

博时标普 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：中国工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。

基金托管人中国工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 境外投资顾问和境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	8
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	9
§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内容的真实、准确和完整发表意见	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 净资产变动表	12
6.4 报表附注	14
§7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	28
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	28
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	29
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	70
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	70
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	70
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	71
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	71
7.11 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末上市基金前十名持有人	72
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72

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.....	72
§ 9 开放式基金份额变动	73
§ 10 重大事件揭示	73
10.1 基金份额持有人大会决议	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件	74
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	76
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.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 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	7,373,638,570.00 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	标普 500 指数（S&P500 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	北京市西城区复兴门内大街55号

	5999号基金大厦21层	
邮政编码	518040	100140
法定代表人	江向阳	廖林

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	90,546,402.05
本期利润	1,652,221,381.77
加权平均基金份额本期利润	0.2418
本期加权平均净值利润率	14.02%
本期基金份额净值增长率	15.30%
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	2,111,895,987.29
期末可供分配基金份额利润	0.2864
期末基金资产净值	13,553,165,059.47
期末基金份额净值	1.8381
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	267.62%

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	3.78%	0.40%	3.81%	0.40%	-0.03%	0.00%
过去三个月	4.43%	0.70%	4.64%	0.70%	-0.21%	0.00%
过去六个月	15.30%	0.67%	15.76%	0.67%	-0.46%	0.00%
过去一年	21.35%	0.69%	22.30%	0.69%	-0.95%	0.00%
过去三年	40.45%	1.08%	44.84%	1.08%	-4.39%	0.00%
自基金合同生效起至今	267.62%	1.11%	306.36%	1.11%	-38.74%	0.00%

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的

使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 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	2015-10-08	-	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—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 5 月 11 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日—至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 21 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 28 日—至今)、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—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 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 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

4.5 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

2024 年上半年, 美国通胀持续回落, 经济仍然稳健, 在龙头科技公司的带领下美股继续创下新高。从经济基本面上来看, 一季度 GDP 环比折合年率 1.4%, 二季度 GDP 环比折合年率初值 2.8%。7 月标普制造业 PMI 超预期萎缩, 但服务业 PMI 创新高。7 月密歇根大学消费者信心指数 66.4, 和预期及前值基本一致。整体来看, 美国经济依然具有韧性, 增长稳步放缓, 软着陆概率提升。通胀方面, 通胀和核心通胀持续下行, 核心 PCE 物价指数同比增速从 1 月的 2.9% 稳步下降至 6 月的 2.6%, 为 2021 年 3 月以来最低。货币政策方面, 上半年美联储暂停加息, 同时放缓了缩表进度。指数表现来看, 上半年标普 500 指数上涨 14.48%, 纳斯达克 100 指数上涨 16.98%, 均创下历史新高。

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。

4.5.2 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 1.8381 元，份额累计净值为 3.6762 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 15.30%，同期业绩基准增长率 15.76%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，美国经济软着陆概率提升。经济方面，消费仍具韧性，融资成本的下行将有助于总体投资小幅修复。通胀或将在三季度持续回落，为降息提供窗口。而降息传导的经济修复、四季度的大选和通胀翘尾都可能会给后续美联储的货币政策带来扰动。货币政策方面，从 CME 隐含利率预期看 9 月大概率将开始降息，同时 6 月美联储已经开始放缓缩表。整体来看，目前受到降息预期、大选预期、科技公司财报盈利指引等各种因素的干扰，市场会加大波动。投资者短期需警惕指数震荡回调风险。而长期在经济增长稳定、科技股盈利驱动上涨的背景下，美股仍具配置价值。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	832,430,062.83	222,479,180.32
结算备付金		95,089,536.46	33,441,207.37
存出保证金		46,040,168.51	7,336,288.99
交易性金融资产	6.4.3.2	12,620,551,129.19	8,292,020,064.36
其中：股票投资		12,620,551,129.19	8,292,020,064.36
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		178,586.83	-
应收股利		5,933,750.81	6,896,739.95
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		13,600,223,234.63	8,562,173,480.99
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		23,002,393.12	105,406,420.91
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,527,139.83	4,112,493.58
应付托管费		2,719,641.60	1,713,539.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,138,825.89	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	13,670,174.72	10,196,356.02
负债合计		47,058,175.16	121,428,809.51
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	3,686,819,284.54	2,647,319,284.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	9,866,345,774.93	5,793,425,387.38
净资产合计		13,553,165,059.47	8,440,744,671.48
负债和净资产总计		13,600,223,234.63	8,562,173,480.99

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8381 元，基金份额总额 7,373,638,570.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		1,705,740,212.79	1,156,426,443.61
1. 利息收入		9,104,034.86	204,094.08
其中：存款利息收入	6.4.3.10	9,104,034.86	204,094.08

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		133,430,906.77	103,797,422.24
其中：股票投资收益	6.4.3.11	11,619,592.67	33,524,442.85
基金投资收益	6.4.3.12	-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	50,616,521.49	24,605,489.70
股利收益	6.4.3.16	71,194,792.61	45,667,489.69
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）	6.4.3.17	1,561,674,979.72	1,086,506,993.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-41,290,241.39	-49,896,991.32
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	42,820,532.83	15,814,925.11
减：二、营业总支出		53,518,831.02	28,640,459.74
1. 管理人报酬		35,095,241.52	18,767,794.16
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		14,623,017.34	7,819,914.19
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	6.4.3.19	-	-
7. 税金及附加		182,368.81	65,549.48
8. 其他费用	6.4.3.20	3,618,203.35	1,987,201.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,652,221,381.77	1,127,785,983.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,652,221,381.77	1,127,785,983.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,652,221,381.77	1,127,785,983.87

6.3 净资产变动表

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：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	2,647,319,284.10	-	5,793,425,387.38	8,440,744,671.48
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,647,319,284.10	-	5,793,425,387.38	8,440,744,671.48
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,039,500,000.44	-	4,072,920,387.55	5,112,420,387.99
(一)、综合收益总额	-	-	1,652,221,381.77	1,652,221,381.77
(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)	1,039,500,000.44	-	2,420,699,005.78	3,460,199,006.22
其中：1. 基金申购款	1,046,500,000.43	-	2,435,840,802.96	3,482,340,803.39
2. 基金赎回款	-6,999,999.99	-	-15,141,797.18	-22,141,797.17
(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	3,686,819,284.54	-	9,866,345,774.93	13,553,165,059.47
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	3,701,319,285.07	-	5,658,092,983.30	9,359,412,268.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,701,319,285.07	-	5,658,092,983.30	9,359,412,268.37
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,328,500,000.52	-	-842,757,932.09	-2,171,257,932.61
(一)、综合收益总额	-	-	1,127,785,983.87	1,127,785,983.87
(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)	-1,328,500,000.52	-	-1,970,543,915.96	-3,299,043,916.48
其中：1. 基金申购款	375,499,999.56	-	648,874,766.75	1,024,374,766.31
2. 基金赎回款	-1,704,000,000.08	-	-2,619,418,682.71	-4,323,418,682.79
(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	2,372,819,284.55	-	4,815,335,051.21	7,188,154,335.76

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[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。

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	832,430,062.83
等于：本金	831,422,362.02
加：应计利息	1,007,700.81
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	832,430,062.83

注：于 2024 年 06 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 111,162,480.20 (折合人民币 792,232,763.89)。

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	9,548,098,060.53	-	12,620,551,129.19	3,072,453,068.66
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	9,548,098,060.53	-	12,620,551,129.19	3,072,453,068.66

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	937,957,898.56	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	937,957,898.56	-	-	-

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
ESU4	S&P500 EMINI FUT Sep24	474.00	932,609,840.94	-5,348,057.62
合计	-	-	-	-5,348,057.62
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-5,348,057.62
净额	-	-	-	-

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	107,410.94

其他应付款	13,562,763.78
合计	13,670,174.72

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	5,294,638,570.00	2,647,319,284.10
本期申购	2,093,000,000.00	1,046,500,000.43
本期赎回（以“-”号填列）	-14,000,000.00	-6,999,999.99
本期末	7,373,638,570.00	3,686,819,284.54

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	1,449,094,457.96	4,344,330,929.42	5,793,425,387.38
本期期初	1,449,094,457.96	4,344,330,929.42	5,793,425,387.38
本期利润	90,546,402.05	1,561,674,979.72	1,652,221,381.77
本期基金份额交易产生的变动数	572,255,127.28	1,848,443,878.50	2,420,699,005.78
其中：基金申购款	576,093,098.52	1,859,747,704.44	2,435,840,802.96
基金赎回款	-3,837,971.24	-11,303,825.94	-15,141,797.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,111,895,987.29	7,754,449,787.64	9,866,345,774.93

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	9,103,254.81
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	780.05	
其他	-	
合计	9,104,034.86	

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	卖出股票成交总额	107,299,587.35
减：卖出股票成本总额	94,985,028.48	
减：交易费用	694,966.20	
买卖股票差价收入	11,619,592.67	

6.4.3.12 基金投资收益

无发生额。

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.3.14 资产支持证券投资收益

6.4.3.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.14.2 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。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
期货投资收益	52,136,603.47
减：增值税抵减	-1,520,081.98
合计	50,616,521.49

6.4.3.16 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	71,194,792.61
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	71,194,792.61

6.4.3.17 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	1,570,821,985.14
——股票投资	1,570,821,985.14
——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	-9,147,005.42
——权证投资	-
——期货投资	-9,147,005.42

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, 561, 674, 979. 72

6.4.3.18 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	42, 820, 532. 83
合计	42, 820, 532. 83

6.4.3.19 信用减值损失

无发生额。

6.4.3.20 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	47, 738. 60
信息披露费	59, 672. 34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1, 156. 63
指数使用费	3, 509, 635. 78
合计	3, 618, 203. 35

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“标普 500ETF 联接基金”)	基金管理人管理的其他基金
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	35,095,241.52	18,767,794.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,448.70	-
应支付基金管理人的净管理费	35,082,792.82	18,767,794.16

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。

由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

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	14,623,017.34	7,819,914.19

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。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	3,985,101,660.00	54.05%	2,306,633,060.00	43.57%
招商证券	2,118,145.00	0.03%	3,302,013.00	0.06%

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
中国工商银行	758,311,066.31	9,103,254.81	239,488,896.71	203,522.17
布朗兄弟哈里 曼银行	74,118,996.52	-	74,711,855.23	-

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

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

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 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 指数成份股，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，将风险控制在此可承受的范围内。

