

贝莱德中证500指数增强型证券投资基金 2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至06月30日止。

目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48

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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	贝莱德中证500指数增强	
基金主代码	025418	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年9月26日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	144,127,148.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	贝莱德中证500指数增强A	贝莱德中证500指数增强C
下属分级基金的交 易代码	025418	025419
报告期末下属分级 基金的份额总额	96,147,543.97份	47,979,604.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，通过量化选择股票的投资方法与严格的投资纪律约束，平衡预期收益、风险以及成本，优化管理组合，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金作为指数增强型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、金融衍生品投资策略 7、参与融资、转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		贝莱德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	王小飞
	联系电话	021-80225188	021-60637103
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-002-6655	021-60637228
传真		021-80225288	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郁蓓华	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.blackrock.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026年1月1日 - 2026年6月30日)	
	贝莱德中证500指数增强A	贝莱德中证500指数增强C
本期已实现收益	23,742,385.15	17,112,197.82
本期利润	29,123,911.77	16,492,742.15
加权平均基金份 额本期利润	0.2806	0.2118
本期加权平均净 值利润率	25.59%	19.34%
本期基金份额净	17.49%	17.25%

值增长率		
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2026年6月30日)	
期末可供分配利润	18,169,446.44	8,892,523.43
期末可供分配基金份额利润	0.1890	0.1853
期末基金资产净值	114,316,990.41	56,872,127.53
期末基金份额净值	1.1890	1.1853
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	18.90%	18.53%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

贝莱德中证500指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	16.39%	1.49%	17.61%	1.56%	-1.22%	-0.07%
过去六个月	17.49%	1.52%	19.93%	1.58%	-2.44%	-0.06%
自基金合同生效 日起至今	18.90%	1.39%	21.89%	1.45%	-2.99%	-0.06%

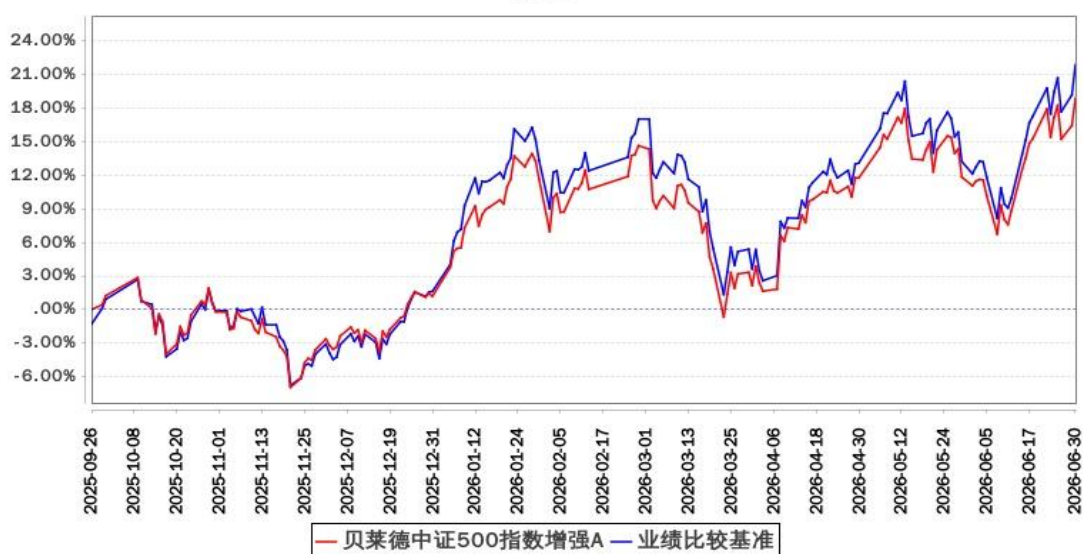
贝莱德中证500指数增强C

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

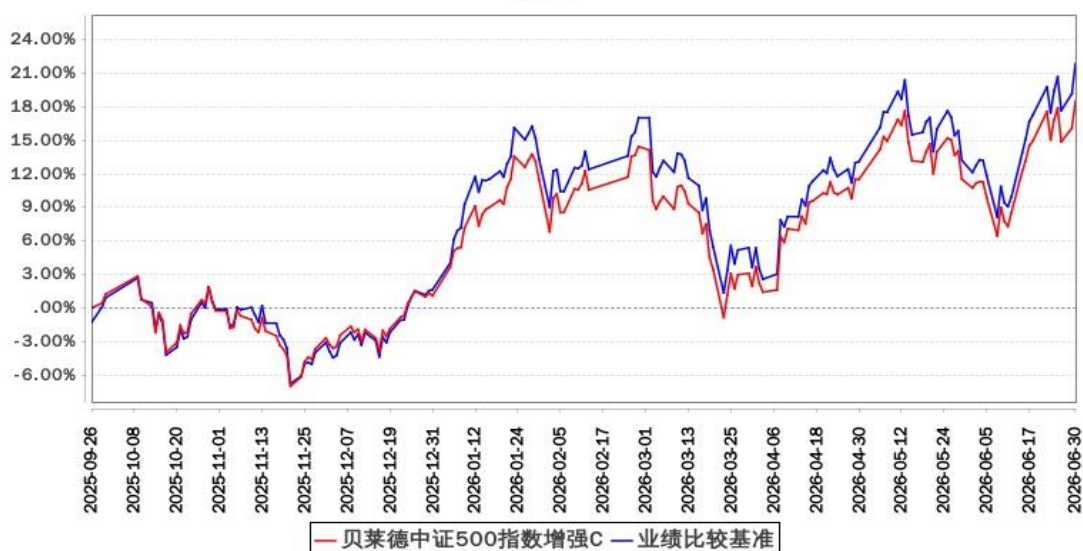
过去三个月	16.26%	1.49%	17.61%	1.56%	-1.35%	-0.07%
过去六个月	17.25%	1.52%	19.93%	1.58%	-2.68%	-0.06%
自基金合同生效 日起至今	18.53%	1.39%	21.89%	1.45%	-3.36%	-0.06%

