

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资
资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告.....	13
6.1 审计意见.....	14
6.2 形成审计意见的基础.....	14
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	14
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	14
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	43
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	43

8.4 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	44
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	123
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	125
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	125
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	125
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	125
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	125
8.11 投资组合报告附注	125
§9 基金份额持有人信息	126
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	126
9.2 期末上市基金前十名持有人	127
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	127
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	127
§10 开放式基金份额变动	127
§11 重大事件揭示	128
11.1 基金份额持有人大会决议	128
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	128
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	128
11.4 基金投资策略的改变	128
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	128
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	129
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	129
11.8 其他重大事件	129
§12 影响投资者决策的其他重要信息	137
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	137
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	139
§13 备查文件目录	139
13.1 备查文件目录	139
13.2 存放地点	139
13.3 查阅方式	139

§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	7,928,638,570.00 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&P500Index（NTR，Net total Return））（经估值汇率调整，以人民币计价）。
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于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。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	95105568	95588
传真	0755-83195140	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	江向阳	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	209,281,994.52	70,708,585.77	74,825,190.75
本期利润	2,840,701,091.57	1,512,250,231.96	-968,138,561.38
加权平均基金份额本期利润	0.3941	0.3089	-0.1925

本期加权平均净值利润率	21.47%	21.63%	-13.43%
本期基金份额净值增长率	25.30%	26.09%	-11.94%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	2,394,245,353.13	1,449,094,457.96	1,907,262,978.33
期末可供分配基金份额利润	0.3020	0.2737	0.2576
期末基金资产净值	15,837,680,132.11	8,440,744,671.48	9,359,412,268.37
期末基金份额净值	1.9975	1.5942	1.2643
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	299.50%	218.84%	152.86%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.78%	0.81%	4.95%	0.81%	-0.17%	0.00%
过去六个月	8.67%	0.93%	9.15%	0.92%	-0.48%	0.01%
过去一年	25.30%	0.81%	26.36%	0.81%	-1.06%	0.00%
过去三年	39.13%	1.10%	43.75%	1.10%	-4.62%	0.00%
过去五年	89.44%	1.35%	98.26%	1.36%	-8.82%	-0.01%
自基金合同生效起至今	299.50%	1.10%	343.56%	1.10%	-44.06%	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

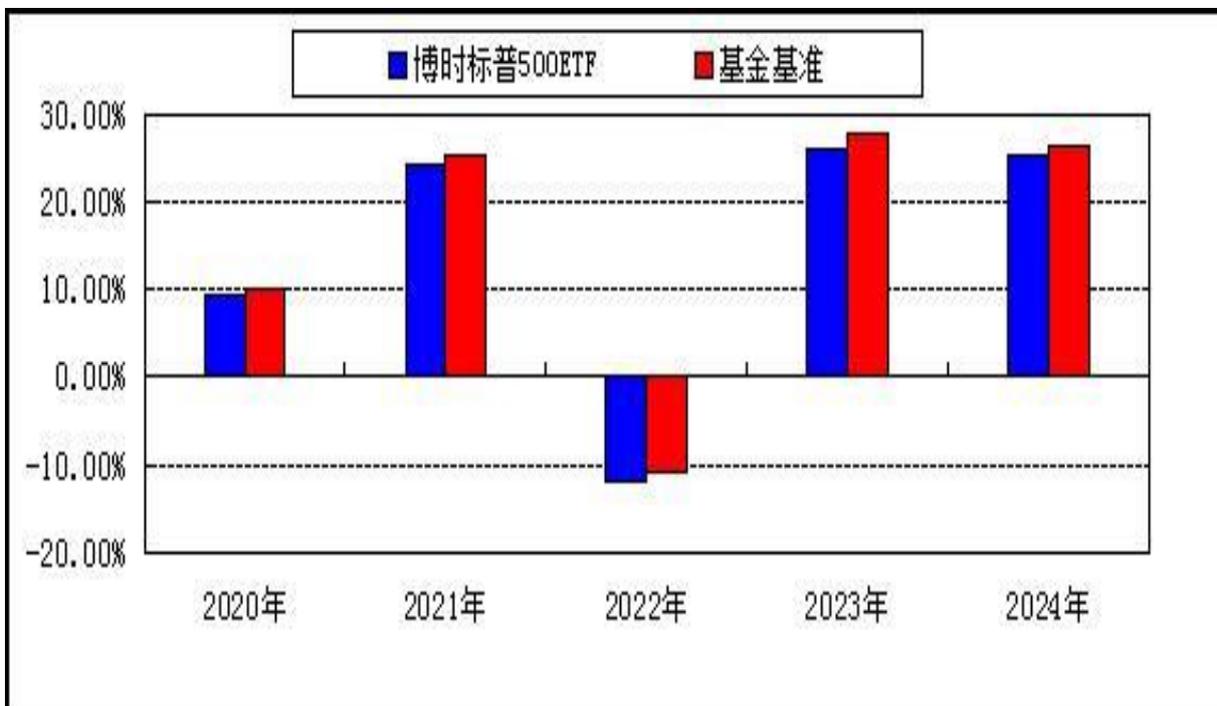
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2013 年 12 月 5 日至 2024 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 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 16089 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 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 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。

其他大事件

12 月，国家开发银行授予博时基金“优秀投资机构合作奖”，表彰公司在国家开发银行 2024 年银行间市场金融债券投资工作中表现突出。

11 月，深证投资者服务中心联合全景投教基地召开《股东来了》（2024）投资者权益知识竞赛深圳片区总结交流会，授予博时基金《股东来了》（2024）深圳片区突出贡献团体奖。

10 月，中国人民银行 2023 年度金融科技发展奖获奖项目名单出炉，博时基金“新一代资管业务资金清算系统”荣获三等奖。

4 月，深圳市人工智能学会公布 2023 年度第三届“深圳人工智能奖”获奖名单，博时基金“智能量化因子投研系统”荣获人工智能行业应用奖。

1 月，中国人民银行公布 2022 年度金融科技发展奖获奖项目名单，博时基金“陪伴服务平台项目”荣获三等奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		

万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2015-10-08	-	17.8	<p>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)、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-2024 年 11 月 8 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—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—至今)的基金经理。</p>
----	---------------------	------------	---	------	---

王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	8.4	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 公平交易制度和控制方法

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

4.4.2 公平交易制度的执行情况

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

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 132 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，美国通胀持续下行，经济指标向好，美股继续表现优异。从经济基本面上来看，2024

年美国的经济仍然保持强劲增长：一季度 GDP 环比增速 1.6%，二季度 GDP 环比增速 3%，三季度 GDP 环比增速 3.1%，四季度 GDP 预计环比增速 2.3%，私人消费全年贡献显著，尤其是耐用品和服务消费。通胀方面，通胀及核心通胀持续下行，美国 12 月 CPI 同比增速从 1 月的 3.1% 回落 0.2 个百分点至 2.9%，核心 CPI 同比增速从 1 月的 3.9% 回落至 3.2%，住所和运输服务仍是通胀主要黏性来源。从货币政策上来看，美联储在年内开启降息周期，全年一共降息 3 次。9 月降息 50bps，11 月和 12 月分别降息 25bps，目前利率降至 4.25%-4.50% 区间。2024 年美国股票市场有较好的表现，标普 500 指数和纳斯达克 100 指数分别上涨了 23.31% 和 24.88%。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.9975 元，份额累计净值为 3.9950 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 25.30%，同期业绩基准增长率为 26.36%。

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 2025 年，整体来看经济中期韧性仍在，经济修复路径和特朗普政策会影响市场预期，通胀仍然存在不确定性，美联储降息空间有限。通胀方面，1 月 CPI 数据略高于预期，市场对降息预期进行了部分调整，但目前看对于通胀的超预期不用过于担心，上半年通胀仍将处于下行趋势，后续通胀情况需关注特朗普关税、移民、减税各项政策的执行情况。流动性方面，预计 25 年仍有 1-2 次降息，目前从 CME 隐含利率预期看大概率 6-7 月开始下一次降息，降息预期也需紧密关注通胀数据的变化。财政政策方面，新成立的政府效率部不断改革以削减政府支出，短期可能有助于减少赤字，继续关注 4 月份新一年的财政预算情况。整体来看，美国经济或将在科技支撑下延续韧性，短期内美股可能继续震荡，但中长期表现将更多依赖于持续的盈利增长，美股仍然具有较好的配置价值。

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

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运

营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《制度管理规范》、《合规管理制度》、《全面风险管理制度》、《内部稽核审计制度》、《投资者适当性管理制度》、《公募基金证券交易佣金分配管理办法》、《货币市场基金投资管理制度》、《对外信息发布管理制度》、《公募基金法定信息披露管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，完善“博时合规管理及审计系统”中制度库应用、合规报告生成等模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的收益分配原则：基金收益每年最多分配 2 次。每次基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

容诚审字[2025]200Z0956 号

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“博时标普 500ETF”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时标普 500ETF 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时标普 500ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时标普 500ETF 的基金管理人博时基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

基金管理人治理层负责监督博时标普 500ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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

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

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

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

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

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

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

容诚会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
薛竞 吴琳杰

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

资产：			
货币资金	7.4.7.1	857,518,349.36	222,479,180.32
结算备付金		43,979,844.60	33,441,207.37
存出保证金		49,941,811.55	7,336,288.99
交易性金融资产	7.4.7.2	14,898,853,405.59	8,292,020,064.36
其中：股票投资		14,898,853,405.59	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	7.4.7.5	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		8,224,700.55	6,896,739.95
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		15,858,518,111.65	8,562,173,480.99
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		485,256.55	105,406,420.91
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,112,365.29	4,112,493.58
应付托管费		3,380,152.21	1,713,539.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,281,414.62	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	7,578,790.87	10,196,356.02
负债合计		20,837,979.54	121,428,809.51

净资产：			
实收基金	7.4.7.8	3,964,319,284.66	2,647,319,284.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	11,873,360,847.45	5,793,425,387.38
净资产合计		15,837,680,132.11	8,440,744,671.48
负债和净资产总计		15,858,518,111.65	8,562,173,480.99

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9975 元，基金份额总额 7,928,638,570.00 份。

7.2 利润表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
一、营业总收入		2,961,256,792.04	1,576,061,070.26
1.利息收入		23,093,212.96	442,412.21
其中：存款利息收入	7.4.7.10	23,093,212.96	442,412.21
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）		304,158,554.68	169,474,487.17
其中：股票投资收益	7.4.7.11	48,190,794.37	57,158,382.65
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	100,792,629.54	12,403,888.25
股利收益	7.4.7.16	155,175,130.77	99,912,216.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,631,419,097.05	1,441,541,646.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-48,916,240.66	-53,119,357.69
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	51,502,168.01	17,721,882.38
减：二、营业总支出		120,555,700.47	63,810,838.30
1. 管理人报酬		79,105,099.46	41,884,598.11
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		32,960,458.13	17,451,915.87
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		366,281.60	67,857.06
8. 其他费用	7.4.7.20	8,123,861.28	4,406,467.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,840,701,091.57	1,512,250,231.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,840,701,091.57	1,512,250,231.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,840,701,091.57	1,512,250,231.96

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,647,319,284.10	5,793,425,387.38	8,440,744,671.48
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）	1,317,000,000.56	6,079,935,460.07	7,396,935,460.63
（一）、综合收益总额	-	2,840,701,091.57	2,840,701,091.57
（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）	1,317,000,000.56	3,239,234,368.50	4,556,234,369.06
其中：1.基金申购款	1,337,000,000.58	3,286,958,347.61	4,623,958,348.19
2.基金赎回款	-20,000,000.02	-47,723,979.11	-67,723,979.13
（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、本期期末净资产	3,964,319,284.66	11,873,360,847.45	15,837,680,132.11
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,701,319,285.07	5,658,092,983.30	9,359,412,268.37
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）	-1,054,000,000.97	135,332,404.08	-918,667,596.89
（一）、综合收益总额	-	1,512,250,231.96	1,512,250,231.96
（二）、本期基金份额交易产生的	-1,054,000,000.97	-1,376,917,827.88	-2,430,917,828.85

