

**博时中证 1000 增强策略交易型开放式指
数证券投资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 审计报告	13
6.1 审计意见	13
6.2 形成审计意见的基础	13
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	13
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 净资产变动表	17
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	44
8.3 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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

8.6 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	53
8.7 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	53
8.8 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	53
8.9 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	53
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末上市基金前十名持有人	55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
11.2 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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 其他重大事件	58
§12 影响投资者决策的其他重要信息	61
12.1 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	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	62
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时中证 1000 增强 ETF
场内简称	1000 增强 ETF
基金主代码	561780
交易代码	561780
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 2 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,955,790.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 11 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上，通过量化增强等增强策略进行组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。 本基金将以博时数量化模型对股票的回报预测为基础，综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等，进行投资组合构建和优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 6.5%。 本基金的投资策略还包括债券（除可转换债券、可交换债券外）投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、衍生品投资策略、融资和转融通证券出借的投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪中证 1000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	博时基金管理有限公司		中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	杨军智
	联系电话	0755-83169999	010-60834299
	电子邮箱	service@bosera.com	yjz@citics.com
客户服务电话	95105568		010-60836588
传真	0755-83195140		010-60834004
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层		广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层		北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码	518040		100125
法定代表人	江向阳		张佑君

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年	2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,346,940.83	1,268,172.24
本期利润	-1,649,064.53	1,515,373.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0680	0.0162
本期加权平均净值利润率	-7.28%	1.62%
本期基金份额净值增长率	5.89%	-1.43%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	-124,408.86	-898,616.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0096	-0.0143
期末基金资产净值	13,523,738.96	62,057,173.57

期末基金份额净值	1.0438	0.9857
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	4.38%	-1.43%

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

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

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

3.2 基金净值表现

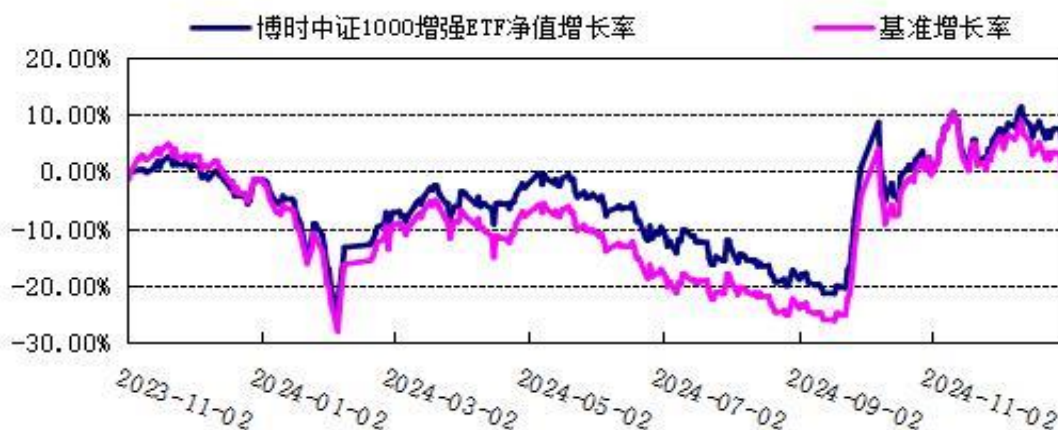
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.50%	2.30%	4.36%	2.40%	-0.86%	-0.10%
过去六个月	17.08%	2.18%	21.69%	2.24%	-4.61%	-0.06%
过去一年	5.89%	2.02%	1.20%	2.12%	4.69%	-0.10%
自基金合同生效起至今	4.38%	1.89%	-0.01%	1.99%	4.39%	-0.10%

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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 11 月 2 日至 2024 年 12 月 31 日)



注：本基金的基金合同于 2023 年 11 月 2 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2023 年 11 月 2 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16089 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

12 月，国家开发银行授予博时基金“优秀投资机构合作奖”，表彰公司在国家开发银行 2024 年银行间市场金融债券投资工作中表现突出。

11 月，深证投资者服务中心联合全景投教基地召开《股东来了》（2024）投资者权益知识竞赛深圳片区总结交流会，授予博时基金《股东来了》（2024）深圳片区突出贡献团体奖。

10 月，中国人民银行 2023 年度金融科技发展奖获奖项目名单出炉，博时基金“新一代资管业务

资金清算系统”荣获三等奖。

4 月，深圳市人工智能学会公布 2023 年度第三届“深圳人工智能奖”获奖名单，博时基金“智能量化因子投研系统”荣获人工智能行业应用奖。

1 月，中国人民银行公布 2022 年度金融科技发展奖获奖项目名单，博时基金“陪伴服务平台项目”荣获三等奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨振建	基金经理	2023-11-02	-	11.3	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)的基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 3 月 3 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博

