

博时中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2021 年中期报告
2021 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：二〇二一年八月三十一日

§ 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
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	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
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等内容真实、准确和完整发表意见	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	53
§9 开放式基金份额变动	53

§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	58

§ 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	ZZ500ETF
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	68,895,098.00 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	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	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	江向阳	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国证券登记结算有限责任公司

§ 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	64,093,173.81
本期利润	64,507,256.66
加权平均基金份额本期利润	0.7728
本期加权平均净值利润率	11.10%
本期基金份额净值增长率	10.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	166,244,355.96
期末可供分配基金份额利润	2.4130
期末基金资产净值	515,744,409.03
期末基金份额净值	7.4859
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	47.57%

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

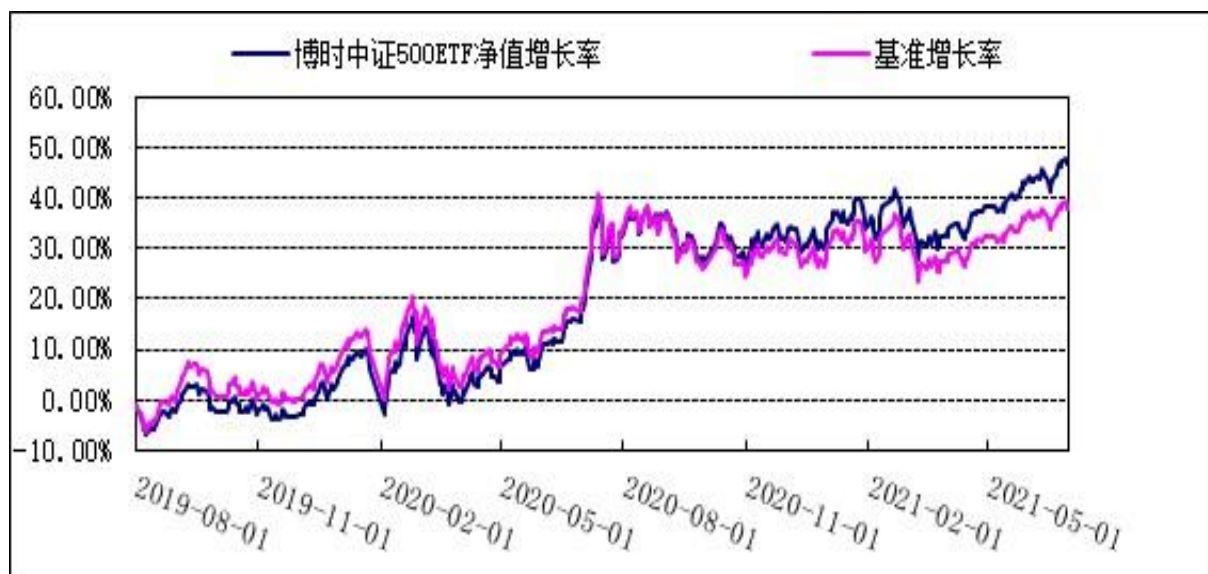
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	2.29%	0.74%	1.18%	0.73%	1.11%	0.01%
过去三个月	11.35%	0.68%	8.86%	0.68%	2.49%	0.00%
过去六个月	10.42%	0.99%	6.93%	0.99%	3.49%	0.00%
过去一年	25.66%	1.25%	16.09%	1.25%	9.57%	0.00%

自基金合同生效起至今	47.57%	1.34%	38.85%	1.36%	8.72%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

注：本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

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

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	基金经理	2019-08-01	-	14.3	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)的基金经理。现任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—至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)的基金经理。
--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 24 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

过去持续多时的“白马抱团”行情，在今年上半年逐渐出现瓦解松动，市场风格在上半年也出现了较大的波动。整体看，以创业板为代表的中小盘成长风格表现最好。创业板指上半年上涨 17.2%，中证 500 上涨 6.93%，而沪深 300 只微涨 0.24%，上证 50 则下跌 3.9%。从行业看，周期板块整体表现最好，按照中信行业分类，钢铁、基础化工涨幅超过 20%，煤炭、有色金属也有 15% 以上的涨幅。另外，处于高景气度的电力设备和新能源行业上半年涨幅也超过了 20%。

上半年虽然国内以及全球疫情出现了一定的反复，特别是印度出现了 Delta 变异毒株，但整体看不管是国内还是全球经济从疫情中逐渐复苏仍是主线。上半年国内经济延续了去年下半年以来良好的增长状态，上半年 GDP 同比增长 12.7%，相比 2019 年两年平均增长 5.3%。规模以上工业增加值同比增加 15.90%，两年平均增长 6.5%。6 月的 PMI 为 50.9，自去年 3 月以来持续保持在 50 以上。货币政策上半年保持稳健，但在 7 月央行超预期降准后，市场对流动性的预期发生了一定的变化，市场流动性整体处于较为充裕的状态。房地产市场仍然面临来自政策较大的压力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 7.4859 元，份额累计净值为 1.4757 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 10.42%，同期业绩基准增长率为 6.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计随着疫苗的逐步普及，受疫情影响中断的海外产能逐步恢复，支撑疫情后中国经济超预期增长的出口面临边际放缓，同时，上半年大宗商品等原材料价格大幅上涨对企业经营造成的压力，也将在下半年逐渐体现。但下半年流动性相比上半年会更加充裕。在流动性边际宽松，而增速边际放缓的宏观背景下，预计下半年 A 股主要延续上半年的震荡格局，部分受益国家政策未来能维持高增速的板块以及部分基本面良好的低估值板块存在结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 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

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。

本年度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

本年度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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	25,073,324.37	41,838,062.67
结算备付金		11,842,166.11	15,841,872.04
存出保证金		5,944,717.96	9,841,435.01
交易性金融资产	6.4.7.2	474,260,593.00	861,404,297.35
其中：股票投资		474,118,593.00	861,404,297.35
基金投资		-	-
债券投资		142,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,049,582.24	2,780,583.97
应收利息	6.4.7.5	7,920.93	12,598.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		520,178,304.61	931,718,850.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		3,871,663.03	2,636,986.74
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		63,960.00	106,558.16
应付托管费		21,319.98	35,519.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	178,367.32	341,073.58
应交税费		120,199.53	249,704.59

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,385.72	260,655.69
负债合计		4,433,895.58	3,630,498.14
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	349,500,053.07	694,459,336.10
未分配利润	6.4.7.10	166,244,355.96	233,629,015.76
所有者权益合计		515,744,409.03	928,088,351.86
负债和所有者权益总计		520,178,304.61	931,718,850.00

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 7.4859 元，基金份额总额 68,895,098.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		66,492,376.88	202,845,994.11
1. 利息收入		296,509.10	947,185.55
其中：存款利息收入	6.4.3.11	162,372.55	379,392.53
债券利息收入		37.49	596.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,903.52
证券出借利息收入		134,099.06	543,292.69
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		63,724,019.38	239,539,407.70
其中：股票投资收益	6.4.3.12	54,037,938.01	223,541,178.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	12,830.90	728,097.54
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	5,504,878.83	7,781,673.95
股利收益	6.4.3.15	4,168,371.64	7,488,458.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	414,082.85	-41,643,992.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	2,057,765.55	4,003,393.60
减：二、费用		1,985,120.22	6,228,513.49
1. 管理人报酬		433,229.38	996,474.49
2. 托管费		144,409.81	332,158.13
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	1,207,344.62	4,564,993.05
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		20,300.69	29,972.45
7. 其他费用	6.4.3.19	179,835.72	304,915.37

