

**博时中证 500 增强策略交易型开放式指数
证券投资基金
2025 年中期报告
2025 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：二〇二五年八月二十九日

§ 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 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
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
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	14
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
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	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
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	38
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	38
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	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
§9 开放式基金份额变动	41

§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
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	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 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	46,643,694.00 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	吴曼	刘强
	联系电话	0755-83169999	025-83387812
	电子邮箱	service@bosera.com	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		95105568	95597
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	http://www.bosera.com
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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,938,344.93
本期利润	6,214,462.86
加权平均基金份额本期利润	0.0961
本期加权平均净值利润率	9.37%
本期基金份额净值增长率	9.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,769,519.60
期末可供分配基金份额利润	0.0808
期末基金资产净值	51,159,804.93
期末基金份额净值	1.0968
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	9.68%

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。

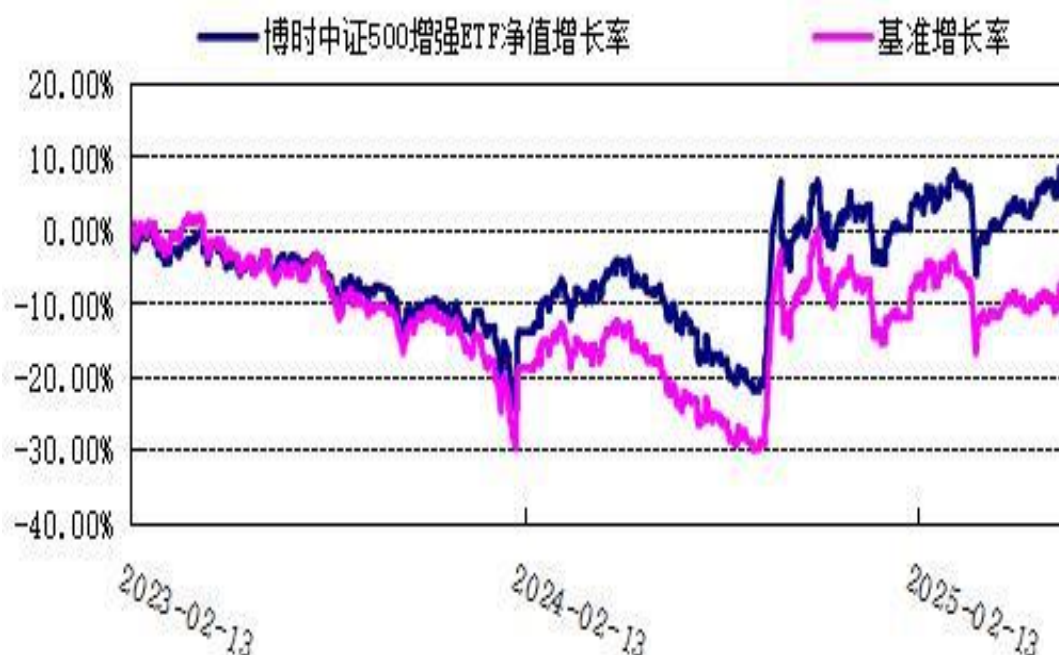
3.2 基金净值表现

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

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	6.37%	0.77%	4.31%	0.79%	2.06%	-0.02%
过去三个月	4.52%	1.54%	0.98%	1.50%	3.54%	0.04%
过去六个月	9.06%	1.34%	3.31%	1.36%	5.75%	-0.02%
过去一年	23.88%	1.66%	19.68%	1.72%	4.20%	-0.06%

自基金合同生效起至今	9.68%	1.35%	-6.61%	1.42%	16.29%	-0.07%
------------	-------	-------	--------	-------	--------	--------

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



§ 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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

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	-	11.8	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。

					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)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)的基金经理。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)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日一至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日一至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日一至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日一至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日一至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日一至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日一至今)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 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	-	18.8	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。曾任博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日-2024 年 7 月 10 日)基金经理。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)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 23 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

2025 年上半年，A 股市场虽经历了一波贸易战冲击，但在新质生产力产业链发力、宏观政策持续呵护之下，延续了 2024 年下半年以来的上涨行情。

具体来看，春节前后，两家非上市企业——DeepSeek 和宇树科技——分别发布创新性产品，为相关行业及产业链企业提供了强大的技术支撑与信心提振，引领了当季科技行情。但二季度初始，国际贸易环境出现波动，尽管多方努力后中美达成临时性关税协议，但整体贸易环境的不确定性有所升高，导致不少企业推迟或调整资本开支计划，出口型制造业的上游环节面临阶段性调整。在股票市场波动加大的背景下，宏观政策更为积极。市场流动性充裕，交易情绪较为活跃，A 股市场风格顺势转向结构性行情，中小市值

