

**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：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰证券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 2 月 13 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	4
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>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
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	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>10</b>
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
<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	43
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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56

7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.4 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.....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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.....	62
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 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时中证 500 增强 ETF
场内简称	中证 500 增强 ETF
基金主代码	159678
交易代码	159678
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 2 月 13 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	186,143,694.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 2 月 27 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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。本基金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 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	基金在指数化投资的基础上，通过量化增强等增强策略进行组合优化，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。投资策略包括股票投资策略、指数增强策略、固定收益品种投资策略、存托凭证投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券投资策略、衍生品投资策略、融资、融券及转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪中证 500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	李双均
	联系电话	0755-83169999	025-83389842
	电子邮箱	service@bosera.com	lishuangjun@htsc.com
客户服务电话		95105568	025-83389988
传真		0755-83195140	025-83387215

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	江苏省南京市江东中路228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	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码	518040	210019
法定代表人	江向阳	张伟

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

# § 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2月13日(基金合同生效日)至2023年6月30日)
本期已实现收益	-8,412,809.82
本期利润	-11,826,649.32
加权平均基金份额本期利润	-0.0428
本期加权平均净值利润率	-4.39%
本期基金份额净值增长率	-3.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-7,239,238.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0389
期末基金资产净值	178,904,455.44
期末基金份额净值	0.9611
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.89%

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。

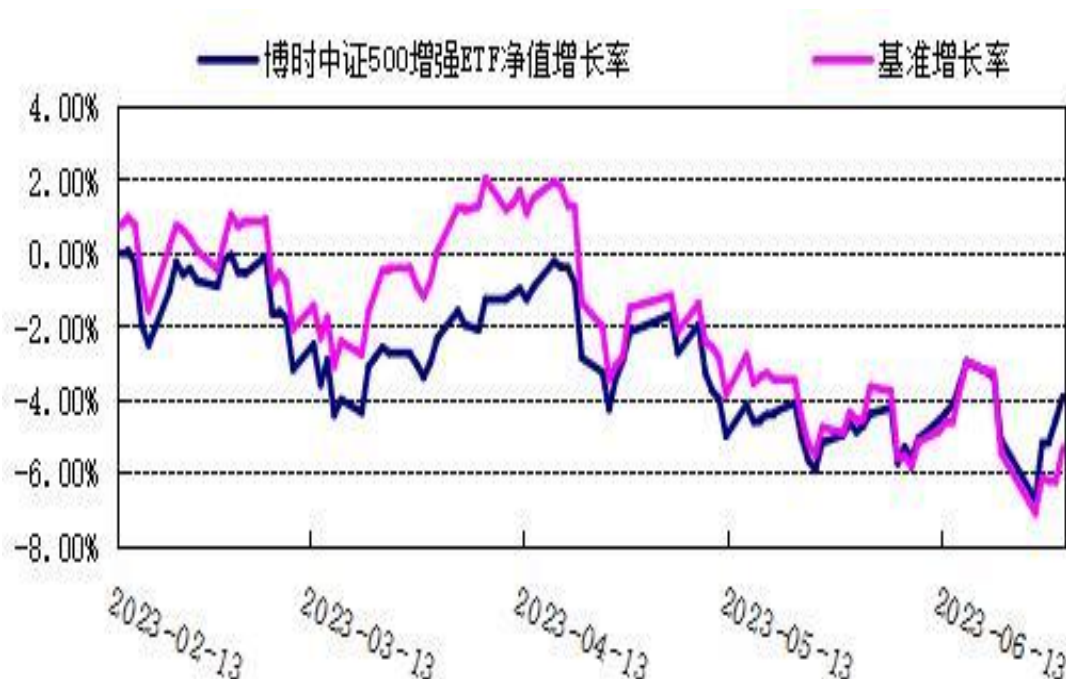
本基金合同于 2023 年 2 月 13 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

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	1.01%	0.86%	-0.81%	0.93%	1.82%	-0.07%
过去三个月	-1.64%	0.75%	-5.38%	0.83%	3.74%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-3.89%	0.75%	-5.30%	0.81%	1.41%	-0.06%

#### 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



注：本基金的基金合同于 2023 年 2 月 13 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。

## § 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

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		
杨振建	基金经理	2023-03-03	-	9.8	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日-2021 年 7 月 16 日)基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日一至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日一至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日一至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 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 3 月 3 日一至今)的基金经理。
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2023-02-13	-	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。
--	--	--	--	--	--

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，并突出成长因子的长期有效性，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，本基金基金份额净值为 0.9611 元，份额累计净值为 0.9611 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-3.89%，同期业绩基准增长率为-5.30%。

#### 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、跃上更高发展台阶筑牢了基石。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，适当突出成长类因子，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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	4,067,112.48
结算备付金		1,542,470.08
存出保证金		1,070,026.49
交易性金融资产	6.4.7.2	173,130,990.19
其中：股票投资		173,120,989.99
基金投资		-
债券投资		10,000.20
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	-
其他债权投资		-
其他权益工具投资	6.4.7.5	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	78,571.24
资产总计		179,889,170.48
<b>负债和净资产</b>		<b>本期末 2023年6月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		423,515.66
应付赎回款		-
应付管理人报酬		78,790.08
应付托管费		15,758.02
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	466,651.28
负债合计		984,715.04

<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.8	186,143,694.00
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.9	-7,239,238.56
净资产合计		178,904,455.44
<b>负债和净资产总计</b>		<b>179,889,170.48</b>

注：1. 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9611 元，基金份额总额 186,143,694.00 份。  
 2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-11,146,395.30
1. 利息收入		155,114.63
其中：存款利息收入	6.4.7.10	155,114.63
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）		-8,195,392.18
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-11,637,430.08
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	1,910.84
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-110,984.11
股利收益	6.4.7.15	3,551,111.17
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）	6.4.7.16	-3,413,839.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	307,721.75
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>680,254.02</b>

1. 管理人报酬		494,252.20
2. 托管费		98,850.46
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.19	87,151.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-11,826,649.32
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-11,826,649.32
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-11,826,649.32

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年2月13日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
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）	487,643,694.00	-	-	487,643,694.00
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-301,500,000.00	-	-7,239,238.56	-308,739,238.56
（一）、综合收益总额	-	-	-11,826,649.32	-11,826,649.32
（二）、本期基金份额 交易产生的基金 净值变动数（净值减	-301,500,000.00	-	4,587,410.76	-296,912,589.24

