

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2022 年年度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）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 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	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.....	8
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.10 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
§ 5 托管人报告.....	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真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 审计报告.....	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.....	15
§ 7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§ 8 投资组合报告.....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	45
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	45

8.4 指数投资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	46
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	69
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	70
8.7 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	70
8.8 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	71
8.9 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	71
8.10 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	71
8.11 投资组合报告附注	71
§ 9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末上市基金前十名持有人	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	73
11.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§ 13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

§ 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	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	7,402,638,570.00 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	<p>本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>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。</p> <p>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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	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）。
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		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

注：本基金未聘请境外投资顾问。

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	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
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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	74,825,190.75	84,148,660.67	97,731,416.85
本期利润	-968,138,561.38	748,239,599.28	273,592,688.27
加权平均基金份额本期利润	-0.1925	0.5388	0.2870
本期加权平均净值利润率	-13.43%	20.48%	13.78%

本期基金份额净值增长率	-11.94%	24.32%	9.53%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	1,907,262,978.33	1,188,130,637.99	471,621,019.72
期末可供分配基金份额利润	0.2576	0.4872	0.4215
期末基金资产净值	9,359,412,268.37	7,002,849,558.16	2,584,124,485.23
期末基金份额净值	1.2643	2.8714	2.3097
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	152.86%	187.14%	130.97%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.30%	1.55%	5.37%	1.55%	-0.07%	0.00%
过去六个月	5.26%	1.43%	5.89%	1.44%	-0.63%	-0.01%
过去一年	-11.94%	1.50%	-10.99%	1.50%	-0.95%	0.00%
过去三年	19.91%	1.61%	22.77%	1.62%	-2.86%	-0.01%
过去五年	55.99%	1.39%	62.84%	1.39%	-6.85%	0.00%
自基金合同生效起至今	152.86%	1.15%	174.67%	1.16%	-21.81%	-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

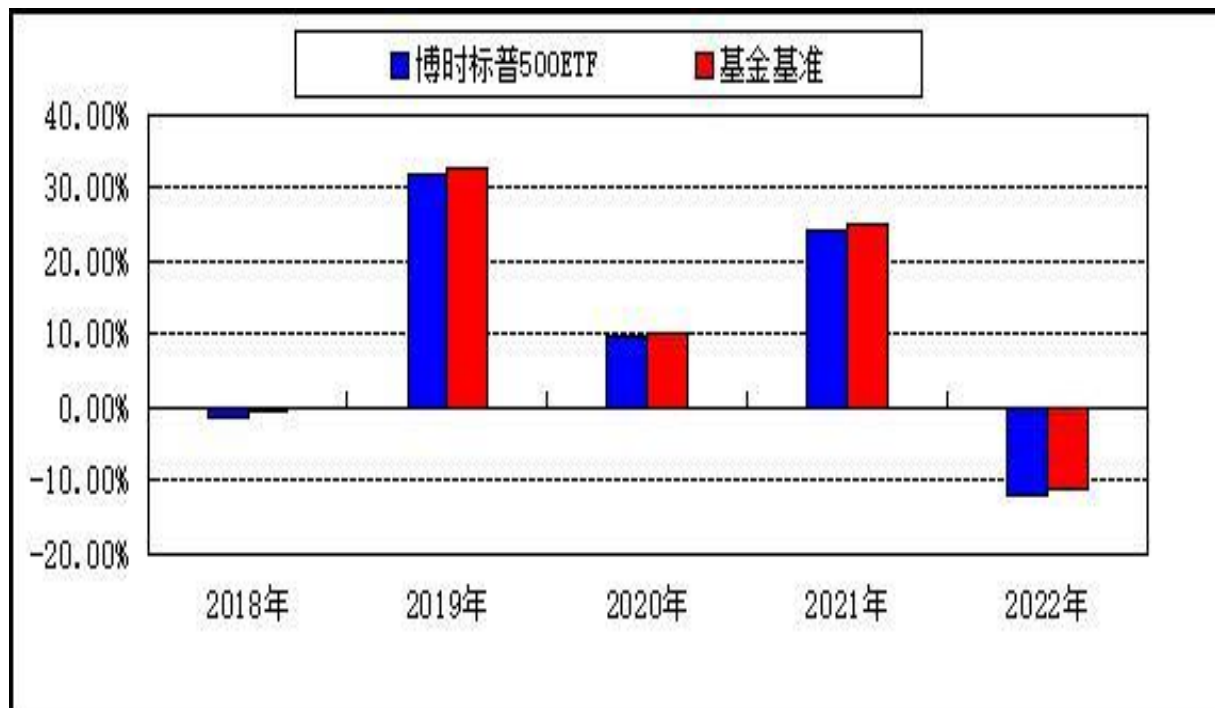
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2013 年 12 月 5 日至 2022 年 12 月 31 日）



3.2.3 过去五年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

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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 2022 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 341 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 15141 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 5227 亿元人民币，累计分红逾 1778 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

深圳证券交易所发布 2022 年度基金市场优秀机构和个人评选结果，博时基金荣获“优秀 ETF 基金管理人”奖，博时国开 ETF 荣获“ETF 产品创新奖”。

2022 年 12 月，深圳市地方金融监管局公布 2021 年度深圳市金融创新奖颁奖仪式暨深圳市金融创新奖成果。博时基金及子公司申报或与外部机构联合申报了多个项目，其中“跨境(境外)回购投资交易支持系统”项目荣获贡献奖（深港金融创新合作类）二等奖，“基于深度学习的基金营销内容智能审核系统”项目和“博时招商蛇口产业园封闭式基础设施证券投资基金”项目荣获贡献奖三等奖。

12 月 26 日，由中国基金报主办的第九届中国基金业英华奖、第四届中国公募基金英华奖揭晓，博时基金荣获 2022 年度优秀 ESG 发展基金公司等多个奖项。

11 月 14 日，由上海证券报主办的第十九届“金基金”奖出炉，博时基金凭借优秀的资产管理能力荣获“金基金”债券投资回报基金管理公司奖。

博时基金聘请了第三方机构对其 2021 年碳排放量进行盘查，实现 2021 年度自身运营活动的碳中和，包含范围一（直接温室气体排放）和范围二（电力产生的间接温室气体排放），积极践行绿色金融与责任投资。

9 月 27 日，第十七届中国基金业明星基金奖出炉，博时基金荣获四项大奖。博时基金管理有限

公司荣获“十大明星基金公司”；博时安盈债券荣获“五年持续回报普通债券型明星基金奖”；博时鑫泽灵活配置混合荣获“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”；博时富瑞纯债荣获“三年持续回报普通债券型明星基金奖”。

8 月 12 日，全国社会保障基金境内委托投资及基本养老保险基金委托投资 2021 年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，3 个社保委托组合获评“综合评级 A 档”，2 个养老组合获评“综合评级 A 档”。在公司基本面单项考评中，博时基金评级 A 档；在业务支持单项考评中，博时基金因提供专业的研究服务支持获评 A 档，为社保考评结果的最高档。博时基金桂征辉荣获 2021 年度“3 年贡献社保表彰奖”、“3 年贡献养老表彰奖”，赵云阳荣获 2021 年度“3 年贡献养老表彰奖”。

1 月，深圳证券交易所发布 2021 年度深圳证券交易所基金市场优秀机构和个人评选结果，博时基金荣获深交所 2021 年度“优秀 REITs 基金管理人”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2015-10-08	-	15.8	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)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日一至今)、博时中证可持续发展 100

				交易型开放式指数证券投资基金(2020年1月19日一至今)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020年3月20日一至今)、博时沪深300交易型开放式指数证券投资基金(2020年4月3日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年3月18日一至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021年4月2日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021年5月11日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年5月17日一至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年6月8日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月21日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月28日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022年1月10日一至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022年3月3日一至今)、博时纳斯达克100指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022年7月26日一至今)的基金经理。
--	--	--	--	--

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

4.2 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，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。

4.4.2 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。

4.4.3 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 66 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

2022 年全年受俄乌冲突、高通胀以及美联储加息影响，美股市场震荡加剧，标普 500、纳斯达克均表现不佳。一季度，美国经济在超额储蓄的支撑下，总体消费需求保持强劲，美联储在 3 月首次加息 25bps。二季度经济景气回落，通胀水平创出新高，美联储 6 月超预期加息 75bps。三季度在美联储 9 月份超预期缩表后，股市出现回落。四季度，美国通胀下行，流动性出现边际改善，股票市场迎来反弹。

本基金为被动跟踪指数的基金，其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，为投资人取得与标的指数基本一致的投资回报。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.2643 元，份额累计净值为 2.5286 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-11.94%，同期业绩基准增长率-10.99%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在高通胀的背景下，美欧央行持续紧缩货币政策，同时海外高通胀对消费、投资的抑制逐步加深，美国 11 月制造业 PMI 自 2020 年 6 月以来首次跌破荣枯平衡线，美国经济在 23 年上半年仍将面临下行压力。四季度美国通胀回落，预计随着经济下行压力的加大，2023 年美国通胀将延续回落态势。随着通胀缓和、经济增长压力逐步增大，市场对 2023 年美联储加息预期缓和。

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

标的指数。

4.7 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。

报告期内，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，制定了《公募基金池管理办法》、《金融工具分类制度》、《金融工具减值制度》等，修订了《债券池管理办法》、《股票池管理办法》、《科创板投资管理制度》、《流动性风险管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“博时产品管理系统”、“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“金手指估值系统”、“统一风险管理平台”等管理平台进行迭代更新，进一步提升公司市场体系、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，按照法规及内部制度的规定，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。

4.8 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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的收益分配原则：基金收益每年最多分配 2 次。每次基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。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，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.10 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年年度报告中财务指标、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 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 22402 号

博时标普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

我们审计了博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“博时标普 500ETF”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(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,公允反映了博时标普 500ETF2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

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,我们独立于博时标普 500ETF,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

博时标普 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标普 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标普 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标普 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，就可能导致对博时标普 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标普 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 沈兆杰

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

2023 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	447,048,878.18	815,661,323.19
结算备付金		33,481,825.66	22,655,089.07
存出保证金		26,944,560.90	19,649,907.40
交易性金融资产	7.4.7.2	8,925,415,490.50	6,573,870,242.06
其中：股票投资		8,925,415,490.50	6,573,870,242.06
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		6,396,446.30	2,866,133.42
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	12,707.56
资产总计		9,439,287,201.54	7,434,715,402.70
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付清算款		67,827,365.70	425,950,780.78
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,425,975.76	2,740,155.29
应付托管费		1,844,156.56	1,141,731.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	345,207.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	5,777,435.15	1,687,969.57
负债合计		79,874,933.17	431,865,844.54
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	3,701,319,285.07	2,438,819,285.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	5,658,092,983.30	4,564,030,273.16
净资产合计		9,359,412,268.37	7,002,849,558.16
负债和净资产总计		9,439,287,201.54	7,434,715,402.70

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2643 元，基金份额总额 7,402,638,570.00 份。

7.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
一、营业总收入		-902,524,568.61	782,228,605.66
1. 利息收入		608,852.96	227,711.61
其中：存款利息收入	7.4.7.9	608,852.96	223,265.86
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		-	4,445.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		119,973,210.32	124,063,582.81
其中：股票投资收益	7.4.7.10	103,325,271.69	39,810,853.90
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-84,224,277.54	38,056,923.39
股利收益	7.4.7.15	100,872,216.17	46,195,805.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,042,963,752.13	664,090,938.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		14,927,413.35	-6,169,528.82
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,929,706.89	15,901.45
减：二、营业总支出		65,613,992.77	33,989,006.38