相关个股表现相对突出。

整个上半年，沪深 300 指数微涨 0.03%，中证 1000 指数上涨 6.69%，本基金业绩基准关联的权益指数——中证 500 指数上涨 3.31%。

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；特别的，我们提高了在指数上行时更有效的因子的暴露。本基金坚持控制跟踪误差：严格限制市值敞口的偏离，适当的放开了行业风险敞口的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0968 元，份额累计净值为 1.0968 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 9.06%，同期业绩基准增长率 3.31%。

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，我们对 A 股市场的乐观判断不变。国内方面，政策持续发力：7 月以来，先是年内第三批以旧换新补贴资金到账，随后国务院印发《育儿补贴制度实施方案》，开启新一波财政刺激。微观层面，陆续披露的半年报显示，AI 产业链景气度持续，大语言模型日益成熟，也为诸多传统行业提升生产率提供了助力。海外市场方面，美联储 9 月重启降息的预期升温，中美经贸会谈持续推进，双方正共同推动已暂停的对等关税及反制措施延续实施。市场对整体宏观基本面的担忧有限。值得关注的是，上证指数自 5 月以来连续数月上涨，市场内生的向上趋势正在形成，近十年高点 3732 点的压力区间已然松动。我们期待行情的进一步演绎。

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，适当提高指数上行时相对有效的因子的暴露，坚持控制基金与业绩基准中证 500 指数的跟踪误差，适当放开一定的行业偏离，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

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

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 2025 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			

货币资金	6.4.6.1	3,086,990.02	2,655,115.82
结算备付金		1,085,552.23	979,352.58
存出保证金		493,487.97	374,143.74
交易性金融资产	6.4.6.2	46,635,778.46	82,504,104.05
其中：股票投资		46,628,878.01	82,504,104.05
基金投资		-	-
债券投资		6,900.45	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		366,188.53	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	75,616.24	-
资产总计		51,743,613.45	86,512,716.19
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		471,674.69	94,003.01
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		21,963.43	39,495.27
应付托管费		4,392.70	7,899.05
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		255.75	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	85,521.95	237,858.07
负债合计		583,808.52	379,255.40
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	46,643,694.00	85,643,694.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	4,516,110.93	489,766.79
净资产合计		51,159,804.93	86,133,460.79
负债和净资产总计		51,743,613.45	86,512,716.19

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0968 元，基金份额总额 46,643,694.00 份。

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
一、营业总收入		6,545,532.16	786,265.97
1. 利息收入		27,295.50	27,840.17
其中：存款利息收入	6.4.6.9	27,295.50	27,840.17
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,233,696.44	983,146.97
其中：股票投资收益	6.4.6.10	3,480,038.42	-666,151.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	866.17	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	151,528.45	-208,276.68
股利收益	6.4.6.14	601,263.40	1,857,574.92
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）	6.4.6.15	2,276,117.93	-275,933.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	8,422.29	51,212.24
减：二、营业总支出		331,069.30	526,445.52
1. 管理人报酬		165,878.97	301,902.53
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		33,175.77	60,380.51
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	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		546.64	-
8. 其他费用	6.4.6.18	131,467.92	164,162.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,214,462.86	259,820.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,214,462.86	259,820.45

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,214,462.86	259,820.45

6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025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	85,643,694.00	-	489,766.79	86,133,460.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	85,643,694.00	-	489,766.79	86,133,460.79
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-39,000,000.00	-	4,026,344.14	-34,973,655.86
（一）、综合收益总额	-	-	6,214,462.86	6,214,462.86
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-39,000,000.00	-	-2,188,118.72	-41,188,118.72
其中：1. 基金申购款	10,500,000.00	-	-232,555.63	10,267,444.37
2. 基金赎回款	-49,500,000.00	-	-1,955,563.09	-51,455,563.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	46,643,694.00	-	4,516,110.93	51,159,804.93
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	150,143,694.00	-	-16,643,396.29	133,500,297.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	150,143,694.00	-	-16,643,396.29	133,500,297.71