少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	25,500,000.00	-	-781,229.37	24,718,770.63
2. 基金赎回款	-327,000,000.00	-	5,368,640.13	-321,631,359.87
(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)	186,143,694.00	-	-7,239,238.56	178,904,455.44

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：倡方方

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2599 号核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，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 487,634,000.00 元(含所募集股票市值)，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2023)验字第 60669135\_A04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 487,643,694.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,694.00 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]120 号核准，本基金于 2023 年 2 月 27 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股(包括创业板及其他经中国证监会

核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、债券回购、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下,本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。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。本基金所持有的股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2023 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间。



#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认

部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01%以上时,可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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，以产生的利息及利息

性质的收入为销售额。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	4,067,112.48
等于：本金	4,065,319.28
加：应计利息	1,793.20
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	4,067,112.48

**6.4.7.2 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	176,497,949.49	-	173,120,989.99	-3,376,959.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	10,000.00	0.20	10,000.20	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,000.00	0.20	10,000.20	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	176,507,949.49	0.20	173,130,990.19	-3,376,959.50	

**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 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,424,880.00	-	-	-
——股指期货	2,424,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,424,880.00	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额为 0。

**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
IC2309	IC2309	2.00	2,388,000.00	-36,880.00

合计	-	-	-	-36,880.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-36,880.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 其他权益工具投资

##### 6.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	78,571.24
合计	78,571.24

#### 6.4.7.7 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	438,428.68
其中：交易所市场	438,428.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	21,428.64
应付 IOPV 计算与发布费	6,793.96
合计	466,651.28



#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	487,643,694.00	487,643,694.00
本期申购	25,500,000.00	25,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-327,000,000.00	-327,000,000.00
本期末	186,143,694.00	186,143,694.00

注：1. 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）。

2. 基金合同于 2023 年 2 月 13 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 487,643,694.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,694.00 份基金份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-8,412,809.82	-3,413,839.50	-11,826,649.32
本期基金份额交易产生的变动数	2,425,678.12	2,161,732.64	4,587,410.76
其中：基金申购款	-439,342.03	-341,887.34	-781,229.37
基金赎回款	2,865,020.15	2,503,619.98	5,368,640.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,987,131.70	-1,252,106.86	-7,239,238.56

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	15,277.16
其他	3,595.76
合计	155,114.63

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	-3,046,795.01

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	-11,637,430.08

#### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出股票成交总额	600,193,213.99
减：卖出股票成本总额	606,961,806.53
减：交易费用	1,822,042.53
买卖股票差价收入	-8,590,635.07

#### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	321,631,359.87
减：现金支付赎回款总额	186,937,475.87
减：赎回股票成本总额	137,740,679.01
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,046,795.01

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,908.76
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,910.84

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,911.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	8,000.00

成本总额	
减：应计利息总额	1.88
减：交易费用	0.40
买卖债券差价收入	1,908.76

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.7.13.2 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。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股指期货投资收益	-110,984.11

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,551,111.17
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	3,551,111.17

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,376,959.50
——股票投资	-3,376,959.50
——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	-36,880.00
——权证投资	-

——股指期货	-36,880.00
4. 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	-3,413,839.50

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	307,721.75
合计	307,721.75

#### 6.4.7.18 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	21,428.64
信息披露费	-
证券出借违约金	-
IOPV 计算与发布费	6,793.96
中登注册登记费	58,928.76
合计	87,151.36

### 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，本基金无须披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 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
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人

华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	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。

#### 6.4.10 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 2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	1,508,375,506.97	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	9,911.04	100.00%

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

##### 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 2023年2月13日（基金合同生效日）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
华泰证券	1,103,074.77	100.00%	438,428.68	100.00%

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。

#### 6.4.10.2 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 2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	494,252.20

其中：支付销售机构的客户维护费	12,589.10
-----------------	-----------

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月13日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	98,850.46

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	5,037,654.00	2.71%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 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

无。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2023 年 2 月 13 日（基金合同生效日）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	2,088.00	55,018.80
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	2,842.00	71,760.50

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	2,649.00	70,675.32	70,675.32	-
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	985.00	56,795.10	56,795.10	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	1,413.00	56,209.14	56,209.14	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	2,620.00	52,373.80	52,373.80	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7 个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,065.00	39,298.50	39,298.50	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	1,444.00	28,677.84	26,078.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	首次公开发行限售	29.60	71.42	226.00	6,689.60	16,140.92	-

301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	首次公开发售	76.80	107.95	119.00	9,139.20	12,846.05	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	首次公开发售	23.60	64.67	190.00	4,484.00	12,287.30	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6 个月	首次公开发售	13.06	20.62	535.00	6,987.10	11,031.70	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	首次公开发售	39.99	36.71	298.00	11,917.02	10,939.58	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	首次公开发售	32.34	31.86	321.00	10,381.14	10,227.06	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	首次公开发售	152.38	135.97	75.00	11,428.50	10,197.75	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发售	9.26	18.59	545.00	5,046.70	10,131.55	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	首次公开发售	71.88	92.60	108.00	7,763.04	10,000.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	首次公开发售	36.15	38.13	259.00	9,362.85	9,875.67	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	首次公开发售	12.68	22.31	418.00	5,300.24	9,325.58	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	首次公开发售	58.32	45.36	203.00	11,838.96	9,208.08	-
68857	西山	2023-	6 个月	首次	135.8	120.4	75.00	10,18	9,030	-



6	科技	05-30		公开发 行 限 售	0	1		5.00	.75	
68844 3	智翔 金泰	2023- 06-13	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	37.88	29.49	304.0 0	11,51 5.52	8,964 .96	-
00128 7	中电 港	2023- 03-30	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	11.88	21.02	399.0 0	4,740 .12	8,386 .98	-
68835 2	顾中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	12.10	12.07	693.0 0	8,385 .30	8,364 .51	-
30129 1	明阳 电气	2023- 06-21	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	38.13	31.03	266.0 0	10,14 2.58	8,253 .98	-
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	-
30114 1	中科 磁业	2023- 03-27	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	41.20	42.69	190.0 0	7,828 .00	8,111 .10	-
68858 2	芯动 联科	2023- 06-21	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	26.74	40.68	195.0 0	5,214 .30	7,932 .60	-
30139 5	仁信 新材	2023- 06-21	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	26.68	26.68	295.0 0	7,870 .60	7,870 .60	-
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	26.66	31.50	239.0 0	6,371 .74	7,528 .50	-
30138 2	蜂助 手	2023- 05-09	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	23.80	32.84	229.0 0	5,450 .20	7,520 .36	-
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次 公 开	43.67	53.05	140.0 0	6,113 .80	7,427 .00	-

