

博时中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2024 年中期报告
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动	48

§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 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	121,295,098.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 31 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

法定代表人	江向阳	缪建民
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-17,296,969.05
本期利润	-57,316,827.99
加权平均基金份额本期利润	-0.4785
本期加权平均净值利润率	-7.61%
本期基金份额净值增长率	-7.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	112,698,770.56
期末可供分配基金份额利润	0.9291
期末基金资产净值	728,020,388.69
期末基金份额净值	6.0021
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	18.32%

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

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

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

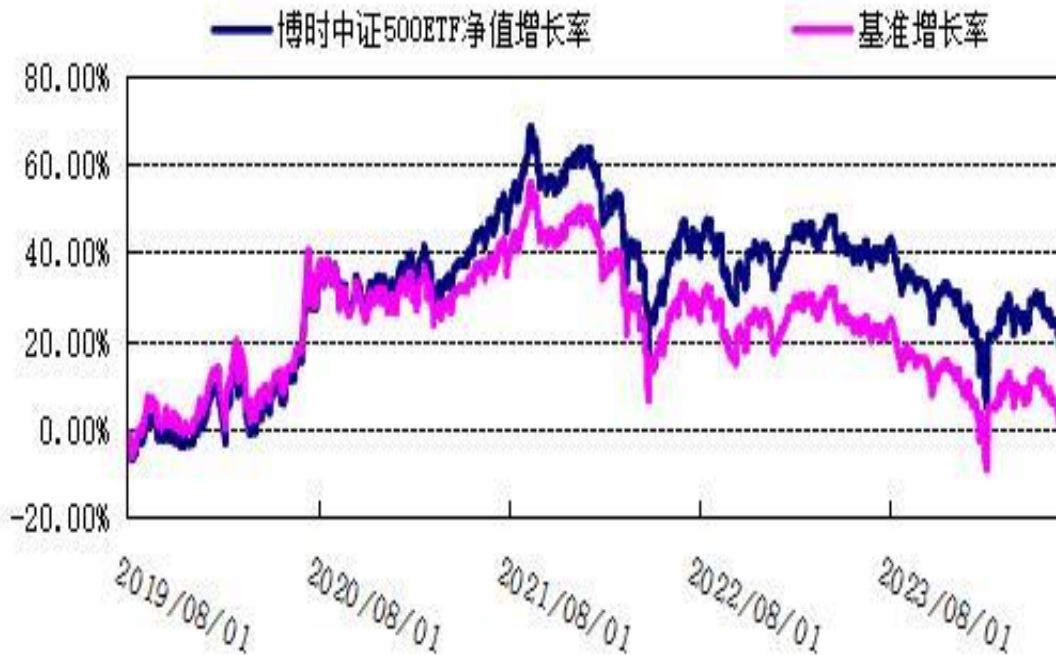
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.05%	0.96%	-6.89%	0.96%	0.84%	0.00%
过去三个月	-5.09%	1.13%	-6.50%	1.14%	1.41%	-0.01%
过去六个月	-7.52%	1.59%	-8.96%	1.61%	1.44%	-0.02%
过去一年	-15.26%	1.26%	-17.60%	1.27%	2.34%	-0.01%

过去三年	-19.82%	1.18%	-27.40%	1.20%	7.58%	-0.02%
自基金合同生效起至今	18.32%	1.25%	0.81%	1.26%	17.51%	-0.01%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 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 16037 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 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2019-08-01	-	17.3	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金

				<p> 经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022 年 7 月 26 日-2023 年 9 月 25 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 5 月 11 日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日一至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII) </p>
--	--	--	--	---

					(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 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023 年 4 月 19 日一至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2023 年 9 月 26 日一至今)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	7.9	王萌先生, 博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 81 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

2024 年上半年国内经济整体保持稳定, 但也面临部分行业产能过剩、国内有效需求不足、居民资产负债表修复缓慢等问题, 整体上也拖累上市公司业绩的修复。从节奏上看, 上半年我国经济和去年类似呈现先升

后降的特点，制造业 PMI 在一季度出现回升后，二季度回落至枯荣线以下。从结构上看，上半年消费低位震荡，地产景气再度探底，服务业生产指数同比持续下滑，社零消费、固定资产投资累计同比一季度均有走弱的迹象。受全球经济复苏拉动，上半年出口明显回暖。海外方面，美国经济仍有韧性，增长稳步放缓，软着陆概率提升。此外，美国通胀和核心通胀持续下行，紧缩预期有一定缓解，大选选情影响多项资产表现。

从市场表现来看，上半年市场整体表现不佳，但上游资源板块以及以银行为代表的部分高股息板块成为市场中为数不多的亮点，小盘和成长相关指数跌幅较大。行业层面，银行、煤炭、石油石化、家电和电力及公用事业上半年涨幅居前，消费者服务、商贸零售、传媒、计算机和医药跌幅相对较大。风格上，大盘价值表现出色，小盘成长表现不佳。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 6.0021 元，份额累计净值为 1.1832 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-7.52%，同期业绩基准增长率-8.96%。

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 2024 年下半年，中国经济可能延续缓慢修复态势，流动性预计维持合理充裕，信贷扩张速度会延续下降，政策上以稳经济为主，难有强刺激，地产和消费预计主要依靠内生恢复。从中期看，增长、盈利有望在曲折中改善。海外方面，考虑到美国大选，对华问题是选举重要议题之一，由此引发的政策扰动值得关注。当前市场估值整体处于历史低位，流动性合理充裕，虽然企业盈利增速恢复不及预期，但部分上市公司通过提高分红比例以及增加回购等行为积极提升股东回报，股票市场目前仍然具备较好的潜在回报率。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2024年6月30日	2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	13,858,901.98	29,827,335.78
结算备付金		12,610,484.36	5,425,157.83
存出保证金		3,381,337.02	4,888,085.29
交易性金融资产	6.4.3.2	698,623,603.24	724,453,321.11
其中：股票投资		698,623,603.24	724,453,321.11
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		1,389,900.60	150,313.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	4,288.32
资产总计		729,864,227.20	764,748,501.62
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,390,337.33	1.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		92,334.03	96,883.10
应付托管费		30,778.01	32,294.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	554.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	330,389.14	779,806.00
负债合计		1,843,838.51	909,539.62
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	615,321,618.13	597,059,067.89
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	112,698,770.56	166,779,894.11
净资产合计		728,020,388.69	763,838,962.00

负债和净资产总计		729,864,227.20	764,748,501.62
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.0021 元，基金份额总额 121,295,098.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30 日
一、营业总收入		-56,362,298.91	31,228,210.15
1. 利息收入		116,713.89	122,523.27
其中：存款利息收入	6.4.3.10	82,473.83	115,921.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		34,240.06	6,601.47
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-16,459,708.98	2,777,733.19
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-23,890,521.06	-5,804,112.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-2,281,957.86	64,947.18
股利收益	6.4.3.15	9,712,769.94	8,516,898.09
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-40,019,858.94	28,201,438.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	555.12	126,515.68
减：二、营业总支出		954,529.08	988,003.05
1. 管理人报酬		562,979.27	585,254.03
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		187,659.77	195,084.65
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		123.30	263.86
8. 其他费用	6.4.3.19	203,766.74	207,400.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号		-57,316,827.99	30,240,207.10

