

博时中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	1
2.1 基金基本情况	1
2.2 基金产品说明	1
2.3 基金管理人和基金托管人	2
2.4 信息披露方式	2
2.5 其他相关资料	2
§3 主要财务指标和基金净值表现	2
3.1 主要会计数据和财务指标	3
3.2 基金净值表现	3
§4 管理人报告	4
4.1 基金管理人及基金经理情况	4
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	6
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
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	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	8
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	9
§5 托管人报告	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	9
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	9
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	9
6.1 资产负债表	9
6.2 利润表	11
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§9 开放式基金份额变动	63

§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 博时
基金主代码	159968
交易代码	159968
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 1 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,295,098.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 31 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，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 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。其他投资策略包括：存托凭证投资策略、债券（除可转换债券）投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券投资策略、衍生品投资策略、融资及转融通证券出借、流通受限证券投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股

	票型指数基金，跟踪中证 500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		张东	缪建民

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	97,323,597.17
本期利润	135,279,862.32
加权平均基金份额本期利润	2.1959
本期加权平均净值利润率	20.76%
本期基金份额净值增长率	23.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	382,895,576.55
期末可供分配基金份额利润	6.4575
期末基金资产净值	695,865,024.07
期末基金份额净值	11.7356
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	131.34%

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。

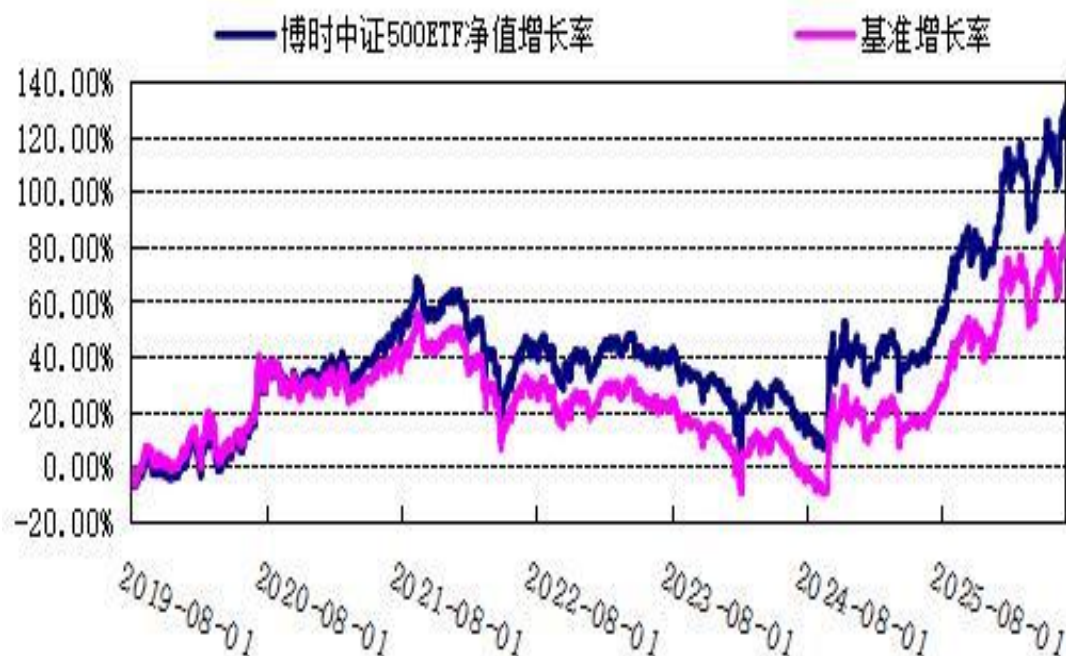
3.2 基金净值表现

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	20.79%	1.63%	18.56%	1.65%	2.23%	-0.02%
过去六个月	23.84%	1.65%	20.97%	1.66%	2.87%	-0.01%
过去一年	58.79%	1.42%	52.68%	1.42%	6.11%	0.00%
过去三年	65.69%	1.47%	50.55%	1.49%	15.14%	-0.02%

过去五年	56.77%	1.35%	32.65%	1.36%	24.12%	-0.01%
自基金合同生效起至今	131.34%	1.35%	84.19%	1.36%	47.15%	-0.01%

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



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 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 17,353 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限	证券从业 年限	说明
----	----	----------------------	------------	----

		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2019-08-01	-	19.3	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022 年 7 月 26 日-2023 年 9 月 25 日)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 3 月 3 日-2024 年 11 月 8 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式

					指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 5 月 11 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日—至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 21 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 28 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022 年 1 月 10 日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023 年 4 月 19 日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2023 年 9 月 26 日—至今)、博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 8 月 15 日—至今)、博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 12 月 2 日—至今)、博时恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金(2026 年 5 月 20 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，基金投资管理符合有关法规和基金合同

的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 18 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

2026 年上半年，中国经济延续供给强、需求弱的弱复苏格局，且内部结构持续分化。生产端在 AI 算力、高技术制造与出口高景气带动下动能较为强劲并逐月加速，需求端则内需较为低迷、地产链持续拖累，仅靠外需支撑。经济含新量继续提升，且产业升级红利正从生产端向利润端传导。价格链是上半年最大的边际变化—PPI 同比在中东冲突推升大宗商品价格的传导下，由负快速转正并走高，名义修复加速兑现。

海外方面，全球资产围绕地缘冲突、AI 浪潮与政策分化重新定价。2 季度前期，霍尔木兹海峡通行量持续低位，国际油价冲高，随着美伊局势边际缓和，原油高位震荡回落，外部流动性压力阶段性释放。政策上，美联储在通胀韧性与油价扰动下转向谨慎，全球流动性阶段性收紧。同时，海外 AI 产业趋势延续高景气，与国内 AI 产业链形成共振。

资本市场上，A 股市场成交活跃，结构持续分化。1 季度末在美伊冲突催化下，避险情绪升温，红利与顺周期占优，前期热门科技成长板块承压，市场震荡回调；进入 4 月后，随着外部扰动减退、油价回落及 1 季报收官，全 A 盈利增速回暖，市场核心逻辑由估值修复切换至业绩兑现，转入景气驱动的结构性的行情，呈现“科技领涨、指数震荡抬升”格局，AI 算力等高景气赛道获资金集中增配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 11.7356 元，份额累计净值为 2.3134 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 23.84%，同期业绩基准增长率 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，总量盈利周期延续修复趋势，但预计结构分化仍将持续。下半年全 A 盈利仍受 PPI 正向支撑，但对盈利总量的解释力将弱于上半年。预计下半年部分资源品、以及有供需缺口的 TMT 等继续受益 PPI 周期；而消费、内需链、传统中下游制造，仍面临利润挤压压力。A 股市场下半年出现系统性价值风格切换的难度较大，科技仍将是主要方向，但投资逻辑将从题材驱动转向业绩筛选，市场风格可能趋于均衡。

在投资策略上，本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价，保证基金估值的公平、合理。

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2026年6月30日	2025年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	25,106,601.41	11,271,710.17
结算备付金		8,999,368.43	22,236,997.96
存出保证金		6,186,528.29	5,122,961.33
交易性金融资产	6.4.6.2	648,144,611.50	501,168,830.82
其中：股票投资		648,144,611.50	501,168,830.82
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	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		7,868,255.51	1,922,318.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		696,305,365.14	541,722,818.32
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	2,199,545.19
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		81,046.71	65,942.89
应付托管费		27,015.57	21,980.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		172,193.74	22,538.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	160,085.05	259,107.03
负债合计		440,341.07	2,569,114.85
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	300,799,918.93	288,624,885.44
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	395,065,105.14	250,528,818.03
净资产合计		695,865,024.07	539,153,703.47
负债和净资产总计		696,305,365.14	541,722,818.32

