

贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56

§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	贝莱德中证 A500 指数增强	
基金主代码	022715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 23 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	171,973,800.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德中证 A500 指数增强 A	贝莱德中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022715	022716
报告期末下属分级基金的份额总额	114,277,425.35 份	57,696,375.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，通过量化选择股票的投资方法与严格的投资纪律约束，平衡预期收益、风险以及成本，优化管理组合，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金作为指数增强型基金，以跟踪标的指数为主，一般情况下保持各类资产配置的基本稳定，与此同时，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、金融衍生品投资策略 7、参与融资、转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		贝莱德基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	帅芳
	联系电话	021-80225188	021-38031815
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		400-002-6655	021-38917599-5
传真		021-80225288	021-38677819
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 19 楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		郁蓓华	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.blackrock.com.cn
基金中期报告备置地点	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(2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日） -2025 年 6 月 30 日)	
	贝莱德中证 A500 指数增强 A	贝莱德中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	9,249,332.41	6,020,919.01
本期利润	9,297,034.69	7,313,804.65
加权平均基金份额本期利润	0.0662	0.0813
本期加权平均净值利润率	6.46%	7.92%
本期基金份额净值增长率	3.98%	3.79%
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	4,544,303.97	2,185,601.54
期末可供分配基金份额利润	0.0398	0.0379
期末基金资产净值	118,821,729.32	59,881,976.79
期末基金份额净值	1.0398	1.0379
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	3.98%	3.79%

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。

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）。

4、表中的“期末”指报告期最后一日，即 2025 年 6 月 30 日；“本期”指 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日） - 2025 年 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

贝莱德中证 A500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.30%	0.56%	2.68%	0.57%	-0.38%	-0.01%
过去三个月	0.22%	1.07%	0.83%	1.14%	-0.61%	-0.07%

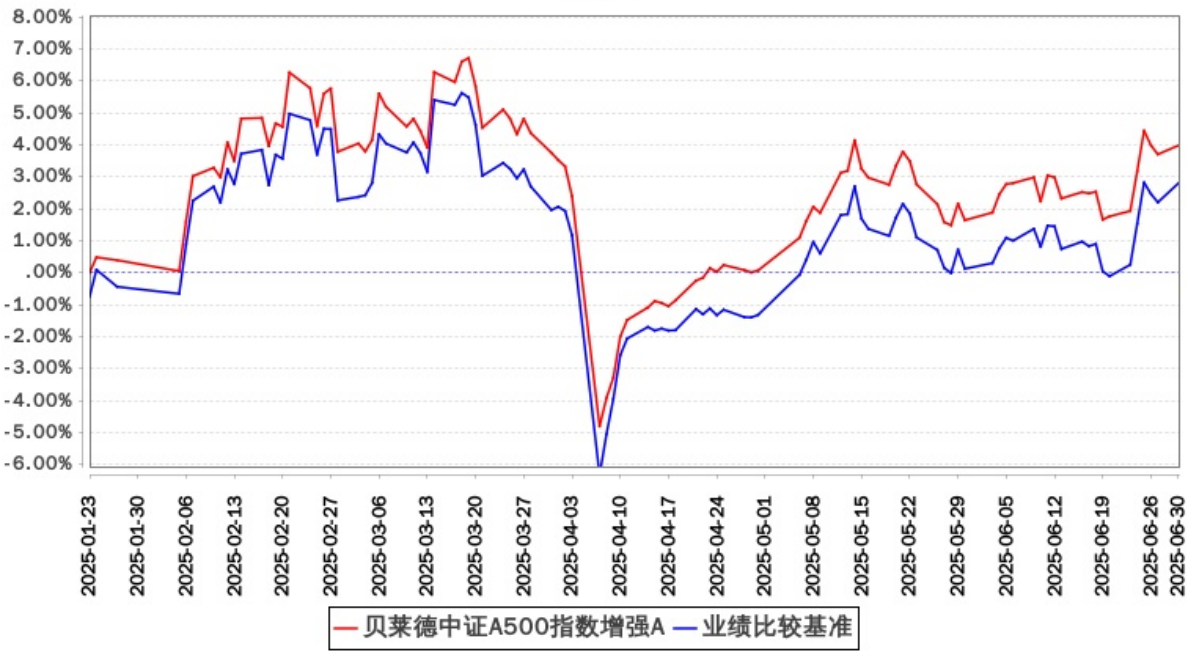
自基金合同 生效起至今	3.98%	0.98%	3.52%	1.03%	0.46%	-0.05%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

