814 6	中船 特气	2023- 04-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	36.15	38.13	474.0 0	17,13 5.10	18,07 3.62	-	
68853 1	日联 科技	2023- 03-24	6 个月	首次 公开	152.3 8	135.9 7	127.0 0	19,35 2.26	17,26 8.19	-	



				发行 限售							
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次 公开发 行 限售	43.67	53.05	325.0 0	14,19 2.75	17,24 1.25	-	
68847 8	晶升 股份	2023- 04-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	32.52	42.37	402.0 0	13,07 3.04	17,03 2.74	-	
30130 3	真兰 仪表	2023- 02-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.80	22.32	741.0 0	19,85 8.80	16,53 9.12	-	
68856 2	航天 软件	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	12.68	22.31	726.0 0	9,205 .68	16,19 7.06	-	
30148 6	致尚 科技	2023- 06-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	57.66	57.66	272.0 0	15,68 3.52	15,68 3.52	-	
30124 6	宏源 药业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	50.00	30.71	497.0 0	24,85 0.00	15,26 2.87	-	
68835 2	顾中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次 公开发 行 限售	12.10	12.07	1,248 .00	15,10 0.80	15,06 3.36	-	
30138 3	天键 股份	2023- 05-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	46.16	35.72	418.0 0	19,29 4.88	14,93 0.96	-	
30140 8	华人 健康	2023- 02-22	6 个月	首次 公开发 行 限售	16.24	16.95	879.0 0	14,27 4.96	14,89 9.05	-	
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	75.00	90.76	164.0 0	12,30 0.00	14,88 4.64	-	
30141 9	阿莱 德	2023- 02-02	6 个月	首次 公开	24.80	43.85	330.0 0	8,184 .00	14,47 0.50	-	

				发行 限售							
00128 7	中电 港	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.88	21.02	687.0 0	8,161 .56	14,44 0.74	-	
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.17	23.50	608.0 0	12,87 1.36	14,28 8.00	-	
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.16	16.21	875.0 0	12,39 0.00	14,18 3.75	-	
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.18	14.59	959.0 0	10,72 1.62	13,99 1.81	-	
30138 7	光大 同创	2023- 04-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	58.32	45.36	307.0 0	17,90 4.24	13,92 5.52	-	
30139 5	仁信 新材	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.68	26.68	520.0 0	13,87 3.60	13,87 3.60	-	
30121 0	金杨 股份	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	57.88	49.17	281.0 0	16,26 4.28	13,81 6.77	-	
68858 1	安杰 思	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	125.8 0	118.0 3	114.0 0	14,34 1.20	13,45 5.42	-	
30138 2	蜂助 手	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.80	32.84	408.0 0	9,710 .40	13,39 8.72	-	
30132 0	豪江 智能	2023- 06-01	6 个月	首次 公开 发行 限售	13.06	20.62	642.0 0	8,384 .52	13,23 8.04	-	
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开	20.92	19.16	689.0 0	14,41 3.88	13,20 1.24	-	

				发行 限售							
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.66	31.50	418.0 0	11,14 3.88	13,16 7.00	-	
68862 9	华丰 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	9.26	18.59	708.0 0	6,556 .08	13,16 1.72	-	
30133 2	德尔 玛	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.81	13.73	928.0 0	13,74 3.68	12,74 1.44	-	
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	10.68	12.34	1,016 .00	10,85 0.88	12,53 7.44	-	
30136 0	荣旗 科技	2023- 04-17	6 个月	首次 公开 发行 限售	71.88	92.60	134.0 0	9,631 .92	12,40 8.40	-	
30130 5	朗坤 环境	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.25	19.69	619.0 0	15,62 9.75	12,18 8.11	-	
30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	19.99	583.0 0	11,65 4.17	11,65 4.17	-	
30132 2	绿通 科技	2023- 02-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	87.41	53.24	216.0 0	18,87 9.84	11,49 9.84	-	
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.86	23.85	472.0 0	10,31 7.92	11,25 7.20	-	
30114 1	中科 磁业	2023- 03-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	41.20	42.69	262.0 0	10,79 4.40	11,18 4.78	-	
30148 8	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个月	首次 公开	39.78	39.78	262.0 0	10,42 2.36	10,42 2.36	-	

				发行 限售							
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.28	29.87	336.0 0	8,494 .08	10,03 6.32	-	
60106 1	中信 金属	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	6.58	7.58	1,306 .00	8,593 .48	9,899 .48	-	
68847 9	友车 科技	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限售	33.99	29.49	332.0 0	11,28 4.68	9,790 .68	-	
30123 2	飞沃 科技	2023- 06-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	72.50	58.42	165.0 0	11,96 2.50	9,639 .30	-	
30143 9	泓淋 电力	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	16.90	560.0 0	11,19 4.40	9,464 .00	-	
30135 5	南王 科技	2023- 06-02	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.55	16.75	563.0 0	9,880 .65	9,430 .25	-	
30135 7	北方 长龙	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	50.00	48.39	190.0 0	9,500 .00	9,194 .10	-	
30138 6	未来 电器	2023- 03-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	29.99	23.79	378.0 0	11,33 6.22	8,992 .62	-	
30132 3	新莱 福	2023- 05-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.06	39.36	228.0 0	8,905 .68	8,974 .08	-	
30137 3	凌玮 科技	2023- 01-20	6 个月	首次 公开 发行 限售	33.73	31.85	277.0 0	9,343 .21	8,822 .45	-	
30117 0	锡南 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开	34.00	34.93	250.0 0	8,500 .00	8,732 .50	-	