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

贝莱德中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



贝莱德中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同于2025年09月26日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓京	本基金的基金经理，首席权益、多资产及指数投资官	2025年9月26日		15年	王晓京先生，首席权益、多资产及指数投资官，基金经理，曾受雇于贝莱德英国（BlackRock Investment Management (UK) Limited）以及贝莱德建信理财有限责任公司，历任研究员、基金经理等职务。加入贝莱德之前，王晓京先生曾就职于花旗银行（伦敦），任投资银行部分析员。王晓京先生是特许金融分析师（CFA）持证人，拥有清华大学电子信息工程学士学位、英国伯明翰大学电子工程硕士学位、伦敦大学电子工程博士学位。

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

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理

理办法》及行业协会的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在产品运作层面，截至2026年6月30日，本基金上半年取得了收益率17.49%（A类）及17.25%（C类），相较于业绩比较基准的超额收益分别为-2.44%（A类）及-2.68%（C类）。其中行业维度，上半年相较于业绩比较基准超额收益贡献居前的行业板块为机械设备、医药生物、汽车，主要贡献来自个股选择；而电子、通信及有色金属板块对组合的超额收益拖累居前，行业配置及个股选择均表现不佳。本基金上半年继续运用了股指期货优化组合的现金管理、灵活调节股票的风险敞口，股指期货的投资在本季度对整体组合管理及超额收益均有积极拉动。

回顾上半年权益市场的表现，中证500指数在开年短暂延续了春季躁动后陷入震荡，市场在等待政策及更多经济数据确认的过程中年初的涨幅被部分消化。基于此背景，本基金在1月降低了主动风险敞口，但仍将主要的主动风险暴露放在个股选择上，在市场震荡调整过程中，组合的累积超额收益逐渐修复。随后伴随中东冲突的爆发，投资者风险偏好剧烈收缩，全球权益资产不同程度受挫，A股市场也经历了较为剧烈的风格切换，本基金在偏成长板块上的布局下跌明显，

超额收益也出现了一定幅度回撤，但模型中更具防御性的质量信号及逆向情绪信号发挥了作用，在市场环境转变中取得了一定积极效果。4月停火协议初步达成以来，地缘冲突的烈度降低，全球风险资产、尤其A股市场的情绪重新升温。在海外映射、产业趋势催化及盈利确定性等多重因素共振下，二季度市场进入了科技类行业大幅引领其他行业的结构性牛市态势。市场风格也展现出了强劲的大盘成长偏向，资产间的表现分化显著，其中科创50指数表现亮眼，而中证红利指数仅二季度出现了双位数回撤。本基金在一季末的资金申购行为后，仓位于4月初回归正常，从投资风险预算角度而言，主要的主动风险暴露仍然放在个股选择上，而不是行业或风格因子的主动偏离。但二季度A股市场增量注意力聚焦科技，除了科技板块的强劲外，市场对于其他行业的反映不够显著。组合相对分散的布局在行业配置层面有所拖累，叠加情绪及基本面类的信号在这种极致的市场行情下表现不佳带来组合在个股选择上的拖累，二季度组合的超额收益因此出现了较明显的回撤，尤其是4月及6月中证500指数明显拉升的阶段。基于去年以来全球出现的AI结构性行情，贝莱德全球平台不断加强在主题行情方面的探索：充分运用大语言模型及前沿Agentic（自主的）科技去辨识符合特定主题的个股，进而生成该主题下的股票篮子并定义潜在受益、受损资产，从而构建适应特定主题行情的信号。因此，虽然上半年超额收益阶段性承压，我们认为模型及策略的长期有效性并未改变，仍对量化选股的投资方法论抱有信心。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金A类份额净值1.1890元，本报告期内净值增长率17.49%，同期业绩比较基准收益率19.93%。截至本报告期末，本基金C类份额净值1.1853元，本报告期内净值增长率17.25%，同期业绩比较基准收益率19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

二、中国在科技和高端制造业具备全球优势。AI领域中美是全球唯二在五层分类上均有显著布局的国家，中国科技企业有望在成本、技术和商业模式上以综合实力参与全球竞争，部分半导体和发电储能企业基于蓝海定位和高门槛，基本面持续向好。近期海内外科技板块短期表现有所波动，但拉长至24-36个月维度，我们认为科技的牛市并未结束。全球科技股动量回调源于前期

拥挤度过高和部分市场杠杆过高，而非头部公司基本面减速。AI需求仍在指数级上升，浪潮刚刚兴起，优质资产近期回调后估值吸引力进一步增强，配置价值显现。

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行

了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体： 贝莱德中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	9,349,417.78	97,312,950.81
结算备付金		3,370,222.26	19,556,083.78
存出保证金		1,622,155.20	3,964,684.80
交易性金融资产	6.4.7.2	157,727,005.45	356,821,061.70
其中：股票投资		148,613,376.13	346,756,694.03
基金投资		-	-
债券投资		9,113,629.32	10,064,367.67
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		191,873.36	503,621.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		172,260,674.05	478,158,402.34
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026年6月30日	2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		834,614.90	46,772,688.70
应付管理人报酬		98,313.41	368,212.45
应付托管费		18,433.75	69,039.82
应付销售服务费		19,142.95	78,386.33
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14,617.62	65,116.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	86,433.48	47,700.00
负债合计		1,071,556.11	47,401,143.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	144,127,148.07	425,815,881.05
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	27,061,969.87	4,941,377.84
净资产合计		171,189,117.94	430,757,258.89
负债和净资产总计		172,260,674.05	478,158,402.34

注： 报告截止日2026年06月30日，基金份额总额144,127,148.07份，其中A类基金份额净值1.1890元，基金份额96,147,543.97份；C类基金份额净值1.1853元，基金份额47,979,604.10份。