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。

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。

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	758,311,066.31	-	-	74,118,996.52	832,430,062.83
结算备付金	-	-	-	95,089,536.46	95,089,536.46
存出保证金	-	-	-	46,040,168.51	46,040,168.51
交易性金融资产	-	-	-	12,620,551,129.19	12,620,551,129.19
应收清算款	-	-	-	178,586.83	178,586.83
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	5,933,750.81	5,933,750.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	758,311,066.31	-	-	12,841,912,168.32	13,600,223,234.63
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	23,002,393.12	23,002,393.12
应付管理人报酬	-	-	-	6,527,139.83	6,527,139.83
应付托管费	-	-	-	2,719,641.60	2,719,641.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,138,825.89	1,138,825.89
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	13,670,174.72	13,670,174.72
负债总计	-	-	-	47,058,175.16	47,058,175.16
利率敏感度缺口	758,311,066.31	-	-	12,794,853,993.16	13,553,165,059.47
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	208,528,732.97	-	-	13,950,447.35	222,479,180.32
结算备付金	-	-	-	33,441,207.37	33,441,207.37
存出保证金	-	-	-	7,336,288.99	7,336,288.99
交易性金融资产	-	-	-	8,292,020,064.36	8,292,020,064.36
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	6,896,739.95	6,896,739.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	208,528,732.97	-	-	8,353,644,748.02	8,562,173,480.99
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	105,406,420.91	105,406,420.91
应付管理人报酬	-	-	-	4,112,493.58	4,112,493.58
应付托管费	-	-	-	1,713,539.00	1,713,539.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	10,196,356.02	10,196,356.02
负债总计	-	-	-	121,428,809.51	121,428,809.51
利率敏感度缺口	208,528,732.97	0.00	0.00	8,232,215,938.51	8,440,744,671.48

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。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	792,232,763.89	792,232,763.89
结算备付金	95,089,536.46	95,089,536.46
存出保证金	46,040,168.51	46,040,168.51
交易性金融资产	12,620,551,129.19	12,620,551,129.19
应收股利	5,933,750.81	5,933,750.81
应收证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-
资产合计	13,559,847,348.86	13,559,847,348.86
以外币计价的负债		
应付赎回款	-	-
应付证券清算款	23,002,393.12	23,002,393.12
应付利息	-	-
其他负债	13,562,763.78	13,562,763.78

负债合计	36,565,156.90	36,565,156.90
资产负债表外汇风险敞口净额	13,523,282,191.96	13,523,282,191.96
项目	上年度末 2023年12月31日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	84,831,569.45	84,831,569.45
结算备付金	33,441,207.37	33,441,207.37
存出保证金	7,336,288.99	7,336,288.99
交易性金融资产	8,292,020,064.36	8,292,020,064.36
应收股利	6,896,739.95	6,896,739.95
应收证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-
资产合计	8,424,525,870.12	8,424,525,870.12
以外币计价的负债		
应付赎回款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付利息	-	-
其他负债	9,980,356.02	9,980,356.02
负债合计	9,980,356.02	9,980,356.02
资产负债表外汇风险敞口净额	8,414,545,514.10	8,414,545,514.10

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 67,616	增加约 42,073
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 67,616	减少约 42,073

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

项目	金额单位：人民币元			
	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	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	12,620,551,129.19	93.12	8,292,020,064.36	98.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,620,551,129.19	93.12	8,292,020,064.36	98.24

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除标普 500 净总收益指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 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 62,192	增加约 43,957
	业绩比较基准下降 5%	减少约 62,192	减少约 43,957

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	12,620,551,129.19
第二层次	-
第三层次	-
合计	12,620,551,129.19

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	12,620,551,129.19	92.80
	其中：普通股	12,362,893,898.22	90.90
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	257,657,230.97	1.89
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	927,519,599.29	6.82
8	其他各项资产	52,152,506.15	0.38
9	合计	13,600,223,234.63	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	12,620,551,129.19	93.12
合计	12,620,551,129.19	93.12

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
能源	463,527,107.20	3.42
公用事业	287,282,831.29	2.12
房地产	273,492,099.41	2.02
原材料	273,704,750.31	2.02
工业	951,323,325.79	7.02
非日常生活消费品	1,264,430,011.41	9.33
日常消费品	732,662,737.15	5.41
医疗保健	1,488,918,889.71	10.99
金融	1,576,962,807.40	11.64
信息技术	4,121,447,758.96	30.41
电信业务	1,186,798,810.56	8.76
合计	12,620,551,129.19	93.12

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	MICROSOFT CORP	MICROSOFT CORP	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	288,960.00	920,431,009.21	6.79
2	NVIDIA CORP	NVIDIA CORP	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	956,358.00	842,020,496.90	6.21
3	APPLE INC	APPLE INC	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	560,403.00	841,191,026.75	6.21
4	ALPHABET INC	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	228,375.00	296,464,234.34	2.19
4	ALPHABET INC	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	189,993.00	248,358,404.26	1.83
5	AMAZON.COM INC	AMAZON.COM INC	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	356,047.00	490,367,190.54	3.62
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	纳斯达克交易所	美国	85,201.00	306,167,671.65	2.26

				交易 所				
7	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	纽约 证券 交易 所	美国	70,385.00	204,058,941.96	1.51
8	ELI LILLY & CO	ELI LILLY & CO	LLY US	纽约 证券 交易 所	美国	31,038.00	200,271,521.27	1.48
9	BROADCOM INC	BROADCOM INC	AVGO US	纳斯 达克 交易 所	美国	16,936.00	193,786,643.83	1.43
10	JPMORGAN CHASE & CO	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	纽约 证券 交易 所	美国	111,647.00	160,935,417.92	1.19
11	TESLA INC	TESLA INC	TSLA US	纳斯 达克 交易 所	美国	107,873.00	152,128,025.97	1.12
12	EXXON MOBIL CORP	EXXON MOBIL CORP	XOM US	纽约 证券 交易 所	美国	174,408.00	143,090,813.97	1.06
13	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	纽约 证券 交易 所	美国	35,783.00	129,870,611.51	0.96
14	VISA INC-CLASS A SHARES	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	纽约 证券 交易 所	美国	61,201.00	114,480,827.77	0.84
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	纽约 证券 交易 所	美国	91,759.00	107,849,110.95	0.80
16	COSTCO WHOLESALE CORP	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	纳斯 达克 交易 所	美国	17,242.00	104,447,013.96	0.77
17	MASTERCARD INC - A	MASTERCARD INC - A	MA US	纽约 证券 交易 所	美国	31,919.00	100,355,222.03	0.74
18	JOHNSON & JOHNSON	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	纽约 证券 交易 所	美国	93,569.00	97,466,437.79	0.72

19	HOME DEPOT INC	HOME DEPOT INC	HD US	纽约 证券 交易 所	美国	38,530.00	94,526,790.72	0.70
20	MERCK & CO. INC.	MERCK & CO. INC.	MRK US	纽约 证券 交易 所	美国	98,472.00	86,881,632.90	0.64
21	ABBVIE INC	ABBVIE INC	ABBV US	纽约 证券 交易 所	美国	68,655.00	83,923,098.67	0.62
22	NETFLIX INC	NETFLIX INC	NFLX US	纳斯 达克 交易 所	美国	16,752.00	80,572,677.10	0.59
23	WALMART INC	WALMART INC	WMT US	纽约 证券 交易 所	美国	166,078.00	80,141,873.59	0.59
24	BANK OF AMERICA CORP	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	纽约 证券 交易 所	美国	264,521.00	74,973,937.21	0.55
25	CHEVRON CORP	CHEVRON CORP	CVX US	纽约 证券 交易 所	美国	66,636.00	74,284,084.00	0.55
26	ADVANCED MICRO DEVICES	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	纳斯 达克 交易 所	美国	62,840.00	72,645,442.25	0.54
27	SALESFORCE.COM INC	SALESFORCE.COM INC	CRM US	纽约 证券 交易 所	美国	37,761.00	69,189,490.87	0.51
28	ADOBE INC	ADOBE INC	ADBE US	纳斯 达克 交易 所	美国	17,417.00	68,957,777.79	0.51
29	COCA-COLA CO/THE	COCA-COLA CO/THE	KO US	纽约 证券 交易 所	美国	150,740.00	68,378,802.41	0.50
30	PEPSICO INC	PEPSICO INC	PEP US	纳斯 达克 交易 所	美国	53,450.00	62,826,365.98	0.46
31	ORACLE CORP	ORACLE CORP	ORCL US	纽约 证券 交易 所	美国	61,978.00	62,368,719.23	0.46

				交易所				
32	QUALCOMM INC	QUALCOMM INC	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	43,466.00	61,700,683.50	0.46
33	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	TMO US	纽约证券交易所	美国	14,840.00	58,486,226.74	0.43
34	LINDE PLC	LINDE PLC	LIN US	纳斯达克交易所	美国	18,689.00	58,446,317.30	0.43
35	WELLS FARGO & CO	WELLS FARGO & CO	WFC US	纽约证券交易所	美国	135,544.00	57,370,441.81	0.42
36	APPLIED MATERIALS INC	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	纳斯达克交易所	美国	32,304.00	54,330,596.50	0.40
37	CISCO SYSTEMS INC	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	纳斯达克交易所	美国	157,428.00	53,304,218.42	0.39
38	ACCENTURE PLC-CL A	ACCENTURE PLC-CL A	ACN US	纽约证券交易所	美国	24,444.00	52,856,297.33	0.39
39	INTUIT INC	INTUIT INC	INTU US	纳斯达克交易所	美国	10,885.00	50,983,209.02	0.38
40	MCDONALD'S CORP	MCDONALD'S CORP	MCD US	纽约证券交易所	美国	28,019.00	50,887,931.62	0.38
41	WALT DISNEY CO/THE	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	纽约证券交易所	美国	70,878.00	50,154,688.38	0.37
42	ABBOTT LABORATORIES	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	纽约证券交易所	美国	67,635.00	50,086,814.37	0.37
43	TEXAS INSTRUMENTS INC	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	纳斯达克交易所	美国	35,398.00	49,074,951.95	0.36

44	GENERAL ELECTRIC CO	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	纽约 证券 交易 所	美国	42,557.00	48,214,842.33	0.36
45	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	纽约 证券 交易 所	美国	163,651.00	48,098,539.73	0.35
46	AMGEN INC	AMGEN INC	AMGN US	纳斯 达克 交易 所	美国	20,856.00	46,441,487.17	0.34
47	DANAHER CORP	DANAHER CORP	DHR US	纽约 证券 交易 所	美国	25,629.00	45,635,791.39	0.34
48	CATERPILLAR INC	CATERPILLAR INC	CAT US	纽约 证券 交易 所	美国	19,013.00	45,135,665.70	0.33
49	SERVICENOW INC	SERVICENOW INC	NOW US	纽约 证券 交易 所	美国	7,970.00	44,683,324.86	0.33
50	INTL BUSINESS MACHINES CORP	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	纽约 证券 交易 所	美国	35,714.00	44,020,364.26	0.32
51	PFIZER INC	PFIZER INC	PFE US	纽约 证券 交易 所	美国	220,311.00	43,931,745.93	0.32
52	INTUITIVE SURGICAL INC	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	纳斯 达克 交易 所	美国	13,790.00	43,719,222.75	0.32
53	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	纽约 证券 交易 所	美国	60,439.00	43,646,546.28	0.32
54	COMCAST CORP-CLASS A	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	纳斯 达克 交易 所	美国	152,179.00	42,470,950.48	0.31
55	UBER TECHNOLOGIES INC	UBER TECHNOLOGIES INC	UBER US	纽约 证券 交易 所	美国	81,238.00	42,079,319.99	0.31
56	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	纽约 证券	美国	12,537.00	40,414,200.18	0.30

