

# 博时中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2022 年中期报告  
2022 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：二〇二二年八月三十一日

## § 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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
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 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
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 .....	10
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	10
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 .....	10
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 .....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	13
6.4 报表附注 .....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64

7.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	66
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变 .....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</b>
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>71</b>
12.1 备查文件目录 .....	71
12.2 存放地点 .....	71
12.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 博时
基金主代码	159968
交易代码	159968
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 1 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	103,695,098.00 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	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
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	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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-26,398,626.81
本期利润	-63,767,134.59
加权平均基金份额本期利润	-0.6917
本期加权平均净值利润率	-9.64%
本期基金份额净值增长率	-10.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	241,017,475.55
期末可供分配基金份额利润	2.3243
期末基金资产净值	767,055,514.54
期末基金份额净值	7.3972
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	45.82%

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。

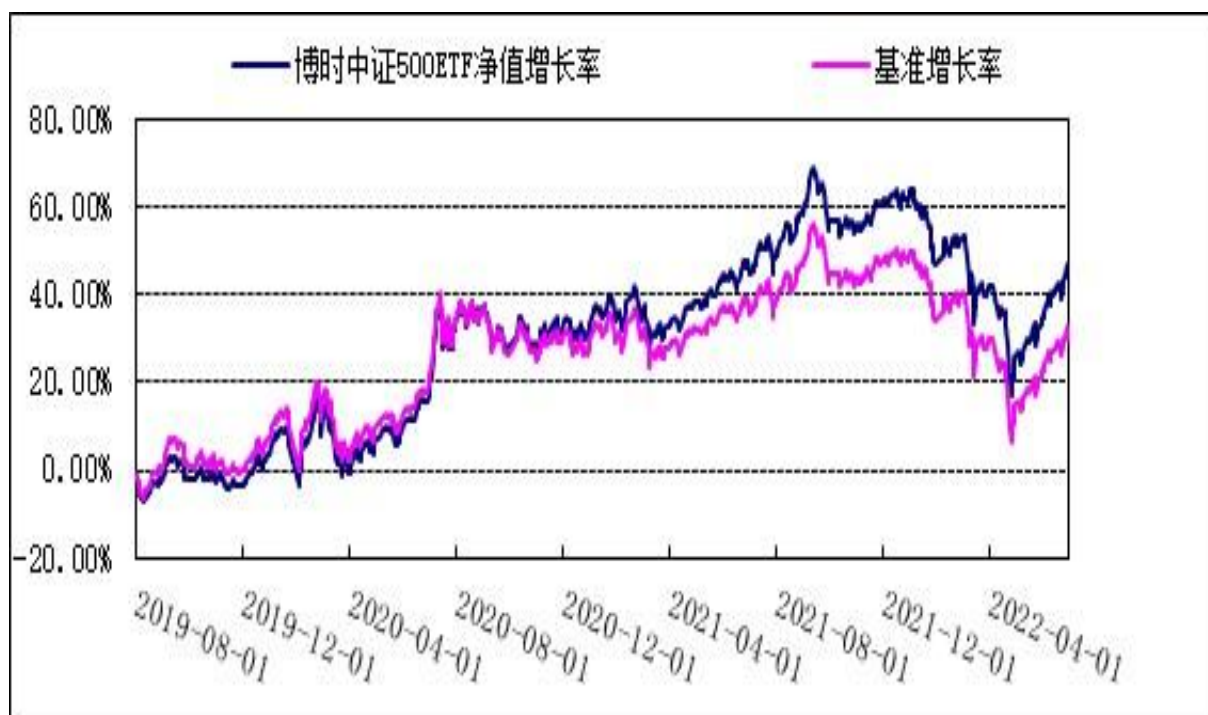
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	7.90%	1.10%	7.10%	1.10%	0.80%	0.00%
过去三个月	3.33%	1.74%	2.04%	1.75%	1.29%	-0.01%
过去六个月	-10.97%	1.62%	-12.30%	1.63%	1.33%	-0.01%
过去一年	-1.18%	1.32%	-5.20%	1.33%	4.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	45.82%	1.33%	31.63%	1.35%	14.19%	-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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的

使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2022 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 327 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 16491 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5557 亿元人民币，累计分红逾 1678 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2019-08-01	-	15.3	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)、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)、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)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼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)、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)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月21日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月28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发起式联接基金(2022年1月10日一至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022年3月3日一至今)的基金经理。
唐屹兵	基金经理助理	2021-07-05	-	7.0	唐屹兵先生,2014年6月硕士毕业后加入博时基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、投资经理助理,现任基金经理助理。

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 10 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

2022 年上半年，受俄乌冲突引发的持续高企的通胀及美联储加息节奏加快影响，海外主要市场指数全线下跌，标普 500 下跌 20.58%，纳斯达克下跌 29.51%，法国 CAC40 下跌 17.20%，德国 DAX 指数下跌 19.52%，日经 225 下跌 8.33%，香港恒生指数下跌 6.57%，英国富时 100 指数下跌 2.92%。A 股主要指数也普遍下跌，价值风格表现相对占优。汇率方面，美元兑人民币相比上年末大涨 5.04%，人民币呈现出相对贬值趋势。债券市场方面，10 年期国债收益率与上年末相比，略升 4.5 个 BP，6 月底收益率为 2.820%；美国债 10 年期收益率和上年末相比大幅上行 146 个 BP，6 月底收益率为 2.98%，全球流动性处于紧缩周期。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 7.3972 元，份额累计净值为 1.4582 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-10.97%，同期业绩基准增长率为-12.30%。

#### 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，海外经济面临衰退风险，特别是目前深受能源危机困扰的欧洲。相比之下，国内经济虽同样面临较大增长压力，但政策端的空间也很大，国内经济下半年整体处于筑底回升趋势。从流动性看，本轮美联储的加息仍未结束，海外流动性整体处于紧缩状态。在当前错综复杂的宏观环境中，国内下半年流动性整体仍然将维持宽松状态。我们对下半年 A 股市场并不悲观，预计下半年 A 股市场仍然以结构性机会为主。

#### 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

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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	26,550,987.23	14,848,608.01
结算备付金		8,417,561.74	18,020,499.36
存出保证金		5,450,714.26	5,007,924.24
交易性金融资产	6.4.4.2	728,704,936.25	585,948,720.93
其中：股票投资		728,704,936.25	585,932,720.93
基金投资		-	-
债券投资		-	16,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收清算款		4,697,340.51	3,498,320.17
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.5	-	10,687.43

资产总计		773,821,539.99	627,334,760.14
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2022年6月30日</b>	<b>2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,191,093.36	4,460,787.18
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		90,646.41	74,281.52
应付托管费		30,215.46	24,760.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.6	454,069.88	509,835.86
负债合计		6,766,025.45	5,069,665.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.4.7	526,038,038.99	379,937,636.75
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.4.8	241,017,475.55	242,327,458.32
净资产合计		767,055,514.54	622,265,095.07
<b>负债和净资产总计</b>		<b>773,821,539.99</b>	<b>627,334,760.14</b>

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 7.3972 元，基金份额总额 103,695,098.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-62,924,508.14	66,492,376.88
1. 利息收入		116,557.39	296,509.10
其中：存款利息收入	6.4.4.9	114,166.20	162,372.55
债券利息收入		-	37.49
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		2,391.19	134,099.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,235,197.82	63,724,019.38
其中：股票投资收益	6.4.4.10	-31,074,699.07	54,037,938.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.11	48,590.64	12,830.90
资产支持证券投资收益	6.4.4.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.13	-2,974,479.96	5,504,878.83
股利收益	6.4.4.14	7,765,390.57	4,168,371.64
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）	6.4.4.15	-37,368,507.78	414,082.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	562,640.07	2,057,765.55
<b>减：二、营业总支出</b>		842,626.45	1,985,120.22
1. 管理人报酬		489,145.96	433,229.38
2. 托管费		163,048.64	144,409.81
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	6.4.4.17	-	-
7. 税金及附加		8.97	20,300.69
8. 其他费用	6.4.4.18	190,422.88	1,387,180.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-63,767,134.59	64,507,256.66
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-63,767,134.59	64,507,256.66
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-63,767,134.59	64,507,256.66