				发行 限售							
60313 5	中重 科技	2023- 03-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.80	17.89	465.0 0	8,277 .00	8,318 .85	-	
68853 5	华海 诚科	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	35.00	51.23	161.0 0	5,635 .00	8,248 .03	-	
30120 2	朗威 股份	2023- 06-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.82	25.82	306.0 0	7,900 .92	7,900 .92	-	
30129 5	美硕 科技	2023- 06-19	6 个月	首次 公开 发行 限售	37.40	36.07	215.0 0	8,041 .00	7,755 .05	-	
30134 5	涛涛 车业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	73.45	46.64	166.0 0	12,19 2.70	7,742 .24	-	
30120 3	国泰 环保	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	46.13	34.40	225.0 0	10,37 9.25	7,740 .00	-	
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	36.90	36.90	198.0 0	7,306 .20	7,306 .20	-	
30142 8	世纪 恒通	2023- 05-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.35	30.60	229.0 0	6,034 .15	7,007 .40	-	
60113 3	柏诚 股份	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.66	12.26	460.0 0	5,363 .60	5,639 .60	-	
60106 5	江盐 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	10.36	11.84	448.0 0	4,641 .28	5,304 .32	-	
00138 0	华纬 科技	2023- 05-09	6 个月	首次 公开	28.84	30.78	170.0 0	4,902 .80	5,232 .60	-	

				发行 限售							
00132 8	登康 口腔	2023- 03-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	20.68	25.49	145.0 0	2,998 .60	3,696 .05	-	
60312 5	常青 科技	2023- 03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.98	24.53	148.0 0	3,845 .04	3,630 .44	-	
00128 2	三联 锻造	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	27.93	33.03	105.0 0	2,932 .65	3,468 .15	-	
00136 0	南矿 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	15.38	14.87	177.0 0	2,722 .26	2,631 .99	-	
60313 7	恒尚 节能	2023- 04-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	15.90	17.09	139.0 0	2,210 .10	2,375 .51	-	
00132 4	长青 科技	2023- 05-12	6 个月	首次 公开发 行 限售	18.88	19.60	114.0 0	2,152 .32	2,234 .40	-	
00136 7	海森 药业	2023- 03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	44.48	39.48	55.00	2,446 .40	2,171 .40	-	
60317 2	万丰 股份	2023- 04-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	14.58	16.13	122.0 0	1,778 .76	1,967 .86	-	

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	1,900.00	13,110.00	13,243.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 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证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%，实现对中证 500 指数的有效跟踪。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估



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

#### 6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	23,890,279.78	-	-	-	23,890,279.78
结算备付金	5,484,763.54	-	-	-	5,484,763.54
存出保证金	53,121.62	-	-	-	53,121.62
交易性金融资产	-	-	-	428,129,302.10	428,129,302.10
应收清算款	-	-	-	1,493,219.10	1,493,219.10
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	352,464.12	352,464.12
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>29,428,164.94</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>429,974,985.32</b>	<b>459,403,150.26</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	369,088.55	369,088.55
应付清算款	-	-	-	1,359,717.94	1,359,717.94
应付管理人报酬	-	-	-	373,005.91	373,005.91
应付托管费	-	-	-	74,601.16	74,601.16
应付销售服务费	-	-	-	35,351.45	35,351.45
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,687,547.66	1,687,547.66
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>3,899,312.67</b>	<b>3,899,312.67</b>
利率敏感度缺口	29,428,164.94	-	-	-426,075,672.65	455,503,837.59
<b>上年度末</b> 2022 年 12 月 31 日	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	25,550,044.55	-	-	-	25,550,044.55
结算备付金	5,611,334.85	-	-	-	5,611,334.85
存出保证金	74,971.68	-	-	-	74,971.68
交易性金融资产	-	-	-	425,539,618.12	425,539,618.12
应收清算款	-	-	-	12,266,645.11	12,266,645.11
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	439,899.70	439,899.70
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>31,236,351.08</b>	-	-	<b>438,246,162.93</b>	<b>469,482,514.01</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	480,667.62	480,667.62
应付清算款	-	-	-	11,311,427.15	11,311,427.15
应付管理人报酬	-	-	-	393,044.78	393,044.78
应付托管费	-	-	-	78,608.93	78,608.93
应付销售服务费	-	-	-	38,911.66	38,911.66
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-1,710,588.64	1,710,588.64
负债总计	-	-	14,013,248.78	14,013,248.78
利率敏感度缺口	31,236,351.08	-	424,232,914.15	455,469,265.23

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	428,129,302.10	93.99	425,539,618.12	93.43
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	428,129,302.10	93.99	425,539,618.12	93.43

##### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,147	增加约 2,075
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,147	减少约 2,075

#### 6.4.10 公允价值

##### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	426,266,547.21
第二层次	680,913.20
第三层次	1,181,841.69
合计	428,129,302.10

###### 6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	428,129,302.10	93.19
	其中：股票	428,129,302.10	93.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,375,043.32	6.39
8	其他各项资产	1,898,804.84	0.41
9	合计	459,403,150.26	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,170,445.00	0.48
B	采矿业	16,979,165.50	3.73
C	制造业	273,555,448.00	60.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,197,130.20	2.24
E	建筑业	3,324,527.67	0.73
F	批发和零售业	11,791,496.27	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业	3,121,682.00	0.69
H	住宿和餐饮业	4,258,065.00	0.93
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,978,390.34	6.36
J	金融业	41,670,495.40	9.15
K	房地产业	9,103,313.00	2.00



L	租赁和商务服务业	990,463.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	5,785,428.75	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	8,261,065.11	1.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	7,464,174.00	1.64
S	综合	454,230.00	0.10
	合计	428,129,302.10	93.99