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-34,500,000.00	-	3,385,007.14	-31,114,992.86
(一)、综合收益总额	-	-	259,820.45	259,820.45
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-34,500,000.00	-	3,125,186.69	-31,374,813.31
其中: 1. 基金申购款	10,500,000.00	-	-1,659,756.54	8,840,243.46
2. 基金赎回款	-45,000,000.00	-	4,784,943.23	-40,215,056.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	115,643,694.00	-	-13,258,389.15	102,385,304.85

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：王德英，会计机构负责人：陈子成

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 号准予注册，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）。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。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。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 6.4.4 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 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。

6.4.5 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	3,086,990.02
等于：本金	3,085,802.75
加：应计利息	1,187.27
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	3,086,990.02

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		44,387,285.72	-	46,628,878.01	2,241,592.29
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,900.00	0.45	6,900.45	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,900.00	0.45	6,900.45	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		44,394,185.72	0.45	46,635,778.46	2,241,592.29

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,349,640.00	-	-	-
——股指期货	3,349,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,349,640.00	-	-	-

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）之间按抵销后的净额为0。

6.4.6.3.2 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
IC2509	IC2509	3.00	3,465,480.00	115,840.00
合计	-	-	-	115,840.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	115,840.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	28,494.28
其中：交易所市场	28,494.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	47,110.68
应付 IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	85,521.95

6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,643,694.00	85,643,694.00
本期申购	10,500,000.00	10,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-49,500,000.00	-49,500,000.00
本期末	46,643,694.00	46,643,694.00

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）。

6.4.6.8 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
上年度末	1,222,342.03	-732,575.24	489,766.79
加：会计政策变更（若有）	-	-	-

前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	1,222,342.03	-732,575.24	489,766.79
本期利润	3,938,344.93	2,276,117.93	6,214,462.86
本期基金份额交易产生的变动数	-1,391,167.36	-796,951.36	-2,188,118.72
其中：基金申购款	356,190.37	-588,746.00	-232,555.63
基金赎回款	-1,747,357.73	-208,205.36	-1,955,563.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,769,519.60	746,591.33	4,516,110.93

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,000.50
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	4,107.39
其他	187.61
合计	27,295.50

6.4.6.10 股票投资收益

6.4.6.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,652,979.72
股票投资收益——赎回差价收入	827,058.70
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	3,480,038.42

6.4.6.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	177,930,733.64
减：卖出股票成本总额	175,097,736.60
减：交易费用	180,017.32
买卖股票差价收入	2,652,979.72

6.4.6.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	51,455,563.09
减：现金支付赎回款总额	25,556,584.09

减：赎回股票成本总额	25,071,920.30
减：交易费用	-
赎回差价收入	827,058.70

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	865.09
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	866.17

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,865.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00
减：应计利息总额	0.63
减：交易费用	0.20
买卖债券差价收入	865.09

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	151,528.45

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	601,263.40
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	601,263.40

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	2,150,677.93
——股票投资	2,150,677.93
——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	125,440.00
——权证投资	-
——股指期货	125,440.00
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	2,276,117.93

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	8,422.29
合计	8,422.29

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
其他	56.49
中登注册登记费	74,383.76
IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	131,467.92

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
华泰证券	30,867,646.80	9.16%	536,418,869.20	100.00%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

无。

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	6,368.89	9.17%	2,072.69	7.27%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	400,170.93	100.00%	204,991.49	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。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	165,878.97	301,902.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,275.00	20,446.93
应支付基金管理人的净管理费	151,603.97	281,455.60

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,175.77	60,380.51

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。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	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	2,752,791.00	5.90%	3,038,956.00	3.55%

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。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

6.4.9.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688692	达梦数据	网下发行	349.00	30,349.04

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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

123257	安克转债	2025-06-16	14 个交易日	新债未上市	100.00	100.01	69.00	6,900.00	6,900.45	-
--------	------	------------	---------	-------	--------	--------	-------	----------	----------	---

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。

6.4.11.2 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
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	4,500.00	120,630.76	171,225.00	-

注：本基金截至 2025 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。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管

理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，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。

6.4.12.2 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于借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 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 2025年6月30日	上年末 2024年12月31日
AAA	—	—
AAA 以下	6,900.45	—
未评级	—	—

