

# 博时中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2021 年年度报告  
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 审计报告</b> .....	13
6.1 审计意见.....	14
6.2 形成审计意见的基础.....	14
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	14
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	14
<b>§7 年度财务报表</b> .....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	64
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	66
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>72</b>
12.1 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 .....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>72</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## §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	74,895,098.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 31 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>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。</p> <p>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%。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒麟	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201

注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518040	518040
法定代表人	江向阳	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2020 年	2019 年 8 月 1 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	122,500,154.90	444,822,178.46	-45,257,387.05
本期利润	119,870,578.56	349,785,870.38	72,164,042.64
加权平均基金份额本期利润	1.6231	1.7738	0.0449
本期加权平均净值利润率	21.90%	29.77%	2.90%
本期基金份额净值增长率	22.55%	28.68%	3.86%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	242,327,458.32	233,629,015.76	-21,164,964.89
期末可供分配基金份额利润	3.2356	1.7066	-0.0572
期末基金资产净值	622,265,095.07	928,088,351.86	1,949,800,712.26
期末基金份额净值	8.3085	6.7796	5.2684
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	63.78%	33.65%	3.86%

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

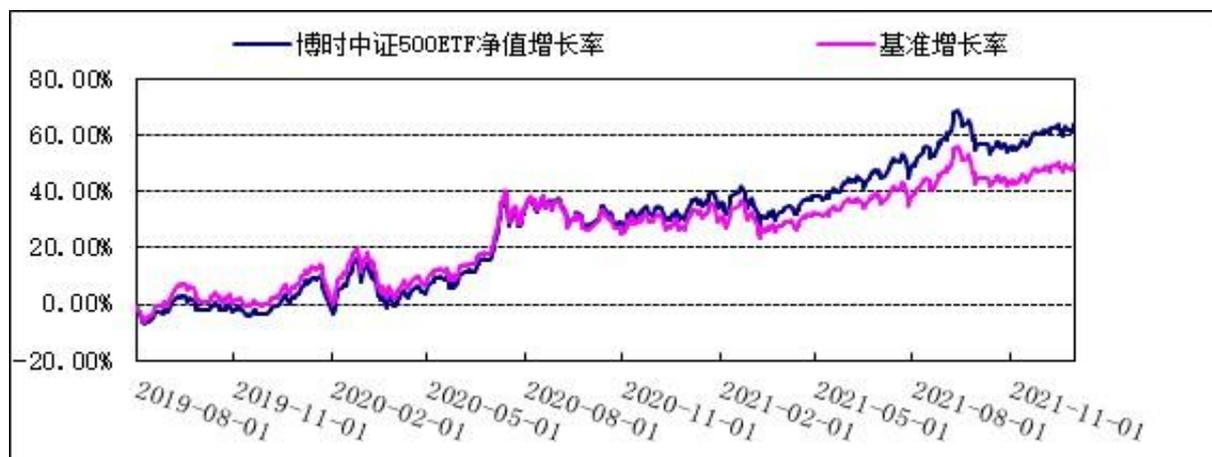
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.35%	0.74%	3.60%	0.76%	0.75%	-0.02%
过去六个月	10.99%	0.94%	8.10%	0.96%	2.89%	-0.02%
过去一年	22.55%	0.97%	15.58%	0.97%	6.97%	0.00%
自基金合同生效起至今	63.78%	1.27%	50.09%	1.29%	13.69%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

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

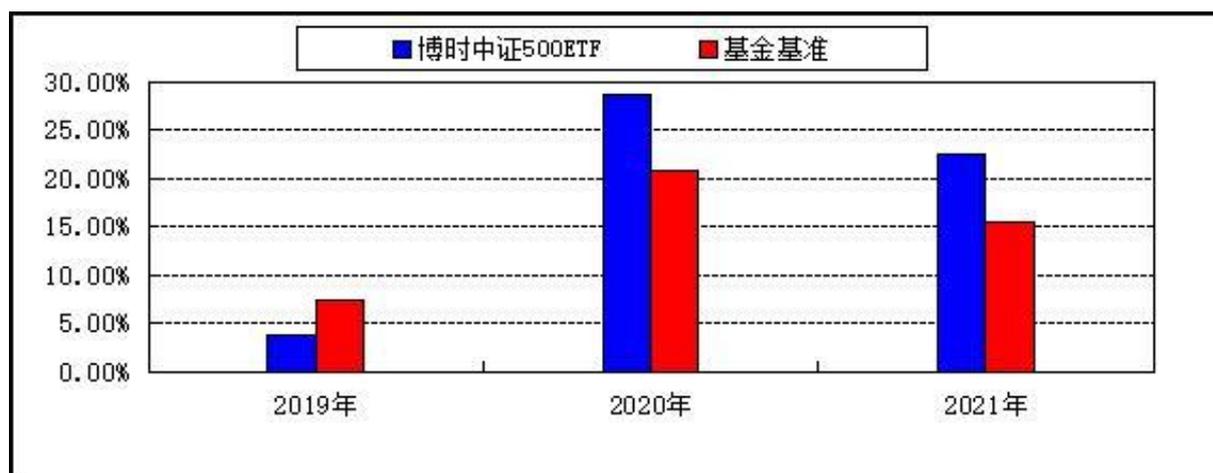
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 8 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日)



#### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比如



注：本基金的基金合同于 2019 年 8 月 1 日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §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 2021 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 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 16687 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 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。

#### 其他大事件

2021 年 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021 年 9 月 28 日，由中国证券报社有限公司主办的第十八届中国基金业金牛奖评选结果正式

揭晓，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时信用债纯债债券一举荣获了“五年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2021 年 9 月 27 日，由证券时报报社有限公司主办的第十六届中国基金业明星基金奖正式公布，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时天颐债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。

2021 年 9 月，由北京济安信科技有限公司主办的第三届济安“群星汇”评选结果揭晓，凭借卓越的综合管理实力和旗下基金产品出色的长期业绩，博时基金一举获得了“济安众星奖”、“济安五星奖”两项重量级的公司奖项。博时旗下产品博时合惠货币(004841)获得了“基金产品单项奖-货币型”，博时合惠货币基金经理魏桢则荣获了“五星基金明星奖”奖。

2021 年 7 月 6 日，由上海证券报社有限公司主办的第十七届“金基金”奖的评选结果揭晓。凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获 2021 年度“金基金”债券投资回报基金管理公司奖，博时富瑞纯债债券荣获 2021 年度“金基金”债券基金三年期奖。

#### 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	2019-08-01	-	14.8	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)的基金经理。现任上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日—至今)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日—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

					<p>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)、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—至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日—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—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—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—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—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—至今)的基金经理。</p>
唐屹兵	基金经理助理	2021-07-05	-	6.7	<p>2014 年 6 月硕士毕业后加入博时基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、投资经理助理，现任基金经理助理</p>

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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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 41 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

2021 年全球新冠疫情仍在反复，全球流动性仍延续前一年的宽松状态。A 股全年处于震荡上行态势，结构性风格切换较为显著。春节之前，A 股延续上年行情，核心资产大涨；春节之后到 3 月底，受美债收益率快速上行带来的货币收紧预期，核心资产回调，低估值躁动；随着美债收益率下行叠加国内货币宽松预期，4 月至 7 月底，科技成长板块回归，随后 8 月至 9 月大宗商品价格飙

升，资源股表现抢眼；9 月至年末，商品价格回落，A 股整体震荡。全年来看，滞涨与高景气板块齐头并进，小盘相对更占优，其中偏大盘的上证 50 下跌 10.06%、沪深 300 指数下跌 5.20%，偏小盘的中证 500 和中证 1000 分别上涨 15.58%、20.52%，偏成长风格的创业板指、科创 50 分别上涨 12.02%、0.37%。行业方面，中信一级行业表现分化明显，其中表现居前的是电力设备及新能源、基础化工、有色金属、煤炭、钢铁，涨幅分别为 50.41%、48.05%、46.39%、44.67%、41.75%，跌幅较为靠前的行业是消费者服务、非银金融、家电、房地产、农林牧渔，跌幅分别为 24.45%、20.41%、18.57%、9.63%、6.67%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 8.3085 元，份额累计净值为 1.6378 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 22.55%，同期业绩基准增长率 15.58%。