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	993,999,999.23	1,925,808,023.06	2,919,808,022.29
2.基金赎回款	-2,048,000,000.20	-3,302,725,850.94	-5,350,725,851.14
（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、本期期末净资产	2,647,319,284.10	5,793,425,387.38	8,440,744,671.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]750 号《关于核准博时标普 500 交易型开放式证券投资基金募集的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 565,038,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2013）第 743 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 565,043,200.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 5,200.00 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期间不定，本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2014]1 号核准，本基金于 2014 年 1 月 15 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、境外上市交易的跟踪同一标的指数的公募基金。本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生工具、法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，

年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：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）

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产的分类

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

债务工具

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

式进行计量：

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果

该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率（经汇率调整）达到 1% 以上，方可进行收益分配。基金收益每

年最多分配 2 次。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	857,518,349.36	222,479,180.32
等于：本金	856,623,728.21	222,465,739.22
加：应计利息	894,621.15	13,441.10
定期存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	857,518,349.36	222,479,180.32

注：于 2024 年 12 月 31 日,银行存款中包含的外币余额为：美元 109,163,989.95(折合人民币 784,714,425.35)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	10,735,403,189.69	-	14,898,853,405.59	4,163,450,215.90
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	10,735,403,189.69	-	14,898,853,405.59	4,163,450,215.90
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,790,388,980.84	-	8,292,020,064.36	1,501,631,083.52
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	6,790,388,980.84	-	8,292,020,064.36	1,501,631,083.52

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	905,573,120.71	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	905,573,120.71	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	125,927,785.40	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	125,927,785.40	-	-	-

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。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	412.00	878,972,033.18	-26,601,087.53
合计	-	-	-	-26,601,087.53
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-26,601,087.53
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他权益工具投资

7.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	90,000.00	216,000.00
其他应付款	7,488,790.87	9,980,356.02
合计	7,578,790.87	10,196,356.02

7.4.7.8 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 12 月 31 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	2,674,000,000.00	1,337,000,000.58
本期赎回（以“-”号填列）	-40,000,000.00	-20,000,000.02
本期末	7,928,638,570.00	3,964,319,284.66

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

7.4.7.9 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	209,281,994.52	2,631,419,097.05	2,840,701,091.57
本期基金份额交易产生的变动数	735,868,900.65	2,503,365,467.85	3,239,234,368.50
其中：基金申购款	747,170,829.39	2,539,787,518.22	3,286,958,347.61
基金赎回款	-11,301,928.74	-36,422,050.37	-47,723,979.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,394,245,353.13	9,479,115,494.32	11,873,360,847.45

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	23,091,674.42	441,092.07
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	1,538.54	1,320.14
其他	-	-
合计	23,093,212.96	442,412.21

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	284,955,084.05	4,068,967,485.67
减：卖出股票成本总额	235,720,293.83	4,009,997,167.65
减：交易费用	1,043,995.85	1,811,935.37
买卖股票差价收入	48,190,794.37	57,158,382.65

7.4.7.12 基金投资收益

无发生额。

7.4.7.13 债券投资收益
7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益
7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.15 衍生工具收益
7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
期货投资收益	100,792,629.54	13,162,205.28
减：增值税抵减	-	-758,317.03
合计	100,792,629.54	12,403,888.25

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	155,175,130.77	99,912,216.27
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	155,175,130.77	99,912,216.27

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	2,661,819,132.38	1,419,058,799.89
——股票投资	2,661,819,132.38	1,419,058,799.89
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-30,400,035.33	22,482,846.30
——权证投资	-	-
——期货投资	-30,400,035.33	22,482,846.30
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	2,631,419,097.05	1,441,541,646.19

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	51,502,168.01	17,721,882.38
合计	51,502,168.01	17,721,882.38

7.4.7.19 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	90,000.00	96,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	3,015.47	1,925.76
指数使用费	7,910,845.81	4,188,541.50
合计	8,123,861.28	4,406,467.26

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行（“BBH”）	境外资产托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
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（“博时资本”）	基金管理人的子公司
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
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“博时标普 500ETF 联接”）	基金管理人管理的其他基金

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海

南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记,变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议,股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议,股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。于 2024 年 12 月 24 日,基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记,上述股东变更完成后,基金管理人股权结构为:招商证券股份有限公司 49%,中国长城资产管理股份有限公司 25%,上海汇华实业有限公司 12%,天津港(集团)有限公司 6%,上海盛业股权投资基金有限公司 6%和浙江省国际贸易集团有限公司 2%。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	79,105,099.46	41,884,598.11
其中:应支付销售机构的客户维护费	137,127.45	-
应支付基金管理人的净管理费	78,967,972.01	41,884,598.11
应支付投资顾问的投资顾问费(若有)	-	-

注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	32,960,458.13	17,451,915.87

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31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
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	4,057,389,461.00	51.17%	2,306,633,060.00	43.57%
招商证券	2,151,698.00	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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	776,927,903.48	23,091,674.42	208,528,732.97	441,092.07
布朗兄弟哈里曼银行	80,590,445.88	-	13,950,447.35	-

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，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。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、法律合规部、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；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风

险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	857,518,349.36	-	-	-	857,518,349.36
结算备付金	-	-	-	43,979,844.60	43,979,844.60
存出保证金	-	-	-	49,941,811.55	49,941,811.55
交易性金融资产	-	-	-	14,898,853,405.59	14,898,853,405.59
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	8,224,700.55	8,224,700.55
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	857,518,349.36	-	-	15,000,999,762.29	15,858,518,111.65
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	485,256.55	485,256.55
应付管理人报酬	-	-	-	8,112,365.29	8,112,365.29
应付托管费	-	-	-	3,380,152.21	3,380,152.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,281,414.62	1,281,414.62
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	7,578,790.87	7,578,790.87
负债总计	-	-	-	20,837,979.54	20,837,979.54
利率敏感度缺口	857,518,349.36	-	-	14,980,161,782.75	15,837,680,132.11
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者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	784,714,425.35	784,714,425.35
结算备付金	43,979,844.60	43,979,844.60
存出保证金	49,941,811.55	49,941,811.55
交易性金融资产	14,898,853,405.59	14,898,853,405.59
应收股利	8,224,700.55	8,224,700.55
应收证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-

资产合计	15,785,714,187.64	15,785,714,187.64
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	7,488,790.87	7,488,790.87
负债合计	7,488,790.87	7,488,790.87
资产负债表外汇风险敞口净额	15,778,225,396.77	15,778,225,396.77
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

7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 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 78,891	增加约 42,073
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 78,891	减少约 42,073

注：以上金额为四舍五入后的结果。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风

险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	14,898,853,405.59	94.07	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	14,898,853,405.59	94.07	8,292,020,064.36	98.24

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 77,508	增加约 43,957
	业绩比较基准下降 5%	减少约 77,508	减少约 43,957

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	14,898,853,405.59	8,292,020,064.36
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	14,898,853,405.59	8,292,020,064.36

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	14,898,853,405.59	93.95
	其中：普通股	14,604,988,509.52	92.10
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-

	房地产信托凭证	293,864,896.07	1.85
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	901,498,193.96	5.68
8	其他各项资产	58,166,512.10	0.37
9	合计	15,858,518,111.65	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	14,898,853,405.59	94.07
合计	14,898,853,405.59	94.07

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	474,622,884.88	3.00
公用事业	349,006,880.46	2.20
房地产	314,601,842.08	1.99
原材料	284,067,315.13	1.79
工业	1,126,956,704.67	7.12
非日常生活消费品	1,687,652,836.13	10.66
日常消费品	829,941,259.09	5.24
医疗保健	1,513,689,966.35	9.56
金融	2,039,789,851.63	12.88
信息技术	4,872,514,832.11	30.77
电信业务	1,406,009,033.06	8.88
合计	14,898,853,405.59	94.07

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.4 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称(中文)	证券代码	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	APPLE INC	APPLE INC	AAPL US	纳斯达克交易所 美国	633,100.00	1,139,655,419.94	7.20
2	NVIDIA CORP	NVIDIA CORP	NVDA US	纳斯达克交易所 美国	1,027,592.00	991,965,627.87	6.26
3	MICROSOFT CORP	MICROSOFT CORP	MSFT US	纳斯达克交易所 美国	311,462.00	943,702,015.30	5.96
4	AMAZON.COM INC	AMAZON.COM INC	AMZN US	纳斯达克交易所 美国	391,970.00	618,161,413.90	3.90
5	ALPHABET INC	ALPHABET INC-CLA	GOOGL US	纳斯达克交易所 美国	244,828.00	333,153,157.97	2.10

				易所			
5	ALPHABET INC	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	纳斯达克 美国 交易所	199,396.00	272,964,928.03	1.72
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	纳斯达克 美国 交易所	91,310.00	384,312,840.47	2.43
7	TESLA INC	TESLA INC	TSLA US	纳斯达克 美国 交易所	116,846.00	339,199,667.98	2.14
8	BROADCOM INC	BROADCOM INC	AVGO US	纳斯达克 美国 交易所	195,499.00	325,810,550.69	2.06
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/ B US	纽约证 美国 券交易 所	76,828.00	250,333,124.74	1.58
10	JPMORGAN CHASE & CO	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	纽约证 美国 券交易 所	117,989.00	203,310,546.51	1.28

11	ELI LILLY & CO	ELI LILLY & CO	LLY US	美国 纽约 证券 交易 所	33,008.00	183,176,073.9 6	1.16
12	VISA INC-CLASS A SHARES	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	美国 纽约 证券 交易 所	72,419.00	164,523,072.7 8	1.04
13	EXXON MOBIL CORP	EXXON MOBIL CORP	XOM US	美国 纽约 证券 交易 所	184,120.0 0	142,371,929.3 3	0.90
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	美国 纽约 证券 交易 所	38,554.00	140,194,836.4 2	0.89
15	MASTERCARD INC - A	MASTERCARD INC - A	MA US	美国 纽约 证券 交易 所	34,347.00	130,010,119.7 3	0.82
16	COSTCO WHOLESALE CORP	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	18,563.00	122,265,482.9 2	0.77
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	美国 纽 约	98,666.00	118,905,875.5 6	0.75

				证 券 交 易 所				
18	WALMART INC	WALMART INC	WMT US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	181,762.0 0	118,049,318.7 6	0.75
19	HOME DEPOT INC	HOME DEPOT INC	HD US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	41,612.00	116,356,128.3 7	0.73
20	NETFLIX INC	NETFLIX INC	NFLX US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	17,923.00	114,835,612.7 0	0.73
21	JOHNSON & JOHNSON	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	100,913.0 0	104,907,783.1 9	0.66
22	SALESFORCE.COM INC	SALESFORCE.COM INC	CRM US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	40,062.00	96,280,915.34	0.61
23	ABBVIE INC	ABBVIE INC	ABBV US	纽 约 证 券	美 国	74,039.00	94,575,840.09	0.60

				交易所			
24	BANK OF AMERICA CORP	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	美国 纽约证券交易所	279,748.00	88,380,835.99	0.56
25	ORACLE CORP	ORACLE CORP	ORCL US	美国 纽约证券交易所	67,343.00	80,668,494.51	0.51
26	MERCK & CO. INC.	MERCK & CO. INC.	MRK US	美国 纽约证券交易所	105,994.00	75,796,524.78	0.48
27	CHEVRON CORP	CHEVRON CORP	CVX US	美国 纽约证券交易所	70,017.00	72,899,449.77	0.46
28	COCA-COLA CO/THE	COCA-COLA CO/THE	KO US	美国 纽约证券交易所	162,453.00	72,705,805.06	0.46
29	CISCO SYSTEMS INC	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	美国 纳斯达克交易所	167,023.00	71,077,185.49	0.45

				所			
30	WELLS FARGO & CO	WELLS FARGO & CO	WFC US	纽约 美国 证券 交易 所	139,545.0 0	70,458,114.73	0.44
31	ACCENTURE PLC-CL A	ACCENTURE PLC-CL A	ACN US	纽约 美国 证券 交易 所	26,183.00	66,211,759.86	0.42
32	SERVICENOW INC	SERVICENOW INC	NOW US	纽约 美国 证券 交易 所	8,623.00	65,712,145.86	0.41
33	PEPSICO INC	PEPSICO INC	PEP US	纳 美国 斯 达 克 交 易 所	57,493.00	62,843,764.50	0.40
34	MCDONALD'S CORP	MCDONALD'S CORP	MCD US	纽约 美国 证券 交易 所	29,999.00	62,513,274.43	0.39
35	INTL BUSINESS MACHINES CORP	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	纽约 美国 证券 交易 所	38,750.00	61,233,756.42	0.39
36	WALT DISNEY CO/THE	WALT DISNEY CO/THE	DIS	纽 美	75,850.00	60,712,489.59	0.38