				交易 所				
57	MICRON TECHNOLOGY INC	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	纳斯 达克 交易 所	美国	43,053.00	40,357,365.74	0.30
58	NEXTERA ENERGY INC	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	纽约 证券 交易 所	美国	79,878.00	40,310,329.50	0.30
59	S&P GLOBAL INC	S&P GLOBAL INC	SPGI US	纽约 证券 交易 所	美国	12,445.00	39,557,089.60	0.29
60	LAM RESEARCH CORP	LAM RESEARCH CORP	LRCX US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,083.00	38,574,749.66	0.28
61	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	纳斯 达克 交易 所	美国	25,317.00	38,528,850.43	0.28
62	UNION PACIFIC CORP	UNION PACIFIC CORP	UNP US	纽约 证券 交易 所	美国	23,720.00	38,248,731.70	0.28
63	AT&T INC	AT&T INC	T US	纽约 证券 交易 所	美国	278,768.00	37,966,291.48	0.28
64	BOOKING HOLDINGS INC	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	纳斯 达克 交易 所	美国	1,319.00	37,239,087.21	0.27
65	CONOCOPHILLIPS	CONOCOPHILLIPS	COP US	纽约 证券 交易 所	美国	45,470.00	37,065,479.07	0.27
66	INTEL CORP	INTEL CORP	INTC US	纳斯 达克 交易 所	美国	165,507.00	36,530,207.86	0.27
67	AMERICAN EXPRESS CO	AMERICAN EXPRESS CO	AXP US	纽约 证券 交易 所	美国	22,092.00	36,456,451.25	0.27
68	LOWE'S COS INC	LOWE'S COS INC	LOW US	纽约 证券 交易 所	美国	22,246.00	34,952,344.10	0.26

69	ELEVANCE HEALTH INC	ELEVANCE HEALTH INC	ELV US	纽约 证券 交易 所	美国	9,036.00	34,894,572.83	0.26
70	EATON CORP PLC	EATON CORP PLC	ETN US	纽约 证券 交易 所	美国	15,543.00	34,732,514.32	0.26
71	TJX COMPANIES INC	TJX COMPANIES INC	TJX US	纽约 证券 交易 所	美国	44,030.00	34,548,609.74	0.25
72	PROGRESSIVE CORP	PROGRESSIVE CORP	PGR US	纽约 证券 交易 所	美国	22,771.00	33,708,085.00	0.25
73	MORGAN STANLEY	MORGAN STANLEY	MS US	纽约 证券 交易 所	美国	48,652.00	33,698,987.42	0.25
74	CITIGROUP INC	CITIGROUP INC	C US	纽约 证券 交易 所	美国	74,159.00	33,539,648.28	0.25
75	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX US	纳斯 达克 交易 所	美国	10,032.00	33,511,632.12	0.25
76	STRYKER CORP	STRYKER CORP	SYK US	纽约 证券 交易 所	美国	13,181.00	31,962,523.86	0.24
77	BOSTON SCIENTIFIC CORP	BOSTON SCIENTIFIC CORP	BSX US	纽约 证券 交易 所	美国	57,159.00	31,370,852.22	0.23
78	ANALOG DEVICES INC	ANALOG DEVICES INC	ADI US	纳斯 达克 交易 所	美国	19,280.00	31,363,997.74	0.23
79	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,123.00	30,883,251.53	0.23
80	KLA CORP	KLA CORP	KLAC US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,234.00	30,755,600.92	0.23
81	SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHW US	纽约 证券 交易 所	美国	58,043.00	30,482,668.21	0.22

				交易 所				
82	BLACKROCK INC	BLACKROCK INC	BLK US	纽约 证券 交易 所	美国	5,430.00	30,468,121.92	0.22
83	PALO ALTO NETWORKS INC	PALO ALTO NETWORKS INC	PANW US	纳斯 达克 交易 所	美国	12,561.00	30,348,085.29	0.22
84	BOEING CO/THE	BOEING CO/THE	BA US	纽约 证券 交易 所	美国	22,435.00	29,101,534.85	0.21
85	MEDTRONIC PLC	MEDTRONIC PLC	MDT US	纽约 证券 交易 所	美国	51,624.00	28,958,504.90	0.21
86	PROLOGIS INC	PROLOGIS INC	PLD US	纽约 证券 交易 所	美国	35,995.00	28,810,790.63	0.21
87	MARSH & MCLENNAN COS	MARSH & MCLENNAN COS	MMC US	纽约 证券 交易 所	美国	19,156.00	28,767,701.07	0.21
88	CHUBB LTD	CHUBB LTD	CB US	纽约 证券 交易 所	美国	15,787.00	28,699,252.72	0.21
89	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	UPS US	纽约 证券 交易 所	美国	28,358.00	27,657,630.56	0.20
90	AUTOMATIC DATA PROCESSING	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	纳斯 达克 交易 所	美国	15,912.00	27,067,837.83	0.20
91	DEERE & CO	DEERE & CO	DE US	纽约 证券 交易 所	美国	10,064.00	26,798,281.16	0.20
92	THE CIGNA GROUP	THE CIGNA GROUP	CI US	纽约 证券 交易 所	美国	11,044.00	26,018,628.91	0.19
93	NIKE INC -CL B	NIKE INC -CL B	NKE US	纽约 证券 交易 所	美国	47,100.00	25,299,619.74	0.19

94	T-MOBILE US INC	T-MOBILE US INC	TMUS US	纳斯达克 交易所	美国	20,046.00	25,169,750.06	0.19
95	AMERICAN TOWER CORP	AMERICAN TOWER CORP	AMT US	纽约 证券 交易所	美国	18,155.00	25,150,255.56	0.19
96	SYNOPSYS INC	SYNOPSYS INC	SNPS US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,930.00	25,148,380.50	0.19
97	ARISTA NETWORKS INC	ARISTA NETWORKS INC	ANET US	纽约 证券 交易 所	美国	9,868.00	24,648,298.93	0.18
98	BLACKSTONE INC	BLACKSTONE INC	BX US	纽约 证券 交易 所	美国	27,784.00	24,513,763.19	0.18
99	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	纳斯 达克 交易 所	美国	8,968.00	24,490,877.04	0.18
100	STARBUCKS CORP	STARBUCKS CORP	SBUX US	纳斯 达克 交易 所	美国	44,038.00	24,433,223.93	0.18
101	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	纳斯 达克 交易 所	美国	52,150.00	24,321,601.85	0.18
102	FISERV INC	FISERV INC	FI US	纽约 证券 交易 所	美国	22,748.00	24,162,431.33	0.18
103	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG US	纽约 证券 交易 所	美国	53,394.00	23,840,101.70	0.18
104	GILEAD SCIENCES INC	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	纳斯 达克 交易 所	美国	48,437.00	23,684,227.68	0.17
105	SOUTHERN CO/THE	SOUTHERN CO/THE	SO US	纽约 证券 交易 所	美国	42,511.00	23,501,180.81	0.17
106	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	纽约 证券 交易 所	美国	78,811.00	23,326,164.85	0.17

				交易 所				
107	CADENCE DESIGN SYS INC	CADENCE DESIGN SYS INC	CDNS US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	10,580.00	23,204,825.17	0.17
108	AMPHENOL CORP-CL A	AMPHENOL CORP-CL A	APH US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	46,701.00	22,422,668.63	0.17
109	COLGATE-PALMOLIVE CO	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	31,897.00	22,059,476.28	0.16
110	ZOETIS INC	ZOETIS INC	ZTS US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	17,740.00	21,917,806.33	0.16
111	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	ICE US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	22,300.00	21,755,604.64	0.16
112	ALTRIA GROUP INC	ALTRIA GROUP INC	MO US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	66,779.00	21,678,182.29	0.16
113	WASTE MANAGEMENT INC	WASTE MANAGEMENT INC	WM US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	14,190.00	21,574,923.16	0.16
114	DUKE ENERGY CORP	DUKE ENERGY CORP	DUK US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	30,005.00	21,433,146.52	0.16
115	MCKESSON CORP	MCKESSON CORP	MCK US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,053.00	21,032,285.18	0.16
116	TRANE TECHNOLOGIES PLC	TRANE TECHNOLOGIES PLC	TT US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	8,800.00	20,629,121.25	0.15
117	CVS HEALTH CORP	CVS HEALTH CORP	CVS US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	48,807.00	20,543,296.19	0.15
118	EOG RESOURCES INC	EOG RESOURCES INC	EOG US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	22,344.00	20,043,692.26	0.15

119	EQUINIX INC	EQUINIX INC	EQIX US	纳斯达克交易所	美国	3,689.00	19,891,592.95	0.15
120	TRANSDIGM GROUP INC	TRANSDIGM GROUP INC	TDG US	纽约证券交易所	美国	2,175.00	19,803,964.31	0.15
121	CME GROUP INC	CME GROUP INC	CME US	纳斯达克交易所	美国	13,998.00	19,613,002.06	0.14
122	KKR & CO INC	KKR & CO INC	KKR US	纽约证券交易所	美国	25,875.00	19,406,882.18	0.14
123	FREEMPORT-MCMORAN INC	FREEMPORT-MCMORAN INC	FCX US	纽约证券交易所	美国	55,849.00	19,343,998.15	0.14
124	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	SHW US	纽约证券交易所	美国	9,069.00	19,288,411.03	0.14
125	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI US	纳斯达克交易所	美国	9,940.00	19,062,441.08	0.14
126	TARGET CORP	TARGET CORP	TGT US	纽约证券交易所	美国	17,986.00	18,976,155.78	0.14
127	FEDEX CORP	FEDEX CORP	FDX US	纽约证券交易所	美国	8,801.00	18,806,854.37	0.14
128	BECTON DICKINSON AND CO	BECTON DICKINSON AND CO	BDX US	纽约证券交易所	美国	11,236.00	18,714,731.35	0.14
129	SCHLUMBERGER LTD	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	纽约证券交易所	美国	55,571.00	18,685,327.74	0.14
130	AIRBNB INC-CLASS A	AIRBNB INC-CLASS A	ABNB US	纳斯达克交易所	美国	17,165.00	18,549,128.68	0.14
131	MOODY'S CORP	MOODY'S CORP	MCO US	纽约证券交易所	美国	6,105.00	18,314,291.36	0.14

				交易 所				
132	GENERAL DYNAMICS CORP	GENERAL DYNAMICS CORP	GD US	纽约 证券 交易 所	美国	8,839.00	18,277,016.84	0.13
133	CSX CORP	CSX CORP	CSX US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	76,005.00	18,118,942.92	0.13
134	PARKER HANNIFIN CORP	PARKER HANNIFIN CORP	PH US	纽约 证券 交易 所	美国	4,997.00	18,013,219.12	0.13
135	MOTOROLA SOLUTIONS INC	MOTOROLA SOLUTIONS INC	MSI US	纽约 证券 交易 所	美国	6,484.00	17,839,436.59	0.13
136	ILLINOIS TOOL WORKS	ILLINOIS TOOL WORKS	ITW US	纽约 证券 交易 所	美国	10,557.00	17,828,308.24	0.13
137	AON PLC-CLASS A	AON PLC-CLASS A	AON US	纽约 证券 交易 所	美国	8,453.00	17,686,093.08	0.13
138	CONSTELLATION ENERGY	CONSTELLATION ENERGY	CEG US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	12,256.00	17,492,795.60	0.13
139	EMERSON ELECTRIC CO	EMERSON ELECTRIC CO	EMR US	纽约 证券 交易 所	美国	22,242.00	17,461,933.70	0.13
140	WELLTOWER INC	WELLTOWER INC	WELL US	纽约 证券 交易 所	美国	23,246.00	17,271,055.05	0.13
141	HCA HEALTHCARE INC	HCA HEALTHCARE INC	HCA US	纽约 证券 交易 所	美国	7,535.00	17,252,876.72	0.13
142	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	2,289.00	17,227,765.73	0.13
143	US BANCORP	US BANCORP	USB US	纽约 证券 交易 所	美国	60,669.00	17,165,320.42	0.13

