博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年年度报告
2025 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年三月三十一日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 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 2025 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 信息披露方式 5
2.5 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 7
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14
§6 审计报告 14
6.1 审计意见 14
6.2 形成审计意见的基础 15
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任 15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任 15
§7 年度财务报表 16
7.1 资产负债表 16
7.2 利润表 18
7.3 净资产变动表 19
7.4 报表附注 21
§8 投资组合报告 51
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 66

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 66
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 67
8.12 投资组合报告附注 67
§9 基金份额持有人信息 68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 68
9.2 期末上市基金前十名持有人 68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 69
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 69
§10 开放式基金份额变动 69
§11 重大事件揭示 69
11.1 基金份额持有人大会决议 69
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 69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 70
11.4 基金投资策略的改变 70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 70
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 71
11.8 其他重大事件 72
§12 影响投资者决策的其他重要信息 75
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 75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 76
§13 备查文件目录 76
13.1 备查文件目录 76
13.2 存放地点 77
13.3 查阅方式 77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 博时
基金主代码	159968
交易代码	159968
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 1 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	56,895,098.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 31 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 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	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	78,005,191.42	6,871,629.85	-5,047,025.38
本期利润	180,539,358.66	90,008,623.33	-36,331,073.90
加权平均基金份额本期利润	2.2549	0.7490	-0.3266
本期加权平均净值利润率	29.30%	11.76%	-4.67%
本期基金份额净值增长率	34.51%	8.55%	-4.83%
3.1.2 期末数据和指标	**2025 年末**	**2024 年末**	**2023 年末**
期末可供分配利润	250,528,818.03	212,396,328.25	166,779,894.11
期末可供分配基金份额利润	4.4033	1.9722	1.4171
期末基金资产净值	539,153,703.47	758,726,089.78	763,838,962.00
期末基金份额净值	9.4763	7.0451	6.4900
3.1.3 累计期末指标	**2025 年末**	**2024 年末**	**2023 年末**
基金份额累计净值增长率	86.81%	38.88%	27.94%

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

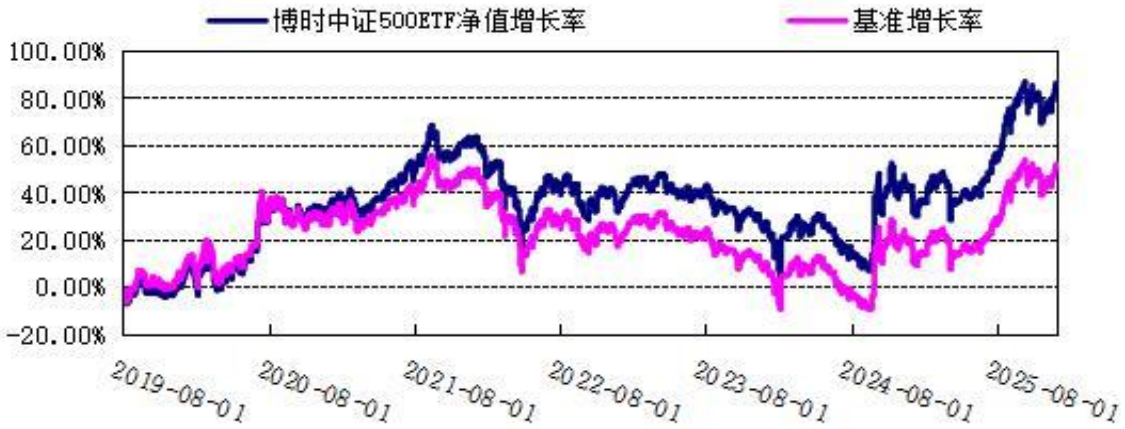
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.71%	1.24%	0.72%	1.24%	0.99%	0.00%
过去六个月	28.22%	1.17%	26.21%	1.17%	2.01%	0.00%
过去一年	34.51%	1.26%	30.39%	1.26%	4.12%	0.00%
过去三年	38.96%	1.35%	27.30%	1.37%	11.66%	-0.02%
过去五年	39.78%	1.29%	17.25%	1.30%	22.53%	-0.01%
自基金合同生效起至今	86.81%	1.32%	52.26%	1.34%	34.55%	-0.02%

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

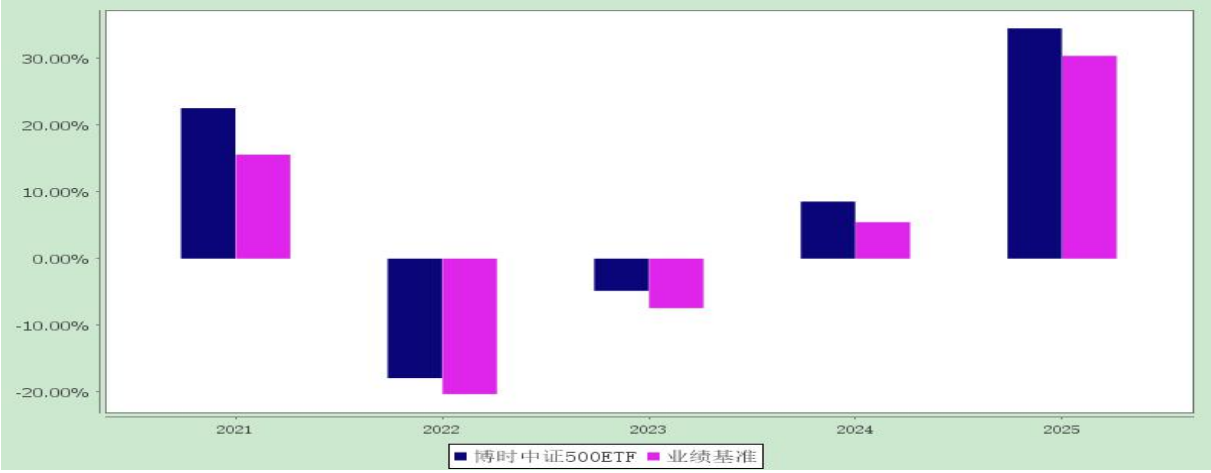
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 8 月 1 日至 2025 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

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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 403 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 16746 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6938 亿元人民币，累计分红逾 2258 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

9 月，深圳市证券业协会召开深圳资本市场投教讲师工作交流会，举行投教讲师聘任仪式，博时基金 16 位员工获颁“深圳资本市场投资者教育讲师”聘书。

12 月，深圳市证券业协会授予博时基金“突出贡献单位”荣誉证书，授予博时基金投教基地“优秀投资者教育基地”荣誉证书，表彰公司在 2025 年度投资者教育工作中积极有为，表现优异。2025 年度，博时基金共四位员工获得“优秀投教讲师”荣誉证书。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2019-08-01	-	18.8	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、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)、博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金

					(2025 年 8 月 15 日—至今)、博时创业板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 12 月 2 日—至今)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	2025-04-15	9.4	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(2025 年 4 月 16 日—至今)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 6 月 30 日—至今)、博时恒生港股通创新药精选交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 7 月 23 日—至今)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2025 年 9 月 1 日—至今)、博时国证工业软件主题交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 11 月 12 日—至今)的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 37 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年中国经济延续稳步改善态势，国内积极宏观政策持续落地见效，逆周期调节与化债、地产纾困政策协同发力，消费需求逐步回暖、投资端企稳回升，房地产市场风险已得到一定程度的缓释，出口端亦保持较强韧性。同时，高技术制造业、先进装备、新能源等领域增长态势良好，叠加 AI 产业化快速推进，新质生产力驱动作用持续凸显，全年经济实现温和复苏。海外方面，全球经济延续缓慢复苏格局，美国经济仍有韧性，通胀水平逐步回落，劳动力市场紧张格局有所改善，核心服务价格涨幅趋于平缓。美联储全年完成多次降息，全球流动性仍宽松，但受通胀粘性及复苏节奏等因素影响，主要经济体货币政策趋于稳健。

