博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
2020 年中期报告
2020 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 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 境外投资顾问和境外资产托管人 5
2.5 信息披露方式 5
2.6 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 6
§4 管理人报告 6
4.1 基金管理人及基金经理情况 6
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 8
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 8
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 10
4.9 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的真实、准确和完整发表意见 10
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 10
6.1 资产负债表 10
6.2 利润表 11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 12
6.4 报表附注 13
§7 投资组合报告 26
7.1 期末基金资产组合情况 26
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 27
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 27
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 27
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 49
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 49
7.11 投资组合报告附注 49
§8 基金份额持有人信息 50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50
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 51

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 51
§9 开放式基金份额变动 51
§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 52
10.4 基金投资策略的改变 52
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 52
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 52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 52
10.8 其他重大事件 53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 54
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	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时标普 500ETF
场内简称	证券简称：标普 500，扩位证券简称：标普 500ETF
基金主代码	513500
交易代码	513500
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013 年 12 月 5 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	996,819,285.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 15 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	本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。 同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。 为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。
业绩比较基准	标普 500 指数（S&P 500 Index（NTR，Net total Return））（经估值汇率调整，以人民币计价）
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，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。 本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票，投资者需承担汇率风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		江向阳	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

2.6 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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	19,107,436.79
本期利润	17,921,187.63
加权平均基金份额本期利润	0.0195
本期加权平均净值利润率	0.99%
本期基金份额净值增长率	-2.18%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2020 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	336,392,214.30
期末可供分配基金份额利润	0.3375
期末基金资产净值	2,056,218,396.34
期末基金份额净值	2.0628
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2020 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	106.28%

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

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

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

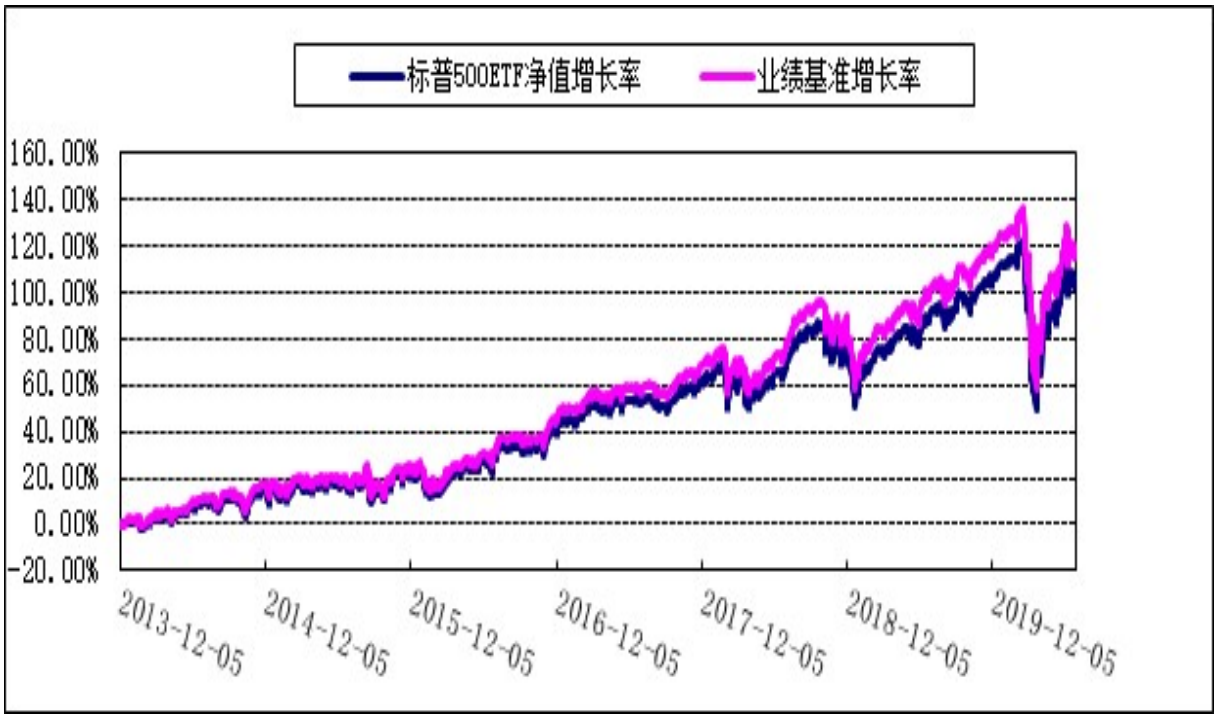
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	1.13%	1.84%	1.20%	1.84%	-0.07%	0.00%
过去三个月	20.07%	2.04%	20.27%	2.05%	-0.20%	-0.01%
过去六个月	-2.18%	3.03%	-1.94%	3.04%	-0.24%	-0.01%
过去一年	9.14%	2.17%	10.05%	2.18%	-0.91%	-0.01%
过去三年	35.79%	1.46%	39.37%	1.46%	-3.58%	0.00%
过去五年	79.11%	1.26%	86.93%	1.26%	-7.82%	0.00%
自基金合同生效起至今	106.28%	1.15%	119.39%	1.16%	-13.11%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：标普 500 指数（S&P 500 Index（NTR，Net total Return））（经估值汇率调整，以人民币计价）

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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理

224 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 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020“Best of the Best Awards”三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获 “中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	基金经理	2015-10-08	-	13.3	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)的基金经理。现任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—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—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—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年

					10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日—至今)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日—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—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—至今)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日—至今)的基金经理。
汪洋	指数与量化投资部副总经理/基金经理	2016-05-16	-	11.1	汪洋先生，硕士。2009 年起先后在华泰联合证券、华泰柏瑞基金、汇添富基金工作。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任指数投资部总经理助理、指数投资部副总经理。现任指数与量化投资部副总经理兼博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2016 年 5 月 16 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2016 年 5 月 16 日—至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(2016 年 5 月 16 日—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(2016 年 5 月 16 日—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—至今)的基金经理。

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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 93 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，受到新冠肺炎疫情的影响，美股大幅震荡，市场波动剧烈。从经济基本面上来看，一季度由于疫情的影响，对经济基本面冲击较大，随着二季度的经济重启，经济修复好于预期，各项经济指标迅速回升，但是随着疫情的反复，经济复苏再度放缓。从最新的经济数据来看，美国经济大概率不会出现一季度断崖式的下滑。2020 年 6 月，芝加哥联储全美活动指数达到 4.11，高于预期值 4 与上期值 2.61，显示美国整体经济活动超预期回暖。2020 年 7 月，美国 Markit PMI 指数自 2020 年 2 月以来首次站上荣枯线 50，高于上期值 47.9，显示经济逐步好转。从货币政策上来看，宽松的货币政策，给市场带来了很好的流动性。从市场情绪上来看，良好的经济数据提振了投资者的信心，标普 500 指数在上半年先大跌而后大涨，半年度指数下跌了 4.04%。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 2.0628 元，份额累计净值为 2.0628 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-2.18%，同期业绩基准增长率-1.94%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年下半年，随着新冠疫情的反复，美国经济复苏的节奏将会放缓。6 月中下旬疫情的反弹，对近期经济复苏的节奏造成一定的拖累，经济前景也存在较大的不确定性。7 月 FOMC 会议上，美联储宣布维持政策利率不变，将延续宽松的货币政策，以促进经济复苏。疫情的反复加上美国大选，美联储也将会更加谨慎的调整货币政策。下半年市场主要的不确定性，一方面来自于疫情明显反弹带来的经济不确定性，另一方面来自于美国大选带来的不确定性。

4.7 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副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、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。

4.8 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。

4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	70,266,881.75	93,109,307.81
结算备付金		44,441,261.65	17,931,023.37
存出保证金		9,005,124.00	3,340,204.56
交易性金融资产	6.4.3.2	1,937,990,335.36	1,386,339,745.15
其中：股票投资		1,937,990,335.36	1,386,339,745.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		7,491,345.59	94,660.46
应收利息	6.4.3.5	625.65	6,758.85
应收股利		1,378,424.31	1,202,281.17
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		**2,070,573,998.31**	**1,502,023,981.37**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,405,249.85	22,712,296.98
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,019,348.08	695,490.82
应付托管费		424,728.37	289,787.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	-	-
应交税费		233,333.97	32,255.95
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	272,941.70	372,888.13
负债合计		**14,355,601.97**	**24,102,719.69**
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	996,819,285.00	700,819,285.00
未分配利润	6.4.3.10	1,059,399,111.34	777,101,976.68
所有者权益合计		**2,056,218,396.34**	**1,477,921,261.68**
负债和所有者权益总计		**2,070,573,998.31**	**1,502,023,981.37**

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0628 元，基金份额总额 996,819,285.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		**26,350,286.39**	**135,338,148.83**
1.利息收入		51,848.99	147,080.11
其中：存款利息收入	6.4.3.11	51,848.99	147,080.11
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		25,310,765.70	17,851,806.08
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-1,114,782.78	5,965,577.27
基金投资收益	6.4.3.13	-	-
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	7,665,909.72	4,692,927.68
股利收益	6.4.3.16	18,759,638.76	7,193,301.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-1,186,249.16	117,446,955.61
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		617,447.44	-392,771.19
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	1,556,473.42	285,078.22
减：二、费用		**8,429,098.76**	**3,905,683.49**
1．管理人报酬		5,374,737.81	2,455,021.02
2．托管费		2,239,474.11	1,022,925.49
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.3.19	155,006.00	54,179.62
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		27,512.34	17,005.85
7．其他费用	6.4.3.20	632,368.50	356,551.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**17,921,187.63**	**131,432,465.34**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**17,921,187.63**	**131,432,465.34**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	700,819,285.00	777,101,976.68	1,477,921,261.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,921,187.63	17,921,187.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	296,000,000.00	264,375,947.03	560,375,947.03
其中：1.基金申购款	334,000,000.00	304,734,738.77	638,734,738.77
2.基金赎回款	-38,000,000.00	-40,358,791.74	-78,358,791.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	996,819,285.00	1,059,399,111.34	2,056,218,396.34
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	438,819,285.00	264,116,682.50	702,935,967.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	131,432,465.34	131,432,465.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	44,000,000.00	34,197,256.08	78,197,256.08
其中：1.基金申购款	138,000,000.00	105,372,721.91	243,372,721.91
2.基金赎回款	-94,000,000.00	-71,175,465.83	-165,175,465.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	482,819,285.00	429,746,403.92	912,565,688.92