贝莱德中证 A500 指数增强 C

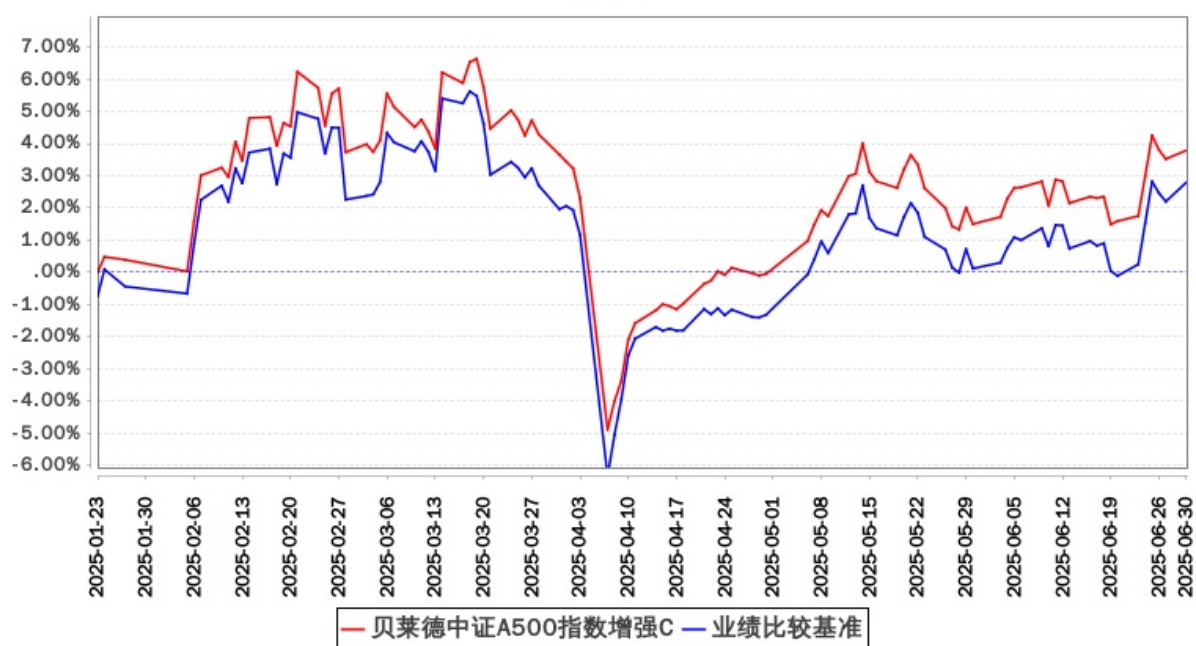
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去一个月	2.26%	0.56%	2.68%	0.57%	-0.42%	-0.01%
过去三个月	0.13%	1.07%	0.83%	1.14%	-0.70%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	3.79%	0.98%	3.52%	1.03%	0.27%	-0.05%

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

贝莱德中证A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势
对比图



贝莱德中证A500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同于 2025 年 1 月 23 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，截至报告期末本基金仍在建仓期。

§ 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人。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 16 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、贝莱德和悦利率债债券型证券投资基金、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。

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、量化及多资产投资总监	2025 年 01 月 23 日	-	14	王晓京先生，量化及多资产投资总监、基金经理。曾受雇于贝莱德英国（Blackrock Investment Management (UK) Limited）以及贝莱德建信理财有限责任公司，历任研究员、基金经理等职务。加入贝莱德之前，王晓京先生曾就职于花旗银行（伦敦），任投资银行部分析员。王晓京先生是特许金融分

					析师（CFA）持证人，拥有清华大学电子信息工程学士学位、英国伯明翰大学电子工程硕士学位、伦敦大学电子工程博士学位。
邹立波	本基金的基金经理助理	2025 年 02 月 27 日	-	8	邹立波先生，固定收益投资部基金经理及基金经理助理，曾任专户投资部投资经理。曾就职于信银理财有限责任公司、中信银行总行资产管理业务中心、中信银行上海分行、南瑞集团有限公司。邹立波先生拥有新西兰奥克兰理工大学硕士学位、奥克兰大学学士学位。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，

通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在产品运作层面，贝莱德中证 A500 指数增强基金，自成立以来至 2025 年 1 季度末累计超额收益(与业绩比较基准【中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%】相比)达到 0.46% (A 类)以及 0.27% (C 类)。在封闭期于今年 2 月下旬结束后，我们增加了主动风险敞口，并将主要的主动风险预算置于个股选择上。超额收益的贡献度上，个股选择也是主要原因，占整体一季度累计超额收益的绝大部分。在 2025 年第二季度内中证 A500 价格指数上升 0.84%，本基金超额收益小幅回撤，但策略整体表现稳定。在 4 月 7 日关税造成股票市场大幅波动以及大量 ETF 资金托底之后，我们减少了组合的主动风险敞口，增加了对指数权重股的配置，以减少自由选股部分未受到市场托举造成的拖累。另外为应对投资者申赎，我们在四月中下旬短暂增持了不超过 10 个百分点的现金。受这些影响，在整个 4 月组合累计超额收益出现一定幅度的回撤。但随后的 5 月及 6 月在股票市场状态以及参与者情绪稳定之后，策略自由选股部分有效性恢复，超额收益也有修复。从方法论角度，除去短暂增持现金造成的小幅 beta 扰动之外，二季度投资组合的主动风险预算基本仍集中于个股选择，对风格和行业层面的主动风险维持了管控。组合成立以来的累计超额收益的绝大部分也来自于个股选择。我们将继续坚持严格的系统化投资方法论和风险控制机制，力争为投资者获取超额收益。

宏观层面，一季度宏观经济数据呈现平稳复苏态势，工业增加值及 PMI 有超越预期的增长，但通胀数据偏弱。第二季度，经历 4 月份的关税动荡，5 月份日内瓦谈判以及伦敦谈判的进展，使得抢出口的经济活动明显升温，外贸对 GDP 拉升效果明显。内需方面，全国房地产价格及交易量在二季度环比走弱，但社会消费零售总额以及乘用车销量同比增速健康，持续受到政府以旧换新补贴的提振。二季度通货膨胀 CPI 月度同比数据仍偏冷，4 月 5 月均维持在-0.1%。PPI 指标在 4 月同比下降 2.7%，5 月同比下降 3.3%。

政策层面，三月公布的两会经济目标及政策基本上达到市场预期，在财政刺激力度方面留有余地（尤其是特别国债的发行量）。央行于 5 月 7 日宣布降息降准，在市场波动初步平抑之后鼓舞了市场参与者的信心。财政政策方面，除了前置发行之前的特别国债和地方债，二季度没有显著增量政策公布。