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 11.7356 元，基金份额总额 59,295,098.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2026年1月1日至2026 年6月30日	2025年1月1日至2025年6月30 日
一、营业总收入		136,044,149.44	36,706,425.08

1.利息收入		129,149.99	169,572.60
其中：存款利息收入	6.4.6.9	129,149.99	169,572.60
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）		97,939,436.72	6,078,918.15
其中：股票投资收益	6.4.6.10	85,151,877.70	-373,530.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	-	5,579.72
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	8,748,878.04	29,954.46
股利收益	6.4.6.14	4,038,680.98	6,416,914.39
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.15	37,956,265.15	30,191,154.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	19,297.58	266,780.23
减：二、营业总支出		764,287.12	827,881.68
1. 管理人报酬		483,987.72	516,343.49
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		161,329.22	172,114.53
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		31,543.41	4,645.32
8. 其他费用	6.4.6.18	87,426.77	134,778.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		135,279,862.32	35,878,543.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		135,279,862.32	35,878,543.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		135,279,862.32	35,878,543.40

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	288,624,885.44	-	250,528,818.03	539,153,703.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	288,624,885.44	-	250,528,818.03	539,153,703.47
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	12,175,033.49	-	144,536,287.11	156,711,320.60
（一）、综合收益总额	-	-	135,279,862.32	135,279,862.32
（二）、本期基金份额	12,175,033.49	-	9,256,424.79	21,431,458.28

交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	117,691,990.60	-	125,411,857.36	243,103,847.96
2.基金赎回款	-105,516,957.11	-	-116,155,432.57	-221,672,389.68
（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	300,799,918.93	-	395,065,105.14	695,865,024.07

项目	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	546,329,761.53	-	212,396,328.25	758,726,089.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	546,329,761.53	-	212,396,328.25	758,726,089.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-77,108,545.58	-	1,970,168.49	-75,138,377.09
（一）、综合收益总额	-	-	35,878,543.40	35,878,543.40
（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）	-77,108,545.58	-	-33,908,374.91	-111,016,920.49

“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	44,641,789.57	-	17,625,118.22	62,266,907.79
2.基金赎回款	-121,750,335.15	-	-51,533,493.13	-173,283,828.28
(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	469,221,215.95	-	214,366,496.74	683,587,712.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时中证 500 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[2019]669 号《关于准予博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,762,083,202.00 元（含所募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2019）第 0399 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 8 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,762,185,861.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 102,659.00 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人博时基金管理有限公司确定 2019 年 10 月 18

日为本基金的基金份额折算日。本次基金份额折算前基金份额总额为 2,762,185,861.00 份，折算前基金份额净值为 0.9781 元。根据基金份额折算公式，本次基金份额折算比例为 0.197128864，折算后，2019 年 10 月 21 日基金份额总额为 544,495,098.00 份，折算后基金份额净值为 4.9618 元。本基金的基金管理人博时基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，本基金登记机构中国证券登记结算有限责任公司已于 2019 年 10 月 21 日进行了变更登记。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2019]664 号核准，本基金于 2019 年 10 月 31 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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>》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政

策有关问题的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

例计算缴纳。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
活期存款	25,106,601.41
等于：本金	25,103,724.10
加：应计利息	2,877.31
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	25,106,601.41

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		530,593,409.10	-	648,144,611.50	117,551,202.40
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		530,593,409.10	-	648,144,611.50	117,551,202.40

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	39,984,000.00	-	-	-
---股指期货	39,984,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	39,984,000.00	-	-	-

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

6.4.6.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2612	IC2612	24.00	41,003,520.00	1,019,520.00
合计	-	-	-	1,019,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,019,520.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	73,304.60
其中：交易所市场	73,304.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	160,085.05

6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,895,098.00	288,624,885.44
本期申购	23,200,000.00	117,691,990.60
本期赎回（以“-”号填列）	-20,800,000.00	-105,516,957.11
本期末	59,295,098.00	300,799,918.93

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

6.4.6.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	276,734,222.62	-26,205,404.59	250,528,818.03
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	276,734,222.62	-26,205,404.59	250,528,818.03
本期利润	97,323,597.17	37,956,265.15	135,279,862.32
本期基金份额交易产生的变动数	8,837,756.76	418,668.03	9,256,424.79
其中：基金申购款	121,038,276.25	4,373,581.11	125,411,857.36
基金赎回款	-112,200,519.49	-3,954,913.08	-116,155,432.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	382,895,576.55	12,169,528.59	395,065,105.14

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,253.68
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	93,839.88
其他	56.43
合计	129,149.99

6.4.6.10 股票投资收益

6.4.6.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	59,225,956.01
股票投资收益——赎回差价收入	25,925,921.69
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	85,151,877.70

6.4.6.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	234,371,969.01
减：卖出股票成本总额	174,897,602.01
减：交易费用	248,410.99
买卖股票差价收入	59,225,956.01

6.4.6.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	221,672,389.68
减：现金支付赎回款总额	108,513,485.68
减：赎回股票成本总额	87,232,982.31
减：交易费用	-
赎回差价收入	25,925,921.69

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	8,748,878.04

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	4,038,680.98
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	4,038,680.98

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	38,439,665.15
——股票投资	38,439,665.15
——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	-483,400.00
——权证投资	-
——股指期货	-483,400.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	37,956,265.15

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	19,297.58
合计	19,297.58

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	166.32
银行汇划费	480.00
合计	87,426.77

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“博时中证 500ETF 联接”）	基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总 额的比例
招商证券	228,615,128.88	47.04%	122,581,203.12	40.76%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

无。

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026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
招商证券	47,090.77	47.08%	25,542.41	34.84%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
招商证券	25,259.54	40.78%	7,077.61	17.46%

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

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

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

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	483,987.72	516,343.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,597.35	6,889.80
应支付基金管理人的净管理费	462,390.37	509,453.69

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 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	161,329.22	172,114.53

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	44,091,905.00	74.36%	40,729,805.00	71.59%
招商证券	792,493.00	1.34%	1,178,333.00	2.07%

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

2.持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	25,106,601.41	35,253.68	8,958,090.16	12,245.82

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	920186	中科仪	北交所网下新股中签	6,000.00	97,260.00
招商证券股份有限公司	001365	天海电子	网下发行	2,307.00	62,727.33
上年度可比期间					
2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

6.4.11 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期限	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				类 型						
688802	沐 曦 股 份	2025-12-09	9 个 月	首次公 开发 行 限 售	104.66	768.89	1,365.00	142,860.90	1,049,534.85	-
301666	大 普 微	2026-04-08	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	46.08	463.33	1,002.00	46,172.16	464,256.66	-
688781	视 涯 科 技	2026-03-18	9 个 月	首次公 开发 行 限 售	22.68	42.16	6,132.00	139,073.76	258,525.12	-
688808	联 讯 仪 器	2026-04-16	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
001248	华 润 新 能 源	2026-06-24	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	10.11	10.11	20,095.00	203,160.45	203,160.45	-
688820	盛 合	2026-04-13	6 个 月	首次	19.68	141.49	1,004.00	19,758.72	142,055.96	-