1. 管理人报酬		43,115,240.74	21,769,511.51
2. 托管费		17,964,683.60	9,070,629.81
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	138,383.39
8. 其他费用	7.4.7.19	4,534,068.43	3,010,481.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-968,138,561.38	748,239,599.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-968,138,561.38	748,239,599.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-968,138,561.38	748,239,599.28

7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,438,819,285.00	4,564,030,273.16	7,002,849,558.16
二、本期期初净资产（基金净值）	2,438,819,285.00	4,564,030,273.16	7,002,849,558.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,262,500,000.07	1,094,062,710.14	2,356,562,710.21
（一）、综合收益总额	-	-968,138,561.38	-968,138,561.38
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,262,500,000.07	2,062,201,271.52	3,324,701,271.59
其中：1. 基金申购款	3,703,499,999.05	5,821,413,556.87	9,524,913,555.92
2. 基金赎回款	-2,440,999,998.98	-3,759,212,285.35	-6,200,212,284.33
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	3,701,319,285.07	5,658,092,983.30	9,359,412,268.37
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,118,819,285.00	1,465,305,200.23	2,584,124,485.23

二、本期期初净资产（基金净值）	1, 118, 819, 285. 00	1, 465, 305, 200. 23	2, 584, 124, 485. 23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1, 320, 000, 000. 00	3, 098, 725, 072. 93	4, 418, 725, 072. 93
（一）、综合收益总额	-	748, 239, 599. 28	748, 239, 599. 28
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1, 320, 000, 000. 00	2, 350, 485, 473. 65	3, 670, 485, 473. 65
其中：1. 基金申购款	1, 475, 000, 000. 00	2, 580, 951, 895. 44	4, 055, 951, 895. 44
2. 基金赎回款	-155, 000, 000. 00	-230, 466, 421. 79	-385, 466, 421. 79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2, 438, 819, 285. 00	4, 564, 030, 273. 16	7, 002, 849, 558. 16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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：徐卫，会计机构负责人：佘方方

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时标普 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[2013]750 号《关于核准博时标普 500 交易型开放式证券投资基金募集的批复》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《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 565,038,000.00 元，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(2013)第 743 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 565,043,200.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 5,200.00 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期间不定，本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 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、备选成份股、境外上市交易的跟踪同一标的指数的公募基金。本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生工具、法律法规或中国证监会允许基金投

资的其他金融工具。其中，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。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%。本基金的标的指数为标普 500 净总收益指数(S&P500 Index(Net TR))。

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 2023 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时标普 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净资产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

新金融工具准则

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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

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

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

(1) 金融资产的分类

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

能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、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

新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未

显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

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

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

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

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、基金投资、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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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

新金融工具准则

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除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。

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确认。

以摊余成本计量的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。基金收益评价日核定的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率(经汇率调整)达到 1%以上，方可进行收益分配。基金收益每年最多分配 2 次。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净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收股利, 金额分别为 815,661,323.19 元、22,655,089.07 元、19,649,907.40 元、12,707.56 元和 2,866,133.42 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收股利, 金额分别为 815,674,030.75 元、22,655,089.07 元、19,649,907.40 元、0.00 元和 2,866,133.42 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 6,573,870,242.06 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 6,573,870,242.06 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款, 金额分别为 425,950,780.78 元、2,740,155.29 元、1,141,731.34 元和 1,497,969.57 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款, 金额分别为 425,950,780.78 元、2,740,155.29 元、1,141,731.34 元和 1,497,969.57 元。

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

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

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

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[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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	447,048,878.18	815,661,323.19
等于：本金	447,042,610.39	815,661,323.19
加：应计利息	6,267.79	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	447,048,878.18	815,661,323.19

注：于 2022 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 62,550,187.74 (折合人民币 435,637,037.53)

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,842,843,206.87	-	8,925,415,490.50	82,572,283.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,842,843,206.87	-	8,925,415,490.50	82,572,283.63
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,475,058,276.92	-	6,573,870,242.06	1,098,811,965.14
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		5,475,058,276.92	-	6,573,870,242.06	1,098,811,965.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	443,550,963.98	-	-	-
一股指期货	443,550,963.98	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	443,550,963.98	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	397,967,516.45	-	-	-
一股指期货	397,967,516.45	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	397,967,516.45	-	-	-
----	----------------	---	---	---

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。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ESH3	S&P500 EMINI FUT Mar23	316.00	424,867,065.48	-18,683,898.50
合计	-	-	-	-18,683,898.50
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-18,683,898.50
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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	12,707.56
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	12,707.56

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	100,000.00	190,000.00

其他应付款	5,677,435.15	-
应付标普指数使用费	-	1,497,969.57
合计	5,777,435.15	1,687,969.57

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,438,819,285.00	2,438,819,285.00
本期申购	6,663,000,000.00	3,703,499,999.05
本期赎回（以“-”号填列）	-4,260,000,000.00	-2,440,999,998.98
-基金拆分/份额折算前	4,841,819,285.00	3,701,319,285.07
基金拆分/份额折算调整	2,560,819,285.00	—
本期末	7,402,638,570.00	3,701,319,285.07

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

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,188,130,637.99	3,375,899,635.17	4,564,030,273.16
本期利润	74,825,190.75	-1,042,963,752.13	-968,138,561.38
本期基金份额交易产生的变动数	644,307,149.59	1,417,894,121.93	2,062,201,271.52
其中：基金申购款	1,863,887,450.56	3,957,526,106.31	5,821,413,556.87
基金赎回款	-1,219,580,300.97	-2,539,631,984.38	-3,759,212,285.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,907,262,978.33	3,750,830,004.97	5,658,092,983.30

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	548,361.05
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	60,491.91	-87,399.22
其他	-	-
合计	608,852.96	223,265.86

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,956,098,881.08	210,515,886.15
减：卖出股票成本总额	3,849,376,144.62	170,705,032.25
减：交易费用	3,397,464.77	-
买卖股票差价收入	103,325,271.69	39,810,853.90

7.4.7.11 基金投资收益

无发生额。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
期货投资收益	-84,224,277.54	38,056,923.39
合计	-84,224,277.54	38,056,923.39

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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	100,872,216.17	46,195,805.52
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	100,872,216.17	46,195,805.52

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
1. 交易性金融资产	-1,016,239,681.51	659,132,534.64
——股票投资	-1,016,239,681.51	659,132,534.64
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-26,724,070.62	4,958,403.97
——权证投资	-	-
——期货投资	-26,724,070.62	4,958,403.97
4. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-	-
合计	-1,042,963,752.13	664,090,938.61

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	4,923,937.21	15,901.45
其他	5,769.68	-
合计	4,929,706.89	15,901.45

7.4.7.18 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	100,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
交易费用	-	642,614.98
银行汇划费用	1,509.69	1,066.53
标普指数使用费	4,312,558.74	2,176,800.16
合计	4,534,068.43	3,010,481.67

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、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行(“BBH”)	境外资产托管人
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
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“博时标普 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

无。

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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	43,115,240.74	21,769,511.51

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 × 0.60% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	17,964,683.60	9,070,629.81

注：支付基金托管人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 × 0.25% / 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固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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
博时标普 500ETF 联接	3,064,633,060.00	41.40%	863,513,080.00	35.41%
招商证券	1,184,939,553.00	16.01%	952,383.00	0.04%

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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021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
中国工商银行	81,061,608.56	548,361.05	14,479,114.54	310,665.08

BBH	365,987,269.62	-	801,182,208.65	-
-----	----------------	---	----------------	---

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

无。

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（2022 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金是被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标普 500 指数成分股，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标普 500 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，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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；在场外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

无。

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，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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

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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	81,061,608.56	-	-	365,987,269.62	447,048,878.18
结算备付金	-	-	-	33,481,825.66	33,481,825.66
存出保证金	-	-	-	26,944,560.90	26,944,560.90
交易性金融资产	-	-	-	8,925,415,490.50	8,925,415,490.50
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	6,396,446.30	6,396,446.30
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	81,061,608.56	-	-	9,358,225,592.98	9,439,287,201.54
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	67,827,365.70	67,827,365.70
应付管理人报酬	-	-	-	4,425,975.76	4,425,975.76

应付托管费	-	-	-	1,844,156.56	1,844,156.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,777,435.15	5,777,435.15
负债总计	-	-	-	79,874,933.17	79,874,933.17
利率敏感度缺口	81,061,608.56	-	-	-9,278,350,659.81	9,359,412,268.37
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,479,114.54	-	-	801,182,208.65	815,661,323.19
结算备付金	-	-	-	22,655,089.07	22,655,089.07
存出保证金	-	-	-	19,649,907.40	19,649,907.40
交易性金融资产	-	-	-	-6,573,870,242.06	6,573,870,242.06
其他资产	-	-	-	12,707.56	12,707.56
应收股利	-	-	-	2,866,133.42	2,866,133.42
资产总计	14,479,114.54	-	-	-7,420,236,288.16	7,434,715,402.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,740,155.29	2,740,155.29
应付托管费	-	-	-	1,141,731.34	1,141,731.34
应交税费	-	-	-	345,207.56	345,207.56
应付清算款	-	-	-	425,950,780.78	425,950,780.78
其他负债	-	-	-	1,687,969.57	1,687,969.57
负债总计	-	-	-	431,865,844.54	431,865,844.54
利率敏感度缺口	14,479,114.54	-	-	-6,988,370,443.62	7,002,849,558.16

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

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	435,637,037.53	435,637,037.53
结算备付金	33,481,825.66	33,481,825.66
存出保证金	26,944,560.90	26,944,560.90
交易性金融资产	8,925,415,490.50	8,925,415,490.50
应收股利	6,396,446.30	6,396,446.30
应收证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-
资产合计	9,427,875,360.89	9,427,875,360.89
以外币计价的负债		
其他负债	5,677,435.15	5,677,435.15
负债合计	5,677,435.15	5,677,435.15
资产负债表外汇风险敞口净额	9,422,197,925.74	9,422,197,925.74
项目	上年度末 2021 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	801,182,208.65	801,182,208.65
结算备付金	22,655,089.07	22,655,089.07
存出保证金	19,649,907.40	19,649,907.40
交易性金融资产	6,573,870,242.06	6,573,870,242.06
应收股利	2,866,133.42	2,866,133.42
资产合计	7,420,223,580.60	7,420,223,580.60
以外币计价的负债		
应付证券清算款	389,459,759.59	389,459,759.59
其他负债	1,497,969.57	1,497,969.57
负债合计	390,957,729.16	390,957,729.16
资产负债表外汇风险敞口净额	7,029,265,851.44	7,029,265,851.44

7.4.13.4.2 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 47,111	增加约 35,146
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 47,111	减少约 35,146

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	8,690,374,848.63	92.85	6,397,706,130.41	91.36
交易性金融资产—基金投资	235,040,641.87	2.51	176,164,111.65	2.52
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	8,925,415,490.50	95.36	6,573,870,242.06	93.87

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 41,935	增加约 32,210
	业绩比较基准下降 5%	减少约 41,935	减少约 32,210

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	8,925,415,490.50	6,573,870,242.06
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	8,925,415,490.50	6,573,870,242.06