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 1.0398 元，本报告期内净值增长率 3.98%，同期业绩比较基准收益率 3.52%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.0379 元，本报告期内净值增长率 3.79%，同期业绩比较基准收益率 3.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年 A 股、港股市场整体收涨，市场情绪亦显著提升，其中港股更具有牛市氛围，A 股中小盘跑赢大盘，整体日成交量重回 1.5 万亿水平。走势上而言，国内主要股指在 4 月 7 日关税冲击的低点后迅速修复，在本轮关税扰动中展现出了很强的韧性。事实上，全球主要股市例如美国和欧洲，从关税的初始冲击恢复前高的速度也都比较快，上半年全球风险资产的整体表现相对不错。

从长期风险溢价模型角度来看，A 股大中盘宽基指数以及大多数有显著正现金流价值的股票（红利及自由现金流类）现在仍很便宜，尽管这与很多人的直觉不一致。在保守假设情形下，长期风险溢价小幅向历史均值靠拢，沪深 300 指数目前或比理论价值中枢便宜大约 10%。此外，下半年美联储和中国央行降息的市场预期颇高，资金成本的下降将继续抬升股票理论价值中枢。从模型角度，当前利率债仍然在超前定价降息预期，投资者风险偏好的提升或将边际上带来股票的增量投资。因此，结合理论模型和宏观、政策等非模型因素，我们在 1-3 年的中期维度对股票市场保持乐观。展望后市，本基金将重点关注以下三类资产：

1) 红利和自由现金流类资产，包含银行等行业。我们认为低利率环境里股票的现金流价值将对股价带来支撑。这一类资产确定性高，可作为稳定底仓的一部分。

2) 有新增长曲线的内生消费行业。“以旧换新”刺激下的汽车、电子和家电等行业；反内卷政策下的建材、建筑装饰等行业；社会消费习惯变化带来的从白酒等传统消费转向宠物、潮玩等新消费行业。无论政策使然还是变化使然，那些有新增长曲线并快速反映到现金流或现金流预期里面的公司商业模式和盈利水平成熟，确定性相对高，值得发挥量化信号的挖掘能力去优选布局。

3) 具有长期增长潜质的板块如 AI、医药行业等。这类资产虽然部分短期盈利前景不够明朗，

现金流短期甚至可能为负值，但长期维度而言想象空间大、资本投入需求高，叠加低利率环境及充沛的资本，有望涌现出丰富的投资机会。当然，这个领域对于选股提出了较高的要求，我们将通过量价信号以及对文本流、资金流的捕捉，积极寻找市场参与者情绪面的变化。

综上，本基金将坚持遵从系统化投资策略，从另类数据、传统数据，甚至政策解读中寻找现金流预期有增长的投资机遇，力争为投资者获取超额收益。

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合规守信情况声明

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	7,822,488.39
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	174,512,376.50
其中：股票投资		164,468,302.53
基金投资		—
债券投资		10,044,073.97
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	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		2,448,412.64
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	64,373.85
资产总计		184,847,651.38
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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		5,956,338.62
应付管理人报酬		122,345.80
应付托管费		22,939.87
应付销售服务费		21,265.96
应付投资顾问费		—
应交税费		9.59

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	21, 045. 43
负债合计		6, 143, 945. 27
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	171, 973, 800. 60
未分配利润	6.4.7.8	6, 729, 905. 51
净资产合计		178, 703, 706. 11
负债和净资产总计		184, 847, 651. 38

注：1、报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 171, 973, 800. 60 份，其中 A 类基金份额净值 1. 0398 元，基金份额 114, 277, 425. 35 份；C 类基金份额净值 1. 0379 元，基金份额 57, 696, 375. 25 份。

2、本基金基金合同于 2025 年 1 月 23 日生效，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效 日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		17, 848, 876. 58
1.利息收入		115, 549. 67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	115, 264. 27
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		285. 40
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16, 343, 861. 85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13, 957, 520. 56
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	27, 618. 01
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	2, 358, 723. 28
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1, 340, 587. 92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	48, 877. 14

减：二、营业总支出		1,238,037.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	838,896.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	157,293.19
3. 销售服务费		165,355.69
4. 投资顾问费		—
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 信用减值损失		—
7. 税金及附加		1.03
8. 其他费用	6.4.7.16	76,490.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,610,839.34
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,610,839.34
五、其他综合收益的税后净额		—
六、综合收益总额		16,610,839.34

注：本基金基金合同于 2025 年 1 月 23 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	—	—	—
加：会计政策变更	—	—	—
前期差错更正	—	—	—
其他	—	—	—
二、本期期初净资产	396,383,188.47	—	396,383,188.47
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-224,409,387.87	6,729,905.51	-217,679,482.36
(一)、综合收益总额	—	16,610,839.34	16,610,839.34
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”号填列)	-224,409,387.87	-9,880,933.83	-234,290,321.70
其中：1. 基金申购款	174,484,888.03	6,172,748.73	180,657,636.76
2. 基金赎回款	-398,894,275.90	-16,053,682.56	-414,947,958.46
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产	—	—	—

生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)			
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	171,973,800.60	6,729,905.51	178,703,706.11

注：本基金基金合同于 2025 年 1 月 23 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不

同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准：中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他

金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的

输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566 号）所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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》、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]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[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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 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, 暂不计缴企业所得税。

(3) 对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。

(4) 对于基金从事 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	4,964,801.51
等于：本金	4,963,037.47
加：应计利息	1,764.04
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
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	2,857,686.88
等于：本金	2,857,684.77
加：应计利息	2.11
合计：	7,822,488.39