			US	纽约证 券交 易所			
37	LINDE PLC	LINDE PLC	LIN US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	19,958.00	60,064,946.73 0.38
38	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	TMO US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	16,032.00	59,953,609.19 0.38
39	ABBOTT LABORATORIES	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	72,659.00	59,077,574.20 0.37
40	ADVANCED MICRO DEVICES	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	67,965.00	59,013,114.81 0.37
41	ADOBE INC	ADOBE INC	ADBE US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	18,447.00	58,966,531.17 0.37
42	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	纽 约 证	美国	65,134.00	56,348,982.71 0.36

				券交易所			
43	INTUITIVE SURGICAL INC	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	纳斯达克 美国 交易所	14,929.00	56,014,462.89	0.35
44	GENERAL ELECTRIC	GENERAL ELECTRIC	GE US	纽约证 美国 券交易所	45,367.00	54,392,911.46	0.34
45	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	纽约证 美国 券交易所	13,150.00	54,128,314.15	0.34
46	INTUIT INC	INTUIT INC	INTU US	纳斯达克 美国 交易所	11,748.00	53,076,399.63	0.34
47	CATERPILLAR INC	CATERPILLAR INC	CAT US	纽约证 美国 券交易所	20,235.00	52,766,080.72	0.33
48	TEXAS INSTRUMENTS INC	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	纳斯达克 美国 交	38,217.00	51,512,575.22	0.33

				易所			
49	QUALCOMM INC	QUALCOMM INC	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	46,514.00	51,364,573.32 0.32
50	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	纽约证券交易所	美国	176,378.00	50,702,345.85 0.32
51	AMERICAN EXPRESS CO	AMERICAN EXPRESS CO	AXP US	纽约证券交易所	美国	23,305.00	49,719,941.22 0.31
52	BOOKING HOLDINGS INC	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	纳斯达克交易所	美国	1,388.00	49,572,406.58 0.31
53	AT&T INC	AT&T INC	T US	纽约证券交易所	美国	300,691.00	49,217,063.19 0.31
54	S&P GLOBAL INC	S&P GLOBAL INC	SPGI US	纽约证券交易所	美国	13,294.00	47,593,036.50 0.30

55	MORGAN STANLEY	MORGAN STANLEY	MS US	美国 纽约 证券 交易 所	51,966.00	46,963,007.02	0.30
56	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PLTR US	美国 纳斯 达克 交易 所	85,884.00	46,691,583.10	0.29
57	PFIZER INC	PFIZER INC	PFE US	美国 纽约 证券 交易 所	237,380.0 0	45,270,324.86	0.29
58	BLACKROCK INC	BLACKROCK INC	BLK US	美国 纽约 证券 交易 所	6,099.00	44,942,925.52	0.28
59	DANAHER CORP	DANAHER CORP	DHR US	美国 纽约 证券 交易 所	26,933.00	44,442,068.43	0.28
60	NEXTERA ENERGY INC	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	美国 纽约 证券 交易 所	86,174.00	44,408,598.59	0.28
61	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	美国 纳斯	27,246.00	44,241,719.02	0.28

				达 克 交 易 所			
62	COMCAST CORP-CLASS A	COMCAST CORP-CLASS A	CMCS A US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	159,975.0 0	43,158,159.80 0.27
63	PROGRESSIVE CORP	PROGRESSIVE CORP	PGR US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	24,543.00	42,273,170.58 0.27
64	AMGEN INC	AMGEN INC	AMG N US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	22,528.00	42,208,113.33 0.27
65	LOWE'S COS INC	LOWE'S COS INC	LOW US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	23,755.00	42,143,677.09 0.27
66	UNION PACIFIC CORP	UNION PACIFIC CORP	UNP US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	25,396.00	41,630,208.52 0.26
67	TJX COMPANIES INC	TJX COMPANIES INC	TJX US	纽 约 证 券	美国	47,260.00	41,042,030.35 0.26

				交易所			
68	APPLIED MATERIALS INC	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	纳斯达克交易所	美国	34,532.00	40,369,617.06 0.25
69	CITIGROUP INC	CITIGROUP INC	C US	纽约证券交易所	美国	79,221.00	40,085,150.72 0.25
70	BOEING CO/THE	BOEING CO/THE	BA US	纽约证券交易所	美国	31,302.00	39,826,999.53 0.25
71	BOSTON SCIENTIFIC CORP	BOSTON SCIENTIFIC CORP	BSX US	纽约证券交易所	美国	61,742.00	39,642,555.54 0.25
72	EATON CORP PLC	EATON CORP PLC	ETN US	纽约证券交易所	美国	16,554.00	39,491,459.25 0.25
73	CONOCOPHILLIPS	CONOCOPHILLIPS	COP US	纽约证券交易所	美国	54,196.00	38,634,899.14 0.24

				所			
74	UBER TECHNOLOGIES INC	UBER TECHNOLOGIES INC	UBER US	纽约证券交易所	美国	88,190.00	38,239,562.16 0.24
75	BLACKSTONE INC	BLACKSTONE INC	BX US	纽约证券交易所	美国	30,229.00	37,466,545.92 0.24
76	STRYKER CORP	STRYKER CORP	SYK US	纽约证券交易所	美国	14,366.00	37,181,843.01 0.23
77	AUTOMATIC DATA PROCESSING	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	纳斯达克交易所	美国	17,074.00	35,928,140.91 0.23
78	PALO ALTO NETWORKS INC	PALO ALTO NETWORKS INC	PANW US	纳斯达克交易所	美国	27,405.00	35,845,774.64 0.23
79	FISERV INC	FISERV INC	FI US	纽约证券交易所	美国	23,835.00	35,195,741.29 0.22
80	GILEAD SCIENCES INC	GILEAD SCIENCES INC	GILD	纳	美	52,231.00	34,680,992.69 0.22

			US	斯达克交易所			
81	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	美国 纽约证券交易所	84,971.00	34,547,161.14	0.22
82	ARISTA NETWORKS INC	ARISTA NETWORKS INC	ANET US	美国 纽约证券交易所	43,247.00	34,361,205.50	0.22
83	SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHW US	美国 纽约证券交易所	62,644.00	33,327,452.69	0.21
84	DEERE & CO	DEERE & CO	DE US	美国 纽约证券交易所	10,661.00	32,470,475.08	0.21
85	T-MOBILE US INC	T-MOBILE US INC	TMUS US	美国 纳斯达克交易所	20,418.00	32,397,149.37	0.20
86	ANALOG DEVICES INC	ANALOG DEVICES INC	ADI US	美国 纳斯达克	20,798.00	31,763,692.76	0.20

				克交易所			
87	MARSH & MCLENNAN COS	MARSH & MCLENNAN COS	MMC US	美国 纽约 证券 交易所	20,587.00	31,434,044.16	0.20
88	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX US	美国 纳斯 达克 交易 所	10,798.00	31,257,712.21	0.20
89	CHUBB LTD	CHUBB LTD	CB US	美国 纽约 证券 交易所	15,697.00	31,176,673.78	0.20
90	STARBUCKS CORP	STARBUCKS CORP	SBUX US	美国 纳斯 达克 交易 所	47,502.00	31,158,533.13	0.20
91	MEDTRONIC PLC	MEDTRONIC PLC	MDT US	美国 纽约 证券 交易所	53,720.00	30,846,528.54	0.19
92	KKR & CO INC	KKR & CO INC	KKR US	美国 纽约 证券 交	28,263.00	30,050,245.96	0.19

				易所			
93	PROLOGIS INC	PROLOGIS INC	PLD US	美国 纽约 证券 交易 所	38,795.00	29,476,979.47	0.19
94	MICRON TECHNOLOGY INC	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	46,365.00	28,049,700.37	0.18
95	LAM RESEARCH CORP	LAM RESEARCH CORP	LRCX US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	53,867.00	27,968,723.12	0.18
96	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	UPS US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	30,645.00	27,778,382.12	0.18
97	EQUINIX INC	EQUINIX INC	EQIX US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	4,043.00	27,402,930.33	0.17
98	GE VERNOVA INC	GE VERNOVA INC	GEV US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	11,547.00	27,302,655.32	0.17

99	SOUTHERN CO/THE	SOUTHERN CO/THE	SO US	美国 纽约证券交易所	45,907.00	27,165,425.38	0.17
100	NIKE INC -CL B	NIKE INC -CL B	NKE US	美国 纽约证券交易所	49,891.00	27,138,021.26	0.17
101	ALTRIA GROUP INC	ALTRIA GROUP INC	MO US	美国 纽约证券交易所	70,992.00	26,684,574.90	0.17
102	INTEL CORP	INTEL CORP	INTC US	美国 纳斯达克交易所	180,574.00	26,025,664.74	0.16
103	AMERICAN TOWER CORP	AMERICAN TOWER CORP	AMT US	美国 纽约证券交易所	19,580.00	25,814,750.61	0.16
104	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	ICE US	美国 纽约证券交易所	24,060.00	25,771,712.23	0.16
105	PAYPAL HOLDINGS INC	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	美国 纳斯达克交易所	42,004.00	25,770,711.60	0.16

				达 克 交 易 所			
10 6	ELEVANCE HEALTH INC	ELEVANCE HEALTH INC	ELV US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,716.00	25,764,896.18 0.16
10 7	KLA CORP	KLA CORP	KLAC US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	5,602.00	25,374,564.91 0.16
10 8	AMPHENOL CORP-CL A	AMPHENOL CORP-CL A	APH US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	50,508.00	25,215,330.07 0.16
10 9	CME GROUP INC	CME GROUP INC	CME US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	15,094.00	25,197,352.02 0.16
11 0	DUKE ENERGY CORP	DUKE ENERGY CORP	DUK US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	32,363.00	25,064,438.50 0.16
11 1	TRANE TECHNOLOGIES PLC	TRANE TECHNOLOGIES PLC	TT US	纽 约 证 券	美 国	9,429.00	25,034,330.11 0.16

				交易所			
11 2	CADENCE DESIGN SYS INC	CADENCE DESIGN SYS INC	CDNS US	纳斯达克 交易所	美国	11,495.00	24,827,207.50 0.16
11 3	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG US	纽约证 券交易 所	美国	57,085.00	24,744,093.78 0.16
11 4	PARKER HANNIFIN CORP	PARKER HANNIFIN CORP	PH US	纽约证 券交易 所	美国	5,394.00	24,661,573.25 0.16
11 5	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	纳斯 达克交 易所	美国	56,031.00	24,057,645.65 0.15
11 6	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	纳斯 达克交 易所	美国	9,754.00	23,990,772.04 0.15
11 7	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	SHW US	纽约证 券交易 所	美国	9,713.00	23,734,228.46 0.15

				所			
11 8	AON PLC-CLASS A	AON PLC-CLASS A	AON US	纽约 证券 交易 所	美国	9,057.00	23,383,233.48 0.15
11 9	MOTOROLA SOLUTIONS INC	MOTOROLA SOLUTIONS INC	MSI US	纽约 证券 交易 所	美国	7,004.00	23,272,149.70 0.15
12 0	THE CIGNA GROUP	THE CIGNA GROUP	CI US	纽约 证券 交易 所	美国	11,665.00	23,155,080.71 0.15
12 1	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC US	纽约 证券 交易 所	美国	16,616.00	23,034,477.33 0.15
12 2	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	4,435.00	22,709,475.03 0.14
12 3	US BANCORP	US BANCORP	USB US	纽约 证券 交易 所	美国	65,374.00	22,476,965.30 0.14
12	SYNOPSYS INC	SYNOPSYS INC	SNPS	纳	美	6,442.00	22,475,892.07 0.14

