

**博时中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2025 年中期报告
2025 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：二〇二五年八月二十九日

§ 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 2025 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 2025 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	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
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§9 开放式基金份额变动	50

§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 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	92,495,098.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 31 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

法定代表人	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	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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	5,687,389.30
本期利润	35,878,543.40
加权平均基金份额本期利润	0.3677
本期加权平均净值利润率	5.17%
本期基金份额净值增长率	4.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	214,366,496.74
期末可供分配基金份额利润	2.3176
期末基金资产净值	683,587,712.69
期末基金份额净值	7.3905
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	45.69%

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

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

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

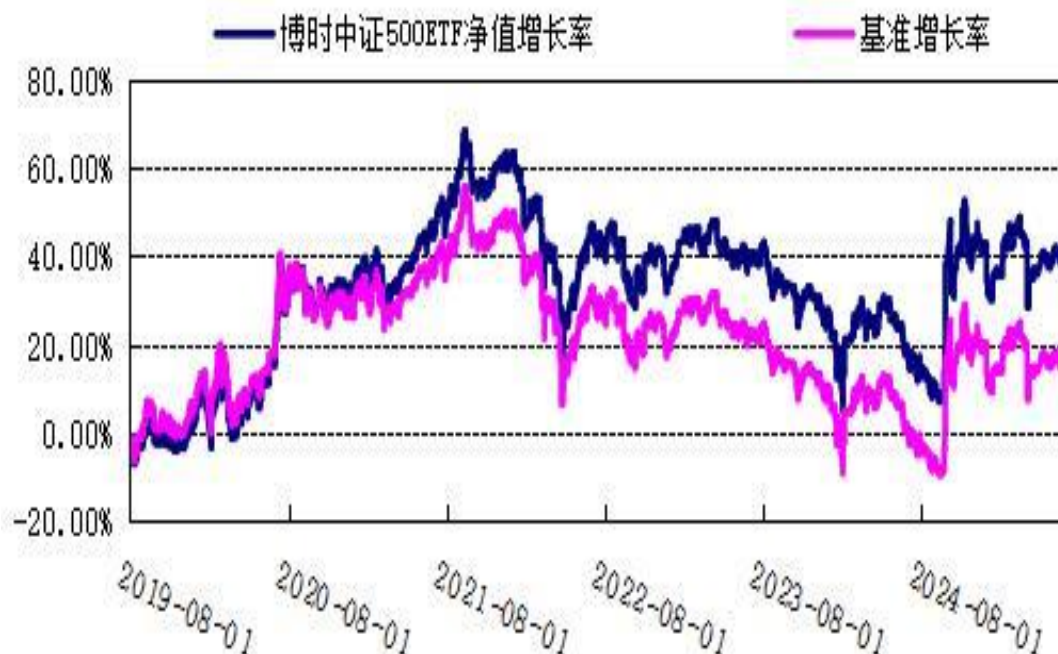
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.11%	0.77%	4.31%	0.79%	0.80%	-0.02%
过去三个月	2.24%	1.49%	0.98%	1.50%	1.26%	-0.01%
过去六个月	4.90%	1.34%	3.31%	1.36%	1.59%	-0.02%
过去一年	23.13%	1.71%	19.68%	1.72%	3.45%	-0.01%

过去三年	-0.09%	1.34%	-8.35%	1.35%	8.26%	-0.01%
自基金合同生效起至今	45.69%	1.34%	20.64%	1.35%	25.05%	-0.01%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经	2019-08-01	-	18.3	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				理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022 年 7 月 26 日-2023 年 9 月 25 日)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 3 月 3 日-2024 年 11 月 8 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、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)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) (2023 年 4 月 19 日一至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (2023 年 9 月 26 日一至今) 的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	2025-04-15	8.9	王萌先生，博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任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 (2025 年 4 月 16 日一至今)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金 (2025 年 6 月 30 日一至今) 的基金经理，博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金、博时中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、博时上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时中证传媒指数型发起式证券投资基金、博时创业板指数证券投资基金、博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、博时中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金、博时上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。

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 23 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

2025 年上半年，中国国内经济保持韧性。从经济基本面上来看，上半年在“抢出口”、财政以及新动能持续发力等因素共同作用下，对经济形成有力支撑，上半年 GDP 同比增长 5.3%。上半年工业增加值累积增速为 6.4%，高于去年整体增速。出口在中美贸易谈判后逐渐恢复，6 月工业企业出口交货值同比增长 4%，较 5 月增加 3.4%。工业生产整体“新旧分化”特征明显，上半年高技术制造业增加值增长 9.5%，与内需尤其是地产开工相关工业生产仍然偏弱。

股票市场亦呈现结构特征。资源品中有色金属表现出色，上半年在中信一级行业涨幅第一，而煤炭则排名垫底。科技板块中，传媒、计算机和通信表现相对较好。金融内，银行涨幅居前，但非银行金融表现一般。消费和地产相关产业链整体表现落后。宽基指数中，北证 50、中证 2000 和科创 100 相对领先，沪深 300 和创业板指相对落后。风格上，代表两端的大盘价值和小盘成长领先。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 7.3905 元，份额累计净值为 1.4569 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 4.90%，同期业绩基准增长率为 3.31%。

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 2025 年下半年，与美国的关税博弈仍然具有不确定性，在“抢出口”效应逐渐消退后，出口的韧性值得关注。内需方面，地产对经济的边际影响逐渐减弱，政策层面仍然具有空间。此外，伴随新一轮“反内卷”政策的落地，一定程度上能从供给端缓和重点领域产能过剩的问题，对 PPI 起到提振作用。目前市场利率处于低位，流动性保持合理充裕，在“反内卷”政策的推动下，上市公司盈利有望迎来修复，同时以科技为代表的新兴产业保持了良好的发展势头，对后续市场相对乐观。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监

管要求履行报告义务。

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	8,958,090.16	7,363,303.05
结算备付金		26,081,786.19	26,808,972.04
存出保证金		4,531,586.84	4,505,700.26
交易性金融资产	6.4.6.2	644,876,597.20	720,958,657.19
其中：股票投资		644,876,597.20	720,958,657.19
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		1,532,138.91	2,990,115.79
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.5	—	—
资产总计		685,980,199.30	762,626,748.33
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,107,867.04	3,142,120.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		82,465.20	101,970.72
应付托管费		27,488.41	33,990.22
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	86,156.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	174,665.96	536,420.35
负债合计		2,392,486.61	3,900,658.55
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	469,221,215.95	546,329,761.53
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	214,366,496.74	212,396,328.25
净资产合计		683,587,712.69	758,726,089.78
负债和净资产总计		685,980,199.30	762,626,748.33