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 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		163,138,834.61	—	164,468,302.53	1,329,467.92
贵金属投资-金交所黄金 合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	9,979,880.00	53,073.97	10,044,073.97	11,120.00
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	9,979,880.00	53,073.97	10,044,073.97	11,120.00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		173,118,714.61	53,073.97	174,512,376.50	1,340,587.92

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**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

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	64,373.85
合计	64,373.85

6.4.7.6 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	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	19,655.58
其他	1,389.85
合计	21,045.43

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德中证 A500 指数增强 A		
项目	本期 2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	216,665,228.96	216,665,228.96
本期申购	98,197,740.06	98,197,740.06
本期赎回（以“-”号填列）	-200,585,543.67	-200,585,543.67
本期末	114,277,425.35	114,277,425.35

金额单位：人民币元

贝莱德中证 A500 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	179,717,959.51	179,717,959.51
本期申购	76,287,147.97	76,287,147.97
本期赎回（以“-”号填列）	-198,308,732.23	-198,308,732.23
本期末	57,696,375.25	57,696,375.25

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金合同于 2025 年 1 月 23 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 396,335,467.83 元，折合基金份额 396,335,467.83 份；募集资金在募集期间产生的活期存款利息为人民币 47,720.64 元，折合基金份额 47,720.64 份；以上收到的实收基金(本息)共计人民币 396,383,188.47 元，折合基金份额 396,383,188.47 份。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

贝莱德中证 A500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,249,332.41	47,702.28	9,297,034.69
本期基金份额交易产生的变动数	-1,315,765.39	-3,436,965.33	-4,752,730.72
其中：基金申购款	6,294,894.63	-2,608,536.74	3,686,357.89
基金赎回款	-7,610,660.02	-828,428.59	-8,439,088.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,933,567.02	-3,389,263.05	4,544,303.97

单位：人民币元

贝莱德中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,020,919.01	1,292,885.64	7,313,804.65
本期基金份额交易产生的变动数	-2,124,757.71	-3,003,445.40	-5,128,203.11
其中：基金申购款	4,632,661.62	-2,146,270.78	2,486,390.84
基金赎回款	-6,757,419.33	-857,174.62	-7,614,593.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,896,161.30	-1,710,559.76	2,185,601.54

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	111,126.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,938.50
结算备付金利息收入	-
其他	198.91
合计	115,264.27

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	490,129,753.49
减：卖出股票成本总额	475,633,644.29
减：交易费用	538,588.64
买卖股票差价收入	13,957,520.56

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 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	27,389.62

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	228.39
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	27,618.01

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 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）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	3,555,650.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,499,636.00
减：应计利息总额	55,650.00
减：交易费用	135.61
买卖债券差价收入	228.39

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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,358,723.28
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	2,358,723.28

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
------	--

1. 交易性金融资产	1,340,587.92
——股票投资	1,329,467.92
——债券投资	11,120.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	1,340,587.92

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	48,877.14
基金转换费收入	—
合计	48,877.14

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 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,655.58
信息披露费	55,626.15
律师费	—
账户维护费	—
持有人大会费用	—
银行费用	—
开户费	1,200.00
证券组合费	—
存托服务费	8.70
合计	76,490.43

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
贝莱德基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	基金托管人、基金代销机构

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通	1,128,902,241.09	100.00%

注：上表中列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通	13,479,516.00	100.00%

注：上表中列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰海通	2,800,000.00	100.00%

注：上表中列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通	221,296.28	100.00%	-	-

- 注：1、上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。
- 2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。
- 3、上表中列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	838, 896. 90
其中：应支付销售机构的客户维护费	372, 533. 58
应支付基金管理人的净管理费	466, 363. 32

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	157,293.19

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德中证 A500 指数增强 A	贝莱德中证 A500 指数增强 C	合计
国泰海通证券股份有限公司	-	42,369.75	42,369.75
合计	-	42,369.75	42,369.75

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

2、上表中列示的国泰海通相关数据包含了合并前的国泰君安相关数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期内无关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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（2025 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。

本基金在日常投资管理中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本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致力于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率。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 2025 年 6 月 30 日，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%。

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 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额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 2025 年 6 月 30 日，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 2025 年 6 月 30 日，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、买入返售金融资产和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 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	7,822,488.39	-	-	-	7,822,488.39
交易性金融资产	10,044,073.97	-	-	164,468,302.53	174,512,376.50
应收申购款	-	-	-	2,448,412.64	2,448,412.64
其他资产	-	-	-	64,373.85	64,373.85
资产总计	17,866,562.36	-	-	166,981,089.02	184,847,651.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,956,338.62	5,956,338.62
应付管理人报酬	-	-	-	122,345.80	122,345.80
应付托管费	-	-	-	22,939.87	22,939.87
应付销售服务费	-	-	-	21,265.96	21,265.96
应交税费	-	-	-	9.59	9.59
其他负债	-	-	-	21,045.43	21,045.43
负债合计	-	-	-	6,143,945.27	6,143,945.27
利率敏感度缺口	17,866,562.36	-	-	160,837,143.75	178,703,706.11

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 (2025 年 6 月 30 日)
	1. 市场利率上升 25 个基点	-13, 573. 75
	2. 市场利率下降 25 个基点	13, 610. 53

注：本基金成立于 2025 年 1 月 23 日，上一年度无数据。

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 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	164,468,302.53	92.03
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	164,468,302.53	92.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 2025 年 6 月 30 日
	沪深 300 指数上升 5%	8,483,735.97
	沪深 300 指数下降 5%	-8,483,735.97