#### 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 2022 年，新冠疫情将会逐步常态化，多国逐步放开防控限制，未来疫情对全球经济影响将会减弱。从全球流动性上来看，海外央行都开始收紧流动性。美联储 Taper 靴子落地，市场预期 3 月加息，美国货币政策逐步常态化；其他国家也开始逐步加息。国内经济方面，稳增长政策发力、疫情逐步缓解两大宏观主线向好，将拉动经济内生性改善。通胀方面，终端消费回暖、猪价周期性回升，中国 CPI 中枢逐步上移，且总体可控，同时，全球供需缺口收窄，中国 PPI 将步入回落周期。在通胀总体可控以及稳增长稳信用的大方向下，需要财政政策和货币政策协调联动，稳健偏松的货币政策配合财政政策发力，流动性保持合理充裕。我们认为 2022 年 A 股在稳增长、货币相对宽松的整体背景下，将呈现出震荡及结构性行情。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告。

2021 年，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步完善投资管理相关的管理机制，修订了《股票池管理办法》、《债券池管理办法》、《信用风险处置制度》等制度文件。系统建设方面，对“金手指估值系统”进行升级改造，对“博时产品管理系统”、“新一代决策支持系统”等管理

平台进行持续迭代更新，同时上线了“统一风险管理平台”，提升了公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，制定了《销售机构管理规范》，日常业务中按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 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公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01% 以上时，可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对基金份额收益分配另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金

收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，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**

托管人声明：

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本年度报告中财务指标、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 审计报告**

---

普华永道中天审字(2022)第 24196 号

博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

### (一)我们审计的内容

我们审计了博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“博时中证 500ETF”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### (二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了博时中证 500ETF 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博时上证 50ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时中证 500ETF 的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估博时中证 500ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算博时中证 500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时中证 500ETF 的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来

可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对博时中证 500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时中证 500ETF 不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

薛竞 叶尔甸

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2022 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		-	-
银行存款	7.4.7.1	14,848,608.01	41,838,062.67
结算备付金		18,020,499.36	15,841,872.04
存出保证金		5,007,924.24	9,841,435.01
交易性金融资产	7.4.7.2	585,948,720.93	861,404,297.35
其中: 股票投资		585,932,720.93	861,404,297.35
基金投资		-	-
债券投资		16,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,498,320.17	2,780,583.97
应收利息	7.4.7.5	10,687.43	12,598.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>627,334,760.14</b>	<b>931,718,850.00</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,460,787.18	2,636,986.74
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		74,281.52	106,558.16
应付托管费		24,760.51	35,519.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	207,291.60	341,073.58
应交税费		-	249,704.59
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	302,544.26	260,655.69
<b>负债合计</b>		<b>5,069,665.07</b>	<b>3,630,498.14</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	379,937,636.75	694,459,336.10
未分配利润	7.4.7.10	242,327,458.32	233,629,015.76

所有者权益合计		<b>622,265,095.07</b>	<b>928,088,351.86</b>
负债和所有者权益总计		<b>627,334,760.14</b>	<b>931,718,850.00</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 8.3085 元，基金份额总额 74,895,098.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>123,490,283.40</b>	<b>359,935,599.80</b>
1.利息收入		487,190.72	1,888,133.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	328,312.68	710,582.34
债券利息收入		78.60	843.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	23,903.52
证券出借利息收入		158,799.44	1,152,803.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		122,503,111.28	445,632,402.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	105,670,461.61	411,489,441.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	97,861.82	1,079,833.09
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	10,521,001.95	22,329,825.25
股利收益	7.4.7.15	6,213,785.90	10,733,302.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,629,576.34	-95,036,308.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,129,557.74	7,451,372.65
<b>减：二、费用</b>		<b>3,619,704.84</b>	<b>10,149,729.42</b>
1. 管理人报酬		822,244.65	1,775,438.68
2. 托管费		274,081.57	591,812.92
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,131,405.50	7,149,781.83
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		39,879.20	84,541.28
7. 其他费用	7.4.7.19	352,093.92	548,154.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>119,870,578.56</b>	<b>349,785,870.38</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>119,870,578.56</b>	<b>349,785,870.38</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	694,459,336.10	233,629,015.76	928,088,351.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	119,870,578.56	119,870,578.56
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）	-314,521,699.35	-111,172,136.00	-425,693,835.35
其中：1.基金申购款	974,002,681.23	449,649,429.13	1,423,652,110.36
2.基金赎回款	-1,288,524,380.58	-560,821,565.13	-1,849,345,945.71
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)	379,937,636.75	242,327,458.32	622,265,095.07
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,877,466,759.35	72,333,952.91	1,949,800,712.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	349,785,870.38	349,785,870.38
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）	-1,183,007,423.25	-188,490,807.53	-1,371,498,230.78
其中：1.基金申购款	4,447,945,578.17	800,771,378.58	5,248,716,956.75
2.基金赎回款	-5,630,953,001.42	-989,262,186.11	-6,620,215,187.53
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)	694,459,336.10	233,629,015.76	928,088,351.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：孙献，会计机构负责人：倡方方

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 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。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、货币市场工具(包括银行存款、同业存单、债券回购等)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金的基金管理人博时基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“博时中证 500ETF 联接基金”)。博时中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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“重要会计政策和会计估计”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。

#### 7.4.3 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基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值

为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额/折算引起的实收基金份额变动于基金份额/折算日根据拆分前的基金份额数及确定的/折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况

下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01% 以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	14,848,608.01	41,838,062.67
定期存款	-	-
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	-	-
合计	14,848,608.01	41,838,062.67

**7.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		566,998,455.66	585,932,720.93	18,934,265.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	16,000.00	16,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	16,000.00	16,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		567,014,455.66	585,948,720.93	18,934,265.27
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		840,288,695.74	861,404,297.35	21,115,601.61
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		840,288,695.74	861,404,297.35	21,115,601.61

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日			备注
		合同/名义 金额	公允价值		
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-
权益衍生工具		29,863,080.00	-	-	-
股指期货		29,863,080.00	-	-	-
其他衍生工具		-	-	-	-
合计		29,863,080.00	-	-	-
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日			备注
		合同/名义 金额	公允价值		
			资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	57,493,640.00	-	-	-
股指期货	57,493,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	57,493,640.00	-	-	-

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2203	中证 500 期货 2203 合约	21	30,684,360.00	821,280.00
减：可抵销期货暂收款				821,280.00
股指期货投资净额				-

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2103	中证 500 期货 2103 合约	47	58,763,160.00	1,269,520.00
减：可抵销期货暂收款				1,269,520.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,504.79	4,377.65
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	9,133.49	8,003.84
应收债券利息	0.53	-
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	48.62	217.47
合计	10,687.43	12,598.96

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	207,291.60	341,073.58
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	207,291.60	341,073.58

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	185,000.00	190,000.00
应付指数使用费	117,544.26	70,655.69
合计	302,544.26	260,655.69

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,895,098.00	694,459,336.10
本期申购	192,000,000.00	974,002,681.23
本期赎回（以“-”号填列）	-254,000,000.00	-1,288,524,380.58
本期末	74,895,098.00	379,937,636.75

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)。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	296,074,609.17	-62,445,593.41	233,629,015.76
本期利润	122,500,154.90	-2,629,576.34	119,870,578.56

本期基金份额交易产生的变动数	-126,358,450.22	15,186,314.22	-111,172,136.00
其中：基金申购款	571,094,119.18	-121,444,690.05	449,649,429.13
基金赎回款	-697,452,569.40	136,631,004.27	-560,821,565.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	292,216,313.85	-49,888,855.53	242,327,458.32

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	76,694.60	314,900.30
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	248,240.55	386,946.18
其他	3,377.53	8,735.86
合计	328,312.68	710,582.34

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	81,571,285.77	188,979,074.52
股票投资收益——赎回差价收入	24,099,175.84	222,510,366.62
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	105,670,461.61	411,489,441.14

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,138,995,122.95	3,340,480,283.49
减：卖出股票成本总额	1,057,423,837.18	3,151,501,208.97
买卖股票差价收入	81,571,285.77	188,979,074.52

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,849,345,945.71	6,620,215,187.53
减：现金支付赎回款总额	878,180,775.71	2,958,405,649.53
减：赎回股票成本总额	947,065,994.16	3,439,299,171.38
赎回差价收入	24,099,175.84	222,510,366.62

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	470,042.06	6,080,862.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	372,100.00	4,999,900.00
减：应收利息总额	80.24	1,129.50
买卖债券差价收入	97,861.82	1,079,833.09

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	10,521,001.95	22,329,825.25

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,213,785.90	10,733,302.65
其中：证券出借权益补偿收入	27,732.28	303,342.80
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	6,213,785.90	10,733,302.65
----	--------------	---------------

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-2,181,336.34	-88,788,468.08
——股票投资	-2,181,336.34	-88,788,468.08
——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	-448,240.00	-6,247,840.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-448,240.00	-6,247,840.00
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	-2,629,576.34	-95,036,308.08

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
替代损益	3,129,557.74	7,451,372.65
合计	3,129,557.74	7,451,372.65

