

博时中证 A500 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	6
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	6
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	7
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	7
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	7
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	8
§5 托管人报告	8
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	8
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	8
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	8
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	8
6.1 资产负债表	8
6.2 利润表	10
6.3 净资产变动表	12
6.4 报表附注	14
§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	47
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	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§9 开放式基金份额变动	64

§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
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	66
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
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 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 博时
基金主代码	159357
交易代码	159357
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 11 月 21 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	1,159,833,841.00 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	2024 年 11 月 28 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。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金的投资策略还包括债券（除可转换债券、可交换债券）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、金融衍生品投资策略、融资和转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 A500 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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证 A500 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	证券时报
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	256,777,369.77
本期利润	241,205,986.46
加权平均基金份额本期利润	0.1658
本期加权平均净值利润率	12.64%
本期基金份额净值增长率	13.32%
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	328,730,634.39
期末可供分配基金份额利润	0.2834
期末基金资产净值	1,641,206,730.38
期末基金份额净值	1.4150
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	42.69%

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	15.45%	1.39%	14.26%	1.41%	1.19%	-0.02%
过去六个月	13.32%	1.28%	11.91%	1.29%	1.41%	-0.01%
过去一年	39.71%	1.14%	36.38%	1.14%	3.33%	0.00%
自基金合同生	42.69%	1.11%	33.91%	1.13%	8.78%	-0.02%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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		

杨振建	基金经理	2024-11-21	-	12.8	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。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)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 日-2026 年 5 月 21 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)、博时中证 800 指数增强型证券投资基金(2025 年 9 月 2 日—至
-----	------	------------	---	------	---

					今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2025 年 11 月 3 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

本报告期内，2026 年上半年 A 股市场呈现“震荡上行、结构分化”的态势，主要指数稳步收涨，市场活力显著增强，行情主线清晰，科技成长板块领涨，人工智能、算力半导体等新质生产力领域表现强劲，市场“含科量”显著提升，上证指数上半年收于 4094 点。海外在地缘局势逐步缓和之后，全球多数权益资产在年初波动后逐步回稳。本基金利用数量化手段对组合进行管理，严格控制与指数跟踪偏离。

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 1.4150 元，份额累计净值为 1.4245 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 13.32%，同期业绩基准增长率 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年在更加积极有为的宏观政策支持下，中国经济运行总体平稳，出口保持了韧性。宏观政策明确实施“更加积极的财政政策”和“适度宽松的货币政策”，为经济回升向好提供了有力支撑。财政政策保持适度支出强度、持续发行超长期特别国债并支持“两重”“两新”建设，货币政策保持流动性合理充裕，推动社会综合融资成本稳中有降。在此背景下，市场流动性整体充裕，科技成长板块表现相对突出，资源品、红利等板块整体表现相对偏弱。展望下半年，从盈利预期角度看，A 股市场预计将在盈利驱动与政策支持下，市场驱动力将从估值扩张转向企业盈利改善预期。宏观基本面预计在“十五五”开局之年的产业政策与流动性宽松环境中逐步企稳。配置上建议关注上市公司业绩兑现能力与结构性机会的平衡。中证 A500 作为 A 股核心资产指数，由于在编制方法上考虑了行业均衡、ESG、互联互通等因素，使得指数投资属性更强。当前成份股的估值水平处于历史相对均衡的位置，值得长期配置。

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 A500 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	6.4.7.1	3,764,993.38	5,564,130.34
结算备付金		13,462,895.99	13,460,311.91
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,627,658,108.86	2,047,032,044.55
其中：股票投资		1,627,482,103.98	2,047,032,044.55
基金投资		-	-
债券投资		176,004.88	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		1,644,946,490.86	2,066,056,486.80
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	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,232,081.47	2,855,494.14
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		197,585.18	266,524.17
应付托管费		65,861.73	88,841.39
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.31	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	244,231.79	219,648.00
负债合计		3,739,760.48	3,430,507.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,159,833,841.00	1,651,833,841.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	481,372,889.38	410,792,138.10
净资产合计		1,641,206,730.38	2,062,625,979.10
负债和净资产总计		1,644,946,490.86	2,066,056,486.80

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4150 元，基金份额总额 1,159,833,841.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证 A500 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		243,267,261.46	100,861,305.23

1.利息收入		9,425.39	31,941.99
其中：存款利息收入	6.4.6.9	9,425.39	31,941.99
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）		258,927,644.37	33,957,764.49
其中：股票投资收益	6.4.6.10	244,114,530.42	-16,639,145.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	4.61	94,895.26
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	-	-
股利收益	6.4.6.14	14,813,109.34	50,502,014.75
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	-15,571,383.31	63,200,761.39
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	-98,424.99	3,670,837.36
减：二、营业总支出		2,061,275.00	5,075,797.46
1. 管理人报酬		1,422,739.52	3,666,868.46
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		474,246.53	1,222,289.41
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		0.04	0.19
8. 其他费用	6.4.6.18	164,288.91	186,639.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		241,205,986.46	95,785,507.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		241,205,986.46	95,785,507.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		241,205,986.46	95,785,507.77

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 A500 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	1,651,833,841.00	-	410,792,138.10	2,062,625,979.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,651,833,841.00	-	410,792,138.10	2,062,625,979.10
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-492,000,000.00	-	70,580,751.28	-421,419,248.72
（一）、综合收益总额	-	-	241,205,986.46	241,205,986.46

(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)	-492,000,000.00	-	-170,625,235.18	-662,625,235.18
其中: 1.基金申购款	171,000,000.00	-	58,848,291.79	229,848,291.79
2.基金赎回款	-663,000,000.00	-	-229,473,526.97	-892,473,526.97
(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	1,159,833,841.00	-	481,372,889.38	1,641,206,730.38

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	6,541,833,841.00	-	29,864,200.76	6,571,698,041.76
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,541,833,841.00	-	29,864,200.76	6,571,698,041.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,015,000,000.00	-	39,516,541.37	-2,975,483,458.63
(一)、综合收益总额	-	-	95,785,507.77	95,785,507.77
(二)、本期基金份额	-3,015,000,000.00	-	-46,082,734.05	-3,061,082,734.05

额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	996,000,000.00	-	-28,974,202.83	967,025,797.17
2.基金赎回款	-4,011,000,000.00	-	-17,108,531.22	-4,028,108,531.22
（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）	-	-	-10,186,232.35	-10,186,232.35
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,526,833,841.00	-	69,380,742.13	3,596,214,583.13

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 A500 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[2024]1522 号《关于准予博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，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 A500 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 1,999,671,799.00 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2024)验字第 70019484_A28 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,999,833,841.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 162,042.00 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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2024]979 号核准, 本基金于 2024 年 11 月 28 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 A500 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)。为更好地实现基金的投资目标, 本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、债券回购、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下, 本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)的资产比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%; 本基金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: 标的指数收益率, 即中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》, 以及中国证券投资基金业协会颁布的《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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本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