合计	6,900.45	-
----	----------	---

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。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,086,990.02	-	-	-	3,086,990.02
结算备付金	1,085,552.23	-	-	-	1,085,552.23
存出保证金	77,630.37	-	-	415,857.60	493,487.97
交易性金融资产	-	-	6,900.45	46,628,878.01	46,635,778.46
应收清算款	-	-	-	366,188.53	366,188.53
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	4,250,172.62	-	6,900.45	47,486,540.38	51,743,613.45
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	471,674.69	471,674.69
应付管理人报酬	-	-	-	21,963.43	21,963.43
应付托管费	-	-	-	4,392.70	4,392.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	255.75	255.75
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	85,521.95	85,521.95
负债总计	-	-	-	583,808.52	583,808.52
利率敏感度缺口	4,250,172.62	-	6,900.45	46,902,731.86	51,159,804.93
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,655,115.82	-	-	-	2,655,115.82
结算备付金	979,352.58	-	-	-	979,352.58
存出保证金	101,724.54	-	-	272,419.20	374,143.74
交易性金融资产	-	-	-	82,504,104.05	82,504,104.05
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	-	-	-	-	-
资产总计	3,736,192.94	-	-	82,776,523.25	86,512,716.19

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	94,003.01	94,003.01
应付管理人报酬	-	-	-	39,495.27	39,495.27
应付托管费	-	-	-	7,899.05	7,899.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	237,858.07	237,858.07
负债总计	-	-	-	379,255.40	379,255.40
利率敏感度缺口	3,736,192.94	-	-	82,397,267.85	86,133,460.79

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。

6.4.12.4.1.2 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（不包括可转债和可交换债）、资产支持证券投资和国债期货投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	46,628,878.01	91.14	82,504,104.05	95.79
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	6,900.45	0.01	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	46,635,778.46	91.16	82,504,104.05	95.79

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。

6.4.12.4.3.2 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 236	增加约 413
	业绩比较基准下降 5%	减少约 236	减少约 413

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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 2025年6月30日
第一层次	46,457,653.01
第二层次	178,125.45
第三层次	—
合计	46,635,778.46

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	46,628,878.01	90.12
	其中：股票	46,628,878.01	90.12
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	6,900.45	0.01
	其中：债券	6,900.45	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	4,172,542.25	8.06
8	其他各项资产	935,292.74	1.81
9	合计	51,743,613.45	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	136,900.00	0.27
B	采矿业	2,042,606.50	3.99
C	制造业	28,319,485.97	55.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,036,869.00	2.03
E	建筑业	10,676.00	0.02
F	批发和零售业	2,055,158.72	4.02
G	交通运输、仓储和邮政业	1,023,800.00	2.00
H	住宿和餐饮业	33,912.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,601,613.02	7.04
J	金融业	4,965,145.40	9.71
K	房地产业	547,570.00	1.07
L	租赁和商务服务业	155,389.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	548,531.40	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	427,196.00	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	28,650.00	0.06
Q	卫生和社会工作	255,936.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,427,809.00	2.79

S	综合	11,630.00	0.02
	合计	46,628,878.01	91.14

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	300476	胜宏科技	5,900	792,842.00	1.55
2	300803	指南针	9,250	746,105.00	1.46
3	601555	东吴证券	83,000	726,250.00	1.42
4	689009	九号公司	12,001	710,099.17	1.39
5	300251	光线传媒	34,300	695,261.00	1.36
6	300454	深信服	7,100	668,678.00	1.31
7	603893	瑞芯微	4,400	668,184.00	1.31
8	000783	长江证券	93,600	648,648.00	1.27
9	002624	完美世界	42,300	641,691.00	1.25
10	002202	金风科技	62,000	635,500.00	1.24
11	002414	高德红外	61,600	631,400.00	1.23
12	603939	益丰药房	25,300	619,091.00	1.21
13	000988	华工科技	13,100	615,831.00	1.20
14	600873	梅花生物	56,900	608,261.00	1.19
15	000893	亚钾国际	19,900	599,786.00	1.17
16	603087	甘李药业	10,700	586,146.00	1.15
17	600998	九州通	112,948	580,552.72	1.13
18	688582	芯动联科	8,520	572,544.00	1.12
19	000709	河钢股份	264,000	570,240.00	1.11
20	601456	国联民生	54,900	568,215.00	1.11
21	603529	爱玛科技	16,200	557,280.00	1.09
22	688608	恒玄科技	1,600	556,768.00	1.09
23	300573	兴齐眼药	10,460	541,723.40	1.06
24	000959	首钢股份	157,000	533,800.00	1.04
25	601665	齐鲁银行	82,900	523,928.00	1.02
26	688213	思特威	5,101	521,424.22	1.02
27	002266	浙富控股	138,700	427,196.00	0.84
28	603565	中谷物流	43,500	415,425.00	0.81
29	000429	粤高速 A	30,800	410,564.00	0.80
30	300373	扬杰科技	7,800	404,820.00	0.79
31	603486	科沃斯	6,500	378,495.00	0.74
32	600988	赤峰黄金	15,200	378,176.00	0.74
33	603766	隆鑫通用	28,500	363,660.00	0.71
34	601168	西部矿业	21,400	355,882.00	0.70
35	600352	浙江龙盛	34,900	354,584.00	0.69
36	688120	华海清科	2,100	354,270.00	0.69
37	600578	京能电力	78,600	352,914.00	0.69
38	600582	天地科技	58,800	352,212.00	0.69
39	603379	三美股份	7,300	351,276.00	0.69