				发行 限售							
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次 公开发 行 限售	21.86	23.85	301.0 0	6,579 .86	7,178 .85	-	
30135 7	北方 长龙	2023- 04-11	6 个月	首次 公开发 行 限售	50.00	48.39	146.0 0	7,300 .00	7,064 .94	-	
30121 0	金杨 股份	2023- 06-21	6 个月	首次 公开发 行 限售	57.88	49.17	140.0 0	8,103 .20	6,883 .80	-	
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次 公开发 行 限售	21.17	23.50	291.0 0	6,160 .47	6,838 .50	-	
30129 5	美硕 科技	2023- 06-19	6 个月	首次 公开发 行 限售	37.40	36.07	189.0 0	7,068 .60	6,817 .23	-	
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	10.68	12.34	550.0 0	5,874 .00	6,787 .00	-	
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	75.00	90.76	74.00	5,550 .00	6,716 .24	-	
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次 公开发 行 限售	11.18	14.59	444.0 0	4,963 .92	6,477 .96	-	
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次 公开发 行 限售	14.16	16.21	399.0 0	5,649 .84	6,467 .79	-	
30138 3	天键 股份	2023- 05-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	46.16	35.72	180.0 0	8,308 .80	6,429 .60	-	
30142 8	世纪 恒通	2023- 05-10	6 个月	首次 公开发 行	26.35	30.60	209.0 0	5,507 .15	6,395 .40	-	

				限售						
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	首次公开发售 限售	125.80	118.03	54.00	6,793.20	6,373.62	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	首次公开发售 限售	57.66	57.66	110.00	6,342.60	6,342.60	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	首次公开发售 限售	29.99	23.79	265.00	7,947.35	6,304.35	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	首次公开发售 限售	39.78	39.78	158.00	6,285.24	6,285.24	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	首次公开发售 限售	46.13	34.40	176.00	8,118.88	6,054.40	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	首次公开发售 限售	14.81	13.73	437.00	6,471.97	6,000.01	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	首次公开发售 限售	17.55	16.75	351.00	6,160.05	5,879.25	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	首次公开发售 限售	19.99	19.99	292.00	5,837.08	5,837.08	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	首次公开发售 限售	6.58	7.58	758.00	4,987.64	5,745.64	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	首次公开发售 限售	25.25	19.69	285.00	7,196.25	5,611.65	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	首次公开发售 限售	72.50	58.42	91.00	6,597.50	5,316.22	-

603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	首次公开发售	17.80	17.89	274.00	4,877.20	4,901.86	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	首次公开发售	33.99	29.49	166.00	5,642.34	4,895.34	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	首次公开发售	39.06	39.36	123.00	4,804.38	4,841.28	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发售	34.00	34.93	135.00	4,590.00	4,715.55	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	首次公开发售	25.28	29.87	153.00	3,867.84	4,570.11	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	首次公开发售	36.90	36.90	119.00	4,391.10	4,391.10	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	首次公开发售	28.84	30.78	113.00	3,258.92	3,478.14	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	首次公开发售	11.66	12.26	267.00	3,113.22	3,273.42	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	首次公开发售	10.36	11.84	260.00	2,693.60	3,078.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	首次公开发售	20.68	25.49	115.00	2,378.20	2,931.35	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	首次公开发售	27.93	33.03	75.00	2,094.75	2,477.25	-
00136	海森	2023-	6 个月	首次	44.48	39.48	55.00	2,446	2,171	-

7	药业	03-30		公开发 行限 售				.40	.40	
00132 4	长青 科技	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限 售	18.88	19.60	109.0 0	2,057 .92	2,136 .40	-
60312 5	常青 科技	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限 售	25.98	24.53	86.00	2,234 .28	2,109 .58	-
00136 0	南矿 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限 售	15.38	14.87	139.0 0	2,137 .82	2,066 .93	-
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	-

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
11803 6	力合 转债	2023- 06-28	16 个 交易 日	新债 未上 市	100.0 0	100.0 0	100.0 0	10,00 0.00	10,00 0.20	-

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。

#### 6.4.12.2 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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
601298	青岛港	2023-0 6-28	重大事 项停牌	6.97	2023-0 7-03	7.40	2,800.00	16,433.44	19,516.00	-

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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪中证 500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是本基金通过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。本基金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 0.35%，年跟踪误差不超过 6.5%。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日
AAA	-
AAA 以下	10,000.20
未评级	-
合计	10,000.20

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 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来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，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。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

#### 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。

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%。

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。

#### 6.4.13.4.1.1 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	4,067,112.48	-	-	-	4,067,112.48
结算备付金	1,542,470.08	-	-	-	1,542,470.08
存出保证金	783,466.49	-	-	286,560.00	1,070,026.49
交易性金融资产	-	-	10,000.20	173,120,989.99	173,130,990.19
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	78,571.24	78,571.24
<b>资产总计</b>	<b>6,393,049.05</b>	<b>-</b>	<b>10,000.20</b>	<b>173,486,121.23</b>	<b>179,889,170.48</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	423,515.66	423,515.66
应付管理人报酬	-	-	-	78,790.08	78,790.08
应付托管费	-	-	-	15,758.02	15,758.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	466,651.28	466,651.28
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>984,715.04</b>	<b>984,715.04</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>6,393,049.05</b>	<b>-</b>	<b>10,000.20</b>	<b>172,501,406.19</b>	<b>178,904,455.44</b>

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	173,120,989.99	96.77
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,000.20	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
<b>合计</b>	<b>173,130,990.19</b>	<b>96.77</b>

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币万元)
		本期末 2023 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 846
	业绩比较基准下降 5%	减少约 846

### 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 2023年6月30日
第一层次	172,376,378.74
第二层次	335,594.68
第三层次	419,016.77
合计	173,130,990.19

##### 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。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	173,120,989.99	96.24
	其中：股票	173,120,989.99	96.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,000.20	0.01
	其中：债券	10,000.20	0.01

	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	5,609,582.56	3.12
8	其他各项资产	1,148,597.73	0.64
9	合计	179,889,170.48	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,128,922.00	0.63
B	采矿业	11,917,062.00	6.66
C	制造业	109,119,982.02	60.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,962,439.00	1.10
E	建筑业	93,989.22	0.05
F	批发和零售业	7,059,887.32	3.95
G	交通运输、仓储和邮政业	5,365,288.00	3.00
H	住宿和餐饮业	13,265.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,463,764.47	4.73
J	金融业	15,706,813.20	8.78
K	房地产业	2,377,692.00	1.33
L	租赁和商务服务业	1,957,438.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	1,782,968.79	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,257,474.05	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,140.92	0.01
R	文化、体育和娱乐业	4,897,864.00	2.74
S	综合	-	-
	合计	173,120,989.99	96.77