4			US	斯达克交易所			
12 5	WELLTOWER INC	WELLTOWER INC	WELL US	美国 纽约证券交易所	24,783.00	22,452,259.27	0.14
12 6	COLGATE-PALMOLIVE CO	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL US	美国 纽约证券交易所	34,223.00	22,364,643.03	0.14
12 7	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	APO US	美国 纽约证券交易所	18,724.00	22,229,809.56	0.14
12 8	MOODY'S CORP	MOODY'S CORP	MCO US	美国 纽约证券交易所	6,525.00	22,203,093.22	0.14
12 9	WASTE MANAGEMENT INC	WASTE MANAGEMENT INC	WM US	美国 纽约证券交易所	15,302.00	22,196,273.81	0.14
13 0	ZOETIS INC	ZOETIS INC	ZTS US	美国 纽约证	18,911.00	22,148,676.89	0.14

				券交易所			
13 1	MCKESSON CORP	MCKESSON CORP	MCK US	美国 纽约 证券 交易所	5,313.00	21,765,985.17	0.14
13 2	TRANSDIGM GROUP INC	TRANSDIGM GROUP INC	TDG US	美国 纽约 证券 交易所	2,356.00	21,462,489.84	0.14
13 3	EMERSON ELECTRIC CO	EMERSON ELECTRIC CO	EMR US	美国 纽约 证券 交易所	23,876.00	21,270,135.44	0.13
13 4	3M CO	3M CO	MMM US	美国 纽约 证券 交易所	22,819.00	21,174,903.74	0.13
13 5	CONSTELLATION ENERGY	CONSTELLATION ENERGY	CEG US	美国 纳斯 达克 交易 所	13,109.00	21,080,805.28	0.13
13 6	EOG RESOURCES INC	EOG RESOURCES INC	EOG US	美国 纽约 证券 交	23,565.00	20,764,395.71	0.13

				易所			
13 7	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY US	美国 纳斯达克 交易所	2,420.00	20,628,091.42	0.13
13 8	ILLINOIS TOOL WORKS	ILLINOIS TOOL WORKS	ITW US	美国 纽约证 券交易 所	11,253.00	20,510,738.49	0.13
13 9	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	COF US	美国 纽约证 券交易 所	15,986.00	20,491,422.11	0.13
14 0	GENERAL DYNAMICS CORP	GENERAL DYNAMICS CORP	GD US	美国 纽约证 券交易 所	10,811.00	20,476,807.16	0.13
14 1	WILLIAMS COS INC	WILLIAMS COS INC	WMB US	美国 纽约证 券交易 所	51,100.00	19,879,750.23	0.13
14 2	BECTON DICKINSON AND CO	BECTON DICKINSON AND CO	BDX US	美国 纽约证 券交易 所	12,102.00	19,736,332.59	0.12

14 3	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	APD US	纽约 证券 交易 所	美国	9,325.00	19,441,911.97	0.12
14 4	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MAR US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	9,665.00	19,379,603.64	0.12
14 5	AUTODESK INC	AUTODESK INC	ADSK US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	9,012.00	19,147,574.60	0.12
14 6	FEDEX CORP	FEDEX CORP	FDX US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	9,410.00	19,029,961.30	0.12
14 7	CINTAS CORP	CINTAS CORP	CTAS US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	14,365.00	18,865,851.57	0.12
14 8	TARGET CORP	TARGET CORP	TGT US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	19,298.00	18,752,405.25	0.12
14 9	CSX CORP	CSX CORP	CSX US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	80,828.00	18,749,644.33	0.12

				达 克 交 易 所			
15 0	ARTHUR J GALLAGHER & CO	ARTHUR J GALLAGHER & CO	AJG US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	9,187.00	18,745,405.97	0.12
15 1	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	HLT US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	10,211.00	18,141,729.96	0.11
15 2	FORTINET INC	FORTINET INC	FTNT US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	26,652.00	18,100,973.17	0.11
15 3	ECOLAB INC	ECOLAB INC	ECL US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	10,561.00	17,788,799.36	0.11
15 4	ONEOK INC	ONEOK INC	OKE US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	24,477.00	17,665,426.87	0.11
15 5	GENERAL MOTORS CO	GENERAL MOTORS CO	GM US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	46,060.00	17,637,574.69	0.11

				交易所			
15 6	TRUIST FINANCIAL CORP	TRUIST FINANCIAL CORP	TFC US	美国 纽约 证券 交易 所	55,620.00	17,344,139.89	0.11
15 7	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	RCL US	美国 纽约 证券 交易 所	10,362.00	17,183,221.66	0.11
15 8	CARRIER GLOBAL CORP	CARRIER GLOBAL CORP	CARR US	美国 纽约 证券 交易 所	34,947.00	17,147,800.39	0.11
15 9	AIRBNB INC-CLASS A	AIRBNB INC-CLASS A	ABNB US	美国 纳斯 达克 交易 所	18,139.00	17,134,600.83	0.11
16 0	CVS HEALTH CORP	CVS HEALTH CORP	CVS US	美国 纽约 证券 交易 所	52,700.00	17,005,619.45	0.11
16 1	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BK US	美国 纽约 证券 交易 所	30,463.00	16,824,251.01	0.11

				所			
16 2	ROPER TECHNOLOGIES INC	ROPER TECHNOLOGIES INC	ROP US	纳斯达克 美国 交易所	4,493.00	16,789,845.60	0.11
16 3	SEMPRA	SEMPRA	SRE US	纽约证 美国 券交易 所	26,547.00	16,739,647.50	0.11
16 4	DIGITAL REALTY TRUST INC	DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR US	纽约证 美国 券交易 所	13,068.00	16,658,027.53	0.11
16 5	WORKDAY INC-CLASS A	WORKDAY INC-CLASS A	WDA Y US	纳斯 美国 达克交 易所	8,924.00	16,552,439.13	0.10
16 6	HCA HEALTHCARE INC	HCA HEALTHCARE INC	HCA US	纽约证 美国 券交易 所	7,642.00	16,488,365.90	0.10
16 7	FREEMPORT-MCMORAN INC	FREEMPORT-MCMORAN INC	FCX US	纽约证 美国 券交易 所	60,205.00	16,480,171.85	0.10
16	TRAVELERS COS	TRAVELERS COS	TRV	纽美	9,512.00	16,471,109.29	0.10

8	INC/THE	INC/THE	US	纽约证 券交 易所			
16 9	PACCAR INC	PACCAR INC	PCAR US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	21,970.00	16,427,789.97 0.10
17 0	SCHLUMBERGER LTD	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	59,184.00	16,311,303.10 0.10
17 1	AUTOZONE INC	AUTOZONE INC	AZO US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	708.00	16,296,217.81 0.10
17 2	NORFOLK SOUTHERN CORP	NORFOLK SOUTHERN CORP	NSC US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	9,473.00	15,982,063.89 0.10
17 3	KINDER MORGAN INC	KINDER MORGAN INC	KMI US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	80,992.00	15,952,359.26 0.10
17 4	SIMON PROPERTY GROUP INC	SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	12,853.00	15,910,913.32 0.10

				券交易所			
17 5	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI US	纳斯达克 美国 交易所	10,643.00	15,901,801.45	0.10
17 6	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	JCI US	纽约证 美国 券交易所	27,985.00	15,878,140.83	0.10
17 7	AFLAC INC	AFLAC INC	AFL US	纽约证 美国 券交易所	20,945.00	15,574,033.77	0.10
17 8	AMERIPRISE FINANCIAL INC	AMERIPRISE FINANCIAL INC	AMP US	纽约证 美国 券交易所	4,066.00	15,561,882.36	0.10
17 9	ALLSTATE CORP	ALLSTATE CORP	ALL US	纽约证 美国 券交易所	11,096.00	15,377,409.75	0.10
18 0	COPART INC	COPART INC	CPRT US	纳斯 美国 达克交	36,741.00	15,157,215.76	0.10

				易所			
18 1	ROSS STORES INC	ROSS STORES INC	ROST US	纳斯达克 美国 交易所	13,901.00	15,115,798.21	0.10
18 2	AMERICAN ELECTRIC POWER	AMERICAN ELECTRIC POWER	AEP US	纳斯达克 美国 交易所	22,315.00	14,794,535.54	0.09
18 3	FAIR ISAAC CORP	FAIR ISAAC CORP	FICO US	纽约证 美国 券交易 所	1,021.00	14,612,144.84	0.09
18 4	CUMMINS INC	CUMMINS INC	CMI US	纽约证 美国 券交易 所	5,743.00	14,391,247.25	0.09
18 5	METLIFE INC	METLIFE INC	MET US	纽约证 美国 券交易 所	24,363.00	14,339,725.40	0.09
18 6	PUBLIC STORAGE	PUBLIC STORAGE	PSA US	纽约证 美国 券交易 所	6,601.00	14,208,616.17	0.09

18 7	PHILLIPS 66	PHILLIPS 66	PSX US	美国 纽约 证券 交易 所	17,305.00	14,172,352.20	0.09
18 8	MSCI INC	MSCI INC	MSCI US	美国 纽约 证券 交易 所	3,281.00	14,151,320.09	0.09
18 9	VISTRA CORP	VISTRA CORP	VST US	美国 纽约 证券 交易 所	14,245.00	14,117,716.77	0.09
19 0	REALTY INCOME CORP	REALTY INCOME CORP	O US	美国 纽约 证券 交易 所	36,667.00	14,077,650.92	0.09
19 1	WW GRAINGER INC	WW GRAINGER INC	GWV US	美国 纽约 证券 交易 所	1,855.00	14,055,210.75	0.09
19 2	QUANTA SERVICES INC	QUANTA SERVICES INC	PWR US	美国 纽约 证券 交易 所	6,183.00	14,047,119.49	0.09
19 3	UNITED RENTALS INC	UNITED RENTALS INC	URI US	美国 纽约	2,748.00	13,915,312.77	0.09

				证 券 交 易 所			
19 4	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	26,139.00	13,678,944.38 0.09
19 5	DOMINION ENERGY INC	DOMINION ENERGY INC	D US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	35,212.00	13,632,932.29 0.09
19 6	PAYCHEX INC	PAYCHEX INC	PAYX US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	13,422.00	13,528,804.87 0.09
19 7	MARATHON PETROLEUM CORP	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	13,466.00	13,503,459.72 0.09
19 8	HOWMET AEROSPACE INC	HOWMET AEROSPACE INC	HWM US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	17,017.00	13,378,685.56 0.08
19 9	P G & E CORP	P G & E CORP	PCG US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	91,622.00	13,290,862.50 0.08

				交易所			
200	KIMBERLY-CLARK CORP	KIMBERLY-CLARK CORP	KMB US	美国 纽约 证券 交易 所	13,970.00	13,159,292.07	0.08
201	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EW US	美国 纽约 证券 交易 所	24,705.00	13,146,944.91	0.08
202	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	DFS US	美国 纽约 证券 交易 所	10,530.00	13,112,445.98	0.08
203	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	FIS US	美国 纽约 证券 交易 所	22,550.00	13,092,689.38	0.08
204	LULULEMON ATHLETICA INC	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	美国 纳斯 达克 交易 所	4,731.00	13,005,121.80	0.08
205	AXON ENTERPRISE INC	AXON ENTERPRISE INC	AXON US	美国 纳斯 达克 交易 所	3,037.00	12,974,701.43	0.08

				所			
20 6	TE CONNECTIVITY PLC	TE CONNECTIVITY PLC	TEL US	纽约 美国 证券 交易所	12,528.00	12,875,345.67	0.08
20 7	NEWMONT CORP	NEWMONT CORP	NEM US	纽约 美国 证券 交易所	47,687.00	12,758,764.05	0.08
20 8	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	PRU US	纽约 美国 证券 交易所	14,913.00	12,706,488.21	0.08
20 9	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	PEG US	纽约 美国 证券 交易所	20,877.00	12,679,602.44	0.08
21 0	AMETEK INC	AMETEK INC	AME US	纽约 美国 证券 交易所	9,689.00	12,554,821.95	0.08
21 1	FASTENAL CO	FASTENAL CO	FAST US	纳斯 达克 美国 交易所	24,006.00	12,409,129.76	0.08
21	REPUBLIC SERVICES	REPUBLIC SERVICES	RSG	纽美	8,527.00	12,331,426.03	0.08