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	3,764,993.38
等于：本金	3,764,606.23
加：应计利息	387.15
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,764,993.38

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		1,298,595,629.79	-	1,627,482,103.98	328,886,474.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	176,000.00	4.88	176,004.88	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	176,000.00	4.88	176,004.88	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,298,771,629.79	4.88	1,627,658,108.86	328,886,474.19

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

无余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	50,095.25

预提费用	164,219.55
应付 IOPV 计算与发布费	29,916.99
合计	244,231.79

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	1,651,833,841.00	1,651,833,841.00
本期申购	171,000,000.00	171,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-663,000,000.00	-663,000,000.00
本期末	1,159,833,841.00	1,159,833,841.00

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

6.4.6.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	158,712,601.28	252,079,536.82	410,792,138.10
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	158,712,601.28	252,079,536.82	410,792,138.10
本期利润	256,777,369.77	-15,571,383.31	241,205,986.46
本期基金份额交易产生的变动数	-86,759,336.66	-83,865,898.52	-170,625,235.18
其中：基金申购款	32,510,043.71	26,338,248.08	58,848,291.79
基金赎回款	-119,269,380.37	-110,204,146.60	-229,473,526.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	328,730,634.39	152,642,254.99	481,372,889.38

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	5,389.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,036.24
其他	-
合计	9,425.39

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	116,825,918.78
股票投资收益——赎回差价收入	127,288,611.64
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	244,114,530.42

6.4.6.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	682,031,412.10
减：卖出股票成本总额	564,606,336.34
减：交易费用	599,156.98
买卖股票差价收入	116,825,918.78

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	892,473,526.97
减：现金支付赎回款总额	459,078,665.97
减：赎回股票成本总额	306,106,249.36
减：交易费用	-
赎回差价收入	127,288,611.64

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	4.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	4.61

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

无发生额。

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	14,813,109.34
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	14,813,109.34

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	-15,571,383.31
——股票投资	-15,571,383.31
——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	-
——权证投资	-
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	-15,571,383.31

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	-98,424.99
合计	-98,424.99

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	645.00
中登注册登记费	59,507.37
IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	164,288.91

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“博时中证 A500ETF 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	995,822,019.95	100.00%	3,637,808,607.53	100.00%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

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	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总 额的比例

招商证券	-	-	699,220.80	100.00%
------	---	---	------------	---------

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	192,650.77	100.00%	-	-
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	709,783.64	100.00%	-	-

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

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	1,422,739.52	3,666,868.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	50,498.55	155,288.36
应支付基金管理人的净管理费	1,372,240.97	3,511,580.10

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	474,246.53	1,222,289.41

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	828,748,239.00	71.45%	1,020,137,539.00	61.76%
招商证券	2,632,524.00	0.23%	2,575,911.00	0.16%

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 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	
	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	3,764,993.38	5,389.15	4,768,480.06	5,924.89

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	2,360.00	38,255.60
招商证券股份有限公司	001365	天海电子	网下发行	2,394.00	65,092.86
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

于本报告期末，本基金持有 606,563.00 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 23,355,319.35 元，估值总额为人民币 21,532,986.50 元，占基金资产净值的比例为 1.31%。（上年度末：本基金持有 882,563.00 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 34,024,194.93 元，估值总额为人民币 37,155,902.30 元，占基金资产净值的比例为 1.80%。）

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	流 通 受 限 类 型	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
300750	宁德时代	2026-04-24	6 个月	非 公 开 发 行 限 售	410.34	373.17	106,700.00	43,783,278.00	39,817,239.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	首 次 公 开 发 行	104.66	768.89	3,994.00	418,012.04	3,070,946.66	-

				行 限 售						
301666	大 普 微	2026-04-08	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	46.08	463.33	1,220.00	56,217.60	565,262.60	-
001248	华 润 新 能 源	2026-06-24	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	10.11	10.11	50,199.00	507,511.89	507,511.89	-
688820	盛 合 晶 微	2026-04-13	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	19.68	141.49	2,391.00	47,054.88	338,302.59	-
688781	视 涯 科 技	2026-03-18	9 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	22.68	42.16	6,335.00	143,677.80	267,083.60	-
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	2026-06-24	6 个 月	新 股	10.11	10.11	21,513.00	217,496.43	217,496.43	-

	新 能 源		交 易 日	未 上 市						
001399	惠 科 股 份	2026-06-16	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-
688818	电 科 蓝 天	2026-02-03	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏 明 电 子	2026-03-18	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	69.66	160.06	714.00	49,737.24	114,282.84	-
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	-
688712	北 芯 生 命	2026-01-28	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒 运	2026-01-20	6 个	首 次	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-

	昌		月	公 开 发 行 限 售						
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 售	17.70	84.32	330.00	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-

				售						
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	285.00	15,179.10	16,740.90	-
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	首次公开发行限售	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	首次公开	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-

				发 行 限 售						
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	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-
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	首	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-

	思维		个月	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	-
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	-
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	至信股份	2026-01-08	6个月	首次公开发 行限售	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	首次公开发 行	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-

				限售						
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	-
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	-

6.4.11.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单位： 张)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
111025	圣 泉 转 债	2026-06-25	18 个 交 易 日	新 债 未 上 市	100.00	100.00	980.00	98,000.00	98,001.29	-
113704	春 风 转	2026-06-10	18 个 交	新 债 未	100.00	100.00	780.00	78,000.00	78,003.59	-

	债		易	上						
			日	市						

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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	9,824.00	2,621,729.25	8,173,568.00	-

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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证 A500 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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	176,004.88	-
未评级	-	-
合计	176,004.88	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 流动性风险

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

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基

金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

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

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

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------	-------	-------	-------	-----	----

日					
资产					
货币资金	3,764,993.38	-	-	-	3,764,993.38
结算备付金	13,462,895.99	-	-	-	13,462,895.99
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	176,004.88	1,627,482,103.98	1,627,658,108.86
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	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	17,227,889.37	-	176,004.88	1,627,542,596.61	1,644,946,490.86
负债					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3,232,081.47	3,232,081.47
应付管理人报酬	-	-	-	197,585.18	197,585.18
应付托管费	-	-	-	65,861.73	65,861.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.31	0.31
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	244,231.79	244,231.79
负债总计	-	-	-	3,739,760.48	3,739,760.48
利率敏感度缺 口	17,227,889.37	-	176,004.88	1,623,802,836.13	1,641,206,730.38
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	5,564,130.34	-	-	-	5,564,130.34
结算备付金	13,460,311.91	-	-	-	13,460,311.91
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	2,047,032,044.55	2,047,032,044.55
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	19,024,442.25	-	-	2,047,032,044.55	2,066,056,486.80
负债					
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,855,494.14	2,855,494.14
应付管理人报酬	-	-	-	266,524.17	266,524.17
应付托管费	-	-	-	88,841.39	88,841.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	219,648.00	219,648.00
负债总计	-	-	-	3,430,507.70	3,430,507.70
利率敏感度缺口	19,024,442.25	-	-	2,043,601,536.85	2,062,625,979.10