行情方面，2025 年 A 股市场呈现震荡上行的态势。年初在经济复苏预期和 Deepseek 的性能超预期带来的中国科技资产重估双重推动下，市场企稳上行；市场在遭受美国全球关税政策冲击后，随着 AI 产业利好持续释放、关税政策缓和，市场热度持续提升，全年结构性上涨行情显著。上证指数点位近十年首次站上 4000 点，其中科技属性的创业板指、科创 50 表现抢眼；风格方面小盘成长占优，中证 2000 表现领先；行业表现分化明显，AI 算力、半导体、有色金属、国防军工、机械等领域表现亮眼，而食品饮料、煤炭、房地产等板块承压。本基金主要采用完全复制指数的被动跟踪策略，期间内本基金保持平稳运行，实现对指数的紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 9.4763 元，份额累计净值为 1.8681 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 34.51%，同期业绩基准增长率 30.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，作为“十五五”开局之年，财政政策将继续保持积极导向，货币政策整体仍有宽松空间，逆周期与跨周期调节协同发力，推动经济稳步复苏和企业盈利改善。同时 AI 技术产业化与国产化进程不断推进，科技赋能经济增长的效应预计将进一步凸显。依托国内政策积极有为、科技创新成果持续释放、“十五五”规划新项目落地等多重支撑，2026 年中国资产仍有望迎来业绩与估值的双重提升，我们对 2026 年 A 股市场持相对乐观态度。结构配置上，建议聚焦三条核心主线：一是科技成长主线，重点关注半导体、AI 算力、高端制造、商业航天、创新药等科技领域；二是经济修复主线，重点布局受益于需求回暖、政策托底的家电、汽车等消费板块，以及受益通胀修复的有色、化工等资源板块；三是高性价比红利资产，在险资等长期资金持续入市、长债利率下行的趋势下，红利资产配置性价比凸显。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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，持续健全内控体系，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，及时发现问题，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，发现违规隐患及时提示有关业务人员并向管理层报告；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《博时基金风险管理与内部控制管理制度》《博时基金合规管理制度》《博时基金问责管理制度》《博时基金关联交易管理制度》《博时基金洗钱风险管理制度》《博时基金销售管理制度》《博时基金私募资产管理业务基本制度》《博时基金信息技术管理制度》《博时基金管理有限公司交易管理制度》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，探索完善“合规管理平台”中应用模块的数智化功能，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，并积极做好

投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

容诚审字[2026]200Z1542 号

博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“博时中证 500ETF”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 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，公允反映了博时中证 500ETF2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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和中国注册会计师独立性准则，我们独立于博时中证 500ETF，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时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

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

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

基金管理人治理层负责监督博时中证 500ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

（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

张振波　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

2026 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	11,271,710.17	7,363,303.05
结算备付金		22,236,997.96	26,808,972.04
存出保证金		5,122,961.33	4,505,700.26
交易性金融资产	7.4.7.2	501,168,830.82	720,958,657.19
其中：股票投资		501,168,830.82	720,958,657.19

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		-	-
应收清算款		1,922,318.04	2,990,115.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		541,722,818.32	762,626,748.33
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 日**	**上年度末 2024 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		2,199,545.19	3,142,120.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		65,942.89	101,970.72
应付托管费		21,980.99	33,990.22
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,538.75	86,156.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	259,107.03	536,420.35
负债合计		2,569,114.85	3,900,658.55
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	288,624,885.44	546,329,761.53
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	250,528,818.03	212,396,328.25
净资产合计		539,153,703.47	758,726,089.78
负债和净资产总计		541,722,818.32	762,626,748.33

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 9.4763 元，基金份额总额 56,895,098.00 份。

7.2 利润表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**182,030,531.21**	**91,958,978.28**
1.利息收入		312,298.99	270,433.56
其中：存款利息收入	7.4.7.9	312,298.99	270,433.56
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）		78,636,235.89	9,051,211.99
其中：股票投资收益	7.4.7.10	60,143,121.05	-8,592,536.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	5,579.72	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	9,032,909.07	2,559,021.84
股利收益	7.4.7.14	9,454,626.05	15,050,486.44
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	34,240.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	102,534,167.24	83,136,993.48
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	547,829.09	-499,660.75
减：二、营业总支出		**1,491,172.55**	**1,950,354.95**
1．管理人报酬		926,341.59	1,150,883.55
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		308,780.62	383,627.94
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	7.4.7.17	-	-
7．税金及附加		32,554.48	9,354.40
8．其他费用	7.4.7.18	223,495.86	406,489.06

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**180,539,358.66**	**90,008,623.33**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**180,539,358.66**	**90,008,623.33**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**180,539,358.66**	**90,008,623.33**

7.3 净资产变动表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	546,329,761.53	212,396,328.25	758,726,089.78
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	546,329,761.53	212,396,328.25	758,726,089.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-257,704,876.09	38,132,489.78	-219,572,386.31
（一）、综合收益总额	-	180,539,358.66	180,539,358.66
（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）	-257,704,876.09	-142,406,868.88	-400,111,744.97
其中：1.基金申购款	87,254,406.85	50,349,127.78	137,603,534.63
2.基金赎回款	-344,959,282.94	-192,755,996.66	-537,715,279.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合	-	-	-

收益结转留存收益			
四、本期期末净资产	288,624,885.44	250,528,818.03	539,153,703.47
项目	**上年度可比期间 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	597,059,067.89	166,779,894.11	763,838,962.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	597,059,067.89	166,779,894.11	763,838,962.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-50,729,306.36	45,616,434.14	-5,112,872.22
（一）、综合收益总额	-	90,008,623.33	90,008,623.33
（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）	-50,729,306.36	-44,392,189.19	-95,121,495.55
其中：1.基金申购款	300,317,493.50	102,338,256.67	402,655,750.17
2.基金赎回款	-351,046,799.86	-146,730,445.86	-497,777,245.72
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	546,329,761.53	212,396,328.25	758,726,089.78

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：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，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

博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]669 号《关于准予博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,762,083,202.00 元（含所募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2019）第 0399 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 8 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,762,185,861.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 102,659.00 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人博时基金管理有限公司确定 2019 年 10 月 18 日为本基金的基金份额折算日。本次基金份额折算前基金份额总额为 2,762,185,861.00 份，折算前基金份额净值为 0.9781 元。根据基金份额折算公式，本次基金份额折算比例为 0.197128864，折算后，2019 年 10 月 21 日基金份额总额为 544,495,098.00 份，折算后基金份额净值为 4.9618 元。本基金的基金管理人博时基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，本基金登记机构中国证券登记结算有限责任公司已于 2019 年 10 月 21 日进行了变更登记。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2019]664 号核准，本基金于 2019 年 10 月 31 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

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 2026 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》、《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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

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。

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：（i）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。（ii）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、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的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/合并/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/合并/折算日根据拆分/合并/折算前的基金份额数及确定的拆分/合并/折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

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

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

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

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成

果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于流通受限股票、出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于