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：成江

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值

税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、沪府发[2011]2 号《上海市人民政府关于本市开征地方教育附加的通知》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。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入和利息收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	70,266,881.75
定期存款	-
其他存款	-
合计	70,266,881.75

注：于 2020 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为美元 9,309,972.37（折合人民币 65,909,949.4 元）。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		1,671,226,740.18	1,937,990,335.36	266,763,595.18
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		1,671,226,740.18	1,937,990,335.36	266,763,595.18

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注（投资成本）
		资产	负债	
利率衍生工具	-			-
货币衍生工具	-			-
权益衍生工具	118,177,215.62			-
其中：股指期货	118,177,215.62			-
指数期权	-			-
股票期权	-			-
其他衍生工具	-			-
合计	118,177,215.62			-

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，具体投资情况详见下表：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量（买/卖）	合约价值（人民币元）	公允价值变动（人民币元）
股指期货	ESU0	S&P500 EMINI FUT Sep20	106	115,948,475.77	-1,049,917.11
总额合计					-1,049,917.11
减：可抵消期货暂收款					-1,049,917.11
股指期货投资净额					0.00

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	625.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-

应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	625.65

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

无余额。

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,481.66
应付标普指数使用费	178,460.04
合计	272,941.70

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	700,819,285.00	700,819,285.00
本期申购	334,000,000.00	334,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-38,000,000.00	-38,000,000.00
本期末	996,819,285.00	996,819,285.00

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	224,910,095.57	552,191,881.11	777,101,976.68
本期利润	19,107,436.79	-1,186,249.16	17,921,187.63
本期基金份额交易产生的变动数	92,374,681.94	172,001,265.09	264,375,947.03
其中：基金申购款	104,291,364.12	200,443,374.65	304,734,738.77
基金赎回款	-11,916,682.18	-28,442,109.56	-40,358,791.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	336,392,214.30	723,006,897.04	1,059,399,111.34

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	51,848.99
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	-
其他	-
合计	51,848.99

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	31,349,998.47
减：卖出股票成本总额	32,464,781.25
买卖股票差价收入	-1,114,782.78

6.4.3.13 基金投资收益

无发生额

6.4.3.14 债券投资收益

无发生额。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	5,359.19
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	172.87
买卖权证差价收入	5,186.32

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
期货投资收益	7,660,723.40
合计	7,660,723.40

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,759,638.76

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	18,759,638.76

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	1,626,937.38
——股票投资	1,626,937.38
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-2,813,186.54
——权证投资	-
——期货投资	-2,813,186.54
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,186,249.16

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,556,473.42
其他	-
合计	1,556,473.42

注：替代损益指投资者以退补现金替代方式申赎本基金时，代理买卖的被替代股票的实际成本与申赎日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申赎日估值的差额。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	155,006.00
银行间市场交易费用	-
合计	155,006.00

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
标普指数使用费	537,508.84
银行汇划费用	378.00

合计	632,368.50

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费。指数使用费取按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率每日计提金额及按指数使用协议规定的费用下限 10 万美元均摊到每日计提的累计金额的孰高者。自 2018 年 12 月 14 日起指数使用费取按前一日基金资产净值的 0.06%的年费率每日计提金额及按指数使用协议规定的费用下限 6 万美元均摊到每日计提的累计金额的孰高者 。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司("博时基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金("标普 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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,374,737.81	2,455,021.02
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 0.60%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 X 0.60% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,239,474.11	1,022,925.49

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
招商证券股份有限公司	1,601,300.00	0.16%	1,124,382.00	0.16%
博时标普 500ETF 联接	418,745,350.00	42.01%	480,599,160.00	68.58%

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
工商银行	4,357,768.23	72,115.69	17,161,656.54	93,044.17
布朗兄弟哈里曼银行	65,909,113.52	-	4,594,777.93	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

本基金于本会计期间无利润分配。

6.4.8 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式投资的股票指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪美国市场股票指数，目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益特征的开放式基金。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行及境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险不重大。

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。于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.3 流动性风险

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 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。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%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,357,768.23	-	-	65,909,113.52	70,266,881.75
结算备付金	-	-	-	44,441,261.65	44,441,261.65
存出保证金	-	-	-	9,005,124.00	9,005,124.00
交易性金融资产	-	-	-	1,937,990,335.36	1,937,990,335.36
应收证券清算款				7,491,345.59	7,491,345.59
应收利息	-	-	-	625.65	625.65
应收股利	-	-	-	1,378,424.31	1,378,424.31
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**4,357,768.23**	**-**	**-**	**2,066,216,230.08**	**2,070,573,998.31**
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,405,249.85	12,405,249.85
应付管理人报酬	-	-	-	1,019,348.08	1,019,348.08
应付托管费	-	-	-	424,728.37	424,728.37
应交税费	-	-	-	233,333.97	233,333.97
其他负债	-	-	-	272,941.70	272,941.70
负债总计	**-**	**-**	**-**	**14,355,601.97**	**14,355,601.97**
利率敏感度缺口	**4,357,768.23**	**-**	**-**	**2,051,860,628.11**	**2,056,218,396.34**
上年度末 2019 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	26,273,297.01	-	-	66,836,010.80	93,109,307.81
结算备付金	4,642,171.68	-	-	13,288,851.69	17,931,023.37
存出保证金	-	-	-	3,340,204.56	3,340,204.56
交易性金融资产	-	-	-	1,386,339,745.15	1,386,339,745.15
应收利息	-	-	-	6,758.85	6,758.85
应收股利	-	-	-	1,202,281.17	1,202,281.17
其他资产	-	-	-	94,660.46	94,660.46
资产总计	**30,915,468.69**	**-**	**-**	**1,471,108,512.68**	**1,502,023,981.37**
负债					
应付证券清算款	-	-	-	22,712,296.98	22,712,296.98
应付管理人报酬	-	-	-	695,490.82	695,490.82
应付托管费	-	-	-	289,787.81	289,787.81
应交税费	-	-	-	32,255.95	32,255.95
其他负债	-	-	-	372,888.13	372,888.13
负债总计	**-**	**-**	**-**	**24,102,719.69**	**24,102,719.69**
利率敏感度缺口	**30,915,468.69**	**-**	**-**	**1,447,005,792.99**	**1,477,921,261.68**

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.00%（2019 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	65,909,949.40	65,909,949.40
结算备付金	44,441,261.65	44,441,261.65
存出保证金	9,005,124.00	9,005,124.00
交易性金融资产	1,937,990,335.36	1,937,990,335.36
应收证券清算款	7,491,345.59	7,491,345.59
应收利息	-	-
应收股利	1,378,424.31	1,378,424.31
其他资产	-	-
资产合计	**2,066,216,440.31**	**2,066,216,440.31**
以外币计价的负债		
其他负债	178,460.04	178,460.04
负债合计	**178,460.04**	**178,460.04**
资产负债表外汇风险敞口净额	**2,066,037,980.27**	**2,066,037,980.27**
项目	上年度末 2019年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
银行存款	66,836,727.12	66,836,727.12
结算备付金	13,288,851.69	13,288,851.69
存出保证金	3,340,204.56	3,340,204.56
交易性金融资产	1,386,339,745.15	1,386,339,745.15
应收股利	1,202,281.17	1,202,281.17
资产合计	**1,471,007,809.69**	**1,471,007,809.69**
以外币计价的负债		
应付证券清算款	20,178,491.91	20,178,491.91
其他负债	202,888.13	202,888.13
负债合计	**20,381,380.04**	**20,381,380.04**
资产负债表外汇风险敞口净额	**1,450,626,429.65**	**1,450,626,429.65**

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 10,330	增加约 7,253
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 10,330	减少约 7,253

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的基金和股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪标普 500 指数指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，标普 500 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	1,937,990,335.36	94.25	1,386,339,745.15	93.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,937,990,335.36	94.25	1,386,339,745.15	93.80

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金还持有衍生金融工具，具体信息请参考附注 6.4.3.3 衍生金融资产/负债。（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除标普 500 净总收益指数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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 10,260	增加约 7,462
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 10,260	减少约 7,462

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

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：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层次：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,937,990,335.36 元，无属于第二层次和第三层次的余额。(2019 年 12 月 31 日：第一层次余额为 1,386,339,745.15 元，无属于第二层次和第三层次的余额。)

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,937,990,335.36	93.60
	其中：普通股	1,884,039,037.86	90.99
	存托凭证	-	-

	优先股	-	-
	房地产信托凭证	53,951,297.50	2.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	114,708,143.40	5.54
8	其他各项资产	17,875,519.55	0.86
9	合计	2,070,573,998.31	100.00

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金还持有衍生金融工具，具体信息请参考附注 6.4.3.3。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	1,937,990,335.36	94.25
合计	1,937,990,335.36	94.25

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	54,759,297.26	2.66
原材料	48,915,184.73	2.38
工业	154,857,254.49	7.53
非日常生活消费品	209,697,923.80	10.20
日常消费品	135,020,950.64	6.57
医疗保健	283,506,870.30	13.79
金融	195,394,572.59	9.50
信息技术	532,297,536.53	25.89
电信业务	209,016,136.17	10.17
公用事业	59,427,548.22	2.89
房地产	55,097,060.63	2.68
合计	1,937,990,335.36	94.25