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002422	科伦药业	235,400	6,986,672.00	1.53
2	002373	千方科技	426,100	5,812,004.00	1.28
3	688002	睿创微纳	120,700	5,407,360.00	1.19
4	603688	石英股份	47,000	5,350,480.00	1.17
5	600418	江淮汽车	423,600	5,333,124.00	1.17
6	601958	金铂股份	472,300	5,266,145.00	1.16
7	000967	盈峰环境	976,300	4,930,315.00	1.08
8	300146	汤臣倍健	205,500	4,927,890.00	1.08
9	601717	郑煤机	388,500	4,836,825.00	1.06
10	600060	海信视像	192,800	4,771,800.00	1.05
11	688029	南微医学	58,296	4,754,621.76	1.04
12	688208	道通科技	150,055	4,548,167.05	1.00
13	600535	天士力	309,300	4,487,943.00	0.99
14	600637	东方明珠	560,500	4,383,110.00	0.96
15	002025	航天电器	67,300	4,293,740.00	0.94
16	603218	日月股份	226,037	4,292,442.63	0.94
17	600258	首旅酒店	224,700	4,258,065.00	0.93
18	002056	横店东磁	231,200	4,210,152.00	0.92
19	000997	新大陆	220,800	4,173,120.00	0.92
20	301029	怡合达	93,320	4,169,537.60	0.92
21	600655	豫园股份	602,200	4,131,092.00	0.91
22	002926	华西证券	492,800	4,095,168.00	0.90
23	300136	信维通信	202,700	4,070,216.00	0.89
24	000739	普洛药业	227,000	4,026,980.00	0.88
25	000563	陕国投 A	1,304,400	3,978,420.00	0.87
26	688188	柏楚电子	20,800	3,922,048.00	0.86
27	603127	昭衍新药	94,400	3,860,960.00	0.85
28	002595	豪迈科技	109,500	3,846,735.00	0.84
29	688390	固德威	22,989	3,835,944.54	0.84

30	688006	杭可科技	123,540	3,764,263.80	0.83
31	002563	森马服饰	598,000	3,719,560.00	0.82
32	603868	飞科电器	57,900	3,652,911.00	0.80
33	600517	国网英大	635,000	3,619,500.00	0.79
34	600167	联美控股	516,300	3,598,611.00	0.79
35	002600	领益智造	508,200	3,511,662.00	0.77
36	000031	大悦城	945,300	3,459,798.00	0.76
37	000400	许继电气	148,400	3,420,620.00	0.75
38	600143	金发科技	386,500	3,374,145.00	0.74
39	000060	中金岭南	686,500	3,260,875.00	0.72
40	601928	凤凰传媒	276,900	3,156,660.00	0.69
41	600066	宇通客车	213,600	3,148,464.00	0.69
42	002568	百润股份	83,500	3,035,225.00	0.67
43	600329	达仁堂	67,100	3,012,119.00	0.66
44	002500	山西证券	527,300	2,942,334.00	0.65
45	600549	厦门钨业	147,000	2,797,410.00	0.61
46	000783	长江证券	481,800	2,794,440.00	0.61
47	002081	金螳螂	600,556	2,708,507.56	0.59
48	000750	国海证券	806,900	2,703,115.00	0.59
49	002250	联化科技	256,700	2,685,082.00	0.59
50	002203	海亮股份	223,200	2,680,632.00	0.59
51	002985	北摩高科	60,500	2,669,260.00	0.59
52	600623	华谊集团	427,400	2,662,702.00	0.58
53	600707	彩虹股份	540,700	2,573,732.00	0.57
54	600369	西南证券	703,300	2,567,045.00	0.56
55	000156	华数传媒	289,500	2,518,650.00	0.55
56	688819	天能股份	67,692	2,493,773.28	0.55
57	600315	上海家化	84,900	2,462,949.00	0.54
58	300866	安克创新	27,800	2,432,500.00	0.53
59	688082	盛美上海	21,200	2,340,480.00	0.51
60	600582	天地科技	382,500	2,229,975.00	0.49
61	603883	老百姓	73,700	2,199,945.00	0.48
62	300070	碧水源	405,800	2,175,088.00	0.48
63	002673	西部证券	342,400	2,174,240.00	0.48
64	601077	渝农商行	603,700	2,167,283.00	0.48
65	603317	天味食品	145,600	2,127,216.00	0.47
66	002423	中粮资本	263,500	2,108,000.00	0.46
67	600597	光明乳业	201,300	2,093,520.00	0.46
68	002625	光启技术	136,600	2,084,516.00	0.46
69	001914	招商积余	137,600	2,070,880.00	0.45
70	601162	天风证券	692,200	2,062,756.00	0.45
71	600481	双良节能	146,800	2,052,264.00	0.45
72	688516	奥特维	10,074	1,897,941.60	0.42

73	002215	诺普信	236,000	1,772,360.00	0.39
74	000878	云南铜业	160,330	1,771,646.50	0.39
75	002531	天顺风能	115,600	1,760,588.00	0.39
76	002065	东华软件	244,400	1,725,464.00	0.38
77	002223	鱼跃医疗	47,500	1,709,525.00	0.38
78	000728	国元证券	254,200	1,657,384.00	0.36
79	000591	太阳能	240,500	1,630,590.00	0.36
80	688281	华秦科技	8,000	1,620,000.00	0.36
81	002273	水晶光电	135,000	1,611,900.00	0.35
82	688301	奕瑞科技	5,610	1,584,432.30	0.35
83	002518	科士达	39,600	1,584,396.00	0.35
84	600718	东软集团	148,300	1,580,878.00	0.35
85	002381	双箭股份	204,200	1,576,424.00	0.35
86	688510	航亚科技	78,626	1,563,871.14	0.34
87	002867	周大生	83,600	1,486,408.00	0.33
88	601108	财通证券	205,080	1,484,779.20	0.33
89	000830	鲁西化工	139,300	1,471,008.00	0.32
90	300855	图南股份	41,300	1,458,716.00	0.32
91	601168	西部矿业	138,700	1,457,737.00	0.32
92	000048	京基智农	74,200	1,448,384.00	0.32
93	688357	建龙微纳	22,120	1,430,942.80	0.31
94	688626	翔宇医疗	31,400	1,429,014.00	0.31
95	600008	首创环保	495,100	1,425,888.00	0.31
96	600635	大众公用	429,100	1,424,612.00	0.31
97	600612	老凤祥	20,300	1,418,564.00	0.31
98	300009	安科生物	141,600	1,416,000.00	0.31
99	600998	九州通	130,040	1,349,815.20	0.30
100	600153	建发股份	121,700	1,327,747.00	0.29
101	600704	物产中大	263,800	1,303,172.00	0.29
102	002152	广电运通	110,600	1,296,232.00	0.28
103	600985	淮北矿业	111,900	1,289,088.00	0.28
104	688722	同益中	67,000	1,242,180.00	0.27
105	300363	博腾股份	41,600	1,230,944.00	0.27
106	600497	驰宏锌锗	244,400	1,226,888.00	0.27
107	600598	北大荒	91,600	1,221,028.00	0.27
108	300088	长信科技	202,200	1,219,266.00	0.27
109	601555	东吴证券	173,800	1,206,172.00	0.26
110	002249	大洋电机	210,800	1,201,560.00	0.26
111	601992	金隅集团	547,200	1,192,896.00	0.26
112	688072	拓荆科技	2,800	1,192,716.00	0.26
113	002683	广东宏大	40,400	1,189,376.00	0.26
114	600959	江苏有线	350,000	1,183,000.00	0.26
115	000039	中集集团	170,300	1,173,367.00	0.26