国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

（4）基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	11,271,710.17	7,363,303.05
等于：本金	11,270,643.58	7,362,654.79
加：应计利息	1,066.59	648.26
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	11,271,710.17	7,363,303.05

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		422,057,293.57	-	501,168,830.82	79,111,537.25
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		422,057,293.57	-	501,168,830.82	79,111,537.25
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		742,080,447.18	-	720,958,657.19	-21,121,789.99
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		742,080,447.18	-	720,958,657.19	-21,121,789.99

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 2025 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	32,383,440.00	-	-	-
---股指期货	32,383,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	32,383,440.00	-	-	-
项目	上年度末 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	30,310,000.00	-	-	-
---股指期货	30,310,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,310,000.00	-	-	-

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

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
IC2603	IC2603	23.00	33,886,360.00	1,502,920.00
合计	-	-	-	1,502,920.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	1,502,920.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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	36,754.27	131,243.61
其中：交易所市场	36,754.27	131,243.61
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	175,000.00	175,000.00
应付指数使用费	47,352.76	230,176.74
合计	259,107.03	536,420.35

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,695,098.00	546,329,761.53
本期申购	17,200,000.00	87,254,406.85
本期赎回（以“-”号填列）	-68,000,000.00	-344,959,282.94
本期末	56,895,098.00	288,624,885.44

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

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	390,277,321.60	-177,880,993.35	212,396,328.25
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-

本期期初	390,277,321.60	-177,880,993.35	212,396,328.25
本期利润	78,005,191.42	102,534,167.24	180,539,358.66
本期基金份额交易产生的变动数	-191,548,290.40	49,141,421.52	-142,406,868.88
其中：基金申购款	69,777,210.79	-19,428,083.01	50,349,127.78
基金赎回款	-261,325,501.19	68,569,504.53	-192,755,996.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	276,734,222.62	-26,205,404.59	250,528,818.03

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	26,144.37	46,373.46
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	285,971.27	223,658.69
其他	183.35	401.41
合计	312,298.99	270,433.56

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	35,230,340.72	-10,868,075.90
股票投资收益——赎回差价收入	24,912,780.33	2,275,539.55
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	60,143,121.05	-8,592,536.35

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	449,298,970.89	479,837,529.57
减：卖出股票成本总额	413,650,232.21	490,107,171.38
减：交易费用	418,397.96	598,434.09
买卖股票差价收入	35,230,340.72	-10,868,075.90

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	537,715,279.60	497,777,245.72
减：现金支付赎回款总额	277,220,517.60	254,208,625.72
减：赎回股票成本总额	235,581,981.67	241,293,080.45
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	24,912,780.33	2,275,539.55

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	3.79	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,575.93	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	5,579.72	-

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,580.90	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,000.00	-
减：应计利息总额	3.79	-
减：交易费用	1.18	-
买卖债券差价收入	5,575.93	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 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。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	9,032,909.07	2,559,021.84

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	9,454,626.05	15,050,486.44
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,454,626.05	15,050,486.44

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	100,233,327.24	83,414,313.48
——股票投资	100,233,327.24	83,414,313.48
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	2,300,840.00	-277,320.00

——权证投资	-	-
——股指期货	2,300,840.00	-277,320.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	102,534,167.24	83,136,993.48

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	547,829.09	-499,660.75
合计	547,829.09	-499,660.75

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	408.10	557.32
银行汇划费	735.00	755.00
指数使用费	47,352.76	230,176.74
合计	223,495.86	406,489.06

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
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
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
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“博时中证 500ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金

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 2024 年第二次临时股东会议决议，基金管理人原股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的 2%股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。上述股东变更事项已于 2024 年 12 月 24 日完成工商变更登记。

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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	361,945,950.48	50.46%	462,324,670.27	48.97%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	74,577.36	50.47%	10,941.97	29.77%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	96,858.40	32.50%	73,254.82	55.82%

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

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	926,341.59	1,150,883.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	23,860.23	177.86
应支付基金管理人的净管理费	902,481.36	1,150,705.69

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	308,780.62	383,627.94

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

日托管费＝前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	4,879,955.00	3.00~6.01	3.84	8,365.46	-	-

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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	40,729,805.00	71.59%	83,936,005.00	77.94%
招商证券	1,178,333.00	2.07%	218,572.00	0.20%

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31

	日		日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	11,271,710.17	26,144.37	7,363,303.05	46,373.46

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54
招商证券股份有限公司	301632	广东建科	网下发行	6,557.00	43,013.92
招商证券股份有限公司	001386	马可波罗	网下发行	4,203.00	57,791.25
招商证券股份有限公司	301638	南网数字	网下发行	18,595.00	105,805.55
招商证券股份有限公司	301449	天溯计量	网下发行	1,118.00	41,142.40
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	1,745.00	151,745.20
招商证券股份有限公司	301631	壹连科技	网下发行	1,525.00	111,309.75

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（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受	流通	认购	期末	数量(单	期末	期末	备

代码	券名称	认购日	限期	受限类型	价格	估值单价	位：股)	成本总额	估值总额	注
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	首次公开发行限售	104.66	399.40	1,365.00	142,860.90	545,181.00	-
001280	中国铀业	2025-11-25	6个月	首次公开发行限售	17.89	45.36	1,784.00	31,915.76	80,922.24	-
301656	联合动力	2025-09-17	6个月	首次公开发行限售	12.48	25.46	3,014.00	37,614.72	76,736.44	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6个月	首次公开发行限售	8.45	24.28	2,954.00	24,961.30	71,723.12	-
688809	强一股份	2025-12-23	6个月	首次公开发行限售	85.09	203.31	147.00	12,508.23	29,886.57	-
301638	南网数字	2025-11-11	6个月	首次公开发行限售	5.69	14.21	1,860.00	10,583.40	26,430.60	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6个月	首次公开发行限售	13.75	18.53	1,261.00	17,338.75	23,366.33	-
688727	恒坤新材	2025-11-11	6个月	首次公开发行限售	14.99	34.87	563.00	8,439.37	19,631.81	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6个月	首次公开发行限售	26.68	42.25	423.00	11,285.64	17,871.75	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	首次公开发行限售	51.66	135.56	131.00	6,767.46	17,758.36	-
001233	海	2025-11-18	6	首次	48.00	51.88	303.00	14,544.00	15,719.64	-

	安集团		个月	公开发行限售						
301632	广东建科	2025-08-05	6个月	首次公开发行限售	6.56	23.68	656.00	4,303.36	15,534.08	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6个月	首次公开发行限售	27.00	133.69	110.00	2,970.00	14,705.90	-
301491	汉桑科技	2025-07-29	6个月	首次公开发行限售	28.91	55.11	245.00	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025-09-18	6个月	首次公开发行限售	7.05	26.82	447.00	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025-07-16	6个月	首次公开发行限售	14.66	40.99	277.00	4,060.82	11,354.23	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	首次公开发行限售	21.93	54.39	195.00	4,276.35	10,606.05	-
001369	双欣环保	2025-12-23	6个月	首次公开发行限售	6.85	12.89	798.00	5,466.30	10,286.22	-
001221	悍高集团	2025-07-23	6个月	首次公开发行限售	15.43	56.94	160.00	2,468.80	9,110.40	-
301667	纳百川	2025-12-10	6个月	首次公开发行限售	22.63	57.07	151.00	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	首次公开发行限售	18.58	32.37	265.00	4,923.70	8,578.05	-
603175	超	2025-10-17	6	首次	17.08	48.56	169.00	2,886.52	8,206.64	-