40	002138	顺络电子	12,200	343,064.00	0.67
41	300888	稳健医疗	8,300	341,130.00	0.67
42	300604	长川科技	7,300	327,843.00	0.64
43	002155	湖南黄金	18,150	323,977.50	0.63
44	688183	生益电子	6,200	317,440.00	0.62
45	600038	中直股份	8,100	314,361.00	0.61
46	300699	光威复材	9,800	310,366.00	0.61
47	600909	华安证券	53,100	309,573.00	0.61
48	600563	法拉电子	2,800	305,452.00	0.60
49	688297	中无人机	5,700	304,380.00	0.59
50	002532	天山铝业	36,600	304,146.00	0.59
51	688256	寒武纪	500	300,750.00	0.59
52	002080	中材科技	15,400	300,300.00	0.59
53	002939	长城证券	35,600	298,328.00	0.58
54	600583	海油工程	54,600	298,116.00	0.58
55	002926	华西证券	33,300	297,702.00	0.58
56	301165	锐捷网络	4,840	297,466.40	0.58
57	002595	豪迈科技	5,000	296,100.00	0.58
58	000723	美锦能源	68,300	295,056.00	0.58
59	600663	陆家嘴	33,300	295,038.00	0.58
60	002500	山西证券	50,500	294,920.00	0.58
61	600166	福田汽车	108,400	293,764.00	0.57
62	603233	大参林	17,900	291,770.00	0.57
63	002056	横店东磁	20,500	290,075.00	0.57
64	600132	重庆啤酒	5,206	286,850.60	0.56
65	000987	越秀资本	41,700	286,062.00	0.56
66	600499	科达制造	29,000	284,200.00	0.56
67	000423	东阿阿胶	5,300	277,190.00	0.54
68	002572	索菲亚	19,700	275,997.00	0.54
69	002299	圣农发展	19,100	272,939.00	0.53
70	603259	药明康德	3,900	271,245.00	0.53
71	002461	珠江啤酒	24,000	270,960.00	0.53
72	601991	大唐发电	85,300	270,401.00	0.53
73	600339	中油工程	82,500	269,775.00	0.53
74	688425	铁建重工	66,000	269,280.00	0.53
75	688685	迈信林	4,800	268,080.00	0.52
76	600299	安迪苏	27,700	267,305.00	0.52
77	002487	大金重工	8,100	266,490.00	0.52
78	600008	首创环保	87,400	263,948.00	0.52
79	301498	乖宝宠物	2,400	262,488.00	0.51
80	601098	中南传媒	20,000	262,400.00	0.51
81	002701	奥瑞金	43,800	260,610.00	0.51
82	603596	伯特利	4,900	258,181.00	0.50
83	688235	百济神州	1,100	257,004.00	0.50
84	600763	通策医疗	6,200	255,936.00	0.50
85	600866	星湖科技	36,800	254,288.00	0.50
86	000902	新洋丰	18,200	251,706.00	0.49
87	300492	华图山鼎	3,680	249,798.40	0.49
88	300365	恒华科技	37,900	249,761.00	0.49
89	600338	西藏珠峰	22,400	248,416.00	0.49