					时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 132 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，市场呈现“V 型”反转，市场风格表现分化较大，大盘、价值风格相关资产占优，上证指数最终收于 3352 点左右。海外通胀持续回落开启的降息周期，全球多数权益资产上涨显著。本基金采用动态多因子模型对组合进行管理，因子配置均衡，对于风格约束和风险预算较为严格，力图在中证 1000 指数基准基础上，获取相对稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.0438 元，份额累计净值为 1.0438 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 5.89%，同期业绩基准增长率 1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，在积极政策刺激下，经济整体企稳向好；政策方面，宏观政策将采取“实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策”，对房地产市场政策预期也在持续积极推进，房地产市场对于经济的拖累有望在 2025 年得到明显改善。国内持续保持相对积极的货币财政政策，国债收益率下行。当前市场整体估值水平处于历史上相对较低的位置，看好 A 股长期配置价值。从盈利预期角度看，随着相关宏观逆周期调节力度逐渐较大，经济基本面有望逐渐见底回升。当前我们需要持续关注不同板块景气趋势的变化，把握结构性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违

规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《制度管理规范》、《合规管理制度》、《全面风险管理制度》、《内部稽核审计制度》、《投资者适当性管理制度》、《公募基金证券交易佣金分配管理办法》、《货币市场基金投资管理制度》、《对外信息发布管理制度》、《公募基金法定信息披露管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，完善“博时合规管理及审计系统”中制度库应用、合规报告生成等模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01% 以上时，可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关、证券交易所、登记机构另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则进行调整，并及时公告。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 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

本基金在本报告期内出现连续了 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。本基金曾于 2024 年 08 月 20 日至 2024 年 09 月 18 日出现连续 20 个工作日持有人数少于 200 人的情形。

§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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，博时基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

容诚审字[2025]200Z1094 号

博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“博时中证 1000 增强 ETF”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度和 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时中证 1000 增强 ETF 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度和 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时中证 1000 增强 ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时中证 1000 增强 ETF 的基金管理人博时基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时中证 1000 增强 ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时中证 1000 增强 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时中证 1000 增强 ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时中证 1000 增强 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时中证 1000 增强 ETF 不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

薛竞 吴琳杰

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	758,546.09	2,401,276.55
结算备付金		453,701.47	3,155,544.65
存出保证金		225,997.76	707,286.67
交易性金融资产	7.4.7.2	12,185,228.86	57,180,498.85
其中：股票投资		12,185,228.86	57,180,498.85
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	23,359.44	-
资产总计		13,646,833.62	63,444,606.72
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		92.07	1,075,354.86
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,691.21	17,424.93
应付托管费		1,338.26	3,484.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	114,973.12	291,168.38
负债合计		123,094.66	1,387,433.15
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	12,955,790.00	62,955,790.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	567,948.96	-898,616.43
净资产合计		13,523,738.96	62,057,173.57
负债和净资产总计		13,646,833.62	63,444,606.72

注：1.报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0438 元，基金份额总额 12,955,790.00 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2024 年度和 2023 年 11 月 2 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日(基金 合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,272,374.07	1,643,156.64
1.利息收入		30,332.24	151,951.02
其中：存款利息收入	7.4.7.9	30,332.24	151,951.02
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,838.46	773,169.80

其中：股票投资收益	7.4.7.10	-277,103.81	820,954.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	759.93	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-130,405.97	-60,152.61
股利收益	7.4.7.14	402,911.39	12,367.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-302,123.70	247,201.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-996,744.15	470,834.41
减：二、营业总支出		376,690.46	127,782.99
1. 管理人报酬		113,666.04	72,528.06
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		22,733.22	14,505.61
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.18	240,291.20	40,749.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,649,064.53	1,515,373.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,649,064.53	1,515,373.65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,649,064.53	1,515,373.65

7.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	62,955,790.00	-898,616.43	62,057,173.57

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	62,955,790.00	-898,616.43	62,057,173.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-50,000,000.00	1,466,565.39	-48,533,434.61
（一）、综合收益总额	-	-1,649,064.53	-1,649,064.53
（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）	-50,000,000.00	3,115,629.92	-46,884,370.08
其中：1.基金申购款	144,000,000.00	-12,080,634.46	131,919,365.54
2.基金赎回款	-194,000,000.00	15,196,264.38	-178,803,735.62
（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	12,955,790.00	567,948.96	13,523,738.96
项目	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	272,955,790.00	-	272,955,790.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-210,000,000.00	-898,616.43	-210,898,616.43
（一）、综合收益总额	-	1,515,373.65	1,515,373.65

(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)	-210,000,000.00	-2,413,990.08	-212,413,990.08
其中: 1.基金申购款	40,000,000.00	-1,218,125.61	38,781,874.39
2.基金赎回款	-250,000,000.00	-1,195,864.47	-251,195,864.47
(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	62,955,790.00	-898,616.43	62,057,173.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 江向阳, 主管会计工作负责人: 王德英, 会计机构负责人: 陈子成

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]658 号准予注册, 由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 272,955,790.00 元(含所募集股票市值), 业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2023)验字第 70019484_A02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 11 月 2 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 272,955,790.00 份基金份额, 无利息折份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司, 基金托管人为中信证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]246 号核准, 本基金于 2023 年 11 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金所持有的股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于 80%；投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2024 年度和 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成