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 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	8,925,415,490.50	94.56
	其中：普通股	8,690,374,848.63	92.07
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	235,040,641.87	2.49
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	480,530,703.84	5.09
8	其他各项资产	33,341,007.20	0.35
9	合计	9,439,287,201.54	100.00

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 7.4.7.3 衍生金融资产/负债。

8.2 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	8,925,415,490.50	95.36
合计	8,925,415,490.50	95.36

8.3 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（%）
非日常生活消费品	874,100,945.39	9.34
日常消费品	642,657,020.53	6.87
医疗保健	1,411,838,323.17	15.08
金融	1,276,021,468.83	13.63
信息技术	2,297,247,380.57	24.54
电信业务	649,693,062.92	6.94
公用事业	284,160,764.50	3.04
能源	466,642,444.85	4.99

原材料	243,958,847.14	2.61
工业	772,341,151.84	8.25
房地产	6,754,080.76	0.07
合计	8,925,415,490.50	95.36

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.4 指数投资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	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	596,391.00	539,680,464.90	5.77
2	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	297,305.00	496,573,786.90	5.31
3	Alphabet Inc	-	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	238,220.00	146,383,011.70	1.56
			GOOG US	纳斯达克交易所	美国	211,172.00	130,497,740.80	1.39
4	Amazon.com Inc	-	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	353,977.00	207,085,890.00	2.21
5	Berkshire Hathaway Inc	-	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	71,858.00	154,592,781.90	1.65
6	UnitedHealth Group Inc	-	UNH US	纽约证券交易所	美国	37,265.00	137,600,700.50	1.47
7	Johnson & Johnson	-	JNJ US	纽约证券交易所	美国	104,273.00	128,286,716.30	1.37
8	Exxon Mobil Corp	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	164,249.00	126,175,323.00	1.35
9	JPMorgan Chase & Co	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	116,985.00	109,258,475.30	1.17
10	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	99,308.00	101,076,342.20	1.08
11	Procter & Gamble Co/The	-	PG US	纽约证券交易所	美国	94,510.00	99,760,481.88	1.07
12	Visa Inc	-	V US	纽约证券交易所	美国	65,209.00	94,355,159.99	1.01
13	Tesla Inc	-	TSLA US	纳斯达克交易所	美国	107,049.00	91,837,275.87	0.98
14	Home Depot Inc/The	-	HD US	纽约证券交易所	美国	40,829.00	89,817,208.40	0.96
15	Chevron Corp	-	CVX US	纽约证券交	美国	70,950.00	88,692,896.03	0.95

				易所				
16	Mastercard Inc	-	MA US	纽约证券交易 所	美国	33,856.00	81,992,472.92	0.88
17	Eli Lilly & Co	-	LLY US	纽约证券交易 所	美国	31,454.00	80,142,567.07	0.86
18	Pfizer Inc	-	PFE US	纽约证券交易 所	美国	223,875.00	79,893,399.03	0.85
19	AbbVie Inc	-	ABBV US	纽约证券交易 所	美国	70,532.00	79,387,222.49	0.85
20	Merck & Co Inc	-	MRK US	纽约证券交易 所	美国	101,119.00	78,136,913.33	0.83
21	Meta Platforms Inc	-	META US	纳斯达克交易 所	美国	89,684.00	75,165,950.85	0.80
22	PepsiCo Inc	-	PEP US	纳斯达克交易 所	美国	54,947.00	69,135,669.07	0.74
23	Coca-Cola Co/The	-	KO US	纽约证券交易 所	美国	155,226.00	68,767,944.04	0.73
24	Bank of America Corp	-	BAC US	纽约证券交易 所	美国	278,362.00	64,209,081.11	0.69
25	Broadcom Inc	-	AVGO US	纳斯达克交易 所	美国	16,153.00	62,901,668.64	0.67
26	Thermo Fisher Scientific Inc	-	TMO US	纽约证券交易 所	美国	15,642.00	59,992,319.05	0.64
27	Costco Wholesale Corp	-	COST US	纳斯达克交易 所	美国	17,653.00	56,124,887.25	0.60
28	Walmart Inc	-	WMT US	纽约证券交易 所	美国	56,291.00	55,587,961.10	0.59
29	Cisco Systems Inc	-	CSCO US	纳斯达克交易 所	美国	163,758.00	54,333,847.18	0.58
30	McDonald's Corp	-	MCD US	纽约证券交易 所	美国	29,212.00	53,615,150.88	0.57
31	Abbott Laboratories	-	ABT US	纽约证券交易 所	美国	69,539.00	53,172,539.76	0.57
32	Danaher Corp	-	DHR US	纽约证券交易 所	美国	26,130.00	48,302,458.17	0.52
33	Accenture PLC	-	ACN US	纽约证券交易 所	美国	25,130.00	46,702,443.00	0.50
34	NextEra Energy Inc	-	NEE US	纽约证券交易 所	美国	79,254.00	46,144,893.34	0.49
35	Verizon Communications Inc	-	VZ US	纽约证券交易 所	美国	167,500.00	45,962,877.70	0.49
36	Linde PLC	-	LIN US	纽约证券交易 所	美国	19,718.00	44,793,641.43	0.48
37	Walt Disney Co/The	-	DIS US	纽约证券交	美国	72,709.00	43,995,085.13	0.47

				易所				
38	Wells Fargo & Co	-	WFC US	纽约证券交易 所	美国	151,973.00	43,702,622.42	0.47
39	Philip Morris International Inc	-	PM US	纽约证券交易 所	美国	61,827.00	43,581,058.81	0.47
40	Adobe Inc	-	ADBE US	纳斯达克交易 所	美国	18,542.00	43,458,680.97	0.46
41	Bristol-Myers Squibb Co	-	BMJ US	纽约证券交易 所	美国	84,797.00	42,492,028.55	0.45
42	Comcast Corp	-	CMCSA US	纳斯达克交易 所	美国	172,053.00	41,903,862.92	0.45
43	Texas Instruments Inc	-	TXN US	纳斯达克交易 所	美国	36,197.00	41,651,569.80	0.45
44	Raytheon Technologies Corp	-	RTX US	纽约证券交易 所	美国	58,630.00	41,209,117.54	0.44
45	NIKE Inc	-	NKE US	纽约证券交易 所	美国	50,240.00	40,941,974.98	0.44
46	ConocoPhillips	-	COP US	纽约证券交易 所	美国	49,697.00	40,842,127.69	0.44
47	Honeywell International Inc	-	HON US	纳斯达克交易 所	美国	26,815.00	40,021,757.01	0.43
48	Amgen Inc	-	AMGN US	纳斯达克交易 所	美国	21,281.00	38,926,833.72	0.42
49	Salesforce Inc	-	CRM US	纽约证券交易 所	美国	39,883.00	36,829,410.51	0.39
50	Netflix Inc	-	NFLX US	纳斯达克交易 所	美国	17,749.00	36,451,498.43	0.39
51	AT&T Inc	-	T US	纽约证券交易 所	美国	284,244.00	36,445,278.49	0.39
52	International Business Machines Corp	-	IBM US	纽约证券交易 所	美国	36,059.00	35,382,623.09	0.38
53	Union Pacific Corp	-	UNP US	纽约证券交易 所	美国	24,520.00	35,361,756.38	0.38
54	Charles Schwab Corp/The	-	SCHW US	纽约证券交易 所	美国	60,834.00	35,275,969.51	0.38
55	United Parcel Service Inc	-	UPS US	纽约证券交易 所	美国	29,108.00	35,241,814.27	0.38
56	Oracle Corp	-	ORCL US	纽约证券交易 所	美国	61,293.00	34,893,271.56	0.37
57	Caterpillar Inc	-	CAT US	纽约证券交易 所	美国	20,756.00	34,630,131.84	0.37
58	Lowe's Cos Inc	-	LOW US	纽约证券交易 所	美国	24,756.00	34,352,091.64	0.37
59	QUALCOMM Inc	-	QCOM US	纳斯达克交	美国	44,709.00	34,233,150.34	0.37

				易所				
60	Elevance Health Inc	-	ELV US	纽约证券交易 所	美国	9,526.00	34,032,881.59	0.36
61	CVS Health Corp	-	CVS US	纽约证券交易 所	美国	52,405.00	34,012,473.43	0.36
62	Deere & Co	-	DE US	纽约证券交易 所	美国	10,955.00	32,713,184.47	0.35
63	Goldman Sachs Group Inc/The	-	GS US	纽约证券交易 所	美国	13,506.00	32,299,657.72	0.35
64	Starbucks Corp	-	SBUX US	纳斯达克交易 所	美国	45,782.00	31,630,249.07	0.34
65	Lockheed Martin Corp	-	LMT US	纽约证券交易 所	美国	9,303.00	31,520,501.39	0.34
66	Morgan Stanley	-	MS US	纽约证券交易 所	美国	52,577.00	31,132,434.36	0.33
67	S&P Global Inc	-	SPGI US	纽约证券交易 所	美国	13,281.00	30,980,895.81	0.33
68	Intuit Inc	-	INTU US	纳斯达克交易 所	美国	11,242.00	30,474,382.04	0.33
69	Intel Corp	-	INTC US	纳斯达克交易 所	美国	164,596.00	30,297,906.32	0.32
70	Gilead Sciences Inc	-	GILD US	纳斯达克交易 所	美国	50,023.00	29,909,297.45	0.32
71	Boeing Co/The	-	BA US	纽约证券交易 所	美国	22,344.00	29,643,486.60	0.32
72	BlackRock Inc	-	BLK US	纽约证券交易 所	美国	5,991.00	29,567,529.07	0.32
73	Advanced Micro Devices Inc	-	AMD US	纳斯达克交易 所	美国	64,306.00	29,008,252.81	0.31
74	Prologis Inc	-	PLD US	纽约证券交易 所	美国	36,815.00	28,904,169.16	0.31
75	Medtronic PLC	-	MDT US	纽约证券交易 所	美国	53,011.00	28,694,255.91	0.31
76	Cigna Group/The	-	CI US	纽约证券交易 所	美国	12,194.00	28,139,490.98	0.30
77	Automatic Data Processing Inc	-	ADP US	纳斯达克交易 所	美国	16,545.00	27,523,672.27	0.29
78	American Tower Corp	-	AMT US	纽约证券交易 所	美国	18,570.00	27,400,409.30	0.29
79	Intuitive Surgical Inc	-	ISRG US	纳斯达克交易 所	美国	14,094.00	26,046,509.86	0.28
80	TJX Cos Inc/The	-	TJX US	纽约证券交易 所	美国	46,306.00	25,671,220.30	0.27
81	Chubb Ltd	-	CB US	纽约证券交	美国	16,554.00	25,433,412.64	0.27