填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-57,316,827.99	30,240,207.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-57,316,827.99	30,240,207.10

6.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	597,059,067.89	-	166,779,894.11	763,838,962.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	597,059,067.89	-	166,779,894.11	763,838,962.00
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	18,262,550.24	-	-54,081,123.55	-35,818,573.31
（一）、综合收益总额	-	-	-57,316,827.99	-57,316,827.99
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	18,262,550.24	-	3,235,704.44	21,498,254.68
其中：1. 基金申购款	60,875,167.55	-	12,853,878.76	73,729,046.31
2. 基金赎回款	-42,612,617.31	-	-9,618,174.32	-52,230,791.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	615,321,618.13	-	112,698,770.56	728,020,388.69
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	562,563,139.57	-	193,679,165.42	756,242,304.99
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	562,563,139.57	-	193,679,165.42	756,242,304.99
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-6,087,516.73	-	26,802,198.21	20,714,681.48
(一)、综合收益总额	-	-	30,240,207.10	30,240,207.10
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-6,087,516.73	-	-3,438,008.89	-9,525,525.62
其中: 1. 基金申购款	24,350,067.04	-	9,597,990.37	33,948,057.41
2. 基金赎回款	-30,437,583.77	-	-13,035,999.26	-43,473,583.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	556,475,622.84	-	220,481,363.63	776,956,986.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	13,858,901.98
等于：本金	13,857,085.15
加：应计利息	1,816.83
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	13,858,901.98

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	842,640,685.65	-	698,623,603.24	-144,017,082.41
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	842,640,685.65	-	698,623,603.24	-144,017,082.41

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	23,485,400.00	-	-	-
---股指期货	23,485,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,485,400.00	-	-	-

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

6.4.3.3.2 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
IC2409	IC2409	23.00	22,425,920.00	-1,059,480.00
合计	-	-	-	-1,059,480.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-1,059,480.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	127,290.10
其中：交易所市场	127,290.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	90,503.14
应付指数使用费	112,595.90
合计	330,389.14

6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,695,098.00	597,059,067.89
本期申购	12,000,000.00	60,875,167.55
本期赎回（以“-”号填列）	-8,400,000.00	-42,612,617.31
本期末	121,295,098.00	615,321,618.13

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

6.4.3.9 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	419,771,888.49	-252,991,994.38	166,779,894.11
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	419,771,888.49	-252,991,994.38	166,779,894.11
本期利润	-17,296,969.05	-40,019,858.94	-57,316,827.99
本期基金份额交易产生的变动数	12,596,238.82	-9,360,534.38	3,235,704.44
其中：基金申购款	42,152,705.72	-29,298,826.96	12,853,878.76
基金赎回款	-29,556,466.90	19,938,292.58	-9,618,174.32
本期已分配利润	-	-	-

本期末	415,071,158.26	-302,372,387.70	112,698,770.56
-----	----------------	-----------------	----------------

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	27,719.43
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	54,612.02
其他	142.38
合计	82,473.83

6.4.3.11 股票投资收益

6.4.3.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,731,670.68
股票投资收益——赎回差价收入	-5,158,850.38
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	-23,890,521.06

6.4.3.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	112,591,278.51
减：卖出股票成本总额	131,094,757.82
减：交易费用	228,191.37
买卖股票差价收入	-18,731,670.68

6.4.3.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	52,230,791.63
减：现金支付赎回款总额	26,277,756.63
减：赎回股票成本总额	31,111,885.38
减：交易费用	-
赎回差价收入	-5,158,850.38

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.3.13 资产支持证券投资收益
6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 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。

6.4.3.14 衍生工具收益
6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-2,281,957.86

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,712,769.94
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	9,712,769.94

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-39,480,978.94
——股票投资	-39,480,978.94
——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	-538,880.00
——权证投资	-
——股指期货	-538,880.00
4. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-40,019,858.94

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	555.12
合计	555.12

6.4.3.18 信用减值损失

无发生额。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	审计费用	30,830.80
信息披露费	59,672.34	
证券出借违约金	-	
其他	257.70	
银行汇划费	410.00	
指数使用费	112,595.90	
合计	203,766.74	

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票成交总

		成交总额的 比例		额的比例
招商证券	64,388,863.63	25.44%	39,861,050.18	17.87%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

无。

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
招商证券	14,877.66	9.56%	4,549.73	3.57%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
招商证券	8,486.89	5.96%	3,371.69	2.56%

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	562,979.27	585,254.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	562,979.27	585,254.03

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	187,659.77	195,084.65

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明
6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	4,879,955.00	3.00~6.01	3.84	8,365.46	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	-	-	-	-	-	-

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况
6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	101,134,005.00	83.38%	97,049,005.00	82.46%
招商证券	485,407.00	0.40%	1,217,770.00	1.03%

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

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	13,858,901.98	27,719.43	23,968,615.49	44,666.57

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

6.4.6.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
招商证券股份 有限公司	688692	达梦数据	网下发行	1,745.00	151,745.20
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
招商证券股份 有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份 有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	7,523.00	189,955.75

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明
6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券
6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	首次公开发行限售	70.48	188.01	1,244.00	87,680.99	233,884.44	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	首次公开发行限售	86.96	174.93	175.00	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	5 个交易日	新股未上市	18.65	18.65	1,158.00	21,596.70	21,596.70	-
688709	成都华	2024-01-31	6 个月	首次公开发行	15.69	18.79	1,045.00	16,396.05	19,635.55	-

	微			限售						
603350	安乃达	2024-06-26	5 个交易日	新股未上市	20.56	20.56	945.00	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	首次公开发行限售	16.16	32.27	481.00	7,772.96	15,521.87	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	首次公开发行限售	16.20	15.96	961.00	15,568.20	15,337.56	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	首次公开发行限售	22.66	15.89	866.00	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	首次公开发行限售	39.82	91.24	150.00	5,972.74	13,686.00	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	首次公开发行限售	11.88	18.98	711.00	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	首次公开发行限售	44.95	65.93	202.00	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	首次公开发行限售	26.00	37.49	298.00	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	首次公开发行限售	19.86	42.51	247.00	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	首次公开发行限售	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	首次公开发行限售	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	首次公开发行限售	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股	2024-03-27	6 个月	首次公开发行	21.73	25.26	306.00	6,649.38	7,729.56	-