6.2 利润表

会计主体：贝莱德中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年1月1日至2026年6月30 日
一、营业总收入		46,838,336.73
1. 利息收入		58,291.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	57,466.07
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		825.70
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		42,001,610.73

其中：股票投资收益	6. 4. 7. 10	37, 655, 577. 59
基金投资收益		-
债券投资收益	6. 4. 7. 11	63, 461. 65
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6. 4. 7. 12	3, 324, 937. 46
股利收益	6. 4. 7. 13	957, 634. 03
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 14	4, 762, 070. 95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 15	16, 363. 28
减：二、营业总支出		1, 221, 682. 81
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	803, 221. 81
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	150, 604. 13
3. 销售服务费		172, 375. 03
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		12, 001. 10
8. 其他费用	6. 4. 7. 16	83, 480. 74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		45, 616, 653. 92
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		45, 616, 653. 92
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		45, 616, 653. 92

6.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	425, 815, 881. 05	-	4, 941, 377. 84	430, 757, 258. 89

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	425,815,881.05	-	4,941,377.84	430,757,258.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 281,688,732.98	-	22,120,592.03	-259,568,140.95
（一）、综合收益总额	-	-	45,616,653.92	45,616,653.92
（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）	- 281,688,732.98	-	-23,496,061.89	-305,184,794.87
其中：1. 基金申购款	168,217,657.05	-	15,609,278.04	183,826,935.09
2. 基金赎回款	- 449,906,390.03	-	-39,105,339.93	-489,011,729.96
（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	144,127,148.07	-	27,061,969.87	171,189,117.94

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：

郁蓓华

杨怡

徐菱莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

贝莱德中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1844号《关于准予贝莱德中证500指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由贝莱德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中证500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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641,923,386.04元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(25)第00323号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《贝莱德中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年9月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为642,036,966.22份基金份额,其中认购资金利息折合113,580.18份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《贝莱德中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《贝莱德中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中:在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中证500指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托

凭证)的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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

《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(4) 对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(5) 对于证券投资基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方

不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
活期存款	7,986,345.03
等于：本金	7,985,734.39
加：应计利息	610.64
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	1,363,072.75
等于：本金	1,362,490.52
加：应计利息	582.23
减：坏账准备	-
合计	9,349,417.78

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		140,475,744.27	-	148,613,376.13	8,137,631.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,000,500.00	111,829.32	9,113,629.32	1,300.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	9,000,500.00	111,829.32	9,113,629.32	1,300.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		149,476,244.27	111,829.32	157,727,005.45	8,138,931.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,176,853.33	-	-	-
其中： 股指期货	13,176,853.33	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,176,853.33	-	-	-

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
IC2612	IC2612	4.00	6,833,920.00	141,560.00
IC2609	IC2609	1.00	1,752,280.00	198,746.67
IM2612	IM2612	3.00	4,931,760.00	800.00
合计				341,106.67
减：可抵销 期货暂收款				341,106.67
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,160.45
其他	3,270.00
合计	86,433.48

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德中证500指数增强A

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	265,200,679.39	265,200,679.39
本期申购	110,809,366.92	110,809,366.92
本期赎回（以“-”号填列）	-279,862,502.34	-279,862,502.34
本期末	96,147,543.97	96,147,543.97

贝莱德中证500指数增强C

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	160,615,201.66	160,615,201.66
本期申购	57,408,290.13	57,408,290.13
本期赎回（以“-”号填列）	-170,043,887.69	-170,043,887.69

本期末	47,979,604.10	47,979,604.10
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

贝莱德中证500指数增强A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	622,623.06	2,563,235.96	3,185,859.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	622,623.06	2,563,235.96	3,185,859.02
本期利润	23,742,385.15	5,381,526.62	29,123,911.77
本期基金份额交易产生的变动数	-3,316,950.91	-10,823,373.44	-14,140,324.35
其中：基金申购款	14,110,141.28	-4,264,204.00	9,845,937.28
基金赎回款	-17,427,092.19	-6,559,169.44	-23,986,261.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,048,057.30	-2,878,610.86	18,169,446.44

贝莱德中证500指数增强C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	207,243.52	1,548,275.30	1,755,518.82
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	207,243.52	1,548,275.30	1,755,518.82
本期利润	17,112,197.82	-619,455.67	16,492,742.15
本期基金份额交易产生的变动数	-6,992,868.86	-2,362,868.68	-9,355,737.54
其中：基金申购款	5,005,924.38	757,416.38	5,763,340.76
基金赎回款	-11,998,793.24	-3,120,285.06	-15,119,078.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,326,572.48	-1,434,049.05	8,892,523.43

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	14,028.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,997.90
结算备付金利息收入	38,106.14
其他	333.34
合计	57,466.07

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	37,655,577.59
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	37,655,577.59

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	527,177,239.07
减：卖出股票成本总额	489,042,518.36
减：交易费用	479,143.12
买卖股票差价收入	37,655,577.59

6.4.7.10.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	63,261.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	200.00
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	63,461.65

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,013,700.00

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	999,800.00
减：应计利息总额	13,700.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	200.00

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	3,324,937.46

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	957,634.03
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	957,634.03

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	4,850,507.86
股票投资	4,851,007.86
债券投资	-500.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	-91,419.14
权证投资	—

股指期货	-91,419.14
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-2,982.23
合计	4,762,070.95

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	16,363.28
合计	16,363.28

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	23,653.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	110.29
汇划手续费	210.00
合计	83,480.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、注册登记机构、基金代销机构
贝莱德基金管理有限公司（“贝莱德基金”）	基金管理人、基金销售机构

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	803,221.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	367,889.95
应支付基金管理人的净管理费	435,331.86

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	150,604.13

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德中证500指数 增强A	贝莱德中证500指数 增强C	合计
中国建设银行	-	58,937.56	58,937.56
合计	-	58,937.56	58,937.56

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,986,345.03	14,028.69

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金，其预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层