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,131,405.50	7,149,781.83
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,131,405.50	7,149,781.83

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月	2020年1月1日至2020年12月

	31 日	31 日
审计费用	65,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	2,645.00	3,066.95
指数使用费	164,448.92	355,087.76
合计	352,093.92	548,154.71

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司
博时中证 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：1. 根据中国证券监督管理委员会《关于核准博时基金管理有限公司设立子公司的批复》（证监许可[2021]2709 号），博时基金管理有限公司获准设立子公司博时财富基金销售有限公司，注册地为深圳市，注册资本为人民币 5,000 万元，业务范围为证券投资基金销售业务以及中国证监会许可的其他业务。博时财富基金销售有限公司于 2021 年 9 月 7 日获得深圳市市场监督管理局颁发的企业法人营业执照。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	1,737,352,007.49	82.36%	5,241,721,678.53	83.37%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	76,737.60	16.33%	365,715.00	6.01%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.5 基金交易

无。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	470,212.71	63.33%	49,067.36	23.67%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	2,333,047.30	75.32%	156,460.15	45.87%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	822,244.65	1,775,438.68
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	274,081.57	591,812.92

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

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	44,582,681.00	59.53%	77,189,081.00	56.39%
招商证券	2,977,572.00	3.98%	4,910,280.00	3.59%

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

#### 7.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	14,848,608.01	76,694.60	41,838,062.67	314,900.30

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。

#### 7.4.10.7 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	688103	国力股份	网下发行	1,595.00	19,203.80
招商证券	688739	成大生物	网下发行	1,914.00	210,540.00
招商证券	001288	运机集团	网下发行	537.00	7,813.35
招商证券	301193	家联科技	网下发行	2,970.00	91,268.10
招商证券	688206	概伦电子	网下发行	6,000.00	169,680.00
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688262	国芯科技	2021-1-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	4,886.00	205,114.28	205,114.28	-
688787	海天瑞声	2021-08-05	2022-02-14	首次公开发行股票限售	36.94	87.35	817.00	30,179.98	71,364.95	-
688255	凯尔达	2021-10-14	2022-04-25	首次公开发行股票限售	47.11	37.87	1,648.00	77,637.28	62,409.76	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	首次公开发行股票限售	60.66	96.75	498.00	30,208.68	48,181.50	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	首次公开发行股票限售	14.14	89.87	462.00	6,532.68	41,519.94	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	首次公开发行股票限售	25.80	33.65	841.00	21,697.80	28,299.65	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	首次公开发行股票限售	116.88	116.08	225.00	26,298.00	26,118.00	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	首次公开发行股票限售	3.55	18.24	1,386.00	4,920.30	25,280.64	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	首次公开发行股票限售	60.64	234.74	107.00	6,488.48	25,117.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	首次公开发行股票限售	6.96	12.51	1,961.00	13,648.56	24,532.11	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	首次公开发行股票限售	86.06	94.50	236.00	20,310.16	22,302.00	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	首次公开发行股票限售	10.07	16.76	1,214.00	12,224.98	20,346.64	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	首次公开发行股票限售	69.89	88.72	228.00	15,934.92	20,228.16	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	首次公开发行股票限售	11.90	45.45	420.00	4,998.00	19,089.00	-

301100	风光股份	2021-1-2-10	2022-06-17	首次公开发行限售	27.81	31.14	599.00	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	首次公开发行限售	4.17	30.94	587.00	2,447.79	18,161.78	-
301168	通灵股份	2021-1-2-02	2022-06-10	首次公开发行限售	39.08	52.13	329.00	12,857.32	17,150.77	-
301101	明月镜片	2021-1-2-09	2022-06-16	首次公开发行限售	26.91	43.36	371.00	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021-1-2-17	2022-06-24	首次公开发行限售	27.85	27.46	575.00	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	首次公开发行限售	22.70	49.02	315.00	7,150.50	15,441.30	-
301179	泽宇智能	2021-1-2-01	2022-06-08	首次公开发行限售	43.99	50.77	295.00	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-1-0-20	2022-04-27	首次公开发行限售	19.11	67.93	220.00	4,204.20	14,944.60	-
301096	百诚医药	2021-1-2-13	2022-06-20	首次公开发行限售	79.60	78.53	190.00	15,124.00	14,920.70	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	首次公开发行限售	12.20	22.72	654.00	7,978.80	14,858.88	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	首次公开发行限售	8.34	48.99	290.00	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	首次公开发行限售	10.48	36.68	379.00	3,971.92	13,901.72	-
301088	戎美股份	2021-1-0-19	2022-04-28	首次公开发行限售	33.16	24.67	524.00	17,375.84	12,927.08	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	10.64	30.44	421.00	4,479.44	12,815.24	-
301138	华研精机	2021-1-2-08	2022-06-15	首次公开发行	26.17	44.86	285.00	7,458.45	12,785.10	-

				限售						
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	首次公开发行限售	18.03	62.73	203.00	3,660.09	12,734.19	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	首次公开发行限售	57.27	53.71	227.00	13,000.29	12,192.17	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	首次公开发行限售	36.31	35.52	312.00	11,328.72	11,082.24	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	首次公开发行限售	4.13	12.96	843.00	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	首次公开发行限售	5.31	13.50	733.00	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	首次公开发行限售	15.81	28.37	335.00	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	首次公开发行限售	4.57	21.08	444.00	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	首次公开发行限售	13.57	38.51	241.00	3,270.37	9,280.91	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	首次公开发行限售	27.12	30.58	294.00	7,973.28	8,990.52	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	首次公开发行限售	3.31	17.01	523.00	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	首次公开发行限售	30.73	29.14	297.00	9,126.81	8,654.58	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-02-28	首次公开发行限售	8.11	33.64	252.00	2,043.72	8,477.28	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	首次公开发行限售	5.24	22.84	344.00	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富	2021-0	2022-	首次公	8.40	23.88	328.00	2,755.20	7,832.64	-

	电路	8-04	02-14	开发行 限售						
301133	金钟 股份	2021-11 -19	2022- 05-26	首次公 开发行 限售	14.33	26.95	286.00	4,098.38	7,707.70	-
301030	仕净 科技	2021-0 7-15	2022- 01-24	首次公 开发行 限售	6.10	31.52	242.00	1,476.20	7,627.84	-
301033	迈普 医学	2021-0 7-15	2022- 01-26	首次公 开发行 限售	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越 科技	2021-0 8-17	2022- 02-24	首次公 开发行 限售	19.34	32.92	196.00	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴 股份	2021-0 7-15	2022- 01-24	首次公 开发行 限售	4.97	12.51	513.00	2,549.61	6,417.63	-
301036	双乐 股份	2021-0 7-21	2022- 02-16	首次公 开发行 限售	23.38	29.93	205.00	4,792.90	6,135.65	-
301041	金 百 泽	2021-0 8-02	2022- 02-11	首次公 开发行 限售	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷 精工	2021-0 9-22	2022- 03-29	首次公 开发行 限售	7.46	33.41	181.00	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰 环保	2021-0 9-08	2022- 03-16	首次公 开发行 限售	9.96	27.29	203.00	2,021.88	5,539.87	-
001234	泰 慕 士	2021-1 2-31	2022- 01-11	新股未 上市	16.53	16.53	333.00	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水 规院	2021-0 7-22	2022- 02-07	首次公 开发行 限售	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	-
301059	金 三 江	2021-0 9-03	2022- 03-14	首次公 开发行 限售	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝 集团	2021-0 7-08	2022- 01-19	首次公 开发行 限售	11.45	16.65	286.00	3,274.70	4,761.90	-
301037	保 立 佳	2021-0 7-21	2022- 02-07	首次公 开发行 限售	14.82	24.26	193.00	2,860.26	4,682.18	-

301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	首次公开发行股票限售	8.03	19.02	218.00	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	首次公开发行股票限售	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	首次公开发行股票限售	11.92	24.82	140.00	1,668.80	3,474.80	-

#### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110084	贵燃转债	2021-12-27	2022-01-18	新债未上市	100.00	100.00	160.00	16,000.00	16,000.00	-

注：1、基金作为特定投资者认购的由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金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；发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期；基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3、基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

4、基金通过询价转让受让的科创板上市公司股东首次公开发行前已发行股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 7.4.12.2 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
002683	宏大爆破	2021-12-20	重大事项停牌	30.12	2022-01-04	31.00	34,700.00	1,014,515.58	1,045,164.00	-

注：本基金截至本期末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股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 7.4.13.2 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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	16,000.00	-
未评级	-	-
合计	16,000.00	-