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022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 （基金净值）	379,937,636.75	-	242,327,458.32	622,265,095.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	379,937,636.75	-	242,327,458.32	622,265,095.07
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	146,100,402.24	-	-1,309,982.77	144,790,419.47
（一）、综合收益总 额	-	-	-63,767,134.59	-63,767,134.59
（二）、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）	146,100,402.24	-	62,457,151.82	208,557,554.06
其中：1. 基金申购款	344,959,283.00	-	142,092,141.26	487,051,424.26
2. 基金赎回款	-198,858,880.76	-	-79,634,989.44	-278,493,870.20
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	526,038,038.99	-	241,017,475.55	767,055,514.54
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 （基金净值）	694,459,336.10	-	233,629,015.76	928,088,351.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	694,459,336.10	-	233,629,015.76	928,088,351.86

(基金净值)				
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-344,959,283.03	-	-67,384,659.80	-412,343,942.83
(一)、综合收益总额	-	-	64,507,256.66	64,507,256.66
(二)、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
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	349,500,053.07	-	166,244,355.96	515,744,409.03

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：佺方方

## 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

除下述会计政策和会计估计外，本基金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。

#### 6.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理



金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

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

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基

金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算

利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。本基金参与的转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入,将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。本基金参与的转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入,将出

借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

## 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 14,848,608.01 元、18,020,499.36 元、5,007,924.24 元、10,687.43 元和 3,498,320.17 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 14,850,112.80 元、18,029,632.85 元、5,007,972.86 元、0.00 元和 3,498,320.17 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 585,948,720.93 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 585,948,721.46 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,460,787.18 元、74,281.52 元、24,760.51 元、

207,291.60 元和 117,544.26 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,460,787.18 元、74,281.52 元、24,760.51 元、207,291.60 元和 117,544.26 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

(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。

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	26,550,987.23
等于：本金	26,548,362.40
加：应计利息	2,624.83
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	26,550,987.23

#### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	747,979,938.76	-	728,704,936.25	-19,275,002.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	747,979,938.76	-	728,704,936.25	-19,275,002.51

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.4.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	30,157,960.00	-	-	-
股指期货	30,157,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,157,960.00	-	-	-

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

##### 6.4.4.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元



代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209 CFX	IC2209	25.00	31,820,000.00	1,662,040.00
合计	-	-	-	1,662,040.00
减:可抵销期货暂收款	-	-	-	1,662,040.00
净额	-	-	-	-

注: 买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.4.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.4.6 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2022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	222,762.58
其中: 交易所市场	222,762.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,739.85
应付指数使用费	139,567.45
合计	454,069.88

#### 6.4.4.7 实收基金

金额单位: 人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	74,895,098.00	379,937,636.75
本期申购	68,000,000.00	344,959,283.00
本期赎回(以“-”号填列)	-39,200,000.00	-198,858,880.76
本期末	103,695,098.00	526,038,038.99

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)。

**6.4.4.8 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	292,216,313.85	-49,888,855.53	242,327,458.32
本期利润	-26,398,626.81	-37,368,507.78	-63,767,134.59
本期基金份额交易产生的变动数	110,695,216.11	-48,238,064.29	62,457,151.82
其中：基金申购款	258,087,223.79	-115,995,082.53	142,092,141.26
基金赎回款	-147,392,007.68	67,757,018.24	-79,634,989.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	376,512,903.15	-135,495,427.60	241,017,475.55

**6.4.4.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	34,150.78
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	79,360.68
其他	654.74
合计	114,166.20

**6.4.4.10 股票投资收益**
**6.4.4.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-15,055,575.41
股票投资收益——赎回差价收入	-16,019,123.66
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	-31,074,699.07

**6.4.4.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	274,779,028.33
减：卖出股票成本总额	289,193,289.09
减：交易费用	641,314.65
买卖股票差价收入	-15,055,575.41

**6.4.4.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	278,493,870.20
减：现金支付赎回款总额	143,575,001.20
减：赎回股票成本总额	150,937,992.66
减：交易费用	-
赎回差价收入	-16,019,123.66

**6.4.4.11 债券投资收益**
**6.4.4.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	89.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	48,501.46
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	48,590.64

**6.4.4.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	378,006.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	329,400.00
减：应计利息总额	92.67
减：交易费用	12.39
买卖债券差价收入	48,501.46

**6.4.4.12 资产支持证券投资收益**
**6.4.4.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.4.12.2 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。

**6.4.4.13 衍生工具收益**
**6.4.4.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**6.4.4.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-2,974,479.96

**6.4.4.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,765,390.57
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	7,765,390.57

**6.4.4.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-38,209,267.78
——股票投资	-38,209,267.78
——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	840,760.00
——权证投资	-
——股指期货	840,760.00
4. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-37,368,507.78

**6.4.4.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	-
替代损益	562,640.07
合计	562,640.07

#### 6.4.4.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.4.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022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	-
其他	18.88
银行汇划费	835.00
指数使用费	97,829.15
合计	190,422.88

#### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 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
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“博时中证 500ETF 联接基金”)	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。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	392,570,944.35	60.35%	1,037,653,607.27	90.38%

###### 6.4.7.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.7.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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%

###### 6.4.7.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	82,961.43	30.54%	47,968.85	21.53%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

##### 6.4.7.2 关联方报酬

###### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	489,145.96	433,229.38
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% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.7.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	163,048.64	144,409.81

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.7.4 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

##### 6.4.7.4.1 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。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.7.5.2 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	596,444.00	0.58%	2,977,572.00	3.98%
博时中证 500 交	70,651,781.00	68.13%	44,582,681.00	59.53%

易型开放式指数 证券投资基金发 起式联接基金				
------------------------------	--	--	--	--

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。

#### 6.4.7.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	26,550,987.23	34,150.78	25,073,324.37	46,297.51

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。

#### 6.4.7.7 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 2022年1月1日至2022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	002948	青岛银行	网下发行	20,490.00	65,568.00
招商证券	301123	奕东电子	网下发行	4,658.00	173,417.34
招商证券	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89
上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
-	-	-	-	-	-

#### 6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 利润分配情况

无。

#### 6.4.9 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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	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



				限类型						
688213	思特威	2022-05-13	6 个月	首次公开发 行限售	31.51	49.01	14,046.00	442,589.46	688,394.46	-
688281	华秦科技	2022-02-28	6 个月	首次公开发 行限售	135.32	246.22	2,074.00	280,649.50	510,660.28	-
688197	首药控股	2022-03-16	6 个月	首次公开发 行限售	39.90	23.20	21,662.00	864,313.80	502,558.40	-
688322	奥比中光	2022-06-30	5 个交易 日	新股未上市	30.99	30.99	8,529.00	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022-06-27	7 个交易 日	新股未上市	21.93	21.93	11,574.00	253,817.82	253,817.82	-
301175	中科环保	2022-06-30	6 个交易 日	新股未上市	3.82	3.82	57,324.00	218,977.68	218,977.68	-
688207	格灵深	2022-03-09	6 个月	首次公	39.49	26.38	8,035.00	317,302.15	211,963.30	-

	瞳			开发 行 限 售						
301139	元道通信	2022-06-30	6 个交易日	新股未上市	38.46	38.46	5,085.00	195,569.10	195,569.10	-
688237	超卓航科	2022-06-24	5 个交易日	新股未上市	41.27	41.27	2,891.00	119,311.57	119,311.57	-
688225	亚信安全	2022-01-26	6 个月	首次公开发 行 限 售	30.51	21.00	4,923.00	150,200.73	103,383.00	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6 个月	首次公开发 行 限 售	19.18	32.07	2,024.00	38,820.32	64,909.68	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8 个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418.00	58,875.36	58,875.36	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6 个月	首次公开发 行 限 售	3.80	6.39	4,743.00	18,023.40	30,307.77	-
301150	中	2022-04-14	6 个	首	109.04	82.76	318.00	34,674.72	26,317.68	-