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		64,507,256.66	196,617,480.62
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		64,507,256.66	196,617,480.62

6.3 所有者权益(基金净值)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: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	694,459,336.10	233,629,015.76	928,088,351.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	64,507,256.66	64,507,256.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-344,959,283.03	-131,891,916.46	-476,851,199.49
其中: 1. 基金申购款	495,118,029.63	178,330,918.94	673,448,948.57
2. 基金赎回款	-840,077,312.66	-310,222,835.40	-1,150,300,148.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	349,500,053.07	166,244,355.96	515,744,409.03
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,877,466,759.35	72,333,952.91	1,949,800,712.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	196,617,480.62	196,617,480.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-957,769,303.31	-108,589,505.34	-1,066,358,808.65
其中: 1. 基金申购款	2,463,415,114.66	165,222,003.98	2,628,637,118.64
2. 基金赎回款	-3,421,184,417.97	-273,811,509.32	-3,694,995,927.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	919,697,456.04	160,361,928.19	1,080,059,384.23

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：江向阳，主管会计工作负责人：孙献，会计机构负责人：佘方方

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、对证券投资基金管理人运用基金买卖国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	25,073,324.37
定期存款	-
其他存款	-
合计	25,073,324.37

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	452,143,283.35	474,118,593.00	21,975,309.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	142,000.00	142,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	142,000.00	142,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	452,285,283.35	474,260,593.00	21,975,309.65

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	35,177,905.19	-	-	-
股指期货	35,177,905.19	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	35,177,905.19	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2109	中证500期货2109合约	27.00	36,001,800.00	823,894.81
减：可抵销期货暂收款				823,894.81
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,361.18
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,470.53
应收债券利息	6.22
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	83.00
合计	7,920.93

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	178,367.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	178,367.32

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	91,739.85

应付指数使用费	86,645.87
合计	178,385.72

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,895,098.00	694,459,336.10
本期申购	97,600,000.00	495,118,029.63
本期赎回（以“-”号填列）	-165,600,000.00	-840,077,312.66
本期末	68,895,098.00	349,500,053.07

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）。

6.4.3.10 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	296,074,609.17	-62,445,593.41	233,629,015.76
本期利润	64,093,173.81	414,082.85	64,507,256.66
本期基金份额交易产生的变动数	-157,146,734.23	25,254,817.77	-131,891,916.46
其中：基金申购款	239,613,232.97	-61,282,314.03	178,330,918.94
基金赎回款	-396,759,967.20	86,537,131.80	-310,222,835.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	203,021,048.75	-36,776,692.79	166,244,355.96

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	46,297.51
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	113,535.34
其他	2,539.70
合计	162,372.55

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	43,259,092.17
股票投资收益——赎回差价收入	10,778,845.84
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	54,037,938.01

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	672,409,098.78
减：卖出股票成本总额	629,150,006.61
买卖股票差价收入	43,259,092.17

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,150,300,148.06
减：现金支付赎回款总额	538,295,615.06
减：赎回股票成本总额	601,225,687.16
赎回差价收入	10,778,845.84

6.4.3.13 债券投资收益
6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	136,963.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	124,100.00
减：应收利息总额	32.16
买卖债券差价收入	12,830.90

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益
6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	5,504,878.83

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,168,371.64
其中：证券出借权益补偿收入	24,064.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,168,371.64

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
1. 交易性金融资产	859,708.04	
——股票投资	859,708.04	
——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	-445,625.19	
——权证投资	-	
——股指期货	-445,625.19	
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	414,082.85	

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
基金赎回费收入	-	
替代损益	2,057,765.55	
合计	2,057,765.55	

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
交易所市场交易费用	1,207,344.62	
银行间市场交易费用	-	
交易基金产生的费用	-	
其中：申购费	-	
赎回费	-	
合计	1,207,344.62	

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
审计费用	32,232.48	
信息披露费	59,507.37	
证券出借违约金	-	
银行汇划费	1,450.00	
指数使用费	86,645.87	
合计	179,835.72	

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 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。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司
博时中证 500ETF 联接基金	基金管理人管理的其他基金
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、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,037,653,607.27	90.38%	2,853,695,288.50	82.00%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	76,737.60	56.03%	365,715.00	8.66%
------	-----------	--------	------------	-------

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	322,116.42	79.92%	156,144.63	87.54%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,828,439.21	79.97%	758,218.36	69.34%

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	433,229.38	996,474.49
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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% 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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	144,409.81	332,158.13

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。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
招商证券	2,117,033.00	3.07%	4,910,280.00	3.59%
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	34,838,581.00	50.57%	77,189,081.00	56.39%

注：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。

6.4.6.6 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	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	25,073,324.37	46,297.51	49,684,411.05	216,759.07

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
688626	翱	2021-03-23	2021-10-08	首	28.82	104.16	2,843.00	81,935.26	296,126.88	-

	宇医疗			次公开发行限售						
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行限售	12.76	39.20	3,711.00	47,352.36	145,471.20	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-01	首次公开发行限售	24.60	163.00	610.00	15,006.00	99,430.00	-
688682	霍莱沃	2021-04-13	2021-10-20	首次公开发行限售	45.72	103.85	946.00	43,251.12	98,242.10	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	310.00	14,672.30	78,107.60	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科	2021-06-30	2021-07-09	新股	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-

	再生			未上市							
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	33.22	87.50	495.00	16,443.90	43,312.50	-	
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-	
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	327.00	9,247.56	37,837.17	-	
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-	
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-	
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	首次公开发行限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-	
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行	48.59	90.39	232.00	11,272.88	20,970.48	-	

				限售							
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-	
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	首次公开发行限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-	
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-	
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-	
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-02	首次公开发行限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-	
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	首次公开发行限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-	
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	首次公开	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-	

				发行限售						
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	首次公开发行限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	首次公开发行限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	首次公开发行限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	首次公开发行限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300952	恒辉	2021-03-03	2021-09-13	首次	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-

	安防			公开发 行限 售							
300966	共同 药业	2021-03-31	2021-10-11	首次公 开发 行限 售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-	
300945	曼卡 龙	2021-02-03	2021-08-10	首次公 开发 行限 售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-	
300948	冠中 生态	2021-02-18	2021-08-25	首次公 开发 行限 售	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-	
300931	通用 电梯	2021-01-13	2021-07-20	首次公 开发 行限 售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-	
300961	深水 海纳	2021-03-23	2021-09-30	首次公 开发 行限 售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-	
300950	德固 特	2021-02-24	2021-09-03	首次公 开发	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-	

				行 限 售							
605162	新 中 港	2021-06-29	2021-07-07	新 股 未 上 市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-	
300958	建 工 修 复	2021-03-18	2021-09-29	首 次 公 开 发 行 限 售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-	
300978	东 箭 科 技	2021-04-15	2021-10-26	首 次 公 开 发 行 限 售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-	
300926	博 俊 科 技	2020-12-29	2021-07-09	首 次 公 开 发 行 限 售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-	
300930	屹 通 新 材	2021-01-13	2021-07-20	首 次 公 开 发 行 限 售	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-	
300985	致 远 新 能	2021-04-21	2021-10-29	首 次 公 开 发 行 限 售	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-	
300971	博 亚 精	2021-04-07	2021-10-15	首 次 公 开 发 行 限 售	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-	