为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

（1）金融资产的分类

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

（2）金融负债

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

（3）衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4)

除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保

留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证

券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	758,546.09	2,401,276.55
等于：本金	758,177.20	2,400,568.41
加：应计利息	368.89	708.14
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	758,546.09	2,401,276.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	12,288,831.15	-	12,185,228.86	-103,602.29

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		12,288,831.15	-	12,185,228.86	-103,602.29
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		56,960,537.44	-	57,180,498.85	219,961.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		56,960,537.44	-	57,180,498.85	219,961.41

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	1,127,600.00	-	-	-
---股指期货	1,127,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,127,600.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,505,560.00	-	-	-

---股指期货	3,505,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,505,560.00	-	-	-

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

7.4.7.3.2 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
IM2503	IM2503	1.00	1,176,280.00	48,680.00
合计	-	-	-	48,680.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	48,680.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	23,359.44	-
合计	23,359.44	-

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	11,327.07	288,319.06
其中：交易所市场	11,327.07	288,319.06
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	86,762.29	-
应付 IOPV 计算与发布费	16,883.76	2,849.32
合计	114,973.12	291,168.38

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,955,790.00	62,955,790.00
本期申购	144,000,000.00	144,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-194,000,000.00	-194,000,000.00
本期末	12,955,790.00	12,955,790.00

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

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	263,974.14	-1,162,590.57	-898,616.43
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	263,974.14	-1,162,590.57	-898,616.43
本期利润	-1,346,940.83	-302,123.70	-1,649,064.53
本期基金份额交易产生的变动数	958,557.83	2,157,072.09	3,115,629.92
其中：基金申购款	-14,270,852.62	2,190,218.16	-12,080,634.46
基金赎回款	15,229,410.45	-33,146.07	15,196,264.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-124,408.86	692,357.82	567,948.96

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	16,903.48	75,563.56
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	9,324.51	76,030.56
其他	4,104.25	356.90
合计	30,332.24	151,951.02

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	773,364.21	463,618.55
股票投资收益——赎回差价收入	-1,050,468.02	357,336.17
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	-277,103.81	820,954.72

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	213,468,330.61	167,387,898.41
减：卖出股票成本总额	212,407,233.62	166,519,960.06
减：交易费用	287,732.78	404,319.80
买卖股票差价收入	773,364.21	463,618.55

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	178,803,735.62	251,195,864.47
减：现金支付赎回款总额	102,986,249.62	124,498,009.47
减：赎回股票成本总额	76,867,954.02	126,340,518.83
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-1,050,468.02	357,336.17

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	0.39	-

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	759.54	-
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	759.93	-

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,760.12	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000.00	-
减：应计利息总额	0.39	-
减：交易费用	0.19	-
买卖债券差价收入	759.54	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-130,405.97	-60,152.61

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 11 月 2 日(基金合同生效 日)至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	402,911.39	12,367.69
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	402,911.39	12,367.69

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日(基金合同生效 日)至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-323,563.70	219,961.41
——股票投资	-323,563.70	219,961.41
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	21,440.00	27,240.00
——权证投资	-	-
——股指期货	21,440.00	27,240.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-302,123.70	247,201.41

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日(基金合同生效 日)至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-996,744.15	470,834.41
合计	-996,744.15	470,834.41

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日(基金合同生效
----	-----------------------------------	-----------------------------------

	31 日	日) 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	4,221.31	-
信息披露费	67,540.98	-
证券出借违约金	-	-
其他	25,004.59	-
中登注册登记费	126,640.56	37,500.00
IOPV 计算与发布费	16,883.76	2,849.32
开户费	-	400.00
合计	240,291.20	40,749.32

注：自 2024 年 11 月 5 日至 2024 年 12 月 31 日，基金管理人自主承担本基金的 IOPV 计算与发布费、信息披露费、注册费、审计费等固定费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议，股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。于 2024 年 12 月 24 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，上述股东变更完成后，基金管理人股权结构为：招商证券股份有限公司 49%，中国长城资产管理股份有限公司 25%，上海汇华实业有限公司 12%，天津港(集团)有限公司 6%，上海盛业股权投

资基金有限公司 6%和浙江省国际贸易集团有限公司 2%。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	403,270,318.73	99.07%	503,514,430.06	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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
中信证券	154,097.77	99.50%	10,550.12	93.14%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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
中信证券	288,319.06	100.00%	288,319.06	100.00%

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

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

务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	113,666.04	72,528.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,108.85	530.56
应支付基金管理人的净管理费	110,557.19	71,997.50

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,733.22	14,505.61

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例
中信证券	1,852,435.00	14.30%	-	-
招商证券	3,118,555.00	24.07%	25,990,755.00	41.28%

注：1.除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。
2.持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪中证 1000 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金

管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 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