90	002758	浙农股份	27,600	246,468.00	0.48
91	000977	浪潮信息	4,800	244,224.00	0.48
92	000553	安道麦 A	33,800	244,036.00	0.48
93	688668	鼎通科技	3,900	243,594.00	0.48
94	002739	万达电影	20,900	238,887.00	0.47
95	300812	易天股份	10,300	238,033.00	0.47
96	300017	网宿科技	22,100	236,912.00	0.46
97	000831	中国稀土	6,500	234,780.00	0.46
98	002281	光迅科技	4,500	221,940.00	0.43
99	600007	中国国贸	10,600	218,148.00	0.43
100	600728	佳都科技	39,800	216,910.00	0.42
101	300502	新易盛	1,620	205,772.40	0.40
102	002850	科达利	1,800	203,706.00	0.40
103	601399	国机重装	67,100	201,300.00	0.39
104	002261	拓维信息	6,500	201,175.00	0.39
105	300207	欣旺达	10,000	200,600.00	0.39
106	300972	万辰集团	1,100	198,264.00	0.39
107	300627	华测导航	5,660	198,100.00	0.39
108	000528	柳工	20,600	197,966.00	0.39
109	600498	烽火通信	9,400	197,682.00	0.39
110	300054	鼎龙股份	6,800	195,024.00	0.38
111	688100	威胜信息	5,200	192,660.00	0.38
112	603466	风语筑	18,400	185,656.00	0.36
113	300395	菲利华	3,600	183,960.00	0.36
114	300735	光弘科技	7,100	178,210.00	0.35
115	688313	仕佳光子	4,500	171,225.00	0.33
116	688093	世华科技	5,500	170,775.00	0.33
117	688072	拓荆科技	1,100	169,081.00	0.33
118	601126	四方股份	10,200	165,954.00	0.32
119	000415	渤海租赁	46,300	154,179.00	0.30
120	600298	安琪酵母	4,300	151,231.00	0.30
121	603636	南威软件	11,800	149,152.00	0.29
122	688122	西部超导	2,840	147,339.20	0.29
123	300994	久祺股份	9,400	147,016.00	0.29
124	600062	华润双鹤	7,600	141,816.00	0.28
125	688387	信科移动	24,500	138,425.00	0.27
126	300967	晓鸣股份	7,400	136,900.00	0.27
127	300033	同花顺	500	136,505.00	0.27
128	601158	重庆水务	27,800	128,992.00	0.25
129	600312	平高电气	8,200	126,198.00	0.25
130	600482	中国动力	5,400	124,578.00	0.24
131	000636	风华高科	8,600	118,164.00	0.23
132	603858	步长制药	7,200	116,928.00	0.23
133	600487	亨通光电	7,600	116,280.00	0.23
134	300777	中简科技	3,100	112,375.00	0.22
135	603173	福斯达	3,000	106,650.00	0.21
136	688099	晶晨股份	1,400	99,414.00	0.19
137	002603	以岭药业	7,000	98,700.00	0.19
138	300074	华平股份	19,200	93,696.00	0.18
139	600871	石化油服	47,800	93,210.00	0.18