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

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 7.4.13.3.1 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、流通受限制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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	14,848,608.01	-	-	-	14,848,608.01
结算备付金	18,020,499.36	-	-	-	18,020,499.36
存出保证金	98,426.64	-	-	4,909,497.60	5,007,924.24
交易性金融资产	-	-	16,000.00	585,932,720.93	585,948,720.93
应收证券清算款	-	-	-	3,498,320.17	3,498,320.17
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,687.43	10,687.43
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>32,967,534.01</b>	-	<b>16,000.00</b>	<b>594,351,226.13</b>	<b>627,334,760.14</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,460,787.18	4,460,787.18
应付管理人报酬	-	-	-	74,281.52	74,281.52
应付托管费	-	-	-	24,760.51	24,760.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	207,291.60	207,291.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	302,544.26	302,544.26
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>5,069,665.07</b>	<b>5,069,665.07</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>32,967,534.01</b>	-	<b>16,000.00</b>	<b>589,281,561.06</b>	<b>622,265,095.07</b>
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	41,838,062.67	-	-	-	41,838,062.67
结算备付金	15,841,872.04	-	-	-	15,841,872.04
存出保证金	439,329.41	-	-	9,402,105.60	9,841,435.01
交易性金融资产	-	-	-	861,404,297.35	861,404,297.35
应收证券清算款	-	-	-	2,780,583.97	2,780,583.97
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	12,598.96	12,598.96
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>58,119,264.12</b>	-	-	<b>873,599,585.88</b>	<b>931,718,850.00</b>
<b>负债</b>					

卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	2,636,986.74	2,636,986.74
应付管理人报酬	-	-	106,558.16	106,558.16
应付托管费	-	-	35,519.38	35,519.38
应付销售服务费	-	-	-	-
应交税费	-	-	249,704.59	249,704.59
应付交易费用	-	-	341,073.58	341,073.58
应付利息	-	-	-	-
其他负债	-	-	260,655.69	260,655.69
<b>负债总计</b>	-	-	<b>3,630,498.14</b>	<b>3,630,498.14</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>58,119,264.12</b>	-	<b>869,969,087.74</b>	<b>928,088,351.86</b>

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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(不包括可转债与可交换债)或资产支持证券投资,因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上期:同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	585,932,720.93	94.16	861,404,297.35	92.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	16,000.00	0.00	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>585,948,720.93</b>	<b>94.16</b>	<b>861,404,297.35</b>	<b>92.81</b>

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。

#### 7.4.13.4.3.2 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		
	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）	
分析		本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日	
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,771	增加约 4,218
业绩比较基准下降 5%	减少约 2,771	减少约 4,218	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 583,776,829.65 元，属于第二层次的余额为 2,171,891.28 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 846,843,702.81 元，第二层次 14,560,594.54 元，第三层次 0.00 元）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	585,932,720.93	93.40
	其中：股票	585,932,720.93	93.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,000.00	0.00
	其中：债券	16,000.00	0.00
	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	32,869,107.37	5.24
8	其他各项资产	8,516,931.84	1.36
9	合计	627,334,760.14	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,515,012.00	1.05
B	采矿业	22,539,496.88	3.62
C	制造业	353,195,906.68	56.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,889,854.29	3.52
E	建筑业	11,249,365.17	1.81
F	批发和零售业	18,127,098.16	2.91
G	交通运输、仓储和邮政业	13,666,613.52	2.20
H	住宿和餐饮业	3,514,375.00	0.56
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,250,447.02	8.08
J	金融业	41,950,448.62	6.74
K	房地产业	15,171,520.56	2.44
L	租赁和商务服务业	7,151,730.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	2,160,814.52	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	5,077,166.01	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	179.40	0.00
Q	卫生和社会工作	1,228,729.55	0.20
R	文化、体育和娱乐业	8,033,599.95	1.29
S	综合	4,208,187.60	0.68
	合计	585,930,544.93	94.16

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

## 8.3 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	002340	格林美	398,600	4,125,510.00	0.66
2	000733	振华科技	30,300	3,765,684.00	0.61
3	600522	中天科技	205,700	3,488,672.00	0.56
4	000723	美锦能源	213,200	3,460,236.00	0.56
5	601615	明阳智能	129,900	3,390,390.00	0.54

6	600157	永泰能源	1,849,800	3,366,636.00	0.54
7	600399	抚顺特钢	130,800	3,239,916.00	0.52
8	600885	宏发股份	43,200	3,224,448.00	0.52
9	600884	杉杉股份	95,950	3,144,281.50	0.51
10	000009	中国宝安	214,520	3,095,523.60	0.50
11	002384	东山精密	113,800	3,083,980.00	0.50
12	601117	中国化学	253,800	3,045,600.00	0.49
13	002013	中航机电	161,500	2,936,070.00	0.47
14	601555	东吴证券	330,240	2,925,926.40	0.47
15	002385	大北农	276,200	2,897,338.00	0.47
16	300285	国瓷材料	67,040	2,853,892.80	0.46
17	002268	卫士通	49,500	2,769,030.00	0.44
18	688099	晶晨股份	21,262	2,768,312.40	0.44
19	300088	长信科技	204,800	2,719,744.00	0.44
20	605358	立昂微	22,500	2,700,225.00	0.43
21	600563	法拉电子	11,600	2,695,840.00	0.43
22	688005	容百科技	23,184	2,679,606.72	0.43
23	600765	中航重机	52,600	2,655,774.00	0.43
24	300037	新宙邦	23,400	2,644,200.00	0.42
25	300751	迈为股份	4,000	2,569,200.00	0.41
26	002028	思源电气	50,991	2,509,267.11	0.40
27	600256	广汇能源	383,000	2,504,820.00	0.40
28	002180	纳思达	52,300	2,497,848.00	0.40
29	600862	中航高科	69,600	2,488,896.00	0.40
30	600298	安琪酵母	41,182	2,485,745.52	0.40
31	600141	兴发集团	65,100	2,465,988.00	0.40
32	300363	博腾股份	27,500	2,459,875.00	0.40
33	300253	卫宁健康	142,600	2,389,976.00	0.38
34	600487	亨通光电	157,400	2,379,888.00	0.38
35	002185	华天科技	187,200	2,379,312.00	0.38
36	000988	华工科技	83,962	2,339,181.32	0.38
37	603456	九州药业	41,200	2,317,912.00	0.37
38	601636	旗滨集团	134,600	2,301,660.00	0.37
39	600392	盛和资源	117,300	2,301,426.00	0.37
40	300058	蓝色光标	207,600	2,227,548.00	0.36
41	600754	锦江酒店	37,900	2,220,940.00	0.36
42	600418	江淮汽车	125,900	2,190,660.00	0.35
43	601168	西部矿业	158,700	2,159,907.00	0.35
44	300223	北京君正	16,100	2,157,400.00	0.35
45	603267	鸿远电子	12,000	2,153,280.00	0.35
46	603589	口子窖	30,300	2,147,361.00	0.35
47	300699	光威复材	25,400	2,145,792.00	0.34
48	603613	国联股份	19,900	2,139,250.00	0.34

49	000630	铜陵有色	613,600	2,135,328.00	0.34
50	600516	方大炭素	190,300	2,059,046.00	0.33
51	300136	信维通信	81,000	2,050,920.00	0.33
52	002138	顺络电子	53,700	2,050,266.00	0.33
53	002797	第一创业	280,060	2,050,039.20	0.33
54	600486	扬农化工	15,600	2,046,720.00	0.33
55	000998	隆平高科	87,700	2,039,902.00	0.33
56	300308	中际旭创	47,000	1,997,500.00	0.32
57	300724	捷佳伟创	17,400	1,988,820.00	0.32
58	601077	渝农商行	515,100	1,983,135.00	0.32
59	688065	凯赛生物	10,758	1,982,484.24	0.32
60	600875	东方电气	92,300	1,977,066.00	0.32
61	300474	景嘉微	12,900	1,963,380.00	0.32
62	000728	国元证券	253,800	1,954,260.00	0.31
63	601689	拓普集团	36,600	1,939,800.00	0.31
64	600038	中直股份	24,100	1,935,230.00	0.31
65	603893	瑞芯微	14,100	1,930,290.00	0.31
66	002353	杰瑞股份	48,200	1,928,000.00	0.31
67	300763	锦浪科技	8,300	1,921,865.00	0.31
68	300146	汤臣倍健	70,800	1,908,768.00	0.31
69	002212	天融信	99,140	1,900,513.80	0.31
70	002223	鱼跃医疗	50,264	1,899,979.20	0.31
71	002409	雅克科技	23,400	1,899,378.00	0.31
72	600233	圆通速递	113,800	1,898,184.00	0.31
73	002080	中材科技	55,700	1,894,914.00	0.30
74	300418	昆仑万维	80,200	1,856,630.00	0.30
75	000519	中兵红箭	69,600	1,856,232.00	0.30
76	688208	道通科技	23,171	1,839,777.40	0.30
77	002673	西部证券	223,600	1,804,452.00	0.29
78	688002	睿创微纳	22,864	1,796,424.48	0.29
79	002439	启明星辰	62,700	1,788,831.00	0.29
80	600733	北汽蓝谷	178,300	1,786,566.00	0.29
81	000547	航天发展	106,773	1,783,109.10	0.29
82	688536	思瑞浦	2,305	1,770,240.00	0.28
83	600482	中国动力	89,800	1,769,060.00	0.28
84	600705	中航产融	445,200	1,767,444.00	0.28
85	000932	华菱钢铁	345,540	1,765,709.40	0.28
86	600699	均胜电子	80,300	1,764,191.00	0.28
87	000636	风华高科	59,200	1,764,160.00	0.28
88	000039	中集集团	102,500	1,758,900.00	0.28
89	603077	和邦生物	514,340	1,753,899.40	0.28
90	603605	珀莱雅	8,400	1,749,804.00	0.28
91	000807	云铝股份	156,330	1,746,206.10	0.28