负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本期持有银行存款和债券投资等利率敏感性资产。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,349,417.78	-	-	-	9,349,417.78
结算备付金	3,370,222.26	-	-	-	3,370,222.26
存出保证金	-	-	-	1,622,155.20	1,622,155.20
交易性金融资产	9,113,629.32	-	-	148,613,376.13	157,727,005.45
应收申购款	-	-	-	191,873.36	191,873.36
资产总计	21,833,269.36	-	-	150,427,404.69	172,260,674.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	834,614.90	834,614.90
应付管理人报酬	-	-	-	98,313.41	98,313.41
应付托管费	-	-	-	18,433.75	18,433.75
应付销售服务费	-	-	-	19,142.95	19,142.95
应交税费	-	-	-	14,617.62	14,617.62
其他负债	-	-	-	86,433.48	86,433.48
负债总计	-	-	-	1,071,556.11	1,071,556.11
利率敏感度缺口	21,833,269.36	-	-	149,355,848.58	171,189,117.94
上年度末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	97,312,950.81	-	-	-	97,312,950.81
结算备付金	19,556,083.78	-	-	-	19,556,083.78
存出保证金	-	-	-	3,964,684.80	3,964,684.80
交易性金融资产	10,064,367.67	-	-	346,756,694.03	356,821,061.70
应收申购款	-	-	-	503,621.25	503,621.25

资产总计	126,933,402.26	-	-351,225,000.08	478,158,402.34
负债				
应付赎回款	-	-	46,772,688.70	46,772,688.70
应付管理人报酬	-	-	368,212.45	368,212.45
应付托管费	-	-	69,039.82	69,039.82
应付销售服务费	-	-	78,386.33	78,386.33
应交税费	-	-	65,116.15	65,116.15
其他负债	-	-	47,700.00	47,700.00
负债总计	-	-	47,401,143.45	47,401,143.45
利率敏感度缺口	126,933,402.26	-	-303,823,856.63	430,757,258.89

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	利率上升25bp	-1,683.43	-13,510.11
	利率下降25bp	1,684.05	13,547.37

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	148,613,376.13	86.81	346,756,694.03	80.50
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	148,613,376.13	86.81	346,756,694.03	80.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	8,310,947.55	—
	业绩比较基准下降5%	-8,310,947.55	—

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

值的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	148,613,376.13	346,397,816.03
第二层次	9,113,629.32	10,423,245.67
第三层次	-	-
合计	157,727,005.45	356,821,061.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值与账面价值相等。
--

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	148,613,376.13	86.27
	其中：股票	148,613,376.13	86.27
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,113,629.32	5.29
	其中：债券	9,113,629.32	5.29
	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	12,719,640.04	7.38
8	其他各项资产	1,814,028.56	1.05
9	合计	172,260,674.05	100.00

- 注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。
- 2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。
- 3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	117,588.00	0.07
B	采矿业	3,455,576.00	2.02
C	制造业	102,897,354.11	60.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,009,012.00	0.59
E	建筑业	328,010.00	0.19
F	批发和零售业	2,108,523.00	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	663,676.00	0.39
H	住宿和餐饮业	341,810.00	0.20

I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,941,002.96	5.22
J	金融业	6,882,432.60	4.02
K	房地产业	220,590.00	0.13
L	租赁和商务服务业	1,125,222.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	2,542,519.56	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	568,744.00	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	365,904.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	131,567,964.23	76.86

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	889,999.00	0.52
C	制造业	12,403,454.20	7.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,997.00	0.08
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	75,082.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	936,375.00	0.55
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,614,464.70	0.94
J	金融业	71,610.00	0.04
K	房地产业	126,126.00	0.07
L	租赁和商务服务业	126,600.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	499,198.00	0.29
N	水利、环境和公	167,506.00	0.10

	共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,045,411.90	9.96

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600109	国金证券	339,400	2,979,932.00	1.74
2	688498	源杰科技	1,458	2,749,788.00	1.61
3	002008	大族激光	16,300	2,446,793.00	1.43
4	002271	东方雨虹	177,300	2,104,551.00	1.23
5	300604	长川科技	5,900	2,014,378.00	1.18
6	300012	华测检测	138,200	1,915,452.00	1.12
7	688002	睿创微纳	12,100	1,871,749.00	1.09
8	002738	中矿资源	29,700	1,752,003.00	1.02
9	600885	宏发股份	50,500	1,741,745.00	1.02
10	688347	华虹宏力	5,100	1,715,130.00	1.00
11	601233	桐昆股份	73,500	1,591,275.00	0.93
12	300223	北京君正	6,000	1,493,400.00	0.87
13	002281	光迅科技	5,500	1,413,170.00	0.83
14	300857	协创数据	3,920	1,332,408.00	0.78
15	001389	广合科技	5,500	1,304,875.00	0.76
16	002487	大金重工	21,700	1,257,949.00	0.73
17	688120	华海清科	3,800	1,224,284.00	0.72
18	002603	以岭药业	81,500	1,222,500.00	0.71
19	603345	安井食品	15,200	1,218,888.00	0.71
20	601555	东吴证券	150,400	1,191,168.00	0.70
21	300136	信维通信	9,700	1,156,725.00	0.68
22	300475	香农芯创	3,800	1,140,000.00	0.67
23	002064	华峰化学	118,900	1,128,361.00	0.66
24	002273	水晶光电	31,800	1,128,264.00	0.66
25	688235	百济神州	4,300	1,094,823.00	0.64