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	80,981.00	116,673,298.41	5.67
2	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	43,508.00	112,363,830.41	5.46
3	AMAZON.COM INC	-	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	4,474.00	87,381,990.13	4.25
4	ALPHABET INC-CL A	-	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	3,204.00	32,165,228.26	1.56
	ALPHABET INC-CL C	-	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	3,124.00	31,263,904.83	1.52
5	FACEBOOK INC-CLASS A	-	FB US	纳斯达克交易所	美国	25,678.00	41,278,465.15	2.01
6	JOHNSON & JOHNSON	-	JNJ US	纽约证券交易所	美国	28,133.00	28,008,935.86	1.36
7	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	-	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	20,760.00	26,235,689.67	1.28
8	VISA INC-CLASS A SHARES	-	V US	纽约证券交易所	美国	18,016.00	24,637,727.02	1.20
9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	-	PG US	纽约证券交易所	美国	26,437.00	22,378,809.86	1.09
10	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	32,538.00	21,666,981.64	1.05
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	-	UNH US	纽约证券交易所	美国	10,127.00	21,146,173.76	1.03
12	HOME DEPOT INC	-	HD US	纽约证券交易所	美国	11,486.00	20,370,254.97	0.99
13	MASTERCARD INC - A	-	MA US	纽约证券交易所	美国	9,438.00	19,757,586.12	0.96
14	INTEL CORP	-	INTC US	纳斯达克交易所	美国	45,214.00	19,151,135.05	0.93
15	NVIDIA CORP	-	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	6,568.00	17,665,114.45	0.86
16	VERIZON COMMUNICATIONS INC	-	VZ US	纽约证券交易所	美国	44,188.00	17,246,259.79	0.84
17	AT&T INC	-	T US	纽约证券交易所	美国	76,085.00	16,283,200.79	0.79
18	ADOBE INC	-	ADBE US	纳斯达克交易所	美国	5,145.00	15,855,743.41	0.77
19	PAYPAL HOLDINGS INC	-	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	12,539.00	15,466,371.05	0.75
20	WALT DISNEY CO/THE	-	DIS US	纽约证券交易所	美国	19,288.00	15,226,623.15	0.74
21	NETFLIX INC	-	NFLX US	纳斯达克	美国	4,696.00	15,127,955.87	0.74

				交易所				
22	CISCO SYSTEMS INC	-	CSCO US	纳斯达克交易所	美国	45,287.00	14,953,218.52	0.73
23	MERCK & CO. INC.	-	MRK US	纽约证券交易所	美国	26,954.00	14,756,175.79	0.72
24	EXXON MOBIL CORP	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	45,152.00	14,294,908.28	0.70
25	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC US	纽约证券交易所	美国	83,379.00	14,019,188.72	0.68
26	PEPSICO INC	-	PEP US	纳斯达克交易所	美国	14,817.00	13,873,670.81	0.67
27	PFIZER INC	-	PFE US	纽约证券交易所	美国	59,317.00	13,731,864.74	0.67
28	COMCAST CORP-CLASS A	-	CMCSA US	纳斯达克交易所	美国	48,637.00	13,421,813.51	0.65
29	ABBVIE INC	-	ABBV US	纽约证券交易所	美国	18,820.00	13,081,129.13	0.64
30	COCA-COLA CO/THE	-	KO US	纽约证券交易所	美国	41,276.00	13,056,096.59	0.63
31	WALMART INC	-	WMT US	纽约证券交易所	美国	15,121.00	12,822,343.53	0.62
32	SALESFORCE.COM INC	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	9,621.00	12,759,396.51	0.62
33	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	19,937.00	12,594,278.36	0.61
34	ABBOTT LABORATORIES	-	ABT US	纽约证券交易所	美国	18,888.00	12,225,799.80	0.59
35	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	-	TMO US	纽约证券交易所	美国	4,218.00	10,819,954.67	0.53
36	AMGEN INC	-	AMGN US	纳斯达克交易所	美国	6,282.00	10,489,500.61	0.51
37	ELI LILLY & CO	-	LLY US	纽约证券交易所	美国	8,994.00	10,453,836.92	0.51
38	MCDONALD'S CORP	-	MCD US	纽约证券交易所	美国	7,941.00	10,370,591.55	0.50
39	ACCENTURE PLC-CL A	-	ACN US	纽约证券交易所	美国	6,802.00	10,339,789.85	0.50
40	COSTCO WHOLESALE CORP	-	COST US	纳斯达克交易所	美国	4,715.00	10,121,102.04	0.49
41	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	-	BMY US	纽约证券交易所	美国	24,163.00	10,058,443.16	0.49
42	BROADCOM INC	-	AVGO US	纳斯达克交易所	美国	4,269.00	9,538,487.09	0.46
43	MEDTRONIC PLC	-	MDT US	纽约证券交易所	美国	14,321.00	9,297,052.14	0.45
44	NIKE INC -CL B	-	NKE US	纽约证券交易所	美国	13,242.00	9,191,867.76	0.45
45	NEXTERA ENERGY INC	-	NEE US	纽约证券交易所	美国	5,226.00	8,885,681.65	0.43
46	TEXAS INSTRUMENTS INC	-	TXN US	纳斯达克	美国	9,801.00	8,809,963.21	0.43

				交易所				
47	ORACLE CORP	-	ORCL US	纽约证券交易所	美国	22,226.00	8,696,677.41	0.42
48	UNION PACIFIC CORP	-	UNP US	纽约证券交易所	美国	7,247.00	8,674,159.43	0.42
49	AMERICAN TOWER CORP	-	AMT US	纽约证券交易所	美国	4,733.00	8,662,970.49	0.42
50	LINDE PLC	-	LIN US	纽约证券交易所	美国	5,609.00	8,422,658.07	0.41
51	DANAHER CORP	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	6,720.00	8,412,552.86	0.41
52	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	-	PM US	纽约证券交易所	美国	16,627.00	8,246,821.91	0.40
53	INTL BUSINESS MACHINES CORP	-	IBM US	纽约证券交易所	美国	9,481.00	8,106,171.71	0.39
54	CITIGROUP INC	-	C US	纽约证券交易所	美国	22,231.00	8,042,341.03	0.39
55	QUALCOMM INC	-	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	12,013.00	7,757,048.72	0.38
56	LOWE'S COS INC	-	LOW US	纽约证券交易所	美国	8,063.00	7,712,920.99	0.38
57	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	-	HON US	纽约证券交易所	美国	7,495.00	7,672,068.66	0.37
58	BOEING CO/THE	-	BA US	纽约证券交易所	美国	5,724.00	7,427,876.53	0.36
59	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	纳斯达克交易所	美国	13,391.00	7,294,033.91	0.35
60	WELLS FARGO & CO	-	WFC US	纽约证券交易所	美国	39,842.00	7,220,772.84	0.35
61	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	-	RTX US	纽约证券交易所	美国	15,705.00	6,851,130.20	0.33
62	LOCKHEED MARTIN CORP	-	LMT US	纽约证券交易所	美国	2,636.00	6,809,977.21	0.33
63	3M CO	-	MMM US	纽约证券交易所	美国	6,143.00	6,783,906.59	0.33
64	STARBUCKS CORP	-	SBUX US	纳斯达克交易所	美国	12,474.00	6,498,709.57	0.32
65	CVS HEALTH CORP	-	CVS US	纽约证券交易所	美国	13,957.00	6,419,593.54	0.31
66	BLACKROCK INC	-	BLK US	纽约证券交易所	美国	1,647.00	6,344,054.85	0.31
67	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	6,597.00	6,262,467.15	0.30
68	S&P GLOBAL INC	-	SPGI US	纽约证券交易所	美国	2,573.00	6,001,660.57	0.29
69	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	-	UPS US	纽约证券交易所	美国	7,518.00	5,917,408.85	0.29
70	SERVICENOW INC	-	NOW US	纽约证券交易所	美国	2,036.00	5,838,478.94	0.28
71	INTUIT INC	-	INTU US	纳斯达克	美国	2,784.00	5,837,705.86	0.28

				交易所				
72	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	-	CHTR US	纳斯达克交易所	美国	1,610.00	5,813,433.37	0.28
73	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	-	VRTX US	纳斯达克交易所	美国	2,768.00	5,688,931.02	0.28
74	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	-	MDLZ US	纳斯达克交易所	美国	15,244.00	5,517,944.38	0.27
75	ALTRIA GROUP INC	-	MO US	纽约证券交易所	美国	19,845.00	5,514,337.59	0.27
76	BECTON DICKINSON AND CO	-	BDX US	纽约证券交易所	美国	3,148.00	5,332,434.87	0.26
77	CROWN CASTLE INTL CORP	-	CCI US	纽约证券交易所	美国	4,450.00	5,272,156.75	0.26
78	CIGNA CORP	-	CI US	纽约证券交易所	美国	3,941.00	5,235,493.08	0.25
79	PROLOGIS INC	-	PLD US	纽约证券交易所	美国	7,887.00	5,211,175.42	0.25
80	CATERPILLAR INC	-	CAT US	纽约证券交易所	美国	5,780.00	5,176,318.02	0.25
81	DOMINION ENERGY INC	-	D US	纽约证券交易所	美国	8,961.00	5,150,010.45	0.25
82	INTUITIVE SURGICAL INC	-	ISRG US	纳斯达克交易所	美国	1,245.00	5,022,468.80	0.24
83	ANTHEM INC	-	ANTM US	纽约证券交易所	美国	2,693.00	5,013,738.29	0.24
84	BOOKING HOLDINGS INC	-	BKNG US	纳斯达克交易所	美国	438.00	4,937,561.31	0.24
85	ZOETIS INC	-	ZTS US	纽约证券交易所	美国	5,072.00	4,920,725.98	0.24
86	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	ADP US	纳斯达克交易所	美国	4,590.00	4,838,166.41	0.24
87	REGENERON PHARMACEUTICALS	-	REGN US	纳斯达克交易所	美国	1,077.00	4,755,095.20	0.23
88	AMERICAN EXPRESS CO	-	AXP US	纽约证券交易所	美国	7,049.00	4,750,803.25	0.23
89	COLGATE-PALMOLIVE CO	-	CL US	纽约证券交易所	美国	9,147.00	4,744,038.22	0.23
90	EQUINIX INC	-	EQIX US	纳斯达克交易所	美国	945.00	4,698,476.54	0.23
91	ADVANCED MICRO DEVICES	-	AMD US	纳斯达克交易所	美国	12,506.00	4,657,890.90	0.23
92	GOLDMAN SACHS GROUP INC	-	GS US	纽约证券交易所	美国	3,305.00	4,623,862.86	0.22
93	TJX COMPANIES INC	-	TJX US	纽约证券交易所	美国	12,792.00	4,578,762.34	0.22
94	TARGET CORP	-	TGT US	纽约证券交易所	美国	5,340.00	4,533,897.28	0.22
95	GENERAL ELECTRIC CO	-	GE US	纽约证券交易所	美国	93,406.00	4,516,458.92	0.22
96	T-MOBILE US INC	-	TMUS US	纳斯达克	美国	6,085.00	4,486,652.59	0.22