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 7.3905 元，基金份额总额 92,495,098.00 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
一、营业总收入		36,706,425.08	-56,362,298.91
1. 利息收入		169,572.60	82,473.83
其中：存款利息收入	6.4.6.9	169,572.60	82,473.83
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,078,918.15	-16,425,468.92
其中：股票投资收益	6.4.6.10	-373,530.42	-23,890,521.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	5,579.72	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.6.13	29,954.46	-2,281,957.86
股利收益	6.4.6.14	6,416,914.39	9,712,769.94
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		-	34,240.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.15	30,191,154.10	-40,019,858.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	266,780.23	555.12
减：二、营业总支出		827,881.68	954,529.08
1. 管理人报酬		516,343.49	562,979.27
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		172,114.53	187,659.77
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		4,645.32	123.30
8. 其他费用	6.4.6.18	134,778.34	203,766.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,878,543.40	-57,316,827.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,878,543.40	-57,316,827.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		35,878,543.40	-57,316,827.99

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

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

(一)、综合收益总额	-	-	35,878,543.40	35,878,543.40
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-77,108,545.58	-	-33,908,374.91	-111,016,920.49
其中: 1. 基金申购款	44,641,789.57	-	17,625,118.22	62,266,907.79
2. 基金赎回款	-121,750,335.15	-	-51,533,493.13	-173,283,828.28
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	469,221,215.95	-	214,366,496.74	683,587,712.69
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	597,059,067.89	-	166,779,894.11	763,838,962.00
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	597,059,067.89	-	166,779,894.11	763,838,962.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	18,262,550.24	-	-54,081,123.55	-35,818,573.31
(一)、综合收益总额	-	-	-57,316,827.99	-57,316,827.99
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	18,262,550.24	-	3,235,704.44	21,498,254.68
其中: 1. 基金申购款	60,875,167.55	-	12,853,878.76	73,729,046.31
2. 基金赎回款	-42,612,617.31	-	-9,618,174.32	-52,230,791.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	615,321,618.13	-	112,698,770.56	728,020,388.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人博时基金管理有限公司确定 2019 年 10 月 18 日为本基金的基金份额折算日。本次基金份额折算前基金份额总额为 2,762,185,861.00 份，折算前基金份额净值为 0.9781 元。根据基金份额折算公式，本次基金份额折算比例为 0.197128864，折算后，2019 年 10 月 21 日基金份额总额为 544,495,098.00 份，折算后基金份额净值为 4.9618 元。本基金的基金管理人博时基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，本基金登记机构中国证券登记结算有限责任公司已于 2019 年 10 月 21 日进行了变更登记。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	8,958,090.16
等于：本金	8,957,345.48
加：应计利息	744.68
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	8,958,090.16

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		637,821,433.09	-	644,876,597.20	7,055,164.11
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	637,821,433.09	-	644,876,597.20	7,055,164.11	

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	28,817,880.00	-	-	-
——股指期货	28,817,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	28,817,880.00	-	-	-

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

6.4.6.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2509	IC2509	26.00	30,034,160.00	1,216,280.00
合计	-	-	-	1,216,280.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,216,280.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	40,532.75

其中：交易所市场	40,532.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	47,352.76
合计	174,665.96

6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,695,098.00	546,329,761.53
本期申购	8,800,000.00	44,641,789.57
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-121,750,335.15
本期末	92,495,098.00	469,221,215.95

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

6.4.6.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	390,277,321.60	-177,880,993.35	212,396,328.25
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	390,277,321.60	-177,880,993.35	212,396,328.25
本期利润	5,687,389.30	30,191,154.10	35,878,543.40
本期基金份额交易产生的变动数	-55,234,584.85	21,326,209.94	-33,908,374.91
其中：基金申购款	32,100,025.72	-14,474,907.50	17,625,118.22
基金赎回款	-87,334,610.57	35,801,117.44	-51,533,493.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	340,730,126.05	-126,363,629.31	214,366,496.74

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	12,245.82
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	157,202.44
其他	124.34
合计	169,572.60

6.4.6.10 股票投资收益

6.4.6.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,509,217.59
股票投资收益——赎回差价收入	1,135,687.17
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-373,530.42

6.4.6.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	175,015,233.79
减：卖出股票成本总额	176,355,730.46
减：交易费用	168,720.92
买卖股票差价收入	-1,509,217.59

6.4.6.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	173,283,828.28
减：现金支付赎回款总额	90,233,303.28
减：赎回股票成本总额	81,914,837.83
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,135,687.17

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	3.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,575.93
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	5,579.72

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,580.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,000.00

减：应计利息总额	3.79
减：交易费用	1.18
买卖债券差价收入	5,575.93

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	29,954.46

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,416,914.39
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	6,416,914.39

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	28,176,954.10
——股票投资	28,176,954.10
——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	2,014,200.00
——权证投资	-
——股指期货	2,014,200.00
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	30,191,154.10

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	266,780.23
合计	266,780.23

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	235.13
银行汇划费	410.00
指数使用费	47,352.76
合计	134,778.34

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.8 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	122,581,203.12	40.76%	64,388,863.63	25.44%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

无。

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	25,259.54	40.78%	7,077.61	17.46%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	14,877.66	9.56%	4,549.73	3.57%

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

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

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	516,343.49	562,979.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,889.80	-
应支付基金管理人的净管理费	509,453.69	562,979.27

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	172,114.53	187,659.77

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	4,879,955.00	3.00~6.01	3.84	8,365.46	-	-

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	75,473,605.00	81.60%	83,936,005.00	77.94%

招商证券	1,413,828.00	1.53%	218,572.00	0.20%
------	--------------	-------	------------	-------

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

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024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	8,958,090.16	12,245.82	13,858,901.98	27,719.43

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

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2025年1月1日至2025年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54
上年度可比期间					
2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	1,745.00	151,745.20

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

6.4.11 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688775	影石创新	2025-06-04	6个月	首次公开发行限售	47.27	124.16	524.00	24,769.48	65,059.84	-
688411	海博	2025-01-20	6个月	首次公开	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-

	思创			发行 限售						
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	11.68	26.95	994.00	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	首次 公开发 行 限售	10.40	34.11	701.00	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	首次 公开发 行 限售	27.50	56.19	397.00	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.80	79.68	227.00	5,855.50	18,087.36	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	12.80	44.54	382.00	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	6.70	24.80	658.00	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	首次 公开发 行 限售	27.57	45.22	349.00	9,620.72	15,781.78	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	首次 公开发 行 限售	29.93	77.87	182.00	5,447.00	14,172.34	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	首次 公开发 行 限售	4.92	18.99	734.00	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	首次 公开发 行 限售	9.08	25.94	536.00	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	5 个 交易 日	新股 未上 市	16.42	16.42	843.00	13,842.06	13,842.06	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	首次 公开发 行 限售	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
603049	中	2025-05-27	6 个	首次	46.50	42.85	307.00	14,275.50	13,154.95	-

	策橡胶		月	公开发 行限售						
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	首次公开发 行限售	12.30	54.45	226.00	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	首次公开发 行限售	26.60	82.50	143.00	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	首次公开发 行限售	11.80	33.85	342.00	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	首次公开发 行限售	5.30	14.44	709.00	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	首次公开发 行限售	89.60	139.48	73.00	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	首次公开发 行限售	11.80	22.98	437.00	5,156.60	10,042.26	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	首次公开发 行限售	93.50	90.66	98.00	9,163.00	8,884.68	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	首次公开发 行限售	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	首次公开发 行限售	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	首次公开发 行限售	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	首次公开发 行限售	7.40	20.21	366.00	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	首次公开发 行限售	26.50	32.68	205.00	5,432.50	6,699.40	-