	晶微			公 开 发 行 限 售						
688818	电 科 蓝 天	2026-02-03	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	9.47	70.14	1,671.00	15,824.37	117,203.94	-
301682	宏 明 电 子	2026-03-18	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	69.66	160.06	629.00	43,816.14	100,677.74	-
688797	臻 宝 科 技	2026-06-16	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-
001399	惠 科 股 份	2026-06-16	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	10.12	27.73	3,361.00	34,013.32	93,200.53	-
001248	华 润 新 能 源	2026-06-24	6 个 交 易 日	新 股 未 上 市	10.11	10.11	8,612.00	87,067.32	87,067.32	-
688712	北 芯	2026-01-28	6 个 月	首 次	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-

	生命			公开发 行限售						
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	首次公 开发 行限售	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	首次公 开发 行限售	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	首次公 开发 行限售	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	首次公 开发 行限售	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	首次公 开发 行限	17.70	84.32	330.00	5,841.00	27,825.60	-

				售						
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	首次公开发 行限售	27.19	31.31	693.00	18,842.67	21,697.83	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	首次公开发 行限售	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	首次公开发 行限售	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	首次公开发 行限售	53.26	58.74	279.00	14,859.54	16,388.46	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	首次公开发 行限售	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	首次公开	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-

				发行 限售						
001393	维 通 利	2026-05-08	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
301531	春 光 集 团	2026-04-28	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智 能	2026-04-22	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
301680	固 德 电 材	2026-02-27	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧 谷 新 材	2026-03-24	6 个 月	首次公 开发 行 限 售	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
688816	易	2026-02-04	6 个	首	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-

	思维		月	次公开发 行限售						
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	首次公开发 行限售	13.86	73.46	137.00	1,898.82	10,064.02	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	首次公开发 行限售	11.18	17.59	507.00	5,668.26	8,918.13	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	首次公开发 行限售	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	10 个交易 日	新股未上市	19.28	19.28	300.00	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	首次公开发 行限售	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
603352	至	2026-01-08	6 个	首	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-

	信 股 份		月	次 公 开 发 行 限 售						
603293	埃 泰 克	2026-04-09	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
001312	福 恩 股 份	2026-04-14	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
920189	康 美 特	2026-06-30	6 个 交 易 日	新 股 未 上 市	8.14	8.14	200.00	1,628.00	1,628.00	-
603284	林 平 发 展	2026-02-03	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
001220	世 盟 股 份	2026-01-27	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股

票所获得的股票,自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》,基金通过询价转让受让的股份,在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金参与网上申购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
400174	中天 3	2023-08-30	重大事项停牌	0.01	-	-	537,300.00	1,162,804.48	5,373.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。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紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.12.2 信用风险

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

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

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 流动性风险

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

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

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；

持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

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

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

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	25,106,601.41	-	-	-	25,106,601.41
结算备付金	8,999,368.43	-	-	-	8,999,368.43
存出保证金	36,000.29	-	-	6,150,528.00	6,186,528.29
交易性金融资产	-	-	-	648,144,611.50	648,144,611.50
应收清算款	-	-	-	7,868,255.51	7,868,255.51
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	34,141,970.13	-	-	662,163,395.01	696,305,365.14
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	81,046.71	81,046.71
应付托管费	-	-	-	27,015.57	27,015.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	172,193.74	172,193.74
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	160,085.05	160,085.05
负债总计	-	-	-	440,341.07	440,341.07
利率敏感度缺口	34,141,970.13	-	-	661,723,053.94	695,865,024.07
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,271,710.17	-	-	-	11,271,710.17
结算备付金	22,236,997.96	-	-	-	22,236,997.96
存出保证金	40,007.33	-	-	5,082,954.00	5,122,961.33
交易性金融资产	-	-	-	501,168,830.82	501,168,830.82
应收清算款	-	-	-	1,922,318.04	1,922,318.04
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	33,548,715.46	-	-	508,174,102.86	541,722,818.32
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,199,545.19	2,199,545.19
应付管理人报酬	-	-	-	65,942.89	65,942.89
应付托管费	-	-	-	21,980.99	21,980.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	22,538.75	22,538.75
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	259,107.03	259,107.03
负债总计	-	-	-	2,569,114.85	2,569,114.85
利率敏感度缺口	33,548,715.46	-	-	505,604,988.01	539,153,703.47

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

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资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）。

6.4.12.4.2 外汇风险

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

6.4.12.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	648,144,611.50	93.14	501,168,830.82	92.95
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	648,144,611.50	93.14	501,168,830.82	92.95

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，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3,434	增加约 3,161
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,434	减少约 3,161

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日
第一层次	644,781,322.19
第二层次	297,639.77
第三层次	3,065,649.54
合计	648,144,611.50

6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	648,144,611.50	93.08
	其中：股票	648,144,611.50	93.08
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	34,105,969.84	4.90
8	其他各项资产	14,054,783.80	2.02
9	合计	696,305,365.14	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	2,105,805.00	0.30
B	采矿业	19,821,370.58	2.85
C	制造业	485,054,631.85	69.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,665,246.48	2.25
E	建筑业	3,753,753.00	0.54
F	批发和零售业	12,257,695.76	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	7,805,775.57	1.12
H	住宿和餐饮业	465,941.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,737,392.36	6.00
J	金融业	35,244,912.56	5.06
K	房地产业	2,586,906.00	0.37
L	租赁和商务服务业	6,586,704.40	0.95
M	科学研究和技术服务业	4,695,747.96	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	2,221,455.12	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,506,029.68	0.22
R	文化、体育和娱乐业	3,010,873.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	644,520,240.32	92.62

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.01
C	制造业	3,291,037.13	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	290,227.77	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,373.00	0.00
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	3,624,371.18	0.52

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	688498	源杰科技	5,246	9,893,956.00	1.42
2	300604	长川科技	25,300	8,637,926.00	1.24
3	001309	德明利	8,900	8,391,810.00	1.21
4	688347	华虹宏力	23,219	7,808,549.70	1.12
5	688120	华海清科	22,433	7,227,463.94	1.04
6	002281	光迅科技	27,600	7,091,544.00	1.02
7	002008	大族激光	47,200	7,085,192.00	1.02
8	300857	协创数据	19,680	6,689,232.00	0.96
9	300136	信维通信	55,200	6,582,600.00	0.95
10	688361	中科飞测	13,590	5,843,700.00	0.84
11	300475	香农芯创	18,900	5,670,000.00	0.81
12	300223	北京君正	21,900	5,450,910.00	0.78
13	002436	兴森科技	97,000	4,942,150.00	0.71
14	300285	国瓷材料	45,640	4,709,135.20	0.68
15	300054	鼎龙股份	43,500	4,609,695.00	0.66
16	600105	永鼎股份	66,700	4,500,916.00	0.65
17	300666	江丰电子	12,100	4,460,060.00	0.64
18	688777	中控技术	36,052	4,236,110.00	0.61
19	688200	华峰测控	8,042	4,222,854.20	0.61
20	300757	罗博特科	6,800	4,209,200.00	0.60
21	688037	芯源微	9,285	4,076,579.25	0.59
22	000021	深科技	62,700	4,029,729.00	0.58
23	601869	长飞光纤	7,100	3,875,890.00	0.56
24	002851	麦格米特	22,900	3,828,422.00	0.55
25	002409	雅克科技	16,400	3,681,800.00	0.53
26	688019	安集科技	10,764	3,653,947.44	0.53
27	300346	南大光电	39,420	3,652,263.00	0.52
28	300567	精测电子	11,100	3,525,360.00	0.51
29	300548	长芯博创	12,600	3,502,800.00	0.50
30	600498	烽火通信	46,600	3,429,760.00	0.49
31	002407	多氟多	67,900	3,410,617.00	0.49
32	002185	华天科技	151,700	3,384,427.00	0.49
33	002138	顺络电子	46,100	3,369,910.00	0.48
34	688002	睿创微纳	21,341	3,301,239.29	0.47
35	688313	仕佳光子	17,772	3,281,599.80	0.47
36	600879	航天电子	150,500	3,204,145.00	0.46
37	300395	菲利华	23,900	3,196,147.00	0.46
38	300620	光库科技	8,400	3,176,880.00	0.46
39	688017	绿的谐波	7,551	3,155,260.86	0.45
40	300390	天华新能	33,300	3,113,883.00	0.45
41	688469	芯联集成	286,823	3,043,192.03	0.44