001389	份 广合科技	2024-03-26	6个月	限售 首次 公开发 行 限售	17.43	34.56	222.00	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏 鑫科技	2024-04-03	6个月	首次 公开发 行 限售	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
688695	中 创股 份	2024-03-06	6个月	首次 公开发 行 限售	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧 莱 新 材	2024-04-29	6个月	首次 公开发 行 限售	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
301588	美 新 科 技	2024-03-06	6个月	首次 公开发 行 限售	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华 阳 智 能	2024-01-26	6个月	首次 公开发 行 限售	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
603325	博 隆 技 术	2024-01-03	6个月	首次 公开发 行 限售	72.46	68.06	66.00	4,782.36	4,491.96	-
603381	永 臻 股 份	2024-06-19	6个月	首次 公开发 行 限售	23.35	25.13	178.00	4,156.30	4,473.14	-
603344	星 德 胜	2024-03-13	6个月	首次 公开发 行 限售	19.18	22.66	182.00	3,490.76	4,124.12	-
001359	平 安 电 工	2024-03-19	6个月	首次 公开发 行 限售	17.39	20.60	184.00	3,199.76	3,790.40	-
603312	西 典 新 能	2024-01-04	6个月	首次 公开发 行 限售	29.02	25.36	130.00	3,772.60	3,296.80	-
603082	北 自 科 技	2024-01-23	6个月	首次 公开发 行 限售	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾 达	2024-01-11	6个月	首次公 开	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-

	科技			发行限售						
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	首次公开发行限售	38.18	38.90	72.00	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	首次公开发行限售	11.82	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	首次公开发行限售	18.65	18.65	129.00	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	首次公开发行限售	20.56	20.56	106.00	2,179.36	2,179.36	-

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

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

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

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

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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

注：本基金截至 2024 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，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。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,858,901.98	-	-	-	13,858,901.98
结算备付金	12,610,484.36	-	-	-	12,610,484.36
存出保证金	17,449.02	-	-	3,363,888.00	3,381,337.02
交易性金融资产	-	-	-	698,623,603.24	698,623,603.24
应收清算款	-	-	-	1,389,900.60	1,389,900.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	26,486,835.36	-	-	703,377,391.84	729,864,227.20
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,390,337.33	1,390,337.33
应付管理人报酬	-	-	-	92,334.03	92,334.03
应付托管费	-	-	-	30,778.01	30,778.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	330,389.14	330,389.14
负债总计	-	-	-	1,843,838.51	1,843,838.51
利率敏感度缺口	26,486,835.36	-	-	701,533,553.33	728,020,388.69
上年度末 2023年12月31日					
资产					
货币资金	29,827,335.78	-	-	-	29,827,335.78
结算备付金	5,425,157.83	-	-	-	5,425,157.83
存出保证金	14,945.29	-	-	4,873,140.00	4,888,085.29
交易性金融资产	-	-	-	724,453,321.11	724,453,321.11
应收清算款	-	-	-	150,313.29	150,313.29
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,288.32	4,288.32
资产总计	35,267,438.90	-	-	729,481,062.72	764,748,501.62
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1.34	1.34
应付管理人报酬	-	-	-	96,883.10	96,883.10
应付托管费	-	-	-	32,294.37	32,294.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	554.81	554.81
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	779,806.00	779,806.00
负债总计	-	-	-	909,539.62	909,539.62
利率敏感度缺口	35,267,438.90	-	-	728,571,523.10	763,838,962.00

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	698,623,603.24	95.96	724,453,321.11	94.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	698,623,603.24	95.96	724,453,321.11	94.84

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

6.4.9.4.3.2 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约3,467	增加约3,677
业绩比较基准下降5%	减少约3,467	减少约3,677	

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 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 2024年6月30日
第一层次	698,078,411.18
第二层次	45,611.11
第三层次	499,580.95
合计	698,623,603.24

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	698,623,603.24	95.72
	其中：股票	698,623,603.24	95.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,469,386.34	3.63
8	其他各项资产	4,771,237.62	0.65
9	合计	729,864,227.20	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,374,965.00	0.60
B	采矿业	32,619,175.48	4.48
C	制造业	442,068,761.32	60.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,099,528.47	3.86
E	建筑业	7,103,268.00	0.98
F	批发和零售业	14,817,122.08	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	14,051,617.86	1.93
H	住宿和餐饮业	2,210,739.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,607,030.81	6.81
J	金融业	64,846,710.20	8.91
K	房地产业	7,897,919.00	1.08
L	租赁和商务服务业	5,326,096.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	5,578,173.55	0.77

N	水利、环境和公共设施管理业	3,181,379.47	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	776,781.00	0.11
Q	卫生和社会工作	4,322,199.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	10,494,649.00	1.44
S	综合	1,247,488.00	0.17
	合计	698,623,603.24	95.96

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	83,500	8,813,425.00	1.21
2	002028	思源电气	72,291	4,836,267.90	0.66
3	688169	石头科技	11,313	4,441,483.80	0.61
4	601058	赛轮轮胎	309,500	4,333,000.00	0.60
5	600066	宇通客车	156,100	4,027,380.00	0.55
6	002340	格林美	604,000	3,847,480.00	0.53
7	000933	神火股份	185,100	3,744,573.00	0.51
8	601077	渝农商行	728,000	3,654,560.00	0.50
9	000988	华工科技	118,262	3,539,581.66	0.49
10	601168	西部矿业	196,300	3,523,585.00	0.48
11	300394	天孚通信	38,940	3,443,074.80	0.47
12	002384	东山精密	161,000	3,332,700.00	0.46
13	000423	东阿阿胶	53,100	3,324,060.00	0.46
14	000630	铜陵有色	902,700	3,258,747.00	0.45
15	600418	江淮汽车	205,500	3,255,120.00	0.45
16	600988	赤峰黄金	195,800	3,199,372.00	0.44
17	601233	桐昆股份	198,600	3,169,656.00	0.44
18	600157	永泰能源	2,613,300	3,083,694.00	0.42
19	002625	光启技术	177,400	3,077,890.00	0.42
20	600096	云天化	151,000	2,932,420.00	0.40
21	601567	三星医疗	83,000	2,905,000.00	0.40
22	000400	许继电气	83,900	2,886,999.00	0.40
23	688777	中控技术	74,453	2,806,878.10	0.39
24	002156	通富微电	124,500	2,787,555.00	0.38
25	002128	电投能源	132,000	2,785,200.00	0.38
26	002273	水晶光电	163,700	2,779,626.00	0.38
27	601555	东吴证券	467,540	2,758,486.00	0.38
28	002078	太阳纸业	197,269	2,751,902.55	0.38
29	600885	宏发股份	98,000	2,712,640.00	0.37
30	601128	常熟银行	354,520	2,683,716.40	0.37
31	002532	天山铝业	328,100	2,660,891.00	0.37
32	300207	欣旺达	175,200	2,657,784.00	0.37
33	002223	鱼跃医疗	70,564	2,653,206.40	0.36
34	600352	浙江龙盛	306,000	2,628,540.00	0.36