				易所				
82	General Electric Co	-	GE US	纽约证券交易 所	美国	43,579.00	25,431,128.32	0.27
83	Mondelez International Inc	-	MDLZ US	纳斯达克交 易所	美国	54,465.00	25,282,140.48	0.27
84	American Express Co	-	AXP US	纽约证券交 易所	美国	23,842.00	24,533,886.50	0.26
85	Citigroup Inc	-	C US	纽约证券交 易所	美国	77,247.00	24,333,489.25	0.26
86	Analog Devices Inc	-	ADI US	纳斯达克交 易所	美国	20,514.00	23,435,262.08	0.25
87	Applied Materials Inc	-	AMAT US	纳斯达克交 易所	美国	34,312.00	23,270,835.81	0.25
88	T-Mobile US Inc	-	TMUS US	纳斯达克交 易所	美国	23,818.00	23,223,597.99	0.25
89	Stryker Corp	-	SYK US	纽约证券交 易所	美国	13,433.00	22,873,377.30	0.24
90	Marsh & McLennan Cos Inc	-	MMC US	纽约证券交 易所	美国	19,783.00	22,799,947.22	0.24
91	Altria Group Inc	-	MO US	纽约证券交 易所	美国	71,477.00	22,754,836.33	0.24
92	PayPal Holdings Inc	-	PYPL US	纳斯达克交 易所	美国	45,468.00	22,552,983.34	0.24
93	Duke Energy Corp	-	DUK US	纽约证券交 易所	美国	30,713.00	22,029,948.22	0.24
94	Northrop Grumman Corp	-	NOC US	纽约证券交 易所	美国	5,771.00	21,929,542.65	0.23
95	ServiceNow Inc	-	NOW US	纽约证券交 易所	美国	8,057.00	21,787,298.21	0.23
96	Booking Holdings Inc	-	BKNG US	纳斯达克交 易所	美国	1,547.00	21,713,102.73	0.23
97	Southern Co/The	-	SO US	纽约证券交 易所	美国	43,420.00	21,594,593.37	0.23
98	Regeneron Pharmaceuticals Inc	-	REGN US	纳斯达克交 易所	美国	4,271.00	21,461,302.00	0.23
99	EOG Resources Inc	-	EOG US	纽约证券交 易所	美国	23,427.00	21,132,442.30	0.23
100	Progressive Corp/The	-	PGR US	纽约证券交 易所	美国	23,335.00	21,080,331.84	0.23
101	Schlumberger Ltd	-	SLB US	纽约证券交 易所	美国	56,554.00	21,056,610.34	0.22
102	Vertex Pharmaceuticals Inc	-	VRTX US	纳斯达克交 易所	美国	10,238.00	20,591,046.33	0.22
103	Becton Dickinson and Co	-	BDX US	纽约证券交 易所	美国	11,375.00	20,146,237.25	0.22

				易所				
104	Target Corp	-	TGT US	纽约证券交易 所	美国	18,357.00	19,054,639.13	0.20
105	Air Products and Chemicals Inc	-	APD US	纽约证券交易 所	美国	8,846.00	18,991,544.59	0.20
106	Zoetis Inc	-	ZTS US	纽约证券交易 所	美国	18,589.00	18,973,088.33	0.20
107	3M Co	-	MMM US	纽约证券交易 所	美国	22,045.00	18,411,870.07	0.20
108	Boston Scientific Corp	-	BSX US	纽约证券交易 所	美国	57,125.00	18,408,647.90	0.20
109	Colgate-Palmolive Co	-	CL US	纽约证券交易 所	美国	33,311.00	18,279,105.92	0.20
110	CSX Corp	-	CSX US	纳斯达克交易 所	美国	83,850.00	18,091,753.38	0.19
111	Humana Inc	-	HUM US	纽约证券交易 所	美国	5,050.00	18,014,352.29	0.19
112	Fiserv Inc	-	FISV US	纳斯达克交易 所	美国	25,327.00	17,827,982.31	0.19
113	PNC Financial Services Group Inc/The	-	PNC US	纽约证券交易 所	美国	16,086.00	17,694,421.83	0.19
114	Eaton Corp PLC	-	ETN US	纽约证券交易 所	美国	15,862.00	17,338,656.55	0.19
115	Aon PLC	-	AON US	纽约证券交易 所	美国	8,250.00	17,245,429.11	0.18
116	Illinois Tool Works Inc	-	ITW US	纽约证券交易 所	美国	11,149.00	17,105,926.09	0.18
117	Equinix Inc	-	EQIX US	纳斯达克交易 所	美国	3,691.00	16,838,422.97	0.18
118	CME Group Inc	-	CME US	纳斯达克交易 所	美国	14,347.00	16,802,734.90	0.18
119	Moderna Inc	-	MRNA US	纳斯达克交易 所	美国	13,178.00	16,485,433.57	0.18
120	US Bancorp	-	USB US	纽约证券交易 所	美国	53,926.00	16,378,739.38	0.17
121	Crown Castle Inc	-	CCI US	纽约证券交易 所	美国	17,272.00	16,316,484.36	0.17
122	Waste Management Inc	-	WM US	纽约证券交易 所	美国	14,898.00	16,277,650.86	0.17
123	Estee Lauder Cos Inc/The	-	EL US	纽约证券交易 所	美国	9,224.00	15,938,951.22	0.17
124	Lam Research Corp	-	LRCX US	纳斯达克交易 所	美国	5,440.00	15,924,084.31	0.17
125	Intercontinental	-	ICE US	纽约证券交	美国	22,277.00	15,916,878.94	0.17

	Exchange Inc			易所				
126	Truist Financial Corp	-	TFC US	纽约证券交易 所	美国	52,915.00	15,857,923.74	0.17
127	Norfolk Southern Corp	-	NSC US	纽约证券交易 所	美国	9,234.00	15,847,545.30	0.17
128	Emerson Electric Co	-	EMR US	纽约证券交易 所	美国	23,583.00	15,777,486.30	0.17
129	Sherwin-Williams Co/The	-	SHW US	纽约证券交易 所	美国	9,406.00	15,547,257.52	0.17
130	General Dynamics Corp	-	GD US	纽约证券交易 所	美国	8,979.00	15,515,594.43	0.17
131	Dollar General Corp	-	DG US	纽约证券交易 所	美国	8,997.00	15,430,149.65	0.16
132	Marathon Petroleum Corp	-	MPC US	纽约证券交易 所	美国	18,692.00	15,151,918.27	0.16
133	Activision Blizzard Inc	-	ATVI US	纳斯达克交易 所	美国	28,404.00	15,143,312.25	0.16
134	Micron Technology Inc	-	MU US	纳斯达克交易 所	美国	43,360.00	15,093,213.10	0.16
135	Freeport-McMoRan Inc	-	FCX US	纽约证券交易 所	美国	57,006.00	15,086,911.53	0.16
136	Pioneer Natural Resources Co	-	PXD US	纽约证券交易 所	美国	9,477.00	15,074,542.61	0.16
137	KLA Corp	-	KLAC US	纳斯达克交易 所	美国	5,653.00	14,844,004.32	0.16
138	McKesson Corp	-	MCK US	纽约证券交易 所	美国	5,656.00	14,776,643.61	0.16
139	O'Reilly Automotive Inc	-	ORLY US	纳斯达克交易 所	美国	2,496.00	14,672,315.02	0.16
140	Dominion Energy Inc	-	D US	纽约证券交易 所	美国	33,234.00	14,193,220.19	0.15
141	Archer-Daniels-Midland Co	-	ADM US	纽约证券交易 所	美国	21,909.00	14,167,742.08	0.15
142	HCA Healthcare Inc	-	HCA US	纽约证券交易 所	美国	8,457.00	14,133,553.34	0.15
143	General Mills Inc	-	GIS US	纽约证券交易 所	美国	23,672.00	13,824,015.04	0.15
144	Phillips 66	-	PSX US	纽约证券交易 所	美国	18,850.00	13,663,904.46	0.15
145	Valero Energy Corp	-	VLO US	纽约证券交易 所	美国	15,376.00	13,585,144.30	0.15
146	Synopsys Inc	-	SNPS US	纳斯达克交易 所	美国	6,099.00	13,562,511.79	0.14
147	American Electric Power	-	AEP US	纳斯达克交	美国	20,495.00	13,553,113.34	0.14

	Co Inc			易所				
148	Sempra Energy	-	SRE US	纽约证券交易 所	美国	12,537.00	13,493,689.49	0.14
149	General Motors Co	-	GM US	纽约证券交易 所	美国	56,662.00	13,275,291.48	0.14
150	MetLife Inc	-	MET US	纽约证券交易 所	美国	26,286.00	13,248,882.69	0.14
151	American International Group Inc	-	AIG US	纽约证券交易 所	美国	29,633.00	13,051,597.16	0.14
152	AutoZone Inc	-	AZO US	纽约证券交易 所	美国	757.00	13,002,199.62	0.14
153	Centene Corp	-	CNC US	纽约证券交易 所	美国	22,584.00	12,899,232.05	0.14
154	Edwards Lifesciences Corp	-	EW US	纽约证券交易 所	美国	24,658.00	12,813,007.10	0.14
155	Ford Motor Co	-	F US	纽约证券交易 所	美国	157,523.00	12,759,094.90	0.14
156	Roper Technologies Inc	-	ROP US	纽约证券交易 所	美国	4,230.00	12,729,482.88	0.14
157	Kimberly-Clark Corp	-	KMB US	纽约证券交易 所	美国	13,461.00	12,726,627.74	0.14
158	Occidental Petroleum Corp	-	OXY US	纽约证券交易 所	美国	29,000.00	12,722,304.47	0.14
159	Amphenol Corp	-	APH US	纽约证券交易 所	美国	23,734.00	12,585,775.74	0.13
160	Agilent Technologies Inc	-	A US	纽约证券交易 所	美国	11,807.00	12,305,873.97	0.13
161	Public Storage	-	PSA US	纽约证券交易 所	美国	6,305.00	12,303,648.08	0.13
162	Johnson Controls International plc	-	JCI US	纽约证券交易 所	美国	27,468.00	12,243,432.50	0.13
163	Cadence Design Systems Inc	-	CDNS US	纳斯达克交 易所	美国	10,941.00	12,240,717.98	0.13
164	Travelers Cos Inc/The	-	TRV US	纽约证券交易 所	美国	9,347.00	12,205,245.81	0.13
165	Moody's Corp	-	MCO US	纽约证券交易 所	美国	6,284.00	12,193,956.54	0.13
166	Dexcom Inc	-	DXCM US	纳斯达克交 易所	美国	15,406.00	12,150,270.11	0.13
167	Motorola Solutions Inc	-	MSI US	纽约证券交易 所	美国	6,669.00	11,969,835.08	0.13
168	Exelon Corp	-	EXC US	纳斯达克交 易所	美国	39,634.00	11,932,991.17	0.13
169	Corteva Inc	-	CTVA US	纽约证券交	美国	28,496.00	11,665,669.34	0.12