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	164,468,302.53
第二层次	10,044,073.97
第三层次	-
合计	174,512,376.50

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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	164,468,302.53	88.98
	其中：股票	164,468,302.53	88.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,044,073.97	5.43
	其中：债券	10,044,073.97	5.43
	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	7,822,488.39	4.23
8	其他资产	2,512,786.49	1.36
9	合计	184,847,651.38	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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 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	697,366.00	0.39
B	采矿业	5,056,463.00	2.83
C	制造业	99,346,493.23	55.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,417,228.00	1.35
E	建筑业	2,690,896.00	1.51

F	批发和零售业	375,611.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	907,644.00	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,368,154.00	6.92
J	金融业	18,702,840.00	10.47
K	房地产业	551,702.00	0.31
L	租赁和商务服务业	67,405.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,471,168.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	133,782.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	144,786,752.23	81.02

7.2.1.2 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	698,334.00	0.39
C	制造业	9,814,428.30	5.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	362,778.00	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	850,826.00	0.48
J	金融业	7,955,184.00	4.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,681,550.30	11.01

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

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	300750	宁德时代	30,600	7,717,932.00	4.32
2	600036	招商银行	141,700	6,511,115.00	3.64
3	600519	贵州茅台	3,800	5,356,176.00	3.00
4	002594	比亚迪	16,000	5,310,560.00	2.97
5	000858	五粮液	38,600	4,589,540.00	2.57
6	000651	格力电器	90,700	4,074,244.00	2.28
7	601318	中国平安	70,300	3,900,244.00	2.18
8	000538	云南白药	65,400	3,648,666.00	2.04
9	000001	平安银行	290,600	3,507,542.00	1.96
10	002001	新和成	163,000	3,467,010.00	1.94
11	600219	南山铝业	862,700	3,304,141.00	1.85
12	000333	美的集团	45,100	3,256,220.00	1.82
13	000338	潍柴动力	211,000	3,245,180.00	1.82
14	600352	浙江龙盛	319,000	3,241,040.00	1.81
15	000725	京东方 A	749,600	2,990,904.00	1.67
16	600584	长电科技	76,900	2,590,761.00	1.45
17	688012	中微公司	13,580	2,475,634.00	1.39
18	600276	恒瑞医药	47,520	2,466,288.00	1.38
19	600900	长江电力	80,200	2,417,228.00	1.35
20	601899	紫金矿业	122,100	2,380,950.00	1.33
21	600941	中国移动	21,000	2,363,550.00	1.32
22	600019	宝钢股份	358,300	2,361,197.00	1.32
23	002230	科大讯飞	47,200	2,259,936.00	1.26

24	000977	浪潮信息	40,200	2,045,376.00	1.14
25	601288	农业银行	334,300	1,965,684.00	1.10
26	000063	中兴通讯	59,700	1,939,653.00	1.09
27	000423	东阿阿胶	33,000	1,725,900.00	0.97
28	688008	澜起科技	19,765	1,620,730.00	0.91
29	002138	顺络电子	57,000	1,602,840.00	0.90
30	300496	中科创达	27,800	1,590,716.00	0.89
31	603799	华友钴业	41,400	1,532,628.00	0.86
32	601728	中国电信	194,800	1,509,700.00	0.84
33	002202	金风科技	145,600	1,492,400.00	0.84
34	600585	海螺水泥	67,900	1,457,813.00	0.82
35	300059	东方财富	61,400	1,420,182.00	0.79
36	603259	药明康德	20,200	1,404,910.00	0.79
37	300628	亿联网络	40,000	1,390,400.00	0.78
38	601117	中国化学	181,000	1,388,270.00	0.78
39	002475	立讯精密	38,300	1,328,627.00	0.74
40	600482	中国动力	56,400	1,301,148.00	0.73
41	601857	中国石油	144,700	1,237,185.00	0.69
42	002405	四维图新	142,000	1,212,680.00	0.68
43	688111	金山办公	4,300	1,204,215.00	0.67
44	300207	欣旺达	58,200	1,167,492.00	0.65
45	601238	广汽集团	154,300	1,155,707.00	0.65
46	002938	鹏鼎控股	35,900	1,149,877.00	0.64
47	300866	安克创新	9,300	1,056,480.00	0.59
48	600104	上汽集团	64,300	1,032,015.00	0.58
49	600535	天士力	64,700	1,012,555.00	0.57
50	600066	宇通客车	39,500	981,970.00	0.55
51	600050	中国联通	180,800	965,472.00	0.54
52	600096	云天化	43,300	951,301.00	0.53
53	000568	泸州老窖	8,200	929,880.00	0.52
54	601766	中国中车	130,200	916,608.00	0.51
55	600887	伊利股份	26,700	744,396.00	0.42
56	600031	三一重工	41,200	739,540.00	0.41
57	601668	中国建筑	126,300	728,751.00	0.41
58	688235	百济神州	3,100	724,284.00	0.41
59	002714	牧原股份	16,600	697,366.00	0.39
60	601168	西部矿业	41,500	690,145.00	0.39
61	688608	恒玄科技	1,900	661,162.00	0.37
62	688981	中芯国际	7,497	661,010.49	0.37
63	002245	蔚蓝锂芯	46,800	600,444.00	0.34