	工			开发 行 限 售							
300927	江 天 化 学	2020-12-29	2021-07-06	首 次 公 开 发 行 限 售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-	
300975	商 络 电 子	2021-04-14	2021-10-21	首 次 公 开 发 行 限 售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-	
300963	中 洲 特 材	2021-03-30	2021-10-11	首 次 公 开 发 行 限 售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-	
301011	华 立 科 技	2021-06-09	2021-12-17	首 次 公 开 发 行 限 售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-	
300943	春 晖 智 控	2021-02-03	2021-08-10	首 次 公 开 发 行 限 售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-	
300967	晓 鸣 股 份	2021-04-02	2021-10-13	首 次 公 开 发 行	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-	

				限售						
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	首次公开发行 限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	首次公开发行 限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行 限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	首次公开发行 限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发行 限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行 限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬	2021-06-15	2021-12-22	首	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-

	电科技			次公开发行限售						
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发行限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发行限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
113051	节能转债	2021-06-21	2021-07-22	新债未上市	100.00	100.00	1,420.00	142,000.00	142,000.00	-

6.4.8.2 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
600460	士	2021-06-30	重要公告	56.35	2021-07-01	59.49	61,400.00	1,674,215.47	3,459,890.00	-

	兰 微									
600811	东方 集团	2021-06-30	拟筹划重 大资产重 组	3.05	3000-12-31	-231,600.00	820,202.88	706,380.00	-	

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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。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。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、监察法律部、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；监察法律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。

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资

者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	142,000.00	-
未评级	-	-
合计	142,000.00	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 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，由于部分成份股流动性差，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一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,073,324.37	-	-	-	25,073,324.37
结算备付金	11,842,166.11	-	-	-	11,842,166.11
存出保证金	184,429.96	-	-	5,760,288.00	5,944,717.96
交易性金融资产	-	-	142,000.00	474,118,593.00	474,260,593.00
应收证券清算款	-	-	-	3,049,582.24	3,049,582.24
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,920.93	7,920.93
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,099,920.44	-	142,000.00	482,936,384.17	520,178,304.61
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,871,663.03	3,871,663.03

应付管理人报酬	-	-	-	63,960.00	63,960.00
应付托管费	-	-	-	21,319.98	21,319.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	120,199.53	120,199.53
应付交易费用	-	-	-	178,367.32	178,367.32
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	178,385.72	178,385.72
负债总计	-	-	-	4,433,895.58	4,433,895.58
利率敏感度缺口	37,099,920.44	-	142,000.00	478,502,488.59	515,744,409.03
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	41,838,062.67	-	-	-	41,838,062.67
结算备付金	15,841,872.04	-	-	-	15,841,872.04
存出保证金	439,329.41	-	-	9,402,105.60	9,841,435.01
交易性金融资产	-	-	-	861,404,297.35	861,404,297.35
应收证券清算款	-	-	-	2,780,583.97	2,780,583.97
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	12,598.96	12,598.96
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	58,119,264.12	-	-	873,599,585.88	931,718,850.00
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,636,986.74	2,636,986.74
应付管理人报酬	-	-	-	106,558.16	106,558.16
应付托管费	-	-	-	35,519.38	35,519.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	249,704.59	249,704.59
应付交易费用	-	-	-	341,073.58	341,073.58
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	260,655.69	260,655.69
负债总计	-	-	-	3,630,498.14	3,630,498.14
利率敏感度缺口	58,119,264.12	-	-	869,969,087.74	928,088,351.86

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。

6.4.9.4.1.2 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(不包括可转换债券、可交换债券)或资产支持证券投资,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)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	474,118,593.00	91.93	861,404,297.35	92.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	142,000.00	0.03	-	-
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	474,260,593.00	91.96	861,404,297.35	92.81

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)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.9.4.3.2 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 2,299	增加约 4,218
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 2,299	减少约 4,218	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 468,452,854.04 元，属于第二层次的余额为 5,807,738.96 元，属于第三层次的余额为 0.00 元(上年度末：第一层次 846,843,702.81 元，第二层次 14,560,594.54 元，第三层次 0.00 元)。

(ii) 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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	474,118,593.00	91.15
	其中：股票	474,118,593.00	91.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	142,000.00	0.03
	其中：债券	142,000.00	0.03
	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	36,915,490.48	7.10
8	其他各项资产	9,002,221.13	1.73

9	合计	520,178,304.61	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,636,882.28	0.90
B	采矿业	16,552,748.72	3.21
C	制造业	300,425,442.12	58.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,404,425.63	2.21
E	建筑业	8,739,568.37	1.69
F	批发和零售业	16,150,981.68	3.13
G	交通运输、仓储和邮政业	9,114,014.05	1.77
H	住宿和餐饮业	2,504,589.00	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,371,568.40	7.63
J	金融业	27,645,287.46	5.36
K	房地产业	15,408,962.76	2.99
L	租赁和商务服务业	6,241,435.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,385,933.20	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	4,051,806.83	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	300,602.80	0.06
Q	卫生和社会工作	1,285,386.30	0.25
R	文化、体育和娱乐业	4,749,765.00	0.92
S	综合	4,149,596.40	0.80
	合计	474,118,996.00	91.93

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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002709	天赐材料	44,004	4,689,946.32	0.91
2	000799	酒鬼酒	17,600	4,498,560.00	0.87
3	603486	科沃斯	17,700	4,037,016.00	0.78
4	600089	特变电工	286,300	3,678,955.00	0.71
5	000009	中国宝安	198,520	3,626,960.40	0.70
6	600460	士兰微	61,400	3,459,890.00	0.67
7	002340	格林美	368,800	3,448,280.00	0.67
8	002074	国轩高科	78,920	3,437,755.20	0.67
9	300285	国瓷材料	61,840	3,014,700.00	0.58
10	601233	桐昆股份	123,300	2,970,297.00	0.58
11	300207	欣旺达	85,100	2,770,856.00	0.54
12	002185	华天科技	168,700	2,596,293.00	0.50
13	600885	宏发股份	40,000	2,508,000.00	0.49
14	300316	晶盛机电	49,636	2,506,618.00	0.49
15	601636	旗滨集团	124,100	2,303,296.00	0.45
16	300037	新宙邦	22,400	2,242,240.00	0.43
17	600733	北汽蓝谷	165,500	2,230,940.00	0.43