116	601231	环旭电子	78,000	1,166,880.00	0.26
117	600583	海油工程	196,600	1,150,110.00	0.25
118	603529	爱玛科技	35,100	1,130,922.00	0.25
119	000768	中航西飞	41,500	1,110,125.00	0.24
120	600487	亨通光电	74,900	1,098,034.00	0.24
121	300383	光环新网	98,200	1,055,650.00	0.23
122	600271	航天信息	75,800	1,037,702.00	0.23
123	600895	张江高科	73,500	1,023,120.00	0.22
124	600348	华阳股份	126,350	999,428.50	0.22
125	603589	口子窖	20,100	991,935.00	0.22
126	000596	古井贡酒	3,900	964,782.00	0.21
127	000636	风华高科	62,200	954,148.00	0.21
128	300017	网宿科技	133,100	946,341.00	0.21
129	600909	华安证券	202,200	944,274.00	0.21
130	600879	航天电子	107,600	913,524.00	0.20
131	600325	华发股份	90,400	890,440.00	0.20
132	002030	达安基因	89,196	889,284.12	0.20
133	601869	长飞光纤	23,900	884,539.00	0.19
134	601000	唐山港	248,900	878,617.00	0.19
135	000630	铜陵有色	302,200	873,358.00	0.19
136	600968	海油发展	284,100	872,187.00	0.19
137	603858	步长制药	41,800	860,662.00	0.19
138	601098	中南传媒	72,100	836,360.00	0.18
139	600737	中粮糖业	103,100	829,955.00	0.18
140	600126	杭钢股份	189,400	821,996.00	0.18
141	600373	中文传媒	61,700	821,844.00	0.18
142	002128	电投能源	61,800	816,996.00	0.18
143	600489	中金黄金	78,100	806,773.00	0.18
144	002532	天山铝业	130,500	781,695.00	0.17
145	605167	利柏特	80,500	779,240.00	0.17
146	300308	中际旭创	5,000	737,250.00	0.16
147	603866	桃李面包	70,500	713,460.00	0.16
148	600298	安琪酵母	19,300	698,853.00	0.15
149	600161	天坛生物	25,700	697,755.00	0.15
150	600208	新潮中宝	280,000	694,400.00	0.15
151	300115	长盈精密	58,100	691,971.00	0.15
152	300390	天华新能	19,310	691,298.00	0.15
153	002017	东信和平	52,150	683,686.50	0.15
154	601012	隆基绿能	23,800	682,346.00	0.15
155	000906	浙商中拓	75,200	670,784.00	0.15
156	000629	钒钛股份	170,700	667,437.00	0.15
157	601966	玲珑轮胎	30,000	666,600.00	0.15
158	300699	光威复材	21,600	666,360.00	0.15

159	601997	贵阳银行	128,500	663,060.00	0.15
160	300438	鹏辉能源	13,800	662,952.00	0.15
161	300724	捷佳伟创	5,900	662,865.00	0.15
162	600699	均胜电子	37,300	657,972.00	0.14
163	002155	湖南黄金	53,900	657,580.00	0.14
164	002624	完美世界	38,400	648,576.00	0.14
165	688248	南网科技	16,600	637,274.00	0.14
166	600109	国金证券	73,300	635,511.00	0.14
167	002299	圣农发展	33,100	633,865.00	0.14
168	000559	万向钱潮	116,300	633,835.00	0.14
169	605358	立昂微	17,200	631,756.00	0.14
170	688777	中控技术	9,961	625,351.58	0.14
171	603737	三棵树	9,420	616,256.40	0.14
172	600339	中油工程	150,500	612,535.00	0.13
173	688521	芯原股份	8,500	611,320.00	0.13
174	600038	中直股份	15,100	601,282.00	0.13
175	000887	中鼎股份	45,500	595,595.00	0.13
176	600435	北方导航	51,600	592,884.00	0.13
177	000933	神火股份	45,400	590,200.00	0.13
178	300418	昆仑万维	14,600	588,088.00	0.13
179	600801	华新水泥	47,500	586,625.00	0.13
180	000932	华菱钢铁	121,300	578,601.00	0.13
181	600409	三友化工	105,800	576,610.00	0.13
182	000012	南玻 A	96,400	574,544.00	0.13
183	603650	彤程新材	17,000	557,600.00	0.12
184	300442	润泽科技	18,000	553,680.00	0.12
185	603786	科博达	8,300	545,310.00	0.12
186	688289	圣湘生物	32,100	540,564.00	0.12
187	688234	天岳先进	7,300	539,762.00	0.12
188	603056	德邦股份	34,900	538,158.00	0.12
189	600377	宁沪高速	54,300	533,769.00	0.12
190	300474	景嘉微	5,800	521,942.00	0.11
191	600901	江苏金租	126,140	520,958.20	0.11
192	002294	信立泰	16,700	520,873.00	0.11
193	600350	山东高速	81,500	519,155.00	0.11
194	600995	南网储能	46,700	514,167.00	0.11
195	600118	中国卫星	18,200	513,422.00	0.11
196	300741	华宝股份	23,900	511,938.00	0.11
197	600521	华海药业	27,800	511,798.00	0.11
198	002368	太极股份	12,400	510,508.00	0.11
199	600498	烽火通信	24,100	490,917.00	0.11
200	600580	卧龙电驱	33,500	489,435.00	0.11
201	002925	盈趣科技	25,100	486,940.00	0.11