64	601166	兴业银行	24,900	581,166.00	0.33
65	002352	顺丰控股	11,400	555,864.00	0.31
66	001914	招商积余	44,600	551,702.00	0.31
67	688041	海光信息	3,900	551,031.00	0.31
68	600028	中国石化	95,100	536,364.00	0.30
69	002916	深南电路	4,802	517,703.62	0.29
70	600177	雅戈尔	68,400	499,320.00	0.28
71	601186	中国铁建	62,100	497,421.00	0.28
72	603501	豪威集团	3,800	485,070.00	0.27
73	603288	海天味业	11,400	443,574.00	0.25
74	600741	华域汽车	24,500	432,425.00	0.24
75	002624	完美世界	27,700	420,209.00	0.24
76	000100	TCL 科技	83,000	359,390.00	0.20
77	002625	光启技术	8,300	331,834.00	0.19
78	601658	邮储银行	58,700	321,089.00	0.18
79	688256	寒武纪-U	500	300,750.00	0.17
80	002273	水晶光电	14,400	287,568.00	0.16
81	688063	派能科技	5,904	266,152.32	0.15
82	300001	特锐德	11,000	263,670.00	0.15
83	300433	蓝思科技	10,700	238,610.00	0.13
84	600690	海尔智家	9,100	225,498.00	0.13
85	300454	深信服	2,300	216,614.00	0.12
86	300033	同花顺	700	191,107.00	0.11
87	000960	锡业股份	11,700	179,010.00	0.10
88	600038	中直股份	4,100	159,121.00	0.09
89	300017	网宿科技	14,500	155,440.00	0.09
90	603939	益丰药房	6,000	146,820.00	0.08
91	000768	中航西飞	5,000	136,700.00	0.08
92	300251	光线传媒	6,600	133,782.00	0.07
93	600004	白云机场	14,600	132,860.00	0.07
94	600885	宏发股份	5,780	128,951.80	0.07
95	601398	工商银行	16,900	128,271.00	0.07
96	601988	中国银行	19,600	110,152.00	0.06
97	601607	上海医药	5,500	98,340.00	0.06
98	300054	鼎龙股份	3,400	97,512.00	0.05
99	601880	辽港股份	61,200	91,800.00	0.05
100	603129	春风动力	400	86,600.00	0.05
101	300476	胜宏科技	600	80,628.00	0.05
102	601800	中国交建	8,600	76,454.00	0.04
103	300627	华测导航	2,100	73,500.00	0.04
104	600489	中金黄金	4,900	71,687.00	0.04

105	600316	洪都航空	1,900	71,630.00	0.04
106	002555	三七互娱	4,100	70,889.00	0.04
107	002821	凯莱英	800	70,600.00	0.04
108	600745	闻泰科技	2,100	70,413.00	0.04
109	600547	山东黄金	2,200	70,246.00	0.04
110	300408	三环集团	2,100	70,140.00	0.04
111	603993	洛阳钼业	8,300	69,886.00	0.04
112	600118	中国卫星	2,400	68,568.00	0.04
113	600660	福耀玻璃	1,200	68,412.00	0.04
114	000792	盐湖股份	4,000	68,320.00	0.04
115	600153	建发股份	6,500	67,405.00	0.04
116	002236	大华股份	4,200	66,696.00	0.04
117	002415	海康威视	2,400	66,552.00	0.04
118	600030	中信证券	2,400	66,288.00	0.04
119	300759	康龙化成	2,700	66,258.00	0.04
120	002050	三花智控	2,500	65,950.00	0.04
121	600704	物产中大	12,500	65,875.00	0.04
122	601877	正泰电器	2,900	65,743.00	0.04
123	002841	视源股份	1,900	65,740.00	0.04
124	000807	云铝股份	4,100	65,518.00	0.04
125	600498	烽火通信	3,100	65,193.00	0.04
126	000708	中信特钢	5,500	64,680.00	0.04
127	000963	华东医药	1,600	64,576.00	0.04
128	000157	中联重科	8,900	64,347.00	0.04
129	600018	上港集团	11,200	63,952.00	0.04
130	600143	金发科技	6,200	63,922.00	0.04
131	603986	兆易创新	500	63,265.00	0.04
132	601919	中远海控	4,200	63,168.00	0.04
133	300136	信维通信	2,800	62,720.00	0.04
134	688617	惠泰医疗	200	59,400.00	0.03
135	600867	通化东宝	6,500	53,300.00	0.03
136	603596	伯特利	1,000	52,690.00	0.03
137	688271	联影医疗	400	51,096.00	0.03
138	688099	晶晨股份	700	49,707.00	0.03
139	002410	广联达	3,600	48,276.00	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	601688	华泰证券	191,300	3,407,053.00	1.91
2	603893	瑞芯微	13,900	2,110,854.00	1.18
3	601555	东吴证券	220,400	1,928,500.00	1.08
4	002850	科达利	9,400	1,063,798.00	0.60
5	601231	环旭电子	60,700	888,041.00	0.50
6	603444	吉比特	2,600	785,070.00	0.44
7	600380	健康元	70,800	780,924.00	0.44
8	600583	海油工程	127,900	698,334.00	0.39
9	603296	华勤技术	8,500	685,780.00	0.38
10	600060	海信视像	29,200	672,184.00	0.38
11	600299	安迪苏	57,400	553,910.00	0.31
12	688772	珠海冠宇	38,057	543,834.53	0.30
13	689009	九号公司	8,100	479,277.00	0.27
14	600061	国投资本	60,100	451,952.00	0.25
15	000728	国元证券	53,100	418,959.00	0.23
16	601169	北京银行	60,500	413,215.00	0.23
17	601377	兴业证券	64,600	399,874.00	0.22
18	601717	郑煤机	23,200	385,584.00	0.22
19	600875	东方电气	20,800	348,192.00	0.19
20	600109	国金证券	36,600	320,982.00	0.18
21	000513	丽珠集团	8,700	313,548.00	0.18
22	002056	横店东磁	14,300	202,345.00	0.11
23	600167	联美控股	28,000	157,360.00	0.09
24	000598	兴蓉环境	19,800	142,758.00	0.08
25	603160	汇顶科技	2,000	142,060.00	0.08
26	688187	时代电气	2,200	93,830.00	0.05
27	600999	招商证券	4,800	84,432.00	0.05
28	603228	景旺电子	2,000	83,680.00	0.05
29	688017	绿的谐波	600	74,934.00	0.04
30	688567	孚能科技	5,000	72,500.00	0.04
31	603341	龙旗科技	1,679	68,217.77	0.04
32	603225	新凤鸣	6,400	68,160.00	0.04
33	000709	河钢股份	31,500	68,040.00	0.04
34	002797	第一创业	9,600	67,968.00	0.04
35	000783	长江证券	9,800	67,914.00	0.04
36	601066	中信建投	2,800	67,340.00	0.04
37	601995	中金公司	1,900	67,184.00	0.04
38	000596	古井贡酒	500	66,575.00	0.04
39	601818	光大银行	15,900	65,985.00	0.04