144	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC US	纽约证券交易所	美国	15,470.00	17,141,918.15	0.13
145	MARATHON PETROLEUM CORP	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	纽约证券交易所	美国	13,698.00	16,935,621.80	0.12
146	PAYPAL HOLDINGS INC	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	40,669.00	16,819,405.29	0.12
147	ECOLAB INC	ECOLAB INC	ECL US	纽约证券交易所	美国	9,881.00	16,759,938.77	0.12
148	CINTAS CORP	CINTAS CORP	CTAS US	纳斯达克交易所	美国	3,353.00	16,733,525.28	0.12
149	ROPER TECHNOLOGIES INC	ROPER TECHNOLOGIES INC	ROP US	纳斯达克交易所	美国	4,161.00	16,715,120.18	0.12
150	PHILLIPS 66	PHILLIPS 66	PSX US	纽约证券交易所	美国	16,482.00	16,582,381.25	0.12
151	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MAR US	纳斯达克交易所	美国	9,327.00	16,070,854.11	0.12
152	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	APD US	纽约证券交易所	美国	8,643.00	15,895,088.41	0.12
153	ARTHUR J GALLAGHER & CO	ARTHUR J GALLAGHER & CO	AJG US	纽约证券交易所	美国	8,495.00	15,699,189.07	0.12
154	3M CO	3M CO	MMM US	纽约证券交易所	美国	21,514.00	15,668,381.41	0.12
155	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EW US	纽约证券交易所	美国	23,428.00	15,422,711.34	0.11
156	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	HLT US	纽约证券交易所	美国	9,721.00	15,116,813.69	0.11

				交易所				
157	PACCAR INC	PACCAR INC	PCAR US	纳斯达克交易所	美国	20,378.00	14,949,969.04	0.11
158	GENERAL MOTORS CO	GENERAL MOTORS CO	GM US	纽约证券交易所	美国	44,359.00	14,687,758.53	0.11
159	AUTODESK INC	AUTODESK INC	ADSK US	纳斯达克交易所	美国	8,316.00	14,665,487.70	0.11
160	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	COF US	纽约证券交易所	美国	14,855.00	14,657,509.61	0.11
161	CARRIER GLOBAL CORP	CARRIER GLOBAL CORP	CARR US	纽约证券交易所	美国	32,578.00	14,645,718.25	0.11
162	TRUIST FINANCIAL CORP	TRUIST FINANCIAL CORP	TFC US	纽约证券交易所	美国	52,023.00	14,403,929.51	0.11
163	WILLIAMS COS INC	WILLIAMS COS INC	WMB US	纽约证券交易所	美国	47,383.00	14,351,789.49	0.11
164	AUTOZONE INC	AUTOZONE INC	AZO US	纽约证券交易所	美国	673.00	14,216,820.72	0.10
165	VALERO ENERGY CORP	VALERO ENERGY CORP	VLO US	纽约证券交易所	美国	12,713.00	14,202,927.60	0.10
166	SIMON PROPERTY GROUP INC	SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG US	纽约证券交易所	美国	12,672.00	13,709,180.90	0.10
167	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	MCHP US	纳斯达克交易所	美国	21,009.00	13,700,015.12	0.10
168	DIGITAL REALTY TRUST INC	DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR US	纽约证券交易所	美国	12,616.00	13,671,075.32	0.10

169	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	纽约证券交易所	美国	25,802.00	13,651,673.89	0.10
170	FORD MOTOR CO	FORD MOTOR CO	F US	纽约证券交易所	美国	152,463.00	13,625,629.29	0.10
171	ROSS STORES INC	ROSS STORES INC	ROST US	纳斯达克交易所	美国	13,036.00	13,500,949.48	0.10
172	NORFOLK SOUTHERN CORP	NORFOLK SOUTHERN CORP	NSC US	纽约证券交易所	美国	8,783.00	13,438,452.79	0.10
173	NEWMONT CORP	NEWMONT CORP	NEM US	纽约证券交易所	美国	44,832.00	13,377,829.17	0.10
174	SEMPRA	SEMPRA	SRE US	纽约证券交易所	美国	24,604.00	13,336,952.69	0.10
175	ONEOK INC	ONEOK INC	OKE US	纽约证券交易所	美国	22,691.00	13,187,794.54	0.10
176	COPART INC	COPART INC	CPRT US	纳斯达克交易所	美国	34,016.00	13,129,750.39	0.10
177	GE VERNOVA INC	GE VERNOVA INC	GEV US	纽约证券交易所	美国	10,656.00	13,025,014.94	0.10
178	TRAVELERS COS INC/THE	TRAVELERS COS INC/THE	TRV US	纽约证券交易所	美国	8,903.00	12,901,902.75	0.10
179	KIMBERLY-CLARK CORP	KIMBERLY-CLARK CORP	KMB US	纽约证券交易所	美国	13,090.00	12,892,652.02	0.10
180	AMERICAN ELECTRIC POWER	AMERICAN ELECTRIC POWER	AEP US	纳斯达克交易所	美国	20,493.00	12,814,384.22	0.09
181	AFLAC INC	AFLAC INC	AFL US	纽约证券交易所	美国	20,103.00	12,795,449.09	0.09

				交易 所				
182	TE CONNECTIVITY LTD	TE CONNECTIVITY LTD	TEL US	纽约 证券 交易 所	美国	11,905.00	12,763,166.26	0.09
183	REALTY INCOME CORP	REALTY INCOME CORP	O US	纽约 证券 交易 所	美国	33,854.00	12,743,917.70	0.09
184	PUBLIC STORAGE	PUBLIC STORAGE	PSA US	纽约 证券 交易 所	美国	6,148.00	12,603,547.67	0.09
185	DEXCOM INC	DEXCOM INC	DXCM US	纳斯 达克 交易 所	美国	15,461.00	12,493,053.63	0.09
186	HUMANA INC	HUMANA INC	HUM US	纽约 证券 交易 所	美国	4,684.00	12,473,158.59	0.09
187	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BK US	纽约 证券 交易 所	美国	29,074.00	12,409,482.49	0.09
188	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	JCI US	纽约 证券 交易 所	美国	26,191.00	12,407,158.51	0.09
189	UNITED RENTALS INC	UNITED RENTALS INC	URI US	纽约 证券 交易 所	美国	2,588.00	11,928,390.56	0.09
190	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	LHX US	纽约 证券 交易 所	美国	7,374.00	11,802,357.95	0.09
191	CROWN CASTLE INC	CROWN CASTLE INC	CCI US	纽约 证券 交易 所	美国	16,893.00	11,762,399.27	0.09
192	AMERIPRISE FINANCIAL INC	AMERIPRISE FINANCIAL INC	AMP US	纽约 证券 交易 所	美国	3,861.00	11,754,805.59	0.09
193	ALLSTATE CORP	ALLSTATE CORP	ALL US	纽约 证券 交易 所	美国	10,260.00	11,674,493.75	0.09

194	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	PRU US	纽约证券交易所	美国	13,957.00	11,656,742.53	0.09
195	METLIFE INC	METLIFE INC	MET US	纽约证券交易所	美国	23,224.00	11,617,343.66	0.09
196	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	FIS US	纽约证券交易所	美国	21,626.00	11,614,797.96	0.09
197	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	纽约证券交易所	美国	25,853.00	11,613,224.58	0.09
198	DR HORTON INC	DR HORTON INC	DHI US	纽约证券交易所	美国	11,522.00	11,572,465.48	0.09
199	CONSTELLATION BRANDS INC-A	CONSTELLATION BRANDS INC-A	STZ US	纽约证券交易所	美国	6,259.00	11,476,396.65	0.08
200	SUPER MICRO COMPUTER INC	SUPER MICRO COMPUTER INC	SMCI US	纳斯达克交易所	美国	1,957.00	11,427,595.39	0.08
201	DOMINION ENERGY INC	DOMINION ENERGY INC	D US	纽约证券交易所	美国	32,588.00	11,380,159.76	0.08
202	HESS CORP	HESS CORP	HES US	纽约证券交易所	美国	10,745.00	11,296,707.78	0.08
203	IDEXX LABORATORIES INC	IDEXX LABORATORIES INC	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	3,210.00	11,145,688.04	0.08
204	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	MPWR US	纳斯达克交易所	美国	1,892.00	11,079,455.55	0.08
205	REPUBLIC SERVICES INC	REPUBLIC SERVICES INC	RSG US	纽约证券交易所	美国	7,958.00	11,022,007.56	0.08
206	MODERNA INC	MODERNA INC	MRNA US	纳斯达克交易所	美国	12,962.00	10,969,837.82	0.08

				交易 所				
207	WW GRAINGER INC	WW GRAINGER INC	GWW US	纽约 证券 交易 所	美国	1,700.00	10,931,142.85	0.08
208	OTIS WORLDWIDE CORP	OTIS WORLDWIDE CORP	OTIS US	纽约 证券 交易 所	美国	15,719.00	10,783,639.05	0.08
209	AMETEK INC	AMETEK INC	AME US	纽约 证券 交易 所	美国	8,999.00	10,691,791.34	0.08
210	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA HOLDINGS INC	IQV US	纽约 证券 交易 所	美国	7,083.00	10,673,306.06	0.08
211	VERISK ANALYTICS INC	VERISK ANALYTICS INC	VRSK US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,547.00	10,655,947.53	0.08
212	KINDER MORGAN INC	KINDER MORGAN INC	KMI US	纽约 证券 交易 所	美国	75,070.00	10,630,626.37	0.08
213	FORTINET INC	FORTINET INC	FTNT US	纳斯 达克 交易 所	美国	24,651.00	10,588,399.15	0.08
214	MSCI INC	MSCI INC	MSCI US	纽约 证券 交易 所	美国	3,080.00	10,574,674.57	0.08
215	AGILENT TECHNOLOGIES INC	AGILENT TECHNOLOGIES INC	A US	纽约 证券 交易 所	美国	11,393.00	10,525,389.83	0.08
216	PAYCHEX INC	PAYCHEX INC	PAYX US	纳斯 达克 交易 所	美国	12,455.00	10,523,894.70	0.08
217	NUCOR CORP	NUCOR CORP	NUE US	纽约 证券 交易 所	美国	9,321.00	10,501,080.95	0.08
218	CUMMINS INC	CUMMINS INC	CMI US	纽约 证券 交易 所	美国	5,317.00	10,493,762.66	0.08