	一科技		月	次公开发 行限售						
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	首次公开发 行限售	52.03	56.42	466.00	24,245.98	26,291.72	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	首次公开发 行限售	26.86	47.07	517.00	13,886.62	24,335.19	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月	首次公开发 行限售	3.82	3.82	6,370.00	24,333.40	24,333.40	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	首次公开发 行限售	17.27	14.83	1,588.00	27,424.76	23,550.04	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	首次公开发 行	48.59	31.38	747.00	36,294.24	23,440.86	-

				限售						
301268	铭利达	2022-03-29	6 个月	首次公开发 行限售	28.50	34.87	641.00	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	首次公开发 行限售	38.46	38.46	566.00	21,768.36	21,768.36	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6 个月	首次公开发 行限售	35.68	29.84	719.00	25,653.92	21,454.96	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6 个月	首次公开发 行限售	19.93	31.38	682.00	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	首次公开发 行限售	50.31	70.37	301.00	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传	2022-03-15	6 个月	首次公	39.88	31.09	642.00	25,602.96	19,959.78	-

	媒			开发行限售						
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	首次公开发发行限售	21.33	22.54	876.00	18,685.08	19,745.04	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	首次公开发发行限售	8.05	10.08	1,831.00	14,739.55	18,456.48	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	首次公开发发行限售	45.13	54.11	334.00	15,073.42	18,072.74	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	首次公开发发行限售	27.53	45.04	399.00	10,984.47	17,970.96	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	首次公开发发行限售	76.56	51.92	343.00	26,260.08	17,808.56	-

301153	中科江南	2022-05-10	6 个月	首次公开发 行限售	33.68	43.98	398.00	13,404.64	17,504.04	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	首次公开发 行限售	72.87	45.69	363.00	26,450.60	16,585.47	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	首次公开发 行限售	96.66	87.82	180.00	17,398.00	15,807.60	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6 个月	首次公开发 行限售	16.91	19.79	784.00	13,257.44	15,515.36	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6 个月	首次公开发 行限售	56.88	56.42	264.00	15,016.32	14,894.88	-
301160	翔楼新材	2022-05-25	6 个月	首次公开发	31.56	37.66	392.00	12,371.52	14,762.72	-

				行 限 售						
301117	佳 缘 科 技	2022-01-07	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	46.80	54.44	262.00	12,261.60	14,263.28	-
301212	联 盛 化 学	2022-04-07	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	29.67	33.28	416.00	12,342.72	13,844.48	-
301298	东 利 机 械	2022-05-27	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	12.68	20.83	634.00	8,039.12	13,206.22	-
301148	嘉 戎 技 术	2022-04-14	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	38.39	23.90	516.00	19,809.24	12,332.40	-
301258	富 士 莱	2022-03-21	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	48.30	41.68	295.00	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾 布	2022-04-18	6 个 月	首 次	18.39	24.94	483.00	8,882.37	12,046.02	-

	鲁			公开发 行限 售						
301097	天益 医疗	2022-03-25	6 个 月	首次公 开发 行限 售	52.37	47.83	249.00	13,040.13	11,909.67	-
301123	奕东 电子	2022-01-14	6 个 月	首次公 开发 行限 售	37.23	25.39	466.00	17,349.18	11,831.74	-
301220	亚香 股份	2022-06-15	6 个 月	首次公 开发 行限 售	35.98	39.15	285.00	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺 科技	2022-03-16	6 个 月	首次公 开发 行限 售	56.69	41.86	261.00	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊 华通	2022-03-14	6 个 月	首次公 开发 行限	15.37	15.99	644.00	9,898.28	10,297.56	-



301288	清研环境	2022-04-14	6 个月	售首次公开发 行限售	19.09	19.98	452.00	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月	首次公开发 行限售	22.49	27.42	327.00	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	首次公开发 行限售	26.27	32.33	277.00	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	首次公开发 行限售	22.55	37.70	237.00	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	首次公开发 行限售	31.98	26.26	338.00	10,809.24	8,875.88	-
301158	德石股份	2022-01-07	6 个月	首次公开	15.64	20.38	379.00	5,927.56	7,724.02	-

				发行限售						
301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	首次公开发 行限售	20.08	20.34	373.00	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	首次公开发 行限售	31.20	22.81	296.00	9,235.20	6,751.76	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	首次公开发 行限售	41.52	41.52	158.00	6,560.16	6,560.16	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建

议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。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、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、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。

#### 6.4.9.2 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
002670	国盛金控	2022-06-01	重大事项	9.60	2022-07-14	9.99	122,640.00	1,151,946.53	1,177,344.00	-

注：本基金截至 2022 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。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、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及绩效分析工作，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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.10.2 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。

##### 6.4.10.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.10.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.10.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.10.2.4 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	16,000.00

未评级	-	-
合计	-	16,000.00

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

#### 6.4.10.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.10.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.3.1 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。

#### 6.4.10.4 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。

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	26,550,987.23	-	-	-	26,550,987.23
结算备付金	8,417,561.74	-	-	-	8,417,561.74
存出保证金	41,314.26	-	-	5,409,400.00	5,450,714.26
交易性金融资产	-	-	-	728,704,936.25	728,704,936.25
应收证券清算款	-	-	-	4,697,340.51	4,697,340.51
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>35,009,863.23</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>738,811,676.76</b>	<b>773,821,539.99</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	6,191,093.36	6,191,093.36
应付管理人报酬	-	-	-	90,646.41	90,646.41
应付托管费	-	-	-	30,215.46	30,215.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	454,069.88	454,069.88
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,766,025.45</b>	<b>6,766,025.45</b>
<b>利率敏感度缺</b>	<b>35,009,863.23</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>732,045,651.31</b>	<b>767,055,514.54</b>

口					
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	14,848,608.01	-	-	-	14,848,608.01
结算备付金	18,020,499.36	-	-	-	18,020,499.36
存出保证金	98,426.64	-	-	4,909,497.60	5,007,924.24
交易性金融资产	-	-	16,000.00	585,932,720.93	585,948,720.93
应收证券清算款	-	-	-	3,498,320.17	3,498,320.17
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	10,687.43	10,687.43
<b>资产总计</b>	<b>32,967,534.01</b>	<b>-</b>	<b>16,000.00</b>	<b>594,351,226.13</b>	<b>627,334,760.14</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,460,787.18	4,460,787.18
应付管理人报酬	-	-	-	74,281.52	74,281.52
应付托管费	-	-	-	24,760.51	24,760.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	509,835.86	509,835.86
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,069,665.07</b>	<b>5,069,665.07</b>
<b>利率敏感度缺 口</b>	<b>32,967,534.01</b>	<b>-</b>	<b>16,000.00</b>	<b>589,281,561.06</b>	<b>622,265,095.07</b>

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

#### 6.4.10.4.1.2 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）。

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.4.3 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。

#### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	728,704,936.25	95.00	585,932,720.93	94.16
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	16,000.00	0.00
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	728,704,936.25	95.00	585,948,720.93	94.16

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

#### 6.4.10.4.3.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3,692	增加约 2,771
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,692	减少约 2,771

### 6.4.11 公允价值

#### 6.4.11.1 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。

#### 6.4.11.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.11.2.1 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 2022年6月30日
第一层次	723,633,543.65
第二层次	2,340,871.16
第三层次	2,730,521.44
合计	728,704,936.25

##### 6.4.11.2.2 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。

##### 6.4.11.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

##### 6.4.11.4 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。

#### 6.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。其中“应收利息”与“其他资产”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额；“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额；“交易费用”项目与“其他费用”项目的上年度可比期间金额合并列示在利润表“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