40	603927	中科软	3,400	65,756.00	0.04
41	000776	广发证券	3,900	65,559.00	0.04
42	601229	上海银行	6,100	64,721.00	0.04
43	601077	渝农商行	8,900	63,546.00	0.04
44	600483	福能股份	6,500	62,660.00	0.04
45	603529	爱玛科技	1,400	48,160.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	23,063,925.40	12.91
2	600036	招商银行	17,877,421.00	10.00
3	601318	中国平安	17,709,121.00	9.91
4	002594	比亚迪	14,326,604.00	8.02
5	000858	五粮液	13,793,866.00	7.72
6	600519	贵州茅台	13,737,433.00	7.69
7	000333	美的集团	11,854,109.02	6.63
8	000725	京东方 A	11,338,682.00	6.34
9	002475	立讯精密	10,461,369.00	5.85
10	000338	潍柴动力	10,435,236.00	5.84
11	002001	新和成	9,913,952.84	5.55
12	688012	中微公司	9,279,206.07	5.19
13	600219	南山铝业	9,131,619.00	5.11
14	601688	华泰证券	8,999,925.00	5.04
15	002352	顺丰控股	8,872,752.00	4.97
16	000538	云南白药	8,798,534.96	4.92
17	600690	海尔智家	8,575,945.00	4.80
18	600030	中信证券	8,125,474.00	4.55
19	600050	中国联通	7,926,526.00	4.44
20	600019	宝钢股份	7,730,432.00	4.33
21	603893	瑞芯微	7,695,954.00	4.31

22	000423	东阿阿胶	7,590,178.00	4.25
23	000513	丽珠集团	7,544,397.00	4.22
24	300628	亿联网络	7,074,412.60	3.96
25	000651	格力电器	7,053,269.00	3.95
26	688041	海光信息	7,025,219.16	3.93
27	600941	中国移动	6,480,703.00	3.63
28	601717	郑煤机	6,442,421.00	3.61
29	601633	长城汽车	6,392,336.00	3.58
30	300207	欣旺达	6,287,589.00	3.52
31	600900	长江电力	6,251,874.00	3.50
32	601288	农业银行	6,102,183.00	3.41
33	002230	科大讯飞	6,079,456.00	3.40
34	600276	恒瑞医药	5,961,492.80	3.34
35	000001	平安银行	5,906,373.56	3.31
36	688599	天合光能	5,552,939.02	3.11
37	688981	中芯国际	5,493,756.56	3.07
38	002138	顺络电子	5,445,887.00	3.05
39	601168	西部矿业	5,385,816.00	3.01
40	603259	药明康德	5,370,513.00	3.01
41	688111	金山办公	5,334,111.48	2.98
42	002273	水晶光电	5,052,290.00	2.83
43	601555	东吴证券	4,914,599.00	2.75
44	601728	中国电信	4,899,198.00	2.74
45	600060	海信视像	4,736,256.00	2.65
46	600104	上汽集团	4,539,964.00	2.54
47	601238	广汽集团	4,516,712.00	2.53
48	600352	浙江龙盛	4,394,559.00	2.46
49	600887	伊利股份	4,367,183.00	2.44
50	002916	深南电路	4,312,105.20	2.41
51	601766	中国中车	4,306,843.00	2.41
52	002202	金风科技	4,257,820.60	2.38
53	601117	中国化学	4,201,409.00	2.35
54	300760	迈瑞医疗	4,138,783.00	2.32
55	603993	洛阳钼业	4,063,622.00	2.27
56	600535	天士力	4,052,839.00	2.27
57	300059	东方财富	4,018,834.00	2.25
58	603927	中科软	4,013,341.00	2.25

59	601899	紫金矿业	3,914,226.00	2.19
60	600482	中国动力	3,855,861.00	2.16
61	600096	云天化	3,777,094.00	2.11
62	000157	中联重科	3,776,788.00	2.11