	颖电子		个月	公开发行限售						
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月	首次公开发行限售	36.80	65.23	112.00	4,121.60	7,305.76	-
603418	友升股份	2025-09-16	6个月	首次公开发行限售	46.36	59.06	119.00	5,516.84	7,028.14	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月	首次公开发行限售	42.28	56.08	118.00	4,989.04	6,617.44	-
603092	德力佳	2025-10-30	6个月	首次公开发行限售	46.68	55.66	118.00	5,508.24	6,567.88	-
601026	道生天合	2025-10-09	6个月	首次公开发行限售	5.98	14.28	451.00	2,696.98	6,440.28	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6个月	首次公开发行限售	27.69	49.55	126.00	3,488.94	6,243.30	-
603406	天富龙	2025-07-30	6个月	首次公开发行限售	23.60	40.16	153.00	3,610.80	6,144.48	-
603262	技源集团	2025-07-16	6个月	首次公开发行限售	10.88	28.10	155.00	1,686.40	4,355.50	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月	首次公开发行限售	10.10	16.30	260.00	2,626.00	4,238.00	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	首次公开发行限售	16.42	42.94	94.00	1,543.48	4,036.36	-
603370	华	2025-08-27	6	首次	18.60	46.35	82.00	1,525.20	3,800.70	-

	新精科		个月	公开发行限售						
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	首次公开发行限售	12.55	26.21	111.00	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月	首次公开发行限售	24.49	32.82	88.00	2,155.12	2,888.16	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6个月	首次公开发行限售	22.29	35.39	69.00	1,538.01	2,441.91	-

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

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

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

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券,该类证券将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	11,271,710.17	-	-	-	11,271,710.17
结算备付金	22,236,997.96	-	-	-	22,236,997.96
存出保证金	40,007.33	-	-	5,082,954.00	5,122,961.33
交易性金融资产	-	-	-	501,168,830.82	501,168,830.82
应收清算款	-	-	-	1,922,318.04	1,922,318.04

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**33,548,715.46**	**-**	**-**	**508,174,102.86**	**541,722,818.32**
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,199,545.19	2,199,545.19
应付管理人报酬	-	-	-	65,942.89	65,942.89
应付托管费	-	-	-	21,980.99	21,980.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	22,538.75	22,538.75
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	259,107.03	259,107.03
负债总计	**-**	**-**	**-**	**2,569,114.85**	**2,569,114.85**
利率敏感度缺口	**33,548,715.46**	**-**	**-**	**505,604,988.01**	**539,153,703.47**
上年度末 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	7,363,303.05	-	-	-	7,363,303.05
结算备付金	26,808,972.04	-	-	-	26,808,972.04
存出保证金	78,888.26	-	-	4,426,812.00	4,505,700.26
交易性金融资产	-	-	-	720,958,657.19	720,958,657.19
应收清算款	-	-	-	2,990,115.79	2,990,115.79
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**34,251,163.35**	**-**	**-**	**728,375,584.98**	**762,626,748.33**
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3,142,120.33	3,142,120.33
应付管理人报酬	-	-	-	101,970.72	101,970.72
应付托管费	-	-	-	33,990.22	33,990.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	86,156.93	86,156.93
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	536,420.35	536,420.35

负债总计	**-**	**-**	**-**	**3,900,658.55**	**3,900,658.55**
利率敏感度缺口	**34,251,163.35**	**-**	**-**	**724,474,926.43**	**758,726,089.78**

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	501,168,830.82	92.95	720,958,657.19	95.02
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	501,168,830.82	92.95	720,958,657.19	95.02

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，期货投资与相关的期货暂收款(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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3,161	增加约 3,708
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,161	减少约 3,708

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	500,044,723.11	720,345,507.02
第二层次	-	27,736.50
第三层次	1,124,107.71	585,413.67
合计	501,168,830.82	720,958,657.19

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	585,413.67	585,413.67
当期购买	-	613,662.10	613,662.10
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,295,151.07	1,295,151.07
当期利得或损失总额	-	1,220,183.01	1,220,183.01
其中：计入损益的利得或损失	-	1,220,183.01	1,220,183.01
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,124,107.71	1,124,107.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	712,508.20	712,508.20
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,138,317.82	1,138,317.82
当期购买	-	502,195.27	502,195.27
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,460,576.86	1,460,576.86
当期利得或损失总额	-	405,477.44	405,477.44
其中：计入损益的利得或损失	-	405,477.44	405,477.44
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	585,413.67	585,413.67
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	342,700.99	342,700.99

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技	不可观察输入值

		术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,118,734.71	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.00%-307.91%	负相关
股票投资	5,373.00	净资产法	净资产回收率	0%-1%	正相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	580,040.67	平均价格亚式期权模型	预期波动率	26.65%-574.44%	负相关
股票投资	5,373.00	净资产法	净资产回收率	0%-1%	正相关

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	501,168,830.82	92.51
	其中：股票	501,168,830.82	92.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	33,508,708.13	6.19
8	其他各项资产	7,045,279.37	1.30
9	合计	541,722,818.32	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,374,751.00	0.44
B	采矿业	21,038,250.04	3.90
C	制造业	341,434,248.83	63.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,486,613.10	2.69
E	建筑业	4,075,594.00	0.76
F	批发和零售业	7,586,374.04	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	7,444,306.84	1.38
H	住宿和餐饮业	614,061.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,179,694.99	7.82
J	金融业	36,946,149.88	6.85
K	房地产业	3,540,746.00	0.66
L	租赁和商务服务业	6,297,176.80	1.17
M	科学研究和技术服务业	3,357,005.08	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	2,184,065.66	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	722,264.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,556,298.56	0.29
R	文化、体育和娱乐业	3,527,859.00	0.65
S	综合	1,803,372.00	0.33
	合计	501,168,830.82	92.95

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002837	英维克	31,000	3,313,590.00	0.61
2	300136	信维通信	51,300	3,180,600.00	0.59
3	002558	巨人网络	72,300	3,129,867.00	0.58
4	002738	中矿资源	38,580	3,030,459.00	0.56
5	600879	航天电子	141,400	3,014,648.00	0.56
6	600118	中国卫星	31,500	2,990,925.00	0.55
7	300450	先导智能	58,500	2,923,830.00	0.54