及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	758,546.09	-	-	-	758,546.09
结算备付金	453,701.47	-	-	-	453,701.47
存出保证金	84,844.16	-	-	141,153.60	225,997.76
交易性金融资产	-	-	-	12,185,228.86	12,185,228.86
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	23,359.44	23,359.44
资产总计	1,297,091.72	-	-	12,349,741.90	13,646,833.62
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	92.07	92.07
应付管理人报酬	-	-	-	6,691.21	6,691.21
应付托管费	-	-	-	1,338.26	1,338.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	114,973.12	114,973.12
负债总计	-	-	-	123,094.66	123,094.66
利率敏感度缺口	1,297,091.72	-	-	12,226,647.24	13,523,738.96
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	2,401,276.55	-	-	-	2,401,276.55
结算备付金	3,155,544.65	-	-	-	3,155,544.65
存出保证金	283,350.67	-	-	423,936.00	707,286.67
交易性金融资产	-	-	-	57,180,498.85	57,180,498.85
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,840,171.87	-	-	57,604,434.85	63,444,606.72
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,075,354.86	1,075,354.86
应付管理人报酬	-	-	-	17,424.93	17,424.93
应付托管费	-	-	-	3,484.98	3,484.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	291,168.38	291,168.38
负债总计	-	-	-	1,387,433.15	1,387,433.15

利率敏感度缺口	5,840,171.87	-	-	56,217,001.70	62,057,173.57
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	12,185,228.86	90.10	57,180,498.85	92.14
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	12,185,228.86	90.10	57,180,498.85	92.14

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 63	增加约 276
	业绩比较基准下降 5%	减少约 63	减少约 276

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	12,185,228.86	57,180,498.85
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	12,185,228.86	57,180,498.85

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	12,185,228.86	89.29
	其中：股票	12,185,228.86	89.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,212,247.56	8.88
8	其他各项资产	249,357.20	1.83
9	合计	13,646,833.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	115,421.00	0.85
B	采矿业	348,902.00	2.58
C	制造业	7,298,830.86	53.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	282,317.00	2.09
E	建筑业	355,337.00	2.63
F	批发和零售业	519,186.00	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	576,141.00	4.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,604,946.00	11.87
J	金融业	313,237.00	2.32
K	房地产业	308,985.00	2.28

L	租赁和商务服务业	155,073.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	205,486.00	1.52
N	水利、环境和公共设施管理业	13,500.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,204.00	0.06
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	79,663.00	0.59
S	综合	-	-
	合计	12,185,228.86	90.10

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600216	浙江医药	9000	142,740.00	1.06
2	600428	中远海特	19400	141,620.00	1.05
3	000682	东方电子	13200	141,372.00	1.05
4	300674	宇信科技	7200	140,544.00	1.04
5	688019	安集科技	1000	139,360.00	1.03
6	601126	四方股份	8200	139,072.00	1.03
7	600266	城建发展	27100	138,210.00	1.02
8	300113	顺网科技	8200	137,842.00	1.02
9	600320	振华重工	34900	136,808.00	1.01
10	301050	雷电微力	2600	134,108.00	0.99
11	002468	申通快递	13200	133,716.00	0.99
12	002100	天康生物	20300	132,965.00	0.98
13	000758	中色股份	26600	131,404.00	0.97
14	688336	三生国健	6100	130,662.00	0.97
15	002550	千红制药	21000	130,200.00	0.96
16	600210	紫江企业	19600	129,556.00	0.96
17	689009	九号公司	2700	128,250.00	0.95
18	688321	微芯生物	6900	128,202.00	0.95
19	600827	百联股份	11700	127,881.00	0.95
20	000090	天健集团	31000	127,410.00	0.94
21	603162	海通发展	13700	126,040.00	0.93
22	000686	东北证券	15700	124,658.00	0.92
23	600710	苏美达	13400	124,620.00	0.92
24	603612	索通发展	8800	118,888.00	0.88
25	600649	城投控股	26600	118,370.00	0.88
26	600268	国电南自	17600	118,272.00	0.87