				交易所				
97	DUKE ENERGY CORP	-	DUK US	纽约证券交易所	美国	7,847.00	4,438,116.11	0.22
98	ACTIVISION BLIZZARD INC	-	ATVI US	纳斯达克交易所	美国	8,227.00	4,420,647.23	0.21
99	CME GROUP INC	-	CME US	纳斯达克交易所	美国	3,829.00	4,406,037.69	0.21
100	STRYKER CORP	-	SYK US	纽约证券交易所	美国	3,442.00	4,390,804.87	0.21
101	MORGAN STANLEY	-	MS US	纽约证券交易所	美国	12,787.00	4,372,384.86	0.21
102	MICRON TECHNOLOGY INC	-	MU US	纳斯达克交易所	美国	11,876.00	4,331,602.84	0.21
103	CHUBB LTD	-	CB US	纽约证券交易所	美国	4,820.00	4,320,678.32	0.21
104	APPLIED MATERIALS INC	-	AMAT US	纳斯达克交易所	美国	9,787.00	4,188,403.17	0.20
105	FISERV INC	-	FISV US	纳斯达克交易所	美国	6,006.00	4,150,751.34	0.20
106	MARSH & MCLENNAN COS	-	MMC US	纽约证券交易所	美国	5,448.00	4,141,165.98	0.20
107	SOUTHERN CO/THE	-	SO US	纽约证券交易所	美国	11,276.00	4,139,104.72	0.20
108	ILLUMINA INC	-	ILMN US	纳斯达克交易所	美国	1,570.00	4,116,371.74	0.20
109	CSX CORP	-	CSX US	纳斯达克交易所	美国	8,175.00	4,036,196.40	0.20
110	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	-	APD US	纽约证券交易所	美国	2,358.00	4,030,803.09	0.20
111	AUTODESK INC	-	ADSK US	纳斯达克交易所	美国	2,341.00	3,964,122.06	0.19
112	HUMANA INC	-	HUM US	纽约证券交易所	美国	1,412.00	3,876,047.49	0.19
113	GLOBAL PAYMENTS INC	-	GPN US	纽约证券交易所	美国	3,195.00	3,836,635.20	0.19
114	TRUIST FINANCIAL CORP	-	TFC US	纽约证券交易所	美国	14,389.00	3,825,103.05	0.19
115	US BANCORP	-	USB US	纽约证券交易所	美国	14,638.00	3,815,646.33	0.19
116	ILLINOIS TOOL WORKS	-	ITW US	纽约证券交易所	美国	3,071.00	3,801,439.12	0.18
117	BOSTON SCIENTIFIC CORP	-	BSX US	纽约证券交易所	美国	15,256.00	3,792,050.35	0.18
118	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	-	ICE US	纽约证券交易所	美国	5,844.00	3,789,729.98	0.18
119	NEWMONT CORP	-	NEM US	纽约证券交易所	美国	8,571.00	3,746,284.08	0.18
120	ECOLAB INC	-	ECL US	纽约证券交易所	美国	2,641.00	3,719,760.09	0.18
121	DEERE & CO	-	DE US	纽约证券	美国	3,341.00	3,717,007.58	0.18

				交易所				
122	KIMBERLY-CLARK CORP	-	KMB US	纽约证券交易所	美国	3,637.00	3,639,499.80	0.18
123	DOLLAR GENERAL CORP	-	DG US	纽约证券交易所	美国	2,689.00	3,626,696.10	0.18
124	NORTHROP GRUMMAN CORP	-	NOC US	纽约证券交易所	美国	1,656.00	3,604,319.57	0.18
125	LAM RESEARCH CORP	-	LRCX US	纳斯达克交易所	美国	1,550.00	3,549,399.36	0.17
126	PROGRESSIVE CORP	-	PGR US	纽约证券交易所	美国	6,250.00	3,544,617.16	0.17
127	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	-	SHW US	纽约证券交易所	美国	863.00	3,530,437.27	0.17
128	ANALOG DEVICES INC	-	ADI US	纳斯达克交易所	美国	3,935.00	3,416,484.58	0.17
129	CONOCOPHILLIPS	-	COP US	纽约证券交易所	美国	11,452.00	3,406,747.72	0.17
130	NORFOLK SOUTHERN CORP	-	NSC US	纽约证券交易所	美国	2,736.00	3,400,705.22	0.17
131	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	-	PNC US	纽约证券交易所	美国	4,531.00	3,374,843.74	0.16
132	AON PLC-CLASS A	-	AON US	纽约证券交易所	美国	2,468.00	3,365,146.88	0.16
133	MOODY'S CORP	-	MCO US	纽约证券交易所	美国	1,722.00	3,349,205.68	0.16
134	BAXTER INTERNATIONAL INC	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	5,434.00	3,312,267.26	0.16
135	BIOGEN INC	-	BIIB US	纳斯达克交易所	美国	1,743.00	3,301,451.55	0.16
136	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	-	EW US	纽约证券交易所	美国	6,618.00	3,237,950.77	0.16
137	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	-	EL US	纽约证券交易所	美国	2,400.00	3,205,824.14	0.16
138	WASTE MANAGEMENT INC	-	WM US	纽约证券交易所	美国	4,147.00	3,109,378.49	0.15
139	ROPER TECHNOLOGIES INC	-	ROP US	纽约证券交易所	美国	1,114.00	3,062,036.95	0.15
140	AMERICAN ELECTRIC POWER	-	AEP US	纽约证券交易所	美国	5,292.00	2,983,689.82	0.15
141	DUPONT DE NEMOURS INC	-	DD US	纽约证券交易所	美国	7,836.00	2,947,384.73	0.14
142	SCHWAB (CHARLES) CORP	-	SCHW US	纽约证券交易所	美国	12,235.00	2,922,480.61	0.14
143	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	DLR US	纽约证券交易所	美国	2,865.00	2,882,384.09	0.14
144	ELECTRONIC ARTS INC	-	EA US	纳斯达克交易所	美国	3,083.00	2,882,136.31	0.14
145	DEXCOM INC	-	DXCM US	纳斯达克交易所	美国	985.00	2,826,978.86	0.14
146	GENERAL MILLS INC	-	GIS US	纽约证券	美国	6,472.00	2,824,712.00	0.14

				交易所				
147	EMERSON ELECTRIC CO	-	EMR US	纽约证券交易所	美国	6,381.00	2,802,161.18	0.14
148	CENTENE CORP	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	6,185.00	2,782,645.26	0.14
149	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	-	LHX US	纽约证券交易所	美国	2,306.00	2,769,918.23	0.13
150	EXELON CORP	-	EXC US	纳斯达克交易所	美国	10,405.00	2,673,201.15	0.13
151	EATON CORP PLC	-	ETN US	纽约证券交易所	美国	4,272.00	2,645,712.23	0.13
152	GENERAL DYNAMICS CORP	-	GD US	纽约证券交易所	美国	2,482.00	2,626,209.34	0.13
153	EBAY INC	-	EBAY US	纳斯达克交易所	美国	7,054.00	2,619,289.69	0.13
154	SEMPRA ENERGY	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	3,123.00	2,591,870.72	0.13
155	FEDEX CORP	-	FDX US	纽约证券交易所	美国	2,566.00	2,547,236.10	0.12
156	SBA COMMUNICATIONS CORP	-	SBAC US	纳斯达克交易所	美国	1,192.00	2,514,076.57	0.12
157	XCEL ENERGY INC	-	XEL US	纳斯达克交易所	美国	5,606.00	2,480,479.81	0.12
158	GENERAL MOTORS CO	-	GM US	纽约证券交易所	美国	13,448.00	2,408,689.43	0.12
159	PHILLIPS 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	4,664.00	2,374,050.86	0.12
160	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	-	ORLY US	纳斯达克交易所	美国	793.00	2,367,273.72	0.12
161	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	-	WBA US	纳斯达克交易所	美国	7,869.00	2,361,486.94	0.11
162	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	-	BK US	纽约证券交易所	美国	8,605.00	2,354,523.12	0.11
163	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	-	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	5,773.00	2,322,230.76	0.11
164	ALLSTATE CORP	-	ALL US	纽约证券交易所	美国	3,355.00	2,303,679.57	0.11
165	ROSS STORES INC	-	ROST US	纳斯达克交易所	美国	3,796.00	2,290,721.18	0.11
166	DOW INC	-	DOW US	纽约证券交易所	美国	7,910.00	2,282,512.92	0.11
167	KLA CORP	-	KLAC US	纳斯达克交易所	美国	1,656.00	2,280,015.84	0.11
168	IHS MARKIT LTD	-	INFO US	纽约证券交易所	美国	4,260.00	2,276,979.59	0.11
169	KINDER MORGAN INC	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	20,769.00	2,230,507.84	0.11
170	EOG RESOURCES INC	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	6,216.00	2,229,352.67	0.11
171	SYNOPSYS INC	-	SNPS US	纳斯达克	美国	1,610.00	2,222,609.03	0.11

				交易所				
172	CONSTELLATION BRANDS INC-A	-	STZ US	纽约证券交易所	美国	1,793.00	2,220,735.44	0.11
173	PUBLIC STORAGE	-	PSA US	纽约证券交易所	美国	1,605.00	2,180,368.83	0.11
174	TRAVELERS COS INC/THE	-	TRV US	纽约证券交易所	美国	2,700.00	2,180,025.83	0.11
175	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	-	COF US	纽约证券交易所	美国	4,863.00	2,154,824.02	0.10
176	MSCI INC	-	MSCI US	纽约证券交易所	美国	907.00	2,143,493.77	0.10
177	AMPHENOL CORP-CL A	-	APH US	纽约证券交易所	美国	3,160.00	2,143,386.59	0.10
178	METLIFE INC	-	MET US	纽约证券交易所	美国	8,238.00	2,129,880.03	0.10
179	T ROWE PRICE GROUP INC	-	TROW US	纳斯达克交易所	美国	2,430.00	2,124,593.35	0.10
180	IDEXX LABORATORIES INC	-	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	907.00	2,119,992.52	0.10
181	EVERSOURCE ENERGY	-	ES US	纽约证券交易所	美国	3,592.00	2,117,519.79	0.10
182	RESMED INC	-	RMD US	纽约证券交易所	美国	1,544.00	2,098,703.62	0.10
183	SYSCO CORP	-	SYY US	纽约证券交易所	美国	5,421.00	2,097,739.81	0.10
184	WEC ENERGY GROUP INC	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	3,369.00	2,090,525.73	0.10
185	VERISK ANALYTICS INC	-	VRSK US	纳斯达克交易所	美国	1,733.00	2,088,145.25	0.10
186	CLOROX COMPANY	-	CLX US	纽约证券交易所	美国	1,336.00	2,074,847.97	0.10
187	AGILENT TECHNOLOGIES INC	-	A US	纽约证券交易所	美国	3,298.00	2,063,279.64	0.10
188	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	274.00	2,041,350.04	0.10
189	TE CONNECTIVITY LTD	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	3,523.00	2,033,944.95	0.10
190	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	-	AIG US	纽约证券交易所	美国	9,198.00	2,030,355.57	0.10
191	CADENCE DESIGN SYS INC	-	CDNS US	纳斯达克交易所	美国	2,982.00	2,025,818.18	0.10
192	KROGER CO	-	KR US	纽约证券交易所	美国	8,396.00	2,012,026.47	0.10
193	AUTOZONE INC	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	250.00	1,996,631.39	0.10
194	YUM! BRANDS INC	-	YUM US	纽约证券交易所	美国	3,215.00	1,978,123.09	0.10
195	MONSTER BEVERAGE CORP	-	MNST US	纳斯达克交易所	美国	3,993.00	1,959,568.50	0.10
196	PACCAR INC	-	PCAR US	纳斯达克	美国	3,692.00	1,956,392.92	0.10