8	600580	卧龙电驱	58,380	2,866,458.00	0.53
9	600988	赤峰黄金	88,900	2,777,236.00	0.52
10	000426	兴业银锡	75,900	2,702,040.00	0.50
11	600487	亨通光电	105,400	2,606,542.00	0.48
12	002202	金风科技	127,300	2,596,920.00	0.48
13	601168	西部矿业	89,100	2,462,724.00	0.46
14	002156	通富微电	64,900	2,446,730.00	0.45
15	600549	厦门钨业	59,300	2,434,858.00	0.45
16	300604	长川科技	23,700	2,401,047.00	0.45
17	002532	天山铝业	148,000	2,394,640.00	0.44
18	300115	长盈精密	50,700	2,357,550.00	0.44
19	688347	华虹公司	21,819	2,353,615.53	0.44
20	002353	杰瑞股份	32,700	2,316,141.00	0.43
21	000933	神火股份	84,100	2,310,227.00	0.43
22	002340	格林美	273,300	2,284,788.00	0.42
23	600096	云天化	68,200	2,278,562.00	0.42
24	300395	菲利华	22,400	2,246,720.00	0.42
25	002261	拓维信息	67,300	2,227,630.00	0.41
26	300058	蓝色光标	191,740	2,208,844.80	0.41
27	301308	江波龙	9,000	2,203,560.00	0.41
28	600143	金发科技	112,700	2,202,158.00	0.41
29	300857	协创数据	12,900	2,175,972.00	0.40
30	002195	岩山科技	302,700	2,146,143.00	0.40
31	002851	麦格米特	23,500	2,116,645.00	0.39
32	300339	润和软件	42,500	2,103,750.00	0.39
33	300207	欣旺达	79,000	2,065,850.00	0.38
34	002131	利欧股份	361,500	2,038,860.00	0.38
35	688525	佰维存储	17,586	2,018,696.94	0.37
36	688120	华海清科	13,325	1,999,816.00	0.37
37	002517	恺英网络	91,300	1,996,731.00	0.37
38	002966	苏州银行	238,890	1,980,398.10	0.37
39	688002	睿创微纳	19,643	1,980,014.40	0.37
40	002402	和而泰	49,400	1,932,528.00	0.36
41	601555	东吴证券	212,340	1,923,800.40	0.36
42	603228	景旺电子	26,280	1,920,805.20	0.36
43	002436	兴森科技	90,700	1,920,119.00	0.36
44	300223	北京君正	18,000	1,908,720.00	0.35
45	600885	宏发股份	62,440	1,898,176.00	0.35
46	600601	方正科技	159,800	1,872,856.00	0.35
47	002273	水晶光电	74,300	1,866,416.00	0.35
48	300751	迈为股份	9,000	1,853,910.00	0.34
49	000831	中国稀土	39,700	1,843,668.00	0.34
50	600157	永泰能源	1,165,600	1,829,992.00	0.34

51	688122	西部超导	24,350	1,816,023.00	0.34
52	002008	大族激光	44,000	1,812,360.00	0.34
53	002281	光迅科技	25,900	1,811,705.00	0.34
54	002595	豪迈科技	21,405	1,808,936.55	0.34
55	600673	东阳光	80,400	1,803,372.00	0.33
56	688469	芯联集成	268,692	1,797,549.48	0.33
57	002130	沃尔核材	67,300	1,771,336.00	0.33
58	688361	中科飞测	11,314	1,730,928.86	0.32
59	002472	双环传动	36,300	1,720,983.00	0.32
60	688027	国盾量子	3,388	1,706,840.52	0.32
61	689009	九号公司	30,617	1,701,999.03	0.32
62	002126	银轮股份	45,000	1,701,000.00	0.32
63	300390	天华新能	31,000	1,692,910.00	0.31
64	002128	电投能源	59,900	1,671,809.00	0.31
65	002465	海格通信	106,100	1,671,075.00	0.31
66	688777	中控技术	33,850	1,670,159.00	0.31
67	688235	百济神州	6,196	1,664,245.60	0.31
68	600699	均胜电子	52,200	1,636,992.00	0.30
69	002850	科达利	10,300	1,625,958.00	0.30
70	600392	盛和资源	75,000	1,614,750.00	0.30
71	603129	春风动力	5,700	1,588,476.00	0.29
72	300346	南大光电	36,920	1,583,868.00	0.29
73	688099	晶晨股份	18,141	1,582,439.43	0.29
74	301358	湖南裕能	24,400	1,577,704.00	0.29
75	601162	天风证券	376,700	1,567,072.00	0.29
76	603659	璞泰来	57,000	1,558,380.00	0.29
77	300454	深信服	13,500	1,554,660.00	0.29
78	002797	第一创业	224,460	1,542,040.20	0.29
79	000878	云南铜业	74,900	1,536,199.00	0.28
80	002138	顺络电子	43,100	1,531,343.00	0.28
81	603979	金诚信	20,000	1,523,000.00	0.28
82	300054	鼎龙股份	40,400	1,519,040.00	0.28
83	601108	财通证券	173,600	1,513,792.00	0.28
84	688578	艾力斯	14,517	1,511,945.55	0.28
85	600021	上海电力	75,400	1,509,508.00	0.28
86	002185	华天科技	136,800	1,500,696.00	0.28
87	601099	太平洋	364,100	1,496,451.00	0.28
88	688385	复旦微电	20,135	1,483,949.50	0.28
89	600352	浙江龙盛	138,900	1,480,674.00	0.27
90	000021	深科技	58,300	1,473,824.00	0.27
91	002294	信立泰	29,720	1,472,626.00	0.27
92	000960	锡业股份	52,700	1,469,276.00	0.27
93	300037	新宙邦	27,920	1,463,008.00	0.27

94	000783	长江证券	177,300	1,444,995.00	0.27
95	688213	思特威	15,148	1,440,423.32	0.27
96	688608	恒玄科技	6,329	1,436,303.26	0.27
97	600141	兴发集团	41,200	1,424,696.00	0.26
98	300724	捷佳伟创	14,900	1,424,440.00	0.26
99	600298	安琪酵母	32,382	1,416,388.68	0.26
100	000893	亚钾国际	29,500	1,415,115.00	0.26
101	601717	中创智领	57,600	1,414,080.00	0.26
102	002078	太阳纸业	89,369	1,407,561.75	0.26
103	603179	新泉股份	19,000	1,403,720.00	0.26
104	601615	明阳智能	96,600	1,398,768.00	0.26
105	600498	烽火通信	43,600	1,398,688.00	0.26
106	300474	景嘉微	19,450	1,397,871.50	0.26
107	601198	东兴证券	100,400	1,393,552.00	0.26
108	002271	东方雨虹	102,000	1,386,180.00	0.26
109	600536	中国软件	29,910	1,384,833.00	0.26
110	000657	中钨高新	48,700	1,349,477.00	0.25
111	300073	当升科技	23,334	1,348,705.20	0.25
112	300017	网宿科技	131,400	1,346,850.00	0.25
113	688676	金盘科技	14,839	1,340,555.26	0.25
114	002414	高德红外	91,300	1,339,371.00	0.25
115	601696	中银证券	89,100	1,335,609.00	0.25
116	601233	桐昆股份	77,100	1,326,891.00	0.25
117	300496	中科创达	19,600	1,323,000.00	0.25
118	601665	齐鲁银行	230,100	1,320,774.00	0.24
119	603606	东方电缆	22,100	1,320,475.00	0.24
120	688019	安集科技	6,055	1,319,505.60	0.24
121	688017	绿的谐波	6,815	1,309,161.50	0.24
122	002080	中材科技	35,900	1,304,606.00	0.24
123	603087	甘李药业	19,100	1,300,137.00	0.24
124	002444	巨星科技	38,200	1,299,564.00	0.24
125	600884	杉杉股份	96,100	1,298,311.00	0.24
126	300458	全志科技	30,800	1,294,524.00	0.24
127	600109	国金证券	138,500	1,288,050.00	0.24
128	688183	生益电子	13,434	1,285,499.46	0.24
129	688568	中科星图	21,592	1,273,928.00	0.24
130	002157	正邦科技	392,400	1,271,376.00	0.24
131	002085	万丰奥威	79,400	1,271,194.00	0.24
132	300757	罗博特科	5,400	1,259,820.00	0.23
133	601577	长沙银行	128,900	1,250,330.00	0.23
134	300748	金力永磁	36,600	1,248,426.00	0.23
135	601128	常熟银行	177,162	1,247,220.48	0.23
136	601179	中国西电	136,934	1,246,099.40	0.23