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 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	15,305,906.68	8.56
2	601318	中国平安	14,200,948.00	7.95
3	600036	招商银行	12,456,821.00	6.97
4	002594	比亚迪	11,934,362.60	6.68
5	002475	立讯精密	9,622,325.00	5.38
6	600050	中国联通	9,136,383.00	5.11
7	002352	顺丰控股	9,022,451.00	5.05
8	000858	五粮液	8,875,627.00	4.97
9	000333	美的集团	8,282,666.00	4.63
10	600519	贵州茅台	8,187,112.00	4.58
11	600030	中信证券	8,139,025.00	4.55
12	600690	海尔智家	8,042,368.00	4.50
13	000338	潍柴动力	7,906,997.57	4.42
14	000725	京东方 A	7,749,176.46	4.34
15	688012	中微公司	7,484,246.35	4.19
16	000513	丽珠集团	6,969,011.93	3.90
17	688041	海光信息	6,916,069.64	3.87
18	603893	瑞芯微	6,466,242.00	3.62
19	601717	郑煤机	6,392,453.00	3.58
20	601633	长城汽车	6,322,207.00	3.54
21	300454	深信服	6,071,322.00	3.40
22	002001	新和成	6,043,976.00	3.38
23	601688	华泰证券	5,851,430.00	3.27
24	300207	欣旺达	5,641,201.00	3.16
25	600019	宝钢股份	5,421,295.00	3.03
26	002273	水晶光电	5,417,505.00	3.03
27	600219	南山铝业	5,409,546.00	3.03
28	000423	东阿阿胶	5,188,471.00	2.90

29	300628	亿联网络	5,085,353.00	2.85
30	000538	云南白药	4,980,507.40	2.79
31	688599	天合光能	4,870,314.84	2.73
32	601288	农业银行	4,663,096.00	2.61
33	688981	中芯国际	4,465,856.70	2.50
34	601168	西部矿业	4,373,986.00	2.45
35	603259	药明康德	4,366,182.00	2.44
36	688111	金山办公	4,287,114.15	2.40
37	600941	中国移动	4,239,470.00	2.37
38	300760	迈瑞医疗	4,198,070.00	2.35
39	600060	海信视像	4,064,790.00	2.27
40	603993	洛阳钼业	4,019,869.00	2.25
41	002230	科大讯飞	3,983,005.00	2.23
42	000157	中联重科	3,953,277.00	2.21
43	600900	长江电力	3,939,555.00	2.20
44	002916	深南电路	3,920,160.90	2.19
45	601728	中国电信	3,901,313.00	2.18
46	603927	中科软	3,897,624.00	2.18
47	600276	恒瑞医药	3,692,138.00	2.07
48	600887	伊利股份	3,688,769.00	2.06
49	600104	上汽集团	3,663,669.00	2.05
50	002138	顺络电子	3,585,049.00	2.01

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	638,772,478.90
卖出股票收入（成交）总额	490,129,753.49

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	10,044,073.97	5.62
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	10,044,073.97	5.62

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	019766	25 国债 01	100,000	10,044,073.97	5.62

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,448,412.64
6	其他应收款	—
7	待摊费用	64,373.85
8	其他	—
9	合计	2,512,786.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
贝莱德中证 A500 指数增强 A	1000	114,277.43	15,850,305.69	13.87%	98,427,119.66	86.13%
贝莱德中证 A500 指数增强 C	1574	36,655.89	1,150,050.56	1.99%	56,546,324.69	98.01%
合计	2574	66,811.89	17,000,356.25	9.89%	154,973,444.35	90.11%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	贝莱德中证 A500 指数增强 A	136,554.40	0.1195%
	贝莱德中证 A500 指数增强 C	763,011.94	1.3225%
	合计	899,566.34	0.5231%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	贝莱德中证 A500 指数增强 A	0~10
	贝莱德中证 A500 指数增强 C	50~100
	合计	50~100

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德中证 A500 指数增强 A	贝莱德中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 1 月 23 日）基金份额总额	216,665,228.96	179,717,959.51
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	98,197,740.06	76,287,147.97
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	200,585,543.67	198,308,732.23
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	114,277,425.35	57,696,375.25

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

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

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、2025 年 2 月 14 日起，洪霞女士不再担任公司副总经理职务；
- 2、2025 年 3 月 14 日起，郁蓓华女士担任公司总经理，陈剑先生不再担任公司总经理职务。

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。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
国泰海通证券股份有限公司	2	1,128,902,241.09	100.00	221,296.28	100.00	-
中国中金财富证券有限公司	2	-	-	-	-	新增
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增

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、根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的 30%”的分仓规定。

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。

5、国泰君安证券股份有限公司（简称“国泰君安”）于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表显示的国泰海通相关数据包含了本报告期通过国泰君安、国泰海通席位交易的情况。

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		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
国泰海通证券	13,479,516.00	100.00	2,800,000.00	100.00	-	-

股份有 限公司						
中国中 金财富 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

注：国泰君安证券股份有限公司（简称“国泰君安”）于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表显示的国泰海通相关数据包含了本报告期通过国泰君安、国泰海通席位交易的情况。

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	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025/1/24
2	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025/1/25
3	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025/1/25
4	贝莱德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025/2/15
5	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2025/2/24
6	贝莱德基金管理有限公司关于聘任贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理助理的公告	中国证监会规定媒介	2025/2/28
7	贝莱德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2025/3/15
8	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（2024 年度）	中国证监会规定媒介	2025/3/31
9	关于贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金基金托管人法定名称变更并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2025/4/4
10	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投	中国证监会规定媒介	2025/4/4

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	资基金托管协议		
11	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025/4/4
12	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书更新（2025 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2025/4/8
13	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新（2025 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2025/4/8
14	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新（2025 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2025/4/8
15	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2025/4/22
16	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书更新（2025 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2025/6/27
17	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新（2025 年第 3 号）	中国证监会规定媒介	2025/6/27
18	贝莱德中证 A500 指数增强型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新（2025 年第 3 号）	中国证监会规定媒介	2025/6/27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

贝莱德基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日