27	300726	宏达电子	3800	118,180.00	0.87
28	605333	沪光股份	3600	117,468.00	0.87
29	300232	洲明科技	16900	116,103.00	0.86
30	300346	南大光电	3000	115,770.00	0.86
31	600301	华锡有色	6700	113,967.00	0.84
32	300366	创意信息	11800	109,740.00	0.81
33	688208	道通科技	2792	109,334.72	0.81
34	300623	捷捷微电	3200	109,312.00	0.81
35	300002	神州泰岳	9400	108,946.00	0.81
36	002707	众信旅游	14700	108,633.00	0.80
37	688658	悦康药业	7500	108,075.00	0.80
38	002534	西子洁能	9700	107,767.00	0.80
39	601677	明泰铝业	8700	104,661.00	0.77
40	002273	水晶光电	4700	104,434.00	0.77
41	000875	吉电股份	19700	103,622.00	0.77
42	300768	迪普科技	5900	103,250.00	0.76
43	600075	新疆天业	23600	102,660.00	0.76
44	605376	博迁新材	3400	98,430.00	0.73
45	688131	皓元医药	2700	96,390.00	0.71
46	688200	华峰测控	900	94,050.00	0.70
47	600058	五矿发展	13200	93,984.00	0.69
48	301327	华宝新能	1200	92,052.00	0.68
49	601886	江河集团	16900	91,260.00	0.67
50	000528	柳工	7500	90,450.00	0.67
51	000957	中通客车	8200	90,200.00	0.67
52	603337	杰克股份	2800	85,288.00	0.63
53	688798	艾为电子	1196	83,504.72	0.62
54	000990	诚志股份	10700	82,925.00	0.61
55	600420	国药现代	6700	79,998.00	0.59
56	603595	东尼电子	4600	78,614.00	0.58
57	603881	数据港	3400	77,010.00	0.57
58	000422	湖北宜化	6100	76,982.00	0.57
59	688383	新益昌	1700	76,279.00	0.56
60	002928	华夏航空	9800	76,048.00	0.56
61	300183	东软载波	3900	75,465.00	0.56
62	002315	焦点科技	1800	75,024.00	0.55
63	603317	天味食品	5400	72,036.00	0.53
64	688550	瑞联新材	2300	71,967.00	0.53
65	688123	聚辰股份	1200	70,224.00	0.52
66	000050	深天马 A	7700	69,531.00	0.51
67	300475	香农芯创	2400	68,376.00	0.51
68	300303	聚飞光电	10000	68,200.00	0.50
69	002267	陕天然气	8000	67,600.00	0.50

70	000603	盛达资源	5500	65,945.00	0.49
71	688608	恒玄科技	200	65,074.00	0.48
72	601107	四川成渝	12300	64,329.00	0.48
73	300182	捷成股份	10700	62,809.00	0.46
74	000966	长源电力	13200	62,700.00	0.46
75	002023	海特高新	6000	60,900.00	0.45
76	688362	甬矽电子	1800	60,624.00	0.45
77	002139	拓邦股份	4400	59,884.00	0.44
78	603919	金徽酒	3000	58,800.00	0.43
79	300463	迈克生物	4300	56,760.00	0.42
80	300972	万辰集团	700	56,287.00	0.42
81	600550	保变电气	7100	55,735.00	0.41
82	688779	五矿新能	10400	55,328.00	0.41
83	688315	诺禾致源	4400	55,000.00	0.41
84	001339	智微智能	1500	54,885.00	0.41
85	300415	伊之密	2700	54,162.00	0.40
86	300620	光库科技	1100	53,460.00	0.40
87	603929	亚翔集成	1900	52,687.00	0.39
88	000731	四川美丰	7000	51,380.00	0.38
89	300446	航天智造	3100	51,181.00	0.38
90	605111	新洁能	1500	50,865.00	0.38
91	600916	中国黄金	5900	50,858.00	0.38
92	688380	中微半导	1700	50,830.00	0.38
93	688408	中信博	700	50,400.00	0.37
94	300229	拓尔思	2400	50,256.00	0.37
95	600339	中油工程	13600	48,688.00	0.36
96	002948	青岛银行	12300	47,724.00	0.35
97	002755	奥赛康	3700	47,027.00	0.35
98	301116	益客食品	3800	46,930.00	0.35
99	688372	伟测科技	800	46,816.00	0.35
100	300369	绿盟科技	6500	46,735.00	0.35
101	600861	北京人力	2400	46,440.00	0.34
102	002405	四维图新	4800	46,272.00	0.34
103	002668	TCL 智家	3500	45,920.00	0.34
104	300170	汉得信息	3700	45,880.00	0.34
105	600602	云赛智联	2900	45,878.00	0.34
106	300031	宝通科技	2500	45,800.00	0.34
107	300479	神思电子	2500	45,500.00	0.34
108	600273	嘉化能源	5700	45,429.00	0.34
109	300777	中简科技	1600	45,264.00	0.33
110	688522	纳睿雷达	800	45,072.00	0.33
111	300650	太龙股份	3900	44,850.00	0.33
112	600718	东软集团	3800	40,926.00	0.30