### 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	101,500	3,012,520.00	1.68
2	300308	中际旭创	20,300	2,993,235.00	1.67
3	002600	领益智造	380,700	2,630,637.00	1.47

4	002056	横店东磁	136,900	2,492,949.00	1.39
5	601555	东吴证券	351,700	2,440,798.00	1.36
6	000783	长江证券	408,100	2,366,980.00	1.32
7	600060	海信视像	92,300	2,284,425.00	1.28
8	600489	中金黄金	216,100	2,232,313.00	1.25
9	600879	航天电子	262,680	2,230,153.20	1.25
10	688390	固德威	13,000	2,169,180.00	1.21
11	300146	汤臣倍健	89,700	2,151,006.00	1.20
12	688002	睿创微纳	47,528	2,129,254.40	1.19
13	601958	金钼股份	188,200	2,098,430.00	1.17
14	603688	石英股份	18,200	2,071,888.00	1.16
15	600066	宇通客车	140,200	2,066,548.00	1.16
16	601000	唐山港	583,400	2,059,402.00	1.15
17	002568	百润股份	55,400	2,013,790.00	1.13
18	600583	海油工程	324,700	1,899,495.00	1.06
19	600373	中文传媒	141,500	1,884,780.00	1.05
20	688029	南微医学	22,100	1,802,476.00	1.01
21	300487	蓝晓科技	28,200	1,760,244.00	0.98
22	601928	凤凰传媒	154,300	1,759,020.00	0.98
23	600901	江苏金租	420,040	1,734,765.20	0.97
24	600968	海油发展	558,500	1,714,595.00	0.96
25	002518	科士达	42,700	1,708,427.00	0.95
26	002131	利欧股份	686,400	1,578,720.00	0.88
27	600481	双良节能	111,800	1,562,964.00	0.87
28	300866	安克创新	17,300	1,513,750.00	0.85
29	688516	奥特维	8,000	1,507,200.00	0.84
30	688009	中国通号	254,215	1,474,447.00	0.82
31	002223	鱼跃医疗	40,900	1,471,991.00	0.82
32	600161	天坛生物	54,100	1,468,815.00	0.82
33	600415	小商品城	172,100	1,468,013.00	0.82
34	002025	航天电器	22,600	1,441,880.00	0.81
35	600109	国金证券	164,600	1,427,082.00	0.80
36	600398	海澜之家	204,000	1,403,520.00	0.78
37	000997	新大陆	74,000	1,398,600.00	0.78
38	002595	豪迈科技	39,700	1,394,661.00	0.78
39	600329	达仁堂	30,200	1,355,678.00	0.76
40	600755	厦门国贸	172,700	1,336,698.00	0.75
41	600517	国网英大	230,300	1,312,710.00	0.73
42	601577	长沙银行	166,100	1,288,936.00	0.72
43	002867	周大生	72,000	1,280,160.00	0.72
44	600377	宁沪高速	129,200	1,270,036.00	0.71
45	003011	海象新材	38,400	1,238,400.00	0.69
46	600998	九州通	117,875	1,223,542.50	0.68
47	600312	平高电气	98,400	1,219,176.00	0.68

48	601336	新华保险	33,100	1,217,087.00	0.68
49	002381	双箭股份	157,000	1,212,040.00	0.68
50	603567	珍宝岛	80,200	1,199,792.00	0.67
51	300856	科思股份	15,200	1,197,304.00	0.67
52	601168	西部矿业	113,100	1,188,681.00	0.66
53	000967	盈峰环境	223,800	1,130,190.00	0.63
54	601077	渝农商行	311,400	1,117,926.00	0.62
55	002373	千方科技	81,400	1,110,296.00	0.62
56	600153	建发股份	101,600	1,108,456.00	0.62
57	600704	物产中大	218,700	1,080,378.00	0.60
58	600655	豫园股份	156,700	1,074,962.00	0.60
59	000878	云南铜业	96,800	1,069,640.00	0.60
60	002152	广电运通	90,900	1,065,348.00	0.60
61	601717	郑煤机	85,300	1,061,985.00	0.59
62	002625	光启技术	68,700	1,048,362.00	0.59
63	002249	大洋电机	181,100	1,032,270.00	0.58
64	600598	北大荒	76,900	1,025,077.00	0.57
65	601231	环旭电子	67,700	1,012,792.00	0.57
66	300363	博腾股份	34,100	1,009,019.00	0.56
67	000039	中集集团	146,100	1,006,629.00	0.56
68	000739	普洛药业	55,900	991,666.00	0.55
69	300017	网宿科技	139,200	989,712.00	0.55
70	300136	信维通信	49,100	985,928.00	0.55
71	000768	中航西飞	36,800	984,400.00	0.55
72	601992	金隅集团	449,000	978,820.00	0.55
73	600718	东软集团	89,400	953,004.00	0.53
74	688006	杭可科技	30,600	932,382.00	0.52
75	002273	水晶光电	77,600	926,544.00	0.52
76	600528	中铁工业	93,600	924,768.00	0.52
77	002563	森马服饰	142,000	883,240.00	0.49
78	603551	奥普家居	68,000	879,240.00	0.49
79	603127	昭衍新药	21,300	871,170.00	0.49
80	000885	城发环境	64,700	861,157.00	0.48
81	600271	航天信息	62,600	856,994.00	0.48
82	688819	天能股份	23,192	854,393.28	0.48
83	600623	华谊集团	135,600	844,788.00	0.47
84	000728	国元证券	129,200	842,384.00	0.47
85	000830	鲁西化工	78,800	832,128.00	0.47
86	002203	海亮股份	68,400	821,484.00	0.46
87	603156	养元饮品	33,100	817,570.00	0.46
88	600008	首创环保	279,500	804,960.00	0.45
89	000591	太阳能	118,200	801,396.00	0.45
90	300009	安科生物	79,300	793,000.00	0.44
91	000060	中金岭南	166,100	788,975.00	0.44