2	INC	INC	US	国 约 证 券 交 易 所			
21 3	KENVUE INC	KENVUE INC	KVUE US	美国 证 券 交 易 所	80,273.00	12,319,685.15	0.08
21 4	DR HORTON INC	DR HORTON INC	DHI US	美国 证 券 交 易 所	12,220.00	12,282,103.12	0.08
21 5	KROGER CO	KROGER CO	KR US	美国 证 券 交 易 所	27,871.00	12,251,273.86	0.08
21 6	BAKER HUGHES CO	BAKER HUGHES CO	BKR US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	41,459.00	12,224,939.38	0.08
21 7	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	LHX US	美国 证 券 交 易 所	7,947.00	12,012,500.45	0.08
21 8	CBRE GROUP INC - A	CBRE GROUP INC - A	CBRE US	美国 证 券 交 易 所	12,609.00	11,899,933.34	0.08

				券交易所			
21 9	CROWN CASTLE INC	CROWN CASTLE INC	CCI US	美国 纽约 证券 交易所	18,208.00	11,879,248.50	0.08
22 0	CENCORA INC	CENCORA INC	COR US	美国 纽约 证券 交易所	7,349.00	11,869,294.29	0.07
22 1	CORTEVA INC	CORTEVA INC	CTVA US	美国 纽约 证券 交易所	28,789.00	11,787,692.44	0.07
22 2	VERISK ANALYTICS INC	VERISK ANALYTICS INC	VRSK US	美国 纳斯 达克 交易所	5,948.00	11,776,451.22	0.07
22 3	TARGA RESOURCES CORP	TARGA RESOURCES CORP	TRGP US	美国 纽约 证券 交易所	9,137.00	11,723,953.33	0.07
22 4	VALERO ENERGY CORP	VALERO ENERGY CORP	VLO US	美国 纽约 证券 交	13,264.00	11,688,581.08	0.07

				易所			
22 5	DELTA AIR LINES INC	DELTA AIR LINES INC	DAL US	美国 纽约 证券 交易 所	26,863.00	11,682,670.35	0.07
22 6	XCEL ENERGY INC	XCEL ENERGY INC	XEL US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	24,057.00	11,676,324.00	0.07
22 7	FORD MOTOR CO	FORD MOTOR CO	F US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	163,508.0 0	11,636,072.98	0.07
22 8	AGILENT TECHNOLOGIES INC	AGILENT TECHNOLOGIES INC	A US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	12,046.00	11,632,697.60	0.07
22 9	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	CTSH US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	20,777.00	11,485,275.44	0.07
23 0	EXELON CORP	EXELON CORP	EXC US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	42,090.00	11,388,349.22	0.07

23 1	SYSCO CORP	SYSCO CORP	SYU US	美国 纽约 证券 交易 所	20,576.00	11,309,085.32	0.07
23 2	YUM! BRANDS INC	YUM! BRANDS INC	YUM US	美国 纽约 证券 交易 所	11,693.00	11,276,679.43	0.07
23 3	GARTNER INC	GARTNER INC	IT US	美国 纽约 证券 交易 所	3,232.00	11,255,647.33	0.07
23 4	OTIS WORLDWIDE CORP	OTIS WORLDWIDE CORP	OTIS US	美国 纽约 证券 交易 所	16,736.00	11,141,451.83	0.07
23 5	MONSTER BEVERAGE CORP	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	美国 纳斯 达克 交易 所	29,359.00	11,092,485.02	0.07
23 6	HESS CORP	HESS CORP	HES US	美国 纽约 证券 交易 所	11,572.00	11,064,325.76	0.07
23 7	CORNING INC	CORNING INC	GLW US	美国 纽约	32,285.00	11,028,322.51	0.07

				证 券 交 易 所			
23 8	INGERSOLL-RAND INC	INGERSOLL-RAND INC	IR US	美国 纽约 证 券 交 易 所	16,888.00	10,981,635.87	0.07
23 9	KEURIG DR PEPPER INC	KEURIG DR PEPPER INC	KDP US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	47,174.00	10,892,071.28	0.07
24 0	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GEHC US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	19,140.00	10,756,471.60	0.07
24 1	GENERAL MILLS INC	GENERAL MILLS INC	GIS US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	23,258.00	10,661,566.47	0.07
24 2	DELL TECHNOLOGIES -C	DELL TECHNOLOGIES -C	DELL US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	12,860.00	10,653,111.04	0.07
24 3	ELECTRONIC ARTS INC	ELECTRONIC ARTS INC	EA US	美国 纳 斯 达 克	10,000.00	10,516,629.20	0.07

				交易所			
24 4	ARCH CAPITAL GROUP LTD	ARCH CAPITAL GROUP LTD	ACGL US	纳斯达克交易所	美国	15,711.00	10,429,727.55 0.07
24 5	CONSTELLATION BRANDS INC-A	CONSTELLATION BRANDS INC-A	STZ US	纽约证券交易所	美国	6,539.00	10,388,093.42 0.07
24 6	VULCAN MATERIALS CO	VULCAN MATERIALS CO	VMC US	纽约证券交易所	美国	5,532.00	10,229,067.03 0.06
24 7	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA HOLDINGS INC	IQV US	纽约证券交易所	美国	7,223.00	10,203,155.51 0.06
24 8	IDEXX LABORATORIES INC	IDEXX LABORATORIES INC	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	3,432.00	10,199,808.23 0.06
24 9	RESMED INC	RESMED INC	RMD US	纽约证券交易所	美国	6,153.00	10,115,010.20 0.06

				所			
25 0	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	28,311.00	10,055,468.25 0.06
25 1	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	4,051.00	9,981,533.83 0.06
25 2	OLD DOMINION FREIGHT LINE	OLD DOMINION FREIGHT LINE	ODFL US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	7,870.00	9,979,425.69 0.06
25 3	WABTEC CORP	WABTEC CORP	WAB US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,203.00	9,816,599.59 0.06
25 4	LENNAR CORP-A	LENNAR CORP-A	LEN US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,999.00	9,801,840.80 0.06
25 5	ENTERGY CORP	ENTERGY CORP	ETR US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	17,957.00	9,787,004.73 0.06
25	ROCKWELL	ROCKWELL	ROK	纽	美	4,729.00	9,715,129.14 0.06

6	AUTOMATION INC	AUTOMATION INC	US	美国 纽约证券交易所			
25 7	NASDAQ INC	NASDAQ INC	NDAQ US	美国 纳斯达克交易所	17,338.00	9,635,336.97	0.06
25 8	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	UAL US	美国 纳斯达克交易所	13,778.00	9,616,956.37	0.06
25 9	DUPONT DE NEMOURS INC	DUPONT DE NEMOURS INC	DD US	美国 纽约证券交易所	17,507.00	9,595,858.06	0.06
26 0	EXTRA SPACE STORAGE INC	EXTRA SPACE STORAGE INC	EXR US	美国 纽约证券交易所	8,880.00	9,549,415.60	0.06
26 1	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	HIG US	美国 纽约证券交易所	12,143.00	9,549,388.29	0.06
26 2	GARMIN LTD	GARMIN LTD	GRM N US	美国 纽约证	6,437.00	9,544,007.19	0.06

				券交易所			
26 3	MARTIN MARIETTA MATERIALS	MARTIN MARIETTA MATERIALS	MLM US	纽约 美国 证券 交易所	2,561.00	9,508,502.82	0.06
26 4	EQUIFAX INC	EQUIFAX INC	EFX US	纽约 美国 证券 交易所	5,190.00	9,507,891.81	0.06
26 5	WILLIS TOWERS WATSON PLC	WILLIS TOWERS WATSON PLC	WTW US	纳斯 达克 美国 交易所	4,220.00	9,502,150.44	0.06
26 6	HP INC	HP INC	HPQ US	纽约 美国 证券 交易所	40,356.00	9,465,802.15	0.06
26 7	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVB US	纽约 美国 证券 交易所	5,951.00	9,409,913.70	0.06
26 8	M & T BANK CORP	M & T BANK CORP	MTB US	纽约 美国 证券 交	6,950.00	9,392,863.03	0.06

				易所			
26 9	CONSOLIDATED EDISON INC	CONSOLIDATED EDISON INC	ED US	美国 纽约 证券 交易 所	14,520.00	9,313,431.93	0.06
27 0	EDISON INTERNATIONAL	EDISON INTERNATIONAL	EIX US	美国 纽约 证券 交易 所	16,219.00	9,308,438.58	0.06
27 1	IRON MOUNTAIN INC	IRON MOUNTAIN INC	IRM US	美国 纽约 证券 交易 所	12,304.00	9,296,566.80	0.06
27 2	DECKERS OUTDOOR CORP	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK US	美国 纽约 证券 交易 所	6,361.00	9,286,374.00	0.06
27 3	VICI PROPERTIES INC	VICI PROPERTIES INC	VICI US	美国 纽约 证券 交易 所	44,172.00	9,274,934.60	0.06
27 4	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	MCHP US	美国 纳斯 达克 交易 所	22,486.00	9,269,960.08	0.06

27 5	DIAMONDBACK ENERGY INC	DIAMONDBACK ENERGY INC	FANG US	纳斯达克 交易所 美国	7,829.00	9,220,022.05	0.06
27 6	CENTENE CORP	CENTENE CORP	CNC US	纽约证 券交易 所 美国	21,151.00	9,210,695.18	0.06
27 7	HUMANA INC	HUMANA INC	HUM US	纽约证 券交易 所 美国	5,048.00	9,206,385.73	0.06
27 8	DEXCOM INC	DEXCOM INC	DXC M US	纳斯 达克 交易 所 美国	16,367.00	9,149,838.25	0.06
27 9	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TTWO US	纳斯 达克 交易 所 美国	6,846.00	9,058,905.64	0.06
28 0	WEC ENERGY GROUP INC	WEC ENERGY GROUP INC	WEC US	纽约证 券交易 所 美国	13,254.00	8,959,666.04	0.06
28 1	EBAY INC	EBAY INC	EBAY US	纳斯 达克 交易 所 美国	20,064.00	8,934,928.17	0.06

				达 克 交 易 所			
28 2	ANSYS INC	ANSYS INC	ANSS US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	3,664.00	8,884,697.93 0.06
28 3	COSTAR GROUP INC	COSTAR GROUP INC	CSGP US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	17,172.00	8,837,012.67 0.06
28 4	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	MPW R US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	2,043.00	8,689,647.74 0.05
28 5	STATE STREET CORP	STATE STREET CORP	STT US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	12,275.00	8,660,521.42 0.05
28 6	CARDINAL HEALTH INC	CARDINAL HEALTH INC	CAH US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	10,133.00	8,614,793.57 0.05
28 7	GLOBAL PAYMENTS INC	GLOBAL PAYMENTS INC	GPN US	纽 约 证 券	美 国	10,660.00	8,586,972.23 0.05

				交易所			
28 8	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	RJF US	美国 纽约 证券 交易 所	7,664.00	8,557,424.45	0.05
28 9	TRACTOR SUPPLY COMPANY	TRACTOR SUPPLY COMPANY	TSCO US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	22,398.00	8,542,966.86	0.05
29 0	FIFTH THIRD BANCORP	FIFTH THIRD BANCORP	FITB US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	28,107.00	8,542,435.49	0.05
29 1	XYLEM INC	XYLEM INC	XYL US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	10,172.00	8,483,429.36	0.05
29 2	DOW INC	DOW INC	DOW US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	29,332.00	8,461,416.47	0.05
29 3	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	KEYS US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	7,267.00	8,391,006.45	0.05

				所			
29 4	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	HPE US	纽约 证券 交易 所	美国	54,374.00	8,344,905.02 0.05
29 5	PPG INDUSTRIES INC	PPG INDUSTRIES INC	PPG US	纽约 证券 交易 所	美国	9,716.00	8,342,685.96 0.05
29 6	GODADDY INC - CLASS A	GODADDY INC - CLASS A	GDDY US	纽约 证券 交易 所	美国	5,877.00	8,338,137.78 0.05
29 7	EQT CORP	EQT CORP	EQT US	纽约 证券 交易 所	美国	25,005.00	8,288,085.39 0.05
29 8	NUCOR CORP	NUCOR CORP	NUE US	纽约 证券 交易 所	美国	9,832.00	8,248,636.67 0.05
29 9	KRAFT HEINZ CO/THE	KRAFT HEINZ CO/THE	KHC US	纳斯 达克 交易 所	美国	36,986.00	8,164,872.69 0.05
30	ON SEMICONDUCTOR	ON SEMICONDUCTOR	ON	纳	美	17,833.00	8,082,425.98 0.05