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。

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		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比例（%）

		例 (%)		
交易性金融资产—股票投资	1,627,482,103.98	99.16	2,047,032,044.55	99.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	176,004.88	0.01	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,627,658,108.86	99.17	2,047,032,044.55	99.24

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 9,011	增加约 12,769
	业绩比较基准下降 5%	减少约 9,011	减少约 12,769

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	1,573,269,365.39
第二层次	9,074,581.20
第三层次	45,314,162.27
合计	1,627,658,108.86

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	1,627,482,103.98	98.94
	其中：股票	1,627,482,103.98	98.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	176,004.88	0.01

	其中：债券	176,004.88	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,227,889.37	1.05
8	其他各项资产	60,492.63	0.00
9	合计	1,644,946,490.86	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

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	5,119,465.00	0.31
B	采矿业	66,847,614.50	4.07
C	制造业	1,146,180,982.12	69.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,397,386.00	2.16
E	建筑业	19,789,026.00	1.21
F	批发和零售业	12,550,752.24	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	36,180,319.00	2.20
H	住宿和餐饮业	758,646.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,018,418.63	5.55
J	金融业	157,455,133.50	9.59

K	房地产业	8,098,622.00	0.49
L	租赁和商务服务业	11,748,363.60	0.72
M	科学研究和技术服务业	19,420,077.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	2,787,537.80	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	543,960.00	0.03
Q	卫生和社会工作	3,181,267.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,245,322.00	0.08
S	综合	2,933,878.00	0.18
	合计	1,621,256,770.39	98.78

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

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	0.00
C	制造业	5,459,189.99	0.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	725,008.32	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	-	-
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	6,221,931.59	0.38

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	300308	中际旭创	54,700	69,469,000.00	4.23
2	300750	宁德时代	129,620	48,825,028.20	2.97
3	300502	新易盛	68,316	41,467,812.00	2.53
4	600519	贵州茅台	30,636	36,318,671.64	2.21
5	603986	兆易创新	32,700	26,650,500.00	1.62
6	601318	中国平安	522,400	24,939,376.00	1.52
7	688256	寒武纪	15,455	24,659,225.25	1.50
8	600036	招商银行	606,563	21,532,986.50	1.31
9	601899	紫金矿业	807,700	20,305,578.00	1.24
10	002371	北方华创	21,140	18,699,598.40	1.14
11	000333	美的集团	238,313	17,999,780.89	1.10
12	002475	立讯精密	249,900	17,592,960.00	1.07
13	688008	澜起科技	56,202	17,416,999.80	1.06
14	688012	中微公司	36,875	17,275,937.50	1.05
15	688041	海光信息	45,539	16,863,091.70	1.03
16	002384	东山精密	62,800	16,475,580.00	1.00
17	600900	长江电力	599,500	15,868,765.00	0.97
18	688981	中芯国际	97,968	15,559,277.76	0.95
19	000725	京东方 A	1,781,500	15,463,420.00	0.94

20	603259	药明康德	121,200	15,090,612.00	0.92
21	600030	中信证券	478,500	13,747,305.00	0.84
22	601166	兴业银行	829,600	13,738,176.00	0.84
23	300059	东方财富	620,300	12,641,714.00	0.77
24	600183	生益科技	71,400	12,380,760.00	0.75
25	600276	恒瑞医药	218,820	11,387,392.80	0.69
26	300274	阳光电源	71,100	11,306,322.00	0.69
27	601398	工商银行	1,585,600	11,210,192.00	0.68
28	300408	三环集团	65,700	10,965,330.00	0.67
29	002594	比亚迪	133,200	10,616,040.00	0.65
30	600487	亨通光电	96,600	10,562,244.00	0.64
31	300476	胜宏科技	29,900	10,358,257.00	0.63
32	002463	沪电股份	66,000	10,084,800.00	0.61
33	601211	国泰海通	553,720	10,077,704.00	0.61
34	300394	天孚通信	32,072	9,707,552.96	0.59
35	688525	佰维存储	18,560	9,182,188.80	0.56
36	000988	华工科技	49,416	9,122,687.76	0.56
37	688498	源杰科技	4,809	9,069,774.00	0.55
38	301308	江波龙	12,300	8,656,740.00	0.53
39	600176	中国巨石	117,700	8,577,976.00	0.52
40	601288	农业银行	1,408,000	8,546,560.00	0.52
41	601328	交通银行	1,307,300	8,405,939.00	0.51
42	000651	格力电器	219,600	8,235,000.00	0.50
43	688072	拓荆科技	9,824	8,173,568.00	0.50
44	600522	中天科技	133,900	8,125,052.00	0.50
45	603019	中科曙光	71,700	7,688,391.00	0.47
46	688521	芯原股份	20,699	7,682,226.86	0.47
47	603993	洛阳钼业	427,900	7,509,645.00	0.46
48	600150	中国船舶	221,269	7,476,679.51	0.46
49	600887	伊利股份	310,000	7,427,600.00	0.45
50	300604	长川科技	21,700	7,408,814.00	0.45
51	600584	长电科技	70,100	7,258,855.00	0.44
52	000338	潍柴动力	263,400	7,177,650.00	0.44
53	000858	五粮液	95,186	7,043,764.00	0.43
54	688347	华虹宏力	20,062	6,746,850.60	0.41
55	601816	京沪高铁	1,438,700	6,517,311.00	0.40
56	600309	万华化学	92,101	6,300,629.41	0.38
57	688120	华海清科	19,466	6,271,555.88	0.38
58	002916	深南电路	13,480	6,172,492.00	0.38
59	300124	汇川技术	92,910	6,162,720.30	0.38
60	002415	海康威视	179,600	6,142,320.00	0.37
61	002281	光迅科技	23,700	6,089,478.00	0.37
62	002008	大族激光	40,400	6,064,444.00	0.37
63	600111	北方稀土	124,000	5,958,200.00	0.36