140	688522	纳睿雷达	1,800	92,196.00	0.18
141	603325	博隆技术	1,000	90,290.00	0.18
142	688070	纵横股份	1,800	86,940.00	0.17
143	600262	北方股份	3,800	86,640.00	0.17
144	000050	深天马 A	9,900	84,348.00	0.16
145	600536	中国软件	1,800	84,186.00	0.16
146	600517	国网英大	15,600	79,560.00	0.16
147	600143	金发科技	7,600	78,356.00	0.15
148	603713	密尔克卫	1,400	74,648.00	0.15
149	600531	豫光金铅	9,600	74,304.00	0.15
150	603612	索通发展	3,900	71,682.00	0.14
151	300595	欧普康视	4,600	70,242.00	0.14
152	300763	锦浪科技	1,200	68,868.00	0.13
153	603225	新凤鸣	6,400	68,160.00	0.13
154	600968	海油发展	15,900	64,872.00	0.13
155	600004	白云机场	7,100	64,610.00	0.13
156	605358	立昂微	2,700	62,910.00	0.12
157	600496	精工钢构	18,300	58,560.00	0.11
158	300475	香农芯创	1,600	57,008.00	0.11
159	301396	宏景科技	900	55,899.00	0.11
160	000039	中集集团	6,900	54,234.00	0.11
161	601333	广深铁路	18,300	52,887.00	0.10
162	002841	视源股份	1,500	51,900.00	0.10
163	000733	振华科技	1,000	50,050.00	0.10
164	688095	福昕软件	700	47,537.00	0.09
165	600528	中铁工业	6,400	47,232.00	0.09
166	000513	丽珠集团	1,300	46,852.00	0.09
167	000519	中兵红箭	2,100	45,969.00	0.09
168	603816	顾家家居	1,800	45,936.00	0.09
169	600459	贵研铂业	2,500	38,775.00	0.08
170	000062	深圳华强	1,400	37,604.00	0.07
171	300772	运达股份	2,900	37,352.00	0.07
172	603267	鸿远电子	700	35,189.00	0.07
173	002340	格林美	5,400	34,290.00	0.07
174	600258	首旅酒店	2,400	33,912.00	0.07
175	600895	张江高科	1,300	33,410.00	0.07
176	300048	合康新能	5,400	31,698.00	0.06
177	000526	学大教育	600	28,650.00	0.06
178	002958	青农商行	7,700	27,797.00	0.05
179	688334	西高院	1,600	27,488.00	0.05
180	300291	百纳千成	4,700	26,837.00	0.05
181	300199	翰宇药业	1,600	26,480.00	0.05
182	603966	法兰泰克	2,700	25,056.00	0.05
183	300496	中科创达	400	22,888.00	0.04
184	300623	捷捷微电	700	20,860.00	0.04
185	002170	芭田股份	2,000	20,500.00	0.04
186	601696	中银证券	1,800	19,242.00	0.04
187	601900	南方传媒	1,200	18,768.00	0.04
188	603833	欧派家居	300	16,935.00	0.03
189	688096	京源环保	1,100	16,742.00	0.03

190	600098	广州发展	2,600	16,250.00	0.03
191	601061	中信金属	1,800	14,238.00	0.03
192	600435	北方导航	800	12,472.00	0.02
193	600673	东阳光	1,000	11,630.00	0.02
194	300558	贝达药业	200	11,590.00	0.02
195	300866	安克创新	100	11,360.00	0.02
196	300601	康泰生物	700	10,633.00	0.02
197	002683	广东宏大	300	10,182.00	0.02
198	300677	英科医疗	400	9,472.00	0.02
199	301235	华康洁净	400	9,456.00	0.02
200	300762	上海瀚讯	400	9,052.00	0.02
201	000034	神州数码	200	7,528.00	0.01
202	600801	华新水泥	600	7,104.00	0.01
203	688475	萤石网络	200	6,304.00	0.01
204	002185	华天科技	600	6,060.00	0.01
205	002373	千方科技	500	4,650.00	0.01
206	002315	焦点科技	100	4,569.00	0.01
207	300073	当升科技	100	4,387.00	0.01
208	003043	华亚智能	100	4,365.00	0.01
209	601233	桐昆股份	300	3,180.00	0.01
210	603380	易德龙	100	2,660.00	0.01
211	600704	物产中大	500	2,635.00	0.01
212	601156	东航物流	200	2,618.00	0.01
213	603927	中科软	120	2,320.80	0.00
214	600901	江苏金租	340	2,060.40	0.00
215	001286	陕西能源	200	1,740.00	0.00
216	000960	锡业股份	100	1,530.00	0.00
217	600177	雅戈尔	200	1,460.00	0.00
218	002531	天顺风能	200	1,428.00	0.00
219	002064	华峰化学	200	1,322.00	0.00
220	600428	中远海特	200	1,250.00	0.00
221	600820	隧道股份	200	1,220.00	0.00
222	600755	厦门国贸	200	1,210.00	0.00
223	002563	森马服饰	200	1,052.00	0.00
224	601598	中国外运	200	986.00	0.00
225	600325	华发股份	200	974.00	0.00
226	688510	航亚科技	40	967.20	0.00
227	000883	湖北能源	200	902.00	0.00
228	688766	普冉股份	14	884.80	0.00
229	002429	兆驰股份	200	876.00	0.00
230	600282	南钢股份	200	840.00	0.00
231	601000	唐山港	200	812.00	0.00
232	603826	坤彩科技	40	782.80	0.00
233	000559	万向钱潮	100	765.00	0.00
234	002608	江苏国信	100	733.00	0.00
235	601016	节能风电	200	578.00	0.00
236	601216	君正集团	100	552.00	0.00
237	600863	内蒙华电	100	411.00	0.00
238	600688	上海石化	100	285.00	0.00
239	001227	兰州银行	100	250.00	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	000988	华工科技	1,661,629.00	1.93
2	002202	金风科技	1,365,262.00	1.59
3	300476	胜宏科技	1,055,343.00	1.23
4	300677	英科医疗	1,042,042.00	1.21
5	300803	指南针	1,003,939.80	1.17
6	002625	光启技术	979,294.00	1.14
7	601456	国联民生	940,372.00	1.09
8	603939	益丰药房	938,369.00	1.09
9	300573	兴齐眼药	933,735.00	1.08
10	300001	特锐德	929,926.00	1.08
11	600060	海信视像	915,391.00	1.06
12	689009	九号公司	903,005.96	1.05
13	601555	东吴证券	900,247.00	1.05
14	603766	隆鑫通用	891,773.00	1.04
15	000039	中集集团	883,679.00	1.03
16	601665	齐鲁银行	873,353.00	1.01
17	600995	南网储能	857,496.00	1.00
18	300251	光线传媒	842,358.00	0.98
19	300558	贝达药业	841,351.00	0.98
20	002155	湖南黄金	832,383.00	0.97