137	002155	湖南黄金	58,420	1,232,077.80	0.23
138	002223	鱼跃医疗	32,064	1,225,165.44	0.23
139	300699	光威复材	30,880	1,218,524.80	0.23
140	300012	华测检测	89,900	1,218,145.00	0.23
141	300024	机器人	66,900	1,216,911.00	0.23
142	000559	万向钱潮	70,600	1,214,320.00	0.23
143	300002	神州泰岳	105,100	1,210,752.00	0.22
143	600363	联创光电	19,200	1,210,752.00	0.22
144	002624	完美世界	72,451	1,187,471.89	0.22
145	300373	扬杰科技	17,400	1,183,200.00	0.22
146	000034	神州数码	30,400	1,182,864.00	0.22
147	000423	东阿阿胶	24,100	1,182,828.00	0.22
148	600497	驰宏锌锗	161,572	1,181,091.32	0.22
149	603160	汇顶科技	14,900	1,177,100.00	0.22
150	300285	国瓷材料	42,640	1,168,762.40	0.22
151	603596	伯特利	22,740	1,165,879.80	0.22
152	002064	华峰化学	105,900	1,164,900.00	0.22
153	300919	中伟股份	25,100	1,162,883.00	0.22
154	000728	国元证券	139,200	1,162,320.00	0.22
155	002683	广东宏大	24,300	1,161,540.00	0.22
156	688599	天合光能	69,833	1,155,736.15	0.21
157	002673	西部证券	143,300	1,130,637.00	0.21
158	600765	中航重机	58,880	1,128,140.80	0.21
159	002409	雅克科技	15,200	1,126,320.00	0.21
160	603920	世运电路	23,100	1,118,271.00	0.21
161	688220	翱捷科技	13,515	1,116,474.15	0.21
162	688617	惠泰医疗	4,570	1,111,743.90	0.21
163	002410	广联达	88,300	1,110,814.00	0.21
164	002065	东华软件	119,900	1,097,085.00	0.20
165	002756	永兴材料	20,100	1,090,425.00	0.20
166	000733	振华科技	20,800	1,090,128.00	0.20
167	300003	乐普医疗	68,900	1,089,309.00	0.20
168	000997	新大陆	37,900	1,073,328.00	0.20
169	002335	科华数据	19,200	1,066,176.00	0.20
170	600873	梅花生物	104,900	1,062,637.00	0.20
171	600637	东方明珠	107,800	1,061,830.00	0.20
172	603766	隆鑫通用	65,800	1,060,038.00	0.20
173	601231	环旭电子	35,300	1,059,000.00	0.20
174	002318	久立特材	36,500	1,056,675.00	0.20
175	600862	中航高科	44,600	1,053,898.00	0.20
176	000703	恒逸石化	96,200	1,036,074.00	0.19
177	000932	华菱钢铁	184,140	1,034,866.80	0.19
178	000683	博源化工	138,800	1,032,672.00	0.19

179	000528	柳工	86,900	1,031,503.00	0.19
180	300627	华测导航	29,409	1,026,668.19	0.19
181	605589	圣泉集团	36,200	1,024,460.00	0.19
182	600909	华安证券	149,960	1,016,728.80	0.19
183	600060	海信视像	41,800	1,014,904.00	0.19
184	300001	特锐德	39,500	1,014,360.00	0.19
185	688234	天岳先进	11,393	1,012,609.84	0.19
186	000830	鲁西化工	61,000	1,010,770.00	0.19
187	300972	万辰集团	5,000	1,005,350.00	0.19
188	000750	国海证券	236,700	1,003,608.00	0.19
189	603486	科沃斯	12,400	1,000,432.00	0.19
190	605358	立昂微	28,700	999,334.00	0.19
191	000623	吉林敖东	51,120	998,373.60	0.19
192	002821	凯莱英	10,700	994,351.00	0.18
193	000039	中集集团	98,350	992,351.50	0.18
194	600737	中粮糖业	57,300	986,133.00	0.18
195	300570	太辰光	8,500	982,175.00	0.18
196	000400	许继电气	38,100	979,551.00	0.18
197	688629	华丰科技	9,778	978,386.68	0.18
198	688180	君实生物	28,591	976,668.56	0.18
199	603444	吉比特	2,300	974,855.00	0.18
200	000887	中鼎股份	42,000	974,820.00	0.18
201	688322	奥比中光	10,835	971,574.45	0.18
202	000060	中金岭南	165,900	970,515.00	0.18
203	600332	白云山	37,600	967,824.00	0.18
204	688065	凯赛生物	19,421	967,165.80	0.18
205	688052	纳芯微	6,111	966,637.98	0.18
206	300383	光环新网	76,800	960,768.00	0.18
207	300567	精测电子	10,500	957,600.00	0.18
208	300677	英科医疗	24,540	954,606.00	0.18
209	600369	西南证券	213,000	954,240.00	0.18
210	600521	华海药业	56,000	950,320.00	0.18
211	601799	星宇股份	7,700	949,949.00	0.18
212	000009	中国宝安	96,420	949,737.00	0.18
213	600171	上海贝岭	30,300	946,875.00	0.18
214	688387	信科移动	73,040	942,216.00	0.17
215	600177	雅戈尔	123,500	938,600.00	0.17
216	601990	南京证券	118,200	936,144.00	0.17
217	300142	沃森生物	85,400	931,714.00	0.17
218	002203	海亮股份	73,400	929,244.00	0.17
219	601212	白银有色	158,200	925,470.00	0.17
220	603568	伟明环保	36,437	924,771.06	0.17
221	600704	物产中大	165,800	923,506.00	0.17

222	001696	宗申动力	42,500	921,825.00	0.17
223	601997	贵阳银行	156,300	917,481.00	0.17
224	002152	广电运通	66,300	915,603.00	0.17
225	300432	富临精工	54,800	915,160.00	0.17
226	300763	锦浪科技	12,800	914,048.00	0.17
227	688266	泽璟制药	9,826	910,870.20	0.17
228	688702	盛科通信	6,423	910,074.87	0.17
229	688018	乐鑫科技	5,316	903,720.00	0.17
230	600486	扬农化工	12,960	899,294.40	0.17
231	000738	航发控制	42,100	897,151.00	0.17
232	002429	兆驰股份	120,900	897,078.00	0.17
233	002739	万达电影	79,000	894,280.00	0.17
234	002007	华兰生物	58,500	885,105.00	0.16
235	002841	视源股份	22,300	883,749.00	0.16
236	002044	美年健康	167,300	883,344.00	0.16
237	688375	国博电子	9,478	882,496.58	0.16
238	600378	昊华科技	27,600	882,096.00	0.16
239	600801	华新建材	35,900	880,986.00	0.16
240	002939	长城证券	86,300	880,260.00	0.16
241	600208	衢州发展	227,300	879,651.00	0.16
242	603345	安井食品	11,000	872,080.00	0.16
243	600435	北方导航	56,500	871,230.00	0.16
244	603605	珀莱雅	12,700	869,696.00	0.16
245	601216	君正集团	180,400	869,528.00	0.16
246	601611	中国核建	64,400	868,112.00	0.16
247	601567	三星医疗	37,600	865,552.00	0.16
248	600153	建发股份	92,900	859,325.00	0.16
249	603699	纽威股份	16,500	857,505.00	0.16
250	600516	方大炭素	150,600	856,914.00	0.16
251	600499	科达制造	61,500	853,005.00	0.16
252	002056	横店东磁	43,400	846,300.00	0.16
253	688615	合合信息	3,710	844,321.80	0.16
254	688188	柏楚电子	6,210	843,876.90	0.16
255	000729	燕京啤酒	75,000	842,250.00	0.16
256	300487	蓝晓科技	13,600	839,800.00	0.16
257	688778	厦钨新能	10,671	825,615.27	0.15
258	688114	华大智造	13,449	817,161.24	0.15
259	600642	申能股份	104,600	813,788.00	0.15
260	000519	中兵红箭	44,600	812,166.00	0.15
261	603728	鸣志电器	11,200	810,320.00	0.15
262	603816	顾家家居	26,300	808,462.00	0.15
263	601958	金钼股份	51,700	805,486.00	0.15
264	000155	川能动力	69,000	803,850.00	0.15