64	000100	TCL 科技	1,019,500	5,933,490.00	0.36
65	000063	中兴通讯	157,900	5,714,401.00	0.35
66	300857	协创数据	16,800	5,710,320.00	0.35
67	300136	信维通信	47,400	5,652,450.00	0.34
68	600000	浦发银行	653,000	5,622,330.00	0.34
69	600089	特变电工	247,700	5,573,250.00	0.34
70	601857	中国石油	634,800	5,510,064.00	0.34
71	002028	思源电气	30,500	5,276,500.00	0.32
72	601088	中国神华	134,600	5,254,784.00	0.32
73	300433	蓝思科技	97,500	5,231,850.00	0.32
74	600031	三一重工	290,600	5,021,568.00	0.31
75	300475	香农芯创	16,200	4,860,000.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	74,600	4,851,238.00	0.30
77	002050	三花智控	109,700	4,808,151.00	0.29
78	601601	中国太保	167,700	4,782,804.00	0.29
79	000001	平安银行	475,500	4,778,775.00	0.29
80	300223	北京君正	19,000	4,729,100.00	0.29
81	000792	盐湖股份	155,600	4,697,564.00	0.29
82	002714	牧原股份	133,900	4,685,161.00	0.29
83	600549	厦门钨业	54,500	4,643,400.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	30,100	4,590,250.00	0.28
85	002156	通富微电	59,500	4,514,265.00	0.28
86	600406	国电南瑞	196,800	4,496,880.00	0.27
87	601668	中国建筑	1,012,400	4,393,816.00	0.27
88	000657	中钨高新	44,700	4,278,684.00	0.26
89	002436	兴森科技	83,300	4,244,135.00	0.26
90	601919	中远海控	307,650	4,079,439.00	0.25
91	002602	世纪华通	288,900	4,073,490.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	29,700	4,034,151.00	0.25
93	601988	中国银行	701,500	4,012,580.00	0.24
94	300054	鼎龙股份	37,400	3,963,278.00	0.24
95	600660	福耀玻璃	78,500	3,959,540.00	0.24
96	601728	中国电信	760,800	3,948,552.00	0.24
97	603501	豪威集团	41,500	3,936,275.00	0.24
98	601012	隆基绿能	297,000	3,896,640.00	0.24
99	601225	陕西煤业	190,000	3,866,500.00	0.24
100	002230	科大讯飞	94,169	3,845,861.96	0.23
101	600941	中国移动	44,300	3,815,559.00	0.23
102	600690	海尔智家	183,800	3,751,358.00	0.23
103	002352	顺丰控股	117,600	3,676,176.00	0.22
104	688777	中控技术	31,143	3,659,302.50	0.22
105	601985	中国核电	403,100	3,639,993.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	55,400	3,623,160.00	0.22
107	002709	天赐材料	69,900	3,594,957.00	0.22

108	002938	鹏鼎控股	34,100	3,593,458.00	0.22
109	300757	罗博特科	5,800	3,590,200.00	0.22
110	603799	华友钴业	74,300	3,585,718.00	0.22
111	300033	同花顺	14,760	3,557,160.00	0.22
112	000977	浪潮信息	50,400	3,528,000.00	0.21
113	600160	巨化股份	66,100	3,503,961.00	0.21
114	300442	润泽科技	40,200	3,339,414.00	0.20
115	002851	麦格米特	19,900	3,326,882.00	0.20
116	000425	徐工机械	401,800	3,250,562.00	0.20
117	000938	紫光股份	112,100	3,235,206.00	0.20
118	002202	金风科技	135,300	3,233,670.00	0.20
119	688126	沪硅产业	81,015	3,231,688.35	0.20
120	601600	中国铝业	388,400	3,192,648.00	0.19
121	600028	中国石化	714,100	3,184,886.00	0.19
122	600938	中国海油	117,300	3,184,695.00	0.19
123	300346	南大光电	33,900	3,140,835.00	0.19
124	600460	士兰微	57,100	3,121,086.00	0.19
125	002466	天齐锂业	50,723	3,110,334.36	0.19
126	002600	领益智造	179,100	3,105,594.00	0.19
127	601766	中国中车	596,100	3,099,720.00	0.19
128	600050	中国联通	766,000	3,064,000.00	0.19
129	300567	精测电子	9,600	3,048,960.00	0.19
130	300661	圣邦股份	21,220	3,044,645.60	0.19
131	002837	英维克	37,510	2,984,295.60	0.18
132	002080	中材科技	32,900	2,961,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	33,300	2,955,375.00	0.18
134	002185	华天科技	130,400	2,909,224.00	0.18
135	002138	顺络电子	39,500	2,887,450.00	0.18
136	601628	中国人寿	81,600	2,884,560.00	0.18
137	002407	多氟多	57,400	2,883,202.00	0.18
138	002179	中航光电	62,200	2,873,640.00	0.18
139	688002	睿创微纳	18,494	2,860,836.86	0.17
140	601100	恒立液压	26,300	2,828,828.00	0.17
141	000568	泸州老窖	36,100	2,798,472.00	0.17
142	601872	招商轮船	158,300	2,781,331.00	0.17
143	600879	航天电子	129,400	2,754,926.00	0.17
144	300395	菲利华	20,600	2,754,838.00	0.17
145	002241	歌尔股份	121,800	2,744,154.00	0.17
146	603288	海天味业	81,792	2,712,222.72	0.17
147	601006	大秦铁路	584,100	2,692,701.00	0.16
148	601658	邮储银行	540,300	2,663,679.00	0.16
149	000408	藏格矿业	38,400	2,661,888.00	0.16
150	300390	天华新能	28,460	2,661,294.60	0.16
151	605117	德业股份	24,888	2,642,607.84	0.16