113	601601	中国太保	1200	40,896.00	0.30
114	002567	唐人神	7900	40,290.00	0.30
115	300083	创世纪	6100	39,711.00	0.29
116	002167	东方锆业	5400	39,636.00	0.29
117	688183	生益电子	1000	39,260.00	0.29
118	300180	华峰超纤	6100	38,430.00	0.28
119	300166	东方国信	4000	37,600.00	0.28
120	002291	遥望科技	5900	37,229.00	0.28
121	300761	立华股份	1900	36,974.00	0.27
122	600993	马应龙	1400	36,554.00	0.27
123	300123	亚光科技	6100	35,380.00	0.26
124	600667	太极实业	5100	35,292.00	0.26
125	002716	湖南白银	10300	34,917.00	0.26
126	601336	新华保险	700	34,790.00	0.26
127	002248	华东数控	4400	34,276.00	0.25
128	300685	艾德生物	1500	34,200.00	0.25
129	600114	东睦股份	2100	33,957.00	0.25
130	603118	共进股份	3800	33,820.00	0.25
131	001236	弘业期货	3500	33,740.00	0.25
132	603267	鸿远电子	900	32,607.00	0.24
133	300115	长盈精密	2000	32,480.00	0.24
133	603083	剑桥科技	800	32,480.00	0.24
134	300705	九典制药	1800	32,310.00	0.24
135	688300	联瑞新材	500	32,200.00	0.24
136	601101	昊华能源	3800	31,274.00	0.23
137	002612	朗姿股份	1900	31,084.00	0.23
138	688766	普冉股份	300	30,378.00	0.22
139	603393	新天然气	1000	30,270.00	0.22
140	300379	东方通	2000	30,180.00	0.22
141	688128	中国电研	1432	30,086.32	0.22
142	300077	国民技术	1200	28,608.00	0.21
143	002970	锐明技术	600	28,578.00	0.21
144	300770	新媒股份	700	28,287.00	0.21
145	002214	大立科技	2500	27,875.00	0.21
146	300772	运达股份	2100	27,804.00	0.21
147	002245	蔚蓝锂芯	2600	27,794.00	0.21
148	300641	正丹股份	1100	27,324.00	0.20
149	601127	赛力斯	200	26,678.00	0.20
150	000550	江铃汽车	1100	25,795.00	0.19
151	300034	钢研高纳	1600	24,960.00	0.18
152	002036	联创电子	2600	24,440.00	0.18
153	688348	昱能科技	500	24,400.00	0.18
154	002043	兔宝宝	2000	23,760.00	0.18

155	300045	华力创通	1100	22,979.00	0.17
156	300319	麦捷科技	1800	22,464.00	0.17
157	605296	神农集团	800	22,160.00	0.16
158	300579	数字认证	700	21,994.00	0.16
159	688018	乐鑫科技	100	21,800.00	0.16
160	000913	钱江摩托	1200	21,612.00	0.16
161	300811	铂科新材	400	21,564.00	0.16
162	688588	凌志软件	1500	20,700.00	0.15
163	603236	移远通信	300	20,532.00	0.15
164	688185	康希诺	332	20,268.60	0.15
165	300527	中船应急	2500	20,175.00	0.15
166	688095	福昕软件	300	20,148.00	0.15
167	603039	泛微网络	400	19,600.00	0.14
168	688262	国芯科技	700	19,390.00	0.14
169	600246	万通发展	2600	19,370.00	0.14
170	000672	上峰水泥	2500	19,125.00	0.14
171	688322	奥比中光	400	18,600.00	0.14
172	300394	天孚通信	200	18,272.00	0.14
173	300684	中石科技	800	17,944.00	0.13
174	300459	汤姆猫	3100	17,794.00	0.13
175	000917	电广传媒	2500	17,675.00	0.13
176	600575	淮河能源	4400	17,468.00	0.13
177	002961	瑞达期货	1200	17,244.00	0.13
178	002777	久远银海	1000	17,220.00	0.13
179	605117	德业股份	200	16,960.00	0.13
180	000969	安泰科技	1500	16,725.00	0.12
181	002249	大洋电机	2800	16,436.00	0.12
182	301155	海力风电	300	15,993.00	0.12
183	002332	仙琚制药	1600	15,904.00	0.12
184	001914	招商积余	1500	15,855.00	0.12
185	603129	春风动力	100	15,707.00	0.12
186	688155	先惠技术	400	15,176.00	0.11
187	600305	恒顺醋业	1900	15,162.00	0.11
188	301205	联特科技	200	15,138.00	0.11
189	300035	中科电气	1000	14,950.00	0.11
190	300352	北信源	2800	14,784.00	0.11
191	300570	太辰光	200	14,540.00	0.11
192	300348	长亮科技	1000	14,300.00	0.11
193	605305	中际联合	500	14,165.00	0.10
194	688127	蓝特光学	500	13,550.00	0.10
195	301175	中科环保	2500	13,500.00	0.10
196	002685	华东重机	1900	12,787.00	0.09
197	000719	中原传媒	1100	12,496.00	0.09