265	600316	洪都航空	23,000	802,930.00	0.15
266	000415	渤海租赁	197,900	801,495.00	0.15
267	301611	珂玛科技	9,300	797,289.00	0.15
268	600348	华阳股份	96,350	795,851.00	0.15
269	603379	三美股份	13,060	793,003.20	0.15
270	600038	中直股份	21,900	791,247.00	0.15
271	688538	和辉光电	295,159	785,122.94	0.15
272	688692	达梦数据	3,002	784,332.54	0.15
273	688772	珠海冠宇	36,373	783,110.69	0.15
274	002262	恩华药业	32,400	781,812.00	0.15
275	600863	内蒙华电	174,300	780,864.00	0.14
276	688166	博瑞医药	15,901	780,103.06	0.14
277	002430	杭氧股份	26,083	779,099.21	0.14
278	002926	华西证券	83,840	778,035.20	0.14
279	603806	福斯特	55,700	777,572.00	0.14
280	600398	海澜之家	128,300	776,215.00	0.14
281	300679	电连技术	15,900	774,012.00	0.14
282	000723	美锦能源	164,600	773,620.00	0.14
283	603156	养元饮品	26,900	773,375.00	0.14
284	000629	钒钛股份	248,200	769,420.00	0.14
285	600563	法拉电子	7,300	766,135.00	0.14
286	603338	浙江鼎力	13,500	764,640.00	0.14
287	600820	隧道股份	117,600	763,224.00	0.14
288	600967	内蒙一机	45,400	762,720.00	0.14
289	002603	以岭药业	44,600	761,322.00	0.14
290	600901	江苏金租	123,700	757,044.00	0.14
291	600312	平高电气	43,500	754,725.00	0.14
292	600170	上海建工	284,800	754,720.00	0.14
293	601699	潞安环能	63,900	754,020.00	0.14
294	600562	国睿科技	26,500	748,890.00	0.14
295	603077	和邦生物	330,340	746,568.40	0.14
296	603298	杭叉集团	27,980	743,428.60	0.14
297	001389	广合科技	9,100	742,833.00	0.14
298	600166	福田汽车	253,689	740,771.88	0.14
299	601399	国机重装	154,200	737,076.00	0.14
300	002385	大北农	183,800	735,200.00	0.14
301	002958	青农商行	237,100	735,010.00	0.14
302	688278	特宝生物	8,759	732,953.12	0.14
303	002025	航天电器	14,600	731,898.00	0.14
304	601106	中国一重	183,299	731,363.01	0.14
305	603737	三棵树	15,760	729,215.20	0.14
306	600970	中材国际	70,000	727,300.00	0.13
307	300100	双林股份	18,300	725,046.00	0.13

308	300623	捷捷微电	26,600	722,722.00	0.13
309	002607	中公教育	263,600	722,264.00	0.13
310	688582	芯动联科	10,786	713,062.46	0.13
311	000050	深天马 A	78,800	711,564.00	0.13
312	300676	华大基因	15,600	707,616.00	0.13
313	002984	森麒麟	33,400	707,078.00	0.13
314	600008	首创环保	235,274	705,822.00	0.13
315	003031	中瓷电子	9,641	705,335.56	0.13
316	603939	益丰药房	32,364	702,946.08	0.13
317	688297	中无人机	14,518	697,154.36	0.13
318	002432	九安医疗	17,400	696,696.00	0.13
319	603885	吉祥航空	46,700	694,896.00	0.13
320	601991	大唐发电	198,700	693,463.00	0.13
321	600329	达仁堂	15,200	693,424.00	0.13
322	600282	南钢股份	131,800	693,268.00	0.13
323	600998	九州通	134,676	689,541.12	0.13
324	300144	宋城演艺	84,100	688,779.00	0.13
325	002500	山西证券	114,890	688,191.10	0.13
326	600380	健康元	58,600	676,830.00	0.13
327	600095	湘财股份	61,100	675,766.00	0.13
328	601155	新城控股	48,400	675,180.00	0.13
329	600132	重庆啤酒	12,900	673,896.00	0.12
330	603589	口子窖	22,400	673,120.00	0.12
331	600763	通策医疗	16,736	672,954.56	0.12
332	688301	奕瑞科技	6,629	670,258.19	0.12
333	002244	滨江集团	66,500	668,325.00	0.12
334	600390	五矿资本	120,100	666,555.00	0.12
335	000513	丽珠集团	19,342	666,525.32	0.12
336	002312	川发龙蟒	60,600	662,358.00	0.12
337	002583	海能达	58,200	658,824.00	0.12
338	000987	越秀资本	80,150	652,421.00	0.12
339	300146	汤臣倍健	54,200	650,942.00	0.12
340	000591	太阳能	146,600	650,904.00	0.12
341	600583	海油工程	118,100	648,369.00	0.12
342	600995	南网储能	51,300	644,841.00	0.12
343	601608	中信重工	97,850	644,831.50	0.12
344	600602	云赛智联	34,500	644,805.00	0.12
345	600985	淮北矿业	57,500	638,825.00	0.12
346	601865	福莱特	40,600	636,202.00	0.12
347	003021	兆威机电	5,100	633,318.00	0.12
348	603225	新凤鸣	32,500	632,450.00	0.12
349	300558	贝达药业	13,500	630,315.00	0.12
350	601880	辽港股份	393,400	629,440.00	0.12

351	600977	中国电影	39,900	627,228.00	0.12
352	601156	东航物流	34,000	625,940.00	0.12
353	600685	中船防务	22,000	625,900.00	0.12
354	601666	平煤股份	79,100	622,517.00	0.12
355	688728	格科微	41,622	621,832.68	0.12
356	600754	锦江酒店	24,300	614,061.00	0.11
357	000921	海信家电	24,700	612,807.00	0.11
358	300735	光弘科技	24,600	611,556.00	0.11
359	601016	节能风电	206,490	609,145.50	0.11
360	002568	百润股份	27,900	608,499.00	0.11
361	601000	唐山港	158,250	607,680.00	0.11
362	603290	斯达半导	6,300	605,367.00	0.11
363	600535	天士力	39,900	601,293.00	0.11
364	600848	上海临港	51,200	599,040.00	0.11
365	600004	白云机场	63,200	597,872.00	0.11
366	000825	太钢不锈	122,100	597,069.00	0.11
367	600816	建元信托	210,400	595,432.00	0.11
368	603927	中科软	31,100	593,699.00	0.11
369	600126	杭钢股份	72,100	588,336.00	0.11
370	000032	深桑达 A	30,400	588,240.00	0.11
371	601001	晋控煤业	44,700	587,805.00	0.11
372	002773	康弘药业	19,600	587,412.00	0.11
373	603650	彤程新材	13,200	582,648.00	0.11
374	600511	国药股份	20,200	580,750.00	0.11
375	002266	浙富控股	139,300	579,488.00	0.11
376	002423	中粮资本	49,100	574,470.00	0.11
377	000598	兴蓉环境	79,400	569,298.00	0.11
378	601966	玲珑轮胎	39,100	568,123.00	0.11
379	600598	北大荒	38,000	568,100.00	0.11
380	000563	陕国投 A	163,900	565,455.00	0.10
381	600483	福能股份	59,300	561,571.00	0.10
382	603000	人民网	29,470	561,403.50	0.10
383	000958	电投产融	86,300	558,361.00	0.10
384	002831	裕同科技	19,540	557,085.40	0.10
385	601333	广深铁路	181,300	551,152.00	0.10
386	600517	国网英大	91,700	551,117.00	0.10
387	000062	深圳华强	22,300	549,026.00	0.10
388	600739	辽宁成大	49,100	548,938.00	0.10
389	601918	新集能源	83,000	548,630.00	0.10
390	002439	启明星辰	38,800	547,856.00	0.10
391	002299	圣农发展	33,100	547,474.00	0.10
392	688318	财富趋势	4,136	547,275.52	0.10
393	600578	京能电力	107,200	546,720.00	0.10