				交易所				
197	AFLAC INC	-	AFL US	纽约证券交易所	美国	7,662.00	1,954,379.94	0.10
198	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	-	MCHP US	纳斯达克交易所	美国	2,619.00	1,952,574.88	0.09
199	CUMMINS INC	-	CMI US	纽约证券交易所	美国	1,576.00	1,933,112.41	0.09
200	HCA HEALTHCARE INC	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	2,813.00	1,932,914.33	0.09
201	SCHLUMBERGER LTD	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	14,819.00	1,929,315.32	0.09
202	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	-	JCI US	纽约证券交易所	美国	7,944.00	1,920,018.17	0.09
203	WILLIS TOWERS WATSON PLC	-	WLTW US	纳斯达克交易所	美国	1,374.00	1,915,778.54	0.09
204	IQVIA HOLDINGS INC	-	IQV US	纽约证券交易所	美国	1,897.00	1,905,421.66	0.09
205	ANSYS INC	-	ANSS US	纳斯达克交易所	美国	917.00	1,893,882.42	0.09
206	PPG INDUSTRIES INC	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	2,520.00	1,892,146.46	0.09
207	HP INC	-	HPQ US	纽约证券交易所	美国	15,270.00	1,884,252.11	0.09
208	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	-	PEG US	纽约证券交易所	美国	5,400.00	1,879,352.39	0.09
209	MCKESSON CORP	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	1,729.00	1,877,930.68	0.09
210	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	-	ALXN US	纳斯达克交易所	美国	2,359.00	1,874,468.67	0.09
211	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	-	ZBH US	纽约证券交易所	美国	2,208.00	1,865,780.14	0.09
212	ROCKWELL AUTOMATION INC	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	1,236.00	1,863,805.81	0.09
213	FASTENAL CO	-	FAST US	纳斯达克交易所	美国	6,117.00	1,855,199.12	0.09
214	MARATHON PETROLEUM CORP	-	MPC US	纽约证券交易所	美国	6,943.00	1,837,337.96	0.09
215	PAYCHEX INC	-	PAYX US	纳斯达克交易所	美国	3,409.00	1,828,151.67	0.09
216	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	4,219.00	1,818,986.20	0.09
217	CONSOLIDATED EDISON INC	-	ED US	纽约证券交易所	美国	3,567.00	1,816,417.83	0.09
218	VALERO ENERGY CORP	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	4,354.00	1,813,076.09	0.09
219	XILINX INC	-	XLNX US	纳斯达克交易所	美国	2,597.00	1,808,945.56	0.09
220	MOTOROLA SOLUTIONS INC	-	MSI US	纽约证券交易所	美国	1,817.00	1,802,555.46	0.09
221	FORD MOTOR CO	-	F US	纽约证券	美国	41,712.00	1,795,424.63	0.09

				交易所				
222	PARKER HANNIFIN CORP	-	PH US	纽约证券交易所	美国	1,371.00	1,778,817.61	0.09
223	TWITTER INC	-	TWTR US	纽约证券交易所	美国	8,378.00	1,766,906.00	0.09
224	AMERICAN WATER WORKS CO INC	-	AWK US	纽约证券交易所	美国	1,933.00	1,760,670.09	0.09
225	OTIS WORLDWIDE CORP	-	OTIS US	纽约证券交易所	美国	4,347.00	1,749,842.99	0.09
226	WILLIAMS COS INC	-	WMB US	纽约证券交易所	美国	12,955.00	1,744,417.83	0.08
227	MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	-	MAR US	纳斯达克交易所	美国	2,874.00	1,744,303.99	0.08
228	BALL CORP	-	BLL US	纽约证券交易所	美国	3,482.00	1,712,985.41	0.08
229	CINTAS CORP	-	CTAS US	纳斯达克交易所	美国	899.00	1,695,240.36	0.08
230	STATE STREET CORP	-	STT US	纽约证券交易所	美国	3,759.00	1,691,182.46	0.08
231	TRANSDIGM GROUP INC	-	TDG US	纽约证券交易所	美国	536.00	1,677,408.23	0.08
232	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	-	MKC US	纽约证券交易所	美国	1,320.00	1,676,575.69	0.08
233	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	5,932.00	1,675,624.20	0.08
234	DOLLAR TREE INC	-	DLTR US	纳斯达克交易所	美国	2,533.00	1,661,972.38	0.08
235	AVALONBAY COMMUNITIES INC	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	1,502.00	1,644,350.37	0.08
236	WELLTOWER INC	-	WELL US	纽约证券交易所	美国	4,458.00	1,633,251.27	0.08
237	STANLEY BLACK & DECKER INC	-	SWK US	纽约证券交易所	美国	1,645.00	1,623,188.47	0.08
238	SKYWORKS SOLUTIONS INC	-	SWKS US	纳斯达克交易所	美国	1,782.00	1,613,039.44	0.08
239	TRANE TECHNOLOGIES PLC	-	TT US	纽约证券交易所	美国	2,555.00	1,609,481.14	0.08
240	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	-	FLT US	纽约证券交易所	美国	895.00	1,593,732.44	0.08
241	VERISIGN INC	-	VRSN US	纳斯达克交易所	美国	1,086.00	1,590,178.74	0.08
242	FIRSTENERGY CORP	-	FE US	纽约证券交易所	美国	5,785.00	1,588,231.31	0.08
243	SIMON PROPERTY GROUP INC	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	3,265.00	1,580,574.13	0.08
244	APTIV PLC	-	APTV US	纽约证券交易所	美国	2,862.00	1,578,778.34	0.08
245	CERNER CORP	-	CERN US	纳斯达克交易所	美国	3,251.00	1,577,709.41	0.08
246	EQUIFAX INC	-	EFX US	纽约证券	美国	1,296.00	1,577,004.50	0.08

				交易所				
247	DTE ENERGY COMPANY	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	2,056.00	1,564,711.09	0.08
248	EQUITY RESIDENTIAL	-	EQR US	纽约证券交易所	美国	3,735.00	1,555,314.47	0.08
249	EDISON INTERNATIONAL	-	EIX US	纽约证券交易所	美国	4,035.00	1,551,407.65	0.08
250	AMETEK INC	-	AME US	纽约证券交易所	美国	2,450.00	1,550,102.54	0.08
251	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	-	ARE US	纽约证券交易所	美国	1,347.00	1,547,230.03	0.08
252	REALTY INCOME CORP	-	O US	纽约证券交易所	美国	3,667.00	1,544,651.33	0.08
253	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	-	HLT US	纽约证券交易所	美国	2,961.00	1,539,688.24	0.07
254	FORTIVE CORP	-	FTV US	纽约证券交易所	美国	3,165.00	1,516,031.74	0.07
255	CORTEVA INC	-	CTVA US	纽约证券交易所	美国	7,992.00	1,515,761.16	0.07
256	KRAFT HEINZ CO/THE	-	KHC US	纳斯达克交易所	美国	6,654.00	1,502,242.01	0.07
257	PPL CORP	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	8,209.00	1,501,707.50	0.07
258	BEST BUY CO INC	-	BBY US	纽约证券交易所	美国	2,428.00	1,500,086.30	0.07
259	ALIGN TECHNOLOGY INC	-	ALGN US	纳斯达克交易所	美国	766.00	1,488,259.85	0.07
260	CORNING INC	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	8,106.00	1,486,308.46	0.07
261	VF CORP	-	VFC US	纽约证券交易所	美国	3,405.00	1,469,001.21	0.07
262	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	-	MTD US	纽约证券交易所	美国	256.00	1,459,940.15	0.07
263	HERSHEY CO/THE	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	1,574.00	1,444,372.90	0.07
264	CHURCH & DWIGHT CO INC	-	CHD US	纽约证券交易所	美国	2,625.00	1,436,519.04	0.07
265	MARKETAXESS HOLDINGS INC	-	MKTX US	纳斯达克交易所	美国	405.00	1,436,236.57	0.07
266	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	-	KEYS US	纽约证券交易所	美国	1,998.00	1,425,517.08	0.07
267	ENTERGY CORP	-	ETR US	纽约证券交易所	美国	2,137.00	1,419,241.31	0.07
268	INCYTE CORP	-	INCY US	纳斯达克交易所	美国	1,926.00	1,417,643.11	0.07
269	ARTHUR J GALLAGHER & CO	-	AJG US	纽约证券交易所	美国	2,024.00	1,396,925.24	0.07
270	FORTINET INC	-	FTNT US	纳斯达克交易所	美国	1,433.00	1,392,593.65	0.07
271	AMERIPRISE FINANCIAL INC	-	AMP US	纽约证券	美国	1,307.00	1,388,306.09	0.07