301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	首次公开发售	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	首次公开发售	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	首次公开发售	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	首次公开发售	8.60	15.61	286.00	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	首次公开发售	20.60	35.08	126.00	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	首次公开发售	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	首次公开发售	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	首次公开发售	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	首次公开发售	12.08	18.12	178.00	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	首次公开发售	20.52	37.47	78.00	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	首次公开发售	19.88	43.81	57.00	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	首次公开发售	11.50	22.39	105.00	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科	2025-04-02	6 个月	首次公开发售	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-

	技			限售						
603120	肯		6 个	首次	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172.95	-
	特	2025-04-09	月	公开发						
	催			行限售						
	化									
001388	信	2025-06-24	6 个	首次	16.42	16.42	94.00	1,543.48	1,543.48	-
	通		月	公开发						
	电			行限售						
	子									

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

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

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

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的

建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

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

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

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 流动性风险

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

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

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

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

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

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2025 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	8,958,090.16	-	-	-	8,958,090.16
结算备付金	26,081,786.19	-	-	-	26,081,786.19
存出保证金	26,462.84	-	-	4,505,124.00	4,531,586.84
交易性金融资产	-	-	-	644,876,597.20	644,876,597.20
应收清算款	-	-	-	1,532,138.91	1,532,138.91
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,066,339.19	-	-	650,913,860.11	685,980,199.30
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,107,867.04	2,107,867.04
应付管理人报酬	-	-	-	82,465.20	82,465.20
应付托管费	-	-	-	27,488.41	27,488.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	174,665.96	174,665.96
负债总计	-	-	-	2,392,486.61	2,392,486.61
利率敏感度缺口	35,066,339.19	-	-	648,521,373.50	683,587,712.69
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,363,303.05	-	-	-	7,363,303.05
结算备付金	26,808,972.04	-	-	-	26,808,972.04
存出保证金	78,888.26	-	-	4,426,812.00	4,505,700.26
交易性金融资产	-	-	-	720,958,657.19	720,958,657.19
应收清算款	-	-	-	2,990,115.79	2,990,115.79
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	34,251,163.35	-	-	728,375,584.98	762,626,748.33
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3,142,120.33	3,142,120.33
应付管理人报酬	-	-	-	101,970.72	101,970.72

应付托管费	-	-	-	33,990.22	33,990.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	86,156.93	86,156.93
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	536,420.35	536,420.35
负债总计	-	-	-	3,900,658.55	3,900,658.55
利率敏感度缺口	34,251,163.35	-	-	724,474,926.43	758,726,089.78

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

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债和可交换债)、资产支持证券投资和国债期货投资，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)。

6.4.12.4.2 外汇风险

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

6.4.12.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	644,876,597.20	94.34	720,958,657.19	95.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	644,876,597.20	94.34	720,958,657.19	95.02

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。

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3,310	增加约 3,708
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,310	减少约 3,708

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日
第一层次	644,369,293.49
第二层次	15,385.54
第三层次	491,918.17
合计	644,876,597.20

6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	644,876,597.20	94.01
	其中：股票	644,876,597.20	94.01
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	35,039,876.35	5.11
8	其他各项资产	6,063,725.75	0.88
9	合计	685,980,199.30	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	1,610,666.00	0.24
B	采矿业	23,062,675.00	3.37
C	制造业	408,516,891.75	59.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,781,082.98	3.04
E	建筑业	5,674,236.00	0.83
F	批发和零售业	14,150,134.52	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	10,730,462.49	1.57
H	住宿和餐饮业	1,730,688.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,816,090.20	8.75
J	金融业	63,318,699.04	9.26
K	房地产业	7,991,530.00	1.17
L	租赁和商务服务业	5,536,930.40	0.81
M	科学研究和技术服务业	4,381,398.28	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	2,700,101.46	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1,320,084.00	0.19
Q	卫生和社会工作	2,965,244.08	0.43
R	文化、体育和娱乐业	9,052,197.00	1.32
S	综合	1,537,486.00	0.22
	合计	644,876,597.20	94.34

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	300476	胜宏科技	52,900	7,108,702.00	1.04
2	000988	华工科技	87,862	4,130,392.62	0.60
3	600988	赤峰黄金	146,100	3,634,968.00	0.53
4	300339	润和软件	69,700	3,542,851.00	0.52
5	002966	苏州银行	390,790	3,431,136.20	0.50
6	600839	四川长虹	324,266	3,151,865.52	0.46
7	601555	东吴证券	349,140	3,054,975.00	0.45
8	601162	天风证券	608,600	3,000,398.00	0.44
9	689009	九号公司	50,420	2,983,351.40	0.44
10	688521	芯原股份	30,729	2,965,348.50	0.43
11	002517	恺英网络	149,400	2,884,914.00	0.42
12	002340	格林美	446,200	2,833,370.00	0.41
13	603893	瑞芯微	18,400	2,794,224.00	0.41
14	002195	岩山科技	495,900	2,791,917.00	0.41
15	002558	巨人网络	118,500	2,790,675.00	0.41
16	002156	通富微电	106,100	2,718,282.00	0.40
17	002261	拓维信息	87,400	2,705,030.00	0.40
18	600487	亨通光电	173,300	2,651,490.00	0.39
19	600157	永泰能源	1,951,000	2,614,340.00	0.38
20	300251	光线传媒	128,200	2,598,614.00	0.38
21	300207	欣旺达	129,100	2,589,746.00	0.38
22	002797	第一创业	365,560	2,588,164.80	0.38
23	300803	指南针	31,425	2,534,740.50	0.37
24	688213	思特威	24,616	2,516,247.52	0.37
25	688608	恒玄科技	7,212	2,509,631.76	0.37
26	000066	中国长城	169,100	2,502,680.00	0.37
27	688777	中控技术	55,491	2,492,100.81	0.36
28	600096	云天化	112,100	2,462,837.00	0.36
29	600536	中国软件	52,310	2,446,538.70	0.36
30	601168	西部矿业	146,500	2,436,295.00	0.36
31	002273	水晶光电	121,500	2,426,355.00	0.35
32	600879	航天电子	231,700	2,425,899.00	0.35
33	002465	海格通信	173,600	2,419,984.00	0.35
34	688120	华海清科	14,166	2,389,804.20	0.35
35	300450	先导智能	95,900	2,383,115.00	0.35
36	601099	太平洋	598,700	2,352,891.00	0.34
37	000831	中国稀土	64,900	2,344,188.00	0.34
38	688235	百济神州	9,949	2,324,484.36	0.34
39	600352	浙江龙盛	228,600	2,322,576.00	0.34
40	002294	信立泰	48,820	2,310,650.60	0.34
41	300017	网宿科技	213,800	2,291,936.00	0.34
42	000933	神火股份	137,700	2,291,328.00	0.34
43	600885	宏发股份	102,540	2,287,667.40	0.33
44	002185	华天科技	224,100	2,263,410.00	0.33
45	601108	财通证券	285,500	2,258,305.00	0.33
46	688617	惠泰医疗	7,559	2,245,023.00	0.33