92	600188	兖矿能源	74,000	1,741,220.00	0.28
93	300296	利亚德	169,800	1,740,450.00	0.28
94	600739	辽宁成大	89,100	1,739,232.00	0.28
95	002444	巨星科技	56,800	1,732,968.00	0.28
96	000739	普洛药业	49,300	1,729,937.00	0.28
97	600529	山东药玻	39,400	1,729,660.00	0.28
98	002507	涪陵榨菜	44,900	1,697,220.00	0.27
99	002465	海格通信	153,800	1,679,496.00	0.27
100	688521	芯原股份	21,521	1,664,864.56	0.27
101	000738	航发控制	54,600	1,653,288.00	0.27
102	002030	达安基因	82,236	1,649,654.16	0.27
103	600988	赤峰黄金	110,500	1,646,450.00	0.26
104	000960	锡业股份	83,600	1,632,708.00	0.26
105	601016	节能风电	250,100	1,628,151.00	0.26
106	600637	东方明珠	170,900	1,615,005.00	0.26
107	600521	华海药业	74,300	1,609,338.00	0.26
108	002273	水晶光电	92,300	1,605,097.00	0.26
109	600549	厦门钨业	70,800	1,602,204.00	0.26
110	600177	雅戈尔	231,100	1,592,279.00	0.26
111	600732	爱旭股份	68,000	1,588,480.00	0.26
112	601198	东兴证券	135,000	1,570,050.00	0.25
113	603127	昭衍新药	13,600	1,569,848.00	0.25
114	002985	北摩高科	12,960	1,561,161.60	0.25
115	002078	太阳纸业	134,569	1,546,197.81	0.25
116	600704	物产中大	259,800	1,538,016.00	0.25
117	300383	光环新网	103,000	1,528,520.00	0.25
118	600201	生物股份	93,400	1,527,090.00	0.25
119	603290	斯达半导	4,000	1,524,000.00	0.24
120	002557	洽洽食品	24,813	1,522,525.68	0.24
121	002299	圣农发展	62,700	1,515,459.00	0.24
122	600642	申能股份	204,935	1,510,370.95	0.24
123	601128	常熟银行	228,200	1,508,402.00	0.24
124	002156	通富微电	77,000	1,496,110.00	0.24
125	600879	航天电子	180,800	1,489,792.00	0.24
126	600497	驰宏锌锗	296,872	1,481,391.28	0.24
127	300357	我武生物	25,800	1,478,340.00	0.24
128	600369	西南证券	276,900	1,464,801.00	0.24
129	600027	华电国际	271,000	1,449,850.00	0.23
130	600372	中航电子	64,600	1,446,394.00	0.23
131	600160	巨化股份	112,000	1,445,920.00	0.23
132	000830	鲁西化工	94,700	1,445,122.00	0.23
133	300618	寒锐钴业	18,000	1,443,240.00	0.23
134	600039	四川路桥	119,500	1,438,780.00	0.23

135	002092	中泰化学	150,620	1,436,914.80	0.23
136	603444	吉比特	3,400	1,434,290.00	0.23
137	002739	万达电影	92,600	1,433,448.00	0.23
138	000623	吉林敖东	77,020	1,422,559.40	0.23
139	000983	山西焦煤	170,860	1,413,012.20	0.23
140	002508	老板电器	39,200	1,411,984.00	0.23
141	600316	洪都航空	35,800	1,398,348.00	0.22
142	600580	卧龙电驱	76,300	1,395,527.00	0.22
143	000629	攀钢钒钛	357,200	1,389,508.00	0.22
144	300115	长盈精密	69,988	1,388,561.92	0.22
145	601997	贵阳银行	213,000	1,386,630.00	0.22
146	002131	利欧股份	562,300	1,383,258.00	0.22
147	603198	迎驾贡酒	19,800	1,375,110.00	0.22
148	002373	千方科技	91,848	1,373,127.60	0.22
149	002249	大洋电机	155,800	1,369,482.00	0.22
150	300017	网宿科技	204,200	1,366,098.00	0.22
151	002603	以岭药业	69,540	1,362,984.00	0.22
152	002936	郑州银行	427,973	1,352,394.68	0.22
153	002422	科伦药业	71,200	1,347,816.00	0.22
154	600118	中国卫星	49,400	1,341,210.00	0.22
155	000825	太钢不锈	189,900	1,336,896.00	0.21
156	000050	深天马 A	102,500	1,334,550.00	0.21
157	600170	上海建工	370,600	1,334,160.00	0.21
158	600859	王府井	49,100	1,325,700.00	0.21
159	300070	碧水源	183,900	1,322,241.00	0.21
160	000887	中鼎股份	60,500	1,319,505.00	0.21
161	600166	福田汽车	383,389	1,318,858.16	0.21
162	000400	许继电气	50,500	1,318,050.00	0.21
163	603218	日月股份	40,000	1,318,000.00	0.21
164	000750	国海证券	317,200	1,303,692.00	0.21
165	600803	新奥股份	71,000	1,303,560.00	0.21
166	600867	通化东宝	118,800	1,302,048.00	0.21
167	600153	建发股份	142,900	1,296,103.00	0.21
168	002506	协鑫集成	341,000	1,295,800.00	0.21
169	600258	首旅酒店	49,500	1,293,435.00	0.21
170	300001	特锐德	52,000	1,293,240.00	0.21
171	300168	万达信息	99,300	1,292,886.00	0.21
172	002191	劲嘉股份	85,400	1,292,102.00	0.21
173	603707	健友股份	30,690	1,288,980.00	0.21
174	002372	伟星新材	53,000	1,288,960.00	0.21
175	002926	华西证券	130,640	1,286,804.00	0.21
176	000027	深圳能源	158,380	1,282,878.00	0.21
177	002056	横店东磁	67,900	1,281,273.00	0.21

178	002266	浙富控股	178,700	1,272,344.00	0.20
179	600909	华安证券	234,260	1,267,346.60	0.20
180	600236	桂冠电力	196,600	1,262,172.00	0.20
181	000513	丽珠集团	31,342	1,260,261.82	0.20
182	002002	鸿达兴业	207,900	1,259,874.00	0.20
183	300251	光线传媒	97,600	1,254,160.00	0.20
184	600008	首创环保	366,874	1,251,040.34	0.20
185	002065	东华软件	160,000	1,248,000.00	0.20
186	000997	新大陆	68,800	1,246,656.00	0.20
187	300009	安科生物	95,048	1,244,178.32	0.20
188	600066	宇通客车	112,600	1,240,852.00	0.20
189	600271	航天信息	92,300	1,235,897.00	0.20
190	002152	广电运通	103,500	1,231,650.00	0.20
191	002408	齐翔腾达	117,260	1,231,230.00	0.20
192	000021	深科技	77,500	1,227,600.00	0.20
193	002203	海亮股份	98,700	1,226,841.00	0.20
194	600171	上海贝岭	47,800	1,226,548.00	0.20
195	000975	银泰黄金	138,880	1,219,366.40	0.20
196	600536	中国软件	24,400	1,218,292.00	0.20
197	300244	迪安诊断	36,061	1,210,567.77	0.19
198	002221	东华能源	95,600	1,203,604.00	0.19
199	000656	金科股份	266,500	1,193,920.00	0.19
200	600535	天士力	75,300	1,193,505.00	0.19
201	600348	华阳股份	100,500	1,190,925.00	0.19
202	300630	普利制药	21,572	1,187,322.88	0.19
203	603156	养元饮品	41,700	1,184,697.00	0.19
204	603568	伟明环保	32,390	1,183,206.70	0.19
205	002500	山西证券	179,090	1,181,994.00	0.19
206	300212	易华录	33,420	1,181,397.00	0.19
207	002572	索菲亚	53,185	1,180,707.00	0.19
208	300026	红日药业	149,750	1,172,542.50	0.19
209	601005	重庆钢铁	558,500	1,167,265.00	0.19
210	300024	机器人	104,000	1,161,680.00	0.19
211	600315	上海家化	28,700	1,159,767.00	0.19
212	600998	九州通	77,500	1,140,800.00	0.18
213	000878	云南铜业	85,100	1,137,787.00	0.18
214	601699	潞安环能	100,000	1,131,000.00	0.18
215	000537	广宇发展	46,900	1,130,290.00	0.18
216	000012	南玻 A	113,800	1,130,034.00	0.18
217	002127	南极电商	163,200	1,126,080.00	0.18
218	000999	华润三九	32,800	1,123,072.00	0.18
219	002745	木林森	73,900	1,118,107.00	0.18
220	300315	掌趣科技	229,500	1,115,370.00	0.18