42	301526	国际复材	64,400	3,005,548.00	0.43
43	300373	扬杰科技	18,700	2,940,201.00	0.42
44	688702	盛科通信	7,236	2,821,967.64	0.41
45	300058	蓝色光标	204,740	2,817,222.40	0.40
46	002273	水晶光电	79,200	2,810,016.00	0.40
47	300037	新宙邦	30,220	2,805,927.00	0.40
48	688172	燕东微	32,724	2,737,689.84	0.39
49	603256	宏和科技	10,200	2,706,366.00	0.39
50	300751	迈为股份	9,400	2,655,124.00	0.38
51	301377	鼎泰高科	4,800	2,644,320.00	0.38
52	605358	立昂微	34,000	2,638,400.00	0.38
53	600988	赤峰黄金	94,900	2,497,768.00	0.36
54	688099	晶晨股份	24,051	2,474,847.90	0.36
55	600885	宏发股份	70,640	2,436,373.60	0.35
56	605589	圣泉集团	38,300	2,434,731.00	0.35
57	002738	中矿资源	41,180	2,429,208.20	0.35
58	000960	锡业股份	56,400	2,407,716.00	0.35
59	002126	银轮股份	48,100	2,395,380.00	0.34
60	600392	盛和资源	79,900	2,378,623.00	0.34
61	600601	方正科技	170,800	2,363,872.00	0.34
62	000831	中国稀土	42,400	2,352,776.00	0.34
63	001389	广合科技	9,600	2,277,600.00	0.33
64	600141	兴发集团	48,200	2,263,954.00	0.33
65	002812	恩捷股份	33,800	2,261,558.00	0.32
66	600378	昊华科技	29,500	2,223,710.00	0.32
67	300570	太辰光	9,000	2,220,390.00	0.32
68	301358	湖南裕能	28,900	2,192,643.00	0.32
69	601179	中国西电	144,034	2,148,987.28	0.31
70	688234	天岳先进	12,332	2,139,725.32	0.31
71	002195	岩山科技	323,300	2,114,382.00	0.30
72	600497	驰宏锌锗	172,372	2,087,424.92	0.30
73	002850	科达利	11,000	2,082,300.00	0.30
74	688629	华丰科技	10,852	2,034,858.52	0.29
75	002261	拓维信息	72,000	2,016,720.00	0.29
76	600157	永泰能源	1,244,400	2,003,484.00	0.29
77	688052	纳芯微	6,709	1,934,271.79	0.28
78	600711	盛屯矿业	176,200	1,932,914.00	0.28
79	002340	格林美	291,100	1,924,171.00	0.28
80	600909	华安证券	172,160	1,912,697.60	0.27
81	600143	金发科技	121,900	1,883,355.00	0.27
82	688027	国盾量子	3,716	1,872,901.16	0.27
83	688411	海博思创	6,427	1,871,542.40	0.27
84	300017	网宿科技	142,500	1,853,925.00	0.27
85	000783	长江证券	189,200	1,844,700.00	0.27

86	301200	大族数控	5,100	1,839,315.00	0.26
87	002131	利欧股份	386,400	1,835,400.00	0.26
88	002821	凯莱英	11,300	1,830,600.00	0.26
89	003031	中瓷电子	10,141	1,828,422.30	0.26
90	600352	浙江龙盛	148,400	1,797,124.00	0.26
91	601555	东吴证券	226,840	1,796,572.80	0.26
92	002203	海亮股份	78,300	1,789,155.00	0.26
93	002966	苏州银行	254,890	1,774,034.40	0.25
94	603659	璞泰来	61,100	1,767,623.00	0.25
95	301611	珂玛科技	9,800	1,764,686.00	0.25
96	601233	桐昆股份	81,400	1,762,310.00	0.25
97	300339	润和软件	45,600	1,756,056.00	0.25
98	688220	翱捷科技	13,968	1,736,501.76	0.25
99	688235	百济神州	6,770	1,723,709.70	0.25
100	300759	康龙化成	59,100	1,709,763.00	0.25
101	688213	思特威	15,652	1,675,859.64	0.24
102	688578	艾力斯	15,052	1,643,678.40	0.24
103	603308	应流股份	27,100	1,636,840.00	0.24
104	688122	西部超导	25,897	1,626,590.57	0.23
105	603129	春风动力	6,300	1,611,540.00	0.23
106	002472	双环传动	38,700	1,606,437.00	0.23
107	601108	财通证券	185,600	1,605,440.00	0.23
108	300207	欣旺达	84,400	1,602,756.00	0.23
109	300001	特锐德	42,200	1,596,426.00	0.23
110	002517	恺英网络	97,500	1,584,375.00	0.23
111	002797	第一创业	239,860	1,575,880.20	0.23
112	002601	龙佰集团	95,200	1,568,896.00	0.23
113	300458	全志科技	39,660	1,564,983.60	0.22
114	601958	金钼股份	55,200	1,551,672.00	0.22
115	688387	信科移动	77,863	1,544,801.92	0.22
116	688322	奥比中光	11,801	1,540,620.55	0.22
117	688385	复旦微电	21,369	1,523,396.01	0.22
118	300115	长盈精密	54,100	1,511,554.00	0.22
119	688301	奕瑞科技	12,163	1,508,212.00	0.22
120	601198	东兴证券	110,700	1,504,413.00	0.22
121	601991	大唐发电	212,300	1,503,084.00	0.22
122	002155	湖南黄金	62,220	1,485,191.40	0.21
123	000703	恒逸石化	109,000	1,479,130.00	0.21
124	002465	海格通信	113,400	1,448,118.00	0.21
125	600563	法拉电子	7,500	1,431,000.00	0.21
126	300454	深信服	14,800	1,423,760.00	0.20
127	002056	横店东磁	46,600	1,420,368.00	0.20
128	603179	新泉股份	28,580	1,418,997.00	0.20
129	601665	齐鲁银行	245,600	1,417,112.00	0.20