47	688002	睿创微纳	31,984	2,229,924.48	0.33
48	601128	常熟银行	291,262	2,146,600.94	0.31
49	601577	长沙银行	211,900	2,106,286.00	0.31
50	600079	人福医药	100,300	2,104,294.00	0.31
51	002130	沃尔核材	88,100	2,098,542.00	0.31
52	688099	晶晨股份	29,518	2,096,073.18	0.31
53	002281	光迅科技	42,300	2,086,236.00	0.31
54	300454	深信服	22,100	2,081,378.00	0.30
55	688469	芯联集成	434,598	2,073,032.46	0.30
56	688122	西部超导	39,925	2,071,309.00	0.30
57	002085	万丰奥威	129,900	2,064,111.00	0.30
58	002595	豪迈科技	34,805	2,061,152.10	0.30
59	000423	东阿阿胶	39,400	2,060,620.00	0.30
60	300223	北京君正	29,600	2,048,320.00	0.30
61	000997	新大陆	62,800	2,033,464.00	0.30
62	002738	中矿资源	63,080	2,028,652.80	0.30
63	300058	蓝色光标	309,240	2,028,614.40	0.30
64	002532	天山铝业	244,000	2,027,640.00	0.30
65	300002	神州泰岳	171,500	2,023,700.00	0.30
66	603129	春风动力	9,300	2,013,450.00	0.29
67	000783	长江证券	290,100	2,010,393.00	0.29
68	300458	全志科技	50,600	2,008,314.00	0.29
69	300474	景嘉微	27,450	2,003,850.00	0.29
70	600109	国金证券	228,200	2,001,314.00	0.29
71	002472	双环传动	59,200	1,982,608.00	0.29
72	002138	顺络电子	70,500	1,982,460.00	0.29
73	002078	太阳纸业	146,569	1,972,818.74	0.29
74	603596	伯特利	37,240	1,962,175.60	0.29
75	002436	兴森科技	147,500	1,952,900.00	0.29
76	601933	永辉超市	398,500	1,952,650.00	0.29
77	002410	广联达	144,400	1,936,404.00	0.28
78	600862	中航高科	73,400	1,914,272.00	0.28
79	300346	南大光电	60,420	1,911,688.80	0.28
80	600143	金发科技	185,300	1,910,443.00	0.28
81	688072	拓荆科技	12,403	1,906,465.13	0.28
82	688525	佰维存储	28,282	1,906,206.80	0.28
83	002851	麦格米特	38,000	1,905,320.00	0.28
84	600580	卧龙电驱	96,280	1,903,455.60	0.28
85	300765	新诺威	36,800	1,902,192.00	0.28
86	601198	东兴证券	170,300	1,898,845.00	0.28
87	300136	信维通信	84,600	1,895,040.00	0.28
88	002850	科达利	16,700	1,889,939.00	0.28
89	002353	杰瑞股份	53,800	1,883,000.00	0.28
90	002065	东华软件	196,100	1,882,560.00	0.28
91	300024	机器人	109,500	1,881,210.00	0.28
92	300054	鼎龙股份	65,500	1,878,540.00	0.27
93	600298	安琪酵母	53,382	1,877,444.94	0.27
94	002223	鱼跃医疗	52,664	1,874,838.40	0.27
95	600873	梅花生物	175,300	1,873,957.00	0.27
96	600363	联创光电	32,100	1,872,393.00	0.27

97	603606	东方电缆	36,200	1,871,902.00	0.27
98	000034	神州数码	49,600	1,866,944.00	0.27
99	300395	菲利华	36,500	1,865,150.00	0.27
100	688578	艾力斯	19,957	1,856,799.28	0.27
101	002202	金风科技	181,100	1,856,275.00	0.27
102	300496	中科创达	32,300	1,848,206.00	0.27
103	002673	西部证券	234,400	1,847,072.00	0.27
104	601615	明阳智能	159,600	1,833,804.00	0.27
105	300857	协创数据	21,000	1,807,260.00	0.26
106	000728	国元证券	228,700	1,804,443.00	0.26
107	002624	完美世界	118,751	1,801,452.67	0.26
108	300383	光环新网	125,700	1,797,510.00	0.26
109	000021	深科技	95,600	1,791,544.00	0.26
110	002008	大族激光	73,400	1,788,758.00	0.26
111	300115	长盈精密	82,900	1,774,060.00	0.26
112	603659	璞泰来	93,900	1,763,442.00	0.26
113	600549	厦门钨业	83,600	1,748,912.00	0.26
114	600895	张江高科	68,000	1,747,600.00	0.26
115	603087	甘李药业	31,700	1,736,526.00	0.25
116	603160	汇顶科技	24,400	1,733,132.00	0.25
117	603605	珀莱雅	20,900	1,730,311.00	0.25
118	300604	长川科技	38,500	1,729,035.00	0.25
119	688220	翱捷科技	21,940	1,717,902.00	0.25
120	000426	兴业银锡	108,500	1,714,300.00	0.25
121	300012	华测检测	146,600	1,713,754.00	0.25
122	002155	湖南黄金	95,720	1,708,602.00	0.25
123	600171	上海贝岭	49,800	1,705,650.00	0.25
124	000733	振华科技	33,800	1,691,690.00	0.25
125	688361	中科飞测	19,957	1,680,179.83	0.25
126	300627	华测导航	47,809	1,673,315.00	0.24
127	605589	圣泉集团	59,400	1,648,350.00	0.24
128	601216	君正集团	296,300	1,635,576.00	0.24
129	600392	盛和资源	123,100	1,621,227.00	0.24
130	601665	齐鲁银行	255,900	1,617,288.00	0.24
131	300699	光威复材	50,980	1,614,536.60	0.24
132	300037	新宙邦	45,820	1,612,864.00	0.24
133	601997	贵阳银行	256,900	1,603,056.00	0.23
134	000750	国海证券	389,000	1,602,680.00	0.23
135	688180	君实生物	47,131	1,601,511.38	0.23
136	002444	巨星科技	62,600	1,596,926.00	0.23
137	000729	燕京啤酒	123,100	1,591,683.00	0.23
138	000932	华菱钢铁	361,340	1,589,896.00	0.23
139	000519	中兵红箭	72,600	1,589,214.00	0.23
140	300003	乐普医疗	115,100	1,586,078.00	0.23
141	600153	建发股份	152,800	1,584,536.00	0.23
142	600060	海信视像	68,800	1,583,776.00	0.23
143	601717	郑煤机	94,800	1,575,576.00	0.23
144	601990	南京证券	194,200	1,569,136.00	0.23
145	601233	桐昆股份	147,800	1,566,680.00	0.23
146	601696	中银证券	146,400	1,565,016.00	0.23