0			US	斯达克交易所			
30 1	SMURFIT WESTROCK PLC	SMURFIT WESTROCK PLC	SW US	美国 纽约证券交易所	20,714.00	8,019,781.88	0.05
30 2	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	BR US	美国 纽约证券交易所	4,896.00	7,957,103.34	0.05
30 3	FORTIVE CORP	FORTIVE CORP	FTV US	美国 纽约证券交易所	14,529.00	7,833,019.77	0.05
30 4	CARNIVAL CORP	CARNIVAL CORP	CCL US	美国 纽约证券交易所	43,511.00	7,794,339.85	0.05
30 5	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	MTD US	美国 纽约证券交易所	886.00	7,793,522.96	0.05
30 6	DOVER CORP	DOVER CORP	DOV US	美国 纽约证	5,746.00	7,748,732.90	0.05

				券交易所			
307	CHURCH & DWIGHT CO INC	CHURCH & DWIGHT CO INC	CHD US	美国 纽约证券交易所	10,264.00	7,725,685.74	0.05
308	SYNCHRONY FINANCIAL	SYNCHRONY FINANCIAL	SYF US	美国 纽约证券交易所	16,308.00	7,619,847.77	0.05
309	VERALTO CORP	VERALTO CORP	VLTO US	美国 纽约证券交易所	10,364.00	7,587,883.83	0.05
310	T ROWE PRICE GROUP INC	T ROWE PRICE GROUP INC	TROW US	美国 纳斯达克交易所	9,309.00	7,567,622.68	0.05
311	HERSHEY CO/THE	HERSHEY CO/THE	HSY US	美国 纽约证券交易所	6,192.00	7,537,865.50	0.05
312	DTE ENERGY COMPANY	DTE ENERGY COMPANY	DTE US	美国 纽约证券交易所	8,677.00	7,531,629.93	0.05

				易所			
31 3	VENTAS INC	VENTAS INC	VTR US	纽约 证券 交易 所	美国	17,572.00	7,438,664.72 0.05
31 4	TYLER TECHNOLOGIES INC	TYLER TECHNOLOGIES INC	TYL US	纽约 证券 交易 所	美国	1,793.00	7,432,198.32 0.05
31 5	EQUITY RESIDENTIAL	EQUITY RESIDENTIAL	EQR US	纽约 证券 交易 所	美国	14,303.00	7,378,053.57 0.05
31 6	AMERICAN WATER WORKS CO INC	AMERICAN WATER WORKS CO INC	AWK US	纽约 证券 交易 所	美国	8,164.00	7,305,832.29 0.05
31 7	BROWN & BROWN INC	BROWN & BROWN INC	BRO US	纽约 证券 交易 所	美国	9,942.00	7,291,070.77 0.05
31 8	ARCHER-DANIELS-MIDL AND CO	ARCHER-DANIELS-MIDL AND CO	ADM US	纽约 证券 交易 所	美国	20,032.00	7,274,780.41 0.05

319	PPL CORP	PPL CORP	PPL US	美国 纽约证券交易所	30,921.00	7,214,965.88	0.05
320	HALLIBURTON CO	HALLIBURTON CO	HAL US	美国 纽约证券交易所	36,812.00	7,195,000.96	0.05
321	NVR INC	NVR INC	NVR US	美国 纽约证券交易所	122.00	7,172,770.98	0.05
322	AMEREN CORPORATION	AMEREN CORPORATION	AEE US	美国 纽约证券交易所	11,179.00	7,163,212.28	0.05
323	NETAPP INC	NETAPP INC	NTAP US	美国 纳斯达克交易所	8,582.00	7,161,073.73	0.05
324	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WST US	美国 纽约证券交易所	3,036.00	7,148,663.67	0.05
325	HUNTINGTON BANCSHARES INC	HUNTINGTON BANCSHARES INC	HBAN US	美国 纳斯达克交易所	60,818.00	7,112,985.49	0.04

				达 克 交 易 所			
32 6	WARNER BROS DISCOVERY INC	WARNER BROS DISCOVERY INC	WBD US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	93,600.00	7,111,857.92 0.04
32 7	CORPAY INC	CORPAY INC	CPAY US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,920.00	7,103,479.12 0.04
32 8	CDW CORP/DE	CDW CORP/DE	CDW US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,586.00	6,988,472.19 0.04
32 9	EXPEDIA GROUP INC	EXPEDIA GROUP INC	EXPE US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	5,144.00	6,889,948.56 0.04
33 0	HUBBELL INC	HUBBELL INC	HUBB US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,248.00	6,769,062.67 0.04
33 1	CINCINNATI FINANCIAL CORP	CINCINNATI FINANCIAL CORP	CINF US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	6,552.00	6,768,039.62 0.04

				交易所			
33 2	PULTEGROUP INC	PULTEGROUP INC	PHM US	美国 纽约 证券 交易 所	8,587.00	6,722,047.52	0.04
33 3	BIOGEN INC	BIOGEN INC	BIIB US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	6,106.00	6,712,021.28	0.04
33 4	PTC INC	PTC INC	PTC US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	5,031.00	6,649,629.20	0.04
33 5	WATERS CORP	WATERS CORP	WAT US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	2,491.00	6,642,880.81	0.04
33 6	DARDEN RESTAURANTS INC	DARDEN RESTAURANTS INC	DRI US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	4,925.00	6,609,361.80	0.04
33 7	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBAC US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	4,509.00	6,605,666.60	0.04

				所			
33 8	KELLANOVA	KELLANOVA	K US	纽约 美国 证券 交易 所	11,266.00	6,557,316.13	0.04
33 9	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TDY US	纽约 美国 证券 交易 所	1,953.00	6,515,895.64	0.04
34 0	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	IFF US	纽约 美国 证券 交易 所	10,716.00	6,512,962.12	0.04
34 1	ATMOS ENERGY CORP	ATMOS ENERGY CORP	ATO US	纽约 美国 证券 交易 所	6,504.00	6,511,339.56	0.04
34 2	DEVON ENERGY CORP	DEVON ENERGY CORP	DVN US	纽约 美国 证券 交易 所	27,525.00	6,475,981.04	0.04
34 3	REGIONS FINANCIAL CORP	REGIONS FINANCIAL CORP	RF US	纽约 美国 证券 交易 所	38,086.00	6,439,244.50	0.04
34	EVERSOURCE ENERGY	EVERSOURCE ENERGY	ES US	纽美	15,353.00	6,338,176.10	0.04

4				约	国			
34 5	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZBH US	纽	美	8,342.00	6,334,169.79	0.04
34 6	TEXAS PACIFIC LAND CORP	TEXAS PACIFIC LAND CORP	TPL US	纽	美	791.00	6,288,515.55	0.04
34 7	CENTERPOINT ENERGY INC	CENTERPOINT ENERGY INC	CNP US	纽	美	27,316.00	6,230,449.95	0.04
34 8	WESTERN DIGITAL CORP	WESTERN DIGITAL CORP	WDC US	纳	美	14,490.00	6,211,055.79	0.04
34 9	CBOE GLOBAL MARKETS INC	CBOE GLOBAL MARKETS INC	CBOE US	巴	美	4,406.00	6,188,726.46	0.04
35 0	ULTA BEAUTY INC	ULTA BEAUTY INC	ULTA US	纳	美	1,974.00	6,171,613.90	0.04

				交易所			
35 1	TERADYNE INC	TERADYNE INC	TER US	纳斯达克 美国 交易所	6,817.00	6,170,498.41	0.04
35 2	WEYERHAEUSER CO	WEYERHAEUSER CO	WY US	纽约证 美国 券交易 所	30,467.00	6,165,102.87	0.04
35 3	FIRSTENERGY CORP	FIRSTENERGY CORP	FE US	纽约证 美国 券交易 所	21,490.00	6,145,163.32	0.04
35 4	NORTHERN TRUST CORP	NORTHERN TRUST CORP	NTRS US	纳斯 美国 达克交 易所	8,303.00	6,117,741.73	0.04
35 5	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	LYV US	纽约证 美国 券交易 所	6,567.00	6,113,205.85	0.04
35 6	STERIS PLC	STERIS PLC	STE US	纽约证 美国 券交易 所	4,137.00	6,113,027.72	0.04

				所			
35 7	SOUTHWEST AIRLINES CO	SOUTHWEST AIRLINES CO	LUV US	纽约 证券 交易 所	美国	25,129.00	6,073,026.15 0.04
35 8	CLOROX COMPANY	CLOROX COMPANY	CLX US	纽约 证券 交易 所	美国	5,184.00	6,052,154.34 0.04
35 9	PACKAGING CORP OF AMERICA	PACKAGING CORP OF AMERICA	PKG US	纽约 证券 交易 所	美国	3,736.00	6,046,060.30 0.04
36 0	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CLA	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CLA	ZBRA US	纳斯 达克 交易 所	美国	2,162.00	6,002,368.92 0.04
36 1	CMS ENERGY CORP	CMS ENERGY CORP	CMS US	纽约 证券 交易 所	美国	12,515.00	5,996,022.35 0.04
36 2	LENNOX INTERNATIONAL INC	LENNOX INTERNATIONAL INC	LII US	纽约 证券 交易 所	美国	1,344.00	5,886,575.01 0.04
36	LYONDELLBASELL	LYONDELLBASELL	LYB	纽	美	10,884.00	5,810,776.78 0.04

3	INDU-CL A	INDU-CL A	US	纽约证 券交易 所			
36 4	CITIZENS FINANCIAL GROUP	CITIZENS FINANCIAL GROUP	CFG US	美国 纽约证 券交易 所	18,460.00	5,806,858.53	0.04
36 5	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MKC US	美国 纽约证 券交易 所	10,565.00	5,790,080.80	0.04
36 6	LEIDOS HOLDINGS INC	LEIDOS HOLDINGS INC	LDOS US	美国 纽约证 券交易 所	5,589.00	5,787,749.89	0.04
36 7	LABCORP HOLDINGS INC	LABCORP HOLDINGS INC	LH US	美国 纽约证 券交易 所	3,502.00	5,772,850.50	0.04
36 8	FIRST SOLAR INC	FIRST SOLAR INC	FSLR US	美国 纳斯 达克交 易所	4,486.00	5,683,239.90	0.04
36 9	COTERRA ENERGY INC	COTERRA ENERGY INC	CTRA US	美国 纽约证	30,881.00	5,669,496.40	0.04

				券交易所			
370	INTERNATIONAL PAPER CO	INTERNATIONAL PAPER CO	IP US	美国 纽约证券交易所	14,560.00	5,632,968.26	0.04
371	ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESS US	美国 纽约证券交易所	2,693.00	5,525,650.62	0.03
372	COOPER COS INC/THE	COOPER COS INC/THE	COO US	美国 纳斯达克交易所	8,347.00	5,515,944.77	0.03
373	INSULET CORP	INSULET CORP	PODD US	美国 纳斯达克交易所	2,939.00	5,515,549.55	0.03
374	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	STX US	美国 纳斯达克交易所	8,866.00	5,500,739.51	0.03
375	NRG ENERGY INC	NRG ENERGY INC	NRG US	美国 纽约证券交易所	8,479.00	5,498,949.02	0.03

				易所			
37 6	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	FDS US	纽约 证券 交易 所	美国	1,592.00	5,496,292.05 0.03
37 7	INVITATION HOMES INC	INVITATION HOMES INC	INVH US	纽约 证券 交易 所	美国	23,879.00	5,487,708.16 0.03
37 8	MID-AMERICA APARTMENT COMM	MID-AMERICA APARTMENT COMM	MAA US	纽约 证券 交易 所	美国	4,894.00	5,437,777.18 0.03
37 9	LAS VEGAS SANDS CORP	LAS VEGAS SANDS CORP	LVS US	纽约 证券 交易 所	美国	14,577.00	5,381,773.36 0.03
38 0	SNAP-ON INC	SNAP-ON INC	SNA US	纽约 证券 交易 所	美国	2,199.00	5,366,259.35 0.03
38 1	WR BERKLEY CORP	WR BERKLEY CORP	WRB US	纽约 证券 交易 所	美国	12,614.00	5,306,270.43 0.03