## § 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	728,704,936.25	94.17
	其中：股票	728,704,936.25	94.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,968,548.97	4.52
8	其他各项资产	10,148,054.77	1.31
9	合计	773,821,539.99	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,598,024.00	0.86
B	采矿业	32,070,489.86	4.18
C	制造业	434,847,338.14	56.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,293,749.20	2.91
E	建筑业	9,356,596.00	1.22
F	批发和零售业	27,972,129.60	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	19,274,104.52	2.51
H	住宿和餐饮业	1,545,040.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,046,722.72	7.05
J	金融业	63,785,772.14	8.32
K	房地产业	17,011,817.00	2.22
L	租赁和商务服务业	8,792,856.78	1.15
M	科学研究和技术服务业	9,026,031.59	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	5,509,378.80	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,678,187.10	0.22
R	文化、体育和娱乐业	9,614,747.00	1.25
S	综合	5,281,951.80	0.69

	合计	728,704,936.25	95.00
--	----	----------------	-------

### 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	600522	中天科技	299,800	6,925,380.00	0.90
2	601615	明阳智能	185,100	6,256,380.00	0.82
3	600256	广汇能源	504,800	5,320,592.00	0.69
4	300769	德方纳米	12,100	4,945,028.00	0.64
5	600096	云天化	141,300	4,448,124.00	0.58
6	300012	华测检测	182,700	4,240,467.00	0.55
7	002497	雅化集团	125,500	4,097,575.00	0.53
8	002407	多氟多	83,300	4,074,203.00	0.53
9	002240	盛新锂能	66,100	3,989,796.00	0.52
10	300390	天华超净	44,900	3,924,260.00	0.51
11	002180	纳思达	77,100	3,902,802.00	0.51
12	600157	永泰能源	2,439,700	3,879,123.00	0.51
13	600885	宏发股份	91,900	3,846,015.00	0.50
14	000009	中国宝安	281,120	3,792,308.80	0.49
15	600141	兴发集团	85,200	3,747,948.00	0.49
16	300073	当升科技	38,634	3,490,195.56	0.46
17	600392	盛和资源	153,900	3,478,140.00	0.45
18	002384	东山精密	149,000	3,416,570.00	0.45
19	603613	国联股份	38,550	3,415,530.00	0.45
20	002756	永兴材料	22,100	3,363,841.00	0.44
21	600418	江淮汽车	192,000	3,294,720.00	0.43
22	300285	国瓷材料	87,640	3,148,028.80	0.41
23	600765	中航重机	97,080	3,124,034.40	0.41
24	600563	法拉电子	15,200	3,118,432.00	0.41
25	600399	抚顺特钢	173,300	3,102,070.00	0.40
26	600233	圆通速递	150,900	3,076,851.00	0.40
27	601555	东吴证券	440,140	3,050,170.20	0.40
28	601058	赛轮轮胎	269,200	3,033,884.00	0.40
29	600487	亨通光电	207,300	3,014,142.00	0.39
30	600499	科达制造	145,200	2,996,928.00	0.39
31	000983	山西焦煤	223,060	2,986,773.40	0.39
32	300037	新宙邦	56,520	2,970,691.20	0.39
33	600732	爱旭股份	89,600	2,958,592.00	0.39
34	603077	和邦生物	678,740	2,891,432.40	0.38
35	688180	君实生物	38,199	2,877,912.66	0.38
36	688122	西部超导	30,958	2,854,327.60	0.37
37	603456	九洲药业	54,900	2,838,330.00	0.37
38	002385	大北农	360,900	2,818,629.00	0.37

39	601108	财通证券	357,400	2,812,738.00	0.37
40	688099	晶晨股份	27,540	2,781,540.00	0.36
41	300363	博腾股份	35,400	2,760,846.00	0.36
42	002268	卫士通	64,000	2,746,240.00	0.36
43	603345	安井食品	16,300	2,736,281.00	0.36
44	600486	扬农化工	20,500	2,732,240.00	0.36
45	600298	安琪酵母	54,782	2,670,622.50	0.35
46	000519	中兵红箭	91,100	2,655,565.00	0.35
47	300144	宋城演艺	170,900	2,623,315.00	0.34
48	002013	中航机电	212,300	2,621,905.00	0.34
49	000630	铜陵有色	802,300	2,615,498.00	0.34
50	600862	中航高科	91,900	2,582,390.00	0.34
51	603605	珀莱雅	15,620	2,580,111.60	0.34
52	002353	杰瑞股份	62,700	2,526,810.00	0.33
53	000988	华工科技	108,962	2,524,649.54	0.33
54	601077	渝农商行	679,600	2,514,520.00	0.33
55	000783	长江证券	421,600	2,500,088.00	0.33
56	601168	西部矿业	209,500	2,478,385.00	0.32
57	601696	中银证券	182,900	2,432,570.00	0.32
58	601162	天风证券	760,100	2,417,118.00	0.32
59	300146	汤臣倍健	111,300	2,409,645.00	0.31
60	688777	中控技术	33,072	2,406,318.72	0.31
61	002625	光启技术	139,100	2,402,257.00	0.31
62	002028	思源电气	66,591	2,374,635.06	0.31
63	300724	捷佳伟创	26,500	2,367,775.00	0.31
64	603517	绝味食品	40,700	2,353,274.00	0.31
65	002797	第一创业	366,260	2,347,726.60	0.31
66	002507	涪陵榨菜	67,700	2,337,004.00	0.30
67	600988	赤峰黄金	146,200	2,331,890.00	0.30
68	603589	口子窖	39,700	2,326,817.00	0.30
69	002056	横店东磁	86,700	2,307,954.00	0.30
70	601128	常熟银行	301,000	2,299,640.00	0.30
71	000932	华菱钢铁	451,340	2,297,320.60	0.30
72	603026	石大胜华	15,800	2,296,530.00	0.30
73	002185	华天科技	244,300	2,291,534.00	0.30
74	601636	旗滨集团	176,900	2,255,475.00	0.29
75	600521	华海药业	98,600	2,238,220.00	0.29
76	600039	四川路桥	211,300	2,224,989.00	0.29
77	002603	以岭药业	91,040	2,212,272.00	0.29
78	600109	国金证券	245,400	2,208,600.00	0.29
79	601607	上海医药	122,000	2,205,760.00	0.29
80	002326	永太科技	66,900	2,203,017.00	0.29
81	000830	鲁西化工	125,400	2,168,166.00	0.28
82	002078	太阳纸业	175,569	2,161,254.39	0.28

83	605117	德业股份	7,700	2,155,153.00	0.28
84	600153	建发股份	163,700	2,139,559.00	0.28
85	002624	完美世界	147,300	2,116,701.00	0.28
86	600546	山煤国际	108,700	2,115,302.00	0.28
87	603939	益丰药房	39,700	2,097,351.00	0.27
88	603267	鸿远电子	15,500	2,082,115.00	0.27
89	688390	固德威	6,629	2,074,943.29	0.27
90	601872	招商轮船	355,900	2,049,984.00	0.27
91	600348	华阳股份	131,900	2,039,174.00	0.27
92	600497	驰宏锌锗	391,472	2,031,739.68	0.26
93	600705	中航产融	587,100	2,031,366.00	0.26
94	002422	科伦药业	108,600	2,030,820.00	0.26
95	601990	南京证券	243,000	2,026,620.00	0.26
96	603127	昭衍新药	17,800	2,025,640.00	0.26
97	600549	厦门钨业	93,600	2,023,632.00	0.26
98	600177	雅戈尔	304,900	2,021,487.00	0.26
99	000738	航发控制	71,700	2,014,770.00	0.26
100	600875	东方电气	122,100	2,008,545.00	0.26
101	000831	五矿稀土	64,200	2,006,250.00	0.26
102	300699	光威复材	33,800	1,989,806.00	0.26
103	300088	长信科技	267,500	1,984,850.00	0.26
104	000970	中科三环	104,255	1,957,908.90	0.26
105	600160	巨化股份	148,200	1,948,830.00	0.25
106	000999	华润三九	43,100	1,939,500.00	0.25
107	600859	王府井	74,600	1,938,108.00	0.25
108	300676	华大基因	27,000	1,935,900.00	0.25
109	601699	潞安环能	131,200	1,918,144.00	0.25
110	002138	顺络电子	70,300	1,915,675.00	0.25
111	000998	隆平高科	114,900	1,914,234.00	0.25
112	002572	索菲亚	69,585	1,913,587.50	0.25
113	002673	西部证券	292,200	1,910,988.00	0.25
114	600516	方大炭素	250,700	1,905,320.00	0.25
115	600143	金发科技	197,900	1,884,008.00	0.25
116	002557	洽洽食品	33,013	1,879,430.09	0.25
117	601997	贵阳银行	321,300	1,866,753.00	0.24
118	000807	云铝股份	188,930	1,866,628.40	0.24
119	600482	中国动力	118,700	1,864,777.00	0.24
120	002508	老板电器	51,700	1,862,751.00	0.24
121	000039	中集集团	133,700	1,851,745.00	0.24
122	002030	达安基因	106,936	1,838,229.84	0.24
123	002273	水晶光电	151,400	1,833,454.00	0.24
124	000960	锡业股份	108,900	1,826,253.00	0.24
125	002465	海格通信	200,700	1,824,363.00	0.24
126	603444	吉比特	4,600	1,784,800.00	0.23