221	002195	二三四五	476,500	1,115,010.00	0.18
222	600673	东阳光	125,300	1,112,664.00	0.18
223	000970	中科三环	69,300	1,112,265.00	0.18
224	600415	小商品城	228,500	1,108,225.00	0.18
225	601872	招商轮船	269,600	1,105,360.00	0.18
226	603712	七一二	25,400	1,099,820.00	0.18
227	002511	中顺洁柔	65,800	1,099,518.00	0.18
228	002250	联化科技	61,000	1,096,170.00	0.18
229	600801	华新水泥	56,500	1,090,450.00	0.18
230	300182	捷成股份	171,800	1,087,494.00	0.17
231	300463	迈克生物	36,900	1,077,111.00	0.17
232	002019	亿帆医药	61,066	1,075,982.92	0.17
233	002153	石基信息	37,300	1,072,002.00	0.17
234	000690	宝新能源	180,800	1,070,336.00	0.17
235	600863	内蒙华电	271,000	1,067,740.00	0.17
236	600208	新潮中宝	357,500	1,065,350.00	0.17
237	600970	中材国际	92,100	1,052,703.00	0.17
238	002831	裕同科技	31,240	1,052,475.60	0.17
239	002683	宏大爆破	34,700	1,045,164.00	0.17
240	000060	中金岭南	212,600	1,043,866.00	0.17
241	600517	国网英大	142,700	1,040,283.00	0.17
242	000686	东北证券	117,300	1,029,894.00	0.17
243	601778	晶科科技	120,700	1,029,571.00	0.17
244	600380	健康元	79,700	1,023,348.00	0.16
245	601866	中远海发	312,967	1,017,142.75	0.16
246	600839	四川长虹	306,966	1,016,057.46	0.16
247	688006	杭可科技	9,439	1,015,447.62	0.16
248	002505	鹏都农牧	265,200	1,013,064.00	0.16
249	600498	烽火通信	56,300	1,012,274.00	0.16
250	600155	华创阳安	101,600	1,011,936.00	0.16
251	002294	信立泰	37,020	1,011,386.40	0.16
252	603858	步长制药	47,900	1,010,211.00	0.16
253	000930	中粮科技	92,900	1,009,823.00	0.16
254	600390	五矿资本	187,700	998,564.00	0.16
255	300482	万孚生物	25,355	998,479.90	0.16
256	002939	长城证券	77,100	998,445.00	0.16
257	000729	燕京啤酒	117,700	996,919.00	0.16
258	600511	国药股份	31,600	996,348.00	0.16
259	600667	太极实业	122,700	991,416.00	0.16
260	600500	中化国际	115,600	989,536.00	0.16
261	000401	冀东水泥	82,700	989,092.00	0.16
262	002701	奥瑞金	141,263	988,841.00	0.16
263	601992	金隅集团	347,500	986,900.00	0.16

264	600718	东软集团	72,300	980,388.00	0.16
265	600728	佳都科技	117,500	978,775.00	0.16
266	600895	张江高科	64,800	975,888.00	0.16
267	600158	中体产业	64,300	972,216.00	0.16
268	002430	杭氧股份	32,300	969,323.00	0.16
269	300376	易事特	95,813	962,920.65	0.15
270	600216	浙江医药	56,000	956,480.00	0.15
271	002128	电投能源	64,400	956,340.00	0.15
272	002004	华邦健康	131,506	952,103.44	0.15
273	603225	新凤鸣	64,100	951,885.00	0.15
274	002532	天山铝业	116,700	951,105.00	0.15
275	600282	南钢股份	256,800	950,160.00	0.15
276	002382	蓝帆医疗	58,300	949,707.00	0.15
277	601179	中国西电	171,034	949,238.70	0.15
278	600764	中国海防	23,300	947,378.00	0.15
279	002966	苏州银行	138,900	940,353.00	0.15
280	000598	兴蓉环境	148,700	939,784.00	0.15
281	300072	三聚环保	117,700	933,361.00	0.15
282	002368	太极股份	33,818	931,347.72	0.15
283	600985	淮北矿业	83,000	927,940.00	0.15
284	002595	豪迈科技	33,401	927,211.76	0.15
285	000540	中天金融	350,100	924,264.00	0.15
286	002670	国盛金控	96,140	922,944.00	0.15
287	002174	游族网络	60,502	922,050.48	0.15
288	002396	星网锐捷	38,600	909,802.00	0.15
289	600528	中铁工业	110,700	908,847.00	0.15
290	603638	艾迪精密	28,460	908,443.20	0.15
291	603866	桃李面包	31,968	907,891.20	0.15
292	688188	柏楚电子	2,348	905,060.08	0.15
293	600297	广汇汽车	337,500	901,125.00	0.14
294	600409	三友化工	103,300	898,710.00	0.14
295	002048	宁波华翔	41,300	893,319.00	0.14
296	600827	百联股份	67,000	893,110.00	0.14
297	000581	威孚高科	41,400	891,756.00	0.14
298	002010	传化智联	102,500	891,750.00	0.14
299	002958	青农商行	231,000	891,660.00	0.14
300	600755	厦门国贸	123,400	889,714.00	0.14
301	688029	南微医学	4,163	885,345.21	0.14
302	600567	山鹰国际	268,821	884,421.09	0.14
303	600060	海信视像	65,700	883,665.00	0.14
304	601717	郑煤机	76,100	881,999.00	0.14
305	603885	吉祥航空	49,300	875,075.00	0.14
306	300271	华宇软件	68,700	872,490.00	0.14

307	000709	河钢股份	353,600	869,856.00	0.14
308	600131	国网信通	39,500	863,075.00	0.14
309	000778	新兴铸管	199,020	861,756.60	0.14
310	600566	济川药业	30,300	858,702.00	0.14
311	600598	北大荒	58,800	856,128.00	0.14
312	002183	怡亚通	129,300	855,966.00	0.14
313	002075	沙钢股份	146,600	854,678.00	0.14
314	000883	湖北能源	162,200	849,928.00	0.14
315	600325	华发股份	141,000	848,820.00	0.14
316	002925	盈趣科技	24,940	848,708.20	0.14
317	600967	内蒙一机	70,900	847,255.00	0.14
318	600820	隧道股份	157,100	845,198.00	0.14
319	603883	老百姓	17,060	842,422.80	0.14
320	600021	上海电力	65,700	842,274.00	0.14
321	600782	新钢股份	159,300	841,104.00	0.14
322	600507	方大特钢	107,598	839,264.40	0.13
323	600737	中粮糖业	89,000	836,600.00	0.13
324	002690	美亚光电	22,228	832,660.88	0.13
325	601456	国联证券	59,200	827,024.00	0.13
326	603927	中科软	30,000	820,800.00	0.13
327	002434	万里扬	55,600	819,544.00	0.13
328	600707	彩虹股份	119,700	816,354.00	0.13
329	600022	山东钢铁	455,700	815,703.00	0.13
330	002281	光迅科技	35,000	815,150.00	0.13
331	601880	辽港股份	470,700	814,311.00	0.13
332	000990	诚志股份	51,000	806,820.00	0.13
333	000987	越秀金控	92,500	804,750.00	0.13
334	601106	中国一重	228,499	795,176.52	0.13
335	600663	陆家嘴	73,100	793,866.00	0.13
336	600435	北方导航	74,200	792,456.00	0.13
337	002124	天邦股份	122,600	789,544.00	0.13
338	601577	长沙银行	100,800	787,248.00	0.13
339	688088	虹软科技	17,847	786,338.82	0.13
340	002146	荣盛发展	180,700	786,045.00	0.13
341	600446	金证股份	54,700	783,304.00	0.13
342	600572	康恩贝	155,700	778,500.00	0.13
343	603650	彤程新材	15,100	759,832.00	0.12
344	002390	信邦制药	101,500	753,130.00	0.12
345	601118	海南橡胶	142,400	751,872.00	0.12
346	688321	微芯生物	21,432	750,334.32	0.12
347	000877	天山股份	48,902	748,689.62	0.12
348	600259	广晟有色	15,200	748,448.00	0.12
349	000898	鞍钢股份	199,300	747,375.00	0.12