18	300146	汤臣倍健	65,600	2,158,240.00	0.42
19	300253	卫宁健康	132,600	2,157,402.00	0.42
20	002648	卫星石化	53,260	2,087,259.40	0.40
21	002625	光启技术	99,800	2,076,838.00	0.40
22	002223	鱼跃医疗	54,364	2,072,899.32	0.40
23	600884	杉杉股份	87,650	2,043,998.00	0.40
24	603737	三棵树	11,460	2,016,960.00	0.39
25	600219	南山铝业	552,500	1,989,000.00	0.39
26	601127	小康股份	29,800	1,986,766.00	0.39
27	002353	杰瑞股份	44,400	1,984,680.00	0.38
28	002138	顺络电子	49,800	1,930,746.00	0.37
29	600779	水井坊	15,000	1,895,250.00	0.37
30	000547	航天发展	99,173	1,871,394.51	0.36
31	603589	口子窖	27,600	1,868,244.00	0.36
32	603444	吉比特	3,500	1,855,000.00	0.36
33	002797	第一创业	259,260	1,851,116.40	0.36
34	000988	华工科技	77,862	1,831,314.24	0.36
35	600704	物产中大	232,400	1,828,988.00	0.35
36	601168	西部矿业	152,400	1,818,132.00	0.35
37	002444	巨星科技	53,100	1,809,648.00	0.35
38	002212	天融信	91,140	1,801,837.80	0.35
39	300699	光威复材	23,600	1,792,420.00	0.35
40	603893	瑞芯微	12,800	1,785,088.00	0.35
41	601099	太平洋	525,400	1,781,106.00	0.35
42	002422	科伦药业	87,700	1,749,615.00	0.34
43	002385	大北农	255,400	1,736,720.00	0.34
44	688099	晶晨股份	15,439	1,732,255.80	0.34
45	000807	云铝股份	144,730	1,722,287.00	0.33
46	600739	辽宁成大	82,700	1,720,987.00	0.33
47	300308	中际旭创	43,900	1,691,028.00	0.33
48	688002	睿创微纳	16,776	1,674,748.08	0.32
49	000636	风华高科	55,300	1,671,166.00	0.32
50	002439	启明星辰	57,400	1,665,174.00	0.32
51	601117	中国化学	190,000	1,664,400.00	0.32
52	600862	中航高科	53,900	1,659,042.00	0.32
53	000830	鲁西化工	87,900	1,646,367.00	0.32
54	600392	盛和资源	94,700	1,643,992.00	0.32
55	600699	均胜电子	64,100	1,635,832.00	0.32
56	600563	法拉电子	10,300	1,631,108.00	0.32
57	002078	太阳纸业	121,169	1,617,606.15	0.31
58	002030	达安基因	75,636	1,606,508.64	0.31
59	002180	纳思达	49,800	1,603,560.00	0.31
60	600754	锦江酒店	28,100	1,600,295.00	0.31
61	600486	扬农化工	14,300	1,598,311.00	0.31
62	600068	葛洲坝	213,100	1,596,119.00	0.31
63	002250	联化科技	56,700	1,581,930.00	0.31
64	600315	上海家化	26,000	1,563,640.00	0.30
65	300088	长信科技	189,100	1,561,966.00	0.30
66	000630	铜陵有色	567,700	1,544,144.00	0.30
67	002507	涪陵榨菜	40,900	1,540,294.00	0.30

68	603605	珀莱雅	7,700	1,514,667.00	0.29
69	002013	中航机电	150,000	1,510,500.00	0.29
70	600201	生物股份	86,400	1,507,680.00	0.29
71	000039	中集集团	82,500	1,499,850.00	0.29
72	002075	沙钢股份	135,800	1,481,578.00	0.29
73	002127	南极电商	151,100	1,476,247.00	0.29
74	300223	北京君正	14,400	1,453,248.00	0.28
75	300001	特锐德	48,100	1,448,291.00	0.28
76	002028	思源电气	46,791	1,440,694.89	0.28
77	000513	丽珠集团	28,642	1,432,672.84	0.28
78	601997	贵阳银行	197,500	1,414,100.00	0.27
79	600177	雅戈尔	213,800	1,408,942.00	0.27
80	002511	中顺洁柔	50,700	1,396,785.00	0.27
81	601005	重庆钢铁	516,400	1,378,788.00	0.27
82	000021	深科技	72,000	1,378,080.00	0.27
83	002273	水晶光电	93,800	1,377,922.00	0.27
84	002299	圣农发展	57,400	1,370,712.00	0.27
85	600549	厦门钨业	65,700	1,368,531.00	0.27
86	002092	中泰化学	132,620	1,362,007.40	0.26
87	002080	中材科技	51,900	1,358,223.00	0.26
88	300482	万孚生物	20,795	1,345,228.55	0.26
89	002465	海格通信	142,100	1,344,266.00	0.26
90	600988	赤峰黄金	89,600	1,343,104.00	0.26
91	000050	深天马 A	94,700	1,342,846.00	0.26
92	002603	以岭药业	45,900	1,338,444.00	0.26
93	300168	万达信息	91,400	1,334,440.00	0.26
94	600171	上海贝岭	43,800	1,332,834.00	0.26
95	000739	普洛药业	45,300	1,331,820.00	0.26
96	600536	中国软件	23,200	1,320,776.00	0.26
97	300618	寒锐钴业	16,700	1,316,628.00	0.26
98	000825	太钢不锈	175,600	1,315,244.00	0.26
99	300009	安科生物	88,148	1,313,405.20	0.25
100	000983	山西焦煤	157,860	1,311,816.60	0.25
101	601128	常熟银行	211,500	1,311,300.00	0.25
102	600516	方大炭素	176,100	1,310,184.00	0.25
103	600867	通化东宝	109,700	1,309,818.00	0.25
104	300357	我武生物	20,400	1,308,048.00	0.25
105	600066	宇通客车	104,500	1,305,205.00	0.25
106	000998	隆平高科	81,300	1,304,052.00	0.25
107	600637	东方明珠	157,900	1,293,201.00	0.25
108	300244	迪安诊断	33,561	1,285,386.30	0.25
109	600316	洪都航空	33,200	1,277,536.00	0.25
110	601689	拓普集团	34,100	1,276,363.00	0.25
111	600418	江淮汽车	102,400	1,272,832.00	0.25
112	300463	迈克生物	30,000	1,262,700.00	0.24
113	600879	航天电子	167,400	1,258,848.00	0.24
114	600529	山东药玻	36,900	1,252,755.00	0.24
115	603290	斯达半导	3,900	1,248,000.00	0.24
116	600369	西南证券	256,200	1,247,694.00	0.24
117	000723	美锦能源	165,000	1,247,400.00	0.24