198	605286	同力日升	400	12,064.00	0.09
199	002881	美格智能	400	11,984.00	0.09
200	603920	世运电路	400	11,760.00	0.09
201	300458	全志科技	300	11,628.00	0.09
202	688630	芯碁微装	200	11,544.00	0.09
203	300735	光弘科技	400	11,196.00	0.08
204	603893	瑞芯微	100	11,006.00	0.08
205	000902	新洋丰	800	10,432.00	0.08
206	688076	诺泰生物	200	10,384.00	0.08
207	601975	招商南油	3300	10,329.00	0.08
208	301348	蓝箭电子	400	10,248.00	0.08
209	600419	天润乳业	1100	10,241.00	0.08
210	300016	北陆药业	1600	9,920.00	0.07
211	600101	明星电力	1100	9,680.00	0.07
212	688347	华虹公司	200	9,294.00	0.07
213	600409	三友化工	1700	9,180.00	0.07
214	603171	税友股份	300	9,150.00	0.07
215	600496	精工钢构	3000	9,060.00	0.07
216	301219	腾远钴业	200	9,042.00	0.07
217	688596	正帆科技	250	8,887.50	0.07
218	000560	我爱我家	2800	8,540.00	0.06
219	301487	盟固利	400	8,508.00	0.06
220	601187	厦门银行	1500	8,460.00	0.06
221	600780	通宝能源	1500	8,445.00	0.06
222	600661	昂立教育	700	8,204.00	0.06
223	000029	深深房 A	500	7,530.00	0.06
224	600449	宁夏建材	500	7,510.00	0.06
225	002705	新宝股份	500	7,500.00	0.06
226	300492	华图山鼎	100	7,280.00	0.05
227	002585	双星新材	1300	6,942.00	0.05
228	603173	福斯达	300	6,915.00	0.05
229	603766	隆鑫通用	700	6,370.00	0.05
230	300049	福瑞股份	200	6,308.00	0.05
231	002847	盐津铺子	100	6,260.00	0.05
232	300613	富瀚微	100	5,850.00	0.04
233	603005	晶方科技	200	5,650.00	0.04
234	688690	纳微科技	300	5,280.00	0.04
235	300065	海兰信	600	4,920.00	0.04
236	600033	福建高速	1200	4,656.00	0.03
237	002626	金达威	300	4,530.00	0.03
238	000062	深圳华强	200	4,480.00	0.03
239	003015	日久光电	300	4,293.00	0.03
240	002697	红旗连锁	700	4,137.00	0.03

241	600038	中直股份	100	3,856.00	0.03
242	601319	中国人保	500	3,810.00	0.03
243	002192	融捷股份	100	3,190.00	0.02
244	600988	赤峰黄金	200	3,122.00	0.02
245	603678	火炬电子	100	3,050.00	0.02
246	688158	优刻得	200	2,796.00	0.02
247	300100	双林股份	100	2,764.00	0.02
248	002212	天融信	400	2,580.00	0.02
249	002073	软控股份	300	2,478.00	0.02
250	603583	捷昌驱动	100	2,471.00	0.02
251	600610	中毅达	500	2,115.00	0.02
252	002367	康力电梯	300	2,061.00	0.02
253	002773	康弘药业	100	1,960.00	0.01
254	603871	嘉友国际	100	1,935.00	0.01
255	600757	长江传媒	200	1,914.00	0.01
256	600551	时代出版	200	1,722.00	0.01
257	600623	华谊集团	200	1,400.00	0.01
258	600120	浙江东方	300	1,398.00	0.01
259	300531	优博讯	100	1,395.00	0.01
260	301090	华润材料	200	1,388.00	0.01
261	002048	宁波华翔	100	1,262.00	0.01
262	600552	凯盛科技	100	1,141.00	0.01
263	600639	浦东金桥	100	1,110.00	0.01
264	000503	国新健康	100	1,098.00	0.01
265	002852	道道全	100	826.00	0.01
266	300133	华策影视	100	722.00	0.01
267	300081	恒信东方	100	718.00	0.01
268	300423	昇辉科技	100	692.00	0.01
269	600643	爱建集团	100	517.00	0.00
270	300587	天铁股份	100	439.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	301219	腾远钴业	1,560,719.40	2.51
2	300034	钢研高纳	1,454,981.40	2.34
3	301050	雷电微力	1,434,220.00	2.31
4	000915	华特达因	1,432,604.00	2.31
5	002745	木林森	1,427,727.00	2.30
6	300726	宏达电子	1,382,363.00	2.23
7	002158	汉钟精机	1,358,036.01	2.19

8	002249	大洋电机	1,357,068.00	2.19
9	002519	银河电子	1,349,091.00	2.17
10	000034	神州数码	1,348,750.00	2.17
11	300772	运达股份	1,329,972.00	2.14
12	300724	捷佳伟创	1,322,594.00	2.13
13	002697	红旗连锁	1,320,713.00	2.13
14	000030	富奥股份	1,295,829.00	2.09
15	000821	京山轻机	1,283,456.00	2.07
16	002048	宁波华翔	1,262,814.00	2.03
17	300638	广和通	1,223,148.00	1.97
18	300679	电连技术	1,209,790.00	1.95
19	002245	蔚蓝锂芯	1,207,546.00	1.95
20	002706	良信股份	1,193,326.00	1.92