219	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	RCL US	纽约证券交易所	美国	9,205.00	10,458,957.79	0.08
220	ARCH CAPITAL GROUP LTD	ARCH CAPITAL GROUP LTD	ACGL US	纳斯达克交易所	美国	14,539.00	10,453,873.25	0.08
221	CORTEVA INC	CORTEVA INC	CTVA US	纽约证券交易所	美国	27,097.00	10,416,617.68	0.08
222	P G & E CORP	P G & E CORP	PCG US	纽约证券交易所	美国	83,085.00	10,338,592.91	0.08
223	DOW INC	DOW INC	DOW US	纽约证券交易所	美国	27,339.00	10,336,239.99	0.08
224	YUM! BRANDS INC	YUM! BRANDS INC	YUM US	纽约证券交易所	美国	10,949.00	10,336,030.40	0.08
225	CENCORA INC	CENCORA INC	COR US	纽约证券交易所	美国	6,436.00	10,334,079.51	0.08
226	QUANTA SERVICES INC	QUANTA SERVICES INC	PWR US	纽约证券交易所	美国	5,691.00	10,305,539.45	0.08
227	FAIR ISAAC CORP	FAIR ISAAC CORP	FICO US	纽约证券交易所	美国	961.00	10,195,616.19	0.08
228	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	PEG US	纽约证券交易所	美国	19,364.00	10,170,847.28	0.08
229	LENNAR CORP-A	LENNAR CORP-A	LEN US	纽约证券交易所	美国	9,520.00	10,168,250.27	0.08
230	INGERSOLL-RAND INC	INGERSOLL-RAND INC	IR US	纽约证券交易所	美国	15,685.00	10,154,445.66	0.07
231	FASTENAL CO	FASTENAL CO	FAST US	纳斯达克	美国	22,260.00	9,969,098.97	0.07

				交易 所				
232	GENERAL MILLS INC	GENERAL MILLS INC	GIS US	纽约 证券 交易 所	美国	21,949.00	9,895,517.19	0.07
233	DIAMONDBACK ENERGY INC	DIAMONDBACK ENERGY INC	FANG US	纳斯 达克 交易 所	美国	6,933.00	9,891,408.80	0.07
234	SYSCO CORP	SYSCO CORP	SYU US	纽约 证券 交易 所	美国	19,361.00	9,850,533.18	0.07
235	MONSTER BEVERAGE CORP	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	纳斯 达克 交易 所	美国	27,576.00	9,816,605.41	0.07
236	CENTENE CORP	CENTENE CORP	CNC US	纽约 证券 交易 所	美国	20,748.00	9,803,571.92	0.07
237	BAKER HUGHES CO	BAKER HUGHES CO	BKR US	纳斯 达克 交易 所	美国	38,801.00	9,725,453.42	0.07
238	KEURIG DR PEPPER INC	KEURIG DR PEPPER INC	KDP US	纳斯 达克 交易 所	美国	40,581.00	9,659,703.20	0.07
239	GARTNER INC	GARTNER INC	IT US	纽约 证券 交易 所	美国	3,018.00	9,658,688.92	0.07
240	KENVUE INC	KENVUE INC	KVUE US	纽约 证券 交易 所	美国	74,446.00	9,645,612.67	0.07
241	EXELON CORP	EXELON CORP	EXC US	纳斯 达克 交易 所	美国	38,879.00	9,589,837.69	0.07
242	LULULEMON ATHLETICA INC	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,454.00	9,481,564.56	0.07
243	ELECTRONIC ARTS INC	ELECTRONIC ARTS INC	EA US	纳斯 达克 交易 所	美国	9,458.00	9,391,576.88	0.07

244	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	19,330.00	9,367,750.99	0.07
245	BIOGEN INC	BIOGEN INC	BIIB US	纳斯达克交易所	美国	5,660.00	9,351,082.83	0.07
246	DUPONT DE NEMOURS INC	DUPONT DE NEMOURS INC	DD US	纽约证券交易所	美国	16,255.00	9,324,455.33	0.07
247	KROGER CO	KROGER CO	KR US	纽约证券交易所	美国	26,025.00	9,260,765.25	0.07
248	MARTIN MARIETTA MATERIALS	MARTIN MARIETTA MATERIALS	MLM US	纽约证券交易所	美国	2,396.00	9,251,675.38	0.07
249	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GEHC US	纳斯达克交易所	美国	16,504.00	9,165,005.51	0.07
250	EXTRA SPACE STORAGE INC	EXTRA SPACE STORAGE INC	EXR US	纽约证券交易所	美国	8,231.00	9,116,457.96	0.07
251	VULCAN MATERIALS CO	VULCAN MATERIALS CO	VMC US	纽约证券交易所	美国	5,141.00	9,111,356.38	0.07
252	XYLEM INC	XYLEM INC	XYL US	纽约证券交易所	美国	9,426.00	9,111,245.91	0.07
253	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	DFS US	纽约证券交易所	美国	9,743.00	9,082,977.11	0.07
254	OLD DOMINION FREIGHT LINE	OLD DOMINION FREIGHT LINE	ODFL US	纳斯达克交易所	美国	6,927.00	8,718,272.88	0.06
255	ROCKWELL AUTOMATION INC	ROCKWELL AUTOMATION INC	ROK US	纽约证券交易所	美国	4,432.00	8,694,987.91	0.06
256	CONSOLIDATED EDISON INC	CONSOLIDATED EDISON INC	ED US	纽约证券交易所	美国	13,445.00	8,568,208.84	0.06

				交易 所				
257	DELTA AIR LINES INC	DELTA AIR LINES INC	DAL US	纽约 证券 交易 所	美国	25,089.00	8,482,475.29	0.06
258	COSTAR GROUP INC	COSTAR GROUP INC	CSGP US	纳斯 达克 交易 所	美国	15,875.00	8,388,047.61	0.06
259	HP INC	HP INC	HPQ US	纽约 证券 交易 所	美国	33,554.00	8,374,425.30	0.06
260	HOWMET AEROSPACE INC	HOWMET AEROSPACE INC	HWM US	纽约 证券 交易 所	美国	15,076.00	8,340,849.52	0.06
261	CDW CORP/DE	CDW CORP/DE	CDW US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,225.00	8,335,248.72	0.06
262	EQUIFAX INC	EQUIFAX INC	EFX US	纽约 证券 交易 所	美国	4,805.00	8,302,866.67	0.06
263	DEVON ENERGY CORP	DEVON ENERGY CORP	DVN US	纽约 证券 交易 所	美国	24,571.00	8,300,337.37	0.06
264	CORNING INC	CORNING INC	GLW US	纽约 证券 交易 所	美国	29,974.00	8,299,086.62	0.06
265	HALLIBURTON CO	HALLIBURTON CO	HAL US	纽约 证券 交易 所	美国	34,419.00	8,286,143.78	0.06
266	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM US	纽约 证券 交易 所	美国	19,223.00	8,281,557.90	0.06
267	VICI PROPERTIES INC	VICI PROPERTIES INC	VICI US	纽约 证券 交易 所	美国	40,557.00	8,278,152.21	0.06
268	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	MTD US	纽约 证券 交易 所	美国	830.00	8,267,085.86	0.06

269	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	HIG US	纽约 证券 交易 所	美国	11,498.00	8,238,644.37	0.06
270	XCEL ENERGY INC	XCEL ENERGY INC	XEL US	纳斯 达克 交易 所	美国	21,602.00	8,222,636.87	0.06
271	PPG INDUSTRIES INC	PPG INDUSTRIES INC	PPG US	纽约 证券 交易 所	美国	9,150.00	8,209,314.60	0.06
272	ON SEMICONDUCTOR	ON SEMICONDUCTOR	ON US	纳斯 达克 交易 所	美国	16,726.00	8,171,355.83	0.06
273	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVB US	纽约 证券 交易 所	美国	5,520.00	8,139,039.36	0.06
274	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	纳斯 达克 交易 所	美国	3,807.00	8,111,301.28	0.06
275	TRACTOR SUPPLY COMPANY	TRACTOR SUPPLY COMPANY	TSCO US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,191.00	8,064,473.08	0.06
276	DOLLAR GENERAL CORP	DOLLAR GENERAL CORP	DG US	纽约 证券 交易 所	美国	8,540.00	8,047,897.56	0.06
277	TARGA RESOURCES CORP	TARGA RESOURCES CORP	TRGP US	纽约 证券 交易 所	美国	8,620.00	7,911,343.80	0.06
278	RESMED INC	RESMED INC	RMD US	纽约 证券 交易 所	美国	5,711.00	7,791,015.05	0.06
279	VISTRA CORP	VISTRA CORP	VST US	纽约 证券 交易 所	美国	12,698.00	7,780,855.23	0.06
280	ANSYS INC	ANSYS INC	ANSS US	纳斯 达克 交易 所	美国	3,394.00	7,776,557.48	0.06
281	WABTEC CORP	WABTEC CORP	WAB US	纽约 证券 交易 所	美国	6,857.00	7,723,661.30	0.06

				交易所				
282	EDISON INTERNATIONAL	EDISON INTERNATIONAL	EIX US	纽约证券交易所	美国	14,958.00	7,655,138.05	0.06
283	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	HPE US	纽约证券交易所	美国	50,542.00	7,625,491.70	0.06
284	EBAY INC	EBAY INC	EBAY US	纳斯达克交易所	美国	19,672.00	7,531,458.56	0.06
285	HERSHEY CO/THE	HERSHEY CO/THE	HSY US	纽约证券交易所	美国	5,739.00	7,518,776.64	0.06
286	CBRE GROUP INC - A	CBRE GROUP INC - A	CBRE US	纽约证券交易所	美国	11,726.00	7,446,820.83	0.05
287	WILLIS TOWERS WATSON PLC	WILLIS TOWERS WATSON PLC	WTW US	纳斯达克交易所	美国	3,974.00	7,424,303.70	0.05
288	NETAPP INC	NETAPP INC	NTAP US	纳斯达克交易所	美国	8,023.00	7,364,567.15	0.05
289	IRON MOUNTAIN INC	IRON MOUNTAIN INC	IRM US	纽约证券交易所	美国	11,396.00	7,278,668.69	0.05
290	FORTIVE CORP	FORTIVE CORP	FTV US	纽约证券交易所	美国	13,686.00	7,227,520.21	0.05
291	T ROWE PRICE GROUP INC	T ROWE PRICE GROUP INC	TROW US	纳斯达克交易所	美国	8,681.00	7,133,970.34	0.05
292	KRAFT HEINZ CO/THE	KRAFT HEINZ CO/THE	KHC US	纳斯达克交易所	美国	30,686.00	7,046,287.97	0.05
293	CHURCH & DWIGHT CO INC	CHURCH & DWIGHT CO INC	CHD US	纽约证券交易所	美国	9,506.00	7,024,046.37	0.05