152	688017	绿的谐波	6,274	2,621,653.64	0.16
153	688469	芯联集成	246,518	2,615,555.98	0.16
154	600905	三峡能源	700,400	2,598,484.00	0.16
155	601888	中国中免	47,900	2,572,709.00	0.16
156	600489	中金黄金	142,500	2,572,125.00	0.16
157	002625	光启技术	84,500	2,562,040.00	0.16
158	688396	华润微	26,146	2,550,542.30	0.16
159	000630	铜陵有色	394,300	2,507,748.00	0.15
160	600893	航发动力	65,300	2,503,602.00	0.15
161	600673	东阳光	73,700	2,474,846.00	0.15
162	600010	包钢股份	1,108,000	2,470,840.00	0.15
163	688271	联影医疗	24,323	2,462,217.29	0.15
164	601127	赛力斯	40,000	2,450,000.00	0.15
165	688111	金山办公	11,397	2,428,130.85	0.15
166	300058	蓝色光标	175,960	2,421,209.60	0.15
167	601689	拓普集团	42,600	2,403,492.00	0.15
168	002273	水晶光电	67,600	2,398,448.00	0.15
169	002027	分众传媒	495,400	2,397,736.00	0.15
170	300037	新宙邦	25,800	2,395,530.00	0.15
171	600118	中国卫星	29,000	2,379,450.00	0.14
172	600019	宝钢股份	427,078	2,319,033.54	0.14
173	300751	迈为股份	8,200	2,316,172.00	0.14
174	000426	兴业银锡	69,600	2,294,016.00	0.14
175	600760	中航沈飞	55,600	2,285,160.00	0.14
176	000807	云铝股份	101,900	2,256,066.00	0.14
177	601168	西部矿业	81,800	2,220,052.00	0.14
178	600362	江西铜业	50,900	2,203,970.00	0.13
179	600104	上汽集团	225,200	2,197,952.00	0.13
180	600989	宝丰能源	107,800	2,191,574.00	0.13
181	300450	先导智能	53,800	2,190,736.00	0.13
182	601727	上海电气	309,000	2,163,000.00	0.13
183	600875	东方电气	74,800	2,151,996.00	0.13
184	600988	赤峰黄金	81,600	2,147,712.00	0.13
185	688099	晶晨股份	20,820	2,142,378.00	0.13
186	002001	新和成	75,300	2,140,026.00	0.13
187	605589	圣泉集团	33,200	2,110,524.00	0.13
188	002422	科伦药业	54,400	2,095,488.00	0.13
189	600885	宏发股份	60,680	2,092,853.20	0.13
190	600667	太极实业	71,700	2,092,206.00	0.13
191	601390	中国中铁	501,700	2,092,089.00	0.13
192	002738	中矿资源	35,300	2,082,347.00	0.13
193	000538	云南白药	43,740	2,071,963.80	0.13
194	002126	银轮股份	41,500	2,066,700.00	0.13
195	000960	锡业股份	48,400	2,066,196.00	0.13

196	600547	山东黄金	88,600	2,045,774.00	0.12
197	600392	盛和资源	68,700	2,045,199.00	0.12
198	600795	国电电力	437,100	2,041,257.00	0.12
199	000831	中国稀土	36,400	2,019,836.00	0.12
200	600418	江淮汽车	77,300	1,996,659.00	0.12
201	600585	海螺水泥	117,600	1,993,320.00	0.12
202	601669	中国电建	422,200	1,984,340.00	0.12
203	002648	卫星化学	82,600	1,940,274.00	0.12
204	300316	晶盛机电	32,100	1,938,840.00	0.12
205	600141	兴发集团	41,200	1,935,164.00	0.12
206	002812	恩捷股份	28,800	1,927,008.00	0.12
207	002129	TCL 中环	158,525	1,905,470.50	0.12
208	600096	云天化	62,500	1,900,000.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	228,500	1,887,410.00	0.12
210	301358	湖南裕能	24,774	1,879,603.38	0.11
211	601179	中国西电	125,600	1,873,952.00	0.11
212	300782	卓胜微	17,000	1,862,860.00	0.11
213	601868	中国能建	685,900	1,831,353.00	0.11
214	600346	恒力石化	103,400	1,831,214.00	0.11
215	600482	中国动力	55,600	1,823,680.00	0.11
216	002195	岩山科技	277,972	1,817,936.88	0.11
217	000066	中国长城	94,900	1,807,845.00	0.11
218	002558	巨人网络	65,200	1,796,912.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	148,200	1,794,702.00	0.11
220	300418	昆仑万维	44,100	1,779,876.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	53,580	1,773,498.00	0.11
222	600066	宇通客车	65,100	1,745,331.00	0.11
223	000625	长安汽车	243,300	1,744,461.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	72,600	1,736,592.00	0.11
225	600157	永泰能源	1,069,600	1,722,056.00	0.10
226	002532	天山铝业	158,700	1,702,851.00	0.10
227	600221	海航控股	1,259,400	1,700,190.00	0.10
228	000157	中联重科	243,400	1,696,498.00	0.10
229	600895	张江高科	45,500	1,694,875.00	0.10
230	688036	传音控股	28,321	1,669,522.95	0.10
231	600711	盛屯矿业	151,400	1,660,858.00	0.10
232	002340	格林美	250,100	1,653,161.00	0.10
233	300803	指南针	18,000	1,650,060.00	0.10
234	605499	东鹏饮料	13,330	1,645,321.90	0.10
235	000933	神火股份	77,200	1,636,640.00	0.10
236	600011	华能国际	215,600	1,636,404.00	0.10
237	600048	保利发展	352,200	1,630,686.00	0.10
238	600143	金发科技	104,800	1,619,160.00	0.10
239	600436	片仔癀	14,800	1,617,344.00	0.10

240	600438	通威股份	132,400	1,603,364.00	0.10
241	300017	网宿科技	122,300	1,591,123.00	0.10
242	600115	中国东航	417,000	1,588,770.00	0.10
243	002821	凯莱英	9,800	1,587,600.00	0.10
244	002236	大华股份	96,060	1,584,029.40	0.10
245	002493	荣盛石化	146,800	1,578,100.00	0.10
246	002131	利欧股份	331,800	1,576,050.00	0.10
247	600570	恒生电子	74,200	1,572,298.00	0.10
248	600886	国投电力	117,700	1,566,587.00	0.10
249	002456	欧菲光	164,500	1,556,170.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	127,500	1,544,025.00	0.09
251	688047	龙芯中科	9,830	1,520,406.10	0.09
252	603659	璞泰来	52,400	1,515,932.00	0.09
253	601233	桐昆股份	69,900	1,513,335.00	0.09
254	003816	中国广核	385,600	1,507,696.00	0.09
255	300339	润和软件	39,000	1,501,890.00	0.09
256	601360	三六零	171,600	1,491,204.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	129,000	1,487,370.00	0.09
258	000301	东方盛虹	129,600	1,483,920.00	0.09
259	688213	思特威	13,819	1,479,600.33	0.09
260	300759	康龙化成	50,700	1,466,751.00	0.09
261	600026	中远海能	81,700	1,465,698.00	0.09
262	002074	国轩高科	53,100	1,460,781.00	0.09
263	688578	艾力斯	13,241	1,445,917.20	0.09
264	300438	鹏辉能源	17,300	1,433,305.00	0.09
265	002555	三七互娱	75,900	1,432,233.00	0.09
266	688235	百济神州	5,581	1,420,978.41	0.09
267	600009	上海机场	61,000	1,409,100.00	0.09
268	688122	西部超导	22,367	1,404,871.27	0.09
269	600196	复星医药	62,200	1,397,634.00	0.09
270	000768	中航西飞	68,100	1,394,688.00	0.08
271	000975	山金国际	81,500	1,385,500.00	0.08
272	002472	双环传动	33,300	1,382,283.00	0.08
273	601111	中国国航	228,400	1,381,820.00	0.08
274	300207	欣旺达	72,400	1,374,876.00	0.08
275	300001	特锐德	36,200	1,369,446.00	0.08
276	600029	南方航空	264,300	1,369,074.00	0.08
277	600415	小商品城	134,400	1,365,504.00	0.08
278	002517	恺英网络	83,800	1,361,750.00	0.08
279	600674	川投能源	95,700	1,356,069.00	0.08
280	603129	春风动力	5,300	1,355,740.00	0.08
281	002601	龙佰集团	81,800	1,348,064.00	0.08
282	600219	南山铝业	337,600	1,347,024.00	0.08
283	300458	全志科技	34,100	1,345,586.00	0.08