127	000629	攀钢钒钛	468,600	1,780,680.00	0.23
128	600170	上海建工	586,400	1,776,792.00	0.23
129	000728	国元证券	285,400	1,775,188.00	0.23
130	300136	信维通信	105,300	1,774,305.00	0.23
131	300357	我武生物	34,100	1,774,223.00	0.23
132	300058	蓝色光标	271,300	1,771,589.00	0.23
133	000975	银泰黄金	181,347	1,766,319.78	0.23
134	600536	中国软件	43,500	1,765,665.00	0.23
135	689009	九号公司	39,500	1,757,750.00	0.23
136	600704	物产中大	342,500	1,757,025.00	0.23
137	601577	长沙银行	220,900	1,751,737.00	0.23
138	002092	中泰化学	224,420	1,741,499.20	0.23
139	002409	雅克科技	31,000	1,720,810.00	0.22
140	600079	人福医药	107,400	1,718,400.00	0.22
141	600739	辽宁成大	117,700	1,716,066.00	0.22
142	603198	迎驾贡酒	26,300	1,713,182.00	0.22
143	600372	中航电子	88,000	1,706,320.00	0.22
144	002294	信立泰	60,620	1,703,422.00	0.22
145	300474	景嘉微	24,650	1,685,813.50	0.22
146	002223	鱼跃医疗	65,664	1,684,938.24	0.22
147	600415	小商品城	301,400	1,678,798.00	0.22
148	300244	迪安诊断	53,961	1,678,187.10	0.22
149	000547	航天发展	139,773	1,668,889.62	0.22
150	002372	伟星新材	69,400	1,668,376.00	0.22
151	300418	昆仑万维	104,200	1,667,200.00	0.22
152	000636	风华高科	88,300	1,659,157.00	0.22
153	002506	协鑫集成	446,000	1,659,120.00	0.22
154	002739	万达电影	121,500	1,658,475.00	0.22
155	600699	均胜电子	105,000	1,649,550.00	0.22
156	300558	贝达药业	27,100	1,647,680.00	0.21
157	300253	卫宁健康	186,500	1,637,470.00	0.21
158	300308	中际旭创	52,200	1,620,810.00	0.21
159	300296	利亚德	221,600	1,617,680.00	0.21
160	600637	东方明珠	225,000	1,608,750.00	0.21
161	600315	上海家化	37,600	1,607,400.00	0.21
162	600867	通化东宝	154,400	1,596,496.00	0.21
163	002683	广东宏大	57,000	1,586,310.00	0.21
164	601016	节能风电	330,100	1,584,480.00	0.21
165	600985	淮北矿业	108,800	1,584,128.00	0.21
166	601198	东兴证券	177,400	1,578,860.00	0.21
167	600236	桂冠电力	259,000	1,577,310.00	0.21
168	600026	中远海能	152,500	1,575,325.00	0.21
169	000887	中鼎股份	86,200	1,572,288.00	0.20
170	600171	上海贝岭	62,800	1,571,884.00	0.20

171	002439	启明星辰	78,500	1,564,505.00	0.20
172	002156	通富微电	101,300	1,560,020.00	0.20
173	002299	圣农发展	81,200	1,557,416.00	0.20
174	600380	健康元	125,900	1,554,865.00	0.20
175	600879	航天电子	239,100	1,551,759.00	0.20
176	002065	东华软件	244,500	1,545,240.00	0.20
177	600258	首旅酒店	62,300	1,545,040.00	0.20
178	300832	新产业	34,200	1,542,762.00	0.20
179	600642	申能股份	269,835	1,532,662.80	0.20
180	300026	红日药业	196,250	1,511,125.00	0.20
181	002408	齐翔腾达	185,960	1,508,135.60	0.20
182	002936	郑州银行	560,373	1,507,403.37	0.20
183	000750	国海证券	415,100	1,506,813.00	0.20
184	000623	吉林敖东	101,320	1,495,483.20	0.19
185	600673	东阳光	165,700	1,489,643.00	0.19
186	002203	海亮股份	128,500	1,484,175.00	0.19
187	000729	燕京啤酒	153,500	1,482,810.00	0.19
188	000513	丽珠集团	40,942	1,482,509.82	0.19
189	600820	隧道股份	241,800	1,479,816.00	0.19
190	000878	云南铜业	129,500	1,475,005.00	0.19
191	688185	康希诺	7,408	1,474,784.64	0.19
192	000400	许继电气	76,800	1,474,560.00	0.19
193	600801	华新水泥	74,800	1,459,348.00	0.19
194	600529	山东药玻	52,200	1,458,990.00	0.19
195	601717	郑煤机	101,200	1,458,292.00	0.19
196	600580	卧龙电驱	101,000	1,456,420.00	0.19
197	600038	中直股份	32,200	1,455,440.00	0.19
198	600369	西南证券	365,000	1,449,050.00	0.19
199	603568	伟明环保	43,090	1,437,913.30	0.19
200	600316	洪都航空	47,300	1,430,352.00	0.19
201	600166	福田汽车	505,189	1,429,684.87	0.19
202	300383	光环新网	137,200	1,429,624.00	0.19
203	300017	网宿科技	266,600	1,428,976.00	0.19
204	002183	怡亚通	198,000	1,427,580.00	0.19
205	002131	利欧股份	735,700	1,427,258.00	0.19
206	600848	上海临港	105,000	1,423,800.00	0.19
207	600909	华安证券	309,360	1,407,588.00	0.18
208	002444	巨星科技	74,700	1,407,348.00	0.18
209	600027	华电国际	358,000	1,406,940.00	0.18
210	601005	重庆钢铁	736,200	1,406,142.00	0.18
211	002958	青农商行	423,500	1,406,020.00	0.18
212	002195	二三四五	623,400	1,402,650.00	0.18
213	600008	首创环保	483,374	1,401,784.60	0.18
214	600325	华发股份	185,100	1,401,207.00	0.18