202	002506	协鑫集成	165,300	484,329.00	0.11
203	002939	长城证券	58,800	478,044.00	0.10
204	603160	汇顶科技	10,300	476,375.00	0.10
205	300212	易华录	14,300	475,189.00	0.10
206	002266	浙富控股	115,000	474,950.00	0.10
207	002244	滨江集团	53,700	473,634.00	0.10
208	301039	中集车辆	35,100	464,373.00	0.10
209	002010	传化智联	85,700	455,924.00	0.10
210	601179	中国西电	84,200	455,522.00	0.10
211	688080	映翰通	9,300	454,770.00	0.10
212	300373	扬杰科技	11,200	454,384.00	0.10
213	600673	东阳光	63,000	454,230.00	0.10
214	002936	郑州银行	195,000	448,500.00	0.10
215	601567	三星医疗	35,500	448,365.00	0.10
216	300357	我武生物	13,200	443,916.00	0.10
217	601665	齐鲁银行	112,800	442,176.00	0.10
218	000709	河钢股份	194,400	439,344.00	0.10
219	603026	胜华新材	7,300	432,525.00	0.09
220	601106	中国一重	128,400	431,424.00	0.09
221	600500	中化国际	77,500	430,900.00	0.09
222	000883	湖北能源	94,100	429,096.00	0.09
223	601016	节能风电	116,460	427,408.20	0.09
224	601519	大智慧	59,500	426,020.00	0.09
225	600871	石化油服	214,500	424,710.00	0.09
226	301003	江苏博云	18,300	422,913.00	0.09
227	300861	美畅股份	9,700	420,689.00	0.09
228	601611	中国核建	49,700	419,965.00	0.09
229	601608	中信重工	98,100	413,001.00	0.09
230	601718	际华集团	138,500	411,345.00	0.09
231	600516	方大炭素	66,200	410,440.00	0.09
232	000027	深圳能源	61,700	406,603.00	0.09
233	000959	首钢股份	114,400	400,400.00	0.09
234	002653	海思科	16,900	398,840.00	0.09
235	002110	三钢闽光	94,500	398,790.00	0.09
236	300487	蓝晓科技	6,350	396,367.00	0.09
237	600764	中国海防	14,500	394,690.00	0.09
238	600171	上海贝岭	21,500	392,375.00	0.09
239	688185	康希诺	4,800	391,200.00	0.09
240	300230	永利股份	107,800	381,612.00	0.08
241	688295	中复神鹰	10,400	381,472.00	0.08
242	601377	兴业证券	62,000	379,440.00	0.08
243	301257	普蕊斯	6,700	376,540.00	0.08
244	001227	兰州银行	129,100	369,226.00	0.08

245	600563	法拉电子	2,600	356,980.00	0.08
246	002384	东山精密	13,600	352,240.00	0.08
247	603338	浙江鼎力	6,200	347,262.00	0.08
248	603088	宁波精达	40,400	338,552.00	0.07
249	002008	大族激光	12,500	327,500.00	0.07
250	300515	三德科技	20,200	325,624.00	0.07
251	300743	天地数码	20,700	325,404.00	0.07
252	603233	大参林	11,580	324,355.80	0.07
253	600141	兴发集团	14,500	322,190.00	0.07
254	002603	以岭药业	12,300	315,987.00	0.07
255	002465	海格通信	28,900	298,826.00	0.07
256	002022	科华生物	26,900	285,140.00	0.06
257	002690	美亚光电	11,000	283,250.00	0.06
258	603871	嘉友国际	18,000	282,780.00	0.06
259	000423	东阿阿胶	5,200	277,940.00	0.06
260	600702	舍得酒业	2,200	272,690.00	0.06
261	688128	中国电研	10,500	267,750.00	0.06
262	603283	赛腾股份	6,000	267,000.00	0.06
263	000718	苏宁环球	97,400	265,902.00	0.06
264	600528	中铁工业	26,500	261,820.00	0.06
265	002737	葵花药业	10,600	258,004.00	0.06
266	600873	梅花生物	28,400	253,612.00	0.06
267	300968	格林精密	28,300	251,587.00	0.06
268	300389	艾比森	12,300	250,551.00	0.06
269	603639	海利尔	13,000	232,960.00	0.05
270	300058	蓝色光标	23,800	230,146.00	0.05
271	688372	伟测科技	1,500	229,725.00	0.05
272	002080	中材科技	11,100	227,772.00	0.05
273	002968	新大正	14,900	225,139.00	0.05
274	300672	国科微	2,700	225,045.00	0.05
275	688596	正帆科技	5,100	220,830.00	0.05
276	300567	精测电子	2,300	218,845.00	0.05
277	688200	华峰测控	1,400	214,200.00	0.05
278	300604	长川科技	4,500	213,705.00	0.05
279	600160	巨化股份	15,500	213,590.00	0.05
280	603456	九洲药业	7,700	210,826.00	0.05
281	688630	芯碁微装	2,500	210,050.00	0.05
282	601568	北元集团	39,800	209,746.00	0.05
283	600259	广晟有色	5,800	209,612.00	0.05
284	688409	富创精密	1,900	207,100.00	0.05
285	002085	万丰奥威	29,500	204,435.00	0.04
286	301291	明阳电气	6,193	200,918.40	0.04
287	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.04