35	600398	海澜之家	282,500	2,610,300.00	0.36
36	002138	顺络电子	94,700	2,600,462.00	0.36
37	002966	苏州银行	344,990	2,587,425.00	0.36
38	002353	杰瑞股份	72,100	2,529,268.00	0.35
39	601108	财通证券	382,300	2,527,003.00	0.35
40	600765	中航重机	121,880	2,486,352.00	0.34
41	688617	惠泰医疗	5,447	2,484,376.70	0.34
42	002185	华天科技	301,400	2,456,410.00	0.34
43	002517	恺英网络	253,300	2,419,015.00	0.33
44	600879	航天电子	310,500	2,412,585.00	0.33
45	603606	东方电缆	48,600	2,372,166.00	0.33
46	301236	软通动力	66,926	2,356,464.46	0.32
47	600873	梅花生物	234,900	2,353,698.00	0.32
48	688099	晶晨股份	39,590	2,348,478.80	0.32
49	600177	雅戈尔	326,600	2,325,392.00	0.32
50	601577	长沙银行	283,900	2,322,302.00	0.32
51	600079	人福医药	134,500	2,309,365.00	0.32
52	600109	国金证券	305,600	2,307,280.00	0.32
53	002738	中矿资源	85,880	2,301,584.00	0.32
54	300003	乐普医疗	154,700	2,295,748.00	0.32
55	600060	海信视像	92,100	2,278,554.00	0.31
56	300017	网宿科技	287,100	2,268,090.00	0.31
57	600497	驰宏锌锗	419,072	2,237,844.48	0.31
58	300136	信维通信	113,800	2,228,204.00	0.31
59	603160	汇顶科技	32,300	2,220,625.00	0.31
60	603979	金诚信	43,500	2,198,055.00	0.30
61	002202	金风科技	324,700	2,181,984.00	0.30
62	002739	万达电影	179,400	2,168,946.00	0.30
63	689009	九号公司	58,850	2,166,268.50	0.30
64	000932	华菱钢铁	487,540	2,159,802.20	0.30
65	000683	远兴能源	307,300	2,123,443.00	0.29
66	600985	淮北矿业	126,600	2,119,284.00	0.29
67	002465	海格通信	204,300	2,116,548.00	0.29
68	600536	中国软件	70,610	2,112,651.20	0.29
69	600348	华阳股份	212,050	2,112,018.00	0.29
70	002409	雅克科技	33,500	2,107,485.00	0.29
71	002444	巨星科技	84,900	2,097,030.00	0.29
72	002281	光迅科技	56,100	2,096,457.00	0.29
73	688120	华海清科	11,042	2,093,342.36	0.29
74	000009	中国宝安	242,620	2,086,532.00	0.29
75	000878	云南铜业	165,100	2,057,146.00	0.28
76	002008	大族激光	98,900	2,057,120.00	0.28
77	688122	西部超导	53,611	2,054,373.52	0.28
78	002436	兴森科技	198,800	2,051,616.00	0.28
79	300474	景嘉微	32,350	2,045,490.50	0.28
80	600642	申能股份	230,335	2,033,858.05	0.28
81	601615	明阳智能	213,600	2,016,384.00	0.28
82	002797	第一创业	395,460	2,012,891.40	0.28
83	000039	中集集团	216,550	2,005,253.00	0.28
84	300054	鼎龙股份	88,300	2,002,644.00	0.28

85	601990	南京证券	260,100	1,997,568.00	0.27
86	600298	安琪酵母	71,382	1,993,699.26	0.27
87	000066	中国长城	227,700	1,992,375.00	0.27
88	300012	华测检测	198,000	1,991,880.00	0.27
89	600529	山东药玻	78,100	1,979,054.00	0.27
90	688525	佰维存储	30,655	1,966,518.25	0.27
91	601666	平煤股份	174,700	1,956,640.00	0.27
92	002673	西部证券	315,500	1,952,945.00	0.27
93	600839	四川长虹	434,366	1,950,303.34	0.27
94	603596	伯特利	50,040	1,946,556.00	0.27
95	601179	中国西电	241,134	1,938,717.36	0.27
96	000831	中国稀土	75,000	1,901,250.00	0.26
97	000783	长江证券	390,100	1,884,183.00	0.26
98	300395	菲利华	61,100	1,878,825.00	0.26
99	601717	郑煤机	126,900	1,878,120.00	0.26
100	300002	神州泰岳	230,700	1,873,284.00	0.26
101	002432	九安医疗	46,200	1,872,948.00	0.26
102	603816	顾家家居	58,000	1,872,820.00	0.26
103	000728	国元证券	308,100	1,867,086.00	0.26
104	000738	航发控制	92,700	1,860,489.00	0.26
105	600862	中航高科	98,200	1,844,196.00	0.25
106	000703	恒逸石化	258,800	1,834,892.00	0.25
107	688180	君实生物	63,053	1,831,689.65	0.25
108	601198	东兴证券	228,100	1,815,676.00	0.25
109	601997	贵阳银行	344,000	1,812,880.00	0.25
110	002595	豪迈科技	47,201	1,801,662.17	0.25
111	603338	浙江鼎力	29,800	1,800,516.00	0.25
112	000960	锡业股份	116,100	1,798,389.00	0.25
113	603345	安井食品	24,200	1,798,302.00	0.25
114	002155	湖南黄金	98,800	1,788,280.00	0.25
115	688188	柏楚电子	9,659	1,782,568.45	0.24
116	601696	中银证券	196,100	1,780,588.00	0.24
117	600863	内蒙华电	383,700	1,780,368.00	0.24
118	601162	天风证券	815,400	1,777,572.00	0.24
119	300037	新宙邦	62,020	1,771,291.20	0.24
120	600521	华海药业	103,600	1,766,380.00	0.24
121	300866	安克创新	24,770	1,763,871.70	0.24
122	600038	中直股份	42,900	1,763,619.00	0.24
123	300724	捷佳伟创	32,600	1,760,726.00	0.24
124	000921	海信家电	54,600	1,760,304.00	0.24
125	002472	双环传动	79,600	1,752,792.00	0.24
126	300001	特锐德	86,900	1,748,428.00	0.24
127	603939	益丰药房	71,164	1,747,076.20	0.24
128	002294	信立泰	65,520	1,744,797.60	0.24
129	002984	森麒麟	72,400	1,744,116.00	0.24
130	600141	兴发集团	90,800	1,732,464.00	0.24
131	600549	厦门钨业	100,000	1,725,000.00	0.24
132	600699	均胜电子	116,000	1,719,120.00	0.24
133	002407	多氟多	140,400	1,717,092.00	0.24
134	600546	山煤国际	116,600	1,704,692.00	0.23