147	688052	纳芯微	8,895	1,552,088.55	0.23
148	000878	云南铜业	121,900	1,550,568.00	0.23
149	300073	当升科技	35,334	1,550,102.58	0.23
150	300001	特锐德	64,600	1,548,462.00	0.23
151	300142	沃森生物	139,900	1,538,900.00	0.23
152	600673	东阳光	132,200	1,537,486.00	0.22
153	002821	凯莱英	17,400	1,535,550.00	0.22
154	002414	高德红外	149,300	1,530,325.00	0.22
155	600369	西南证券	350,200	1,523,370.00	0.22
156	603979	金诚信	32,800	1,523,232.00	0.22
157	600699	均胜电子	86,600	1,510,304.00	0.22
158	002837	英维克	50,700	1,506,297.00	0.22
159	002007	华兰生物	95,900	1,502,753.00	0.22
160	688027	国盾量子	5,425	1,491,929.25	0.22
161	688065	凯赛生物	31,617	1,489,160.70	0.22
162	600118	中国卫星	52,000	1,485,640.00	0.22
163	300373	扬杰科技	28,600	1,484,340.00	0.22
164	600177	雅戈尔	203,000	1,481,900.00	0.22
165	600521	华海药业	79,400	1,479,222.00	0.22
166	600398	海澜之家	210,900	1,467,864.00	0.21
167	000893	亚钾国际	48,500	1,461,790.00	0.21
168	002152	广电运通	108,500	1,458,240.00	0.21
169	603345	安井食品	18,000	1,447,560.00	0.21
170	600435	北方导航	92,800	1,446,752.00	0.21
171	600704	物产中大	273,500	1,441,345.00	0.21
172	600909	华安证券	246,560	1,437,444.80	0.21
173	000738	航发控制	69,000	1,431,750.00	0.21
174	300748	金力永磁	60,000	1,430,400.00	0.21
175	688249	晶合集成	70,500	1,429,035.00	0.21
176	600316	洪都航空	37,800	1,425,060.00	0.21
177	600497	驰宏锌锗	268,272	1,419,158.88	0.21
178	000623	吉林敖东	83,220	1,410,579.00	0.21
179	603179	新泉股份	30,000	1,409,100.00	0.21
180	002044	美年健康	273,700	1,406,818.00	0.21
181	002958	青农商行	388,500	1,402,485.00	0.21
182	600765	中航重机	82,980	1,400,702.40	0.20
183	002318	久立特材	59,800	1,398,722.00	0.20
184	000009	中国宝安	157,420	1,397,889.60	0.20
185	600038	中直股份	36,000	1,397,160.00	0.20
186	600141	兴发集团	67,800	1,391,934.00	0.20
187	688385	复旦微电	28,226	1,390,695.02	0.20
188	603228	景旺电子	32,980	1,379,883.20	0.20
189	600562	国睿科技	43,600	1,372,964.00	0.20
190	002409	雅克科技	25,000	1,367,250.00	0.20
191	600155	华创云信	195,400	1,359,984.00	0.20
192	000528	柳工	141,300	1,357,893.00	0.20
193	000400	许继电气	62,300	1,356,271.00	0.20
194	002683	广东宏大	39,800	1,350,812.00	0.20
195	001696	宗申动力	60,000	1,347,000.00	0.20
196	300919	中伟股份	40,800	1,341,504.00	0.20

197	300757	罗博特科	8,900	1,334,733.00	0.20
198	688188	柏楚电子	10,126	1,333,189.16	0.20
199	600637	东方明珠	177,200	1,323,684.00	0.19
200	000960	锡业股份	86,300	1,320,390.00	0.19
201	002607	中公教育	431,400	1,320,084.00	0.19
202	300724	捷佳伟创	24,300	1,319,490.00	0.19
203	600498	烽火通信	62,400	1,312,272.00	0.19
204	600884	杉杉股份	138,300	1,308,318.00	0.19
205	603939	益丰药房	53,264	1,303,370.08	0.19
206	300623	捷捷微电	43,500	1,296,300.00	0.19
207	600529	山东药玻	58,200	1,288,548.00	0.19
208	600563	法拉电子	11,800	1,287,262.00	0.19
209	300558	贝达药业	22,100	1,280,695.00	0.19
210	688568	中科星图	35,515	1,278,895.15	0.19
211	000039	中集集团	161,150	1,266,639.00	0.19
212	002739	万达电影	110,800	1,266,444.00	0.19
213	000415	渤海租赁	378,500	1,260,405.00	0.18
214	002841	视源股份	36,400	1,259,440.00	0.18
215	600486	扬农化工	21,460	1,244,680.00	0.18
216	002653	海思科	29,400	1,241,268.00	0.18
217	301358	湖南裕能	39,700	1,238,243.00	0.18
218	002025	航天电器	24,000	1,233,840.00	0.18
219	600901	江苏金租	203,500	1,233,210.00	0.18
220	002926	华西证券	137,740	1,231,395.60	0.18
221	000887	中鼎股份	69,100	1,215,469.00	0.18
222	002385	大北农	300,700	1,214,828.00	0.18
223	300285	国瓷材料	69,740	1,209,989.00	0.18
224	300763	锦浪科技	20,900	1,199,451.00	0.18
225	688017	绿的谐波	9,598	1,198,694.22	0.18
226	688114	华大智造	18,357	1,190,084.31	0.17
227	688582	芯动联科	17,609	1,183,324.80	0.17
228	002939	长城证券	141,200	1,183,256.00	0.17
229	300679	电连技术	26,000	1,179,880.00	0.17
230	600820	隧道股份	193,300	1,179,130.00	0.17
231	600863	内蒙华电	286,600	1,177,926.00	0.17
232	300144	宋城演艺	137,700	1,177,335.00	0.17
233	603486	科沃斯	20,200	1,176,246.00	0.17
234	002568	百润股份	45,900	1,175,499.00	0.17
235	600132	重庆啤酒	21,200	1,168,120.00	0.17
236	600008	首创环保	386,774	1,168,057.48	0.17
237	000723	美锦能源	269,600	1,164,672.00	0.17
238	600390	五矿资本	197,500	1,151,425.00	0.17
239	600516	方大炭素	247,500	1,148,400.00	0.17
240	002064	华峰化学	173,600	1,147,496.00	0.17
241	603568	伟明环保	59,837	1,141,689.96	0.17
242	002080	中材科技	58,400	1,138,800.00	0.17
243	600998	九州通	221,376	1,137,872.64	0.17
244	688538	和辉光电	485,872	1,136,940.48	0.17
245	600763	通策医疗	27,536	1,136,686.08	0.17
246	002312	川发龙蟒	99,000	1,136,520.00	0.17