92	688082	盛美上海	7,000	772,800.00	0.43
93	601108	财通证券	103,500	749,340.00	0.42
94	600325	华发股份	75,100	739,735.00	0.41
95	603858	步长制药	35,800	737,122.00	0.41
96	002030	达安基因	73,440	732,196.80	0.41
97	002215	诺普信	96,000	720,960.00	0.40
98	601098	中南传媒	62,000	719,200.00	0.40
99	600737	中粮糖业	86,300	694,715.00	0.39
100	002128	电投能源	51,900	686,118.00	0.38
101	600315	上海家化	22,900	664,329.00	0.37
102	601333	广深铁路	157,400	623,304.00	0.35
103	300088	长信科技	100,400	605,412.00	0.34
104	603529	爱玛科技	18,700	602,514.00	0.34
105	600582	天地科技	100,900	588,247.00	0.33
106	600497	驰宏锌锗	116,800	586,336.00	0.33
107	601012	隆基绿能	20,300	582,001.00	0.33
108	300390	天华新能	16,090	576,022.00	0.32
109	002017	东信和平	43,770	573,824.70	0.32
110	300724	捷佳伟创	5,100	572,985.00	0.32
111	000906	浙商中拓	63,900	569,988.00	0.32
112	600985	淮北矿业	49,300	567,936.00	0.32
113	000559	万向钱潮	101,500	553,175.00	0.31
114	300699	光威复材	17,800	549,130.00	0.31
115	600435	北方导航	45,800	526,242.00	0.29
116	605167	利柏特	53,700	519,816.00	0.29
117	688418	震有科技	24,500	516,460.00	0.29
118	688777	中控技术	8,206	515,172.68	0.29
119	300444	双杰电气	64,500	496,650.00	0.28
120	002478	常宝股份	65,300	486,485.00	0.27
121	600409	三友化工	89,200	486,140.00	0.27
122	000933	神火股份	37,100	482,300.00	0.27
123	603866	桃李面包	46,389	469,456.68	0.26
124	300058	蓝色光标	48,500	468,995.00	0.26
125	600895	张江高科	32,700	455,184.00	0.25
126	000932	华菱钢铁	94,900	452,673.00	0.25
127	688289	圣湘生物	26,654	448,853.36	0.25
128	688256	寒武纪	2,300	432,400.00	0.24
129	300741	华宝股份	19,800	424,116.00	0.24
130	002925	盈趣科技	21,000	407,400.00	0.23
131	002244	滨江集团	45,900	404,838.00	0.23
132	000400	许继电气	17,100	394,155.00	0.22
133	301039	中集车辆	29,400	388,962.00	0.22
134	600418	江淮汽车	30,300	381,477.00	0.21
135	600909	华安证券	81,100	378,737.00	0.21

136	601567	三星医疗	29,900	377,637.00	0.21
137	300251	光线传媒	46,600	376,994.00	0.21
138	002683	广东宏大	12,700	373,888.00	0.21
139	600208	新湖中宝	149,900	371,752.00	0.21
140	600143	金发科技	41,900	365,787.00	0.20
141	301003	江苏博云	15,800	365,138.00	0.20
142	002690	美亚光电	13,600	350,200.00	0.20
143	000027	深圳能源	52,200	343,998.00	0.19
144	300230	永利股份	91,000	322,140.00	0.18
145	300532	今天国际	15,600	320,736.00	0.18
146	300383	光环新网	29,700	319,275.00	0.18
147	601377	兴业证券	51,800	317,016.00	0.18
148	600563	法拉电子	2,200	302,060.00	0.17
149	002532	天山铝业	50,000	299,500.00	0.17
150	688072	拓荆科技	700	298,179.00	0.17
151	600348	华阳股份	36,700	290,297.00	0.16
152	300515	三德科技	17,900	288,548.00	0.16
153	002384	东山精密	11,100	287,490.00	0.16
154	300743	天地数码	17,600	276,672.00	0.15
155	603233	大参林	9,620	269,456.20	0.15
156	000636	风华高科	17,500	268,450.00	0.15
157	002603	以岭药业	10,400	267,176.00	0.15
158	603589	口子窖	5,400	266,490.00	0.15
159	000423	东阿阿胶	4,900	261,905.00	0.15
160	600141	兴发集团	11,600	257,752.00	0.14
161	000630	铜陵有色	87,300	252,297.00	0.14
162	600487	亨通光电	17,200	252,152.00	0.14
163	603871	嘉友国际	15,900	249,789.00	0.14
164	688208	道通科技	8,200	248,542.00	0.14
165	300418	昆仑万维	6,000	241,680.00	0.14
165	002022	科华生物	22,800	241,680.00	0.14
166	000048	京基智农	12,100	236,192.00	0.13
167	002500	山西证券	42,300	236,034.00	0.13
168	603283	赛腾股份	5,300	235,850.00	0.13
169	300968	格林精密	26,000	231,140.00	0.13
170	600702	舍得酒业	1,800	223,110.00	0.12
171	688128	中国电研	8,700	221,850.00	0.12
172	002737	葵花药业	9,100	221,494.00	0.12
173	603883	老百姓	7,400	220,890.00	0.12
174	000718	苏宁环球	79,600	217,308.00	0.12
175	300389	艾比森	10,500	213,885.00	0.12
176	600873	梅花生物	23,800	212,534.00	0.12
177	603639	海利尔	11,200	200,704.00	0.11
178	300672	国科微	2,300	191,705.00	0.11