38 2	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	EL US	美国 纽约 证券 交易 所	9,776.00	5,269,129.40	0.03
38 3	TRIMBLE INC	TRIMBLE INC	TRMB US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	10,232.00	5,197,163.74	0.03
38 4	NISOURCE INC	NISOURCE INC	NI US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	19,557.00	5,167,850.89	0.03
38 5	VERISIGN INC	VERISIGN INC	VRSN US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	3,463.00	5,151,944.11	0.03
38 6	KEYCORP	KEYCORP	KEY US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	41,521.00	5,115,768.20	0.03
38 7	QUEST DIAGNOSTICS INC	QUEST DIAGNOSTICS INC	DGX US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	4,678.00	5,073,019.79	0.03
38 8	OMNICOM GROUP	OMNICOM GROUP	OMC US	美国 纽 约	8,174.00	5,055,536.74	0.03

				证 券 交 易 所				
38 9	FOX CORP	FOX CORP - CLASS A	FOXA US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	9,265.00	3,235,453.55	0.02
38 9	FOX CORP	FOX CORP - CLASS B	FOX US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	5,529.00	1,817,920.91	0.01
39 0	BEST BUY CO INC	BEST BUY CO INC	BBY US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	8,187.00	5,049,452.76	0.03
39 1	HOLOGIC INC	HOLOGIC INC	HOLX US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	9,734.00	5,044,273.23	0.03
39 2	DOLLAR GENERAL CORP	DOLLAR GENERAL CORP	DG US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,215.00	5,022,400.66	0.03
39 3	MOLINA HEALTHCARE INC	MOLINA HEALTHCARE INC	MOH US	纽 约 证 券	美 国	2,396.00	5,012,872.43	0.03

				交易所			
39 4	PENTAIR PLC	PENTAIR PLC	PNR US	美国 纽约 证券 交易 所	6,923.00	5,008,379.11	0.03
39 5	JACOBS SOLUTIONS INC	JACOBS SOLUTIONS INC	J US	美国 纽约 证券 交易 所	5,201.00	4,995,633.36	0.03
39 6	BALL CORP	BALL CORP	BALL US	美国 纽约 证券 交易 所	12,498.00	4,952,913.56	0.03
39 7	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	BLDR US	美国 纽约 证券 交易 所	4,818.00	4,950,196.34	0.03
39 8	TYSON FOODS INC-CLA	TYSON FOODS INC-CLA	TSN US	美国 纽约 证券 交易 所	11,969.00	4,942,020.40	0.03
39 9	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	PFG US	美国 纳斯 达克 交易	8,814.00	4,904,585.94	0.03

40	JABIL INC	JABIL INC	JBL US	美国 纽约 证券 交易 所	4,724.00	4,886,556.43	0.03
40	GENUINE PARTS CO	GENUINE PARTS CO	GPC US	美国 纽约 证券 交易 所	5,820.00	4,884,828.34	0.03
40	STEEL DYNAMICS INC	STEEL DYNAMICS INC	STLD US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	5,932.00	4,864,126.03	0.03
40	IDEX CORP	IDEX CORP	IEX US	美国 纽约 证券 交易 所	3,172.00	4,772,147.87	0.03
40	KIMCO REALTY CORP	KIMCO REALTY CORP	KIM US	美国 纽约 证券 交易 所	28,260.00	4,759,668.23	0.03
40	MASCO CORP	MASCO CORP	MAS US	美国 纽约 证券 交易 所	9,037.00	4,714,261.19	0.03
40	EVEREST GROUP LTD	EVEREST GROUP LTD	EG US	美 纽	1,800.00	4,689,913.44	0.03

6				约	国			
40 7	EXPEDITORS INTL WASH INC	EXPEDITORS INTL WASH INC	EXPD US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,861.00	4,666,874.40	0.03
40 8	SUPER MICRO COMPUTER INC	SUPER MICRO COMPUTER INC	SMCI US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	21,095.00	4,621,965.80	0.03
40 9	LOEWS CORP	LOEWS CORP	L US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,571.00	4,609,115.75	0.03
41 0	TAPESTRY INC	TAPESTRY INC	TPR US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,759.00	4,583,003.74	0.03
41 1	ALLIANT ENERGY CORP	ALLIANT ENERGY CORP	LNT US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	10,753.00	4,571,336.61	0.03
41 2	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	ARE US	纽 约 证	美 国	6,517.00	4,569,905.61	0.03

				券交易所			
41 3	DOLLAR TREE INC	DOLLAR TREE INC	DLTR US	纳斯达克 美国 交易所	8,471.00	4,563,316.65	0.03
41 4	AVERY DENNISON CORP	AVERY DENNISON CORP	AVY US	纽约证 美国 券交易所	3,365.00	4,526,481.21	0.03
41 5	BAXTER INTERNATIONAL INC	BAXTER INTERNATIONAL INC	BAX US	纽约证 美国 券交易所	21,394.00	4,484,476.44	0.03
41 6	VIATRIS INC	VIATRIS INC	VTRS US	纳斯达克 美国 交易所	50,037.00	4,478,090.34	0.03
41 7	GEN DIGITAL INC	GEN DIGITAL INC	GEN US	纳斯达克 美国 交易所	22,722.00	4,472,107.50	0.03
41 8	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF US	纽约证 美国 券交易所	7,288.00	4,469,834.53	0.03

				易所			
41 9	ALIGN TECHNOLOGY INC	ALIGN TECHNOLOGY INC	ALGN US	纳斯达克 交易所	美国	2,942.00	4,409,626.36 0.03
42 0	F5 INC	F5 INC	FFIV US	纳斯达克 交易所	美国	2,435.00	4,401,669.02 0.03
42 1	DOMINO'S PIZZA INC	DOMINO'S PIZZA INC	DPZ US	纳斯达克 交易所	美国	1,446.00	4,363,164.43 0.03
42 2	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	AKA M US	纳斯达克 交易所	美国	6,294.00	4,327,568.48 0.03
42 3	APTIV PLC	APTIV PLC	APTIV US	纽约证 券交易 所	美国	9,846.00	4,280,592.14 0.03
42 4	TEXTRON INC	TEXTRON INC	TXT US	纽约证 券交易 所	美国	7,771.00	4,272,812.20 0.03

425	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	DOC US	纽约证券交易所 美国	29,312.00	4,271,018.34	0.03
426	EVERGY INC	EVERGY INC	EVRG US	纳斯达克交易所 美国	9,638.00	4,264,294.74	0.03
427	SKYWORKS SOLUTIONS INC	SKYWORKS SOLUTIONS INC	SWKS US	纳斯达克交易所 美国	6,688.00	4,263,381.38	0.03
428	MODERNA INC	MODERNA INC	MRNA US	纳斯达克交易所 美国	14,185.00	4,239,806.74	0.03
429	NEWS CORP	NEWS CORP - CLASS A	NWSA US	纳斯达克交易所 美国	15,877.00	3,143,146.45	0.02
429	NEWS CORP	NEWS CORP - CLASS B	NWS US	纳斯达克交易所 美国	4,694.00	1,026,779.70	0.01
430	AMCOR PLC	AMCOR PLC	AMCR US	纽约交易所 美国	60,542.00	4,095,233.06	0.03

				证 券 交 易 所			
43 1	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	JBHT US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	3,338.00	4,094,966.08 0.03
43 2	REVVITY INC	REVVITY INC	RVTY US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	5,100.00	4,091,716.35 0.03
43 3	EPAM SYSTEMS INC	EPAM SYSTEMS INC	EPAM US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	2,379.00	3,998,603.43 0.03
43 4	CONAGRA BRANDS INC	CONAGRA BRANDS INC	CAG US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	19,999.00	3,989,362.52 0.03
43 5	UDR INC	UDR INC	UDR US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	12,583.00	3,926,505.57 0.02
43 6	ROLLINS INC	ROLLINS INC	ROL US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	11,778.00	3,924,221.60 0.02

				交易所			
43 7	POOL CORP	POOL CORP	POOL US	纳斯达克 交易所	美国	1,597.00	3,913,948.51 0.02
43 8	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	JKHY US	纳斯达克 交易所	美国	3,059.00	3,854,727.02 0.02
43 9	CARMAX INC	CARMAX INC	KMX US	纽约证 券交易 所	美国	6,491.00	3,814,913.78 0.02
44 0	JUNIPER NETWORKS INC	JUNIPER NETWORKS INC	JNPR US	纽约证 券交易 所	美国	13,868.00	3,733,342.98 0.02
44 1	STANLEY BLACK & DECKER INC	STANLEY BLACK & DECKER INC	SWK US	纽约证 券交易 所	美国	6,460.00	3,728,431.87 0.02
44 2	CAMDEN PROPERTY TRUST	CAMDEN PROPERTY TRUST	CPT US	纽约证 券交易 所	美国	4,469.00	3,727,780.31 0.02

				所			
44 3	HOST HOTELS & RESORTS INC	HOST HOTELS & RESORTS INC	HST US	纳斯达克 美国 交易所	29,297.00	3,689,686.68	0.02
44 4	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	CHRW US	纳斯达克 美国 交易所	4,956.00	3,680,848.40	0.02
44 5	REGENCY CENTERS CORP	REGENCY CENTERS CORP	REG US	纳斯达克 美国 交易所	6,844.00	3,637,164.49	0.02
44 6	JM SMUCKER CO/THE	JM SMUCKER CO/THE	SJM US	纽约证 美国 券交易所	4,456.00	3,527,309.93	0.02
44 7	DAYFORCE INC	DAYFORCE INC	DAY US	纽约证 美国 券交易所	6,608.00	3,450,468.80	0.02
44 8	BIO-TECHNE CORP	BIO-TECHNE CORP	TECH US	纳斯达克 美国 交易所	6,655.00	3,445,828.91	0.02
44	NORDSON CORP	NORDSON CORP	NDSN	纳美	2,275.00	3,421,829.36	0.02

9			US	斯达克交易所			
450	ALLEGION PLC	ALLEGION PLC	ALLEUS	美国 纽约证券交易所	3,639.00	3,418,404.23	0.02
451	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	NCLHUS	美国 纽约证券交易所	18,425.00	3,407,842.53	0.02
452	INCYTE CORP	INCYTE CORP	INCYUS	美国 纳斯达克交易所	6,697.00	3,325,079.17	0.02
453	ASSURANT INC	ASSURANT INC	AIZUS	美国 纽约证券交易所	2,147.00	3,290,729.76	0.02
454	BUNGE GLOBAL SA	BUNGE GLOBAL SA	BGUS	美国 纽约证券交易所	5,849.00	3,269,415.44	0.02
455	BXP INC	BXP INC	BXPUS	美国 纽约证	6,089.00	3,254,749.66	0.02

				券交易所			
45 6	EASTMAN CHEMICAL CO	EASTMAN CHEMICAL CO	EMN US	纽约 美国 证券 交易所	4,855.00	3,187,038.96	0.02
45 7	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	UHS US	纽约 美国 证券 交易所	2,459.00	3,171,477.37	0.02
45 8	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	IPG US	纽约 美国 证券 交易所	15,610.00	3,144,150.09	0.02
45 9	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	ERIE US	纳 美国 斯达 克交 易所	1,045.00	3,096,621.47	0.02
46 0	ALBEMARLE CORP	ALBEMARLE CORP	ALB US	纽约 美国 证券 交易所	4,928.00	3,049,335.38	0.02
46 1	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	TAP US	纽约 美国 证券 交	7,314.00	3,013,653.89	0.02

				易所			
46 2	PAYCOM SOFTWARE INC	PAYCOM SOFTWARE INC	PAYC US	纽约 证券 交易 所	美国	2,037.00	3,001,328.73 0.02
46 3	PINNACLE WEST CAPITAL	PINNACLE WEST CAPITAL	PNW US	纽约 证券 交易 所	美国	4,763.00	2,902,384.86 0.02
46 4	LKQ CORP	LKQ CORP	LKQ US	纳 斯 达 克 交 易 所	美国	10,895.00	2,878,172.46 0.02
46 5	LAMB WESTON HOLDINGS INC	LAMB WESTON HOLDINGS INC	LW US	纽约 证券 交易 所	美国	5,975.00	2,870,394.61 0.02
46 6	CHARLES RIVER LABORATORIES	CHARLES RIVER LABORATORIES	CRL US	纽约 证券 交易 所	美国	2,142.00	2,842,388.25 0.02
46 7	GLOBE LIFE INC	GLOBE LIFE INC	GL US	纽约 证券 交易 所	美国	3,519.00	2,821,007.64 0.02