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

8.4.2 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	301219	腾远钴业	2,066,757.70	3.33
2	002745	木林森	1,949,703.00	3.14
3	002249	大洋电机	1,911,119.00	3.08
4	002158	汉钟精机	1,900,698.00	3.06
5	300772	运达股份	1,884,300.70	3.04
6	002697	红旗连锁	1,848,957.00	2.98
7	002048	宁波华翔	1,781,537.00	2.87
8	301050	雷电微力	1,775,541.92	2.86
9	002519	银河电子	1,726,398.00	2.78
10	000951	中国重汽	1,723,519.00	2.78
11	000719	中原传媒	1,700,573.00	2.74
12	002706	良信股份	1,697,773.40	2.74
13	002274	华昌化工	1,573,128.00	2.53
14	000915	华特达因	1,536,373.74	2.48
15	300034	钢研高纳	1,536,132.00	2.48
16	002612	朗姿股份	1,508,730.00	2.43
17	002043	兔宝宝	1,478,581.00	2.38
18	000090	天健集团	1,456,944.00	2.35
19	000034	神州数码	1,405,091.00	2.26
20	002545	东方铁塔	1,376,612.00	2.22
21	301087	可孚医疗	1,374,347.00	2.21
22	300724	捷佳伟创	1,334,261.94	2.15
23	002206	海利得	1,326,198.00	2.14
24	001338	永顺泰	1,323,664.00	2.13
25	300638	广和通	1,308,828.00	2.11

26	300726	宏达电子	1,307,406.00	2.11
27	301301	川宁生物	1,295,410.00	2.09
28	000030	富奥股份	1,284,445.00	2.07
29	000821	京山轻机	1,246,457.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	193,575,581.59
卖出股票的收入（成交）总额	213,468,330.61

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,上海振华重工(集团)股份有限公司在报告编制前一年受到舟山市定海区应急管理局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

8.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 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	225,997.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	23,359.44
8	其他	-
9	合计	249,357.20

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
254	51,007.05	7,289,790.00	56.27%	5,666,000.00	43.73%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	3,118,555.00	24.07%
2	华泰证券股份有限公司	2,265,100.00	17.48%
3	中信证券股份有限公司	1,852,435.00	14.30%
4	周云帆	977,700.00	7.55%
5	王菊英	500,000.00	3.86%
5	朱国翔	500,000.00	3.86%
7	王润娴	350,000.00	2.70%
8	王大敏	291,700.00	2.25%
9	周华珍	192,300.00	1.48%
10	苏晓燕	183,900.00	1.42%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023 年 11 月 2 日)基金份额总额	272,955,790.00
本报告期期初基金份额总额	62,955,790.00
本报告期基金总申购份额	144,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	194,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,955,790.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间从 2024 年 9 月 12 日起，至 2024 年 10 月 15 日 17:00 止，会议审议通过了《关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同终止条款的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2024 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生任公司总经理。

基金管理人于 2024 年 12 月 7 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 4221.31 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券	3	403,270,318.73	99.07%	154,097.77	99.50%	-
光大证券	1	3,773,593.47	0.93%	776.95	0.50%	增加 1 个

注：根据中国证券监督管理委员会有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	4,760.12	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下 193 只基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-27
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-07
3	博时基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-18
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20241106	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-06
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增长城证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-28
6	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-25
7	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-18
8	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-18
9	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-18
10	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-18
11	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易	中国证券报、基	2024-10-15

	型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
12	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-08
13	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-30
14	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20240925	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-25
15	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-21
16	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-14
17	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-13
18	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-12
19	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-11
20	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-30
21	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-23
22	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开	中国证券报、基	2024-08-22

	展费率优惠活动的公告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
23	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换等业务费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-17
24	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-27
25	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增爱建证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-26
26	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-20
27	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-20
28	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-19
29	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-06
30	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-06-26
31	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-05-25
32	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-05-21
33	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售	中国证券报、基	2024-05-15

	有限公司办理旗下基金销售业务的公告	金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
34	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-07
35	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
36	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
37	博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-22
38	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-13
39	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增信达证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-10
40	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-13
41	博时基金管理有限公司关于博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-02-28

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别						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	2024-01-01~2024-01-08;2024-01-11~2024-07-30;2024-08-01~2024-09-23;2024-10-25~2024-11-25;2024-11-27~2024-12-09;2024-12-12~2024-12-31	25,990,755.00	82,833,400.00	105,705,600.00	3,118,555.00	24.07%
	2	2024-01-23~2024-01-25;2024-02-06~2024-02-07;2024-02-20~2024-02-28;2024-10-23~2024-10-23;2024-10-28~2024-10-28;2024-11-01~2024-11-03;2024-11-05~2024-11-07;2024-11-13~2024-11-21;2024-11-26~2024-12-25	13,144,000.00	80,336,935.00	91,628,500.00	1,852,435.00	14.30%
	3	2024-03-12~2024-03-17;2024-03-19~2024-05-22;2024-05-24~2024-05-30;2024-06-04~2024-06-10	-	13,941,500.00	13,891,400.00	50,100.00	0.39%
	4	2024-07-31~2024-08-01	-	23,340,200.00	23,340,200.00	-	-
	5	2024-01-18~2024-01-18;2024-02-08~2024-02-18	6,579,000.00	22,547,300.00	29,126,300.00	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：1.申购份额包含红利再投资份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日