179	002968	新大正	12,500	188,875.00	0.11
180	002080	中材科技	9,200	188,784.00	0.11
181	301257	普蕊斯	3,300	185,460.00	0.10
182	601568	北元集团	33,100	174,437.00	0.10
183	002085	万丰奥威	25,100	173,943.00	0.10
184	600160	巨化股份	12,600	173,628.00	0.10
185	603456	九洲药业	6,000	164,280.00	0.09
186	601598	中国外运	35,000	163,100.00	0.09
187	002371	北方华创	500	158,825.00	0.09
188	600339	中油工程	38,300	155,881.00	0.09
189	300619	金银河	2,500	154,875.00	0.09
190	603088	宁波精达	18,200	152,516.00	0.09
191	600637	东方明珠	18,400	143,888.00	0.08
192	600566	济川药业	4,900	142,296.00	0.08
193	300001	特锐德	6,700	139,226.00	0.08
194	688551	科威尔	2,000	131,160.00	0.07
195	002533	金杯电工	15,900	129,744.00	0.07
196	603886	元祖股份	7,000	128,380.00	0.07
197	688569	铁科轨道	3,000	126,210.00	0.07
198	000913	钱江摩托	6,900	125,787.00	0.07
199	688510	航亚科技	6,300	125,307.00	0.07
200	000547	航天发展	12,500	125,000.00	0.07
201	000563	陕国投 A	40,600	123,830.00	0.07
202	002432	九安医疗	3,500	123,235.00	0.07
203	000822	山东海化	17,900	121,899.00	0.07
204	605077	华康股份	4,400	116,512.00	0.07
205	002938	鹏鼎控股	4,700	114,163.00	0.06
206	002429	兆驰股份	20,700	113,850.00	0.06
207	002049	紫光国微	1,200	111,900.00	0.06
208	688589	力合微	2,700	109,998.00	0.06
209	603466	风语筑	7,700	107,030.00	0.06
210	002465	海格通信	10,300	106,502.00	0.06
211	300523	辰安科技	4,400	104,984.00	0.06
212	603199	九华旅游	3,000	103,650.00	0.06
213	600728	佳都科技	14,800	102,564.00	0.06
214	002416	爱施德	13,800	101,844.00	0.06
215	300232	洲明科技	11,000	100,540.00	0.06
216	300384	三联虹普	5,900	100,241.00	0.06
217	600535	天士力	6,900	100,119.00	0.06
218	688248	南网科技	2,600	99,814.00	0.06
219	600350	山东高速	15,000	95,550.00	0.05
220	002756	永兴材料	1,480	92,662.80	0.05
221	300511	雪榕生物	11,900	90,440.00	0.05
222	300450	先导智能	2,400	86,808.00	0.05

223	301291	明阳电气	2,654	86,102.78	0.05
224	603267	鸿远电子	1,300	84,890.00	0.05
225	002111	威海广泰	8,800	83,952.00	0.05
226	300115	长盈精密	7,000	83,370.00	0.05
227	301395	仁信新材	2,944	78,545.92	0.04
228	300213	佳讯飞鸿	11,600	77,372.00	0.04
229	000807	云铝股份	6,000	76,380.00	0.04
230	688711	宏微科技	1,300	75,842.00	0.04
231	002624	完美世界	4,400	74,316.00	0.04
232	600019	宝钢股份	13,200	74,184.00	0.04
233	601699	潞安环能	4,400	71,808.00	0.04
234	301210	金杨股份	1,400	71,559.60	0.04
235	301486	致尚科技	1,095	63,137.70	0.04
236	301488	豪恩汽电	1,571	62,494.38	0.03
237	605358	立昂微	1,700	62,441.00	0.03
238	688281	华秦科技	300	60,750.00	0.03
239	600328	中盐化工	6,500	58,500.00	0.03
240	600580	卧龙电驱	4,000	58,440.00	0.03
241	301292	海科新源	2,912	58,210.88	0.03
242	002572	索菲亚	3,200	55,744.00	0.03
243	600390	五矿资本	9,700	52,186.00	0.03
244	002955	鸿合科技	2,200	51,810.00	0.03
245	603228	景旺电子	2,000	51,300.00	0.03
246	002409	雅克科技	700	51,016.00	0.03
247	300144	宋城演艺	4,100	50,840.00	0.03
248	600967	内蒙一机	4,900	49,490.00	0.03
249	600549	厦门钨业	2,600	49,478.00	0.03
250	603878	武进不锈	5,820	49,179.00	0.03
251	002155	湖南黄金	4,000	48,800.00	0.03
252	603109	神驰机电	2,700	48,195.00	0.03
253	601128	常熟银行	7,000	47,740.00	0.03
254	300638	广和通	2,100	47,628.00	0.03
255	002483	润邦股份	8,100	46,980.00	0.03
256	301261	恒工精密	1,184	43,689.60	0.02
257	000729	燕京啤酒	3,500	43,645.00	0.02
258	600073	上海梅林	5,500	40,150.00	0.02
259	300693	盛弘股份	1,000	36,920.00	0.02
260	605499	东鹏饮料	200	34,580.00	0.02
261	688468	科美诊断	3,500	33,250.00	0.02
262	601163	三角轮胎	2,000	31,740.00	0.02
263	601137	博威合金	2,000	31,120.00	0.02
264	002081	金螳螂	6,600	29,766.00	0.02
265	688249	晶合集成	1,444	26,078.64	0.01
266	603929	亚翔集成	1,400	23,520.00	0.01

267	600183	生益科技	1,600	22,720.00	0.01
268	000750	国海证券	6,700	22,445.00	0.01
269	600050	中国联通	4,300	20,640.00	0.01
270	600438	通威股份	600	20,586.00	0.01
271	002027	分众传媒	3,000	20,430.00	0.01
272	300003	乐普医疗	900	20,349.00	0.01
273	300639	凯普生物	2,000	20,040.00	0.01
274	601298	青岛港	2,800	19,516.00	0.01
275	002966	苏州银行	2,900	18,995.00	0.01
276	600732	爱旭股份	602	18,511.50	0.01
277	300118	东方日升	700	17,941.00	0.01
278	600970	中材国际	1,400	17,850.00	0.01
279	600498	烽火通信	800	16,296.00	0.01
280	301293	三博脑科	226	16,140.92	0.01
281	600827	百联股份	1,200	16,044.00	0.01
282	603339	四方科技	1,000	15,910.00	0.01
283	600511	国药股份	400	15,540.00	0.01
284	002990	盛视科技	400	14,720.00	0.01
285	002463	沪电股份	700	14,658.00	0.01
286	688301	奕瑞科技	48	13,556.64	0.01
287	603605	珀莱雅	120	13,488.00	0.01
288	002299	圣农发展	700	13,405.00	0.01
289	600258	首旅酒店	700	13,265.00	0.01
290	301325	曼恩斯特	119	12,846.05	0.01
291	600026	中远海能	1,000	12,640.00	0.01
292	300602	飞荣达	800	12,392.00	0.01
293	688361	中科飞测	190	12,287.30	0.01
294	300870	欧陆通	200	11,986.00	0.01
295	002033	丽江股份	1,100	11,968.00	0.01
296	300832	新产业	200	11,800.00	0.01
297	600803	新奥股份	600	11,388.00	0.01
298	301320	豪江智能	535	11,031.70	0.01
299	688484	南芯科技	298	10,939.58	0.01
300	300771	智莱科技	1,000	10,890.00	0.01
301	603056	德邦股份	700	10,794.00	0.01
302	603939	益丰药房	280	10,360.00	0.01
303	600096	云天化	600	10,242.00	0.01
304	301307	美利信	321	10,227.06	0.01
305	688531	日联科技	75	10,197.75	0.01
306	688629	华丰科技	545	10,131.55	0.01
307	301360	荣旗科技	108	10,000.80	0.01
308	688146	中船特气	259	9,875.67	0.01
309	600039	四川路桥	980	9,613.80	0.01
310	600667	太极实业	1,300	9,438.00	0.01