288	301307	美利信	5,904	198,461.79	0.04
289	600808	马钢股份	76,900	197,633.00	0.04
290	002361	神剑股份	48,200	195,210.00	0.04
291	601598	中国外运	41,800	194,788.00	0.04
292	688120	华海清科	745	187,777.25	0.04
293	300619	金银河	2,900	179,655.00	0.04
294	000598	兴蓉环境	33,000	179,190.00	0.04
295	688037	芯源微	1,036	177,104.20	0.04
296	300001	特锐德	8,300	172,474.00	0.04
297	000570	苏常柴 A	30,800	171,556.00	0.04
298	301190	善水科技	9,000	169,110.00	0.04
299	002337	赛象科技	25,200	168,336.00	0.04
300	300970	华绿生物	7,200	168,192.00	0.04
301	002508	老板电器	6,600	166,914.00	0.04
302	002909	集泰股份	21,100	164,791.00	0.04
303	003027	同兴环保	7,900	164,715.00	0.04
304	603050	科林电气	10,200	164,322.00	0.04
305	002666	德联集团	31,700	163,889.00	0.04
306	002495	佳隆股份	67,000	163,480.00	0.04
307	600076	康欣新材	63,600	163,452.00	0.04
308	300658	延江股份	24,940	163,357.00	0.04
309	600399	抚顺特钢	16,000	163,200.00	0.04
310	002141	贤丰控股	49,600	163,184.00	0.04
311	600130	波导股份	37,500	163,125.00	0.04
312	002442	龙星化工	33,100	162,852.00	0.04
313	002486	嘉麟杰	55,200	162,840.00	0.04
314	605066	天正电气	17,300	162,793.00	0.04
315	300155	安居宝	32,300	162,792.00	0.04
316	000677	恒天海龙	59,800	162,656.00	0.04
316	002969	嘉美包装	41,600	162,656.00	0.04
317	601113	华鼎股份	50,200	162,648.00	0.04
318	300239	东宝生物	26,400	162,624.00	0.04
319	002956	西麦食品	10,400	162,552.00	0.04
320	002066	瑞泰科技	13,600	162,520.00	0.04
321	600858	银座股份	26,900	162,476.00	0.04
322	002388	新亚制程	22,800	162,336.00	0.04
323	301092	争光股份	6,200	162,316.00	0.04
324	002144	宏达高科	14,500	162,255.00	0.04
325	600379	宝光股份	15,900	162,180.00	0.04
326	300839	博汇股份	12,200	162,138.00	0.04
327	002842	翔鹭钨业	19,000	162,070.00	0.04
328	002767	先锋电子	11,600	162,052.00	0.04
329	300063	天龙集团	37,400	161,942.00	0.04



330	300190	维尔利	40,500	161,595.00	0.04
331	300694	蠡湖股份	15,200	161,576.00	0.04
332	300279	和晶科技	28,900	161,551.00	0.04
333	301259	艾布鲁	12,000	161,400.00	0.04
334	300350	华鹏飞	37,600	161,304.00	0.04
335	003011	海象新材	5,000	161,250.00	0.04
336	301258	富士莱	4,100	161,212.00	0.04
337	000548	湖南投资	33,300	161,172.00	0.04
338	605287	德才股份	6,800	161,160.00	0.04
339	688600	皖仪科技	6,500	161,135.00	0.04
340	605566	福莱茵特	7,000	161,000.00	0.04
341	000407	胜利股份	44,100	160,965.00	0.04
342	603949	雪龙集团	10,200	160,956.00	0.04
343	605196	华通线缆	22,600	160,912.00	0.04
344	002722	物产金轮	11,600	160,892.00	0.04
345	603700	宁水集团	11,000	160,820.00	0.04
345	002296	辉煌科技	18,700	160,820.00	0.04
346	300176	派生科技	26,100	160,776.00	0.04
347	688218	江苏北人	7,300	160,673.00	0.04
348	000533	顺钠股份	37,800	160,650.00	0.04
349	300932	三友联众	10,400	160,576.00	0.04
350	300375	鹏翎股份	41,700	160,545.00	0.04
351	002443	金洲管道	24,100	160,506.00	0.04
352	301212	联盛化学	4,900	160,426.00	0.04
353	600785	新华百货	11,800	160,362.00	0.04
354	002342	巨力索具	39,100	160,310.00	0.04
355	603020	爱普股份	17,500	160,300.00	0.04
356	300281	金明精机	29,900	160,264.00	0.04
357	002578	闽发铝业	43,600	160,012.00	0.04
358	603266	天龙股份	11,500	159,965.00	0.04
359	688011	新光光电	6,191	159,851.62	0.04
360	601956	东贝集团	27,000	159,840.00	0.04
360	300004	南风股份	29,600	159,840.00	0.04
361	600980	北矿科技	10,100	159,580.00	0.04
362	603040	新坐标	6,000	159,540.00	0.04
363	600218	全柴动力	17,800	159,488.00	0.04
364	300018	中元股份	23,400	159,354.00	0.03
365	003030	祖名股份	6,600	159,324.00	0.03
366	300411	金盾股份	24,300	159,165.00	0.03
367	603023	威帝股份	39,000	159,120.00	0.03
368	688257	新锐股份	6,000	159,060.00	0.03
369	603199	九华旅游	4,600	158,930.00	0.03
370	002371	北方华创	500	158,825.00	0.03