294	M & T BANK CORP	M & T BANK CORP	MTB US	纽约 证券 交易 所	美国	6,487.00	6,997,607.65	0.05
295	AMERICAN WATER WORKS CO INC	AMERICAN WATER WORKS CO INC	AWK US	纽约 证券 交易 所	美国	7,574.00	6,971,847.97	0.05
296	GARMIN LTD	GARMIN LTD	GRMN US	纽约 证券 交易 所	美国	5,974.00	6,936,400.98	0.05
297	FIFTH THIRD BANCORP	FIFTH THIRD BANCORP	FITB US	纳斯 达克 交易 所	美国	26,594.00	6,915,954.05	0.05
298	DECKERS OUTDOOR CORP	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK US	纽约 证券 交易 所	美国	998.00	6,884,589.29	0.05
299	DOVER CORP	DOVER CORP	DOV US	纽约 证券 交易 所	美国	5,343.00	6,871,263.95	0.05
300	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	EL US	纽约 证券 交易 所	美国	9,059.00	6,869,362.88	0.05
301	WEC ENERGY GROUP INC	WEC ENERGY GROUP INC	WEC US	纽约 证券 交易 所	美国	12,278.00	6,865,473.64	0.05
302	WESTERN DIGITAL CORP	WESTERN DIGITAL CORP	WDC US	纳斯 达克 交易 所	美国	12,694.00	6,854,729.99	0.05
303	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TTWO US	纳斯 达克 交易 所	美国	6,173.00	6,840,586.07	0.05
304	GLOBAL PAYMENTS INC	GLOBAL PAYMENTS INC	GPN US	纽约 证券 交易 所	美国	9,923.00	6,838,550.16	0.05
305	LYONDELLBASELL INDU-CL A	LYONDELLBASELL INDU-CL A	LYB US	纽约 证券 交易 所	美国	10,001.00	6,818,178.63	0.05
306	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	IFF US	纽约 证券 交易 所	美国	9,927.00	6,735,892.67	0.05

				交易所				
307	FIRST SOLAR INC	FIRST SOLAR INC	FSLR US	纳斯达克交易所	美国	4,161.00	6,685,929.45	0.05
308	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WST US	纽约证券交易所	美国	2,832.00	6,648,110.52	0.05
309	CARDINAL HEALTH INC	CARDINAL HEALTH INC	CAH US	纽约证券交易所	美国	9,469.00	6,634,994.36	0.05
310	EQUITY RESIDENTIAL	EQUITY RESIDENTIAL	EQR US	纽约证券交易所	美国	13,407.00	6,625,368.19	0.05
311	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	KEYS US	纽约证券交易所	美国	6,786.00	6,613,567.06	0.05
312	NVR INC	NVR INC	NVR US	纽约证券交易所	美国	122.00	6,598,022.23	0.05
313	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	BR US	纽约证券交易所	美国	4,594.00	6,449,882.28	0.05
314	PULTEGROUP INC	PULTEGROUP INC	PHM US	纽约证券交易所	美国	8,177.00	6,416,170.38	0.05
315	TERADYNE INC	TERADYNE INC	TER US	纳斯达克交易所	美国	6,069.00	6,413,920.52	0.05
316	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	RJF US	纽约证券交易所	美国	7,252.00	6,388,604.06	0.05
317	DTE ENERGY COMPANY	DTE ENERGY COMPANY	DTE US	纽约证券交易所	美国	8,045.00	6,364,770.12	0.05
318	NASDAQ INC	NASDAQ INC	NDAQ US	纳斯达克交易所	美国	14,793.00	6,353,016.10	0.05

319	ENERGY CORP	ENERGY CORP	ETR US	纽约 证券 交易 所	美国	8,302.00	6,330,836.22	0.05
320	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZBH US	纽约 证券 交易 所	美国	7,998.00	6,186,225.89	0.05
321	STATE STREET CORP	STATE STREET CORP	STT US	纽约 证券 交易 所	美国	11,712.00	6,176,712.04	0.05
322	DOLLAR TREE INC	DOLLAR TREE INC	DLTR US	纳斯 达克 交易 所	美国	8,056.00	6,130,039.48	0.05
323	PTC INC	PTC INC	PTC US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,655.00	6,026,948.39	0.04
324	STERIS PLC	STERIS PLC	STE US	纽约 证券 交易 所	美国	3,841.00	6,009,696.48	0.04
325	TYLER TECHNOLOGIES INC	TYLER TECHNOLOGIES INC	TYL US	纽约 证券 交易 所	美国	1,650.00	5,912,300.63	0.04
326	BROWN & BROWN INC	BROWN & BROWN INC	BRO US	纽约 证券 交易 所	美国	9,204.00	5,864,854.96	0.04
327	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBAC US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,177.00	5,843,584.74	0.04
328	VERALTO CORP	VERALTO CORP	VLTO US	纽约 证券 交易 所	美国	8,541.00	5,811,258.79	0.04
329	AXON ENTERPRISE INC	AXON ENTERPRISE INC	AXON US	纳斯 达克 交易 所	美国	2,758.00	5,783,497.41	0.04
330	VENTAS INC	VENTAS INC	VTR US	纽约 证券 交易 所	美国	15,737.00	5,749,037.19	0.04
331	WEYERHAEUSER CO	WEYERHAEUSER CO	WY US	纽约 证券 交易 所	美国	28,343.00	5,734,635.00	0.04

				交易 所				
332	INVITATION HOMES INC	INVITATION HOMES INC	INVH US	纽约 证券 交易 所	美国	22,385.00	5,725,654.37	0.04
333	PPL CORP	PPL CORP	PPL US	纽约 证券 交易 所	美国	28,682.00	5,651,960.77	0.04
334	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	STX US	纳斯 达克 交易 所	美国	7,592.00	5,587,595.36	0.04
335	EVERSOURCE ENERGY	EVERSOURCE ENERGY	ES US	纽约 证券 交易 所	美国	13,695.00	5,534,982.54	0.04
336	COTERRA ENERGY INC	COTERRA ENERGY INC	CTRA US	纽约 证券 交易 所	美国	28,935.00	5,499,726.26	0.04
337	FIRSTENERGY CORP	FIRSTENERGY CORP	FE US	纽约 证券 交易 所	美国	20,137.00	5,492,218.46	0.04
338	CENTERPOINT ENERGY INC	CENTERPOINT ENERGY INC	CNP US	纽约 证券 交易 所	美国	24,871.00	5,491,224.91	0.04
339	LEIDOS HOLDINGS INC	LEIDOS HOLDINGS INC	LDOS US	纽约 证券 交易 所	美国	5,256.00	5,464,440.26	0.04
340	GODADDY INC - CLASS A	GODADDY INC - CLASS A	GDDY US	纽约 证券 交易 所	美国	5,479.00	5,455,359.36	0.04
341	HUBBELL INC	HUBBELL INC	HUBB US	纽约 证券 交易 所	美国	2,087.00	5,436,014.88	0.04
342	GENUINE PARTS CO	GENUINE PARTS CO	GPC US	纽约 证券 交易 所	美国	5,415.00	5,337,993.16	0.04
343	APTIV PLC	APTIV PLC	APTIV US	纽约 证券 交易 所	美国	10,577.00	5,308,271.12	0.04

344	STEEL DYNAMICS INC	STEEL DYNAMICS INC	STLD US	纳斯达克 交易所	美国	5,742.00	5,299,410.09	0.04
345	HUNTINGTON BANCSHARES INC	HUNTINGTON BANCSHARES INC	HBAN US	纳斯 达克 交易 所	美国	56,345.00	5,292,554.82	0.04
346	AMEREN CORPORATION	AMEREN CORPORATION	AEE US	纽约 证券 交易 所	美国	10,367.00	5,253,858.22	0.04
347	SYNCHRONY FINANCIAL	SYNCHRONY FINANCIAL	SYF US	纽约 证券 交易 所	美国	15,611.00	5,250,193.05	0.04
348	CARNIVAL CORP	CARNIVAL CORP	CCL US	纽约 证券 交易 所	美国	39,271.00	5,239,289.26	0.04
349	CORPAY INC	CORPAY INC	CPAY US	纽约 证券 交易 所	美国	2,731.00	5,185,215.30	0.04
350	BALL CORP	BALL CORP	BALL US	纽约 证券 交易 所	美国	12,067.00	5,161,665.72	0.04
351	ULTA BEAUTY INC	ULTA BEAUTY INC	ULTA US	纳斯 达克 交易 所	美国	1,863.00	5,123,284.12	0.04
352	CINCINNATI FINANCIAL CORP	CINCINNATI FINANCIAL CORP	CINF US	纳斯 达克 交易 所	美国	6,086.00	5,122,434.54	0.04
353	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	ARE US	纽约 证券 交易 所	美国	6,119.00	5,100,931.77	0.04
354	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TDY US	纽约 证券 交易 所	美国	1,843.00	5,095,997.96	0.04
355	REGIONS FINANCIAL CORP	REGIONS FINANCIAL CORP	RF US	纽约 证券 交易 所	美国	35,606.00	5,085,287.09	0.04
356	DARDEN RESTAURANTS INC	DARDEN RESTAURANTS INC	DRI US	纽约 证券 交易 所	美国	4,640.00	5,003,903.02	0.04

				交易 所				
357	DOMINO'S PIZZA INC	DOMINO'S PIZZA INC	DPZ US	纽约 证券 交易 所	美国	1,356.00	4,989,782.55	0.04
358	CBOE GLOBAL MARKETS INC	CBOE GLOBAL MARKETS INC	CBOE US	巴兹 全球 市场	美国	4,088.00	4,954,588.99	0.04
359	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MKC US	纽约 证券 交易 所	美国	9,787.00	4,948,064.40	0.04
360	CMS ENERGY CORP	CMS ENERGY CORP	CMS US	纽约 证券 交易 所	美国	11,610.00	4,925,640.07	0.04
361	EXPEDITORS INTL WASH INC	EXPEDITORS INTL WASH INC	EXPD US	纽约 证券 交易 所	美国	5,491.00	4,883,439.37	0.04
362	AVERY DENNISON CORP	AVERY DENNISON CORP	AVY US	纽约 证券 交易 所	美国	3,131.00	4,878,958.46	0.04
363	ATMOS ENERGY CORP	ATMOS ENERGY CORP	ATO US	纽约 证券 交易 所	美国	5,865.00	4,875,816.26	0.04
364	OMNICOM GROUP	OMNICOM GROUP	OMC US	纽约 证券 交易 所	美国	7,613.00	4,866,792.66	0.04
365	JACOBS SOLUTIONS INC	JACOBS SOLUTIONS INC	J US	纽约 证券 交易 所	美国	4,868.00	4,846,995.69	0.04
366	ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESS US	纽约 证券 交易 所	美国	2,496.00	4,842,027.74	0.04
367	MOLINA HEALTHCARE INC	MOLINA HEALTHCARE INC	MOH US	纽约 证券 交易 所	美国	2,278.00	4,826,621.02	0.04
368	COOPER COS INC/THE	COOPER COS INC/THE	COO US	纳斯 达克 交易 所	美国	7,727.00	4,807,504.81	0.04
369	HOLOGIC INC	HOLOGIC INC	HOLX	纳斯	美	9,073.00	4,801,113.14	0.04