215	688256	寒武纪	21,566	1,395,320.20	0.18
216	300001	特锐德	79,300	1,372,683.00	0.18
217	688521	芯原股份	27,675	1,367,145.00	0.18
218	300618	寒锐钴业	23,600	1,366,912.00	0.18
219	300024	机器人	135,300	1,363,824.00	0.18
220	000825	太钢不锈	248,200	1,352,690.00	0.18
221	603218	日月股份	53,100	1,348,740.00	0.18
222	002500	山西证券	234,490	1,345,972.60	0.18
223	002926	华西证券	171,540	1,344,873.60	0.18
224	002430	杭氧股份	42,883	1,340,522.58	0.17
225	000050	深天马 A	134,000	1,335,980.00	0.17
226	600271	航天信息	122,100	1,335,774.00	0.17
227	000027	深圳能源	207,180	1,328,023.80	0.17
228	000739	普洛药业	64,300	1,327,152.00	0.17
229	002373	千方科技	118,548	1,318,253.76	0.17
230	002250	联化科技	80,400	1,316,148.00	0.17
231	002212	天融信	129,040	1,309,756.00	0.17
232	603233	大参林	41,800	1,308,340.00	0.17
233	600118	中国卫星	65,100	1,307,208.00	0.17
234	600863	内蒙华电	358,100	1,307,065.00	0.17
235	601866	中远海发	435,167	1,305,501.00	0.17
236	600208	新湖中宝	472,100	1,302,996.00	0.17
237	688009	中国通号	283,855	1,285,863.15	0.17
238	002985	北摩高科	21,758	1,274,583.64	0.17
239	300677	英科医疗	50,240	1,274,086.40	0.17
240	000060	中金岭南	284,800	1,270,208.00	0.17
241	601992	金隅集团	457,500	1,267,275.00	0.17
242	002249	大洋电机	206,100	1,265,454.00	0.16
243	300009	安科生物	124,848	1,262,213.28	0.16
244	600066	宇通客车	145,900	1,262,035.00	0.16
245	603156	养元饮品	55,500	1,260,960.00	0.16
246	000778	新兴铸管	260,920	1,257,634.40	0.16
247	603658	安图生物	25,700	1,256,473.00	0.16
248	002152	广电运通	135,400	1,255,158.00	0.16
249	603858	步长制药	62,900	1,239,759.00	0.16
250	300070	碧水源	237,000	1,234,770.00	0.16
251	300182	捷成股份	224,300	1,233,650.00	0.16
252	600998	九州通	102,800	1,224,348.00	0.16
253	300168	万达信息	129,300	1,220,592.00	0.16
254	000401	冀东水泥	115,900	1,219,268.00	0.16
255	002966	苏州银行	199,590	1,217,499.00	0.16
256	600056	中国医药	81,820	1,212,572.40	0.16
257	300251	光线传媒	127,800	1,210,266.00	0.16
258	600390	五矿资本	247,000	1,207,830.00	0.16



259	600970	中材国际	124,400	1,205,436.00	0.16
260	002191	劲嘉股份	112,300	1,203,856.00	0.16
261	002831	裕同科技	40,640	1,200,912.00	0.16
262	002128	电投能源	83,600	1,197,152.00	0.16
263	600667	太极实业	162,100	1,196,298.00	0.16
264	000997	新大陆	90,000	1,188,900.00	0.15
265	000021	深科技	101,900	1,186,116.00	0.15
266	688002	睿创微纳	29,791	1,183,298.52	0.15
267	300482	万孚生物	29,055	1,182,829.05	0.15
268	600021	上海电力	115,100	1,179,775.00	0.15
269	600528	中铁工业	146,400	1,178,520.00	0.15
270	600062	华润双鹤	45,900	1,177,794.00	0.15
271	002670	国盛金控	122,640	1,177,344.00	0.15
272	002505	鹏都农牧	347,100	1,176,669.00	0.15
273	002244	滨江集团	135,800	1,174,670.00	0.15
274	002221	东华能源	125,700	1,170,267.00	0.15
275	603885	吉祥航空	65,000	1,169,350.00	0.15
276	600839	四川长虹	405,266	1,167,166.08	0.15
277	600827	百联股份	88,300	1,166,443.00	0.15
278	000656	金科股份	406,900	1,163,734.00	0.15
279	600297	广汇汽车	445,300	1,162,233.00	0.15
280	603707	健友股份	41,190	1,161,558.00	0.15
281	600598	北大荒	78,000	1,151,280.00	0.15
282	002396	星网锐捷	50,800	1,150,112.00	0.15
283	000987	越秀金控	162,650	1,143,429.50	0.15
284	002127	南极电商	214,000	1,142,760.00	0.15
285	600498	烽火通信	78,200	1,132,336.00	0.15
286	600201	生物股份	123,600	1,132,176.00	0.15
287	600155	华创阳安	133,500	1,132,080.00	0.15
288	002019	亿帆医药	80,566	1,126,312.68	0.15
289	002266	浙富控股	233,800	1,119,902.00	0.15
290	600259	广晟有色	22,100	1,119,365.00	0.15
291	600409	三友化工	136,300	1,116,297.00	0.15
292	600511	国药股份	41,600	1,114,048.00	0.15
293	002155	湖南黄金	91,700	1,113,238.00	0.15
294	000012	南玻A	149,500	1,109,290.00	0.14
295	000930	中粮科技	121,900	1,101,976.00	0.14
296	600718	东软集团	95,600	1,100,356.00	0.14
297	000883	湖北能源	215,000	1,098,650.00	0.14
298	002153	石基信息	68,660	1,089,634.20	0.14
299	600755	厦门国贸	145,100	1,088,250.00	0.14
300	600060	海信视像	86,500	1,081,250.00	0.14
301	002124	天邦食品	160,400	1,077,888.00	0.14
302	002511	中顺洁柔	85,800	1,074,216.00	0.14

303	600959	江苏有线	329,330	1,073,615.80	0.14
304	000686	东北证券	152,900	1,068,771.00	0.14
305	600282	南钢股份	338,000	1,064,700.00	0.14
306	600566	济川药业	39,200	1,064,672.00	0.14
307	603712	七一二	33,700	1,061,550.00	0.14
308	600782	新钢股份	209,900	1,057,896.00	0.14
309	600895	张江高科	84,800	1,055,760.00	0.14
310	601880	辽港股份	620,200	1,054,340.00	0.14
311	601179	中国西电	225,134	1,053,627.12	0.14
312	000581	威孚高科	54,600	1,051,050.00	0.14
313	600064	南京高科	95,100	1,046,100.00	0.14
314	600022	山东钢铁	601,100	1,045,914.00	0.14
315	000709	河钢股份	462,500	1,045,250.00	0.14
316	600535	天士力	98,800	1,038,388.00	0.14
317	000690	宝新能源	236,800	1,037,184.00	0.14
318	688188	柏楚电子	4,700	1,034,188.00	0.13
319	601778	晶科科技	191,300	1,033,020.00	0.13
320	300376	易事特	126,013	1,023,225.56	0.13
321	002701	奥瑞金	196,163	1,020,047.60	0.13
322	002939	长城证券	99,800	1,013,968.00	0.13
323	600216	浙江医药	74,200	1,012,830.00	0.13
324	002002	鸿达兴业	272,100	1,009,491.00	0.13
325	600500	中化国际	151,700	1,008,805.00	0.13
326	600808	马钢股份	265,055	1,004,558.45	0.13
327	600037	歌华有线	106,800	1,002,852.00	0.13
328	600663	陆家嘴	96,700	1,001,812.00	0.13
329	300630	普利制药	28,472	1,000,790.80	0.13
330	000598	兴蓉环境	195,100	996,961.00	0.13
331	600728	佳都科技	154,300	996,778.00	0.13
332	002468	申通快递	83,300	992,936.00	0.13
333	002532	天山铝业	152,000	992,560.00	0.13
334	688208	道通科技	30,107	991,122.44	0.13
335	600567	山鹰国际	354,721	982,577.17	0.13
336	002595	豪迈科技	43,701	976,280.34	0.13
337	600517	国网英大	187,800	974,682.00	0.13
338	688289	圣湘生物	32,662	967,121.82	0.13
339	603225	新凤鸣	83,800	967,052.00	0.13
340	603866	桃李面包	58,375	966,106.25	0.13
341	601456	国联证券	78,600	964,422.00	0.13
342	002004	华邦健康	172,506	962,583.48	0.13
343	300463	迈克生物	46,700	956,883.00	0.12
344	600597	光明乳业	75,700	956,091.00	0.12
345	000785	居然之家	213,200	948,740.00	0.12
346	002745	木林森	97,000	947,690.00	0.12