247	000513	丽珠集团	31,442	1,133,169.68	0.17
248	600166	福田汽车	417,289	1,130,853.19	0.17
249	000703	恒逸石化	192,100	1,129,548.00	0.17
250	688183	生益电子	21,937	1,123,174.40	0.16
251	600170	上海建工	468,400	1,119,476.00	0.16
252	300487	蓝晓科技	22,200	1,116,660.00	0.16
253	002262	恩华药业	53,400	1,109,652.00	0.16
254	600208	衢州发展	373,700	1,106,152.00	0.16
255	601179	中国西电	180,034	1,105,408.76	0.16
256	603816	顾家家居	43,300	1,105,016.00	0.16
257	603589	口子窖	31,700	1,103,160.00	0.16
258	600312	平高电气	71,500	1,100,385.00	0.16
259	605358	立昂微	47,200	1,099,760.00	0.16
260	002500	山西证券	188,190	1,099,029.60	0.16
261	300676	华大基因	21,900	1,089,963.00	0.16
262	600021	上海电力	123,700	1,087,323.00	0.16
263	601155	新城控股	79,400	1,086,192.00	0.16
264	000683	博源化工	226,600	1,085,414.00	0.16
265	002203	海亮股份	104,800	1,081,536.00	0.16
266	600985	淮北矿业	94,600	1,072,764.00	0.16
267	600126	杭钢股份	118,700	1,068,300.00	0.16
268	600380	健康元	96,500	1,064,395.00	0.16
269	002244	滨江集团	108,800	1,060,800.00	0.16
270	002432	九安医疗	29,100	1,060,113.00	0.16
271	600583	海油工程	194,100	1,059,786.00	0.16
272	601000	唐山港	260,150	1,056,209.00	0.15
273	688728	格科微	68,520	1,055,208.00	0.15
274	600348	华阳股份	158,350	1,054,611.00	0.15
275	000403	派林生物	58,090	1,053,171.70	0.15
276	000591	太阳能	239,700	1,052,283.00	0.15
277	603338	浙江鼎力	22,200	1,052,280.00	0.15
278	000060	中金岭南	228,600	1,046,988.00	0.15
279	000921	海信家电	40,500	1,040,850.00	0.15
280	603885	吉祥航空	77,200	1,039,884.00	0.15
281	000629	钒钛股份	405,700	1,038,592.00	0.15
282	300567	精测电子	17,100	1,036,431.00	0.15
283	601991	大唐发电	326,700	1,035,639.00	0.15
284	603379	三美股份	21,460	1,032,655.20	0.15
285	600872	中炬高新	54,300	1,031,700.00	0.15
286	688278	特宝生物	14,297	1,030,956.67	0.15
287	002603	以岭药业	73,100	1,030,710.00	0.15
288	000830	鲁西化工	99,900	1,028,970.00	0.15
289	600535	天士力	65,600	1,026,640.00	0.15
290	600816	建元信托	345,900	1,020,405.00	0.15
291	002984	森麒麟	54,400	1,020,000.00	0.15
292	600095	湘财股份	100,400	1,007,012.00	0.15
293	002439	启明星辰	62,900	1,005,771.00	0.15
294	002056	横店东磁	70,900	1,003,235.00	0.15
295	300146	汤臣倍健	89,200	1,002,608.00	0.15
296	600970	中材国际	115,900	994,422.00	0.15

297	600499	科达制造	101,000	989,800.00	0.14
298	603927	中科软	51,100	988,274.00	0.14
299	601880	辽港股份	658,400	987,600.00	0.14
300	601016	节能风电	341,090	985,750.10	0.14
301	002423	中粮资本	80,500	984,515.00	0.14
302	603000	人民网	48,570	981,599.70	0.14
303	600685	中船防务	36,000	978,840.00	0.14
304	000062	深圳华强	36,400	977,704.00	0.14
305	000636	风华高科	70,900	974,166.00	0.14
306	601611	中国核建	105,800	972,302.00	0.14
307	300390	天华新能	50,900	970,663.00	0.14
308	601666	平煤股份	130,400	966,264.00	0.14
309	600511	国药股份	33,100	965,196.00	0.14
310	603298	杭叉集团	45,980	963,281.00	0.14
311	000958	电投产融	140,400	960,336.00	0.14
312	600859	王府井	69,100	959,799.00	0.14
313	300212	易华录	44,020	957,875.20	0.14
314	603737	三棵树	25,960	956,626.00	0.14
315	000563	陕国投 A	267,500	954,975.00	0.14
316	688297	中无人机	17,848	953,083.20	0.14
317	000155	川能动力	97,000	952,540.00	0.14
318	601456	国联民生	92,000	952,200.00	0.14
319	603077	和邦生物	543,040	950,320.00	0.14
320	600655	豫园股份	171,100	949,605.00	0.14
321	600004	白云机场	103,900	945,490.00	0.14
322	301308	江波龙	10,800	944,892.00	0.14
323	601966	玲珑轮胎	64,300	943,281.00	0.14
324	600483	福能股份	97,700	941,828.00	0.14
325	600325	华发股份	193,300	941,371.00	0.14
326	000598	兴蓉环境	130,400	940,184.00	0.14
327	603899	晨光股份	32,400	939,276.00	0.14
328	688520	神州细胞	15,663	937,430.55	0.14
329	603156	养元饮品	44,300	937,388.00	0.14
330	300677	英科医疗	39,540	936,307.20	0.14
331	002773	康弘药业	32,300	935,731.00	0.14
332	600131	国网信通	52,800	934,560.00	0.14
333	601958	金钼股份	85,000	929,900.00	0.14
334	688301	奕瑞科技	10,562	925,336.82	0.14
335	600663	陆家嘴	103,600	917,896.00	0.13
336	600378	昊华科技	33,900	917,673.00	0.13
337	000050	深天马 A	107,400	915,048.00	0.13
338	600282	南钢股份	216,600	909,720.00	0.13
339	600271	航天信息	97,900	904,596.00	0.13
340	002507	涪陵榨菜	70,680	903,997.20	0.13
341	300529	健帆生物	41,900	903,783.00	0.13
342	600598	北大荒	62,500	901,250.00	0.13
343	000987	越秀资本	131,250	900,375.00	0.13
344	000951	中国重汽	51,200	900,096.00	0.13
345	600754	锦江酒店	40,100	899,844.00	0.13
346	002756	永兴材料	28,300	898,525.00	0.13