				交易所				
272	DR HORTON INC	-	DHI US	纽约证券交易所	美国	3,533.00	1,386,908.39	0.07
273	SOUTHWEST AIRLINES CO	-	LUV US	纽约证券交易所	美国	5,727.00	1,385,804.05	0.07
274	FIRST REPUBLIC BANK/CA	-	FRC US	纽约证券交易所	美国	1,831.00	1,373,902.21	0.07
275	CARRIER GLOBAL CORP	-	CARR US	纽约证券交易所	美国	8,694.00	1,367,622.62	0.07
276	TYSON FOODS INC-CL A	-	TSN US	纽约证券交易所	美国	3,143.00	1,328,599.36	0.06
277	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	-	AKAM US	纳斯达克交易所	美国	1,732.00	1,313,104.81	0.06
278	AMEREN CORPORATION	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	2,636.00	1,313,027.50	0.06
279	REPUBLIC SERVICES INC	-	RSG US	纽约证券交易所	美国	2,244.00	1,303,478.96	0.06
280	COPART INC	-	CPRT US	纳斯达克交易所	美国	2,206.00	1,300,458.98	0.06
281	CITRIX SYSTEMS INC	-	CTXS US	纳斯达克交易所	美国	1,239.00	1,297,392.64	0.06
282	CONAGRA BRANDS INC	-	CAG US	纽约证券交易所	美国	5,201.00	1,294,976.26	0.06
283	LENNAR CORP-A	-	LEN US	纽约证券交易所	美国	2,933.00	1,279,488.37	0.06
284	LYONDELLBASELL INDU-CL A	-	LYB US	纽约证券交易所	美国	2,743.00	1,276,221.18	0.06
285	TELEFLEX INC	-	TFX US	纽约证券交易所	美国	495.00	1,275,514.22	0.06
286	FREEPORT-MCMORAN INC	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	15,504.00	1,269,929.77	0.06
287	WEYERHAEUSER CO	-	WY US	纽约证券交易所	美国	7,968.00	1,266,956.38	0.06
288	CMS ENERGY CORP	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	3,056.00	1,263,913.90	0.06
289	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	-	WST US	纽约证券交易所	美国	785.00	1,262,476.26	0.06
290	CDW CORP/DE	-	CDW US	纳斯达克交易所	美国	1,520.00	1,250,194.39	0.06
291	KELLOGG CO	-	K US	纽约证券交易所	美国	2,671.00	1,249,151.30	0.06
292	NORTHERN TRUST CORP	-	NTRS US	纳斯达克交易所	美国	2,222.00	1,248,069.69	0.06
293	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	9,610.00	1,245,022.11	0.06
294	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	-	MXIM US	纳斯达克交易所	美国	2,848.00	1,222,044.03	0.06
295	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	-	LH US	纽约证券交易所	美国	1,037.00	1,219,486.85	0.06
296	PIONEER NATURAL RESOURCES	-	PXD US	纽约证券	美国	1,761.00	1,218,025.85	0.06

	CO			交易所				
297	AMCOR PLC	-	AMCR US	纽约证券交易所	美国	16,813.00	1,215,272.14	0.06
298	OLD DOMINION FREIGHT LINE	-	ODFL US	纳斯达克交易所	美国	1,008.00	1,210,217.30	0.06
299	DELTA AIR LINES INC	-	DAL US	纽约证券交易所	美国	6,062.00	1,203,791.81	0.06
300	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	-	TTWO US	纳斯达克交易所	美国	1,216.00	1,201,512.35	0.06
301	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	3,271.00	1,159,936.36	0.06
302	VULCAN MATERIALS CO	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	1,414.00	1,159,706.35	0.06
303	LAS VEGAS SANDS CORP	-	LVS US	纽约证券交易所	美国	3,589.00	1,157,095.14	0.06
304	QUEST DIAGNOSTICS INC	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	1,429.00	1,152,888.36	0.06
305	TRACTOR SUPPLY COMPANY	-	TSCO US	纳斯达克交易所	美国	1,235.00	1,152,264.02	0.06
306	CARDINAL HEALTH INC	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	3,118.00	1,152,035.85	0.06
307	CBRE GROUP INC - A	-	CBRE US	纽约证券交易所	美国	3,579.00	1,145,763.13	0.06
308	ESSEX PROPERTY TRUST INC	-	ESS US	纽约证券交易所	美国	699.00	1,134,063.90	0.06
309	AMERISOURCEBERGEN CORP	-	ABC US	纽约证券交易所	美国	1,586.00	1,131,454.33	0.06
310	PAYCOM SOFTWARE INC	-	PAYC US	纽约证券交易所	美国	516.00	1,131,450.50	0.06
311	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	-	PEAK US	纽约证券交易所	美国	5,747.00	1,121,303.03	0.05
312	HOLOGIC INC	-	HOLX US	纳斯达克交易所	美国	2,758.00	1,112,939.88	0.05
313	ONEOK INC	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	4,697.00	1,104,645.11	0.05
314	CARMAX INC	-	KMX US	纽约证券交易所	美国	1,738.00	1,101,838.51	0.05
315	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	-	BR US	纽约证券交易所	美国	1,226.00	1,095,261.94	0.05
316	DOMINO'S PIZZA INC	-	DPZ US	纽约证券交易所	美国	417.00	1,090,642.85	0.05
317	KANSAS CITY SOUTHERN	-	KSU US	纽约证券交易所	美国	1,015.00	1,072,752.03	0.05
318	GARMIN LTD	-	GRMN US	纳斯达克交易所	美国	1,550.00	1,069,889.44	0.05
319	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	-	JKHY US	纳斯达克交易所	美国	819.00	1,067,026.28	0.05
320	COOPER COS INC/THE	-	COO US	纽约证券交易所	美国	525.00	1,054,215.42	0.05
321	DOVER CORP	-	DOV US	纽约证券	美国	1,538.00	1,051,371.45	0.05

				交易所				
322	INTERNATIONAL PAPER CO	-	IP US	纽约证券交易所	美国	4,197.00	1,046,182.81	0.05
323	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	-	HIG US	纽约证券交易所	美国	3,824.00	1,043,625.91	0.05
324	TYLER TECHNOLOGIES INC	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	424.00	1,041,232.47	0.05
325	FIFTH THIRD BANCORP	-	FITB US	纳斯达克交易所	美国	7,602.00	1,037,617.96	0.05
326	NASDAQ INC	-	NDAQ US	纳斯达克交易所	美国	1,226.00	1,036,935.92	0.05
327	VENTAS INC	-	VTR US	纽约证券交易所	美国	3,983.00	1,032,597.89	0.05
328	WW GRAINGER INC	-	GWW US	纽约证券交易所	美国	463.00	1,029,756.32	0.05
329	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	-	ZBRA US	纳斯达克交易所	美国	567.00	1,027,402.88	0.05
330	HORMEL FOODS CORP	-	HRL US	纽约证券交易所	美国	2,992.00	1,022,448.58	0.05
331	HESS CORP	-	HES US	纽约证券交易所	美国	2,787.00	1,022,240.65	0.05
332	EVERGY INC	-	EVRG US	纽约证券交易所	美国	2,422.00	1,016,618.89	0.05
333	M & T BANK CORP	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	1,370.00	1,008,396.19	0.05
334	TIFFANY & CO	-	TIF US	纽约证券交易所	美国	1,166.00	1,006,577.75	0.05
335	MASCO CORP	-	MAS US	纽约证券交易所	美国	2,817.00	1,001,335.59	0.05
336	WESTERN DIGITAL CORP	-	WDC US	纳斯达克交易所	美国	3,200.00	1,000,191.76	0.05
337	MID-AMERICA APARTMENT COMM	-	MAA US	纽约证券交易所	美国	1,221.00	991,215.45	0.05
338	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	1,141.00	989,196.31	0.05
339	BOSTON PROPERTIES INC	-	BXP US	纽约证券交易所	美国	1,542.00	986,641.31	0.05
340	DUKE REALTY CORP	-	DRE US	纽约证券交易所	美国	3,933.00	985,387.61	0.05
341	STERIS PLC	-	STE US	纽约证券交易所	美国	907.00	985,254.58	0.05
342	FMC CORP	-	FMC US	纽约证券交易所	美国	1,383.00	975,374.29	0.05
343	MARTIN MARIETTA MATERIALS	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	665.00	972,504.19	0.05
344	QORVO INC	-	QRVO US	纳斯达克交易所	美国	1,226.00	959,341.49	0.05
345	EXPEDITORS INTL WASH INC	-	EXPD US	纳斯达克交易所	美国	1,778.00	957,142.17	0.05
346	VIACOMCBS INC - CLASS B	-	VIAC US	纳斯达克	美国	5,773.00	953,087.32	0.05

				交易所				
347	GENUINE PARTS CO	-	GPC US	纽约证券交易所	美国	1,541.00	948,690.95	0.05
348	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	13,720.00	945,082.10	0.05
349	LEIDOS HOLDINGS INC	-	LDOS US	纽约证券交易所	美国	1,425.00	944,969.89	0.05
350	NUCOR CORP	-	NUE US	纽约证券交易所	美国	3,216.00	942,809.30	0.05
351	ATMOS ENERGY CORP	-	ATO US	纽约证券交易所	美国	1,306.00	920,699.45	0.04
352	JM SMUCKER CO/THE	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	1,218.00	912,381.75	0.04
353	ALLIANT ENERGY CORP	-	LNT US	纳斯达克交易所	美国	2,664.00	902,252.26	0.04
354	IDEX CORP	-	IEX US	纽约证券交易所	美国	806.00	901,788.41	0.04
355	EXTRA SPACE STORAGE INC	-	EXR US	纽约证券交易所	美国	1,379.00	901,774.18	0.04
356	SYNCHRONY FINANCIAL	-	SYF US	纽约证券交易所	美国	5,735.00	899,716.66	0.04
357	KEYCORP	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	10,416.00	898,154.08	0.04
358	OMNICOM GROUP	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	2,289.00	884,791.66	0.04
359	XYLEM INC	-	XYL US	纽约证券交易所	美国	1,922.00	883,897.66	0.04
360	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	-	BF/B US	纽约证券交易所	美国	1,947.00	877,475.85	0.04
361	ULTA BEAUTY INC	-	ULTA US	纳斯达克交易所	美国	602.00	866,947.36	0.04
362	HALLIBURTON CO	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	9,369.00	860,935.30	0.04
363	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	-	TDY US	纽约证券交易所	美国	391.00	860,735.88	0.04
364	ARISTA NETWORKS INC	-	ANET US	纽约证券交易所	美国	574.00	853,484.84	0.04
365	WATERS CORP	-	WAT US	纽约证券交易所	美国	662.00	845,467.87	0.04
366	EXPEDIA GROUP INC	-	EXPE US	纳斯达克交易所	美国	1,447.00	842,059.80	0.04
367	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	-	VAR US	纽约证券交易所	美国	970.00	841,358.93	0.04
368	SVB FINANCIAL GROUP	-	SIVB US	纳斯达克交易所	美国	550.00	839,214.55	0.04
369	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	-	J US	纽约证券交易所	美国	1,390.00	834,474.82	0.04
370	UDR INC	-	UDR US	纽约证券交易所	美国	3,148.00	833,060.62	0.04
371	E*TRADE FINANCIAL CORP	-	ETFC US	纳斯达克	美国	2,361.00	831,222.01	0.04