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	603129	春风动力	1,723,358.00	2.00
2	601168	西部矿业	1,518,423.00	1.76
3	600096	云天化	1,450,326.00	1.68
4	689009	九号公司	1,444,995.16	1.68
5	600988	赤峰黄金	1,437,412.00	1.67
6	603893	瑞芯微	1,344,055.00	1.56
7	601555	东吴证券	1,319,037.00	1.53
8	688122	西部超导	1,318,087.71	1.53
9	688099	晶晨股份	1,234,075.56	1.43
10	688578	艾力斯	1,227,231.50	1.42
11	600352	浙江龙盛	1,221,312.00	1.42
12	600141	兴发集团	1,220,084.00	1.42
13	600008	首创环保	1,167,458.00	1.36
14	600578	京能电力	1,125,764.00	1.31
15	600021	上海电力	1,123,856.00	1.30
16	600663	陆家嘴	1,111,592.00	1.29
17	600418	江淮汽车	1,108,332.00	1.29

18	002432	九安医疗	1,059,057.00	1.23
19	688120	华海清科	1,048,383.06	1.22
20	000039	中集集团	1,045,989.00	1.21

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	159,117,178.93
卖出股票的收入（成交）总额	177,930,733.64

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）	6,900.45	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,900.45	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	123257	安克转债	69	6,900.45	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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东吴证券股份有限公司在报告编制前一年受到中国证券监督管理委员会的处罚。胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制前一年受到中华人民共和国梅沙海关的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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	493,487.97
2	应收清算款	366,188.53
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	75,616.24
8	其他	-
9	合计	935,292.74

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
1,554	30,015.25	13,899,937.00	29.80%	32,743,757.00	70.20%

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	BARCLAYS BANK PLC	3,937,522.00	8.44%
2	北京华彬庄园绿色休闲健身俱乐部有限公司	3,200,060.00	6.86%
3	招商证券股份有限公司	2,752,791.00	5.90%
4	平安资管—工商银行—平安资产鑫享 32 号资产管理产品	2,481,900.00	5.32%
5	张达安	1,600,000.00	3.43%
6	韩菊萍	1,100,032.00	2.36%
7	王磊	957,800.00	2.05%
8	中国银河证券股份有限公司	681,624.00	1.46%
9	邢晓萍	600,011.00	1.29%
10	吴抗援	600,000.00	1.29%

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
本报告期期初基金份额总额	85,643,694.00
本报告期基金总申购份额	10,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	49,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	46,643,694.00

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，未发生涉及本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 2024 年起改聘容诚会计师事务所（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及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

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	
银河证券	2	35,186,114.50	10.44%	7,248.61	10.44%	增加 1 个
华泰证券	3	30,867,646.80	9.16%	6,368.89	9.17%	-
广发证券	2	270,994,151.27	80.40%	55,828.63	80.39%	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

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
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	4,865.92	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	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	2025-06-26
2	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-20250606	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
3	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-20250603	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为申购、赎回代办券	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披	2025-04-25

	商的公告	露网站	
5	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-22
6	博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
7	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-20250408	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
8	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
9	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增江海证券为申购、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	2025-03-25
11	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-20250325	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
12	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东方财富证券为申购、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	2025-03-05
13	博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-22
14	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增联储证券为申购、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	2025-01-02

§ 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、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数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 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
二〇二五年八月二十九日