118	300070	碧水源	170,600	1,247,086.00	0.24
119	002152	广电运通	95,700	1,246,971.00	0.24
120	000932	华菱钢铁	188,840	1,246,344.00	0.24
121	600827	百联股份	61,800	1,245,270.00	0.24
122	600487	亨通光电	109,200	1,244,880.00	0.24
123	000750	国海证券	293,400	1,244,016.00	0.24
124	600380	健康元	90,300	1,239,819.00	0.24
125	000960	锡业股份	77,100	1,235,913.00	0.24
126	002156	通富微电	51,400	1,235,656.00	0.24
127	300271	华宇软件	63,900	1,230,075.00	0.24
128	300296	利亚德	156,700	1,225,394.00	0.24
129	688208	道通科技	14,084	1,225,167.16	0.24
130	600166	福田汽车	354,389	1,222,642.05	0.24
131	000975	银泰黄金	128,480	1,221,844.80	0.24
132	600038	中直股份	23,100	1,218,294.00	0.24
133	002131	利欧股份	520,500	1,217,970.00	0.24
134	002373	千方科技	72,848	1,216,561.60	0.24
135	601615	明阳智能	75,100	1,215,869.00	0.24
136	600909	华安证券	217,560	1,211,809.20	0.23
137	300383	光环新网	83,400	1,200,126.00	0.23
138	002572	索菲亚	49,285	1,192,697.00	0.23
139	002690	美亚光电	21,028	1,172,521.28	0.23
140	002926	华西证券	121,200	1,167,156.00	0.23
141	600642	申能股份	189,235	1,161,902.90	0.23
142	601198	东兴证券	106,100	1,159,673.00	0.22
143	601866	中远海发	305,867	1,147,001.25	0.22
144	002065	东华软件	144,100	1,142,713.00	0.22
145	300115	长盈精密	55,188	1,136,872.80	0.22
146	002294	信立泰	34,520	1,135,708.00	0.22
147	601699	潞安环能	95,700	1,130,217.00	0.22
148	300474	景嘉微	11,500	1,126,080.00	0.22
149	603156	养元饮品	39,300	1,123,194.00	0.22
150	600271	航天信息	86,000	1,120,580.00	0.22
151	002500	山西证券	165,590	1,111,108.90	0.22
152	000623	吉林敖东	71,520	1,107,844.80	0.21
153	603260	合盛硅业	14,400	1,107,504.00	0.21
154	600998	九州通	72,000	1,106,640.00	0.21
155	603638	艾迪精密	25,760	1,104,331.20	0.21
156	600415	小商品城	211,800	1,090,770.00	0.21
157	600895	张江高科	59,600	1,088,892.00	0.21
158	000012	南玻A	105,600	1,081,344.00	0.21
159	600153	建发股份	132,600	1,074,060.00	0.21
160	300630	普利制药	20,372	1,067,492.80	0.21
161	600188	兖州煤业	69,000	1,059,840.00	0.21
162	600707	彩虹股份	110,600	1,040,746.00	0.20
163	600535	天士力	70,200	1,039,662.00	0.20
164	600256	广汇能源	312,200	1,039,626.00	0.20
165	600390	五矿资本	173,300	1,036,334.00	0.20
166	300418	昆仑万维	63,200	1,035,216.00	0.20
167	600667	太极实业	113,700	1,034,670.00	0.20

168	300024	机器人	96,200	1,026,454.00	0.20
169	002557	洽洽食品	23,813	1,026,340.30	0.20
170	600008	首创环保	339,274	1,021,214.74	0.20
171	600497	驰宏锌锗	236,872	1,020,918.32	0.20
172	600060	海信视像	60,400	1,020,760.00	0.20
173	002670	国盛金控	89,340	1,017,582.60	0.20
174	002372	伟星新材	49,100	1,014,897.00	0.20
175	002382	蓝帆医疗	48,500	1,011,225.00	0.20
176	000027	深圳能源	109,980	1,008,516.60	0.20
177	000878	云南铜业	78,600	1,008,438.00	0.20
178	600208	新湖中宝	331,200	1,006,848.00	0.20
179	600155	华创阳安	93,800	1,003,660.00	0.19
180	688029	南微医学	3,219	1,003,330.11	0.19
181	603858	步长制药	43,900	987,311.00	0.19
182	600372	中航电子	59,300	981,415.00	0.19
183	002019	亿帆医药	56,866	980,938.50	0.19
184	600765	中航重机	43,300	980,745.00	0.19
185	600498	烽火通信	52,500	978,075.00	0.19
186	600141	兴发集团	51,900	977,277.00	0.19
187	300251	光线传媒	90,300	976,143.00	0.19
188	002221	东华能源	88,800	972,360.00	0.19
189	000718	苏宁环球	117,200	971,588.00	0.19
190	002174	游族网络	56,302	966,705.34	0.19
191	002683	宏大爆破	34,800	966,396.00	0.19
192	600409	三友化工	95,500	965,505.00	0.19
193	600511	国药股份	29,000	958,740.00	0.19
194	601717	郑煤机	81,900	952,497.00	0.18
195	600170	上海建工	342,800	946,128.00	0.18
196	002966	苏州银行	128,500	944,475.00	0.18
197	002146	荣盛发展	167,400	944,136.00	0.18
198	600875	东方电气	86,000	943,420.00	0.18
199	002506	协鑫集成	270,800	942,384.00	0.18
200	002390	信邦制药	89,800	941,104.00	0.18
201	000401	冀东水泥	76,200	941,070.00	0.18
202	000997	新大陆	56,500	937,335.00	0.18
203	300058	蓝色光标	153,400	928,070.00	0.18
204	600801	华新水泥	52,700	925,939.00	0.18
205	000738	航发控制	44,400	924,852.00	0.18
206	002408	齐翔腾达	74,000	919,080.00	0.18
207	600160	巨化股份	103,800	917,592.00	0.18
208	002958	青农商行	213,800	915,064.00	0.18
209	000686	东北证券	108,100	913,445.00	0.18
210	603866	桃李面包	29,268	913,161.60	0.18
211	688088	虹软科技	16,339	910,899.25	0.18
212	603707	健友股份	21,800	910,150.00	0.18
213	600663	陆家嘴	68,000	905,760.00	0.18
214	300315	掌趣科技	212,800	904,400.00	0.18
215	600258	首旅酒店	37,900	904,294.00	0.18
216	002195	二三四五	441,100	895,433.00	0.17
217	002268	卫士通	45,600	888,288.00	0.17

218	000540	中天金融	323,500	883,155.00	0.17
219	300017	网宿科技	150,900	882,765.00	0.17
220	600325	华发股份	130,700	880,918.00	0.17
221	603225	新凤鸣	43,100	874,930.00	0.17
222	600732	爱旭股份	62,800	874,176.00	0.17
223	000060	中金岭南	192,700	871,004.00	0.17
224	601016	节能风电	231,600	866,184.00	0.17
225	601992	金隅集团	321,400	864,566.00	0.17
226	600859	王府井	29,900	863,512.00	0.17
227	600027	华电国际	251,000	863,440.00	0.17
228	000961	中南建设	145,800	863,136.00	0.17
229	688321	微芯生物	18,629	860,473.51	0.17
230	600567	山鹰国际	248,821	858,432.45	0.17
231	002831	裕同科技	28,840	856,259.60	0.17
232	603927	中科软	19,800	850,410.00	0.16
233	603077	和邦生物	408,140	848,931.20	0.16
234	603712	七一二	23,500	848,350.00	0.16
235	000158	常山北明	73,746	847,341.54	0.16
236	002429	兆驰股份	139,500	846,765.00	0.16
237	600282	南钢股份	237,100	844,076.00	0.16
238	002191	劲嘉股份	79,000	840,560.00	0.16
239	600528	中铁工业	103,400	837,540.00	0.16
240	600216	浙江医药	52,300	837,323.00	0.16
241	600500	中化国际	106,400	836,304.00	0.16
242	603883	老百姓	15,860	835,504.80	0.16
243	601577	长沙银行	92,900	830,526.00	0.16
244	600839	四川长虹	284,566	828,087.06	0.16
245	300212	易华录	30,720	826,675.20	0.16
246	600737	中粮糖业	82,500	825,825.00	0.16
247	000671	阳光城	158,800	825,760.00	0.16
248	603198	迎驾贡酒	18,600	823,980.00	0.16
249	002056	横店东磁	63,300	822,900.00	0.16
250	002595	豪迈科技	30,801	822,386.70	0.16
251	600598	北大荒	54,900	821,304.00	0.16
252	000898	鞍钢股份	184,500	821,025.00	0.16
253	002081	金螳螂	103,200	817,344.00	0.16
254	000581	威孚高科	39,000	812,370.00	0.16
255	000999	华润三九	30,100	805,175.00	0.16
256	000709	河钢股份	327,200	804,912.00	0.16
257	600580	卧龙电驱	60,400	803,320.00	0.16
258	600728	佳都科技	108,100	801,021.00	0.16
259	002203	海亮股份	75,200	800,128.00	0.16
260	002124	天邦股份	113,400	794,934.00	0.15
261	002281	光迅科技	32,300	794,580.00	0.15
262	300182	捷成股份	158,800	792,412.00	0.15
263	002010	传化智联	102,300	788,733.00	0.15
264	600808	马钢股份	183,755	788,308.95	0.15
265	000729	燕京啤酒	108,600	786,264.00	0.15
266	000930	中粮科技	86,600	780,266.00	0.15
267	002242	九阳股份	23,900	776,511.00	0.15