135	002850	科达利	22,300	1,703,274.00	0.23
136	300699	光威复材	68,180	1,692,909.40	0.23
137	600820	隧道股份	258,800	1,689,964.00	0.23
138	002262	恩华药业	71,000	1,685,540.00	0.23
139	600895	张江高科	91,000	1,681,680.00	0.23
140	600872	中炬高新	74,000	1,679,060.00	0.23
141	600369	西南证券	468,800	1,678,304.00	0.23
142	002195	岩山科技	668,300	1,677,433.00	0.23
143	301358	湖南裕能	53,300	1,676,818.00	0.23
144	002064	华峰化学	233,500	1,674,195.00	0.23
145	300285	国瓷材料	93,740	1,673,259.00	0.23
146	000021	深科技	110,200	1,666,224.00	0.23
147	603589	口子窖	42,200	1,653,818.00	0.23
148	600021	上海电力	165,700	1,638,773.00	0.23
149	300073	当升科技	47,734	1,637,753.54	0.22
150	601000	唐山港	348,450	1,637,715.00	0.22
151	603087	甘李药业	35,300	1,635,096.00	0.22
152	300146	汤臣倍健	120,000	1,626,000.00	0.22
153	600486	扬农化工	28,660	1,617,857.00	0.22
154	000513	丽珠集团	43,242	1,609,034.82	0.22
155	601966	玲珑轮胎	86,700	1,592,679.00	0.22
156	002756	永兴材料	44,500	1,592,210.00	0.22
157	600704	物产中大	366,700	1,591,478.00	0.22
158	300058	蓝色光标	292,500	1,591,200.00	0.22
159	600153	建发股份	176,600	1,577,038.00	0.22
160	600155	华创云信	265,900	1,571,469.00	0.22
161	300114	中航电测	34,700	1,570,175.00	0.22
162	603179	新泉股份	40,000	1,569,600.00	0.22
163	688065	凯赛生物	34,559	1,568,633.01	0.22
164	000830	鲁西化工	135,300	1,568,127.00	0.22
165	300529	健帆生物	57,000	1,550,970.00	0.21
166	600118	中国卫星	69,400	1,542,762.00	0.21
167	600583	海油工程	260,000	1,536,600.00	0.21
168	002558	巨人网络	162,600	1,534,944.00	0.21
169	002152	广电运通	146,000	1,527,160.00	0.21
170	601156	东航物流	74,800	1,522,180.00	0.21
171	000591	太阳能	321,700	1,515,207.00	0.21
172	000623	吉林敖东	112,520	1,507,768.00	0.21
173	600970	中材国际	124,200	1,497,852.00	0.21
174	002025	航天电器	32,200	1,493,436.00	0.21
175	002385	大北农	386,800	1,489,180.00	0.20
176	300373	扬杰科技	38,200	1,485,980.00	0.20
177	002439	启明星辰	86,000	1,484,360.00	0.20
178	300144	宋城演艺	184,800	1,483,944.00	0.20
179	600380	健康元	131,900	1,473,323.00	0.20
180	601216	君正集团	397,100	1,465,299.00	0.20
181	000729	燕京啤酒	165,900	1,464,897.00	0.20
182	605358	立昂微	63,100	1,460,134.00	0.20
183	600143	金发科技	220,000	1,454,200.00	0.20
184	000723	美锦能源	305,200	1,452,752.00	0.20

185	300251	光线传媒	172,500	1,450,725.00	0.20
186	600998	九州通	296,376	1,446,314.88	0.20
187	600282	南钢股份	290,100	1,444,698.00	0.20
188	600637	东方明珠	237,200	1,442,176.00	0.20
189	000519	中兵红箭	98,200	1,440,594.00	0.20
190	300383	光环新网	169,200	1,429,740.00	0.20
191	600516	方大炭素	331,300	1,427,903.00	0.20
192	300677	英科医疗	53,240	1,427,364.40	0.20
193	000636	风华高科	109,000	1,423,540.00	0.20
194	600392	盛和资源	165,000	1,422,300.00	0.20
195	600763	通策医疗	26,300	1,421,515.00	0.20
196	300024	机器人	145,800	1,420,092.00	0.20
197	000818	航锦科技	63,800	1,408,704.00	0.19
198	002958	青农商行	522,700	1,400,836.00	0.19
199	601665	齐鲁银行	284,300	1,395,913.00	0.19
200	600909	华安证券	331,460	1,395,446.60	0.19
201	002044	美年健康	368,300	1,392,174.00	0.19
202	600008	首创环保	517,974	1,388,170.32	0.19
203	688213	思特威	28,543	1,384,335.50	0.19
204	000883	湖北能源	230,100	1,382,901.00	0.19
205	600511	国药股份	44,500	1,370,155.00	0.19
206	600566	济川药业	43,200	1,369,872.00	0.19
207	000629	钒钛股份	546,700	1,366,750.00	0.19
208	601016	节能风电	456,990	1,366,400.10	0.19
209	600867	通化东宝	163,200	1,365,984.00	0.19
210	300088	长信科技	288,800	1,357,360.00	0.19
211	601456	国联证券	140,600	1,355,384.00	0.19
212	000997	新大陆	97,000	1,349,270.00	0.19
213	600170	上海建工	627,200	1,348,480.00	0.19
214	600582	天地科技	194,745	1,341,793.05	0.18
215	600498	烽火通信	83,700	1,330,830.00	0.18
216	600129	太极集团	46,000	1,330,320.00	0.18
217	600499	科达制造	157,800	1,330,254.00	0.18
218	600535	天士力	105,600	1,328,448.00	0.18
219	601933	永辉超市	533,600	1,323,328.00	0.18
220	600004	白云机场	139,300	1,320,564.00	0.18
221	002120	韵达股份	170,600	1,320,444.00	0.18
222	000598	兴蓉环境	175,500	1,319,760.00	0.18
223	601991	大唐发电	437,500	1,316,875.00	0.18
224	600580	卧龙电驱	108,000	1,312,200.00	0.18
225	000750	国海证券	450,500	1,310,955.00	0.18
226	002261	拓维信息	117,900	1,305,153.00	0.18
227	000060	中金岭南	307,800	1,305,072.00	0.18
228	300567	精测电子	23,000	1,299,730.00	0.18
229	300118	东方日升	107,400	1,299,540.00	0.18
230	603000	人民网	64,970	1,298,750.30	0.18
231	300568	星源材质	158,100	1,296,420.00	0.18
232	002430	杭氧股份	57,883	1,287,896.75	0.18
233	002429	兆驰股份	266,100	1,279,941.00	0.18
234	603486	科沃斯	27,100	1,278,578.00	0.18