				交易所				
372	SEAGATE TECHNOLOGY	-	STX US	纳斯达克交易所	美国	2,412.00	826,637.25	0.04
373	PERKINELMER INC	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	1,189.00	825,675.08	0.04
374	ABIOMED INC	-	ABMD US	纳斯达克交易所	美国	481.00	822,569.65	0.04
375	GARTNER INC	-	IT US	纽约证券交易所	美国	953.00	818,584.82	0.04
376	CITIZENS FINANCIAL GROUP	-	CFG US	纽约证券交易所	美国	4,556.00	814,096.06	0.04
377	UNITED RENTALS INC	-	URI US	纽约证券交易所	美国	770.00	812,449.08	0.04
378	NORTONLIFELOCK INC	-	NLOK US	纳斯达克交易所	美国	5,787.00	812,416.59	0.04
379	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	-	CHRW US	纳斯达克交易所	美国	1,438.00	804,856.18	0.04
380	REGIONS FINANCIAL CORP	-	RF US	纽约证券交易所	美国	10,220.00	804,559.69	0.04
381	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	-	PFG US	纳斯达克交易所	美国	2,720.00	799,904.21	0.04
382	WABTEC CORP	-	WAB US	纽约证券交易所	美国	1,931.00	787,011.52	0.04
383	CBOE GLOBAL MARKETS INC	-	CBOE US	BZX 交易所	美国	1,172.00	773,960.39	0.04
384	CELANESE CORP	-	CE US	纽约证券交易所	美国	1,263.00	772,001.21	0.04
385	CENTERPOINT ENERGY INC	-	CNP US	纽约证券交易所	美国	5,816.00	768,725.53	0.04
386	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	-	JBHT US	纳斯达克交易所	美国	901.00	767,604.27	0.04
387	CONCHO RESOURCES INC	-	CXO US	纽约证券交易所	美国	2,101.00	766,012.52	0.04
388	BAKER HUGHES CO	-	BKR US	纽约证券交易所	美国	6,994.00	762,020.81	0.04
389	CENTURYLINK INC	-	CTL US	纽约证券交易所	美国	10,547.00	748,914.89	0.04
390	ADVANCE AUTO PARTS INC	-	AAP US	纽约证券交易所	美国	738.00	744,254.38	0.04
391	DARDEN RESTAURANTS INC	-	DRI US	纽约证券交易所	美国	1,387.00	744,005.82	0.04
392	NETAPP INC	-	NTAP US	纳斯达克交易所	美国	2,362.00	741,945.33	0.04
393	INGERSOLL-RAND INC	-	IR US	纽约证券交易所	美国	3,693.00	735,185.97	0.04
394	CINCINNATI FINANCIAL CORP	-	CINF US	纳斯达克交易所	美国	1,612.00	730,720.22	0.04
395	DENTSPLY SIRONA INC	-	XRAY US	纳斯达克交易所	美国	2,340.00	729,899.28	0.04
396	BIO-RAD LABORATORIES-A	-	BIO US	纽约证券	美国	228.00	728,761.75	0.04

				交易所				
397	AES CORP	-	AES US	纽约证券交易所	美国	7,100.00	728,331.88	0.04
398	HASBRO INC	-	HAS US	纳斯达克交易所	美国	1,360.00	721,627.59	0.04
399	AVERY DENNISON CORP	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	890.00	718,853.14	0.03
400	EASTMAN CHEMICAL CO	-	EMN US	纽约证券交易所	美国	1,452.00	715,859.78	0.03
401	PACKAGING CORP OF AMERICA	-	PKG US	纽约证券交易所	美国	1,012.00	715,012.51	0.03
402	ALLEGION PLC	-	ALLE US	纽约证券交易所	美国	985.00	712,811.49	0.03
403	LAMB WESTON HOLDINGS INC	-	LW US	纽约证券交易所	美国	1,560.00	706,044.20	0.03
404	FOX CORP - CLASS A	-	FOXA US	纳斯达克交易所	美国	3,659.00	694,742.34	0.03
405	HUNTINGTON BANCSHARES INC	-	HBAN US	纳斯达克交易所	美国	10,831.00	692,786.35	0.03
406	NVR INC	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	30.00	692,109.62	0.03
407	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	-	FBHS US	纽约证券交易所	美国	1,491.00	674,815.32	0.03
408	WESTERN UNION CO	-	WU US	纽约证券交易所	美国	4,388.00	671,621.97	0.03
409	DISH NETWORK CORP-A	-	DISH US	纳斯达克交易所	美国	2,745.00	670,640.68	0.03
410	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	-	UAL US	纳斯达克交易所	美国	2,698.00	661,067.99	0.03
411	NISOURCE INC	-	NI US	纽约证券交易所	美国	4,087.00	657,957.26	0.03
412	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	-	RCL US	纽约证券交易所	美国	1,834.00	653,085.29	0.03
413	PULTEGROUP INC	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	2,692.00	648,544.22	0.03
414	F5 NETWORKS INC	-	FFIV US	纳斯达克交易所	美国	650.00	641,841.63	0.03
415	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	1,303.00	634,928.43	0.03
416	CAMPBELL SOUP CO	-	CPB US	纽约证券交易所	美国	1,806.00	634,548.19	0.03
417	HENRY SCHEIN INC	-	HSIC US	纳斯达克交易所	美国	1,525.00	630,392.31	0.03
418	MYLAN NV	-	MYL US	纳斯达克交易所	美国	5,520.00	628,387.75	0.03
419	LOEWS CORP	-	L US	纽约证券交易所	美国	2,585.00	627,524.40	0.03
420	MGM RESORTS INTERNATIONAL	-	MGM US	纽约证券交易所	美国	5,267.00	626,433.81	0.03
421	EVEREST RE GROUP LTD	-	RE US	纽约证券	美国	428.00	624,791.36	0.03

				交易所				
422	PINNACLE WEST CAPITAL	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	1,201.00	623,146.72	0.03
423	ALBEMARLE CORP	-	ALB US	纽约证券交易所	美国	1,135.00	620,400.30	0.03
424	WR BERKLEY CORP	-	WRB US	纽约证券交易所	美国	1,508.00	611,621.51	0.03
425	WHIRLPOOL CORP	-	WHR US	纽约证券交易所	美国	664.00	608,893.07	0.03
426	LKQ CORP	-	LKQ US	纳斯达克交易所	美国	3,246.00	602,077.49	0.03
427	NRG ENERGY INC	-	NRG US	纽约证券交易所	美国	2,607.00	600,935.71	0.03
428	REGENCY CENTERS CORP	-	REG US	纳斯达克交易所	美国	1,811.00	588,354.52	0.03
429	CARNIVAL CORP	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	5,059.00	588,085.43	0.03
430	HOST HOTELS & RESORTS INC	-	HST US	纽约证券交易所	美国	7,528.00	575,047.40	0.03
431	JUNIPER NETWORKS INC	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	3,539.00	572,742.45	0.03
432	SNAP-ON INC	-	SNA US	纽约证券交易所	美国	581.00	569,717.88	0.03
433	PERRIGO CO PLC	-	PRGO US	纽约证券交易所	美国	1,455.00	569,318.17	0.03
434	IRON MOUNTAIN INC	-	IRM US	纽约证券交易所	美国	3,074.00	567,998.20	0.03
435	TEXTRON INC	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	2,431.00	566,389.80	0.03
436	WESTROCK CO	-	WRK US	纽约证券交易所	美国	2,768.00	553,784.54	0.03
437	BORGWARNER INC	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	2,213.00	553,042.75	0.03
438	GLOBE LIFE INC	-	GL US	纽约证券交易所	美国	1,046.00	549,684.80	0.03
439	WYNN RESORTS LTD	-	WYNN US	纳斯达克交易所	美国	1,036.00	546,336.63	0.03
440	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	830.00	545,820.25	0.03
441	LINCOLN NATIONAL CORP	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	2,064.00	537,578.72	0.03
442	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	-	HII US	纽约证券交易所	美国	433.00	534,885.75	0.03
443	CABOT OIL & GAS CORP	-	COG US	纽约证券交易所	美国	4,257.00	517,761.07	0.03
444	DAVITA INC	-	DVA US	纽约证券交易所	美国	911.00	510,407.45	0.02
445	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	-	IPG US	纽约证券交易所	美国	4,160.00	505,374.36	0.02
446	DIAMONDBACK ENERGY INC	-	FANG US	纳斯达克	美国	1,686.00	499,165.07	0.02