				易所				
170	FedEx Corp	-	FDX US	纽约证券交易 所	美国	9,549.00	11,518,660.01	0.12
171	NXP Semiconductors NV	-	NXPI US	纳斯达克交 易所	美国	10,335.00	11,374,863.65	0.12
172	Aflac Inc	-	AFL US	纽约证券交 易所	美国	22,567.00	11,306,819.02	0.12
173	Autodesk Inc	-	ADSK US	纳斯达克交 易所	美国	8,610.00	11,205,698.05	0.12
174	Ross Stores Inc	-	ROST US	纳斯达克交 易所	美国	13,842.00	11,189,611.49	0.12
175	Fidelity National Information Services Inc	-	FIS US	纽约证券交 易所	美国	23,666.00	11,183,323.57	0.12
176	Devon Energy Corp	-	DVN US	纽约证券交 易所	美国	26,072.00	11,169,050.46	0.12
177	Williams Cos Inc/The	-	WMB US	纽约证券交 易所	美国	48,578.00	11,130,936.55	0.12
178	Marriott International Inc/MD	-	MAR US	纳斯达克交 易所	美国	10,731.00	11,127,610.18	0.12
179	Biogen Inc	-	BIIB US	纳斯达克交 易所	美国	5,744.00	11,078,091.11	0.12
180	Realty Income Corp	-	O US	纽约证券交 易所	美国	25,013.00	11,049,857.39	0.12
181	Arthur J Gallagher & Co	-	AJG US	纽约证券交 易所	美国	8,409.00	11,041,905.70	0.12
182	L3Harris Technologies Inc	-	LHX US	纽约证券交 易所	美国	7,594.00	11,012,054.59	0.12
183	Hess Corp	-	HES US	纽约证券交 易所	美国	11,067.00	10,931,092.50	0.12
184	Cintas Corp	-	CTAS US	纳斯达克交 易所	美国	3,443.00	10,829,449.18	0.12
185	Sysco Corp	-	SYU US	纽约证券交 易所	美国	20,212.00	10,761,751.46	0.11
186	Trane Technologies PLC	-	TT US	纽约证券交 易所	美国	9,186.00	10,753,862.93	0.11
187	Monster Beverage Corp	-	MNST US	纳斯达克交 易所	美国	15,191.00	10,741,796.70	0.11
188	Microchip Technology Inc	-	MCHP US	纳斯达克交 易所	美国	21,936.00	10,732,476.46	0.11
189	Chipotle Mexican Grill Inc	-	CMG US	纽约证券交 易所	美国	1,105.00	10,677,960.70	0.11
190	Simon Property Group Inc	-	SPG US	纽约证券交 易所	美国	13,040.00	10,669,343.75	0.11

191	Xcel Energy Inc	-	XEL US	纳斯达克交易所	美国	21,826.00	10,657,376.20	0.11
192	IQVIA Holdings Inc	-	IQV US	纽约证券交易所	美国	7,408.00	10,571,044.83	0.11
193	Constellation Brands Inc	-	STZ US	纽约证券交易所	美国	6,475.00	10,450,948.17	0.11
194	Newmont Corp	-	NEM US	纽约证券交易所	美国	31,657.00	10,406,577.75	0.11
195	Parker-Hannifin Corp	-	PH US	纽约证券交易所	美国	5,122.00	10,380,750.23	0.11
196	MSCI Inc	-	MSCI US	纽约证券交易所	美国	3,189.00	10,331,476.59	0.11
197	Paychex Inc	-	PAYX US	纳斯达克交易所	美国	12,793.00	10,296,179.65	0.11
198	Prudential Financial Inc	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	14,677.00	10,166,744.93	0.11
199	TE Connectivity Ltd	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	12,686.00	10,142,914.71	0.11
200	Charter Communications Inc	-	CHTR US	纳斯达克交易所	美国	4,284.00	10,117,505.06	0.11
201	Yum! Brands Inc	-	YUM US	纽约证券交易所	美国	11,235.00	10,021,911.75	0.11
202	Ecolab Inc	-	ECL US	纽约证券交易所	美国	9,883.00	10,019,061.00	0.11
203	Enphase Energy Inc	-	ENPH US	纳斯达克交易所	美国	5,422.00	10,005,435.74	0.11
204	Allstate Corp/The	-	ALL US	纽约证券交易所	美国	10,578.00	9,989,860.66	0.11
205	Kinder Morgan Inc	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	78,889.00	9,933,700.36	0.11
206	Halliburton Co	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	36,216.00	9,925,248.67	0.11
207	Capital One Financial Corp	-	COF US	纽约证券交易所	美国	15,224.00	9,856,462.38	0.11
208	Dow Inc	-	DOW US	纽约证券交易所	美国	28,068.00	9,850,357.77	0.11
209	Carrier Global Corp	-	CARR US	纽约证券交易所	美国	33,353.00	9,581,975.03	0.10
210	PACCAR Inc	-	PCAR US	纳斯达克交易所	美国	13,870.00	9,560,403.23	0.10
211	Hilton Worldwide Holdings Inc	-	HLT US	纽约证券交易所	美国	10,787.00	9,493,065.44	0.10
212	Cummins Inc	-	CMI US	纽约证券交易所	美国	5,625.00	9,491,922.75	0.10

213	DuPont de Nemours Inc	-	DD US	纽约证券交易所	美国	19,814.00	9,470,705.59	0.10
214	Hershey Co/The	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	5,862.00	9,454,189.18	0.10
215	Consolidated Edison Inc	-	ED US	纽约证券交易所	美国	14,153.00	9,394,705.16	0.10
216	Nucor Corp	-	NUE US	纽约证券交易所	美国	10,232.00	9,393,016.17	0.10
217	IDEXX Laboratories Inc	-	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	3,303.00	9,384,741.95	0.10
218	Bank of New York Mellon Corp/The	-	BK US	纽约证券交易所	美国	29,336.00	9,300,350.77	0.10
219	Ameriprise Financial Inc	-	AMP US	纽约证券交易所	美国	4,245.00	9,205,569.05	0.10
220	Otis Worldwide Corp	-	OTIS US	纽约证券交易所	美国	16,615.00	9,061,784.88	0.10
221	TransDigm Group Inc	-	TDG US	纽约证券交易所	美国	2,060.00	9,033,636.40	0.10
222	Kraft Heinz Co/The	-	KHC US	纳斯达克交易所	美国	31,755.00	9,003,459.14	0.10
223	Mettler-Toledo International Inc	-	MTD US	纽约证券交易所	美国	889.00	8,949,546.17	0.10
224	AMETEK Inc	-	AME US	纽约证券交易所	美国	9,160.00	8,913,540.23	0.10
225	Electronic Arts Inc	-	EA US	纳斯达克交易所	美国	10,461.00	8,901,629.24	0.10
226	Illumina Inc	-	ILMN US	纳斯达克交易所	美国	6,274.00	8,835,311.06	0.09
227	Fortinet Inc	-	FTNT US	纳斯达克交易所	美国	25,861.00	8,805,652.24	0.09
228	CoStar Group Inc	-	CSGP US	纳斯达克交易所	美国	16,220.00	8,729,997.95	0.09
229	VICI Properties Inc	-	VICI US	纽约证券交易所	美国	38,411.00	8,667,558.92	0.09
230	Welltower Inc	-	WELL US	纽约证券交易所	美国	18,846.00	8,603,755.52	0.09
231	Keysight Technologies Inc	-	KEYS US	纽约证券交易所	美国	7,131.00	8,496,116.72	0.09
232	Public Service Enterprise Group Inc	-	PEG US	纽约证券交易所	美国	19,900.00	8,491,748.74	0.09
233	ResMed Inc	-	RMD US	纽约证券交易所	美国	5,843.00	8,469,675.06	0.09
234	Keurig Dr Pepper Inc	-	KDP US	纳斯达克交易所	美国	33,891.00	8,417,088.64	0.09

235	SBA Communications Corp	-	SBAC US	纳斯达克交易所	美国	4,306.00	8,406,375.69	0.09
236	Arista Networks Inc	-	ANET US	纽约证券交易所	美国	9,872.00	8,343,362.36	0.09
237	Dollar Tree Inc	-	DLTR US	纳斯达克交易所	美国	8,396.00	8,270,673.11	0.09
238	Rockwell Automation Inc	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	4,581.00	8,217,727.73	0.09
239	WEC Energy Group Inc	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	12,581.00	8,215,404.27	0.09
240	Baker Hughes Co	-	BKR US	纳斯达克交易所	美国	39,942.00	8,214,656.97	0.09
241	PPG Industries Inc	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	9,374.00	8,209,081.81	0.09
242	Cognizant Technology Solutions Corp	-	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	20,497.00	8,164,067.30	0.09
243	ONEOK Inc	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	17,826.00	8,156,718.05	0.09
244	Eversource Energy	-	ES US	纽约证券交易所	美国	13,892.00	8,111,706.39	0.09
245	Kroger Co/The	-	KR US	纽约证券交易所	美国	25,979.00	8,066,008.45	0.09
246	Digital Realty Trust Inc	-	DLR US	纽约证券交易所	美国	11,468.00	8,008,568.19	0.09
247	State Street Corp	-	STT US	纽约证券交易所	美国	14,635.00	7,906,471.26	0.08
248	Constellation Energy Corp	-	CEG US	纳斯达克交易所	美国	13,043.00	7,831,254.14	0.08
249	DR Horton Inc	-	DHI US	纽约证券交易所	美国	12,484.00	7,750,372.36	0.08
250	American Water Works Co Inc	-	AWK US	纽约证券交易所	美国	7,252.00	7,698,319.50	0.08
251	Verisk Analytics Inc	-	VRSK US	纳斯达克交易所	美国	6,238.00	7,664,597.74	0.08
252	Fastenal Co	-	FAST US	纳斯达克交易所	美国	22,844.00	7,528,579.94	0.08
253	ON Semiconductor Corp	-	ON US	纳斯达克交易所	美国	17,247.00	7,491,788.11	0.08
254	Global Payments Inc	-	GPN US	纽约证券交易所	美国	10,785.00	7,460,244.12	0.08
255	AmerisourceBergen Corp	-	ABC US	纽约证券交易所	美国	6,460.00	7,455,510.97	0.08
256	Walgreens Boots Alliance Inc	-	WBA US	纳斯达克交易所	美国	28,628.00	7,448,932.77	0.08

257	Zimmer Biomet Holdings Inc	-	ZBH US	纽约证券交易所	美国	8,370.00	7,432,447.01	0.08
258	International Flavors & Fragrances Inc	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	10,169.00	7,425,085.14	0.08
259	Discover Financial Services	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	10,897.00	7,424,636.28	0.08
260	Gartner Inc	-	IT US	纽约证券交易所	美国	3,152.00	7,379,086.19	0.08
261	Republic Services Inc	-	RSG US	纽约证券交易所	美国	8,192.00	7,359,395.87	0.08
262	Willis Towers Watson PLC	-	WTW US	纳斯达克交易所	美国	4,317.00	7,353,585.86	0.08
263	PG&E Corp	-	PCG US	纽约证券交易所	美国	64,213.00	7,271,762.40	0.08
264	Copart Inc	-	CPRT US	纳斯达克交易所	美国	17,091.00	7,247,857.18	0.08
265	Old Dominion Freight Line Inc	-	ODFL US	纳斯达克交易所	美国	3,614.00	7,142,760.88	0.08
266	Baxter International Inc	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	20,106.00	7,137,341.72	0.08
267	Albemarle Corp	-	ALB US	纽约证券交易所	美国	4,673.00	7,057,833.57	0.08
268	Aptiv PLC	-	APTIV US	纽约证券交易所	美国	10,807.00	7,009,562.83	0.07
269	M&T Bank Corp	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	6,885.00	6,955,811.37	0.07
270	WW Grainger Inc	-	GWV US	纽约证券交易所	美国	1,794.00	6,950,061.40	0.07
271	Tractor Supply Co	-	TSCO US	纳斯达克交易所	美国	4,406.00	6,903,435.63	0.07
272	United Rentals Inc	-	URI US	纽约证券交易所	美国	2,765.00	6,844,365.23	0.07
273	Genuine Parts Co	-	GPC US	纽约证券交易所	美国	5,622.00	6,793,780.79	0.07
274	T Rowe Price Group Inc	-	TROW US	纳斯达克交易所	美国	8,913.00	6,769,951.83	0.07
275	CBRE Group Inc	-	CBRE US	纽约证券交易所	美国	12,601.00	6,754,080.76	0.07
276	Corning Inc	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	30,360.00	6,753,561.48	0.07
277	Edison International	-	EIX US	纽约证券交易所	美国	15,231.00	6,748,671.07	0.07
278	CDW Corp/DE	-	CDW US	纳斯达克交易所	美国	5,400.00	6,716,186.65	0.07