235	002939	长城证券	189,900	1,272,330.00	0.17
236	603658	安图生物	27,600	1,271,532.00	0.17
237	600166	福田汽车	564,689	1,270,550.25	0.17
238	603156	养元饮品	59,500	1,265,565.00	0.17
239	600325	华发股份	194,300	1,262,950.00	0.17
240	603228	景旺电子	39,480	1,255,464.00	0.17
241	600816	建元信托	463,000	1,254,730.00	0.17
242	601231	环旭电子	78,100	1,253,505.00	0.17
243	300765	新诺威	49,500	1,248,885.00	0.17
244	600673	东阳光	177,200	1,247,488.00	0.17
245	300487	蓝晓科技	29,700	1,240,272.00	0.17
246	000893	亚钾国际	76,600	1,237,856.00	0.17
247	603568	伟明环保	60,137	1,237,619.46	0.17
248	600754	锦江酒店	53,800	1,236,324.00	0.17
249	603927	中科软	68,300	1,235,547.00	0.17
250	002508	老板电器	55,800	1,233,180.00	0.17
251	300601	康泰生物	78,900	1,231,629.00	0.17
252	000027	深圳能源	167,980	1,226,254.00	0.17
253	601636	旗滨集团	189,200	1,220,340.00	0.17
254	002926	华西证券	185,140	1,220,072.60	0.17
255	600563	法拉电子	16,000	1,218,880.00	0.17
256	000998	隆平高科	123,800	1,216,954.00	0.17
257	603290	斯达半导	14,100	1,214,151.00	0.17
258	002624	完美世界	159,551	1,212,587.60	0.17
259	002497	雅化集团	135,600	1,209,552.00	0.17
260	603298	杭叉集团	61,580	1,209,431.20	0.17
261	300604	长川科技	44,400	1,206,348.00	0.17
262	600737	中粮糖业	125,700	1,205,463.00	0.17
263	002653	海思科	39,200	1,203,440.00	0.17
264	601866	中远海发	465,767	1,201,678.86	0.17
265	300253	卫宁健康	203,300	1,199,470.00	0.16
266	603077	和邦生物	726,940	1,199,451.00	0.16
267	688052	纳芯微	11,643	1,196,667.54	0.16
268	002299	圣农发展	87,700	1,196,228.00	0.16
269	002065	东华软件	263,900	1,192,828.00	0.16
270	002056	横店东磁	95,600	1,192,132.00	0.16
271	688385	复旦微电	37,954	1,190,996.52	0.16
272	002500	山西证券	253,390	1,190,933.00	0.16
273	600131	国网信通	70,500	1,189,335.00	0.16
274	688772	珠海冠宇	79,700	1,187,530.00	0.16
275	688002	睿创微纳	42,413	1,186,291.61	0.16
276	601958	金钼股份	113,900	1,185,699.00	0.16
277	002414	高德红外	200,900	1,183,301.00	0.16
278	600373	中文传媒	79,700	1,182,748.00	0.16
279	300390	天华新能	68,800	1,181,984.00	0.16
280	600655	豫园股份	229,100	1,179,865.00	0.16
281	300009	安科生物	138,048	1,178,929.92	0.16
282	300763	锦浪科技	28,200	1,174,248.00	0.16
283	603893	瑞芯微	19,800	1,171,566.00	0.16
284	002507	涪陵榨菜	94,880	1,162,280.00	0.16

285	002368	太极股份	51,418	1,159,475.90	0.16
286	002372	伟星新材	75,000	1,156,500.00	0.16
287	600707	彩虹股份	168,900	1,150,209.00	0.16
288	601611	中国核建	142,000	1,148,780.00	0.16
289	603885	吉祥航空	104,300	1,146,257.00	0.16
290	688114	华大智造	24,107	1,142,912.87	0.16
291	000887	中鼎股份	92,800	1,135,872.00	0.16
292	002203	海亮股份	141,100	1,125,978.00	0.15
293	603379	三美股份	28,760	1,125,666.40	0.15
294	002831	裕同科技	43,740	1,119,306.60	0.15
295	603225	新凤鸣	71,600	1,116,244.00	0.15
296	600755	厦门国贸	155,500	1,114,935.00	0.15
297	688521	芯原股份	41,329	1,105,550.75	0.15
298	688390	固德威	19,654	1,102,982.48	0.15
299	600859	王府井	93,400	1,096,516.00	0.15
300	601880	辽港股份	885,900	1,089,657.00	0.15
301	600995	南网储能	112,800	1,089,648.00	0.15
302	600801	华新水泥	79,100	1,087,625.00	0.15
303	600416	湘电股份	109,200	1,085,448.00	0.15
304	600329	达仁堂	33,500	1,085,065.00	0.15
305	600884	杉杉股份	132,900	1,079,148.00	0.15
306	002683	广东宏大	53,600	1,078,968.00	0.15
307	600390	五矿资本	264,600	1,071,630.00	0.15
308	300070	碧水源	255,755	1,071,613.45	0.15
309	300296	利亚德	238,000	1,071,000.00	0.15
310	002019	亿帆医药	86,566	1,069,955.76	0.15
311	002506	协鑫集成	550,600	1,068,164.00	0.15
312	600435	北方导航	123,500	1,064,570.00	0.15
313	002244	滨江集团	146,300	1,062,138.00	0.15
314	600739	辽宁成大	125,800	1,052,946.00	0.14
315	600483	福能股份	90,300	1,052,898.00	0.14
316	000050	深天马 A	144,600	1,052,688.00	0.14
317	601098	中南传媒	84,500	1,049,490.00	0.14
318	600598	北大荒	83,700	1,045,413.00	0.14
319	300803	指南针	28,700	1,044,967.00	0.14
320	600399	抚顺特钢	185,400	1,043,802.00	0.14
320	601598	中国外运	185,400	1,043,802.00	0.14
321	300748	金力永磁	80,500	1,043,280.00	0.14
322	002572	索菲亚	67,885	1,040,677.05	0.14
323	002568	百润股份	61,700	1,038,411.00	0.14
324	600901	江苏金租	205,600	1,038,280.00	0.14
325	002487	大金重工	45,100	1,031,888.00	0.14
326	000155	川能动力	95,700	1,030,689.00	0.14
327	600848	上海临港	112,700	1,026,697.00	0.14
328	300676	华大基因	29,200	1,022,292.00	0.14
329	002080	中材科技	79,100	1,020,390.00	0.14
330	002240	盛新锂能	76,000	1,019,920.00	0.14
331	001286	陕西能源	88,200	1,016,946.00	0.14
332	002373	千方科技	111,548	1,011,740.36	0.14
333	002936	郑州银行	582,380	1,007,517.40	0.14

334	002557	洽洽食品	35,713	1,006,749.47	0.14
335	300595	欧普康视	63,300	992,544.00	0.14
336	000563	陕国投 A	360,700	991,925.00	0.14
337	603712	七一二	54,500	991,355.00	0.14
338	002268	电科网安	69,500	988,985.00	0.14
339	600968	海油发展	239,100	985,092.00	0.14
340	601928	凤凰传媒	89,800	984,208.00	0.14
341	603858	步长制药	64,900	983,235.00	0.14
342	603883	老百姓	53,510	982,443.60	0.13
343	000778	新兴铸管	281,620	980,037.60	0.13
344	600258	首旅酒店	78,900	974,415.00	0.13
345	601212	白银有色	348,500	968,830.00	0.13
346	688538	和辉光电	489,075	968,368.50	0.13
347	688017	绿的谐波	11,780	967,138.00	0.13
348	600271	航天信息	130,700	961,952.00	0.13
349	300558	贝达药业	29,500	960,225.00	0.13
350	600062	华润双鹤	49,000	959,420.00	0.13
351	688301	奕瑞科技	8,305	956,985.15	0.13
352	600528	中铁工业	130,500	955,260.00	0.13
353	002531	天顺风能	105,700	944,958.00	0.13
354	600977	中国电影	87,800	944,728.00	0.13
355	601155	新城控股	106,500	944,655.00	0.13
356	000709	河钢股份	486,300	943,422.00	0.13
357	603688	石英股份	31,850	943,078.50	0.13
358	688234	天岳先进	20,041	940,323.72	0.13
359	002408	齐翔腾达	167,260	936,656.00	0.13
360	688005	容百科技	40,042	932,177.76	0.13
361	600959	江苏有线	352,930	931,735.20	0.13
362	000739	普洛药业	68,600	930,902.00	0.13
363	600378	昊华科技	32,100	927,690.00	0.13
364	601118	海南橡胶	201,400	916,370.00	0.13
365	688220	翱捷科技	24,383	913,387.18	0.13
366	000825	太钢不锈	269,000	909,220.00	0.12
367	603737	三棵树	24,800	899,496.00	0.12
368	603882	金域医学	33,000	897,270.00	0.12
369	688536	思瑞浦	9,161	896,037.41	0.12
370	688331	荣昌生物	20,706	894,499.20	0.12
371	603444	吉比特	5,000	890,050.00	0.12
372	600056	中国医药	87,920	889,750.40	0.12
373	600612	老凤祥	15,100	878,669.00	0.12
374	000987	越秀资本	177,050	878,168.00	0.12
375	601399	国机重装	339,400	875,652.00	0.12
376	600906	财达证券	152,600	874,398.00	0.12
377	600517	国网英大	201,800	873,794.00	0.12
378	601019	山东出版	73,800	872,316.00	0.12
379	603456	九洲药业	63,400	869,848.00	0.12
380	688200	华峰测控	9,379	860,523.25	0.12
381	300212	易华录	51,120	860,349.60	0.12
382	002266	浙富控股	307,100	856,809.00	0.12
383	600316	洪都航空	50,700	843,141.00	0.12