			US	达 克 交 易 所	国			
370	WATERS CORP	WATERS CORP	WAT US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,306.00	4,767,948.36	0.04
371	NORTHERN TRUST CORP	NORTHERN TRUST CORP	NTRS US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	7,954.00	4,760,537.91	0.04
372	LABCORP HOLDINGS INC	LABCORP HOLDINGS INC	LH US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,277.00	4,752,879.10	0.04
373	SOUTHWEST AIRLINES CO	SOUTHWEST AIRLINES CO	LUV US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	23,267.00	4,744,088.90	0.04
374	SKYWORKS SOLUTIONS INC	SKYWORKS SOLUTIONS INC	SWKS US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	6,238.00	4,738,224.76	0.03
375	BAXTER INTERNATIONAL INC	BAXTER INTERNATIONAL INC	BAX US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	19,811.00	4,722,773.21	0.03
376	CLOROX COMPANY	CLOROX COMPANY	CLX US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,828.00	4,695,685.74	0.03
377	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	PFG US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	8,383.00	4,686,914.01	0.03
378	ALIGN TECHNOLOGY INC	ALIGN TECHNOLOGY INC	ALGN US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	2,722.00	4,683,536.69	0.03
379	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	BLDR US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,745.00	4,680,564.74	0.03
380	MID-AMERICA APARTMENT COMM	MID-AMERICA APARTMENT COMM	MAA US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,542.00	4,616,275.09	0.03
381	WARNER BROS DISCOVERY INC	WARNER BROS DISCOVERY INC	WBD US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	86,691.00	4,596,650.88	0.03

				所				
382	EVEREST GROUP LTD	EVEREST GROUP LTD	EG US	纽约 证券 交易 所	美国	1,689.00	4,586,400.68	0.03
383	CITIZENS FINANCIAL GROUP	CITIZENS FINANCIAL GROUP	CFG US	纽约 证券 交易 所	美国	17,690.00	4,542,413.50	0.03
384	TEXTRON INC	TEXTRON INC	TXT US	纽约 证券 交易 所	美国	7,414.00	4,536,678.85	0.03
385	TYSON FOODS INC-CL A	TYSON FOODS INC-CL A	TSN US	纽约 证券 交易 所	美国	11,120.00	4,528,345.91	0.03
386	EQT CORP	EQT CORP	EQT US	纽约 证券 交易 所	美国	17,168.00	4,524,610.33	0.03
387	PACKAGING CORP OF AMERICA	PACKAGING CORP OF AMERICA	PKG US	纽约 证券 交易 所	美国	3,465.00	4,508,202.73	0.03
388	NRG ENERGY INC	NRG ENERGY INC	NRG US	纽约 证券 交易 所	美国	8,105.00	4,497,404.91	0.03
389	BEST BUY CO INC	BEST BUY CO INC	BBY US	纽约 证券 交易 所	美国	7,486.00	4,496,974.74	0.03
390	MARATHON OIL CORP	MARATHON OIL CORP	MRO US	纽约 证券 交易 所	美国	21,929.00	4,480,650.73	0.03
391	LAS VEGAS SANDS CORP	LAS VEGAS SANDS CORP	LVS US	纽约 证券 交易 所	美国	14,193.00	4,475,917.25	0.03
392	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	UAL US	纳斯 达克 交易 所	美国	12,783.00	4,433,017.69	0.03
393	EXPEDIA GROUP INC	EXPEDIA GROUP INC	EXPE US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,935.00	4,431,163.80	0.03
394	ZEBRA TECHNOLOGIES	ZEBRA TECHNOLOGIES	ZBRA	纳斯	美	1,999.00	4,401,162.97	0.03

	CORP-CL A	CORP-CL A	US	达 克 交 易 所	国			
395	WR BERKLEY CORP	WR BERKLEY CORP	WRB US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,852.00	4,397,308.01	0.03
396	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	FDS US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,482.00	4,312,114.10	0.03
397	VERISIGN INC	VERISIGN INC	VRSN US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	3,368.00	4,267,744.49	0.03
398	IDEX CORP	IDEX CORP	IDEX US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,942.00	4,218,569.57	0.03
399	QUEST DIAGNOSTICS INC	QUEST DIAGNOSTICS INC	DGX US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,319.00	4,213,255.26	0.03
400	KELLANOVA	KELLANOVA	K US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	10,234.00	4,206,929.51	0.03
401	BUNGE GLOBAL SA	BUNGE GLOBAL SA	BG US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,505.00	4,188,911.04	0.03
402	INTERNATIONAL PAPER CO	INTERNATIONAL PAPER CO	IP US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	13,503.00	4,152,461.73	0.03
403	MASCO CORP	MASCO CORP	MAS US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	8,562.00	4,068,180.84	0.03
404	AMCOR PLC	AMCOR PLC	AMCR US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	56,193.00	3,916,657.94	0.03
405	INSULET CORP	INSULET CORP	PODD US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	2,723.00	3,916,186.58	0.03
406	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	DOC US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	27,362.00	3,822,068.63	0.03

				所				
407	SNAP-ON INC	SNAP-ON INC	SNA US	纽约 证券 交易 所	美国	2,049.00	3,817,029.34	0.03
408	GEN DIGITAL INC	GEN DIGITAL INC	GEN US	纳斯 达克 交易 所	美国	21,422.00	3,813,704.33	0.03
409	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	AKAM US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,921.00	3,801,176.27	0.03
410	NEWS CORP	NEWS CORP - CLASS A	NWSA US	纳斯 达克 交易 所	美国	14,743.00	2,896,791.27	0.02
410	NEWS CORP	NEWS CORP - CLASS B	NWS US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,448.00	899,963.18	0.01
411	ROLLINS INC	ROLLINS INC	ROL US	纽约 证券 交易 所	美国	10,919.00	3,796,717.25	0.03
412	TRIMBLE INC	TRIMBLE INC	TRMB US	纳斯 达克 交易 所	美国	9,494.00	3,783,650.05	0.03
413	CONAGRA BRANDS INC	CONAGRA BRANDS INC	CAG US	纽约 证券 交易 所	美国	18,586.00	3,764,476.39	0.03
414	LOEWS CORP	LOEWS CORP	L US	纽约 证券 交易 所	美国	7,058.00	3,759,493.33	0.03
415	ENPHASE ENERGY INC	ENPHASE ENERGY INC	ENPH US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,289.00	3,758,433.36	0.03
416	CELANESE CORP	CELANESE CORP	CE US	纽约 证券 交易 所	美国	3,906.00	3,754,970.81	0.03
417	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF US	纽约 证券 交易 所	美国	7,106.00	3,753,662.18	0.03
418	KEYCORP	KEYCORP	KEY US	纽约	美	36,657.00	3,712,321.40	0.03

				证券交易所	国			
419	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	LYV US	纽约证券交易所	美国	5,537.00	3,699,082.73	0.03
420	JABIL INC	JABIL INC	JBL US	纽约证券交易所	美国	4,688.00	3,634,721.59	0.03
421	ALLIANT ENERGY CORP	ALLIANT ENERGY CORP	LNT US	纳斯达克交易所	美国	9,967.00	3,615,570.31	0.03
422	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	JBHT US	纳斯达克交易所	美国	3,169.00	3,613,572.67	0.03
423	KIMCO REALTY CORP	KIMCO REALTY CORP	KIM US	纽约证券交易所	美国	25,946.00	3,598,386.60	0.03
424	WESTROCK CO	WESTROCK CO	WRK US	美国证券交易所	美国	10,036.00	3,594,824.63	0.03
425	REVVITY INC	REVVITY INC	RVTY US	纽约证券交易所	美国	4,797.00	3,584,876.04	0.03
426	NISOURCE INC	NISOURCE INC	NI US	纽约证券交易所	美国	17,429.00	3,578,576.45	0.03
427	PENTAIR PLC	PENTAIR PLC	PNR US	纽约证券交易所	美国	6,454.00	3,526,541.47	0.03
428	HOST HOTELS & RESORTS INC	HOST HOTELS & RESORTS INC	HST US	纳斯达克交易所	美国	27,411.00	3,512,441.81	0.03
429	VIATRIS INC	VIATRIS INC	VTRS US	纳斯达克交易所	美国	46,292.00	3,506,983.97	0.03
430	NORDSON CORP	NORDSON CORP	NDSN US	纳斯达克交易所	美国	2,112.00	3,491,114.86	0.03

				所				
431	AES CORP	AES CORP	AES US	纽约 证券 交易 所	美国	27,630.00	3,459,769.91	0.03
432	UDR INC	UDR INC	UDR US	纽约 证券 交易 所	美国	11,778.00	3,454,108.38	0.03
433	STANLEY BLACK & DECKER INC	STANLEY BLACK & DECKER INC	SWK US	纽约 证券 交易 所	美国	5,982.00	3,405,911.83	0.03
434	EVERGY INC	EVERGY INC	EVRG US	纳斯 达克 交易 所	美国	8,939.00	3,374,531.46	0.02
435	FOX CORP	FOX CORP - CLASS A	FOXA US	纳斯 达克 交易 所	美国	8,986.00	2,201,103.77	0.02
435	FOX CORP	FOX CORP - CLASS B	FOX US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,129.00	1,170,438.50	0.01
436	LAMB WESTON HOLDINGS INC	LAMB WESTON HOLDINGS INC	LW US	纽约 证券 交易 所	美国	5,613.00	3,363,429.40	0.02
437	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	JKHY US	纳斯 达克 交易 所	美国	2,834.00	3,353,164.25	0.02
438	JUNIPER NETWORKS INC	JUNIPER NETWORKS INC	JNPR US	纽约 证券 交易 所	美国	12,635.00	3,283,117.92	0.02
439	POOL CORP	POOL CORP	POOL US	纳斯 达克 交易 所	美国	1,490.00	3,263,516.37	0.02
440	CAMDEN PROPERTY TRUST	CAMDEN PROPERTY TRUST	CPT US	纽约 证券 交易 所	美国	4,141.00	3,220,062.92	0.02
441	JM SMUCKER CO/THE	JM SMUCKER CO/THE	SJM US	纽约 证券 交易 所	美国	4,128.00	3,207,894.69	0.02
442	CARMAX INC	CARMAX INC	KMX US	纽约	美	6,119.00	3,198,275.93	0.02

				证券交易所	国			
443	EASTMAN CHEMICAL CO	EASTMAN CHEMICAL CO	EMN US	纽约证券交易所	美国	4,574.00	3,193,624.41	0.02
444	INCYTE CORP	INCYTE CORP	INCY US	纳斯达克交易所	美国	7,245.00	3,130,032.83	0.02
445	BIO-TECHNE CORP	BIO-TECHNE CORP	TECH US	纳斯达克交易所	美国	6,126.00	3,128,151.36	0.02
446	ALBEMARLE CORP	ALBEMARLE CORP	ALB US	纽约证券交易所	美国	4,569.00	3,110,355.60	0.02
447	QORVO INC	QORVO INC	QRVO US	纳斯达克交易所	美国	3,753.00	3,103,708.00	0.02
448	MGM RESORTS INTERNATIONAL	MGM RESORTS INTERNATIONAL	MGM US	纽约证券交易所	美国	9,756.00	3,089,871.46	0.02
449	LKQ CORP	LKQ CORP	LKQ US	纳斯达克交易所	美国	10,371.00	3,074,001.86	0.02
450	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	UHS US	纽约证券交易所	美国	2,320.00	3,057,665.17	0.02
451	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	IPG US	纽约证券交易所	美国	14,673.00	3,041,985.99	0.02
452	EPAM SYSTEMS INC	EPAM SYSTEMS INC	EPAM US	纽约证券交易所	美国	2,253.00	3,020,422.15	0.02
453	CHARLES RIVER LABORATORIES	CHARLES RIVER LABORATORIES	CRL US	纽约证券交易所	美国	2,002.00	2,947,453.20	0.02
454	APA CORP	APA CORP	APA US	纳斯达克交易所	美国	13,998.00	2,936,962.26	0.02