26	001309	德明利	1,100	1,037,190.00	0.61
27	688037	芯源微	2,350	1,031,767.50	0.60
28	300054	鼎龙股份	9,400	996,118.00	0.58
29	600352	浙江龙盛	82,000	993,020.00	0.58
30	688361	中科飞测	2,300	989,000.00	0.58
31	002436	兴森科技	19,400	988,430.00	0.58
32	300073	当升科技	20,100	965,604.00	0.56
33	002850	科达利	5,100	965,430.00	0.56
34	000783	长江证券	97,000	945,750.00	0.55
35	601869	长飞光纤	1,700	928,030.00	0.54
36	300567	精测电子	2,900	921,040.00	0.54
37	603699	纽威股份	18,100	910,430.00	0.53
38	300548	长芯博创	3,200	889,600.00	0.52
39	300751	迈为股份	3,100	875,626.00	0.51
40	688220	翱捷科技	6,800	845,376.00	0.49
41	300620	光库科技	2,200	832,040.00	0.49
42	300037	新宙邦	8,900	826,365.00	0.48
43	300957	贝泰妮	26,000	819,260.00	0.48
44	000951	中国重汽	40,120	782,741.20	0.46
45	002126	银轮股份	15,700	781,860.00	0.46
46	688099	晶晨股份	7,500	771,750.00	0.45
47	002851	麦格米特	4,600	769,028.00	0.45
48	000050	深天马A	76,400	757,124.00	0.44
49	300001	特锐德	19,900	752,817.00	0.44
50	600060	海信视像	26,900	749,703.00	0.44
51	301536	星辰科技	5,800	746,518.00	0.44
52	600316	洪都航空	26,400	737,616.00	0.43
53	688180	君实生物-U	21,800	737,276.00	0.43
54	002410	广联达	88,500	722,160.00	0.42
55	300285	国瓷材料	6,977	719,886.86	0.42
56	002299	圣农发展	47,200	715,552.00	0.42
57	688702	盛科通信-U	1,800	701,982.00	0.41
58	300458	全志科技	17,720	699,231.20	0.41
59	603979	金诚信	11,800	696,554.00	0.41
60	002138	顺络电子	9,300	679,830.00	0.40
61	300373	扬杰科技	4,300	676,089.00	0.39
62	688301	奕瑞科技	5,400	669,600.00	0.39
63	600105	永鼎股份	9,900	668,052.00	0.39
64	300058	蓝色光标	48,400	665,984.00	0.39
65	689009	九号公司	17,400	663,810.00	0.39
66	301377	鼎泰高科	1,200	661,080.00	0.39
67	300487	蓝晓科技	11,000	647,350.00	0.38
68	002812	恩捷股份	9,500	635,645.00	0.37

69	000039	中集集团	77,900	631,769.00	0.37
70	688200	华峰测控	1,200	630,120.00	0.37
71	688385	复旦微电	8,700	620,223.00	0.36
72	300757	罗博特科	1,000	619,000.00	0.36
73	688019	安集科技	1,820	617,817.20	0.36
74	300395	菲利华	4,600	615,158.00	0.36
75	688777	中控技术	5,200	611,000.00	0.36
76	688313	仕佳光子	3,300	609,345.00	0.36
77	688052	纳芯微	2,058	593,341.98	0.35
78	001286	陕西能源	57,700	585,078.00	0.34
79	603766	隆鑫通用	48,300	576,219.00	0.34
80	002841	视源股份	16,600	573,198.00	0.33
81	002266	浙富控股	112,400	568,744.00	0.33
82	000831	中国稀土	10,200	565,998.00	0.33
83	300432	富临精工	28,100	564,529.00	0.33
84	603129	春风动力	2,200	562,760.00	0.33
85	300666	江丰电子	1,500	552,900.00	0.32
86	600392	盛和资源	18,500	550,745.00	0.32
87	603160	汇顶科技	8,800	543,048.00	0.32
88	300346	南大光电	5,800	537,370.00	0.31
89	600988	赤峰黄金	20,300	534,296.00	0.31
90	605358	立昂微	6,800	527,680.00	0.31
91	002402	和而泰	20,400	526,932.00	0.31
92	000683	博源化工	91,400	526,464.00	0.31
93	603225	新凤鸣	26,700	524,655.00	0.31
94	002821	凯莱英	3,200	518,400.00	0.30
95	600298	安琪酵母	14,200	514,040.00	0.30
96	600497	驰宏锌锗	42,000	508,620.00	0.30
97	600764	中国海防	28,900	503,727.00	0.29
98	688778	厦钨新能	9,200	500,480.00	0.29
99	002195	岩山科技	76,100	497,694.00	0.29
100	688469	芯联集成-U	45,500	482,755.00	0.28
101	603606	东方电缆	11,520	478,195.20	0.28
102	688213	思特威	4,400	471,108.00	0.28
103	688475	萤石网络	17,200	470,420.00	0.27
104	600499	科达制造	34,000	469,200.00	0.27
105	000729	燕京啤酒	46,300	469,019.00	0.27
106	300972	万辰集团	2,700	468,207.00	0.27
107	688676	金盘科技	5,500	465,520.00	0.27
108	300919	中伟新材	10,500	459,375.00	0.27
109	600601	方正科技	32,600	451,184.00	0.26
110	603659	璞泰来	15,400	445,522.00	0.26
111	688561	奇安信	18,500	443,630.00	0.26