130	603156	养元饮品	28,800	1,413,216.00	0.20
131	600884	杉杉股份	102,800	1,392,940.00	0.20
132	600707	彩虹股份	81,900	1,383,291.00	0.20
133	300024	机器人	71,500	1,382,095.00	0.20
134	603650	彤程新材	14,100	1,381,518.00	0.20
135	002130	沃尔核材	72,000	1,365,120.00	0.20
136	688331	荣昌生物	10,445	1,360,565.70	0.20
137	002402	和而泰	52,600	1,358,658.00	0.20
138	601162	天风证券	402,400	1,356,088.00	0.19
139	002429	兆驰股份	129,200	1,342,388.00	0.19
140	000060	中金岭南	177,300	1,342,161.00	0.19
141	603379	三美股份	17,560	1,332,628.40	0.19
142	300012	华测检测	96,000	1,330,560.00	0.19
143	000878	云南铜业	83,000	1,318,040.00	0.19
144	002432	九安医疗	18,600	1,314,648.00	0.19
145	601099	太平洋	389,000	1,310,930.00	0.19
146	000893	亚钾国际	31,800	1,300,302.00	0.19
147	600109	国金证券	147,800	1,297,684.00	0.19
148	688676	金盘科技	15,326	1,297,192.64	0.19
149	002271	东方雨虹	109,000	1,293,830.00	0.19
150	002414	高德红外	97,500	1,292,850.00	0.19
151	000034	神州数码	46,580	1,292,595.00	0.19
152	300496	中科创达	20,900	1,291,411.00	0.19
153	300623	捷捷微电	28,500	1,282,215.00	0.18
154	689009	九号公司	33,603	1,281,954.45	0.18
155	603688	石英股份	15,450	1,276,324.50	0.18
156	688266	泽璟制药	10,905	1,272,177.30	0.18
157	002444	巨星科技	40,900	1,271,990.00	0.18
158	002335	科华数据	29,925	1,270,316.25	0.18
159	600256	广汇能源	255,100	1,260,194.00	0.18
160	002487	大金重工	21,700	1,257,949.00	0.18
161	000661	长春高新	18,800	1,252,080.00	0.18
162	603979	金诚信	21,200	1,251,436.00	0.18
163	688728	格科微	59,460	1,251,038.40	0.18
164	300474	景嘉微	20,650	1,248,912.00	0.18
165	600060	海信视像	44,800	1,248,576.00	0.18
166	600298	安琪酵母	34,482	1,248,248.40	0.18
167	300763	锦浪科技	13,600	1,228,760.00	0.18
168	301536	星宸科技	9,500	1,222,745.00	0.18
169	000733	振华科技	21,500	1,217,760.00	0.17
170	002756	永兴材料	21,400	1,212,096.00	0.17
171	600021	上海电力	80,400	1,211,628.00	0.17
172	601128	常熟银行	208,118	1,211,246.76	0.17
173	600699	均胜电子	55,800	1,205,838.00	0.17

174	300748	金力永磁	39,000	1,203,150.00	0.17
175	601577	长沙银行	137,600	1,198,496.00	0.17
176	601615	明阳智能	103,300	1,195,181.00	0.17
177	002078	太阳纸业	95,669	1,194,905.81	0.17
178	002025	航天电器	15,600	1,189,032.00	0.17
179	300073	当升科技	24,734	1,188,221.36	0.17
180	601696	中银证券	93,900	1,187,835.00	0.17
181	002157	正邦科技	422,100	1,186,101.00	0.17
182	300142	沃森生物	91,100	1,183,389.00	0.17
183	603920	世运电路	24,600	1,181,784.00	0.17
184	300432	富临精工	58,600	1,177,274.00	0.17
185	603606	东方电缆	28,280	1,173,902.80	0.17
186	603087	甘李药业	20,600	1,169,256.00	0.17
187	300919	中伟新材	26,700	1,168,125.00	0.17
188	000423	东阿阿胶	25,700	1,165,752.00	0.17
189	688608	恒玄科技	6,949	1,161,803.31	0.17
190	688169	石头科技	12,174	1,156,164.78	0.17
191	002252	上海莱士	263,300	1,142,722.00	0.16
192	688343	云天励飞	13,975	1,141,198.50	0.16
193	688599	天合光能	80,106	1,131,096.72	0.16
194	300724	捷佳伟创	16,000	1,129,600.00	0.16
195	000728	国元证券	149,300	1,118,257.00	0.16
196	300953	震裕科技	8,200	1,096,340.00	0.16
197	688375	国博电子	10,495	1,094,628.50	0.16
198	603119	浙江荣泰	16,300	1,081,342.00	0.16
199	002064	华峰化学	113,300	1,075,217.00	0.15
200	688018	乐鑫科技	8,277	1,058,793.84	0.15
201	000786	北新建材	58,400	1,056,456.00	0.15
202	603290	斯达半导	6,900	1,055,286.00	0.15
203	002831	裕同科技	29,477	1,048,202.12	0.15
204	001203	大中矿业	34,800	1,042,260.00	0.15
205	600171	上海贝岭	32,500	1,038,050.00	0.15
206	688180	君实生物	30,693	1,038,037.26	0.15
207	300679	电连技术	17,100	1,025,829.00	0.15
208	300677	英科医疗	26,140	1,023,903.80	0.15
209	300383	光环新网	82,000	1,020,080.00	0.15
210	688188	柏楚电子	9,510	1,014,717.00	0.15
211	000519	中兵红箭	47,900	1,009,253.00	0.15
212	300972	万辰集团	5,800	1,005,778.00	0.14
213	603806	福斯特	59,700	1,002,363.00	0.14
214	688187	时代电气	14,504	995,844.64	0.14
215	002673	西部证券	153,000	992,970.00	0.14
216	600177	雅戈尔	131,700	991,701.00	0.14
217	600516	方大炭素	160,600	990,902.00	0.14

218	603160	汇顶科技	16,000	987,360.00	0.14
219	688065	凯赛生物	20,404	976,331.40	0.14
220	000559	万向钱潮	75,500	976,215.00	0.14
221	600642	申能股份	111,700	975,141.00	0.14
222	601699	潞安环能	68,200	973,896.00	0.14
223	000623	吉林敖东	54,520	966,639.60	0.14
224	002624	完美世界	77,351	960,699.42	0.14
225	600637	东方明珠	115,200	957,312.00	0.14
226	300699	光威复材	33,380	956,337.00	0.14
227	001696	宗申动力	45,900	955,179.00	0.14
228	688568	中科星图	22,870	948,418.90	0.14
229	603225	新凤鸣	48,000	943,200.00	0.14
230	002085	万丰奥威	84,800	940,432.00	0.14
231	000983	山西焦煤	161,800	938,440.00	0.13
232	603345	安井食品	11,700	938,223.00	0.13
233	000750	国海证券	254,900	938,032.00	0.13
234	300558	贝达药业	14,400	937,008.00	0.13
235	002318	久立特材	39,000	932,100.00	0.13
236	002739	儒意电影	96,400	925,440.00	0.13
237	600100	同方股份	133,700	915,845.00	0.13
238	002065	东华软件	128,100	914,634.00	0.13
239	600369	西南证券	227,200	913,344.00	0.13
240	688617	惠泰医疗	5,019	911,249.64	0.13
241	600499	科达制造	65,600	905,280.00	0.13
242	002266	浙富控股	178,600	903,716.00	0.13
243	300627	华测导航	31,809	903,375.60	0.13
244	600536	中国软件	32,110	902,933.20	0.13
245	600595	中孚实业	159,900	898,638.00	0.13
246	002044	美年健康	178,600	898,358.00	0.13
247	603444	吉比特	2,500	896,050.00	0.13
248	603699	纽威股份	17,800	895,340.00	0.13
249	688772	珠海冠宇	45,369	890,593.47	0.13
250	002223	鱼跃医疗	34,564	886,912.24	0.13
251	603596	伯特利	35,687	886,465.08	0.13
252	000629	钒钛股份	265,200	885,768.00	0.13
253	000155	川能动力	73,900	885,322.00	0.13
254	000400	许继电气	40,700	883,190.00	0.13
255	300002	神州泰岳	112,300	877,063.00	0.13
256	300003	乐普医疗	73,700	873,345.00	0.13
257	601016	节能风电	224,190	869,857.20	0.13
258	600985	淮北矿业	61,600	865,480.00	0.12
259	600862	中航高科	47,900	863,637.00	0.12
260	002430	杭氧股份	27,883	863,257.68	0.12
261	600521	华海药业	59,900	862,560.00	0.12