279	Hartford Financial Services Group Inc/The	-	HIG US	纽约证券交易所	美国	12,687.00	6,700,329.72	0.07
280	Diamondback Energy Inc	-	FANG US	纳斯达克交易所	美国	7,020.00	6,687,378.28	0.07
281	Ulta Beauty Inc	-	ULTA US	纳斯达克交易所	美国	2,043.00	6,674,245.90	0.07
282	Equifax Inc	-	EFX US	纽约证券交易所	美国	4,884.00	6,611,176.08	0.07
283	HP Inc	-	HPQ US	纽约证券交易所	美国	35,306.00	6,607,122.54	0.07
284	Vulcan Materials Co	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	5,301.00	6,464,946.43	0.07
285	Arch Capital Group Ltd	-	ACGL US	纳斯达克交易所	美国	14,752.00	6,450,128.90	0.07
286	Lennar Corp	-	LEN US	纽约证券交易所	美国	10,161.00	6,404,440.70	0.07
287	Ameren Corp	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	10,311.00	6,385,522.20	0.07
288	Entergy Corp	-	ETR US	纽约证券交易所	美国	8,116.00	6,359,028.03	0.07
289	Weyerhaeuser Co	-	WY US	纽约证券交易所	美国	29,351.00	6,336,957.21	0.07
290	FirstEnergy Corp	-	FE US	纽约证券交易所	美国	21,663.00	6,327,661.00	0.07
291	DTE Energy Co	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	7,727.00	6,324,931.51	0.07
292	Fortive Corp	-	FTV US	纽约证券交易所	美国	14,111.00	6,314,327.49	0.07
293	AvalonBay Communities Inc	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	5,580.00	6,277,065.83	0.07
294	Fifth Third Bancorp	-	FITB US	纳斯达克交易所	美国	27,376.00	6,255,649.41	0.07
295	eBay Inc	-	EBAY US	纳斯达克交易所	美国	21,643.00	6,250,973.72	0.07
296	First Republic Bank/CA	-	FRC US	纽约证券交易所	美国	7,296.00	6,193,684.53	0.07
297	Alexandria Real Estate Equities Inc	-	ARE US	纽约证券交易所	美国	5,956.00	6,042,560.23	0.06
298	PPL Corp	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	29,367.00	5,976,349.31	0.06
299	Ingersoll Rand Inc	-	IR US	纽约证券交易所	美国	16,150.00	5,876,990.65	0.06
300	LyondellBasell Industries NV	-	LYB US	纽约证券交易所	美国	10,130.00	5,857,882.58	0.06

301	Delta Air Lines Inc	-	DAL US	纽约证券交易所	美国	25,573.00	5,852,553.82	0.06
302	ANSYS Inc	-	ANSS US	纳斯达克交易所	美国	3,475.00	5,846,957.56	0.06
303	Martin Marietta Materials Inc	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	2,477.00	5,830,426.66	0.06
304	Warner Bros Discovery Inc	-	WBD US	纳斯达克交易所	美国	88,135.00	5,819,061.20	0.06
305	Laboratory Corp of America Holdings	-	LH US	纽约证券交易所	美国	3,534.00	5,795,844.84	0.06
306	Nasdaq Inc	-	NDAQ US	纳斯达克交易所	美国	13,520.00	5,776,801.40	0.06
307	McCormick & Co Inc/MD	-	MKC US	纽约证券交易所	美国	9,995.00	5,770,070.46	0.06
308	Raymond James Financial Inc	-	RJF US	纽约证券交易所	美国	7,721.00	5,745,717.34	0.06
309	Hewlett Packard Enterprise Co	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	51,318.00	5,704,253.11	0.06
310	Quanta Services Inc	-	PWR US	纽约证券交易所	美国	5,700.00	5,656,996.35	0.06
311	Waters Corp	-	WAT US	纽约证券交易所	美国	2,370.00	5,654,660.42	0.06
312	Huntington Bancshares Inc/OH	-	HBAN US	纳斯达克交易所	美国	57,541.00	5,650,575.69	0.06
313	Cardinal Health Inc	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	10,455.00	5,597,280.82	0.06
314	Regions Financial Corp	-	RF US	纽约证券交易所	美国	37,269.00	5,596,192.88	0.06
315	Equity Residential	-	EQR US	纽约证券交易所	美国	13,566.00	5,574,424.05	0.06
316	Southwest Airlines Co	-	LUV US	纽约证券交易所	美国	23,681.00	5,553,149.08	0.06
317	Xylem Inc/NY	-	XYL US	纽约证券交易所	美国	7,188.00	5,535,305.01	0.06
318	Extra Space Storage Inc	-	EXR US	纽约证券交易所	美国	5,342.00	5,475,816.18	0.06
319	Church & Dwight Co Inc	-	CHD US	纽约证券交易所	美国	9,727.00	5,460,897.38	0.06
320	Citizens Financial Group Inc	-	CFG US	纽约证券交易所	美国	19,642.00	5,385,763.76	0.06
321	Coterra Energy Inc	-	CTRA US	纽约证券交易所	美国	31,447.00	5,381,217.62	0.06
322	Molina Healthcare Inc	-	MOH US	纽约证券交易所	美国	2,329.00	5,356,351.14	0.06

323	AES Corp/The	-	AES US	纽约证券交易所	美国	26,640.00	5,336,042.51	0.06
324	Principal Financial Group Inc	-	PFG US	纳斯达克交易所	美国	9,076.00	5,304,642.75	0.06
325	Dover Corp	-	DOV US	纽约证券交易所	美国	5,598.00	5,279,342.17	0.06
326	VeriSign Inc	-	VRSN US	纳斯达克交易所	美国	3,679.00	5,263,940.51	0.06
327	CenterPoint Energy Inc	-	CNP US	纽约证券交易所	美国	25,108.00	5,244,266.63	0.06
328	EPAM Systems Inc	-	EPAM US	纽约证券交易所	美国	2,294.00	5,236,233.94	0.06
329	Teledyne Technologies Inc	-	TDY US	纽约证券交易所	美国	1,869.00	5,205,563.44	0.06
330	Hologic Inc	-	HOLX US	纳斯达克交易所	美国	9,957.00	5,187,813.33	0.06
331	Conagra Brands Inc	-	CAG US	纽约证券交易所	美国	19,114.00	5,151,796.80	0.06
332	Northern Trust Corp	-	NTRS US	纳斯达克交易所	美国	8,313.00	5,123,280.74	0.05
333	STERIS PLC	-	STE US	纽约证券交易所	美国	3,982.00	5,122,014.64	0.05
334	CMS Energy Corp	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	11,577.00	5,106,245.60	0.05
335	Kellogg Co	-	K US	纽约证券交易所	美国	10,209.00	5,065,278.08	0.05
336	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	-	WAB US	纽约证券交易所	美国	7,254.00	5,042,521.81	0.05
337	Mid-America Apartment Communities Inc	-	MAA US	纽约证券交易所	美国	4,606.00	5,036,073.98	0.05
338	Tyson Foods Inc	-	TSN US	纽约证券交易所	美国	11,551.00	5,007,893.89	0.05
339	Ventas Inc	-	VTR US	纽约证券交易所	美国	15,942.00	5,001,885.88	0.05
340	Quest Diagnostics Inc	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	4,543.00	4,949,789.42	0.05
341	Ancor PLC	-	AMCR US	纽约证券交易所	美国	59,387.00	4,926,055.80	0.05
342	PerkinElmer Inc	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	5,035.00	4,917,061.23	0.05
343	West Pharmaceutical Services Inc	-	WST US	纽约证券交易所	美国	2,953.00	4,840,317.26	0.05
344	Clorox Co/The	-	CLX US	纽约证券交易所	美国	4,921.00	4,809,501.55	0.05

345	IDEX Corp	-	IEX US	纽约证券交易所	美国	3,008.00	4,783,403.17	0.05
346	Invitation Homes Inc	-	INVH US	纽约证券交易所	美国	23,166.00	4,782,174.62	0.05
347	Marathon Oil Corp	-	MRO US	纽约证券交易所	美国	25,329.00	4,775,319.99	0.05
348	Darden Restaurants Inc	-	DRI US	纽约证券交易所	美国	4,882.00	4,703,382.84	0.05
349	J M Smucker Co/The	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	4,250.00	4,690,344.69	0.05
350	CF Industries Holdings Inc	-	CF US	纽约证券交易所	美国	7,825.00	4,643,229.17	0.05
351	Targa Resources Corp	-	TRGP US	纽约证券交易所	美国	9,029.00	4,621,927.94	0.05
352	Omnicom Group Inc	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	8,133.00	4,620,377.00	0.05
353	Expeditors International of Washington Inc	-	EXPD US	纳斯达克交易所	美国	6,347.00	4,593,712.54	0.05
354	Take-Two Interactive Software Inc	-	TTWO US	纳斯达克交易所	美国	6,292.00	4,563,108.14	0.05
355	Cooper Cos Inc/The	-	COO US	纽约证券交易所	美国	1,968.00	4,532,273.07	0.05
356	Steel Dynamics Inc	-	STLD US	纳斯达克交易所	美国	6,653.00	4,526,976.77	0.05
357	KeyCorp	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	37,210.00	4,514,441.18	0.05
358	Cincinnati Financial Corp	-	CINF US	纳斯达克交易所	美国	6,269.00	4,470,457.71	0.05
359	Best Buy Co Inc	-	BBY US	纽约证券交易所	美国	7,992.00	4,464,575.48	0.05
360	Ball Corp	-	BALL US	纽约证券交易所	美国	12,520.00	4,459,243.94	0.05
361	SolarEdge Technologies Inc	-	SEDG US	纳斯达克交易所	美国	2,229.00	4,397,509.94	0.05
362	Las Vegas Sands Corp	-	LVS US	纽约证券交易所	美国	13,106.00	4,387,735.75	0.05
363	Broadridge Financial Solutions Inc	-	BR US	纽约证券交易所	美国	4,693.00	4,384,021.32	0.05
364	Monolithic Power Systems Inc	-	MPWR US	纳斯达克交易所	美国	1,779.00	4,381,236.17	0.05
365	FMC Corp	-	FMC US	纽约证券交易所	美国	5,024.00	4,366,770.77	0.05
366	Atmos Energy Corp	-	ATO US	纽约证券交	美国	5,580.00	4,355,316.79	0.05