268	002396	星网锐捷	36,200	772,870.00	0.15
269	300166	东方国信	62,400	771,264.00	0.15
270	600820	隧道股份	145,500	769,695.00	0.15
271	002387	维信诺	73,600	767,648.00	0.15
272	000488	晨鸣纸业	94,300	767,602.00	0.15
273	002745	木林森	57,000	763,800.00	0.15
274	000629	攀钢钒钛	331,000	757,990.00	0.15
275	002004	华邦健康	121,906	757,036.26	0.15
276	002048	宁波华翔	38,700	754,650.00	0.15
277	002563	森马服饰	62,300	744,485.00	0.14
278	600755	厦门国贸	89,900	738,079.00	0.14
279	600970	中材国际	80,400	737,268.00	0.14
280	300002	神州泰岳	150,920	731,962.00	0.14
281	601106	中国一重	215,499	730,541.61	0.14
282	603000	人民网	42,470	730,059.30	0.14
283	600022	山东钢铁	421,600	725,152.00	0.14
284	600398	海澜之家	100,100	724,724.00	0.14
285	600803	新奥股份	43,700	721,487.00	0.14
286	600037	歌华有线	75,000	720,750.00	0.14
287	000598	兴蓉环境	137,900	718,459.00	0.14
288	600881	亚泰集团	250,305	713,369.25	0.14
289	600811	东方集团	231,600	706,380.00	0.14
290	002925	盈趣科技	18,140	705,827.40	0.14
291	002002	鸿达兴业	177,000	695,610.00	0.13
292	603885	吉祥航空	45,400	692,804.00	0.13
293	600039	四川路桥	110,400	692,208.00	0.13
294	000778	新兴铸管	185,620	690,506.40	0.13
295	601880	辽港股份	403,500	689,985.00	0.13
296	000883	湖北能源	150,200	689,418.00	0.13
297	600348	华阳股份	92,600	687,092.00	0.13
298	601456	国联证券	44,600	686,840.00	0.13
299	000690	宝新能源	134,400	686,784.00	0.13
300	600782	新钢股份	122,700	684,666.00	0.13
301	600260	凯乐科技	76,720	681,273.60	0.13
302	600597	光明乳业	47,200	680,152.00	0.13
303	000887	中鼎股份	56,300	680,104.00	0.13
304	601118	海南橡胶	132,200	672,898.00	0.13
305	002701	奥瑞金	130,663	671,607.82	0.13
306	002249	大洋电机	127,700	670,425.00	0.13
307	002867	周大生	33,850	669,214.50	0.13
308	600126	杭钢股份	130,300	668,439.00	0.13
309	600908	无锡银行	114,900	666,420.00	0.13
310	600967	内蒙一机	65,700	664,884.00	0.13
311	002705	新宝股份	25,300	664,125.00	0.13
312	002085	万丰奥威	118,300	662,480.00	0.13
313	603568	伟明环保	28,990	661,841.70	0.13
314	600645	中源协和	28,800	660,960.00	0.13
315	600410	华胜天成	84,900	658,824.00	0.13
316	600026	中远海能	106,700	657,272.00	0.13
317	002183	怡亚通	114,700	657,231.00	0.13

318	600718	东软集团	67,200	657,216.00	0.13
319	000528	柳工	79,600	652,720.00	0.13
320	601179	中国西电	157,934	650,688.08	0.13
321	603650	彤程新材	13,500	649,350.00	0.13
322	600985	淮北矿业	53,000	647,130.00	0.13
323	600572	康恩贝	143,900	638,916.00	0.12
324	002110	三钢闽光	94,400	636,256.00	0.12
325	600167	联美控股	70,900	633,137.00	0.12
326	000877	天山股份	48,502	631,981.06	0.12
327	600329	中新药业	22,400	629,216.00	0.12
328	000970	中科三环	65,800	628,390.00	0.12
329	600446	金证股份	43,400	626,696.00	0.12
330	002368	太极股份	31,218	626,233.08	0.12
331	601200	上海环境	52,100	623,637.00	0.12
332	300072	三聚环保	108,600	623,364.00	0.12
333	000402	金融街	92,000	621,000.00	0.12
334	600064	南京高科	66,800	620,572.00	0.12
335	002266	浙富控股	124,000	618,760.00	0.12
336	002128	露天煤业	59,100	615,231.00	0.12
337	000990	诚志股份	48,300	614,859.00	0.12
338	000089	深圳机场	79,000	613,830.00	0.12
339	601598	中国外运	121,400	613,070.00	0.12
340	600517	国网英大	87,900	598,599.00	0.12
341	002985	北摩高科	6,130	597,675.00	0.12
342	600158	中体产业	51,900	592,179.00	0.11
343	300026	红日药业	138,850	590,112.50	0.11
344	000400	许继电气	46,600	589,956.00	0.11
345	003035	南网能源	58,300	579,502.00	0.11
346	000519	中兵红箭	53,900	577,808.00	0.11
347	600120	浙江东方	133,947	573,293.16	0.11
348	601718	际华集团	202,900	572,178.00	0.11
349	300376	易事特	71,013	570,944.52	0.11
350	601975	招商南油	266,439	570,179.46	0.11
351	002233	塔牌集团	55,300	568,484.00	0.11
352	600195	中牧股份	47,503	568,135.88	0.11
353	000959	首钢股份	100,800	566,496.00	0.11
354	600507	方大特钢	83,298	564,760.44	0.11
355	001914	招商积余	32,700	561,786.00	0.11
356	600307	酒钢宏兴	241,500	560,280.00	0.11
357	000090	天健集团	101,000	558,530.00	0.11
358	000685	中山公用	68,400	558,144.00	0.11
359	600376	首开股份	99,500	557,200.00	0.11
360	601333	广深铁路	261,000	553,320.00	0.11
361	601000	唐山港	228,450	550,564.50	0.11
362	002505	鹏都农牧	245,500	549,920.00	0.11
363	002440	闰土股份	62,000	548,700.00	0.11
364	600435	北方导航	69,100	548,654.00	0.11
365	000559	万向钱潮	102,100	542,151.00	0.11
366	600804	鹏博士	110,400	534,336.00	0.10
367	002839	张家港行	97,600	530,944.00	0.10