284	601186	中国铁建	225,400	1,341,130.00	0.08
285	002128	电投能源	57,900	1,338,648.00	0.08
286	002595	豪迈科技	28,380	1,322,508.00	0.08
287	600233	圆通速递	83,900	1,321,425.00	0.08
288	601877	正泰电器	52,700	1,321,189.00	0.08
289	601117	中国化学	179,600	1,320,060.00	0.08
290	300115	长盈精密	46,500	1,299,210.00	0.08
291	301236	软通动力	30,400	1,290,480.00	0.08
292	600372	中航机载	118,500	1,285,725.00	0.08
293	002155	湖南黄金	53,650	1,280,625.50	0.08
294	600839	四川长虹	181,100	1,264,078.00	0.08
295	002465	海格通信	97,200	1,241,244.00	0.08
296	300568	星源材质	65,910	1,233,835.20	0.08
297	300454	深信服	12,700	1,221,740.00	0.07
298	300347	泰格医药	25,300	1,214,400.00	0.07
299	000963	华东医药	43,000	1,209,160.00	0.07
300	000547	航天发展	62,600	1,198,790.00	0.07
301	600741	华域汽车	77,200	1,198,144.00	0.07
302	002920	德赛西威	14,700	1,198,050.00	0.07
303	688506	百利天恒	4,038	1,187,293.14	0.07
304	300024	机器人	61,400	1,186,862.00	0.07
305	603650	彤程新材	12,100	1,185,558.00	0.07
306	002130	沃尔核材	61,700	1,169,832.00	0.07
307	002497	雅化集团	56,500	1,150,905.00	0.07
308	688676	金盘科技	13,548	1,146,702.72	0.07
309	300012	华测检测	82,500	1,143,450.00	0.07
310	001979	招商蛇口	176,600	1,135,538.00	0.07
311	000878	云南铜业	71,300	1,132,244.00	0.07
312	002432	九安医疗	16,000	1,130,880.00	0.07
313	688331	荣昌生物	8,672	1,129,614.72	0.07
314	300496	中科创达	18,200	1,124,578.00	0.07
315	002271	东方雨虹	93,700	1,112,219.00	0.07
316	300083	创世纪	81,600	1,111,392.00	0.07
317	002414	高德红外	83,700	1,109,862.00	0.07
318	000034	神州数码	39,860	1,106,115.00	0.07
319	300866	安克创新	10,500	1,097,250.00	0.07
320	002444	巨星科技	35,100	1,091,610.00	0.07
321	601021	春秋航空	23,900	1,089,362.00	0.07
322	300474	景嘉微	18,000	1,088,640.00	0.07
323	603979	金诚信	18,400	1,086,152.00	0.07
324	000733	振华科技	19,100	1,081,824.00	0.07
325	000661	长春高新	16,000	1,065,600.00	0.06
326	601319	中国人保	156,500	1,057,940.00	0.06
327	300763	锦浪科技	11,700	1,057,095.00	0.06

328	688266	泽璟制药	9,030	1,053,439.80	0.06
329	002756	永兴材料	18,500	1,047,840.00	0.06
330	600699	均胜电子	47,900	1,035,119.00	0.06
331	300748	金力永磁	33,500	1,033,475.00	0.06
332	002078	太阳纸业	82,200	1,026,678.00	0.06
333	601615	明阳智能	88,700	1,026,259.00	0.06
334	300073	当升科技	21,300	1,023,252.00	0.06
335	002025	航天电器	13,400	1,021,348.00	0.06
336	300142	沃森生物	78,400	1,018,416.00	0.06
337	601677	明泰铝业	60,900	1,010,940.00	0.06
338	300432	富临精工	50,300	1,010,527.00	0.06
339	300919	中伟新材	23,000	1,006,250.00	0.06
340	603606	东方电缆	24,180	1,003,711.80	0.06
341	000423	东阿阿胶	22,100	1,002,456.00	0.06
342	600039	四川路桥	127,900	1,000,178.00	0.06
343	603087	甘李药业	17,600	998,976.00	0.06
344	601800	中国交建	174,300	995,253.00	0.06
345	002252	上海莱士	226,100	981,274.00	0.06
346	600226	亨通股份	102,000	978,180.00	0.06
347	688599	天合光能	68,746	970,693.52	0.06
348	300724	捷佳伟创	13,700	967,220.00	0.06
349	688169	石头科技	10,182	966,984.54	0.06
350	688608	恒玄科技	5,742	960,004.98	0.06
351	688223	晶科能源	201,341	956,369.75	0.06
352	002064	华峰化学	97,200	922,428.00	0.06
353	601633	长城汽车	61,100	921,999.00	0.06
354	600588	用友网络	100,400	921,672.00	0.06
355	688390	固德威	8,439	915,715.89	0.06
356	001965	招商公路	99,900	915,084.00	0.06
357	000786	北新建材	50,100	906,309.00	0.06
358	002831	裕同科技	25,200	896,112.00	0.05
359	688180	君实生物	26,410	893,186.20	0.05
360	300677	英科医疗	22,400	877,408.00	0.05
361	002294	信立泰	27,200	867,408.00	0.05
362	000519	中兵红箭	41,000	863,870.00	0.05
363	603806	福斯特	51,200	859,648.00	0.05
364	688188	柏楚电子	8,050	858,935.00	0.05
365	601618	中国中冶	349,800	853,512.00	0.05
366	600177	雅戈尔	113,200	852,396.00	0.05
367	600516	方大炭素	137,800	850,226.00	0.05
368	688065	凯赛生物	17,748	849,241.80	0.05
369	601607	上海医药	54,700	842,380.00	0.05
370	302132	中航成飞	14,400	839,808.00	0.05
371	603260	合盛硅业	17,400	839,724.00	0.05