				交易所				
447	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	-	AAL US	纳斯达克交易所	美国	5,307.00	491,051.75	0.02
448	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	-	TAP US	纽约证券交易所	美国	2,008.00	488,449.25	0.02
449	SMITH (A.O.) CORP	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	1,443.00	481,364.66	0.02
450	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	-	LYV US	纽约证券交易所	美国	1,517.00	476,086.53	0.02
451	PENTAIR PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	1,770.00	476,041.86	0.02
452	ASSURANT INC	-	AIZ US	纽约证券交易所	美国	637.00	465,800.87	0.02
453	DISCOVERY INC-C	-	DISCK US	纳斯达克交易所	美国	3,379.00	460,730.60	0.02
454	HOWMET AEROSPACE INC	-	HWM US	纽约证券交易所	美国	4,099.00	459,949.10	0.02
455	NEWELL BRANDS INC	-	NWL US	纳斯达克交易所	美国	4,075.00	458,121.52	0.02
456	VORNADO REALTY TRUST	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	1,693.00	457,969.53	0.02
457	ROBERT HALF INTL INC	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	1,224.00	457,788.22	0.02
458	MOHAWK INDUSTRIES INC	-	MHK US	纽约证券交易所	美国	635.00	457,460.30	0.02
459	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	-	CF US	纽约证券交易所	美国	2,284.00	455,011.92	0.02
460	FEDERAL REALTY INVS TRUST	-	FRT US	纽约证券交易所	美国	751.00	453,036.39	0.02
461	ROLLINS INC	-	ROL US	纽约证券交易所	美国	1,505.00	451,650.51	0.02
462	FRANKLIN RESOURCES INC	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	2,962.00	439,729.97	0.02
463	IPG PHOTONICS CORP	-	IPGP US	纳斯达克交易所	美国	379.00	430,347.30	0.02
464	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	-	AIV US	纽约证券交易所	美国	1,590.00	423,691.08	0.02
465	ZIONS BANCORP NA	-	ZION US	纳斯达克交易所	美国	1,750.00	421,230.25	0.02
466	KIMCO REALTY CORP	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	4,618.00	419,779.80	0.02
467	QUANTA SERVICES INC	-	PWR US	纽约证券交易所	美国	1,470.00	408,261.31	0.02
468	FLIR SYSTEMS INC	-	FLIR US	纳斯达克交易所	美国	1,398.00	401,527.01	0.02
469	COMERICA INC	-	CMA US	纽约证券交易所	美国	1,485.00	400,547.49	0.02
470	NIELSEN HOLDINGS PLC	-	NLSN US	纽约证券交易所	美国	3,806.00	400,396.41	0.02
471	SEALED AIR CORP	-	SEE US	纽约证券	美国	1,662.00	386,517.34	0.02

				交易所				
472	APACHE CORP	-	APA US	纳斯达克交易所	美国	4,030.00	385,160.20	0.02
473	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	-	PBCT US	纳斯达克交易所	美国	4,535.00	371,461.01	0.02
474	MARATHON OIL CORP	-	MRO US	纽约证券交易所	美国	8,440.00	365,676.00	0.02
475	NATIONAL OILWELL VARCO INC	-	NOV US	纽约证券交易所	美国	4,145.00	359,470.46	0.02
476	LEGGETT & PLATT INC	-	LEG US	纽约证券交易所	美国	1,412.00	351,368.33	0.02
477	NEWS CORP - CLASS A	-	NWSA US	纳斯达克交易所	美国	4,152.00	348,613.84	0.02
478	ALASKA AIR GROUP INC	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	1,310.00	336,280.50	0.02
479	MOSAIC CO/THE	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	3,724.00	329,814.37	0.02
480	HOLLYFRONTIER CORP	-	HFC US	纽约证券交易所	美国	1,590.00	328,687.03	0.02
481	DEVON ENERGY CORP	-	DVN US	纽约证券交易所	美国	4,087.00	328,110.61	0.02
482	NOBLE ENERGY INC	-	NBL US	纳斯达克交易所	美国	5,122.00	324,900.34	0.02
483	FOX CORP - CLASS B	-	FOX US	纳斯达克交易所	美国	1,701.00	323,213.44	0.02
484	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	-	NCLH US	纽约证券交易所	美国	2,737.00	318,357.40	0.02
485	DXC TECHNOLOGY CO	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	2,710.00	316,559.84	0.02
486	INVESCO LTD	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	4,018.00	306,072.84	0.01
487	HANESBRANDS INC	-	HBI US	纽约证券交易所	美国	3,717.00	297,090.72	0.01
488	SL GREEN REALTY CORP	-	SLG US	纽约证券交易所	美国	818.00	285,439.92	0.01
489	FLOWSERVE CORP	-	FLS US	纽约证券交易所	美国	1,390.00	280,651.20	0.01
490	TAPESTRY INC	-	TPR US	纽约证券交易所	美国	2,948.00	277,158.46	0.01
491	L BRANDS INC	-	LB US	纽约证券交易所	美国	2,492.00	264,102.45	0.01
492	RALPH LAUREN CORP	-	RL US	纽约证券交易所	美国	511.00	262,350.13	0.01
493	PVH CORP	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	758.00	257,848.84	0.01
494	UNUM GROUP	-	UNM US	纽约证券交易所	美国	2,173.00	255,216.47	0.01
495	DISCOVERY INC - A	-	DISCA US	纳斯达克交易所	美国	1,708.00	255,136.68	0.01
496	KOHLS CORP	-	KSS US	纽约证券	美国	1,684.00	247,617.41	0.01

				交易所				
497	TECHNIPFMC PLC	-	FTI US	纽约证券交易所	美国	4,491.00	217,471.20	0.01
498	XEROX HOLDINGS CORP	-	XRX US	纽约证券交易所	美国	1,956.00	211,728.31	0.01
499	H&R BLOCK INC	-	HRB US	纽约证券交易所	美国	2,056.00	207,851.85	0.01
500	GAP INC/THE	-	GPS US	纽约证券交易所	美国	2,273.00	203,077.30	0.01
501	UNDER ARMOUR INC-CLASS A	-	UAA US	纽约证券交易所	美国	2,012.00	138,736.11	0.01
502	UNDER ARMOUR INC-CLASS C	-	UA US	纽约证券交易所	美国	2,098.00	131,298.67	0.01
503	NEWS CORP - CLASS B	-	NWS US	纳斯达克交易所	美国	1,301.00	110,064.63	0.01
504	COTY INC-CL A	-	COTY US	纽约证券交易所	美国	3,158.00	99,936.06	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MICROSOFT CORP	MSFT US	27,665,107.28	1.87
2	APPLE INC	AAPL US	26,976,510.11	1.83
3	AMAZON.COM INC	AMZN US	18,816,215.07	1.27
4	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	8,890,209.89	0.60
	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	8,859,046.40	0.60
5	FACEBOOK INC-CLASS A	FB US	10,404,748.49	0.70
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	9,077,768.97	0.61
7	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	8,281,522.56	0.56
8	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	8,113,570.41	0.55
9	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	7,005,846.72	0.47
10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	6,617,971.41	0.45
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	5,824,562.87	0.39
12	MASTERCARD INC - A	MA US	5,681,789.47	0.38
13	AT&T INC	T US	5,681,325.85	0.38
14	INTEL CORP	INTC US	5,602,501.91	0.38
15	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	5,269,440.69	0.36
16	HOME DEPOT INC	HD US	5,200,899.02	0.35
17	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	5,146,385.75	0.35
18	EXXON MOBIL CORP	XOM US	5,039,575.92	0.34
19	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	4,975,773.50	0.34
20	MERCK & CO. INC.	MRK US	4,713,141.41	0.32

注：“买入金额”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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	AON PLC-CLASS A	AON US	3,147,159.52	0.21
2	APPLE INC	AAPL US	2,866,533.15	0.19
3	WELLCARE HEALTH PLANS INC	WCG US	1,055,627.74	0.07
4	MICROSOFT CORP	MSFT US	747,520.62	0.05
5	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	681,547.75	0.05
6	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	642,051.54	0.04
7	INTEL CORP	INTC US	521,936.74	0.04
8	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	516,899.75	0.03
9	AT&T INC	T US	416,796.28	0.03
10	EBAY INC	EBAY US	405,460.49	0.03
11	CITIGROUP INC	C US	390,278.40	0.03
12	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	371,303.84	0.03
13	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	361,794.89	0.02
14	ORACLE CORP	ORCL US	357,500.53	0.02
15	BIOGEN INC	BIIB US	341,044.96	0.02
16	HOME DEPOT INC	HD US	294,520.78	0.02
17	DUPONT DE NEMOURS INC	DD US	286,000.46	0.02
18	INGERSOLL-RAND INC	IR US	283,967.60	0.02
19	HARLEY-DAVIDSON INC	HOG US	278,192.74	0.02
20	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	234,369.52	0.02

注：“卖出金额”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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	582,192,573.81
卖出收入（成交）总额	31,349,998.47

注：“买入成交总金额”、“ 卖出成交总金额”按买入、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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例

				(%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Sep20	-1,049,917.11	-0.05

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.11.2 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。

7.11.3 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	9,005,124.00
2	应收证券清算款	7,491,345.59
3	应收股利	1,378,424.31
4	应收利息	625.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,875,519.55

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
22,140.00	45,023.45	216,567,382.00	21.73%	361,506,553.00	36.27%	418,745,350.00	42.01%

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	华泰证券资管－工行个人“鑫稳利”鑫智合－全天候多资产 FOF 固收类开净型理财 1 期	121,431,600.00	12.18%
2	张瑞英	17,997,000.00	1.81%
3	李乐宁	16,061,800.00	1.61%
4	邓运宏	12,643,900.00	1.27%
5	JPMORGAN CHASE BANK,NATIONAL ASSOCIATION	8,948,038.00	0.90%
6	麦格理银行有限公司－自有资金	7,324,700.00	0.73%
7	杨巧伟	7,023,000.00	0.70%
8	永安国富资产管理有限公司－永安国富－永富 11 号私募证券投资基金	4,925,393.00	0.49%
9	中信证券股份有限公司	4,649,109.00	0.47%
10	李婴	4,500,000.00	0.45%
	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	418,745,350.00	42.01%

注：前十名持有人为除博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金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（2013 年 12 月 5 日）基金份额总额	565,043,200.00
本报告期期初基金份额总额	700,819,285.00

本报告期基金总申购份额	334,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	38,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	996,819,285.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备

	元数量	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	注
Morgan Stanley Asia Limited	-	613,542,572.28	100.00%	139,478.00	100.00%	

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，我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，在多家券商开立了券商交易账户。

1、基金券商交易账户的选择标准如下：

(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服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金券商交易账户的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构；

(2)基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

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

无。

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暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时基金管理有限公司旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-03
4	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（摘要）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-03
5	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（正文）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-03
6	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
7	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 5 月 25 日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-21
8	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-22
9	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变	上海证券报、基金管理	2020-04-17

	更的公告	人网站、证监会基金电子披露网	
10	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 4 月 10 日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-08
11	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-27
12	博时标普 500 交易型开放式证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-25
13	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 2 月 17 日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-02-13
14	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
15	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-17
16	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 1 月 20 日暂停申购、赎回的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-16
17	关于标普 500ETF 基金新增国泰君安证券为申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-15

§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

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	480,599,160.00	162,546,037.00	224,399,847.00	418,745,350.00	42.01%
产品特有风险							
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。 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。 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。 此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。							

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 中国证监会批准博时标普 500 指数型证券投资基金设立的文件

12.1.2《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3《博时标普 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 博时标普 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 报告期内博时标普 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阅，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

二〇二〇年八月三十一日