262	000415	渤海租赁	211,900	862,433.00	0.12
263	601717	中创智领	61,800	859,638.00	0.12
264	601216	君正集团	192,600	858,996.00	0.12
265	601212	白银有色	169,000	858,520.00	0.12
266	601997	贵阳银行	166,900	856,197.00	0.12
267	000683	博源化工	148,400	854,784.00	0.12
268	300487	蓝晓科技	14,500	853,325.00	0.12
269	000039	中集集团	104,950	851,144.50	0.12
270	600863	华能蒙电	178,800	840,360.00	0.12
271	603766	隆鑫通用	70,300	838,679.00	0.12
272	600704	物产中大	177,000	835,440.00	0.12
273	601001	晋控煤业	47,900	832,981.00	0.12
274	000032	深桑达 A	33,300	830,835.00	0.12
275	000050	深天马 A	83,400	826,494.00	0.12
276	601990	南京证券	125,600	825,192.00	0.12
277	600873	梅花生物	112,000	823,200.00	0.12
278	600312	平高电气	46,600	822,956.00	0.12
279	688538	和辉光电	315,108	819,280.80	0.12
280	002841	视源股份	23,700	818,361.00	0.12
281	603077	和邦生物	352,440	817,660.80	0.12
282	000729	燕京啤酒	80,300	813,439.00	0.12
283	603605	珀莱雅	13,500	808,920.00	0.12
284	000887	中鼎股份	45,200	808,628.00	0.12
285	000967	盈峰环境	76,500	805,545.00	0.12
286	600332	白云山	40,100	803,604.00	0.12
287	600765	中航重机	62,080	802,073.60	0.12
288	688297	中无人机	19,011	789,907.05	0.11
289	600166	福田汽车	270,889	788,286.99	0.11
290	688692	达梦数据	3,225	787,835.25	0.11
291	600153	建发股份	99,300	787,449.00	0.11
292	600348	华阳股份	102,850	786,802.50	0.11
293	688615	合合信息	6,919	782,538.90	0.11
294	000830	鲁西化工	65,100	781,200.00	0.11
295	002410	广联达	94,200	768,672.00	0.11
296	688582	芯动联科	11,824	768,560.00	0.11
297	601611	中国核建	68,800	767,120.00	0.11
298	002939	长城证券	91,900	766,446.00	0.11
299	002683	广东宏大	26,000	761,540.00	0.11
300	002007	华兰生物	62,300	759,437.00	0.11
301	600901	江苏金租	132,000	759,000.00	0.11
302	000062	深圳华强	23,800	757,316.00	0.11
303	600737	中粮糖业	61,200	754,596.00	0.11
304	600363	联创光电	20,800	744,224.00	0.11
305	600578	京能电力	114,700	739,815.00	0.11

306	002926	华西证券	89,940	734,809.80	0.11
307	601799	星宇股份	8,000	724,960.00	0.10
308	603728	鸣志电器	11,900	724,948.00	0.10
309	603568	伟明环保	47,024	723,229.12	0.10
310	000921	海信家电	26,400	721,248.00	0.10
311	000737	北方铜业	54,300	717,846.00	0.10
312	000591	太阳能	156,000	717,600.00	0.10
313	002603	以岭药业	47,800	717,000.00	0.10
314	600398	海澜之家	137,000	716,510.00	0.10
315	603298	杭叉集团	29,980	715,322.80	0.10
316	688114	华大智造	13,867	708,326.36	0.10
317	600486	扬农化工	13,860	702,702.00	0.10
318	601000	唐山港	169,050	701,557.50	0.10
319	000528	柳工	92,900	701,395.00	0.10
320	688248	南网科技	9,972	689,862.96	0.10
321	603341	龙旗科技	16,200	688,338.00	0.10
322	600208	衢州发展	242,600	686,558.00	0.10
323	000738	航发控制	37,400	684,046.00	0.10
324	600008	首创环保	251,374	683,737.28	0.10
325	600316	洪都航空	24,400	681,736.00	0.10
326	600435	北方导航	60,600	678,720.00	0.10
327	000932	华菱钢铁	195,540	678,523.80	0.10
328	600170	上海建工	304,300	675,546.00	0.10
329	600998	九州通	143,976	675,247.44	0.10
330	600995	南网储能	54,700	672,810.00	0.10
331	000987	越秀资本	85,950	672,129.00	0.10
332	603486	科沃斯	13,200	669,900.00	0.10
333	002152	广电运通	70,900	665,042.00	0.10
334	000997	新大陆	40,400	658,520.00	0.09
335	600820	隧道股份	125,600	654,376.00	0.09
336	000951	中国重汽	33,500	653,585.00	0.09
337	600161	天坛生物	56,400	653,112.00	0.09
338	002262	恩华药业	34,600	648,750.00	0.09
339	688778	厦钨新能	11,874	645,945.60	0.09
340	600282	南钢股份	140,700	645,813.00	0.09
341	601106	中国一重	195,599	645,476.70	0.09
342	600483	福能股份	63,300	645,027.00	0.09
343	000009	中国宝安	103,220	643,060.60	0.09
344	688295	中复神鹰	10,588	640,997.52	0.09
345	603885	吉祥航空	62,100	639,009.00	0.09
346	600583	海油工程	126,100	634,283.00	0.09
347	002500	山西证券	122,790	633,596.40	0.09
348	603816	顾家家居	28,100	628,316.00	0.09
349	600546	山煤国际	56,600	618,638.00	0.09

350	603939	益丰药房	34,364	617,864.72	0.09
351	000582	北部湾港	57,500	616,975.00	0.09
352	603338	浙江鼎力	14,500	616,250.00	0.09
353	600763	通策医疗	17,936	607,671.68	0.09
354	600329	达仁堂	16,300	606,686.00	0.09
355	601666	平煤股份	84,600	604,890.00	0.09
356	600562	国睿科技	28,400	602,648.00	0.09
357	688318	财富趋势	8,422	600,572.82	0.09
358	688166	博瑞医药	17,114	599,161.14	0.09
359	601567	三星电气	40,000	597,600.00	0.09
360	600685	中船防务	23,300	592,752.00	0.09
361	002312	川发龙蟒	64,500	591,465.00	0.08
362	600038	中直股份	23,300	589,257.00	0.08
363	300676	华大基因	16,800	589,008.00	0.08
364	000723	美锦能源	175,800	588,930.00	0.08
365	600380	健康元	62,500	588,750.00	0.08
366	603565	中谷物流	60,000	588,600.00	0.08
367	600602	云赛智联	36,600	588,528.00	0.08
368	003022	联泓新科	22,700	587,930.00	0.08
369	000513	丽珠集团	20,342	587,680.38	0.08
370	600390	五矿资本	128,400	585,504.00	0.08
371	601156	东航物流	36,100	581,932.00	0.08
372	601880	辽港股份	420,100	579,738.00	0.08
373	601399	国机重装	164,600	576,100.00	0.08
374	600132	重庆啤酒	13,800	569,940.00	0.08
375	601865	福莱特	54,200	569,642.00	0.08
376	600535	天士力	42,700	564,921.00	0.08
377	688281	华秦科技	11,195	562,324.85	0.08
378	688336	三生国健	10,523	558,771.30	0.08
379	600511	国药股份	21,400	557,256.00	0.08
380	600906	财达证券	74,200	553,532.00	0.08
381	000739	普洛药业	33,200	553,112.00	0.08
382	600977	中国电影	42,600	550,392.00	0.08
383	601236	红塔证券	80,700	550,374.00	0.08
384	300100	双林股份	19,760	548,932.80	0.08
385	600816	建元信托	224,800	548,512.00	0.08
386	000598	兴蓉环境	85,200	546,984.00	0.08
387	002244	滨江集团	71,100	540,360.00	0.08
388	002299	圣农发展	35,300	535,148.00	0.08
389	600970	中材国际	75,000	534,750.00	0.08
390	601155	新城控股	51,500	528,390.00	0.08
391	002120	韵达股份	82,700	525,972.00	0.08
392	300146	汤臣倍健	58,000	524,320.00	0.08
393	600967	内蒙一机	48,300	524,055.00	0.08