468	RALPH LAUREN CORP	RALPH LAUREN CORP	RL US	美国 纽约证券交易所	1,684.00	2,796,074.25	0.02
469	ENPHASE ENERGY INC	ENPHASE ENERGY INC	ENPH US	美国 纳斯达克交易所	5,658.00	2,793,350.71	0.02
470	GENERAC HOLDINGS INC	GENERAC HOLDINGS INC	GNRC US	美国 纽约证券交易所	2,492.00	2,777,487.06	0.02
471	AES CORP	AES CORP	AES US	美国 纽约证券交易所	29,806.00	2,757,493.39	0.02
472	SOLVENTUM CORP	SOLVENTUM CORP	SOLV US	美国 纽约证券交易所	5,787.00	2,748,047.83	0.02
473	HORMEL FOODS CORP	HORMEL FOODS CORP	HRL US	美国 纽约证券交易所	12,174.00	2,745,238.31	0.02
474	HENRY SCHEIN INC	HENRY SCHEIN INC	HSIC US	美国 纳斯达克	5,226.00	2,599,607.23	0.02

				达 克 交 易 所			
47 5	FEDERAL REALTY INVS TRUST	FEDERAL REALTY INVS TRUST	FRT US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,203.00	2,577,586.64 0.02
47 6	APA CORP	APA CORP	APA US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	15,503.00	2,573,190.36 0.02
47 7	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MKTX US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	1,580.00	2,567,288.18 0.02
47 8	TELEFLEX INC	TELEFLEX INC	TFX US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	1,946.00	2,489,695.73 0.02
47 9	THE CAMPBELL'S COMPANY	THE CAMPBELL'S COMPANY	CPB US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	8,225.00	2,476,137.83 0.02
48 0	MATCH GROUP INC	MATCH GROUP INC	MTCH US	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	10,524.00	2,474,535.10 0.02

				交易所			
48 1	SMITH (A.O.) CORP	SMITH (A.O.) CORP	AOS US	美国 纽约 证券 交易 所	4,992.00	2,447,681.25	0.02
48 2	WYNN RESORTS LTD	WYNN RESORTS LTD	WYN N US	美国 纳 斯 达 克 交 易 所	3,876.00	2,400,610.46	0.02
48 3	INVESCO LTD	INVESCO LTD	IVZ US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	18,837.00	2,366,929.93	0.01
48 4	MGM RESORTS INTERNATIONAL	MGM RESORTS INTERNATIONAL	MGM US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	9,478.00	2,360,761.85	0.01
48 5	MOSAIC CO/THE	MOSAIC CO/THE	MOS US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	13,305.00	2,350,872.05	0.01
48 6	CELANESE CORP	CELANESE CORP	CE US	美国 纽 约 证 券 交 易 所	4,581.00	2,279,089.48	0.01

				所			
48 7	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	HII US	美国 纽约 证券 交易 所	1,639.00	2,226,404.40	0.01
48 8	HASBRO INC	HASBRO INC	HAS US	美国 纳斯 达克 交易 所	5,493.00	2,207,655.62	0.01
48 9	CAESARS ENTERTAINMENT INC	CAESARS ENTERTAINMENT INC	CZR US	美国 纳斯 达克 交易 所	8,905.00	2,139,304.50	0.01
49 0	BORGWARNER INC	BORGWARNER INC	BWA US	美国 纽约 证券 交易 所	9,163.00	2,093,921.76	0.01
49 1	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	BF/B US	美国 纽约 证券 交易 所	7,626.00	2,082,015.68	0.01
49 2	DAVITA INC	DAVITA INC	DVA US	美国 纽约 证券 交易 所	1,890.00	2,031,797.67	0.01
49	WALGREENS BOOTS	WALGREENS BOOTS	WBA	美 纳	30,060.00	2,016,057.23	0.01

3	ALLIANCE INC	ALLIANCE INC	US	斯达克交易所			
49 4	FRANKLIN RESOURCES INC	FRANKLIN RESOURCES INC	BEN US	纽约证券交易所	美国	12,941.00	1,887,478.96 0.01
49 5	MOHAWK INDUSTRIES INC	MOHAWK INDUSTRIES INC	MHK US	纽约证券交易所	美国	2,196.00	1,880,553.59 0.01
49 6	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	PARA US	纳斯达克交易所	美国	24,945.00	1,875,631.11 0.01
49 7	FMC CORP	FMC CORP	FMC US	纽约证券交易所	美国	5,229.00	1,827,159.66 0.01

注：所用证券代码采用当地市场代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL US	304,276,813.42	3.60

2	MICROSOFT CORP	MSFT US	269,819,163.29	3.20
3	NVIDIA CORP	NVDA US	185,941,707.45	2.20
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	150,161,802.72	1.78
5	ALPHABET INC	GOOGL US	80,091,085.43	0.95
		GOOG US	67,649,736.26	0.80
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	86,734,484.28	1.03
7	BROADCOM INC	AVGO US	68,287,326.68	0.81
8	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	67,003,558.06	0.79
9	TESLA INC	TSLA US	59,062,788.47	0.70
10	EXXON MOBIL CORP	XOM US	56,555,845.10	0.67
11	ELI LILLY & CO	LLY US	52,719,852.70	0.62
12	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	51,864,747.54	0.61
13	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	48,841,609.91	0.58
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	44,197,161.88	0.52
15	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	34,525,389.60	0.41
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	33,662,901.80	0.40
17	MASTERCARD INC - A	MA US	33,484,017.07	0.40
18	HOME DEPOT INC	HD US	32,460,876.40	0.38
19	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	30,278,603.66	0.36
20	ABBVIE INC	ABBV US	27,445,848.10	0.33

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	PXD US	16,797,577.31	0.20
2	ALPHABET INC	GOOG US	11,219,726.90	0.13
		GOOGL US	4,206,755.54	0.05
3	APPLE INC	AAPL US	14,484,251.92	0.17
4	NVIDIA CORP	NVDA US	12,172,146.69	0.14
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	6,155,497.10	0.07
6	MICROSOFT CORP	MSFT US	5,644,310.00	0.07
7	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	5,470,587.19	0.06
8	EXXON MOBIL CORP	XOM US	5,333,296.80	0.06
9	WELLS FARGO & CO	WFC US	5,284,112.49	0.06
10	MARATHON OIL CORP	MRO US	4,946,686.72	0.06
11	ILLUMINA INC	ILMN US	4,814,698.20	0.06
12	ELI LILLY & CO	LLY US	4,182,900.90	0.05
13	WESTROCK CO	WRK US	3,685,160.85	0.04
14	CHEVRON CORP	CVX US	3,649,685.61	0.04
15	CATALENT INC	CTLT US	3,426,132.39	0.04

16	GENERAL MOTORS CO	GM US	3,163,936.28	0.04
17	CHUBB LTD	CB US	2,858,249.05	0.03
18	CATERPILLAR INC	CAT US	2,817,574.59	0.03
19	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	2,791,457.84	0.03
20	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	2,722,267.83	0.03

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

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	4,180,734,502.68
卖出收入（成交）总额	284,955,084.05

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

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Mar25	-26,601,087.53	-0.17

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。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查, 或在报

告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	49,941,811.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	8,224,700.55
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	58,166,512.10

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		博时标普 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基 金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
106706	74,303.59	985,234,349.00	12.43%	2,886,014,760.00	36.40%	4,057,389,461.00	51.17%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	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	2.86%
2	赵勇	61,891,000.00	0.78%
3	翠庭置业（上海）有限公司	49,001,300.00	0.62%
4	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	35,660,000.00	0.45%
5	李大鹏	34,447,300.00	0.43%
6	张瑞英	31,921,100.00	0.40%
7	平安银行股份有限公司—平安盈禧均衡配置 1 年持有期混合型基金中基金(FOF)	28,000,000.00	0.35%
8	潘思宇	23,000,000.00	0.29%
9	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	21,120,500.00	0.27%
10	中信证券资管—工商银行—中信证券资管贵宾优享 1 号集合资产管理计划	19,300,400.00	0.24%
-	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	4,057,389,461.00	51.17%

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标普 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年12月5日)基金份额总额	565,043,200.00
本报告期期初基金份额总额	5,294,638,570.00
本报告期基金总申购份额	2,674,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	40,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,928,638,570.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 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。

基金管理人于 2024 年 12 月 7 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》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 90000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
摩根士丹利	-	4,411,889,659.38	100.00%	1,034,876.66	100.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

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

2、基金券商交易账户的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构；
- (2)基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2024-12-31
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	2024-12-31

		露网站	
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	2024-12-30
4	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	2024-12-30
5	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	2024-12-27
6	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	2024-12-27
7	博时基金管理有限公司关于旗下 193 只基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-27
8	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	2024-12-26
9	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	2024-12-26
10	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	2024-12-25
11	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	2024-12-25
12	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	2024-12-24
13	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	2024-12-24
14	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	2024-12-24
15	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	2024-12-23
16	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	2024-12-23
17	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	2024-12-20

	溢价风险提示公告	网站、证监会基金电子披露网站	
18	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	2024-12-20
19	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	2024-12-19
20	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	2024-12-19
21	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	2024-12-18
22	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及停复牌公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-17
23	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	2024-12-16
24	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-13
25	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	2024-12-13
26	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	2024-12-12
27	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	2024-12-11
28	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	2024-12-10
29	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	2024-12-09
30	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	2024-12-07
31	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	2024-12-06

32	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	2024-12-05
33	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	2024-12-04
34	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	2024-12-03
35	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	2024-12-02
36	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	2024-11-29
37	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	2024-11-28
38	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金恢复申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-27
39	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	2024-11-27
40	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	2024-11-27
41	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	2024-11-26
42	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	2024-11-25
43	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	2024-11-21
44	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-21
45	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	2024-11-20
46	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	2024-11-19

		露网站	
47	博时基金管理有限公司关于终止乾道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	2024-11-18
48	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20241106	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-06
49	关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金新增粤开证券为申购、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	2024-11-01
50	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-25
51	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-30
52	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20240925	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-25
53	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-21
54	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	2024-09-10
55	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	2024-09-04
56	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	2024-09-03
57	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	2024-09-02
58	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	2024-08-30
59	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	2024-08-30
60	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-30
61	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	2024-08-29

	溢价风险提示公告	网站、证监会基金电子披露网站	
62	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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	2024-08-23
63	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-22
64	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国联证券为申购、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	2024-08-20
65	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	2024-08-19
66	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换等业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-17
67	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	2024-08-16
68	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	2024-08-02
69	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	2024-08-01
70	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	2024-07-31
71	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	2024-07-30
72	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	2024-07-27
73	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	2024-07-25
74	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	2024-07-24
75	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	2024-07-23

76	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	2024-07-20
77	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-07-20
78	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	2024-07-19
79	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增爱建证券为申购、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	2024-07-19
80	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-07-19
81	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	2024-07-18
82	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	2024-07-17
83	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东方财富证券为申购、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	2024-07-17
84	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	2024-07-16
85	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	2024-07-12
86	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	2024-07-11
87	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	2024-07-10
88	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	2024-07-09
89	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	2024-07-06
90	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	2024-07-05

		露网站	
91	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	2024-07-04
92	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	2024-07-03
93	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	2024-07-03
94	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	2024-07-02
95	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
96	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
97	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
98	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
99	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
100	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
101	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
102	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
103	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
104	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
105	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服	上海证券报、基金管理人	2024-04-29

	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	网站、证监会基金电子披露网站	
106	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
107	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
108	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
109	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
110	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
111	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
112	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
113	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
114	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-22
115	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
116	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别	间区间						
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	2024-01-01~2024-12-31	2,306,633,060.00	2,073,752,100.00	322,995,699.00	4,057,389,461.00	51.17%	
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日