347	002429	兆驰股份	246,500	946,560.00	0.12
348	300115	长盈精密	91,688	945,303.28	0.12
349	601958	金钼股份	106,200	938,808.00	0.12
350	300888	稳健医疗	14,100	937,650.00	0.12
351	300166	东方国信	100,400	925,688.00	0.12
352	601106	中国一重	301,099	924,373.93	0.12
353	601860	紫金银行	321,700	923,279.00	0.12
354	603927	中科软	39,300	916,476.00	0.12
355	688006	杭可科技	13,060	914,983.60	0.12
356	002390	信邦制药	132,400	914,884.00	0.12
357	600572	康恩贝	204,900	907,707.00	0.12
358	601718	际华集团	292,800	907,680.00	0.12
359	300072	三聚环保	179,000	905,740.00	0.12
360	600398	海澜之家	189,700	901,075.00	0.12
361	601118	海南橡胶	187,700	897,206.00	0.12
362	600507	方大特钢	127,998	894,706.02	0.12
363	600737	中粮糖业	117,600	884,352.00	0.12
364	000540	中天金融	457,600	883,168.00	0.12
365	603883	老百姓	25,908	877,763.04	0.11
366	600582	天地科技	181,545	867,785.10	0.11
367	002010	传化智联	133,700	859,691.00	0.11
368	000089	深圳机场	110,900	856,148.00	0.11
369	000559	万向钱潮	144,000	855,360.00	0.11
370	600967	内蒙一机	93,700	854,544.00	0.11
371	002048	宁波华翔	53,200	852,264.00	0.11
372	000937	冀中能源	114,100	851,186.00	0.11
373	002368	太极股份	44,218	849,427.78	0.11
374	600435	北方导航	98,200	846,484.00	0.11
375	600871	石化油服	447,100	845,019.00	0.11
376	000898	鞍钢股份	260,900	840,098.00	0.11
377	601000	唐山港	325,250	839,145.00	0.11
378	002690	美亚光电	38,526	835,243.68	0.11
379	001914	招商积余	46,200	830,214.00	0.11
380	601568	北元集团	130,800	829,272.00	0.11
381	600195	中牧股份	67,103	822,682.78	0.11
382	600556	天下秀	99,300	817,239.00	0.11
383	002110	三钢闽光	133,400	812,406.00	0.11
384	601333	广深铁路	372,500	812,050.00	0.11
385	000959	首钢股份	170,300	810,628.00	0.11
386	002233	塔牌集团	91,000	805,350.00	0.10
387	002281	光迅科技	45,800	805,164.00	0.10
388	688321	微芯生物	31,939	804,543.41	0.10
389	000156	华数传媒	100,900	804,173.00	0.10
390	600811	东方集团	281,200	795,796.00	0.10

391	002705	新宝股份	35,900	789,441.00	0.10
392	003035	南网能源	123,800	786,130.00	0.10
393	600764	中国海防	31,100	784,964.00	0.10
394	000537	广宇发展	60,400	784,596.00	0.10
395	000402	金融街	130,100	774,095.00	0.10
396	600329	达仁堂	31,400	771,812.00	0.10
397	002174	游族网络	78,202	764,033.54	0.10
398	600120	浙江东方	190,447	763,692.47	0.10
399	600126	杭钢股份	148,300	759,296.00	0.10
400	300212	易华录	43,620	758,988.00	0.10
401	600167	联美控股	100,500	752,745.00	0.10
402	002416	爱施德	80,900	752,370.00	0.10
403	000488	晨鸣纸业	133,300	751,812.00	0.10
404	600446	金证股份	72,400	751,512.00	0.10
405	601200	上海环境	73,900	750,824.00	0.10
406	000990	诚志股份	68,300	747,885.00	0.10
407	601098	中南传媒	78,800	743,872.00	0.10
408	600373	中文传媒	74,400	743,256.00	0.10
409	002867	周大生	47,750	741,557.50	0.10
410	000685	中山公用	96,400	740,352.00	0.10
411	002081	金螳螂	145,500	739,140.00	0.10
412	600707	彩虹股份	157,400	736,632.00	0.10
413	601611	中国核建	87,500	734,125.00	0.10
414	002925	盈趣科技	34,040	732,540.80	0.10
415	002382	蓝帆医疗	76,700	732,485.00	0.10
416	000158	常山北明	121,946	731,676.00	0.10
417	603638	艾迪精密	35,360	724,880.00	0.09
418	600095	湘财股份	94,100	723,629.00	0.09
419	601608	中信重工	190,250	721,047.50	0.09
420	001965	招商公路	94,300	719,509.00	0.09
421	002399	海普瑞	40,800	717,264.00	0.09
422	002146	荣盛发展	236,600	716,898.00	0.09
423	603317	天味食品	25,118	715,109.46	0.09
424	002387	维信诺	105,300	707,616.00	0.09
425	600131	国网信通	52,500	706,125.00	0.09
426	688029	南微医学	8,057	702,570.40	0.09
427	000967	盈峰环境	138,000	698,280.00	0.09
428	002948	青岛银行	191,890	694,641.80	0.09
429	600376	首开股份	141,100	692,801.00	0.09
430	000528	柳工	106,400	692,664.00	0.09
431	601187	厦门银行	116,100	691,956.00	0.09
432	688088	虹软科技	21,848	690,178.32	0.09
433	688213	思特威	14,046	688,394.46	0.09
434	600623	华谊集团	82,800	687,240.00	0.09

435	603000	人民网	60,470	677,264.00	0.09
436	002423	中粮资本	100,400	673,684.00	0.09
437	000563	陕国投 A	215,700	672,984.00	0.09
438	600901	江苏租赁	131,000	672,030.00	0.09
439	601598	中国外运	173,100	671,628.00	0.09
440	600307	酒钢宏兴	344,000	667,360.00	0.09
441	600006	东风汽车	88,100	665,155.00	0.09
442	601991	大唐发电	272,400	661,932.00	0.09
443	603228	景旺电子	27,980	652,773.40	0.09
444	300257	开山股份	43,400	649,264.00	0.08
445	603650	彤程新材	19,800	645,084.00	0.08
446	600906	财达证券	71,300	640,987.00	0.08
447	600717	天津港	158,752	636,595.52	0.08
448	000961	中南建设	208,300	635,315.00	0.08
449	002242	九阳股份	33,300	611,388.00	0.08
450	002434	万里扬	71,500	611,325.00	0.08
451	000718	苏宁环球	165,100	607,568.00	0.08
452	601928	凤凰传媒	83,600	597,740.00	0.08
453	000671	阳光城	270,700	592,833.00	0.08
454	000415	渤海租赁	269,300	584,381.00	0.08
455	601969	海南矿业	67,200	577,248.00	0.08
456	600968	海油发展	223,200	575,856.00	0.08
457	000553	安道麦 A	47,500	575,225.00	0.07
458	600648	外高桥	41,300	561,680.00	0.07
459	000031	大悦城	139,800	559,200.00	0.07
460	600787	中储股份	96,200	547,378.00	0.07
461	600928	西安银行	145,800	535,086.00	0.07
462	600339	中油工程	183,800	531,182.00	0.07
463	002563	森马服饰	88,000	520,960.00	0.07
464	688281	华秦科技	2,074	510,660.28	0.07
465	688197	首药控股	21,662	502,558.40	0.07
466	601228	广州港	135,700	498,019.00	0.06
467	300869	康泰医学	17,600	497,376.00	0.06
468	002815	崇达技术	38,313	490,789.53	0.06
469	000028	国药一致	16,400	488,556.00	0.06
470	600835	上海机电	35,200	483,296.00	0.06
471	688819	天能股份	13,589	469,907.62	0.06
472	600377	宁沪高速	54,300	465,351.00	0.06
473	000717	韶钢松山	131,800	461,300.00	0.06
474	603056	德邦股份	33,700	452,591.00	0.06
475	603379	三美股份	20,260	450,785.00	0.06
476	002945	华林证券	29,300	446,825.00	0.06
477	000869	张裕 A	14,900	443,126.00	0.06
478	601139	深圳燃气	63,700	442,078.00	0.06