372	002176	江特电机	83,700	837,837.00	0.05
373	300972	万辰集团	4,800	832,368.00	0.05
374	000623	吉林敖东	46,900	831,537.00	0.05
375	300699	光威复材	28,500	816,525.00	0.05
376	000617	中油资本	123,900	816,501.00	0.05
377	002085	万丰奥威	72,800	807,352.00	0.05
378	300558	贝达药业	12,400	806,868.00	0.05
379	300832	新产业	19,200	806,400.00	0.05
380	002318	久立特材	33,500	800,650.00	0.05
381	300251	光线传媒	71,900	797,371.00	0.05
382	002459	晶澳科技	97,360	788,616.00	0.05
383	300342	天银机电	16,700	784,900.00	0.05
384	002065	东华软件	109,900	784,686.00	0.05
385	600499	科达制造	56,500	779,700.00	0.05
386	002266	浙富控股	153,600	777,216.00	0.05
387	600085	同仁堂	33,600	776,496.00	0.05
388	688472	阿特斯	71,525	773,900.50	0.05
389	002044	美年健康	153,500	772,105.00	0.05
390	605090	九丰能源	20,700	769,419.00	0.05
391	600515	海南机场	280,100	767,474.00	0.05
392	300409	道氏技术	38,400	765,312.00	0.05
393	603596	伯特利	30,764	764,177.76	0.05
394	000400	许继电气	35,000	759,500.00	0.05
395	002223	鱼跃医疗	29,400	754,404.00	0.05
396	688005	容百科技	24,629	753,647.40	0.05
397	688617	惠泰医疗	4,150	753,474.00	0.05
398	002405	四维图新	116,200	751,814.00	0.05
399	301550	斯菱智驱	8,200	749,726.00	0.05
400	300003	乐普医疗	63,200	748,920.00	0.05
401	000032	深桑达 A	29,800	743,510.00	0.05
402	600521	华海药业	51,400	740,160.00	0.05
403	000415	渤海租赁	181,700	739,519.00	0.05
404	600862	中航高科	41,000	739,230.00	0.05
405	601216	君正集团	165,500	738,130.00	0.04
406	000683	博源化工	127,600	734,976.00	0.04
407	000999	华润三九	32,600	733,174.00	0.04
408	000039	中集集团	90,400	733,144.00	0.04
409	603766	隆鑫通用	60,300	719,379.00	0.04
410	600803	新奥股份	45,500	718,900.00	0.04
411	600704	物产中大	152,200	718,384.00	0.04
412	600312	平高电气	39,900	704,634.00	0.04
413	603605	珀莱雅	11,700	701,064.00	0.04
414	600018	上港集团	148,300	699,976.00	0.04
415	000967	盈峰环境	65,800	692,874.00	0.04

416	000887	中鼎股份	38,700	692,343.00	0.04
417	600765	中航重机	53,400	689,928.00	0.04
418	600332	白云山	34,400	689,376.00	0.04
419	688116	天奈科技	18,043	689,242.60	0.04
420	300122	智飞生物	58,500	683,865.00	0.04
421	600166	福田汽车	232,600	676,866.00	0.04
422	600153	建发股份	85,200	675,636.00	0.04
423	000830	鲁西化工	56,000	672,000.00	0.04
424	002410	广联达	80,900	660,144.00	0.04
425	600323	瀚蓝环境	23,900	656,294.00	0.04
426	002007	华兰生物	53,700	654,603.00	0.04
427	300896	爱美客	7,400	645,280.00	0.04
428	601799	星宇股份	7,000	634,340.00	0.04
429	688114	华大智造	12,194	622,869.52	0.04
430	603568	伟明环保	40,260	619,198.80	0.04
431	600398	海澜之家	117,700	615,571.00	0.04
432	002603	以岭药业	40,900	613,500.00	0.04
433	688009	中国通号	126,778	603,463.28	0.04
434	600486	扬农化工	11,900	603,330.00	0.04
435	601000	唐山港	145,300	602,995.00	0.04
436	601018	宁波港	190,900	601,335.00	0.04
437	002389	航天彩虹	33,800	600,626.00	0.04
438	600529	山东药玻	32,500	599,625.00	0.04
439	600208	衢州发展	208,800	590,904.00	0.04
440	000738	航发控制	32,200	588,938.00	0.04
441	600008	首创环保	215,800	586,976.00	0.04
442	600316	洪都航空	21,000	586,740.00	0.04
443	000932	华菱钢铁	168,000	582,960.00	0.04
444	600998	九州通	123,600	579,684.00	0.04
445	600170	上海建工	261,000	579,420.00	0.04
446	603486	科沃斯	11,400	578,550.00	0.04
447	600820	隧道股份	107,900	562,159.00	0.03
448	600161	天坛生物	48,380	560,240.40	0.03
449	300118	东方日升	44,700	556,515.00	0.03
450	603885	吉祥航空	53,600	551,544.00	0.03
451	601238	广汽集团	108,400	550,672.00	0.03
452	688303	大全能源	31,500	549,045.00	0.03
453	002607	中公教育	302,200	543,960.00	0.03
454	603816	顾家家居	24,100	538,876.00	0.03
455	603939	益丰药房	29,688	533,790.24	0.03
456	688166	博瑞医药	14,988	524,729.88	0.03
457	600763	通策医疗	15,400	521,752.00	0.03
458	601567	三星电气	34,400	513,936.00	0.03
459	600038	中直股份	20,000	505,800.00	0.03