				所				
455	ALLEGION PLC	ALLEGION PLC	ALLE US	纽约 证券 交易 所	美国	3,399.00	2,862,064.80	0.02
456	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	CHRW US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,552.00	2,858,717.98	0.02
457	REGENCY CENTERS CORP	REGENCY CENTERS CORP	REG US	纳斯 达克 交易 所	美国	6,393.00	2,833,933.54	0.02
458	CATALENT INC	CATALENT INC	CTLT US	纽约 证券 交易 所	美国	7,036.00	2,819,606.39	0.02
459	F5 INC	F5 INC	FFIV US	纳斯 达克 交易 所	美国	2,278.00	2,796,128.28	0.02
460	TELEFLEX INC	TELEFLEX INC	TFX US	纽约 证券 交易 所	美国	1,831.00	2,744,632.09	0.02
461	SMITH (A. O.) CORP	SMITH (A. O.) CORP	AOS US	纽约 证券 交易 所	美国	4,695.00	2,736,385.46	0.02
462	TAPESTRY INC	TAPESTRY INC	TPR US	纽约 证券 交易 所	美国	8,933.00	2,724,169.91	0.02
463	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	HII US	纽约 证券 交易 所	美国	1,533.00	2,691,249.94	0.02
464	MOSAIC CO/THE	MOSAIC CO/THE	MOS US	纽约 证券 交易 所	美国	12,495.00	2,573,526.68	0.02
465	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	TAP US	纽约 证券 交易 所	美国	7,069.00	2,560,782.32	0.02
466	BXP INC	BXP INC	BXP US	纽约 证券 交易 所	美国	5,617.00	2,464,322.86	0.02
467	CAMPBELL SOUP CO	CAMPBELL SOUP CO	CPB US	纽约	美	7,649.00	2,463,437.64	0.02

				证券交易所	国			
468	HORMEL FOODS CORP	HORMEL FOODS CORP	HRL US	纽约证券交易所	美国	11,285.00	2,452,186.85	0.02
469	BATH & BODY WORKS INC	BATH & BODY WORKS INC	BBWI US	纽约证券交易所	美国	8,695.00	2,419,831.89	0.02
470	PINNACLE WEST CAPITAL	PINNACLE WEST CAPITAL	PNW US	纽约证券交易所	美国	4,415.00	2,403,283.10	0.02
471	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	纳斯达克交易所	美国	27,839.00	2,399,684.14	0.02
472	ASSURANT INC	ASSURANT INC	AIZ US	纽约证券交易所	美国	2,021.00	2,394,542.44	0.02
473	CAESARS ENTERTAINMENT INC	CAESARS ENTERTAINMENT INC	CZR US	纳斯达克交易所	美国	8,414.00	2,383,004.94	0.02
474	WYNN RESORTS LTD	WYNN RESORTS LTD	WYNN US	纳斯达克交易所	美国	3,671.00	2,341,542.21	0.02
475	HENRY SCHEIN INC	HENRY SCHEIN INC	HSIC US	纳斯达克交易所	美国	4,978.00	2,274,089.19	0.02
476	MATCH GROUP INC	MATCH GROUP INC	MTCH US	纳斯达克交易所	美国	10,328.00	2,236,137.84	0.02
477	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	NCLH US	纽约证券交易所	美国	16,680.00	2,233,661.70	0.02
478	GENERAC HOLDINGS INC	GENERAC HOLDINGS INC	GNRC US	纽约证券交易所	美国	2,356.00	2,220,071.75	0.02
479	DAYFORCE INC	DAYFORCE INC	DAY US	纽约证券交易所	美国	6,138.00	2,169,717.20	0.02

				所				
480	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	BF/B US	纽约 证券 交易 所	美国	6,959.00	2,142,025.38	0.02
481	HASBRO INC	HASBRO INC	HAS US	纳斯 达克 交易 所	美国	5,087.00	2,120,860.85	0.02
482	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MKTX US	纳斯 达克 交易 所	美国	1,473.00	2,105,119.10	0.02
483	FEDERAL REALTY INVS TRUST	FEDERAL REALTY INVS TRUST	FRT US	纽约 证券 交易 所	美国	2,902.00	2,088,258.87	0.02
484	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	AAL US	纳斯 达克 交易 所	美国	25,508.00	2,059,685.40	0.02
485	BORGWARNER INC	BORGWARNER INC	BWA US	纽约 证券 交易 所	美国	8,858.00	2,035,285.23	0.02
486	SOLVENTUM CORP	SOLVENTUM CORP	SOLV US	纽约 证券 交易 所	美国	5,371.00	2,024,142.90	0.01
487	FMC CORP	FMC CORP	FMC US	纽约 证券 交易 所	美国	4,852.00	1,990,034.89	0.01
488	DAVITA INC	DAVITA INC	DVA US	纽约 证券 交易 所	美国	2,011.00	1,985,984.52	0.01
489	GLOBE LIFE INC	GLOBE LIFE INC	GL US	纽约 证券 交易 所	美国	3,264.00	1,913,987.09	0.01
490	ETSY INC	ETSY INC	ETSY US	纳斯 达克 交易 所	美国	4,546.00	1,910,859.57	0.01
491	PAYCOM SOFTWARE INC	PAYCOM SOFTWARE INC	PAYC US	纽约 证券 交易 所	美国	1,869.00	1,905,291.26	0.01
492	RALPH LAUREN CORP	RALPH LAUREN CORP	RL US	纽约	美	1,518.00	1,893,883.53	0.01

				证券交易所	国			
493	INVESCO LTD	INVESCO LTD	IVZ US	纽约证券交易所	美国	17,488.00	1,864,516.84	0.01
494	FRANKLIN RESOURCES INC	FRANKLIN RESOURCES INC	BEN US	纽约证券交易所	美国	11,658.00	1,856,932.64	0.01
495	MOHAWK INDUSTRIES INC	MOHAWK INDUSTRIES INC	MHK US	纽约证券交易所	美国	2,060.00	1,667,638.42	0.01
496	BIO-RAD LABORATORIES-AB	BIO-RAD LABORATORIES-AB	BIO US	纽约证券交易所	美国	793.00	1,543,495.48	0.01
497	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	PARA US	纳斯达克交易所	美国	19,220.00	1,423,192.03	0.01

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	MICROSOFT CORP	MSFT US	196,128,261.40	2.32
2	APPLE INC	AAPL US	180,230,275.11	2.14
3	NVIDIA CORP	NVDA US	109,810,487.27	1.30
4	ALPHABET INC	GOOGL US	57,153,628.03	0.68
		GOOG US	48,551,440.71	0.58
5	AMAZON.COM INC	AMZN US	100,819,766.27	1.19
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	59,287,255.26	0.70
7	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	46,197,248.39	0.55
8	EXXON MOBIL CORP	XOM US	44,693,975.96	0.53
9	TESLA INC	TSLA US	39,602,008.96	0.47
10	ELI LILLY & CO	LLY US	36,241,867.82	0.43
11	BROADCOM INC	AVGO US	35,383,568.87	0.42
12	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	34,325,113.31	0.41
13	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	32,071,918.72	0.38
14	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	28,428,446.87	0.34
15	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	25,676,746.34	0.30
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	24,386,649.16	0.29
17	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	24,135,154.23	0.29

18	MASTERCARD INC - A	MA US	24,037,971.56	0.28
19	HOME DEPOT INC	HD US	23,390,072.89	0.28
20	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	21,024,201.91	0.25

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	16,797,577.31	0.20
2	APPLE INC	AAPL US	8,813,424.53	0.10
3	ALPHABET INC	GOOG US	3,666,163.18	0.04
		GOOGL US	1,296,053.26	0.02
4	ILLUMINA INC	ILMN US	4,814,698.20	0.06
5	NVIDIA CORP	NVDA US	3,162,831.79	0.04
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	2,994,710.01	0.04
7	GENERAL MOTORS CO	GM US	2,476,514.33	0.03
8	WELLS FARGO & CO	WFC US	2,183,553.73	0.03
9	BROADCOM INC	AVGO US	1,904,564.66	0.02
10	ROBERT HALF INC	RHI US	1,901,057.59	0.02
11	CATERPILLAR INC	CAT US	1,811,567.04	0.02
12	COMERICA INC	CMA US	1,760,155.66	0.02
13	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,591,916.57	0.02
14	CHEVRON CORP	CVX US	1,581,552.35	0.02
15	DENTSPLY SIRONA INC	XRAY US	1,570,286.68	0.02
16	ZIONS BANCORP NA	ZION US	1,563,176.37	0.02
17	WHIRLPOOL CORP	WHR US	1,532,050.05	0.02
18	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	1,301,544.67	0.02
19	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	1,190,029.01	0.01
20	VF CORP	VFC US	1,108,941.61	0.01

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,852,694,108.17
卖出收入（成交）总额	107,299,587.35

注：“买入成交总金额”、“卖出成交总金额”按买入、卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

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 Sep24	-5,348,057.62	-0.04

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，因此此处公允价值实为公允价值变动金。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	46,040,168.51
2	应收清算款	178,586.83
3	应收股利	5,933,750.81
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	52,152,506.15

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
65,006	113,430.12	1,343,986,765.00	18.23%	2,044,550,145.00	27.73%	3,985,101,660.00	54.05%

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	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	226,380,500.00	3.07%
2	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)	71,453,498.00	0.97%
3	赵勇	61,891,000.00	0.84%
4	翠庭置业 (上海) 有限公司	54,083,500.00	0.73%
5	西南证券股份有限公司	52,740,973.00	0.72%
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)	51,831,200.00	0.70%
7	中信证券资管—工商银行—中信证券贵宾定制 6 号集合资产管理计划	39,620,500.00	0.54%
8	永安国富资产管理有限公司—永安国富—永富 16 号混合投资私募基金	35,900,900.00	0.49%
9	国泰君安证券股份有限公司	33,598,200.00	0.46%
10	张瑞英	31,921,100.00	0.43%
-	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	3,985,101,660.00	54.05%

注：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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 5 日）基金份额总额	565,043,200.00
本报告期期初基金份额总额	5,294,638,570.00
本报告期基金总申购份额	2,093,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,373,638,570.00

§ 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。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
摩根士丹利	-	2,926,398,199.15	100.00%	691,439.68	100.00%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
摩根士丹利	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-29
2	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-28
3	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-27

		露网站	
4	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	2024-06-26
5	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-18
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增民生证券为申购、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	2024-06-11
7	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-25
8	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-24
9	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
10	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
11	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
12	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增西南证券为申购、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	2024-04-22
13	关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金新增财通证券为申购、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	2024-04-22
14	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024-04-22
15	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-13
16	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2024-03-29
17	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-28
18	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东海证券为申购、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	2024-02-23
19	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-02-08
20	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金	上海证券报、基金管理人	2024-01-22

	2023 年第 4 季度报告	网站、证监会基金电子披露网站	
21	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-12
22	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年境外主要市场节假日暂停申购、赎回等交易类业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-11

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2024-01-01~2024-06-30	2,306,633,060.00	1,713,864,300.00	35,395,700.00	3,985,101,660.00	54.05%

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标普 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时标普 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
- 6、报告期内博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，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