371	603895	天永智能	6,200	158,286.00	0.03
372	603768	常青股份	8,900	158,153.00	0.03
373	603215	比依股份	8,800	157,872.00	0.03
374	301486	致尚科技	2,717	156,662.22	0.03
375	603090	宏盛股份	7,000	155,750.00	0.03
376	002448	中原内配	22,200	155,400.00	0.03
377	603886	元祖股份	8,400	154,056.00	0.03
378	000913	钱江摩托	8,400	153,132.00	0.03
379	600566	济川药业	5,200	151,008.00	0.03
380	301387	光大同创	3,070	150,224.31	0.03
381	002533	金杯电工	18,400	150,144.00	0.03
382	601128	常熟银行	21,800	148,676.00	0.03
383	002432	九安医疗	4,200	147,882.00	0.03
384	601577	长沙银行	19,000	147,440.00	0.03
385	601456	国联证券	16,200	147,420.00	0.03
386	000998	隆平高科	9,600	147,360.00	0.03
387	600372	中航电子	9,700	147,246.00	0.03
388	002966	苏州银行	22,400	146,720.00	0.03
389	002507	涪陵榨菜	8,000	146,480.00	0.03
390	000822	山东海化	21,500	146,415.00	0.03
391	002511	中顺洁柔	13,100	146,065.00	0.03
392	300850	新强联	3,900	145,782.00	0.03
393	002028	思源电气	3,100	144,832.00	0.03
394	600927	永安期货	8,900	144,714.00	0.03
395	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.03
396	600415	小商品城	16,700	142,451.00	0.03
397	002463	沪电股份	6,800	142,392.00	0.03
398	002791	坚朗五金	2,200	142,362.00	0.03
399	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
400	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.03
401	002938	鹏鼎控股	5,600	136,024.00	0.03
402	688589	力合微	3,300	134,442.00	0.03
403	605077	华康股份	5,000	132,400.00	0.03
404	603466	风语筑	9,400	130,660.00	0.03
405	002049	紫光国微	1,400	130,550.00	0.03
406	688009	中国通号	22,200	128,760.00	0.03
407	300476	胜宏科技	5,200	125,372.00	0.03
408	300523	辰安科技	5,200	124,072.00	0.03
409	601138	工业富联	4,900	123,480.00	0.03
410	002416	爱施德	16,600	122,508.00	0.03
411	688008	澜起科技	2,100	120,582.00	0.03
412	600584	长电科技	3,800	118,446.00	0.03
413	000021	深科技	5,900	117,941.00	0.03

414	000938	紫光股份	3,700	117,845.00	0.03
415	002156	通富微电	5,200	117,520.00	0.03
416	300384	三联虹普	6,900	117,231.00	0.03
417	603986	兆易创新	1,100	116,875.00	0.03
418	688362	甬矽电子	3,500	116,515.00	0.03
419	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
420	000977	浪潮信息	2,400	116,400.00	0.03
421	688981	中芯国际	2,300	116,196.00	0.03
422	688041	海光信息	1,700	116,059.00	0.03
423	688110	东芯股份	3,200	115,520.00	0.03
424	300223	北京君正	1,300	114,803.00	0.03
425	688047	龙芯中科	1,000	114,790.00	0.03
426	002756	永兴材料	1,700	106,437.00	0.02
427	000778	新兴铸管	25,900	105,672.00	0.02
428	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
429	688498	源杰科技	360	102,600.00	0.02
430	002111	威海广泰	10,300	98,262.00	0.02
431	603267	鸿远电子	1,500	97,950.00	0.02
432	300450	先导智能	2,700	97,659.00	0.02
433	000807	云铝股份	7,500	95,475.00	0.02
434	300213	佳讯飞鸿	13,800	92,046.00	0.02
435	600019	宝钢股份	15,800	88,796.00	0.02
436	688711	宏微科技	1,500	87,510.00	0.02
437	002281	光迅科技	2,200	81,598.00	0.02
438	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
439	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
440	600328	中盐化工	7,900	71,100.00	0.02
441	002572	索菲亚	4,000	69,680.00	0.02
442	600906	财达证券	9,400	67,680.00	0.01
443	002955	鸿合科技	2,600	61,230.00	0.01
444	603228	景旺电子	2,300	58,995.00	0.01
445	002409	雅克科技	800	58,304.00	0.01
446	300638	广和通	2,500	56,700.00	0.01
447	603109	神驰机电	3,100	55,335.00	0.01
448	688249	晶合集成	2,826	51,037.56	0.01
449	000729	燕京啤酒	4,000	49,880.00	0.01
450	600073	上海梅林	6,400	46,720.00	0.01
450	002019	亿帆医药	3,200	46,720.00	0.01
451	000623	吉林敖东	2,900	46,516.00	0.01
452	300693	盛弘股份	1,200	44,304.00	0.01
453	688468	科美诊断	4,100	38,950.00	0.01
454	605499	东鹏饮料	200	34,580.00	0.01
455	301301	川宁生物	3,423	30,670.08	0.01

456	688472	阿特斯	1,767	30,109.68	0.01
457	688469	中芯集成	5,017	27,141.97	0.01
458	301325	曼恩斯特	250	26,987.50	0.01
459	600183	生益科技	1,900	26,980.00	0.01
460	603929	亚翔集成	1,600	26,880.00	0.01
461	688361	中科飞测	409	26,450.03	0.01
462	600050	中国联通	5,200	24,960.00	0.01
463	600438	通威股份	700	24,017.00	0.01
464	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
465	301358	湖南裕能	535	22,946.15	0.01
466	688576	西山科技	171	20,590.11	0.00
467	688443	智翔金泰	676	19,935.24	0.00
468	688484	南芯科技	504	18,501.84	0.00
469	688582	芯动联科	450	18,306.00	0.00
470	688146	中船特气	474	18,073.62	0.00
471	300118	东方日升	700	17,941.00	0.00
472	688531	日联科技	127	17,268.19	0.00
473	688543	国科军工	325	17,241.25	0.00
474	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
475	301303	真兰仪表	741	16,539.12	0.00
476	301139	元道通信	566	16,351.74	0.00
477	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
478	301246	宏源药业	497	15,262.87	0.00
479	688352	硕中科技	1,248	15,063.36	0.00
480	301383	天键股份	418	14,930.96	0.00
481	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
482	688458	美芯晟	164	14,884.64	0.00
483	002990	盛视科技	400	14,720.00	0.00
484	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
485	001287	中电港	687	14,440.74	0.00
486	688552	航天南湖	608	14,288.00	0.00
487	688334	西高院	875	14,183.75	0.00
488	002033	丽江股份	1,300	14,144.00	0.00
489	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
490	688581	安杰思	114	13,455.42	0.00
491	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
492	000401	冀东水泥	1,800	13,266.00	0.00
493	601298	青岛港	1,900	13,243.00	0.00
494	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
495	688512	慧智微	689	13,201.24	0.00
496	688433	华曙高科	419	13,201.00	0.00
497	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
498	301332	德尔玛	928	12,741.44	0.00