350	600811	东方集团	247,300	744,373.00	0.12
351	600597	光明乳业	51,100	741,972.00	0.12
352	000488	晨鸣纸业	102,200	739,928.00	0.12
353	600329	中新药业	23,500	738,135.00	0.12
354	002233	塔牌集团	69,500	735,310.00	0.12
355	002429	兆驰股份	151,200	734,832.00	0.12
356	600808	马钢股份	198,355	731,929.95	0.12
357	002440	闰土股份	76,200	730,758.00	0.12
358	603228	景旺电子	21,080	727,892.40	0.12
359	300166	东方国信	67,300	726,840.00	0.12
360	002155	湖南黄金	70,100	726,236.00	0.12
361	001914	招商积余	35,300	715,178.00	0.11
362	600037	歌华有线	81,600	708,288.00	0.11
363	601200	上海环境	55,900	703,781.00	0.11
364	600908	无锡银行	124,000	703,080.00	0.11
365	002416	爱施德	61,500	699,870.00	0.11
366	000559	万向钱潮	109,700	698,789.00	0.11
367	002085	万丰奥威	127,200	698,328.00	0.11
368	002110	三钢闽光	102,300	695,640.00	0.11
369	600373	中文传媒	56,200	694,632.00	0.11
370	002705	新宝股份	28,000	691,600.00	0.11
371	600398	海澜之家	107,800	690,998.00	0.11
372	600906	财达证券	53,900	687,764.00	0.11
373	600026	中远海能	116,000	686,720.00	0.11
374	600167	联美控股	75,800	682,958.00	0.11
375	600546	山煤国际	82,900	680,609.00	0.11
376	601000	唐山港	246,650	678,287.50	0.11
377	002081	金螳螂	110,900	674,272.00	0.11
378	600064	南京高科	71,900	671,546.00	0.11
379	603000	人民网	46,470	670,097.40	0.11
380	601991	大唐发电	206,700	669,708.00	0.11
381	600195	中牧股份	50,903	665,302.21	0.11
382	000528	柳工	86,100	663,831.00	0.11
383	601611	中国核建	66,400	662,008.00	0.11
384	000961	中南建设	159,300	659,502.00	0.11
385	601718	际华集团	218,900	652,322.00	0.10
386	000685	中山公用	73,500	650,475.00	0.10
387	002867	周大生	36,450	648,081.00	0.10
388	601608	中信重工	144,250	643,355.00	0.10
389	000158	常山北明	92,846	642,494.32	0.10
390	002038	双鹭药业	59,400	642,114.00	0.10
391	002387	维信诺	69,100	641,248.00	0.10
392	300133	华策影视	94,500	639,765.00	0.10

393	600120	浙江东方	144,447	638,455.74	0.10
394	000090	天健集团	108,600	637,482.00	0.10
395	000959	首钢股份	110,900	635,457.00	0.10
396	601333	广深铁路	282,300	632,352.00	0.10
397	000758	中色股份	114,800	626,808.00	0.10
398	000089	深圳机场	85,500	625,860.00	0.10
399	000671	阳光城	205,800	621,516.00	0.10
400	003022	联泓新科	16,700	608,548.00	0.10
401	600376	首开股份	107,300	607,318.00	0.10
402	600582	天地科技	138,045	604,637.10	0.10
403	000415	渤海租赁	206,300	600,333.00	0.10
404	000718	苏宁环球	126,100	593,931.00	0.10
405	601598	中国外运	130,700	585,536.00	0.09
406	002242	九阳股份	25,000	580,000.00	0.09
407	601975	招商南油	287,139	577,149.39	0.09
408	600062	华润双鹤	43,000	574,910.00	0.09
409	600126	杭钢股份	112,000	574,560.00	0.09
410	600307	酒钢宏兴	261,100	574,420.00	0.09
411	000967	盈峰环境	78,300	573,939.00	0.09
412	601098	中南传媒	59,400	568,458.00	0.09
413	000402	金融街	99,900	565,434.00	0.09
414	600556	天下秀	45,600	563,160.00	0.09
415	002458	益生股份	49,700	562,107.00	0.09
416	601958	金钼股份	81,100	555,535.00	0.09
417	688289	圣湘生物	9,366	552,594.00	0.09
418	001965	招商公路	71,900	551,473.00	0.09
419	600643	爱建集团	81,500	550,940.00	0.09
420	600959	江苏有线	166,130	546,567.70	0.09
421	002399	海普瑞	31,400	536,940.00	0.09
422	600056	中国医药	45,000	531,450.00	0.09
423	000563	陕国投 A	164,500	531,335.00	0.09
424	003035	南网能源	63,500	526,415.00	0.08
425	300257	开山股份	33,000	524,040.00	0.08
426	002563	森马服饰	67,500	521,775.00	0.08
427	601928	凤凰传媒	64,000	517,760.00	0.08
428	300741	华宝股份	10,700	511,995.00	0.08
429	601860	紫金银行	152,800	511,880.00	0.08
430	600901	江苏租赁	99,900	508,491.00	0.08
431	600266	城建发展	112,620	506,790.00	0.08
432	600717	天津港	120,652	505,531.88	0.08
433	603317	天味食品	18,718	501,829.58	0.08
434	600968	海油发展	169,700	497,221.00	0.08
435	002815	崇达技术	29,313	493,924.05	0.08

436	000937	冀中能源	88,300	486,533.00	0.08
437	600095	湘财股份	47,800	483,736.00	0.08
438	002244	滨江集团	103,700	483,242.00	0.08
439	600928	西安银行	110,600	475,580.00	0.08
440	000717	韶钢松山	99,800	474,050.00	0.08
441	000028	国药一致	12,800	473,344.00	0.08
442	002468	申通快递	51,100	464,499.00	0.07
443	002423	中粮资本	57,200	463,320.00	0.07
444	600787	中储股份	73,100	456,144.00	0.07
445	600006	东风汽车	66,800	454,908.00	0.07
446	600776	东方通信	39,500	454,645.00	0.07
447	600729	重庆百货	17,014	442,704.28	0.07
448	002424	贵州百灵	58,100	441,560.00	0.07
449	000062	深圳华强	25,600	441,088.00	0.07
450	600835	上海机电	27,400	436,208.00	0.07
451	600649	城投控股	105,296	432,766.56	0.07
452	000681	视觉中国	18,100	432,590.00	0.07
453	600623	华谊集团	47,500	432,250.00	0.07
454	600339	中油工程	139,500	429,660.00	0.07
455	300869	康泰医学	10,500	425,775.00	0.07
456	601139	深圳燃气	48,200	425,606.00	0.07
457	002375	亚厦股份	55,600	416,444.00	0.07
458	600648	外高桥	31,400	415,422.00	0.07
459	600299	安迪苏	33,600	413,952.00	0.07
460	601969	海南矿业	33,800	405,938.00	0.07
461	000031	大悦城	107,000	399,110.00	0.06
462	000156	华数传媒	46,700	395,082.00	0.06
463	000869	张裕 A	11,700	372,762.00	0.06
464	600639	浦东金桥	28,800	367,776.00	0.06
465	002653	海思科	17,900	365,160.00	0.06
466	600871	石化油服	169,900	363,586.00	0.06
467	600377	宁沪高速	40,900	352,558.00	0.06
468	603379	三美股份	15,360	349,900.80	0.06
469	601869	长飞光纤	10,600	347,044.00	0.06
470	601228	广州港	103,300	343,989.00	0.06
471	601828	美凯龙	38,800	341,828.00	0.05
472	603708	家家悦	20,100	334,464.00	0.05
473	002302	西部建设	41,600	334,048.00	0.05
474	601298	青岛港	58,000	330,020.00	0.05
475	000046	泛海控股	172,200	323,736.00	0.05
476	601156	东航物流	14,700	321,636.00	0.05
477	001872	招商港口	18,800	318,660.00	0.05
478	002948	青岛银行	68,700	318,081.00	0.05