112	601666	平煤股份	60,900	435,435.00	0.25
113	300017	网宿科技	33,200	431,932.00	0.25
114	002120	韵达股份	67,600	429,936.00	0.25
115	603256	宏和科技	1,600	424,528.00	0.25
116	601139	深圳燃气	74,900	423,934.00	0.25
117	600498	烽火通信	5,700	419,520.00	0.25
118	300146	汤臣倍健	45,900	414,936.00	0.24
119	600166	福田汽车	141,100	410,601.00	0.24
120	300003	乐普医疗	34,400	407,640.00	0.24
121	688331	荣昌生物	3,100	403,806.00	0.24
122	688027	国盾量子	800	403,208.00	0.24
123	603816	顾家家居	18,000	402,480.00	0.24
124	603308	应流股份	6,600	398,640.00	0.23
125	688599	天合光能	28,200	398,184.00	0.23
126	000738	航发控制	21,600	395,064.00	0.23
127	688122	西部超导	6,200	389,422.00	0.23
128	600282	南钢股份	84,700	388,773.00	0.23
129	600038	中直股份	15,300	386,937.00	0.23
130	688608	恒玄科技	2,300	384,537.00	0.22
131	300759	康龙化成	13,100	378,983.00	0.22
132	300024	机器人	19,600	378,868.00	0.22
133	300115	长盈精密	13,400	374,396.00	0.22
134	000878	云南铜业	23,500	373,180.00	0.22
135	000960	锡业股份	8,700	371,403.00	0.22
136	300207	欣旺达	19,300	366,507.00	0.21
137	600763	通策医疗	10,800	365,904.00	0.21
138	002517	恺英网络	22,500	365,625.00	0.21
139	603444	吉比特	1,019	365,229.98	0.21
140	002065	东华软件	48,600	347,004.00	0.20
141	000893	亚钾国际	8,400	343,476.00	0.20
142	600754	锦江酒店	19,000	341,810.00	0.20
143	600546	山煤国际	31,200	341,016.00	0.20
144	688322	奥比中光	2,600	339,430.00	0.20
145	300339	润和软件	8,800	338,888.00	0.20
146	000703	恒逸石化	24,500	332,465.00	0.19
147	600711	盛屯矿业	29,900	328,003.00	0.19
148	600801	华新建材	20,500	319,800.00	0.19
149	000021	深科技	4,900	314,923.00	0.18
150	600171	上海贝岭	9,700	309,818.00	0.18
151	000423	东阿阿胶	6,800	308,448.00	0.18
152	300677	英科医疗	7,800	305,526.00	0.18
153	300496	中科创达	4,900	302,771.00	0.18
154	000034	神州数码	10,880	301,920.00	0.18

155	603737	三棵树	12,420	299,322.00	0.17
156	688018	乐鑫科技	2,300	294,216.00	0.17
157	300748	金力永磁	9,500	293,075.00	0.17
158	688017	绿的谐波	700	292,502.00	0.17
159	688192	迪哲医药	7,300	291,489.00	0.17
160	300454	深信服	2,900	278,980.00	0.16
161	688234	天岳先进	1,600	277,616.00	0.16
162	002203	海亮股份	12,100	276,485.00	0.16
163	002624	完美世界	22,100	274,482.00	0.16
164	002056	横店东磁	8,900	271,272.00	0.16
165	300953	震裕科技	2,000	267,400.00	0.16
166	600369	西南证券	66,300	266,526.00	0.16
167	601615	明阳智能	22,500	260,325.00	0.15
168	600143	金发科技	16,600	256,470.00	0.15
169	002155	湖南黄金	10,600	253,022.00	0.15
170	002152	广电运通	26,900	252,322.00	0.15
171	300676	华大基因	7,076	248,084.56	0.14
172	000415	渤海租赁	60,900	247,863.00	0.14
173	002185	华天科技	11,000	245,410.00	0.14
174	002500	山西证券	46,900	242,004.00	0.14
175	601608	中信重工	50,500	240,885.00	0.14
176	601699	潞安环能	16,600	237,048.00	0.14
177	601156	东航物流	14,500	233,740.00	0.14
178	688772	珠海冠宇	11,600	227,708.00	0.13
179	300383	光环新网	18,200	226,408.00	0.13
180	688615	合合信息	2,000	226,200.00	0.13
181	601198	东兴证券	16,500	224,235.00	0.13
182	601958	金钼股份	7,900	222,069.00	0.13
183	601155	新城控股	21,500	220,590.00	0.13
184	000932	华菱钢铁	62,400	216,528.00	0.13
185	301200	大族数控	600	216,390.00	0.13
186	002131	利欧股份	44,500	211,375.00	0.12
187	002430	杭氧股份	6,800	210,528.00	0.12
188	300002	神州泰岳	26,700	208,527.00	0.12
189	688578	艾力斯	1,900	207,480.00	0.12
190	688188	柏楚电子	1,940	206,998.00	0.12
191	300699	光威复材	7,200	206,280.00	0.12
192	600486	扬农化工	4,000	202,800.00	0.12
193	603233	大参林	13,200	198,396.00	0.12
194	603806	福斯特	11,700	196,443.00	0.11
195	601865	福莱特	18,300	192,333.00	0.11
196	002939	长城证券	23,000	191,820.00	0.11
197	002472	双环传动	4,600	190,946.00	0.11

198	600685	中船防务	7,500	190,800.00	0.11
199	601799	星宇股份	2,100	190,302.00	0.11
200	002465	海格通信	14,900	190,273.00	0.11
201	600808	马钢股份	75,000	187,500.00	0.11
202	002414	高德红外	13,600	180,336.00	0.11
203	600380	健康元	19,000	178,980.00	0.10
204	002340	格林美	26,000	171,860.00	0.10
205	601611	中国核建	15,400	171,710.00	0.10
206	600583	海油工程	34,100	171,523.00	0.10
207	688728	格科微	8,000	168,320.00	0.10
208	300142	沃森生物	12,900	167,571.00	0.10
209	300763	锦浪科技	1,800	162,630.00	0.10
210	000060	中金岭南	21,300	161,241.00	0.09
211	301358	湖南裕能	2,100	159,327.00	0.09
212	600820	隧道股份	30,000	156,300.00	0.09
213	603920	世运电路	3,200	153,728.00	0.09
214	600909	华安证券	13,800	153,318.00	0.09
215	688411	海博思创	500	145,600.00	0.09
216	600363	联创光电	4,000	143,120.00	0.08
217	002444	巨星科技	4,600	143,060.00	0.08
218	000709	河钢股份	72,700	141,038.00	0.08
219	600602	云赛智联	8,700	139,896.00	0.08
220	000830	鲁西化工	11,600	139,200.00	0.08
221	603338	浙江鼎力	3,200	136,000.00	0.08
222	603341	龙旗科技	3,200	135,968.00	0.08
223	002312	川发龙蟒	14,800	135,716.00	0.08
224	601665	齐鲁银行	23,500	135,595.00	0.08
225	688375	国博电子	1,300	135,590.00	0.08
226	002683	广东宏大	4,500	131,805.00	0.08
227	300390	天华新能	1,400	130,914.00	0.08
228	002756	永兴材料	2,200	124,608.00	0.07
229	601696	中银证券	9,600	121,440.00	0.07
230	600131	国网信通	8,300	121,180.00	0.07
231	601128	常熟银行	20,630	120,066.60	0.07
232	601118	海南橡胶	23,900	117,588.00	0.07
233	688281	华秦科技	2,240	112,515.20	0.07
234	688629	华丰科技	600	112,506.00	0.07
235	300627	华测导航	3,900	110,760.00	0.06
236	002335	科华数据	2,515	106,761.75	0.06
237	600348	华阳股份	13,700	104,805.00	0.06
238	688169	石头科技	1,100	104,467.00	0.06
239	601212	白银有色	20,400	103,632.00	0.06
240	002085	万丰奥威	9,200	102,028.00	0.06