394	000883	湖北能源	121,000	522,720.00	0.08
395	688278	特宝生物	9,584	521,369.60	0.07
396	300144	宋城演艺	89,700	521,157.00	0.07
397	300735	光弘科技	22,900	520,746.00	0.07
398	300718	长盛轴承	8,400	512,148.00	0.07
399	000027	深圳能源	81,380	504,556.00	0.07
400	002568	百润股份	29,800	504,216.00	0.07
401	600131	国网信通	34,400	502,240.00	0.07
402	000800	一汽解放	84,200	500,990.00	0.07
403	003021	兆威机电	5,700	497,895.00	0.07
404	601608	中信重工	104,350	497,749.50	0.07
405	601866	中远海发	222,667	492,094.07	0.07
406	603737	三棵树	20,392	491,447.20	0.07
407	600095	湘财股份	65,100	490,203.00	0.07
408	000088	盐田港	118,500	484,665.00	0.07
409	688363	华熙生物	13,536	484,182.72	0.07
410	601118	海南橡胶	97,700	480,684.00	0.07
411	600801	华新建材	30,800	480,480.00	0.07
412	002583	海能达	62,000	476,780.00	0.07
413	600126	杭钢股份	76,900	471,397.00	0.07
414	600871	石化油服	231,900	470,757.00	0.07
415	603000	人民网	31,670	468,399.30	0.07
416	600754	锦江酒店	25,900	465,941.00	0.07
417	600566	济川药业	20,800	461,552.00	0.07
418	002984	森麒麟	35,300	461,371.00	0.07
419	600517	国网英大	97,900	458,172.00	0.07
420	000709	河钢股份	235,900	457,646.00	0.07
421	600655	豫园股份	111,100	456,621.00	0.07
422	603589	口子窖	23,800	444,584.00	0.06
423	000825	太钢不锈	130,200	443,982.00	0.06
424	603858	步长制药	30,200	440,920.00	0.06
425	600598	北大荒	40,500	439,020.00	0.06
426	601598	中国外运	88,400	438,464.00	0.06
427	688192	迪哲医药	10,919	435,995.67	0.06
428	001286	陕西能源	42,800	433,992.00	0.06
429	002423	中粮资本	52,500	432,075.00	0.06
430	600350	山东高速	38,500	428,505.00	0.06
431	600004	白云机场	58,900	427,614.00	0.06
432	688709	成都华微	11,212	427,065.08	0.06
433	603899	晨光股份	20,700	427,041.00	0.06
434	002773	康弘药业	20,800	425,360.00	0.06
435	601966	玲珑轮胎	41,700	424,923.00	0.06
436	600663	陆家嘴	67,300	422,644.00	0.06
437	301606	绿联科技	6,900	421,038.00	0.06

438	600582	天地科技	94,345	419,835.25	0.06
439	688349	三一重能	27,107	411,484.26	0.06
440	600848	上海临港	54,600	408,954.00	0.06
441	000429	粤高速 A	29,900	408,135.00	0.06
442	688563	航材股份	7,922	405,844.06	0.06
443	601098	中南传媒	41,000	403,440.00	0.06
444	002508	老板电器	26,900	393,278.00	0.06
445	603233	大参林	25,920	389,577.60	0.06
446	600968	海油发展	116,200	386,946.00	0.06
447	601928	凤凰传媒	43,600	383,244.00	0.06
448	600062	华润双鹤	23,600	378,544.00	0.05
449	300957	贝泰妮	12,000	378,120.00	0.05
450	003035	南网能源	64,700	376,554.00	0.05
451	300888	稳健医疗	13,240	370,587.60	0.05
452	600688	上海石化	125,400	367,422.00	0.05
453	688425	铁建重工	91,187	366,571.74	0.05
454	601808	中海油服	33,900	366,459.00	0.05
455	002670	国盛证券	33,240	365,640.00	0.05
456	688561	奇安信	15,228	365,167.44	0.05
457	600295	鄂尔多斯	34,000	364,480.00	0.05
458	688708	佳驰科技	7,049	358,089.20	0.05
459	002032	苏泊尔	9,000	356,400.00	0.05
460	600098	广州发展	60,100	355,191.00	0.05
461	000539	粤电力 A	50,600	344,586.00	0.05
462	000537	绿发电力	47,100	344,301.00	0.05
463	600808	马钢股份	136,055	340,137.50	0.05
464	002153	石基信息	46,934	339,332.82	0.05
465	600292	电投水电	27,500	331,100.00	0.05
466	600377	宁沪高速	28,300	327,431.00	0.05
467	601298	青岛港	40,000	322,000.00	0.05
468	000959	首钢股份	88,700	311,337.00	0.04
469	603833	欧派家居	10,300	310,133.00	0.04
470	002265	建设工业	17,800	309,720.00	0.04
471	301301	川宁生物	38,100	302,514.00	0.04
472	002608	江苏国信	43,100	297,390.00	0.04
473	600339	中油工程	95,600	293,492.00	0.04
474	600606	绿地控股	240,600	291,126.00	0.04
475	603529	爱玛科技	14,900	290,699.00	0.04
476	600032	浙江新能	41,100	289,755.00	0.04
477	603786	科博达	7,000	286,370.00	0.04
478	000785	居然智家	142,100	284,200.00	0.04
479	301498	乖宝宠物	7,000	284,130.00	0.04
480	600764	中国海防	16,300	284,109.00	0.04
481	688520	神州细胞	8,277	283,156.17	0.04

482	603658	安图生物	9,700	281,494.00	0.04
483	601139	深圳燃气	49,100	277,906.00	0.04
484	000937	冀中能源	66,666	265,330.68	0.04
485	300140	节能环保	53,000	263,410.00	0.04
486	000898	鞍钢股份	136,300	254,881.00	0.04
487	688475	萤石网络	9,262	253,315.70	0.04
488	603049	中策橡胶	5,607	251,249.67	0.04
489	603175	超颖电子	2,800	249,452.00	0.04
490	601228	广州港	86,200	243,084.00	0.03
491	601019	山东出版	35,500	227,200.00	0.03
492	600927	永安期货	16,700	207,915.00	0.03
493	002945	华林证券	15,400	206,822.00	0.03
494	601112	振石股份	10,807	196,687.13	0.03
495	002461	珠江啤酒	25,200	190,764.00	0.03
496	600299	安迪苏	22,700	178,195.00	0.03
497	688819	天能股份	8,006	177,733.20	0.03
498	603092	德力佳	2,100	113,337.00	0.02
499	001221	悍高集团	2,400	96,528.00	0.01
500	001386	马可波罗	6,300	89,208.00	0.01