384	000937	冀中能源	124,600	834,820.00	0.11
385	603650	彤程新材	28,200	833,310.00	0.11
386	600871	石化油服	478,800	833,112.00	0.11
387	603529	爱玛科技	30,400	830,832.00	0.11
388	688567	孚能科技	86,123	826,780.80	0.11
389	600925	苏能股份	162,200	819,110.00	0.11
390	002423	中粮资本	108,500	812,665.00	0.11
391	000032	深桑达 A	53,600	802,928.00	0.11
392	603728	鸣志电器	19,900	800,577.00	0.11
393	601965	中国汽研	47,300	798,897.00	0.11
394	001227	兰州银行	334,700	796,586.00	0.11
395	688063	派能科技	20,034	795,550.14	0.11
396	600098	广州发展	123,600	791,040.00	0.11
397	600208	新湖中宝	500,400	790,632.00	0.11
398	601298	青岛港	82,500	788,700.00	0.11
399	688297	中无人机	23,576	778,715.28	0.11
400	601608	中信重工	204,150	777,811.50	0.11
401	002607	中公教育	507,700	776,781.00	0.11
402	002670	国盛金控	91,040	771,108.80	0.11
403	600663	陆家嘴	87,300	769,986.00	0.11
404	600022	山东钢铁	629,100	767,502.00	0.11
405	688561	奇安信	32,490	767,413.80	0.11
406	603233	大参林	53,620	766,766.00	0.11
407	600578	京能电力	236,200	765,288.00	0.11
408	688516	奥特维	18,231	762,238.11	0.10
409	300438	鹏辉能源	41,300	757,442.00	0.10
410	300357	我武生物	36,900	746,118.00	0.10
411	601106	中国一重	322,499	744,972.69	0.10
412	003031	中瓷电子	16,040	741,689.60	0.10
413	300776	帝尔激光	16,060	738,117.60	0.10
414	600500	中化国际	211,000	736,390.00	0.10
415	600377	宁沪高速	58,300	734,580.00	0.10
416	002865	钧达股份	18,900	725,382.00	0.10
417	600967	内蒙一机	100,000	720,000.00	0.10
418	000785	居然之家	295,600	718,308.00	0.10
419	600350	山东高速	79,800	706,230.00	0.10
420	600315	上海家化	39,600	704,088.00	0.10
421	300888	稳健医疗	27,640	699,292.00	0.10
422	600827	百联股份	94,300	695,934.00	0.10
423	000958	电投产融	190,100	695,766.00	0.10
424	688349	三一重能	28,002	695,569.68	0.10
425	000537	中绿电	72,900	694,737.00	0.10
426	000559	万向钱潮	155,400	693,084.00	0.10
427	601568	北元集团	186,700	692,657.00	0.10
428	688425	铁建重工	188,035	691,968.80	0.10
429	002608	江苏国信	88,900	688,975.00	0.09
430	000156	华数传媒	109,100	685,148.00	0.09
431	002690	美亚光电	41,426	683,529.00	0.09
432	603707	健友股份	57,087	678,193.56	0.09
433	002867	周大生	51,650	674,549.00	0.09

434	603826	坤彩科技	23,200	672,104.00	0.09
435	601992	金隅集团	490,300	671,711.00	0.09
436	603517	绝味食品	43,600	671,440.00	0.09
437	688029	南微医学	10,872	669,280.32	0.09
438	600126	杭钢股份	158,700	652,257.00	0.09
439	300682	朗新集团	76,400	650,164.00	0.09
440	688032	禾迈股份	5,638	647,129.64	0.09
441	003022	联泓新科	47,200	647,112.00	0.09
442	000967	盈峰环境	149,600	632,808.00	0.09
443	688475	萤石网络	18,334	625,372.74	0.09
444	603218	日月股份	60,600	622,362.00	0.09
445	600032	浙江新能	84,900	618,072.00	0.08
446	600481	双良节能	132,200	617,374.00	0.08
447	600361	创新新材	152,900	616,187.00	0.08
448	600339	中油工程	197,200	615,264.00	0.08
449	688778	厦钨新能	19,619	612,897.56	0.08
450	688520	神州细胞	15,559	612,246.65	0.08
451	301267	华夏眼科	29,500	611,240.00	0.08
452	603786	科博达	9,400	603,010.00	0.08
453	600095	湘财股份	100,700	600,172.00	0.08
454	000898	鞍钢股份	281,300	596,356.00	0.08
455	603127	昭衍新药	44,640	592,372.80	0.08
456	003035	南网能源	133,700	588,280.00	0.08
457	688248	南网科技	19,725	584,451.75	0.08
458	688281	华秦科技	6,885	573,658.20	0.08
459	600808	马钢股份	283,055	571,771.10	0.08
460	002153	石基信息	96,234	551,420.82	0.08
461	002563	森马服饰	94,900	551,369.00	0.08
462	603185	弘元绿能	31,900	545,171.00	0.07
463	601228	广州港	177,500	541,375.00	0.07
464	000539	粤电力 A	104,900	532,892.00	0.07
465	001872	招商港口	27,300	525,525.00	0.07
466	688779	长远锂科	113,411	525,092.93	0.07
467	600928	西安银行	156,800	512,736.00	0.07
468	001203	大中矿业	53,200	511,252.00	0.07
469	000401	冀东水泥	124,900	507,094.00	0.07
470	000959	首钢股份	183,200	498,304.00	0.07
471	600764	中国海防	25,100	492,713.00	0.07
472	688006	杭可科技	28,167	491,514.15	0.07
473	002518	科士达	27,600	488,520.00	0.07
474	603056	德邦股份	36,100	472,910.00	0.06
475	603305	旭升集团	43,700	461,472.00	0.06
476	600299	安迪苏	47,400	459,780.00	0.06
477	688172	燕东微	27,906	451,519.08	0.06
478	601139	深圳燃气	67,500	450,900.00	0.06
479	300861	美畅股份	22,500	435,375.00	0.06
480	603317	天味食品	37,445	427,247.45	0.06
481	688276	百克生物	14,407	408,726.59	0.06
482	688387	信科移动	80,558	406,012.32	0.06
483	301029	怡合达	20,380	400,670.80	0.06