479	000062	深圳华强	34,000	431,800.00	0.06
480	600299	安迪苏	44,300	424,394.00	0.06
481	601298	青岛港	76,900	420,643.00	0.05
482	601869	长飞光纤	13,600	420,512.00	0.05
483	603868	飞科电器	5,200	393,900.00	0.05
484	001872	招商港口	24,700	385,320.00	0.05
485	601156	东航物流	19,300	382,140.00	0.05
486	002653	海思科	23,500	378,585.00	0.05
487	300741	华宝股份	13,500	375,570.00	0.05
488	600823	世茂股份	122,500	365,050.00	0.05
489	600350	山东高速	69,200	363,300.00	0.05
490	601828	美凯龙	59,300	359,358.00	0.05
491	600927	永安期货	17,700	357,009.00	0.05
492	001227	兰州银行	66,700	328,164.00	0.04
493	603355	莱克电气	12,840	323,953.20	0.04
494	603515	欧普照明	16,700	291,415.00	0.04
495	603786	科博达	4,700	289,379.00	0.04
496	001203	大中矿业	24,600	277,980.00	0.04
497	601665	齐鲁银行	55,200	269,376.00	0.04
498	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.03
499	688400	凌云光	11,574	253,817.82	0.03
500	603719	良品铺子	8,600	246,218.00	0.03
501	002946	新乳业	18,900	245,511.00	0.03
502	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.03
503	601003	柳钢股份	56,100	227,205.00	0.03
504	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
505	688207	格灵深瞳	8,035	211,963.30	0.03
506	600956	新天绿能	15,700	193,424.00	0.03
507	002901	大博医疗	4,900	191,786.00	0.03
508	603983	丸美股份	5,600	150,080.00	0.02
509	600917	重庆燃气	19,100	137,902.00	0.02
510	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
511	688225	亚信安全	4,923	103,383.00	0.01
512	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
513	301238	瑞泰新材	2,024	64,909.68	0.01
514	601089	N 福元	1,749	36,816.45	0.00
515	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
516	301150	中一科技	318	26,317.68	0.00
517	301302	C 华如	466	26,291.72	0.00
518	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
519	301217	铜冠铜箔	1,588	23,550.04	0.00
520	301236	软通动力	747	23,440.86	0.00
521	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
522	301216	万凯新材	719	21,454.96	0.00

523	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
524	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
525	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
526	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
527	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
528	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
529	301112	N 信邦	399	17,970.96	0.00
530	301200	大族数控	343	17,808.56	0.00
531	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
532	301206	三元生物	363	16,585.47	0.00
533	301219	腾远钴业	180	15,807.60	0.00
534	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
535	301207	华兰疫苗	264	14,894.88	0.00
536	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
537	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
538	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
539	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
540	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
541	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
542	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
543	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
544	301123	奕东电子	466	11,831.74	0.00
545	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
546	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
547	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
548	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
549	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
550	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
551	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
552	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
553	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
554	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
555	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
556	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
557	600903	贵州燃气	300	2,337.00	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	600096	云天化	5,145,298.00	0.83

2	300769	德方纳米	4,617,989.00	0.74
3	300012	华测检测	4,090,729.00	0.66
4	002497	雅化集团	4,055,886.00	0.65
5	002240	盛新锂能	3,918,624.00	0.63
6	600522	中天科技	3,780,196.50	0.61
7	688099	晶晨股份	3,776,161.79	0.61
8	688180	君实生物	3,646,360.02	0.59
9	300390	天华超净	3,368,090.00	0.54
10	002407	多氟多	3,351,570.00	0.54
11	601058	赛轮轮胎	3,341,428.72	0.54
12	688122	西部超导	3,317,570.87	0.53
13	601615	明阳智能	3,179,558.00	0.51
14	688005	容百科技	3,154,472.67	0.51
15	300073	当升科技	3,147,291.84	0.51
16	601108	财通证券	3,097,045.30	0.50
17	600256	广汇能源	3,088,181.00	0.50
18	688777	中控技术	3,074,782.57	0.49
19	600563	法拉电子	3,028,561.00	0.49
20	002756	永兴材料	3,021,018.00	0.49

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	688005	容百科技	5,451,197.46	0.88
2	000733	振华科技	5,342,787.00	0.86
3	600188	兖矿能源	5,233,082.00	0.84
4	601117	中国化学	4,550,118.00	0.73
5	002340	格林美	4,501,202.00	0.72
6	600884	杉杉股份	4,076,236.88	0.66
7	601689	拓普集团	3,831,914.14	0.62
8	605358	立昂微	3,594,553.80	0.58
9	000723	美锦能源	3,498,404.00	0.56
10	600754	锦江酒店	3,378,229.00	0.54
11	300751	迈为股份	3,270,209.00	0.53
12	300763	锦浪科技	3,212,755.00	0.52
13	688099	晶晨股份	3,021,753.67	0.49
14	600733	北汽蓝谷	2,553,613.00	0.41
15	600563	法拉电子	2,408,194.00	0.39
16	600256	广汇能源	2,300,402.00	0.37
17	603893	瑞芯微	2,297,842.00	0.37
18	600803	新奥股份	2,279,012.64	0.37



19	600522	中天科技	2,241,010.00	0.36
20	300223	北京君正	2,063,399.00	0.33

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	391,708,179.73
卖出股票的收入（成交）总额	274,779,028.33

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，盛新锂能集团股份有限公司在报告编制前一年受到深圳证券交易所的通报批评。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	5,450,714.26
2	应收清算款	4,697,340.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,148,054.77

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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	户均持有	持有人结构
----	------	-------

人户数(户)	的基金份额	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
2,815	36,836.62	14,918,318.00	14.39%	18,124,999.00	17.48%	70,651,781.00	68.13%

## 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	申万宏源证券有限公司	6,743,000.00	6.50%
2	农银人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	2,225,500.00	2.15%
3	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	1.85%
4	孙雪理	1,266,376.00	1.22%
5	罗志中	1,100,000.00	1.06%
6	方正证券股份有限公司	1,075,159.00	1.04%
7	中信证券股份有限公司	915,448.00	0.88%
8	广发证券股份有限公司	817,746.00	0.79%
9	招商证券股份有限公司	596,444.00	0.58%
10	白巍	550,000.00	0.53%
-	招商银行股份有限公司—博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	70,651,781.00	68.13%

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	74,895,098.00
本报告期基金总申购份额	68,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	39,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	103,695,098.00

## § 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

本报告期内，基金管理人、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	佣金	占当期佣金总量的	

			的比例		比例	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	392,570,944.35	60.35%	82,961.43	30.54%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	257,957,938.47	39.65%	188,685.34	69.46%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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》（证监基金字[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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司的特定要求，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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	378,006.52	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露	2022-06-18

		露网站	
2	关于博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增东北证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-05-16
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-05-16
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20220430	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-30
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华安证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-26
6	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2022-04-22
7	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022-03-30
8	博时基金管理有限公司关于调整直销网上交易定期投资业务影响部分定期投资计划的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-14
9	博时基金管理有限公司关于部分基金在青岛农商银行直销银行开展费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-02-11
10	博时基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
11	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022-01-24
12	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-20220121	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-21
13	关于成立博时财富基金销售有限公司的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-20
14	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-18
15	博时基金管理有限公司关于暂停使用交通银行非快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-06
16	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开	中国证券报、基金管理人	2022-01-04

	通交通银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
17	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	2022-01-01
18	博时基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01

## § 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发起式联接基金	1	2022-01-01~2022-06-30	44,582,681.00	26,069,100.00	-	70,651,781.00	68.13%
<b>产品特有风险</b>							
<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</p>							

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。

## 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  
二〇二二年八月三十一日