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	占基金资产净值比例(%)
1	688802	沐曦股份	1,365.00	1,049,534.85	0.15
2	301666	大普微	1,002.00	464,256.66	0.07
3	001248	华润新能源	28,707.00	290,227.77	0.04
4	002080	中材科技	3,000.00	270,000.00	0.04
5	688781	视涯科技	6,132.00	258,525.12	0.04
6	688808	联讯仪器	163.00	258,245.79	0.04
7	688820	盛合晶微	1,004.00	142,055.96	0.02
8	688818	电科蓝天	1,671.00	117,203.94	0.02
9	301682	宏明电子	629.00	100,677.74	0.01
10	688797	臻宝科技	207.00	97,014.69	0.01
11	001399	惠科股份	3,361.00	93,200.53	0.01
12	688712	北芯生命	1,500.00	53,880.00	0.01
13	688785	恒运昌	116.00	53,725.40	0.01
14	688813	泰金新能	234.00	40,269.06	0.01
15	688635	长进光子	128.00	39,448.32	0.01
16	001257	盛龙股份	1,743.00	36,149.82	0.01
17	603459	红板科技	330.00	27,825.60	0.00
18	001365	天海电子	693.00	21,697.83	0.00
19	688811	有研复材	834.00	20,124.42	0.00
20	301696	三瑞智能	216.00	18,748.80	0.00

21	001237	惠康科技	279.00	16,388.46	0.00
22	301669	高特电子	546.00	15,506.40	0.00
23	301687	新广益	195.00	15,167.10	0.00
24	001393	维通利	387.00	15,089.13	0.00
25	301531	春光集团	290.00	14,952.40	0.00
26	301599	理奇智能	433.00	14,059.51	0.00
27	301680	固德电材	117.00	13,122.72	0.00
28	301683	慧谷新材	96.00	11,689.92	0.00
29	688816	易思维	177.00	10,106.70	0.00
30	603407	长裕集团	137.00	10,064.02	0.00
31	301513	尚水智能	138.00	7,032.48	0.00
32	920136	永励精密	300.00	5,784.00	0.00
33	400174	中天 3	537,300.00	5,373.00	0.00
34	603435	嘉德利	104.00	4,857.84	0.00
35	603352	至信股份	112.00	2,858.24	0.00
36	603293	埃泰克	72.00	2,442.96	0.00
37	001312	福恩股份	134.00	2,248.52	0.00
38	920189	康美特	200.00	1,628.00	0.00
39	603284	林平发展	46.00	1,604.02	0.00
40	001220	世盟股份	57.00	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值 比例（%）
1	688498	源杰科技	8,489,399.11	1.57
2	001309	德明利	5,942,972.12	1.10
3	688027	国盾量子	4,816,596.63	0.89
4	300666	江丰电子	3,702,488.00	0.69
5	300475	香农芯创	3,598,941.00	0.67
6	600105	永鼎股份	3,565,148.00	0.66
7	688120	华海清科	3,301,339.55	0.61
8	601869	长飞光纤	3,160,610.00	0.59
9	688037	芯源微	2,979,011.52	0.55
10	300548	长芯博创	2,942,376.00	0.55
11	688525	佰维存储	2,837,846.04	0.53
12	688313	仕佳光子	2,817,398.12	0.52
13	002407	多氟多	2,652,405.00	0.49
14	300620	光库科技	2,599,302.00	0.48
15	688200	华峰测控	2,584,017.85	0.48

16	688361	中科飞测	2,522,791.88	0.47
17	600487	亨通光电	2,353,192.00	0.44
18	603256	宏和科技	2,261,458.00	0.42
19	600711	盛屯矿业	2,224,183.00	0.41
20	002812	恩捷股份	2,177,072.00	0.40

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值 比例（%）
1	600487	亨通光电	13,670,505.01	2.54
2	688525	佰维存储	9,098,749.76	1.69
3	600549	厦门钨业	5,610,443.00	1.04
4	002353	杰瑞股份	5,455,049.00	1.01
5	301308	江波龙	5,271,886.00	0.98
6	688027	国盾量子	4,807,844.48	0.89
7	002156	通富微电	4,248,766.82	0.79
8	000657	中钨高新	4,218,789.00	0.78
9	601168	西部矿业	3,995,101.58	0.74
10	600673	东阳光	3,866,912.00	0.72
11	600118	中国卫星	3,684,549.72	0.68
12	000426	兴业银锡	3,055,032.00	0.57
13	002837	英维克	3,041,013.70	0.56
14	600580	卧龙电驱	3,037,278.20	0.56
15	002202	金风科技	3,025,707.00	0.56
16	600096	云天化	3,024,472.00	0.56
17	688183	生益电子	2,893,799.00	0.54
18	603228	景旺电子	2,867,170.06	0.53
19	300450	先导智能	2,705,839.00	0.50
20	688120	华海清科	2,679,095.03	0.50

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	254,445,815.25
卖出股票的收入（成交）总额	234,371,969.01

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,186,528.29
2	应收清算款	7,868,255.51
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	-
8	其他	-
9	合计	14,054,783.80

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净值 比例(%)	流通受限情况说明
1	688802	沐曦股份	1,049,534.85	0.15	首次公开发行限售
2	301666	大普微	464,256.66	0.07	首次公开发行限售
3	001248	华润新能源	290,227.77	0.04	新股未上市
4	688781	视涯科技	258,525.12	0.04	首次公开发行限售

注：上述流通受限情况为报告期末时点情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,560	38,009.68	6,421,669.00	10.83%	8,781,524.00	14.81%	44,091,905.00	74.36%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.3 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

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 8 月 1 日）基金份额总额	2,762,185,861.00
本报告期期初基金份额总额	56,895,098.00
本报告期基金总申购份额	23,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	20,800,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,295,098.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2026 年 02 月 14 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》，张东先生代任公司首席信息官，王德英先生离任公司副总经理、公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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的诉讼。

本报告期内，无涉及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改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	126,771,885.70	26.09%	26,104.83	26.10%	-
中信建投	3	119,227,990.00	24.53%	24,501.13	24.49%	增加 1 个
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	11,343,083.84	2.33%	2,335.62	2.33%	-
招商证券	3	228,615,128.88	47.04%	47,090.77	47.08%	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

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

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

(3) 本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时中证 500 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	2026-06-26
2	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华鑫证券为申购、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	2026-06-12
3	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）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	2026-05-29
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-13
5	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
6	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-24
7	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 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	2026-04-22
8	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证	中国证券报、基金管理人	2026-03-31

	券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	网站、证监会基金电子披露网站	
9	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增瑞银证券为申购、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	2026-03-25
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
12	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	2026-02-14
13	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国联民生证券为申购、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	2026-02-10
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-20260124	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
15	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-22

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
招商银行股份有	1	2026-01-01~2026-06-30	40,729,805.00	13,395,800.00	10,033,700.00	44,091,905.00	74.36%

限公司一博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金							
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--

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.申购份额包含买入份额，赎回份额包含卖出份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日