241	688709	成都华微	2,500	95,225.00	0.06
242	300623	捷捷微电	2,000	89,980.00	0.05
243	000009	中国宝安	12,800	79,744.00	0.05
244	600595	中孚实业	13,800	77,556.00	0.05
245	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.04
246	000800	一汽解放	12,700	75,565.00	0.04
247	002130	沃尔核材	3,800	72,048.00	0.04
248	600095	湘财股份	9,200	69,276.00	0.04
249	603728	鸣志电器	1,100	67,012.00	0.04
250	688387	信科移动-U	3,300	65,472.00	0.04
251	002318	久立特材	2,600	62,140.00	0.04
252	688114	华大智造	1,200	61,296.00	0.04
253	688363	华熙生物	1,700	60,809.00	0.04
254	002601	龙佰集团	3,600	59,328.00	0.03
255	002432	九安医疗	800	56,544.00	0.03
256	300724	捷佳伟创	800	56,480.00	0.03
257	000750	国海证券	15,200	55,936.00	0.03
258	002926	华西证券	6,600	53,922.00	0.03
259	002670	国盛证券	4,700	51,700.00	0.03
260	000737	北方铜业	3,900	51,558.00	0.03
261	600562	国睿科技	2,100	44,562.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	601333	广深铁路	340,500	936,375.00	0.55
2	002080	中材科技	8,300	747,000.00	0.44
3	002532	天山铝业	68,300	732,859.00	0.43
4	002353	杰瑞股份	4,700	716,750.00	0.42
5	601636	旗滨集团	49,500	506,385.00	0.30
6	300438	鹏辉能源	6,100	505,385.00	0.30
7	601168	西部矿业	18,500	502,090.00	0.29
8	000933	神火股份	23,600	500,320.00	0.29
9	002497	雅化集团	21,900	446,103.00	0.26
10	688390	固德威	4,050	439,465.50	0.26
11	600309	万华化学	6,300	430,983.00	0.25
12	002415	海康威视	12,200	417,240.00	0.24
13	603228	景旺电子	4,900	354,809.00	0.21
14	000426	兴业银锡	10,400	342,784.00	0.20
15	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.19
16	300450	先导智能	7,200	293,184.00	0.17
17	600031	三一重工	16,800	290,304.00	0.17
18	688396	华润微	2,900	282,895.00	0.17

19	688023	安恒信息	7,600	279,072.00	0.16
20	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.15
21	300568	星源材质	13,200	247,104.00	0.14
22	002558	巨人网络	8,700	239,772.00	0.14
23	688063	派能科技	4,500	239,715.00	0.14
24	601231	环旭电子	7,000	226,800.00	0.13
25	688700	东威科技	2,500	223,500.00	0.13
26	688800	瑞可达	2,200	211,134.00	0.12
27	002001	新和成	7,400	210,308.00	0.12
28	601677	明泰铝业	12,600	209,160.00	0.12
29	688321	微芯生物	7,800	205,374.00	0.12
30	000338	潍柴动力	7,500	204,375.00	0.12
31	688525	佰维存储	400	197,892.00	0.12
32	300750	宁德时代	500	196,505.00	0.11
33	603236	移远通信	3,780	193,422.60	0.11
34	603916	苏博特	13,400	183,044.00	0.11
35	603259	药明康德	1,400	174,314.00	0.10
36	600323	瀚蓝环境	6,100	167,506.00	0.10
37	000807	云铝股份	7,400	163,836.00	0.10
38	688595	芯海科技	3,600	157,896.00	0.09
39	603927	中科软	12,370	157,222.70	0.09
40	688153	唯捷创芯	4,700	150,964.00	0.09
41	603187	海容冷链	12,500	143,625.00	0.08
42	002396	星网锐捷	7,480	143,391.60	0.08
43	688222	成都先导	4,400	141,284.00	0.08
44	688598	金博股份	2,800	138,460.00	0.08
45	600150	中国船舶	4,000	135,160.00	0.08
46	600900	长江电力	5,100	134,997.00	0.08
47	605020	永和股份	3,200	130,304.00	0.08
48	605168	三人行	2,500	126,600.00	0.07
49	600325	华发股份	54,600	126,126.00	0.07
50	600496	精工钢构	40,400	125,240.00	0.07
51	002028	思源电气	700	121,100.00	0.07
52	002405	四维图新	18,200	117,754.00	0.07
53	688012	中微公司	247	115,719.50	0.07
54	688365	光云科技	7,300	115,121.00	0.07
55	688372	伟测科技	600	111,600.00	0.07
56	688080	映翰通	2,440	105,530.00	0.06
57	688110	东芯股份	500	101,850.00	0.06
58	600361	创新新材	27,600	99,360.00	0.06
59	600817	宇通重工	10,400	91,520.00	0.05
60	300049	福瑞医科	2,300	89,424.00	0.05
61	688111	金山办公	400	85,220.00	0.05