484	688375	国博电子	5,639	398,338.96	0.05
485	002791	坚朗五金	15,300	395,811.00	0.05
486	600927	永安期货	34,200	381,330.00	0.05
487	688819	天能股份	15,855	378,300.30	0.05
488	688153	唯捷创芯	9,731	360,047.00	0.05
489	601858	中国科传	18,700	357,544.00	0.05
490	688107	安路科技	14,005	356,007.10	0.05
491	000031	大悦城	151,200	353,808.00	0.05
492	002600	领益智造	46,500	331,080.00	0.05
493	601828	美凯龙	127,300	324,615.00	0.04
494	601158	重庆水务	67,600	324,480.00	0.04
495	002945	华林证券	31,700	316,366.00	0.04
496	688348	昱能科技	5,282	311,638.00	0.04
497	600956	新天绿能	36,100	294,937.00	0.04
498	301165	锐捷网络	7,900	235,736.00	0.03
499	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
500	688295	中复神鹰	11,509	233,632.70	0.03
501	603868	飞科电器	5,600	215,040.00	0.03
502	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
503	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
504	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
505	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
506	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
507	601033	永兴股份	961	15,337.56	0.00
508	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
509	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
510	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
511	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
512	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
513	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
514	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
515	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
516	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
517	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
518	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
519	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
520	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
521	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
522	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
523	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
524	400174	中天 3	537,300	5,373.00	0.00
525	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
526	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
527	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
528	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
529	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
530	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
531	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
532	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
533	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00

534	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
535	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
536	300482	万孚生物	55	1,342.00	0.00
537	002985	北摩高科	58	1,277.74	0.00
538	300115	长盈精密	88	1,055.12	0.00
539	603638	艾迪精密	60	841.80	0.00
540	600372	中航机载	47	562.59	0.00
541	000807	云铝股份	30	405.30	0.00
542	600507	方大特钢	98	366.52	0.00
543	688072	拓荆科技	1	120.11	0.00
544	600195	中牧股份	3	22.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688777	中控技术	3,194,135.42	0.42
2	601567	三星医疗	2,792,505.00	0.37
3	688617	惠泰医疗	2,433,869.46	0.32
4	002202	金风科技	2,401,001.00	0.31
5	601615	明阳智能	2,250,084.00	0.29
6	603979	金诚信	2,242,113.00	0.29
7	002436	兴森科技	2,241,888.00	0.29
8	301358	湖南裕能	2,122,396.00	0.28
9	300002	神州泰岳	2,074,507.00	0.27
10	000921	海信家电	2,063,854.00	0.27
11	300054	鼎龙股份	2,024,197.00	0.27
12	688169	石头科技	2,009,146.18	0.26
13	603345	安井食品	1,965,856.00	0.26
14	600872	中炬高新	1,947,138.00	0.25
15	002984	森麒麟	1,802,459.00	0.24
16	688525	佰维存储	1,763,025.50	0.23
17	603179	新泉股份	1,706,103.00	0.22
18	603087	甘李药业	1,673,928.00	0.22
19	688065	凯赛生物	1,611,217.32	0.21
20	000818	航锦科技	1,584,868.00	0.21

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	5,617,723.00	0.74
2	002422	科伦药业	4,511,404.00	0.59
3	000975	银泰黄金	3,930,743.73	0.51
4	600160	巨化股份	3,864,672.00	0.51
5	300418	昆仑万维	3,450,786.00	0.45

6	600161	天坛生物	3,255,341.00	0.43
7	600415	小商品城	2,900,722.00	0.38
8	688072	拓荆科技	2,698,890.79	0.35
9	600482	中国动力	2,611,136.00	0.34
10	002600	领益智造	1,476,847.00	0.19
11	688169	石头科技	1,447,529.70	0.19
12	688728	格科微	1,370,167.77	0.18
13	002131	利欧股份	1,152,709.00	0.15
14	000581	威孚高科	1,047,328.00	0.14
15	002032	苏泊尔	1,015,270.60	0.13
16	000547	航天发展	986,369.98	0.13
17	601778	晶科科技	978,829.00	0.13
18	002092	ST 中泰	945,387.80	0.12
19	300026	红日药业	940,970.50	0.12
20	000970	中科三环	910,911.65	0.12

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	142,523,143.27
卖出股票的收入（成交）总额	112,591,278.51

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指

期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，重庆农村商业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局合川监管分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,381,337.02
2	应收清算款	1,389,900.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,771,237.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	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
2,273	53,363.44	4,437,303.00	3.66%	15,723,790.00	12.96%	101,134,005.00	83.38%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	孙雪理	1,266,376.00	1.04%
2	中银国际证券—中银理财—稳富固收增强(1年滚续)—中银证券—中银理财7号单一资产管理计划	1,000,000.00	0.82%
3	罗志中	990,000.00	0.82%
4	东方证券股份有限公司	883,000.00	0.73%
5	宋丹丹	571,700.00	0.47%
6	白巍	550,000.00	0.45%
7	广发证券股份有限公司	537,503.00	0.44%
8	招商证券股份有限公司	485,407.00	0.40%
9	方正证券股份有限公司	347,966.00	0.29%
10	中信证券股份有限公司	328,550.00	0.27%
-	招商银行股份有限公司—博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	101,134,005.00	83.38%

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

2. 前十名持有人为除博时中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年8月1日）基金份额总额	2,762,185,861.00
本报告期期初基金份额总额	117,695,098.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	121,295,098.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2024 年 4 月 13 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》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生任公司总经理。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	40,708,370.59	16.08%	30,363.66	19.51%	-
招商证券	3	64,388,863.63	25.44%	14,877.66	9.56%	-
中信证券	2	11,697,691.57	4.62%	8,725.71	5.61%	-
中泰证券	1	41,548.05	0.02%	31.00	0.02%	-
银河证券	1	301,374.25	0.12%	224.82	0.14%	-
中金公司	2	29,583,991.90	11.69%	22,068.15	14.18%	-
长江证券	2	106,402,485.70	42.04%	79,365.71	50.99%	-

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总额的比例

		额的比例		额的比例		
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时中证 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	2024-06-26
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-06
3	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	2024-05-25
4	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华宝证券为申购、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	2024-04-30
6	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京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	2024-04-29
7	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海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	2024-04-29
8	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增联储证券为申购、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	2024-04-22
9	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-22
10	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	2024-04-13
11	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-29
12	博时基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-02-28

13	博时基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-31
14	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024-01-22
15	关于指定博时基金管理有限公司旗下部分证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-05

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2024-01-01~2024-06-30	97,049,005.00	4,976,400.00	891,400.00	101,134,005.00	83.38%

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

- 注：1. 申购份额包含红利再投资份额。
2. 份额占比为四舍五入后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日