368	600643	爱建集团	74,900	522,802.00	0.10
369	600673	东阳光	116,400	522,636.00	0.10
370	603228	景旺电子	19,880	520,856.00	0.10
371	300133	华策影视	87,700	519,184.00	0.10
372	600373	中文传媒	52,400	516,664.00	0.10
373	601860	紫金银行	141,000	511,830.00	0.10
374	601608	中信重工	135,250	505,835.00	0.10
375	601991	大唐发电	191,000	504,240.00	0.10
376	000758	中色股份	106,100	503,975.00	0.10
377	002155	湖南黄金	64,900	502,975.00	0.10
378	000967	盈峰环境	73,000	501,510.00	0.10
379	002038	双鹭药业	47,500	500,175.00	0.10
380	600582	天地科技	127,545	497,425.50	0.10
381	600056	中国医药	40,900	496,935.00	0.10
382	002936	郑州银行	134,930	495,193.10	0.10
383	600266	城建发展	104,120	493,528.80	0.10
384	000681	视觉中国	38,100	492,633.00	0.10
385	000563	陕国投 A	152,600	491,372.00	0.10
386	600131	国网信通	37,100	491,204.00	0.10
387	600388	龙净环保	57,534	490,189.68	0.10
388	300113	顺网科技	37,700	487,838.00	0.09
389	601098	中南传媒	55,300	487,746.00	0.09
390	600095	湘财股份	41,200	482,452.00	0.09
391	601958	金铂股份	74,400	482,112.00	0.09
392	002416	爱施德	47,800	479,434.00	0.09
393	600901	江苏租赁	92,000	478,400.00	0.09
394	600928	西安银行	102,400	477,184.00	0.09
395	600062	华润双鹤	40,000	476,400.00	0.09
396	003022	联泓新科	15,400	472,780.00	0.09
397	300741	华宝股份	9,300	471,696.00	0.09
398	300180	华峰超纤	95,000	470,250.00	0.09
399	600259	广晟有色	13,900	469,959.00	0.09
400	600959	江苏有线	154,030	469,791.50	0.09
401	600649	城投控股	97,596	464,556.96	0.09
402	600764	中国海防	16,400	464,120.00	0.09
403	600094	大名城	122,600	462,202.00	0.09
404	000415	渤海租赁	190,700	461,494.00	0.09
405	600776	东方通信	37,100	460,040.00	0.09
406	002399	海普瑞	28,700	457,191.00	0.09
407	002458	益生股份	45,800	456,626.00	0.09
408	600006	东风汽车	61,600	449,680.00	0.09
409	601611	中国核建	61,200	441,864.00	0.09
410	300257	开山股份	30,600	439,722.00	0.09
411	600556	天下秀	41,600	439,296.00	0.09
412	600546	山煤国际	61,000	437,980.00	0.08
413	600717	天津港	111,552	437,283.84	0.08
414	002317	众生药业	50,319	433,246.59	0.08
415	600633	浙数文化	60,100	431,518.00	0.08
416	000028	国药一致	11,400	431,376.00	0.08
417	600729	重庆百货	15,614	428,604.30	0.08

418	000717	韶钢松山	93,100	427,329.00	0.08
419	600648	外高桥	28,700	424,186.00	0.08
420	002434	万里扬	51,800	420,098.00	0.08
421	601928	凤凰传媒	58,700	419,118.00	0.08
422	600863	内蒙华电	179,300	417,769.00	0.08
423	000501	鄂武商 A	35,700	417,690.00	0.08
424	600021	上海电力	60,400	417,364.00	0.08
425	000078	海王生物	127,300	414,998.00	0.08
426	603355	莱克电气	6,600	410,718.00	0.08
427	601828	美凯龙	34,200	410,400.00	0.08
428	002375	亚厦股份	51,800	410,256.00	0.08
429	600968	海油发展	156,600	405,594.00	0.08
430	605358	立昂微	3,500	404,530.00	0.08
431	002424	贵州百灵	54,700	402,592.00	0.08
432	002244	滨江集团	95,900	401,821.00	0.08
433	600835	上海机电	24,700	401,375.00	0.08
434	000062	深圳华强	23,700	400,767.00	0.08
435	600623	华谊集团	43,500	383,235.00	0.07
436	000869	张裕 A	10,300	382,542.00	0.07
437	600377	宁沪高速	38,500	375,760.00	0.07
438	600566	济川药业	20,700	370,530.00	0.07
439	600339	中油工程	129,100	366,644.00	0.07
440	600312	平高电气	62,700	366,168.00	0.07
441	600787	中储股份	68,000	362,440.00	0.07
442	002468	申通快递	47,200	359,664.00	0.07
443	002583	海能达	71,000	357,840.00	0.07
444	000031	大悦城	99,200	357,120.00	0.07
445	600639	浦东金桥	26,100	356,265.00	0.07
446	000826	启迪环境	66,268	354,533.80	0.07
447	600823	世茂股份	87,100	351,884.00	0.07
448	601969	海南矿业	30,100	350,063.00	0.07
449	601778	晶科科技	64,000	349,440.00	0.07
450	600466	蓝光发展	117,200	345,740.00	0.07
451	603317	天味食品	11,518	338,974.74	0.07
452	603888	新华网	16,000	338,720.00	0.07
453	002532	天山铝业	40,200	337,278.00	0.07
454	002815	崇达技术	26,913	335,874.24	0.07
455	601298	青岛港	54,300	335,574.00	0.07
456	000156	华数传媒	42,700	329,217.00	0.06
457	603708	家家悦	18,900	328,293.00	0.06
458	000937	冀中能源	81,800	321,474.00	0.06
459	002635	安洁科技	21,900	320,397.00	0.06
460	002948	青岛银行	63,500	315,595.00	0.06
461	000813	德展健康	69,400	315,076.00	0.06
462	000553	安道麦 A	33,700	312,399.00	0.06
463	002302	西部建设	39,200	309,680.00	0.06
464	300010	豆神教育	53,800	305,046.00	0.06
465	601228	广州港	95,400	303,372.00	0.06
466	603377	东方时尚	28,120	300,602.80	0.06
467	600350	山东高速	48,200	296,430.00	0.06

468	600640	号百控股	24,300	296,217.00	0.06
469	688626	翔宇医疗	2,843	296,126.88	0.06
470	001872	招商港口	17,500	296,100.00	0.06
471	603515	欧普照明	11,500	295,205.00	0.06
472	601139	深圳燃气	44,300	290,608.00	0.06
473	000061	农产品	52,500	289,800.00	0.06
474	600871	石化油服	146,500	288,605.00	0.06
475	000046	泛海控股	119,900	275,770.00	0.05
476	002653	海思科	12,300	264,696.00	0.05
477	603786	科博达	3,500	264,250.00	0.05
478	603379	三美股份	14,060	263,062.60	0.05
479	002901	大博医疗	3,600	262,404.00	0.05
480	601568	北元集团	30,600	261,936.00	0.05
481	603056	德邦股份	23,600	259,364.00	0.05
482	002419	天虹股份	37,300	244,688.00	0.05
483	601512	中新集团	23,400	233,064.00	0.05
484	601003	柳钢股份	39,500	233,050.00	0.05
485	600657	信达地产	66,100	230,028.00	0.04
486	000537	广宇发展	42,900	224,367.00	0.04
487	601869	长飞光纤	9,200	224,112.00	0.04
488	603983	丸美股份	4,200	218,862.00	0.04
489	601801	皖新传媒	45,900	216,648.00	0.04
490	601187	厦门银行	22,700	215,196.00	0.04
491	603719	良品铺子	4,500	202,500.00	0.04
492	002946	新乳业	13,300	201,495.00	0.04
493	600917	重庆燃气	24,000	196,080.00	0.04
494	000732	泰禾集团	76,600	165,456.00	0.03
495	603868	飞科电器	3,900	164,034.00	0.03
496	600903	贵州燃气	17,600	161,920.00	0.03
497	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.03
498	002818	富森美	11,500	138,690.00	0.03
499	002423	中粮资本	14,200	128,510.00	0.02
500	600956	新天绿能	10,700	125,297.00	0.02
501	603256	宏和科技	13,500	123,390.00	0.02
502	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
503	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.02
504	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
505	601068	中铝国际	23,300	80,385.00	0.02
506	300957	贝泰妮	310	78,107.60	0.02
507	300134	大富科技	5,900	66,139.00	0.01
508	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
509	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
510	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
511	300979	华利集团	495	43,312.50	0.01
512	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
513	300973	立高食品	327	37,837.17	0.01
514	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
515	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
516	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
517	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00