				易所				
367	Align Technology Inc	-	ALGN US	纳斯达克交易所	美国	2,898.00	4,256,681.34	0.05
368	Jacobs Solutions Inc	-	J US	纽约证券交易所	美国	5,090.00	4,256,459.17	0.05
369	FactSet Research Systems Inc	-	FDS US	纽约证券交易所	美国	1,519.00	4,244,491.83	0.05
370	Paycom Software Inc	-	PAYC US	纽约证券交易所	美国	1,939.00	4,190,537.77	0.04
371	Etsy Inc	-	ETSY US	纳斯达克交易所	美国	5,013.00	4,181,943.80	0.04
372	APA Corp	-	APA US	纳斯达克交易所	美国	12,823.00	4,168,853.83	0.04
373	Mosaic Co/The	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	13,580.00	4,149,192.49	0.04
374	First Solar Inc	-	FSLR US	纳斯达克交易所	美国	3,955.00	4,125,964.50	0.04
375	W R Berkley Corp	-	WRB US	纽约证券交易所	美国	8,153.00	4,120,697.59	0.04
376	Incyte Corp	-	INCY US	纳斯达克交易所	美国	7,365.00	4,119,956.49	0.04
377	Synchrony Financial	-	SYF US	纽约证券交易所	美国	17,969.00	4,112,327.05	0.04
378	Textron Inc	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	8,327.00	4,105,991.07	0.04
379	Avery Dennison Corp	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	3,230.00	4,071,714.10	0.04
380	Skyworks Solutions Inc	-	SWKS US	纳斯达克交易所	美国	6,400.00	4,061,977.59	0.04
381	Howmet Aerospace Inc	-	HWM US	纽约证券交易所	美国	14,685.00	4,030,663.70	0.04
382	Iron Mountain Inc	-	IRM US	纽约证券交易所	美国	11,595.00	4,025,613.67	0.04
383	Evergy Inc	-	EVRG US	纳斯达克交易所	美国	9,155.00	4,012,474.26	0.04
384	JB Hunt Transport Services Inc	-	JBHT US	纳斯达克交易所	美国	3,304.00	4,012,204.66	0.04
385	Leidos Holdings Inc	-	LDOS US	纽约证券交易所	美国	5,452.00	3,994,169.41	0.04
386	Garmin Ltd	-	GRMN US	纽约证券交易所	美国	6,116.00	3,931,138.10	0.04
387	Alliant Energy Corp	-	LNT US	纳斯达克交易所	美国	10,012.00	3,849,769.85	0.04
388	Essex Property Trust	-	ESS US	纽约证券交	美国	2,583.00	3,812,347.94	0.04

	Inc			易所				
389	Teradyne Inc	-	TER US	纳斯达克交易所	美国	6,212.00	3,779,118.72	0.04
390	SVB Financial Group	-	SIVB US	纳斯达克交易所	美国	2,357.00	3,777,877.48	0.04
391	LKQ Corp	-	LKQ US	纳斯达克交易所	美国	10,123.00	3,765,546.31	0.04
392	FleetCor Technologies Inc	-	FLT US	纽约证券交易所	美国	2,942.00	3,763,576.24	0.04
393	Viatis Inc	-	VTRS US	纳斯达克交易所	美国	48,366.00	3,749,138.76	0.04
394	Healthpeak Properties Inc	-	PEAK	美国证券交易所	美国	21,439.00	3,743,303.47	0.04
395	Tyler Technologies Inc	-	TYL US	纽约证券交易所	美国	1,661.00	3,729,703.56	0.04
396	Brown & Brown Inc	-	BRO US	纽约证券交易所	美国	9,376.00	3,720,146.10	0.04
397	Choe Global Markets Inc	-	CBOE US	美国证券交易所	美国	4,231.00	3,697,252.42	0.04
398	Akamai Technologies Inc	-	AKAM US	纳斯达克交易所	美国	6,272.00	3,682,390.17	0.04
399	Zebra Technologies Corp	-	ZBRA US	纳斯达克交易所	美国	2,059.00	3,676,947.96	0.04
400	Expedia Group Inc	-	EXPE US	纳斯达克交易所	美国	6,006.00	3,664,254.35	0.04
401	Hormel Foods Corp	-	HRL US	纽约证券交易所	美国	11,546.00	3,662,824.52	0.04
402	Fox Corp	-	FOXA US	纳斯达克交易所	美国	12,064.00	2,551,715.78	0.03
			FOX US	纳斯达克交易所	美国	5,557.00	1,101,079.93	0.01
403	Kimco Realty Corp	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	24,666.00	3,638,487.28	0.04
404	NetApp Inc	-	NTAP US	纳斯达克交易所	美国	8,670.00	3,626,607.90	0.04
405	Bio-Techne Corp	-	TECH US	纳斯达克交易所	美国	6,261.00	3,614,012.29	0.04
406	Everest Re Group Ltd	-	RE US	纽约证券交易所	美国	1,562.00	3,603,788.67	0.04
407	NVR Inc	-	NVR US	纽约证券交易所	美国	112.00	3,597,974.76	0.04
408	Interpublic Group of Cos Inc/The	-	IPG US	纽约证券交易所	美国	15,496.00	3,594,929.84	0.04
409	Lamb Weston Holdings	-	LW US	纽约证券交易所	美国	5,737.00	3,570,460.14	0.04

	Inc			易所				
410	Jack Henry & Associates Inc	-	JKHY US	纳斯达克交易所	美国	2,910.00	3,558,072.06	0.04
411	Nordson Corp	-	NDSN US	纳斯达克交易所	美国	2,145.00	3,551,315.01	0.04
412	PTC Inc	-	PTC US	纳斯达克交易所	美国	4,217.00	3,525,540.97	0.04
413	Trimble Inc	-	TRMB US	纳斯达克交易所	美国	9,837.00	3,463,904.54	0.04
414	Gen Digital Inc	-	GEN US	纳斯达克交易所	美国	23,121.00	3,450,841.11	0.04
415	EQT Corp	-	EQT US	纽约证券交易所	美国	14,639.00	3,449,130.19	0.04
416	United Airlines Holdings Inc	-	UAL US	纳斯达克交易所	美国	13,039.00	3,423,590.51	0.04
417	International Paper Co	-	IP US	纽约证券交易所	美国	14,186.00	3,421,437.61	0.04
418	Domino's Pizza Inc	-	DPZ US	纽约证券交易所	美国	1,412.00	3,406,502.87	0.04
419	Snap-on Inc	-	SNA US	纽约证券交易所	美国	2,120.00	3,373,643.88	0.04
420	Brown-Forman Corp	-	BF/B US	纽约证券交易所	美国	7,293.00	3,336,072.93	0.04
421	Camden Property Trust	-	CPT US	纽约证券交易所	美国	4,249.00	3,310,818.45	0.04
422	UDR Inc	-	UDR US	纽约证券交易所	美国	12,205.00	3,292,163.98	0.04
423	Packaging Corp of America	-	PKG US	纽约证券交易所	美国	3,691.00	3,288,097.77	0.04
424	Pool Corp	-	POOL US	纳斯达克交易所	美国	1,557.00	3,278,430.91	0.04
425	Teleflex Inc	-	TFX US	纽约证券交易所	美国	1,871.00	3,252,870.27	0.03
426	Match Group Inc	-	MTCH US	纳斯达克交易所	美国	11,140.00	3,219,028.37	0.03
427	Loews Corp	-	L US	纽约证券交易所	美国	7,860.00	3,193,086.63	0.03
428	Host Hotels & Resorts Inc	-	HST US	纳斯达克交易所	美国	28,518.00	3,187,794.23	0.03
429	Campbell Soup Co	-	CPB US	纽约证券交易所	美国	8,010.00	3,165,880.81	0.03
430	NiSource Inc	-	NI US	纽约证券交易所	美国	16,198.00	3,093,321.24	0.03
431	Stanley Black & Decker	-	SWK US	纽约证券交	美国	5,901.00	3,087,289.62	0.03

	Inc			易所				
432	Charles River Laboratories International Inc	-	CRL US	纽约证券交易所	美国	2,029.00	3,079,182.68	0.03
433	Globe Life Inc	-	GL US	纽约证券交易所	美国	3,608.00	3,029,213.77	0.03
434	Royal Caribbean Cruises Ltd	-	RCL US	纽约证券交易所	美国	8,753.00	3,013,309.34	0.03
435	Henry Schein Inc	-	HSIC US	纳斯达克交易所	美国	5,407.00	3,007,711.89	0.03
436	CH Robinson Worldwide Inc	-	CHRW US	纳斯达克交易所	美国	4,695.00	2,993,901.85	0.03
437	MGM Resorts International	-	MGM US	纽约证券交易所	美国	12,713.00	2,968,778.38	0.03
438	Masco Corp	-	MAS US	纽约证券交易所	美国	8,995.00	2,923,715.75	0.03
439	MarketAxess Holdings Inc	-	MKTX US	纳斯达克交易所	美国	1,501.00	2,915,478.30	0.03
440	PulteGroup Inc	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	9,087.00	2,881,471.69	0.03
441	Juniper Networks Inc	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	12,945.00	2,881,409.63	0.03
442	Celanese Corp	-	CE US	纽约证券交易所	美国	3,979.00	2,833,289.54	0.03
443	Seagate Technology Holdings PLC	-	STX US	纳斯达克交易所	美国	7,658.00	2,805,949.45	0.03
444	Western Digital Corp	-	WDC US	纳斯达克交易所	美国	12,669.00	2,783,799.02	0.03
445	Live Nation Entertainment Inc	-	LYV US	纽约证券交易所	美国	5,697.00	2,767,096.73	0.03
446	Ceridian HCM Holding Inc	-	CDAY US	纽约证券交易所	美国	6,126.00	2,736,968.71	0.03
447	Eastman Chemical Co	-	EMN US	纽约证券交易所	美国	4,786.00	2,714,604.96	0.03
448	Molson Coors Beverage Co	-	TAP US	纽约证券交易所	美国	7,498.00	2,690,403.81	0.03
449	Boston Properties Inc	-	BXP US	纽约证券交易所	美国	5,690.00	2,678,099.03	0.03
450	Regency Centers Corp	-	REG US	纳斯达克交易所	美国	6,143.00	2,673,971.11	0.03
451	Bath & Body Works Inc	-	BBWI US	纽约证券交易所	美国	9,109.00	2,673,384.41	0.03
452	CarMax Inc	-	KMX US	纽约证券交易所	美国	6,303.00	2,672,941.54	0.03

453	BorgWarner Inc	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	9,339.00	2,617,956.58	0.03
454	Allegion plc	-	ALLE US	纽约证券交易所	美国	3,504.00	2,568,760.66	0.03
455	Huntington Ingalls Industries Inc	-	HII US	纽约证券交易所	美国	1,591.00	2,556,090.94	0.03
456	Qorvo Inc	-	QRVO US	纳斯达克交易所	美国	4,044.00	2,552,861.32	0.03
457	Tapestry Inc	-	TPR US	纽约证券交易所	美国	9,611.00	2,548,952.22	0.03
458	News Corp	-	NWSA US	纳斯达克交易所	美国	15,250.00	1,933,024.73	0.02
			NWS US	纳斯达克交易所	美国	4,703.00	603,993.23	0.01
459	VF Corp	-	VFC US	纽约证券交易所	美国	13,173.00	2,533,070.50	0.03
460	Bio-Rad Laboratories Inc	-	BIO US	纽约证券交易所	美国	859.00	2,515,619.86	0.03
461	Universal Health Services Inc	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	2,559.00	2,510,999.54	0.03
462	Westrock Co	-	WRK US	纽约证券交易所	美国	10,143.00	2,483,770.53	0.03
463	Caesars Entertainment Inc	-	CZR US	纳斯达克交易所	美国	8,558.00	2,479,486.75	0.03
464	Advance Auto Parts Inc	-	AAP US	纽约证券交易所	美国	2,398.00	2,455,564.32	0.03
465	Comerica Inc	-	CMA US	纽约证券交易所	美国	5,223.00	2,431,742.67	0.03
466	Pinnacle West Capital Corp	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	4,513.00	2,390,031.47	0.03
467	F5 Inc	-	FFIV US	纳斯达克交易所	美国	2,388.00	2,386,781.51	0.03
468	Paramount Global	-	PARA US	纳斯达克交易所	美国	20,142.00	2,367,942.83	0.03
469	Wynn Resorts Ltd	-	WYNN US	纳斯达克交易所	美国	4,113.00	2,362,386.12	0.03
470	Rollins Inc	-	ROL US	纽约证券交易所	美国	9,232.00	2,349,419.22	0.03
471	American Airlines Group Inc	-	AAL US	纳斯达克交易所	美国	25,920.00	2,296,245.34	0.02
472	Invesco Ltd	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	18,139.00	2,272,692.52	0.02
473	Catalent Inc	-	CTLT US	纽约证券交易所	美国	7,178.00	2,250,135.36	0.02