347	601001	晋控煤业	73,500	898,170.00	0.13
348	688234	天岳先进	15,211	890,604.05	0.13
349	300601	康泰生物	58,500	888,615.00	0.13
350	600737	中粮糖业	93,900	887,355.00	0.13
351	600739	辽宁成大	80,600	886,600.00	0.13
352	301536	星辰科技	14,700	886,410.00	0.13
353	000559	万向钱潮	115,600	884,340.00	0.13
354	601918	新集能源	136,500	881,790.00	0.13
355	688363	华熙生物	16,970	871,409.50	0.13
356	600582	天地科技	145,345	870,616.55	0.13
357	002429	兆驰股份	197,900	866,802.00	0.13
358	603290	斯达半导	10,600	861,462.00	0.13
359	601333	广深铁路	297,900	860,931.00	0.13
360	300070	碧水源	190,055	855,247.50	0.13
361	600566	济川药业	32,400	853,092.00	0.12
362	601866	中远海发	345,067	852,315.49	0.12
363	688772	珠海冠宇	59,628	852,084.12	0.12
364	600764	中国海防	25,000	850,000.00	0.12
365	002120	韵达股份	126,700	848,890.00	0.12
366	600867	通化东宝	103,200	846,240.00	0.12
367	601231	环旭电子	57,800	845,614.00	0.12
368	603728	鸣志电器	14,700	844,809.00	0.12
369	300751	迈为股份	12,100	841,676.00	0.12
370	300735	光弘科技	33,500	840,850.00	0.12
371	003031	中瓷电子	15,740	837,525.40	0.12
372	603688	石英股份	23,750	836,475.00	0.12
373	300888	稳健医疗	20,340	835,974.00	0.12
374	002430	杭氧股份	42,983	834,729.86	0.12
375	600329	达仁堂	25,000	834,000.00	0.12
376	600258	首旅酒店	58,800	830,844.00	0.12
377	603341	龙旗科技	20,400	828,852.00	0.12
378	601098	中南传媒	63,100	827,872.00	0.12
379	688778	厦钨新能	14,795	827,336.40	0.12
380	600995	南网储能	84,200	823,476.00	0.12
381	688561	奇安信	23,977	814,738.46	0.12
382	600707	彩虹股份	126,000	813,960.00	0.12
383	601212	白银有色	260,000	813,800.00	0.12
384	688676	金盘科技	24,103	806,245.35	0.12
385	000032	深桑达 A	39,800	805,154.00	0.12
386	000027	深圳能源	124,780	796,096.40	0.12
387	600578	京能电力	176,400	792,036.00	0.12
388	603858	步长制药	48,600	789,264.00	0.12
389	002508	老板电器	41,300	785,113.00	0.11
390	603529	爱玛科技	22,700	780,880.00	0.11
391	000709	河钢股份	361,300	780,408.00	0.11
392	002299	圣农发展	54,600	780,234.00	0.11
393	600906	财达证券	114,000	777,480.00	0.11
394	300573	兴齐眼药	15,000	776,850.00	0.11
395	301498	乖宝宠物	7,100	776,527.00	0.11
396	688318	财富趋势	6,753	776,054.76	0.11

397	000967	盈峰环境	110,600	768,670.00	0.11
398	600517	国网英大	150,700	768,570.00	0.11
399	000883	湖北能源	169,600	764,896.00	0.11
400	002831	裕同科技	32,640	764,428.80	0.11
401	002670	国盛金控	50,740	763,637.00	0.11
402	600848	上海临港	84,000	761,880.00	0.11
403	600546	山煤国际	87,100	760,383.00	0.11
404	601399	国机重装	253,400	760,200.00	0.11
405	600959	江苏有线	219,630	755,527.20	0.11
406	601928	凤凰传媒	67,000	748,390.00	0.11
407	601156	东航物流	55,700	729,113.00	0.11
408	600968	海油发展	178,600	728,688.00	0.11
409	600808	马钢股份	210,355	725,724.75	0.11
410	600528	中铁工业	97,600	720,288.00	0.11
411	300595	欧普康视	47,000	717,690.00	0.10
412	000739	普洛药业	51,200	716,800.00	0.10
413	000825	太钢不锈	199,500	716,205.00	0.10
414	603225	新凤鸣	67,000	713,550.00	0.10
415	601118	海南橡胶	150,300	709,416.00	0.10
416	002572	索菲亚	50,585	708,695.85	0.10
417	601636	旗滨集团	141,400	708,414.00	0.10
418	603565	中谷物流	73,800	704,790.00	0.10
419	601608	中信重工	160,950	703,351.50	0.10
420	600977	中国电影	65,600	703,232.00	0.10
421	002266	浙富控股	228,300	703,164.00	0.10
422	301301	川宁生物	58,400	703,136.00	0.10
423	600801	华新水泥	59,000	698,560.00	0.10
424	600871	石化油服	356,700	695,565.00	0.10
425	000543	皖能电力	99,000	693,000.00	0.10
426	601598	中国外运	138,500	682,805.00	0.10
427	600062	华润双鹤	36,500	681,090.00	0.10
428	600056	中国医药	65,720	679,544.80	0.10
429	688387	信科移动	119,741	676,536.65	0.10
430	603650	彤程新材	21,000	675,150.00	0.10
431	601106	中国一重	240,899	674,517.20	0.10
432	688563	航材股份	11,838	670,385.94	0.10
433	000582	北部湾港	81,200	669,900.00	0.10
434	000785	居然智家	217,500	663,375.00	0.10
435	688702	盛科通信	10,815	660,580.20	0.10
436	300957	贝泰妮	14,800	654,456.00	0.10
437	603233	大参林	40,020	652,326.00	0.10
438	600925	苏能股份	121,000	632,830.00	0.09
439	600373	中文传媒	61,300	629,551.00	0.09
440	601965	中国汽研	35,200	624,800.00	0.09
441	002153	石基信息	71,634	620,350.44	0.09
442	000429	粤高速 A	45,700	609,181.00	0.09
443	000537	中绿电	72,300	604,428.00	0.09
444	600606	绿地控股	370,400	603,752.00	0.09
445	688281	华秦科技	9,578	579,564.78	0.08
446	601568	北元集团	139,600	579,340.00	0.08

447	600098	广州发展	92,400	577,500.00	0.08
448	002372	伟星新材	55,600	576,016.00	0.08
449	600361	创新新材	144,300	575,757.00	0.08
450	688425	铁建重工	140,474	573,133.92	0.08
451	001286	陕西能源	65,600	570,720.00	0.08
452	603658	安图生物	15,000	562,500.00	0.08
453	600612	老凤祥	11,100	552,225.00	0.08
454	003022	联泓新科	34,800	550,884.00	0.08
455	600688	上海石化	193,100	550,335.00	0.08
456	688349	三一重能	21,649	539,926.06	0.08
457	000937	冀中能源	92,700	533,025.00	0.08
458	601019	山东出版	54,700	518,009.00	0.08
459	301165	锐捷网络	8,380	515,034.80	0.08
460	002608	江苏国信	66,000	483,780.00	0.07
461	000898	鞍钢股份	208,400	483,488.00	0.07
462	601139	深圳燃气	75,900	482,724.00	0.07
463	600339	中油工程	147,000	480,690.00	0.07
464	688100	威胜信息	12,969	480,501.45	0.07
465	600032	浙江新能	63,300	478,548.00	0.07
466	603707	健友股份	42,587	474,845.05	0.07
467	688248	南网科技	14,898	468,691.08	0.07
468	600720	中交设计	60,400	466,892.00	0.07
469	000959	首钢股份	135,600	461,040.00	0.07
470	600928	西安银行	117,100	459,032.00	0.07
471	003035	南网能源	99,300	455,787.00	0.07
472	600295	鄂尔多斯	52,100	453,791.00	0.07
473	688032	禾迈股份	4,413	440,682.18	0.06
474	002461	珠江啤酒	38,700	436,923.00	0.06
475	688475	萤石网络	13,828	435,858.56	0.06
476	603556	海兴电力	17,100	435,537.00	0.06
477	601228	广州港	132,600	428,298.00	0.06
478	301267	华夏眼科	22,000	421,740.00	0.06
479	688172	燕东微	21,202	416,831.32	0.06
480	688375	国博电子	6,902	414,189.02	0.06
481	603786	科博达	7,100	393,411.00	0.06
482	600927	永安期货	25,600	379,136.00	0.06
483	601061	中信金属	47,400	374,934.00	0.05
484	002563	森马服饰	70,700	371,882.00	0.05
485	600007	中国国贸	17,700	364,266.00	0.05
486	000539	粤电力 A	77,800	353,212.00	0.05
487	600299	安迪苏	35,300	340,645.00	0.05
488	002945	华林证券	23,600	339,132.00	0.05
489	603826	坤彩科技	17,200	336,604.00	0.05
490	300140	节能环保	54,100	333,797.00	0.05
491	688819	天能股份	11,935	331,315.60	0.05
492	001213	中铁特货	77,600	315,056.00	0.05
493	601921	浙版传媒	39,000	314,340.00	0.05
494	601858	中国科传	13,800	268,410.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	7,657	237,443.57	0.03
496	601158	重庆水务	50,700	235,248.00	0.03