311	600710	苏美达	1,100	9,416.00	0.01
312	688562	航天软件	418	9,325.58	0.01
313	301387	光大同创	203	9,208.08	0.01
314	603737	三棵树	140	9,158.80	0.01
315	688576	西山科技	75	9,030.75	0.01
316	688443	智翔金泰	304	8,964.96	0.01
317	600801	华新水泥	700	8,645.00	0.00
318	001287	中电港	399	8,386.98	0.00
319	688352	顾中科技	693	8,364.51	0.00
320	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
321	600386	北巴传媒	2,000	8,180.00	0.00
322	301141	中科磁业	190	8,111.10	0.00
323	688582	芯动联科	195	7,932.60	0.00
324	600500	中化国际	1,400	7,784.00	0.00
325	688433	华曙高科	239	7,528.50	0.00
326	301382	蜂助手	229	7,520.36	0.00
327	688543	国科军工	140	7,427.00	0.00
328	688523	航天环宇	301	7,178.85	0.00
329	301357	北方长龙	146	7,064.94	0.00
330	688552	航天南湖	291	6,838.50	0.00
331	301295	美硕科技	189	6,817.23	0.00
332	688620	安凯微	550	6,787.00	0.00
333	688458	美芯晟	74	6,716.24	0.00
334	688593	新相微	444	6,477.96	0.00
335	688334	西高院	399	6,467.79	0.00
336	301383	天键股份	180	6,429.60	0.00
337	301428	世纪恒通	209	6,395.40	0.00
338	688581	安杰思	54	6,373.62	0.00
339	301386	未来电器	265	6,304.35	0.00
340	301203	国泰环保	176	6,054.40	0.00
341	301332	德尔玛	437	6,000.01	0.00
342	301355	南王科技	351	5,879.25	0.00
343	601061	中信金属	758	5,745.64	0.00
344	301305	朗坤环境	285	5,611.65	0.00
345	002170	芭田股份	800	5,496.00	0.00
346	002945	华林证券	400	5,472.00	0.00
347	301232	飞沃科技	91	5,316.22	0.00
348	000987	越秀资本	800	5,080.00	0.00
349	002937	兴瑞科技	200	4,920.00	0.00
350	603135	中重科技	274	4,901.86	0.00
351	688479	友车科技	166	4,895.34	0.00
352	301323	新莱福	123	4,841.28	0.00
353	301170	锡南科技	135	4,715.55	0.00
354	688631	莱斯信息	153	4,570.11	0.00

355	300839	博汇股份	340	4,518.60	0.00
356	001380	华纬科技	113	3,478.14	0.00
357	601133	柏诚股份	267	3,273.42	0.00
358	603279	景津装备	100	3,136.00	0.00
359	601065	江盐集团	260	3,078.40	0.00
360	001328	登康口腔	115	2,931.35	0.00
361	001282	三联锻造	75	2,477.25	0.00
362	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
363	001324	长青科技	109	2,136.40	0.00
364	603125	常青科技	86	2,109.58	0.00
365	001360	南矿集团	139	2,066.93	0.00
366	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
367	000960	锡业股份	100	1,555.00	0.00
368	002242	九阳股份	100	1,495.00	0.00
369	601857	中国石油	200	1,494.00	0.00
370	002673	西部证券	200	1,270.00	0.00
371	603399	吉翔股份	100	1,157.00	0.00
372	600871	石化油服	500	990.00	0.00
373	600167	联美控股	100	697.00	0.00
374	002092	中泰化学	100	645.00	0.00
375	600502	安徽建工	100	528.00	0.00
376	002421	达实智能	100	352.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688390	固德威	9,865,406.95	5.51
2	002625	光启技术	9,186,191.50	5.13
3	603688	石英股份	8,740,360.00	4.89
4	300390	天华新能	8,258,923.00	4.62
5	002422	科伦药业	8,151,293.00	4.56
6	600901	江苏金租	8,046,328.00	4.50
7	601231	环旭电子	7,891,392.00	4.41
8	000878	云南铜业	7,860,980.00	4.39
9	600598	北大荒	7,544,494.12	4.22
10	600968	海油发展	7,234,995.00	4.04
11	002048	宁波华翔	7,006,155.40	3.92
12	600582	天地科技	6,958,543.00	3.89
13	300073	当升科技	6,924,571.00	3.87
14	002244	滨江集团	6,919,430.00	3.87

15	688819	天能股份	6,849,558.97	3.83
16	600064	南京高科	6,837,711.60	3.82
17	600998	九州通	6,531,488.00	3.65
18	601958	金钼股份	6,396,243.00	3.58
19	601298	青岛港	6,387,555.00	3.57
20	002603	以岭药业	6,319,917.60	3.53
21	603345	安井食品	6,144,794.00	3.43
22	601168	西部矿业	6,100,905.00	3.41
23	600060	海信视像	6,092,229.00	3.41
24	688063	派能科技	6,010,150.13	3.36
25	002497	雅化集团	5,915,865.00	3.31
26	002250	联化科技	5,856,525.00	3.27
27	600732	爱旭股份	5,855,239.20	3.27
28	300017	网宿科技	5,816,438.00	3.25
29	601699	潞安环能	5,797,273.42	3.24
30	603605	珀莱雅	5,537,153.40	3.10
31	000728	国元证券	5,499,739.00	3.07
32	300724	捷佳伟创	5,315,422.00	2.97
33	603317	天味食品	5,314,540.00	2.97
34	300009	安科生物	5,208,975.99	2.91
35	600583	海油工程	5,207,234.75	2.91
36	601128	常熟银行	5,108,964.00	2.86
37	600755	厦门国贸	5,088,857.00	2.84
38	600373	中文传媒	4,959,418.00	2.77
39	600160	巨化股份	4,947,830.00	2.77
40	002056	横店东磁	4,928,334.36	2.75
41	600566	济川药业	4,927,516.00	2.75
42	002756	永兴材料	4,912,081.00	2.75
43	603600	永艺股份	4,861,971.00	2.72
44	688777	中控技术	4,831,544.38	2.70
45	300146	汤臣倍健	4,813,147.00	2.69
46	600655	豫园股份	4,792,771.98	2.68
47	300532	今天国际	4,665,969.00	2.61
48	000998	隆平高科	4,649,248.00	2.60
49	300308	中际旭创	4,638,129.00	2.59
50	002966	苏州银行	4,604,617.00	2.57
51	002831	裕同科技	4,577,055.58	2.56
52	002690	美亚光电	4,449,535.30	2.49
53	300136	信维通信	4,408,434.00	2.46
54	600499	科达制造	4,395,812.00	2.46
55	600398	海澜之家	4,326,471.00	2.42
56	600909	华安证券	4,317,844.20	2.41
57	002203	海亮股份	4,203,225.00	2.35
58	600377	宁沪高速	4,190,588.00	2.34