499	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
500	301305	朗坤环境	619	12,188.11	0.00
501	300870	欧陆通	200	11,986.00	0.00
502	301386	未来电器	478	11,510.62	0.00
503	301322	绿通科技	216	11,499.84	0.00
504	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
505	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
506	301298	东利机械	634	10,416.62	0.00
507	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
508	301125	腾亚精工	327	9,993.12	0.00
509	601061	中信金属	1,306	9,899.48	0.00
510	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
511	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
512	301439	泓淋电力	560	9,464.00	0.00
513	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
514	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
515	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
516	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
517	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
518	603135	中重科技	465	8,318.85	0.00
519	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
520	601137	博威合金	500	7,780.00	0.00
521	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
522	301345	涛涛车业	166	7,742.24	0.00
523	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
524	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
525	600728	佳都科技	900	6,237.00	0.00
526	002170	芭田股份	900	6,183.00	0.00
527	601133	柏诚股份	460	5,639.60	0.00
528	601065	江盐集团	448	5,304.32	0.00
529	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
530	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
531	603125	常青科技	148	3,630.44	0.00
532	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
533	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
534	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
535	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
536	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
537	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	002625	光启技术	14,126,132.32	3.10
2	603688	石英股份	12,822,342.00	2.82
3	301029	怡合达	12,403,452.20	2.72
4	603127	昭衍新药	11,032,146.05	2.42
5	600060	海信视像	10,928,209.00	2.40
6	688390	固德威	10,407,499.92	2.29
7	002430	杭氧股份	10,177,995.16	2.23
8	002422	科伦药业	9,864,740.00	2.17
9	002384	东山精密	9,824,918.64	2.16
10	688029	南微医学	9,549,173.69	2.10
11	002081	金螳螂	9,210,795.64	2.02
12	002434	万里扬	9,033,751.00	1.98
13	000155	川能动力	8,965,464.00	1.97
14	603444	吉比特	8,689,427.00	1.91
15	601717	郑煤机	8,635,697.00	1.90
16	600655	豫园股份	8,412,633.00	1.85
17	688006	杭可科技	8,352,162.69	1.83
18	300866	安克创新	8,269,510.00	1.82
19	603883	老百姓	8,200,824.00	1.80
20	600258	首旅酒店	8,173,844.00	1.79

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688390	固德威	13,899,128.42	3.05
2	300308	中际旭创	13,000,537.00	2.85
3	002625	光启技术	12,014,747.48	2.64
4	300009	安科生物	11,155,216.52	2.45
5	600500	中化国际	11,008,142.00	2.42
6	600563	法拉电子	10,977,697.00	2.41
7	300136	信维通信	10,956,797.08	2.41
8	002444	巨星科技	10,711,064.10	2.35
9	603444	吉比特	10,609,916.31	2.33

10	600998	九州通	10,453,998.00	2.30
11	600959	江苏有线	10,436,965.70	2.29
12	002430	杭氧股份	10,285,578.36	2.26
13	002273	水晶光电	10,257,370.80	2.25
14	300017	网宿科技	10,004,384.87	2.20
15	000156	华数传媒	9,936,879.07	2.18
16	600008	首创环保	9,729,229.00	2.14
17	600901	江苏金租	9,494,314.00	2.08
18	600064	南京高科	9,441,566.50	2.07
19	600820	隧道股份	9,416,820.83	2.07
20	688063	派能科技	9,363,039.26	2.06
21	688301	奕瑞科技	9,348,042.08	2.05
22	603868	飞科电器	9,283,764.81	2.04
23	002497	雅化集团	9,213,738.00	2.02
24	002384	东山精密	9,135,848.00	2.01
25	002192	融捷股份	9,132,073.00	2.00

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,861,192,059.66
卖出股票的收入（成交）总额	1,872,133,417.08

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	53,121.62
2	应收清算款	1,493,219.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	352,464.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,898,804.84

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。



### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时中证 500 指数增强 A	19,215	14,338.87	14,108,579.02	5.12%	261,412,752.94	94.88%
博时中证 500 指数增强 C	13,649	6,288.52	3,243,242.28	3.78%	82,588,804.22	96.22%
合计	32,553	11,100.46	17,351,821.30	4.80%	344,001,557.16	95.20%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时中证 500 指数增强 A	4,083,768.72	1.48%
	博时中证 500 指数增强 C	134,718.17	0.16%
	合计	4,218,486.89	1.17%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	博时中证 500 指数增强 A	>100
	博时中证 500 指数增强 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时中证 500 指数增强 A	-
	博时中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 26 日）基金份额总额	383,128,088.40	-
本报告期期初基金份额总额	277,095,237.58	92,265,547.46
本报告期基金总申购份额	22,533,442.91	23,211,321.68
减：本报告期基金总赎回份额	24,107,348.53	29,644,822.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	275,521,331.96	85,832,046.50

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
江海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	121,178,570.17	3.25%	88,618.74	3.25%	增加 1 个
东兴证券	2	309,405,451.55	8.31%	226,272.55	8.31%	增加 1 个
海通证券	6	167,868,384.60	4.51%	122,770.93	4.51%	-
中信证券	3	326,913,085.07	8.78%	239,078.44	8.78%	-
广发证券	2	455,503,788.70	12.24%	333,109.79	12.23%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	127,350,315.45	3.42%	93,132.92	3.42%	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	293,960,623.20	7.90%	214,988.45	7.90%	-
中金公司	2	488,578,938.22	13.12%	357,314.90	13.12%	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	186,328,478.05	5.00%	136,257.66	5.00%	增加 1 个
平安证券	2	-	-	-	-	-
国新证券	2	101,621,710.27	2.73%	74,315.95	2.73%	-
招商证券	5	1,144,202,104.11	30.73%	836,767.19	30.73%	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务; 能根据公司所管理基金的特定要求, 提供专门研究报告, 具有开发量化投资组合模型的能力; 能积极为公司投资业务的开展, 投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

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

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01

2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12
5	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
6	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
7	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
8	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
9	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时中证 500 指数增强型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时中证 500 指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日