497	600956	新天绿能	27,100	209,212.00	0.03
498	001389	广合科技	3,400	199,818.00	0.03
499	688295	中复神鹰	8,811	183,268.80	0.03
500	603868	飞科电器	4,200	150,654.00	0.02
501	688775	影石创新	524	65,059.84	0.01
502	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
503	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
504	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
505	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
506	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
507	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
508	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
509	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
510	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
511	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
512	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
513	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
514	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
515	603049	中策橡胶	307	13,154.95	0.00
516	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
517	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
518	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
519	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
520	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
521	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
522	603202	天有为	98	8,884.68	0.00
523	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
524	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
525	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
526	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
527	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
528	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
529	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
530	400174	中天 3	537,300	5,373.00	0.00
531	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
532	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
533	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
534	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
535	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
536	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
537	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
538	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
539	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
540	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
541	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
542	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	688608	恒玄科技	3,138,363.23	0.41
2	688235	百济神州	2,903,819.14	0.38
3	000933	神火股份	2,382,611.00	0.31
4	300450	先导智能	2,119,966.00	0.28
5	002130	沃尔核材	2,042,744.00	0.27
6	300454	深信服	2,032,626.00	0.27
7	300458	全志科技	1,990,098.00	0.26
8	600363	联创光电	1,989,680.00	0.26
9	688120	华海清科	1,896,220.90	0.25
10	300346	南大光电	1,864,106.80	0.25
11	002851	麦格米特	1,817,844.00	0.24
12	300115	长盈精密	1,774,487.00	0.23
13	300857	协创数据	1,767,747.80	0.23
14	605589	圣泉集团	1,663,642.00	0.22
15	600171	上海贝岭	1,661,934.00	0.22
16	603659	璞泰来	1,599,299.00	0.21
17	002007	华兰生物	1,580,282.00	0.21
18	300627	华测导航	1,533,506.40	0.20
19	688027	国盾量子	1,498,520.89	0.20
20	002837	英维克	1,415,095.20	0.19

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	600418	江淮汽车	8,213,578.68	1.08
2	002625	光启技术	5,190,937.00	0.68
3	002384	东山精密	3,964,391.00	0.52
4	688047	龙芯中科	2,964,272.72	0.39
5	301236	软通动力	2,776,836.62	0.37
6	302132	中航成飞	2,234,856.00	0.29
7	300866	安克创新	2,088,304.00	0.28
8	002128	电投能源	1,937,710.00	0.26
9	600642	申能股份	1,898,964.10	0.25
10	688120	华海清科	1,873,444.67	0.25
11	601567	三星医疗	1,850,666.00	0.24
12	688072	拓荆科技	1,572,489.59	0.21
13	688617	惠泰医疗	1,507,341.54	0.20
14	688536	思瑞浦	1,384,300.86	0.18
15	603444	吉比特	1,266,895.00	0.17
16	002407	多氟多	1,237,125.80	0.16
17	688005	容百科技	1,236,407.65	0.16

18	688331	荣昌生物	1,197,654.62	0.16
19	600416	湘电股份	1,190,066.00	0.16
20	688213	思特威	1,122,891.75	0.15

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	127,753,303.36
卖出股票的收入（成交）总额	175,015,233.79

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，东吴证券股份有限公司在报告编制前一年受到中国证券监督管理委员会的处罚。胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制前一年受到中华人民共和国梅沙海关的处罚。苏州银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局江苏监管局、国家金融监督管理总局泰州监管分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,531,586.84
2	应收清算款	1,532,138.91
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	6,063,725.75

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

持有人 户数	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

(户)						指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,872	49,409.77	4,458,965.00	4.82%	12,562,528.00	13.58%	75,473,605.00	81.60%

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	招商证券股份有限公司	1,413,828.00	1.53%
2	孙雪理	1,266,376.00	1.37%
3	罗志中	900,000.00	0.97%
4	中国农业再保险股份有限公司—农行专户四	720,000.00	0.78%
5	白巍	505,000.00	0.55%
6	宋丹丹	501,700.00	0.54%
7	方正证券股份有限公司	484,287.00	0.52%
8	广发证券股份有限公司	394,212.00	0.43%
9	中信证券股份有限公司	362,234.00	0.39%
10	长城基金—兴业银行—长城基金泓湖百世自动驾驶1号集合资产管理计划	215,600.00	0.23%
—	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	75,473,605.00	81.60%

注：1. 以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

2. 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	107,695,098.00
本报告期基金总申购份额	8,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	92,495,098.00

§ 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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及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 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	13,746,146.36	4.57%	2,831.95	4.57%	—
国泰海通	2	47,842,291.18	15.91%	9,850.94	15.90%	增加 1 个
中金公司	2	18,919,085.73	6.29%	3,897.95	6.29%	—
长江证券	2	51,978,920.16	17.29%	10,702.69	17.28%	—
中信建投	2	44,593,216.61	14.83%	9,185.32	14.83%	—
中信证券	2	1,048,927.02	0.35%	216.15	0.35%	—
招商证券	3	122,581,203.12	40.76%	25,259.54	40.78%	—

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

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

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

（3）本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

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	—	—	—	—	—	—
国泰海通	29,580.90	100.00%	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时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	2025-06-26
2	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	2025-06-26

3	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-20250606	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
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-20250603	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增万和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	2025-04-25
6	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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	2025-04-22
7	博时基金管理有限公司关于运用公司固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	2025-04-08
8	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-20250408	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
9	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2025-03-31
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
12	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	2025-03-22
13	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	2025-03-21
14	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	2025-03-19
15	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
16	关于博时基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
17	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2025-01-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
招商银行股份有限公司－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	1	2025-01-01~2025-06-30	83,936,005.00	2,020,600.00	10,483,000.00	75,473,605.00	81.60%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：1. 申购份额包含红利再投资份额和买入份额，赎回份额包含卖出份额。
2. 份额占比为四舍五入后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日