479	600823	世茂股份	93,400	306,352.00	0.05
480	000553	安道麦 A	36,200	305,528.00	0.05
481	002945	华林证券	21,800	297,788.00	0.05
482	603355	莱克电气	10,040	294,372.80	0.05
483	001203	大中矿业	18,700	281,996.00	0.05
484	603786	科博达	3,400	273,020.00	0.04
485	601568	北元集团	33,200	269,916.00	0.04
486	600350	山东高速	52,200	269,352.00	0.04
487	603515	欧普照明	12,900	267,804.00	0.04
488	603719	良品铺子	6,300	267,561.00	0.04
489	600657	信达地产	71,200	265,576.00	0.04
490	600466	蓝光发展	126,000	257,040.00	0.04
491	603056	德邦股份	25,100	256,773.00	0.04
492	002946	新乳业	14,600	232,724.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	41,500	231,570.00	0.04
494	601003	柳钢股份	42,900	223,938.00	0.04
495	600917	重庆燃气	25,700	215,623.00	0.03
496	600956	新天绿能	12,100	208,241.00	0.03
497	688262	国芯科技	4,886	205,114.28	0.03
498	600903	贵州燃气	18,900	182,952.00	0.03
499	002901	大博医疗	3,500	177,170.00	0.03
500	601187	厦门银行	23,800	164,220.00	0.03
501	603868	飞科电器	3,700	160,654.00	0.03
502	601068	中铝国际	24,000	146,400.00	0.02
503	603983	丸美股份	4,100	130,667.00	0.02
504	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.01
505	688255	凯尔达	1,648	62,409.76	0.01
506	301155	海力风电	498	48,181.50	0.01
507	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
508	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
509	301211	亨迪药业	841	28,299.65	0.00
510	301177	迪阿股份	225	26,118.00	0.00
511	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
512	301050	雷电微力	107	25,117.18	0.00
513	301039	中集车辆	1,961	24,532.11	0.00
514	301166	优宁维	236	22,302.00	0.00
515	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
516	301221	光庭信息	228	20,228.16	0.00
517	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
518	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
519	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
520	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
521	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00

522	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
523	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
524	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
525	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
526	301096	百诚医药	190	14,920.70	0.00
527	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
528	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
529	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
530	301088	戎美股份	524	12,927.08	0.00
531	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
532	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
533	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
534	301108	洁雅股份	227	12,192.17	0.00
535	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
536	301092	争光股份	312	11,082.24	0.00
537	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
538	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
539	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
540	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
541	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
542	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
543	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
544	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
545	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
546	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
547	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
548	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
549	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
550	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
551	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
552	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
553	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
554	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
555	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
556	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
557	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
558	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
559	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
560	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
561	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
562	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
563	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
564	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00

565	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
566	002709	天赐材料	4	458.60	0.00
567	000826	启迪环境	68	302.60	0.00
568	600388	龙净环保	34	293.08	0.00
569	002317	众生药业	19	229.71	0.00
570	601868	中国能建	69	188.37	0.00
571	603377	东方时尚	20	179.40	0.00
572	300002	神州泰岳	20	126.60	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600089	特变电工	14,367,185.83	1.55
2	601233	桐昆股份	9,839,907.86	1.06
3	600885	宏发股份	9,168,304.38	0.99
4	603737	三棵树	8,858,826.57	0.95
5	688099	晶晨股份	8,526,447.38	0.92
6	600460	士兰微	8,521,635.00	0.92
7	688002	睿创微纳	8,206,865.50	0.88
8	600563	法拉电子	8,057,796.17	0.87
9	600219	南山铝业	7,212,755.70	0.78
10	600884	杉杉股份	7,162,010.49	0.77
11	603345	安井食品	7,049,322.91	0.76
12	603486	科沃斯	6,974,641.42	0.75
13	600392	盛和资源	6,843,945.14	0.74
14	600486	扬农化工	6,680,188.37	0.72
15	601615	明阳智能	6,614,491.00	0.71
16	601168	西部矿业	6,527,670.00	0.70
17	603589	口子窖	6,407,761.00	0.69
18	601636	旗滨集团	6,156,430.00	0.66
19	600739	辽宁成大	6,145,080.03	0.66
20	600733	北汽蓝谷	6,033,116.00	0.65

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。

### 8.4.2 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	600089	特变电工	23,518,759.69	2.53
2	000690	宝新能源	18,628,023.17	2.01
3	601233	桐昆股份	14,969,731.94	1.61
4	600460	士兰微	14,167,135.91	1.53

5	600426	华鲁恒升	12,741,260.23	1.37
6	603737	三棵树	12,168,522.25	1.31
7	603486	科沃斯	11,965,836.51	1.29
8	600219	南山铝业	11,894,478.70	1.28
9	600143	金发科技	11,590,023.10	1.25
10	603345	安井食品	11,230,161.60	1.21
11	600885	宏发股份	11,153,298.95	1.20
12	601799	星宇股份	10,387,919.41	1.12
13	688002	睿创微纳	9,612,372.53	1.04
14	603882	金域医学	9,502,885.10	1.02
15	600563	法拉电子	9,111,262.00	0.98
16	688099	晶晨股份	9,064,954.37	0.98
17	601099	太平洋	8,928,690.94	0.96
18	600132	重庆啤酒	8,774,802.29	0.95
19	600779	水井坊	8,666,271.19	0.93
20	600486	扬农化工	8,537,538.80	0.92

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	992,411,386.16
卖出股票的收入（成交）总额	1,138,995,122.95

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	16,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,000.00	0.00

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110084	贵燃转债	160	16,000.00	0.00

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2203	IC2203	21.00	30,684,360.00	821,280.00	-
公允价值变动总额合计					821,280.00
股指期货投资本期收益					10,521,001.95
股指期货投资本期公允价值变动					-448,240.00

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,007,924.24
2	应收证券清算款	3,498,320.17
3	应收股利	-
4	应收利息	10,687.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,516,931.84

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,987	25,073.69	11,791,550.00	15.74%	18,520,867.00	24.73%	44,582,681.00	59.53%

### 9.2 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	2,977,572.00	3.98%
2	博时基金—上海银行—博时基金阳光增利集合资产管理计划	1,914,300.00	2.56%
3	农银人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	1,575,500.00	2.10%
4	中信证券股份有限公司	1,510,148.00	2.02%
5	孙雪理	1,266,376.00	1.69%
6	罗志中	1,100,000.00	1.47%
7	博时基金—招商银行—博时基金汇利 1 号集合资产管理计划	850,900.00	1.14%
8	宁波霁泽投资管理有限公司—霁泽夏天量化套利 2 号私募证券投资基金	683,500.00	0.91%
9	白巍	558,000.00	0.75%
10	华泰证券股份有限公司	502,331.00	0.67%
-	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	44,582,681.00	59.53%

注：前十名持有人为除博时中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.3 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。

### 9.4 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。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 8 月 1 日)基金份额总额	2,762,185,861.00
本报告期期初基金份额总额	136,895,098.00
本报告期基金总申购份额	192,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	254,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	74,895,098.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生任博时基金管理有限公司总经理。

基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内重大人事变动情况：自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 65000 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
中泰证券	1	25,598,710.97	1.21%	18,721.81	2.52%	-
国泰君安	1	21,889,287.04	1.04%	16,007.21	2.16%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	270,164,778.51	12.81%	197,567.27	26.61%	新增 1 个
中信证券	2	54,529,696.51	2.58%	40,020.69	5.39%	新增

						1 个
招商证券	3	1,737,352,007.49	82.36%	470,212.71	63.33%	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	333,079.00	70.86%	-	-	-	-
中信证券	60,225.46	12.81%	-	-	-	-
招商证券	76,737.60	16.33%	-	-	-	-

### 11.8 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部分公开募集证券投资基金可投资北京证券交易所股票的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-11-26
2	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增财达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	2021-11-10
3	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、	2021-10-27

		证监会基金电子披露网站	
4	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-30
5	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-30
6	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-20210928	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-28
7	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增第一创业证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-10
8	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-31
9	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-25
10	博时基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-21
11	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-21
12	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-01
13	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中金财富证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-02
14	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、	2021-05-29

		证监会基金电子披露网站	
15	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
16	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增安信证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-24
17	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东吴证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-24
18	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
19	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
20	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第一季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
21	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-06
22	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
23	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
24	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
25	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、	2021-03-31

		证监会基金电子披露网站	
26	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
27	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
28	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
29	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
30	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
31	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-23
32	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-23
33	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-23
34	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22
35	关于博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增华创证券为场内申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-14

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2021-01-01~2021-10-26;2021-10-28~2021-12-31	77,189,081.00	24,884,100.00	57,490,500.00	44,582,681.00	59.53%

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日