518	300981	中红医疗	232	20,970.48	0.00
519	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
520	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
521	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
522	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
523	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
524	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
525	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
526	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
527	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
528	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
529	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
530	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
531	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
532	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
533	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
534	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
535	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
536	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
537	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
538	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
539	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
540	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
541	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
542	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
543	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
544	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
545	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
546	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
547	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
548	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
549	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
550	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
551	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
552	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
553	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
554	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
555	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
556	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
557	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
558	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
559	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
560	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
561	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
562	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	603345	安井食品	7,049,322.91	0.76
2	600143	金发科技	5,865,494.68	0.63
3	601799	星宇股份	5,860,597.92	0.63
4	600089	特变电工	5,857,422.88	0.63
5	603737	三棵树	5,810,966.97	0.63
6	600426	华鲁恒升	5,413,607.62	0.58
7	601233	桐昆股份	5,410,828.36	0.58
8	603816	顾家家居	4,486,218.53	0.48
9	000799	酒鬼酒	4,433,828.65	0.48
10	600885	宏发股份	4,336,472.73	0.47
11	600486	扬农化工	3,734,960.12	0.40
12	600079	人福医药	3,625,243.45	0.39
13	603882	金域医学	3,551,525.54	0.38
14	600739	辽宁成大	3,501,120.03	0.38
15	601966	玲珑轮胎	3,500,913.95	0.38
16	603589	口子窖	3,477,523.00	0.37
17	600219	南山铝业	3,449,266.70	0.37
18	600392	盛和资源	3,360,714.20	0.36
19	600754	锦江酒店	3,319,918.65	0.36
20	601168	西部矿业	3,294,446.00	0.35

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	000690	宝新能源	18,619,043.17	2.01
2	600426	华鲁恒升	12,741,260.23	1.37
3	600143	金发科技	11,590,023.10	1.25
4	603345	安井食品	11,230,161.60	1.21
5	601799	星宇股份	10,387,919.41	1.12
6	603882	金域医学	9,502,885.10	1.02
7	600089	特变电工	8,950,467.80	0.96
8	600132	重庆啤酒	8,774,802.29	0.95
9	603816	顾家家居	8,241,815.00	0.89
10	600079	人福医药	8,223,403.02	0.89
11	601966	玲珑轮胎	8,002,154.79	0.86
12	300274	阳光电源	7,957,002.02	0.86
13	601233	桐昆股份	7,759,753.16	0.84
14	603737	三棵树	7,432,232.19	0.80
15	603806	福斯特	7,105,927.04	0.77
16	689009	九号公司	7,086,897.34	0.76
17	600885	宏发股份	6,481,710.95	0.70

18	600739	辽宁成大	5,839,074.00	0.63
19	600486	扬农化工	5,701,561.80	0.61
20	603589	口子窖	5,439,044.17	0.59

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	483,278,495.88
卖出股票的收入（成交）总额	672,409,098.78

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）	142,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	142,000.00	0.03

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	113051	节能转债	1,420	142,000.00	0.03

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2109	IC2109	27.00	36,001,800.00	823,894.81	-
公允价值变动总额合计					823,894.81
股指期货投资本期收益					5,504,878.83
股指期货投资本期公允价值变动					-445,625.19

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除国轩高科(002074)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2020 年 11 月 2 日，因存在一、控股股东非经营性资金占用、二、违规使用募集资金、三未在规定期限内披露业绩预告、四、政府补助披露不及时等违规行为，深圳证券交易所对国轩高科股份有限公司处以通报批评的处分。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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规定备选股票库之外的股票。

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	5,944,717.96
2	应收证券清算款	3,049,582.24
3	应收股利	-
4	应收利息	7,920.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,002,221.13

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

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	600460	士兰微	3,459,890.00	0.67	停牌
---	--------	-----	--------------	------	----

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
3,032	22,722.66	11,531,342.00	16.74%	22,525,175.00	32.69%	34,838,581.00	50.57%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	韩国产业银行—自有资金	4,230,900.00	6.14%
2	罗志中	2,831,600.00	4.11%
3	招商证券股份有限公司	2,117,033.00	3.07%
4	博时基金—上海银行—博时基金阳光增利集合资产管理计划	1,914,300.00	2.78%
5	孙雪理	1,296,376.00	1.88%
6	方正证券股份有限公司	1,125,417.00	1.63%
7	中信证券股份有限公司	899,410.00	1.31%
8	白巍	701,000.00	1.02%
9	广发证券股份有限公司	668,107.00	0.97%
10	孙杰风	300,000.00	0.44%
-	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	34,838,581.00	50.57%

注：前十名持有人为除博时中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 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	136,895,098.00
本报告期基金总申购份额	97,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	165,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	68,895,098.00

§ 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 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》，高阳先生担任公司总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	1,037,653,607.27	90.38%	322,116.42	79.92%	-
中信建投	2	11,749,077.14	1.02%	8,591.66	2.13%	新增 1 个
中泰证券	1	25,598,710.97	2.23%	18,721.81	4.64%	-
国泰君安	1	21,889,287.04	1.91%	16,007.21	3.97%	-
中信证券	2	51,255,945.53	4.46%	37,626.32	9.34%	新增 1 个

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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	-	-	-	-	-	-
招商证券	76,737.60	56.03%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	60,225.46	43.97%	-	-	-	-

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	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新	中国证券报、基金管理人	2021-06-02

	增中金财富证券为申购、赎回代办券商的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
2	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
3	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增安信证券为申购、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	2021-05-24
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东吴证券为申购、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	2021-05-24
6	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
7	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
8	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2021-04-22
9	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	2021-04-06
10	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
11	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
12	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
13	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2021-03-31
14	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
15	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
16	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-20210310	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
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-20210220	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
18	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变	中国证券报、基金管理人	2021-02-06

	更正的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
19	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	2021-01-23
20	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-23
21	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-23
22	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2021-01-22
23	关于博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增华创证券为场内申购、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	2021-01-14

§ 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
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	1	2021-01-01~2021-06-30	77,189,081.00	3,790,000.00	46,140,500.00	34,838,581.00	50.57%

金发起式联接基金							
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

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

- 12.1.1 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
- 12.1.2 《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 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
- 12.1.6 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
二〇二一年八月三十一日