59	000987	越秀资本	4,166,725.53	2.33
60	600500	中化国际	4,126,357.00	2.31
61	000783	长江证券	4,119,914.00	2.30
62	600985	淮北矿业	4,103,816.00	2.29
63	300888	稳健医疗	4,084,808.00	2.28
64	688006	杭可科技	4,060,923.43	2.27
65	600481	双良节能	4,026,084.00	2.25
66	688385	复旦微电	4,006,779.92	2.24
67	603939	益丰药房	3,957,381.37	2.21
68	601000	唐山港	3,946,161.00	2.21
69	688301	奕瑞科技	3,938,780.84	2.20
70	603026	胜华新材	3,885,741.00	2.17
71	688122	西部超导	3,883,857.63	2.17
72	603127	昭衍新药	3,856,869.00	2.16
73	603355	莱克电气	3,853,141.00	2.15
74	601555	东吴证券	3,832,438.00	2.14
75	603056	德邦股份	3,799,433.00	2.12
76	002299	圣农发展	3,799,338.00	2.12
77	600435	北方导航	3,761,239.00	2.10
78	300003	乐普医疗	3,730,658.00	2.09
79	600153	建发股份	3,691,501.00	2.06
80	300298	三诺生物	3,658,207.00	2.04
81	002429	兆驰股份	3,655,079.00	2.04
82	688617	惠泰医疗	3,609,605.37	2.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601298	青岛港	6,905,740.00	3.86
2	603688	石英股份	6,884,543.00	3.85
3	600064	南京高科	6,872,958.40	3.84
4	688390	固德威	6,671,540.27	3.73
5	601231	环旭电子	6,525,549.20	3.65
6	600901	江苏金租	6,365,273.00	3.56
7	600598	北大荒	6,286,757.04	3.51
8	600582	天地科技	6,280,824.18	3.51
9	601699	潞安环能	5,852,860.00	3.27
10	603345	安井食品	5,805,601.32	3.25
11	600732	爱旭股份	5,774,092.00	3.23
12	600998	九州通	5,602,454.77	3.13
13	688819	天能股份	5,499,774.23	3.07

14	688063	派能科技	5,467,294.31	3.06
15	600968	海油发展	5,411,393.00	3.02
16	603605	珀莱雅	5,369,834.00	3.00
17	300073	当升科技	5,123,252.17	2.86
18	600060	海信视像	5,081,473.00	2.84
19	600566	济川药业	5,054,076.00	2.83
20	603317	天味食品	5,053,387.80	2.82
21	601128	常熟银行	4,825,395.88	2.70
22	002497	雅化集团	4,630,308.85	2.59
23	688777	中控技术	4,622,353.51	2.58
24	600160	巨化股份	4,558,981.00	2.55
25	600499	科达制造	4,554,743.00	2.55
26	603600	永艺股份	4,536,199.50	2.54
27	002603	以岭药业	4,514,755.00	2.52
28	601168	西部矿业	4,448,203.00	2.49
29	688385	复旦微电	4,138,491.93	2.31
30	600909	华安证券	3,915,416.00	2.19
31	603355	莱克电气	3,895,387.55	2.18
32	600500	中化国际	3,791,480.00	2.12
33	688122	西部超导	3,789,996.58	2.12
34	300390	天华新能	3,732,953.90	2.09
35	600755	厦门国贸	3,680,189.99	2.06
36	600985	淮北矿业	3,662,244.00	2.05
37	688301	奕瑞科技	3,613,306.20	2.02
38	600373	中文传媒	3,581,408.00	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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	912,317,182.03
卖出股票的收入（成交）总额	600,193,213.99

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

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	-	-
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）	10,000.20	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,000.20	0.01

## 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	118036	力合转债	100	10,000.20	0.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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	1,070,026.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	78,571.24
8	其他	-
9	合计	1,148,597.73

### 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

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

5,396	34,496.61	22,238,189.00	11.95%	163,905,505.00	88.05%
-------	-----------	---------------	--------	----------------	--------

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王平	5,380,754.00	2.89%
2	招商证券股份有限公司	5,037,654.00	2.71%
3	石家庄泛安科技开发有限公司	4,840,292.00	2.60%
4	方正证券股份有限公司	3,480,973.00	1.87%
5	北京华彬庄园绿色休闲健身俱乐部有限公司	3,200,060.00	1.72%
6	苏崇德	2,500,072.00	1.34%
7	麻炎平	2,000,058.00	1.07%
7	冯韶华	2,000,058.00	1.07%
9	倪青楠	2,000,038.00	1.07%
9	王伟芬	2,000,038.00	1.07%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

## 8.4 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

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、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

基金合同生效日（2023年2月13日）基金份额总额	487,643,694.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	25,500,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	327,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	186,143,694.00

## § 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	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
----	------	------	-----------	----

名称	数量	成交金额	占当期股票成交总额的占比	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	1,508,375,506.97	100.00%	1,103,074.77	100.00%	增加 3 个

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，本公司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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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占比	成交金额	占当期回购成交总额的占比	成交金额	占当期权证成交总额的占比
华泰证券	9,911.04	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-27
2	关于新增中国银河证券股份有限公司为部分基金流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-20
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国金证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-09
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华福证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-08
5	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01

6	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
7	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
8	关于博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增东北证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国中金财富证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-24
11	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-04
12	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-03
13	关于博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增部分券商为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-03
14	博时基金管理有限公司关于博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-03
15	关于博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增华创证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-01
16	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-27
17	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-27
18	关于博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-24
19	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-22
20	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-22

		露网站	
21	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
22	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-15
23	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-14
24	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
25	关于博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-08
26	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-06
27	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-19
28	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-19
29	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-19
30	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-19
31	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-19

## § 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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 500 增强策略交易型开放式指数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、报告期内博时中证 500 增强策略交易型开放式指数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、基金托管人处

### 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