460	300049	福瑞医科	13,000	505,440.00	0.03
461	300676	华大基因	14,400	504,864.00	0.03
462	603392	万泰生物	18,600	501,642.00	0.03
463	300573	兴齐眼药	12,234	498,657.84	0.03
464	601880	辽港股份	360,700	497,766.00	0.03
465	600535	天士力	36,600	484,218.00	0.03
466	600511	国药股份	18,500	481,740.00	0.03
467	600816	建元信托	193,100	471,164.00	0.03
468	300100	双林股份	16,900	469,482.00	0.03
469	002244	滨江集团	61,000	463,600.00	0.03
470	000833	粤桂股份	19,600	459,032.00	0.03
471	601155	新城控股	44,300	454,518.00	0.03
472	002120	韵达股份	70,900	450,924.00	0.03
473	300144	宋城演艺	77,100	447,951.00	0.03
474	688063	派能科技	8,334	443,952.18	0.03
475	000998	隆平高科	57,600	434,304.00	0.03
476	002544	普天科技	23,300	424,526.00	0.03
477	600064	南京高科	59,300	422,809.00	0.03
478	601866	中远海发	190,800	421,668.00	0.03
479	600635	大众公用	95,000	406,600.00	0.02
480	300457	赢合科技	19,000	400,520.00	0.02
481	600754	锦江酒店	22,200	399,378.00	0.02
482	000035	中国天楹	81,800	395,094.00	0.02
483	600655	豫园股份	95,300	391,683.00	0.02
484	300601	康泰生物	32,800	371,952.00	0.02
485	603899	晨光股份	18,000	371,340.00	0.02
486	600004	白云机场	50,500	366,630.00	0.02
487	600663	陆家嘴	58,100	364,868.00	0.02
488	600258	首旅酒店	32,900	359,268.00	0.02
489	600859	王府井	38,600	354,348.00	0.02
490	002091	江苏国泰	48,000	347,040.00	0.02
491	300070	碧水源	106,500	339,735.00	0.02
492	000069	华侨城 A	197,200	323,408.00	0.02
493	600864	哈投股份	61,200	317,628.00	0.02
494	301078	孩子王	43,500	294,060.00	0.02
495	002292	奥飞娱乐	43,400	284,704.00	0.02
496	603833	欧派家居	9,000	270,990.00	0.02
497	002891	中宠股份	9,500	253,840.00	0.02
498	600325	华发股份	108,200	249,942.00	0.02
499	002572	索菲亚	28,400	207,320.00	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	3,994.00	3,070,946.66	0.19
2	001248	华润新能源	71,712.00	725,008.32	0.04
3	301666	大普微	1,220.00	565,262.60	0.03
4	688820	盛合晶微	2,391.00	338,302.59	0.02
5	688781	视涯科技	6,335.00	267,083.60	0.02
6	688808	联讯仪器	163.00	258,245.79	0.02
7	001399	惠科股份	6,488.00	179,912.24	0.01
8	688818	电科蓝天	1,717.00	120,430.38	0.01
9	301682	宏明电子	714.00	114,282.84	0.01
10	688797	臻宝科技	207.00	97,014.69	0.01
11	688712	北芯生命	1,500.00	53,880.00	0.00
12	688785	恒运昌	116.00	53,725.40	0.00
13	688813	泰金新能	234.00	40,269.06	0.00
14	688635	长进光子	128.00	39,448.32	0.00
15	001257	盛龙股份	1,743.00	36,149.82	0.00
16	603459	红板科技	330.00	27,825.60	0.00
17	001365	天海电子	719.00	22,511.89	0.00
18	688811	有研复材	834.00	20,124.42	0.00
19	301696	三瑞智能	216.00	18,748.80	0.00
20	001237	惠康科技	285.00	16,740.90	0.00
21	301669	高特电子	546.00	15,506.40	0.00
22	301687	新广益	195.00	15,167.10	0.00
23	001393	维通利	387.00	15,089.13	0.00
24	301531	春光集团	290.00	14,952.40	0.00
25	301599	理奇智能	433.00	14,059.51	0.00
26	601112	振石股份	775.00	13,632.25	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	603435	嘉德利	104.00	4,857.84	0.00
33	603352	至信股份	112.00	2,858.24	0.00
34	603293	埃泰克	72.00	2,442.96	0.00
35	001312	福恩股份	134.00	2,248.52	0.00
36	603284	林平发展	46.00	1,604.02	0.00
37	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	300750	宁德时代	48,472,596.60	2.35
2	600519	贵州茅台	13,117,333.00	0.64
3	688012	中微公司	12,257,242.44	0.59
4	300308	中际旭创	8,304,972.00	0.40
5	688041	海光信息	8,131,236.83	0.39
6	688498	源杰科技	7,281,577.48	0.35
7	301308	江波龙	6,762,648.00	0.33
8	688525	佰维存储	6,205,277.07	0.30
9	300502	新易盛	5,765,682.00	0.28
10	601318	中国平安	5,365,648.00	0.26
11	601899	紫金矿业	4,940,846.00	0.24
12	688347	华虹宏力	4,680,249.85	0.23
13	002371	北方华创	4,612,360.00	0.22
14	300394	天孚通信	4,604,163.00	0.22
15	688008	澜起科技	4,488,430.54	0.22
16	002602	世纪华通	4,338,270.00	0.21
17	600036	招商银行	3,927,324.00	0.19
18	300857	协创数据	3,810,300.00	0.18
19	000657	中钨高新	3,514,594.00	0.17
20	600183	生益科技	3,385,441.00	0.16

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	300750	宁德时代	48,438,178.20	2.35
2	600519	贵州茅台	31,797,162.43	1.54
3	601318	中国平安	19,498,469.00	0.95
4	601899	紫金矿业	17,354,368.98	0.84
5	600036	招商银行	14,582,771.86	0.71
6	688012	中微公司	14,494,116.14	0.70
7	688041	海光信息	13,939,189.98	0.68
8	600900	长江电力	10,196,603.72	0.49
9	601166	兴业银行	9,476,270.25	0.46
10	688008	澜起科技	9,249,850.92	0.45
11	688256	寒武纪	8,812,792.13	0.43
12	688981	中芯国际	8,549,108.59	0.41
13	603986	兆易创新	8,454,047.14	0.41

14	600030	中信证券	8,194,206.88	0.40
15	603259	药明康德	7,722,508.00	0.37
16	600276	恒瑞医药	7,612,443.00	0.37
17	601398	工商银行	7,343,162.00	0.36
18	300502	新易盛	7,189,680.00	0.35
19	601088	中国神华	7,051,735.00	0.34
20	601288	农业银行	6,079,094.00	0.29

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	361,261,871.25
卖出股票的收入（成交）总额	682,031,412.10

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	176,004.88	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	176,004.88	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111025	圣泉转债	980	98,001.29	0.01
2	113704	春风转债	780	78,003.59	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行安徽省分行、国家外汇管理局内蒙古自治区分局、浙江金融监管局、金融监管总局的处罚，在报告编制前一年受到中国人民银行山东省分行的通报批评。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案

调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同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	-
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	60,492.63
8	其他	-
9	合计	60,492.63

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

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	300750	宁德时代	39,817,239.00	2.43	非公开发行限售

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	3,070,946.66	0.19	首次公开发行限售
2	001248	华润新能源	725,008.32	0.04	新股未上市

3	301666	大普微	565,262.60	0.03	首次公开发行限售
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.02	首次公开发行限售
5	688781	视涯科技	267,083.60	0.02	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 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		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
3,504	331,002.81	227,294,814.00	19.60%	103,790,788.00	8.95%	828,748,239.00	71.45%

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（2024 年 11 月 21 日）基金份额总额	1,999,833,841.00
本报告期期初基金份额总额	1,651,833,841.00

本报告期基金总申购份额	171,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	663,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,159,833,841.00

§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

本基金自基金合同生效日起，聘请安永华明会计师事务所（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	
招商证券	5	995,822,019.95	100.00%	192,650.77	100.00%	增加 2 个

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

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 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报、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	证券时报、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	证券时报、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	证券时报、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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-28
7	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-24
8	博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-22
9	关于博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增民生证券为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-09
10	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
11	博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
12	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-25
13	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26

		网站	
14	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
15	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-13
16	博时基金管理有限公司关于博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-30
17	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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
18	博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-22
19	博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-14
20	博时基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-12

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-01-01~2026-06-30	1,020,137,539.00	43,943,000.00	235,332,300.00	828,748,239.00	71.45%
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 A500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时中证 A500 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 A500 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 A500 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