62	000792	盐湖股份	2,800	84,532.00	0.05
63	002602	世纪华通	5,900	83,190.00	0.05
64	688177	百奥泰	4,900	82,418.00	0.05
65	002544	普天科技	4,300	78,346.00	0.05
66	603214	爱婴室	6,200	75,082.00	0.04
67	600446	金证股份	7,200	72,432.00	0.04
68	300347	泰格医药	1,500	72,000.00	0.04
69	601318	中国平安	1,500	71,610.00	0.04
70	300118	东方日升	5,600	69,720.00	0.04
71	000408	藏格矿业	1,000	69,320.00	0.04
72	605123	派克新材	700	67,907.00	0.04
73	688288	鸿泉技术	3,800	67,526.00	0.04
74	688787	海天瑞声	500	67,225.00	0.04
75	301165	锐捷网络	820	65,969.00	0.04
76	300457	赢合科技	2,900	61,132.00	0.04
77	600741	华域汽车	3,700	57,424.00	0.03
78	002460	赣锋锂业	800	52,320.00	0.03
79	002916	深南电路	100	45,790.00	0.03
80	600489	中金黄金	2,500	45,125.00	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	5,621,427.79	1.31
2	601555	东吴证券	3,841,650.00	0.89
3	600109	国金证券	3,138,418.00	0.73
4	002738	中矿资源	2,963,001.37	0.69
5	002271	东方雨虹	2,686,264.00	0.62
6	300012	华测检测	2,628,903.00	0.61
7	002532	天山铝业	2,492,371.00	0.58
8	601233	桐昆股份	2,423,766.00	0.56
9	002008	大族激光	2,228,409.00	0.52
10	600885	宏发股份	2,096,714.08	0.49
11	600096	云天化	2,096,445.00	0.49
12	000423	东阿阿胶	2,075,528.00	0.48
13	603345	安井食品	2,062,940.00	0.48
14	603444	吉比特	2,007,549.11	0.47
15	600352	浙江龙盛	1,988,191.00	0.46
16	002603	以岭药业	1,884,453.00	0.44
17	002299	圣农发展	1,858,921.00	0.43
18	300308	中际旭创	1,767,549.00	0.41
19	002402	和而泰	1,730,674.00	0.40

20	002487	大金重工	1,698,565.00	0.39
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002008	大族激光	10,031,278.00	2.33
2	300003	乐普医疗	7,576,607.00	1.76
3	600282	南钢股份	6,608,785.99	1.53
4	002353	杰瑞股份	6,264,598.00	1.45
5	300073	当升科技	5,898,118.00	1.37
6	600096	云天化	5,378,010.00	1.25
7	300054	鼎龙股份	5,307,075.00	1.23
8	300207	欣旺达	5,179,541.00	1.20
9	002624	完美世界	5,060,934.00	1.17
10	600487	亨通光电	4,854,546.00	1.13
11	002156	通富微电	4,793,042.00	1.11
12	002299	圣农发展	4,792,640.15	1.11
13	600004	白云机场	4,782,560.00	1.11
14	002080	中材科技	4,756,183.00	1.10
15	002138	顺络电子	4,699,899.00	1.09
16	300146	汤臣倍健	4,683,042.00	1.09
17	300450	先导智能	4,595,463.00	1.07
18	688235	百济神州	4,365,878.98	1.01
19	601555	东吴证券	4,363,647.00	1.01
20	300454	深信服	4,356,808.00	1.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	286,048,192.60
卖出股票收入（成交）总额	527,177,239.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,113,629.32	5.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,113,629.32	5.32

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	019785	25国债13	90,000	9,113,629.32	5.32

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,622,155.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	191,873.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,814,028.56

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
贝莱德中 证500指 数增强A	1,198	80,256.71	44,148,074.08	45.92 %	51,999,469.89	54.08 %
贝莱德中 证500指 数增强C	4,464	10,748.12	120,040.00	0.25 %	47,859,564.10	99.75 %
合计	5,662	25,455.17	44,268,114.08	30.71 %	99,859,033.99	69.29 %

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	贝莱德中证500指数增强A	9,039.18	0.0094 %
	贝莱德中证500指数增强C	110,008.67	0.2293 %
	合计	119,047.85	0.0826 %

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	贝莱德中证500指数增强A	0
	贝莱德中证500指数增强C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德中证500指数增强A	0
	贝莱德中证500指数增强C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德中证500指数增强A	贝莱德中证500指数增强C
基金合同生效日 （2025年9月26日） 基金份额总额	343,360,935.99	298,676,030.23
本报告期初基金份额总额	265,200,679.39	160,615,201.66
本报告期基金总申购份额	110,809,366.92	57,408,290.13
减：本报告期基金总赎回份额	279,862,502.34	170,043,887.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	96,147,543.97	47,979,604.10
-------------	---------------	---------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：2026年上半年，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及影响基金管理人经营或基金运营业务，或与基金财产相关的诉讼。

本报告期无涉及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发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信证券股份有限公司	2	813,225,541.96	100.00	163,621.98	100.00	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	-	-	18,400,000.00	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	贝莱德基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026年3月31日
2	贝莱德中证500指数增强型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026年4月22日
3	贝莱德中证500指数增强型证券投资基金（A类份额）产品资料概要更新（2026年第1号）	中国证监会规定媒介	2026年6月27日
4	贝莱德中证500指数增强型证券投资基金（C类份额）产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026年6月27日

	(2026年第1号)		
5	贝莱德中证500指数增强型证券投资基金招募说明书更新（2026年第1号）	中国证监会规定媒介	2026年6月27日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260617-20260630	0.00	82,956,951.02	38,858,386.89	44,098,564.13	30.60%
个人	-	-	-	-	-	-	-%
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

贝莱德基金管理有限公司

2026年8月31日