474	Carnival Corp	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	39,940.00	2,242,018.96	0.02
475	Robert Half International Inc	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	4,328.00	2,225,442.10	0.02
476	Hasbro Inc	-	HAS US	纳斯达克交易所	美国	5,178.00	2,200,185.25	0.02
477	Whirlpool Corp	-	WHR US	纽约证券交易所	美国	2,173.00	2,140,866.36	0.02
478	Franklin Resources Inc	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	11,330.00	2,081,617.26	0.02
479	Pentair PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	6,561.00	2,055,349.43	0.02
480	Federal Realty Investment Trust	-	FRT US	纽约证券交易所	美国	2,915.00	2,051,294.78	0.02
481	Zions Bancorp NA	-	ZION US	纳斯达克交易所	美国	5,968.00	2,043,322.26	0.02
482	NRG Energy Inc	-	NRG US	纽约证券交易所	美国	9,189.00	2,036,407.11	0.02
483	A O Smith Corp	-	AOS US	纽约证券交易所	美国	5,060.00	2,017,187.74	0.02
484	Signature Bank/New York NY	-	SBNY US	纳斯达克交易所	美国	2,510.00	2,014,177.64	0.02
485	Sealed Air Corp	-	SEE US	纽约证券交易所	美国	5,770.00	2,004,464.81	0.02
486	Organon & Co	-	OGN US	纽约证券交易所	美国	10,145.00	1,973,418.37	0.02
487	DENTSPLY SIRONA Inc	-	XRAY US	纳斯达克交易所	美国	8,572.00	1,900,865.55	0.02
488	Assurant Inc	-	AIZ US	纽约证券交易所	美国	2,107.00	1,835,181.99	0.02
489	Generac Holdings Inc	-	GNRC US	纽约证券交易所	美国	2,527.00	1,771,570.12	0.02
490	DXC Technology Co	-	DXC US	纽约证券交易所	美国	9,176.00	1,693,539.99	0.02
491	Alaska Air Group Inc	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	5,059.00	1,512,944.16	0.02
492	Mohawk Industries Inc	-	MHK US	纽约证券交易所	美国	2,103.00	1,497,170.73	0.02
493	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	-	NCLH US	纽约证券交易所	美国	16,807.00	1,432,741.35	0.02
494	Lumen Technologies Inc	-	LUMN US	纽约证券交易所	美国	37,961.00	1,380,080.20	0.01
495	Newell Brands Inc	-	NWL US	纳斯达克交易所	美国	15,011.00	1,367,456.59	0.01

496	Lincoln National Corp	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	6,142.00	1,314,096.33	0.01
497	Ralph Lauren Corp	-	RL US	纽约证券交易所	美国	1,639.00	1,206,220.87	0.01
498	DaVita Inc	-	DVA US	纽约证券交易所	美国	2,192.00	1,139,942.33	0.01
499	DISH Network Corp	-	DISH US	纳斯达克交易所	美国	10,025.00	980,274.41	0.01
500	Vornado Realty Trust	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	6,425.00	931,196.62	0.01

注：所用证券代码采用当地市场代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	Apple Inc	AAPL US	471,789,884.40	6.74
2	Microsoft Corp	MSFT US	410,554,117.40	5.86
3	Alphabet Inc	GOOGL US	136,706,790.30	1.95
		GOOG US	118,895,972.50	1.70
4	Amazon.com Inc	AMZN US	227,166,229.50	3.24
5	Tesla Inc	TSLA US	150,704,125.50	2.15
6	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	114,699,458.90	1.64
7	UnitedHealth Group Inc	UNH US	103,471,277.00	1.48
8	Johnson & Johnson	JNJ US	96,291,970.85	1.38
9	NVIDIA Corp	NVDA US	89,845,451.41	1.28
10	Exxon Mobil Corp	XOM US	83,801,082.52	1.20
11	JPMorgan Chase & Co	JPM US	77,948,286.02	1.11
12	Meta Platforms Inc	META US	72,928,141.22	1.04
13	Procter & Gamble Co/The	PG US	72,386,936.85	1.03
14	Visa Inc	V US	70,050,735.75	1.00
15	Home Depot Inc/The	HD US	65,024,329.61	0.93
16	Chevron Corp	CVX US	62,763,077.95	0.90
17	Mastercard Inc	MA US	59,526,361.18	0.85
18	Pfizer Inc	PFE US	59,160,751.93	0.84
19	AbbVie Inc	ABBV US	57,251,043.35	0.82
20	Eli Lilly & Co	LLY US	54,536,424.82	0.78

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。

8.5.2 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	Apple Inc	AAPL US	265,255,518.90	3.79
2	Microsoft Corp	MSFT US	220,790,616.20	3.15
3	Alphabet Inc	GOOGL US	74,453,830.25	1.06
		GOOG US	67,963,127.30	0.97
4	Amazon.com Inc	AMZN US	123,012,775.50	1.76
5	Tesla Inc	TSLA US	77,471,656.51	1.11
6	Berkshire Hathaway Inc	BRK/B US	61,743,186.50	0.88
7	UnitedHealth Group Inc	UNH US	56,034,472.36	0.80
8	Johnson & Johnson	JNJ US	51,932,939.21	0.74
9	NVIDIA Corp	NVDA US	47,123,174.02	0.67
10	Exxon Mobil Corp	XOM US	45,795,423.50	0.65
11	Meta Platforms Inc	META US	41,993,231.50	0.60
12	JPMorgan Chase & Co	JPM US	41,755,127.83	0.60
13	Procter & Gamble Co/The	PG US	38,882,747.64	0.56
14	Visa Inc	V US	37,692,794.13	0.54
15	Chevron Corp	CVX US	37,348,923.20	0.53
16	Home Depot Inc/The	HD US	36,243,184.06	0.52
17	Elevance Health Inc	ELV US	34,334,103.97	0.49
18	Mastercard Inc	MA US	31,690,643.73	0.45
19	Pfizer Inc	PFE US	30,680,834.64	0.44
20	Bank of America Corp	BAC US	29,567,040.57	0.42

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。

8.5.3 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	7,217,161,074.57
卖出收入（成交）总额	3,956,098,881.08

注：本项“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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Mar23	-18,683,898.50	-0.20

注：期货投资采用当日无负债结算制度，其公允价值与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵销后的净额为 0。

8.10 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

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 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。

8.11.3 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	26,944,560.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	6,396,446.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,341,007.20

8.11.4 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。

8.11.5 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
47,882	154,601.70	2,698,383,761.00	36.45%	1,639,621,749.00	22.15%	3,064,633,060.00	41.40%

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	1,184,939,553.00	16.01%
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	368,721,700.00	4.98%
3	华泰证券股份有限公司	128,500,085.00	1.74%
4	BARCLAYS BANK PLC	122,681,903.00	1.66%
5	上海浦东发展银行股份有限公司—兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF）	93,876,398.00	1.27%
6	中国民生银行股份有限公司—兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	92,290,800.00	1.25%
7	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	89,736,000.00	1.21%
8	招商银行股份有限公司—兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	86,403,000.00	1.17%
9	中信证券股份有限公司	54,509,209.00	0.74%
10	郭栋梓	48,096,400.00	0.65%
-	中国工商银行股份有限公司—博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,064,633,060.00	41.40%

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。

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(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	2,438,819,285.00
本报告期基金总申购份额	6,663,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,260,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	2,560,819,285.00
本报告期期末基金份额总额	7,402,638,570.00

§ 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

基金管理人于 2023 年 2 月 18 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》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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事项。

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。报告期内本基金应付审计费为 100000 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
摩根士丹利	-	11,107,126,975.94	100.00%	3,321,398.38	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，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，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；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。

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

无。

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	关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、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站	2022-12-29
2	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 12 月 26 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站	2022-12-23
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增山西证券股份有限公司为申购、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站	2022-12-14
4	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 11 月 24 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站	2022-11-23
5	博时基金管理有限公司旗下基金在杭州银行直销银行开展申购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站	2022-11-16
6	关于修改博时基金管理有限公司旗下部分基金招募说明书的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-11-09
7	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-11-09
8	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 3 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站	2022-10-26
9	博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-10-18
10	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-09-30
11	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华金证券股份有限公司为申购、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站	2022-09-13
12	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 9 月 5 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站	2022-09-02
13	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-08-31
14	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通广发银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-08-29

	告	露网站	
15	博时标普 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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-08-25
16	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展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站	2022-08-22
17	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 2 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站	2022-07-21
18	博时基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台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站	2022-07-18
19	博时基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-07-16
20	博时基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-07-16
21	博时基金管理有限公司关于部分基金在招赢通平台开展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站	2022-07-05
22	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 7 月 4 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站	2022-07-01
23	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 6 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站	2022-06-17
24	博时基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-17
25	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 5 月 30 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站	2022-05-27
26	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20220430	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-30
27	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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站	2022-04-22
28	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 4 月 15 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站	2022-04-14
29	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 交易	上海证券报、基金管理人	2022-03-30

	型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告	网站、证监会基金电子披露网站	
30	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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站	2022-03-30
31	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分及相关业务安排的第二次提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-28
32	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-25
33	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增长城证券股份有限公司为申购、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站	2022-03-23
34	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分及相关业务安排的第一次提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-23
35	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分及相关业务安排的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-18
36	博时基金管理有限公司关于调整直销网上交易定期投资业务影响部分定期投资计划的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-14
37	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增申万宏源西部证券有限公司为申购、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站	2022-03-04
38	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 2 月 21 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站	2022-02-18
39	博时基金管理有限公司关于部分基金在青岛农商银行直销银行开展费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-02-11
40	博时基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
41	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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站	2022-01-24
42	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20220121	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-21
43	关于成立博时财富基金销售有限公司的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-20

44	关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金新增方正证券为申购、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站	2022-01-18
45	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 1 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站	2022-01-14
46	博时基金管理有限公司关于暂停使用交通银行非快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-06
47	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通交通银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-04
48	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站	2022-01-01
49	博时基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01

§ 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
博时标普 500 交易型开放式指数证	1	2022-01-01~2022-12-31	863,513,080.00	2,995,490,580.00	794,370,600.00	3,064,633,060.00	41.40%

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

注：申购份额包含红利再投资份额。

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标普 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 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

13.1.6 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

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

二〇二三年三月三十日