394	688802	沐曦股份	1,365	545,181.00	0.10
395	301536	星宸科技	9,000	539,190.00	0.10
396	600808	马钢股份	127,555	538,282.10	0.10
397	300718	长盛轴承	6,300	537,768.00	0.10
398	601118	海南橡胶	91,500	535,275.00	0.10
399	600546	山煤国际	53,000	534,770.00	0.10
400	600655	豫园股份	104,000	533,520.00	0.10
401	688281	华秦科技	7,223	533,057.40	0.10
402	603341	龙旗科技	12,600	532,476.00	0.10
403	603899	晨光股份	19,600	530,376.00	0.10
404	300601	康泰生物	35,880	529,947.60	0.10
405	000951	中国重汽	31,300	528,970.00	0.10
406	603688	石英股份	14,450	528,581.00	0.10
407	601866	中远海发	208,467	525,336.84	0.10
408	688561	奇安信	14,759	525,125.22	0.10
409	002120	韵达股份	77,100	519,654.00	0.10
410	002670	国盛证券	30,840	519,345.60	0.10
411	600131	国网信通	32,000	516,480.00	0.10
412	600582	天地科技	88,445	515,634.35	0.10
413	600566	济川药业	19,600	515,480.00	0.10
414	000883	湖北能源	113,500	515,290.00	0.10
415	603833	欧派家居	9,800	510,482.00	0.09
416	000709	河钢股份	220,600	509,586.00	0.09
417	300529	健帆生物	25,600	503,552.00	0.09
418	601598	中国外运	82,700	501,162.00	0.09
419	603786	科博达	6,400	499,840.00	0.09
420	000739	普洛药业	30,700	499,489.00	0.09
421	600663	陆家嘴	63,100	499,121.00	0.09
422	600707	彩虹股份	76,700	497,783.00	0.09
423	000027	深圳能源	76,280	497,345.60	0.09
424	000967	盈峰环境	67,500	495,450.00	0.09
425	000088	盐田港	110,100	489,945.00	0.09
426	002508	老板电器	25,300	489,555.00	0.09
427	600528	中铁工业	59,300	485,074.00	0.09
428	002153	石基信息	43,734	473,639.22	0.09
429	000582	北部湾港	50,200	470,876.00	0.09
430	300888	稳健医疗	12,440	470,729.60	0.09
431	600871	石化油服	217,100	468,936.00	0.09
432	688709	成都华微	10,129	465,832.71	0.09
433	600906	财达证券	69,300	462,231.00	0.09
434	600959	江苏有线	133,630	459,687.20	0.09
435	300070	碧水源	116,255	455,719.60	0.08
436	603565	中谷物流	44,800	449,792.00	0.08

437	300957	贝泰妮	11,300	447,593.00	0.08
438	688172	燕东微	15,378	445,039.32	0.08
439	688363	华熙生物	10,174	444,400.32	0.08
440	002265	建设工业	16,500	442,530.00	0.08
441	603858	步长制药	28,200	441,048.00	0.08
442	688425	铁建重工	85,365	432,800.55	0.08
443	601098	中南传媒	38,400	432,384.00	0.08
444	603233	大参林	24,320	428,518.40	0.08
445	003022	联泓新科	21,400	423,934.00	0.08
446	688192	迪哲医药	7,333	422,380.80	0.08
447	600968	海油发展	108,600	417,024.00	0.08
448	301498	乖宝宠物	6,400	416,960.00	0.08
449	600764	中国海防	15,200	415,568.00	0.08
450	601061	中信金属	28,800	414,720.00	0.08
451	688563	航材股份	7,064	412,890.80	0.08
452	603529	爱玛科技	13,900	412,830.00	0.08
453	601928	凤凰传媒	40,800	409,632.00	0.08
454	000959	首钢股份	82,900	406,210.00	0.08
455	600062	华润双鹤	22,200	406,038.00	0.08
456	301200	大族数控	3,400	403,818.00	0.07
457	688248	南网科技	8,917	398,946.58	0.07
458	600295	鄂尔多斯	31,600	390,576.00	0.07
459	688336	三生国健	6,537	389,409.09	0.07
460	000785	居然智家	133,100	388,652.00	0.07
461	002032	苏泊尔	8,600	379,088.00	0.07
462	600606	绿地控股	225,300	373,998.00	0.07
463	001286	陕西能源	39,800	370,538.00	0.07
464	600098	广州发展	56,100	366,894.00	0.07
465	301301	川宁生物	35,800	363,012.00	0.07
466	000537	中绿电	44,100	362,061.00	0.07
467	601965	中国汽研	21,500	356,900.00	0.07
468	002372	伟星新材	34,000	354,620.00	0.07
469	600720	中交设计	49,000	353,780.00	0.07
470	688349	三一重能	13,001	328,665.28	0.06
471	000429	粤高速 A	27,900	328,662.00	0.06
472	600688	上海石化	117,400	326,372.00	0.06
473	603658	安图生物	9,200	325,864.00	0.06
474	000898	鞍钢股份	127,600	322,828.00	0.06
475	688295	中复神鹰	9,552	313,401.12	0.06
476	000937	冀中能源	56,600	304,508.00	0.06
477	688100	威胜信息	7,740	304,182.00	0.06
478	601139	深圳燃气	46,000	303,600.00	0.06
479	600339	中油工程	89,600	300,160.00	0.06

480	002608	江苏国信	40,100	296,339.00	0.05
481	601019	山东出版	33,500	289,440.00	0.05
482	600032	浙江新能	38,600	286,026.00	0.05
483	003035	南网能源	60,800	278,464.00	0.05
484	601228	广州港	80,600	261,144.00	0.05
485	603049	中策橡胶	4,607	257,761.65	0.05
486	688475	萤石网络	8,284	249,431.24	0.05
487	600927	永安期货	15,500	249,085.00	0.05
488	688819	天能股份	7,127	236,758.94	0.04
489	603707	健友股份	25,887	233,759.61	0.04
490	300140	节能环境	33,100	224,087.00	0.04
491	002945	华林证券	14,400	220,752.00	0.04
492	002461	珠江啤酒	23,600	219,244.00	0.04
493	600007	中国国贸	10,800	214,056.00	0.04
494	000539	粤电力 A	47,600	210,392.00	0.04
495	600299	安迪苏	21,500	192,855.00	0.04
496	001213	中铁特货	47,100	190,755.00	0.04
497	601921	浙版传媒	23,800	186,116.00	0.03
498	600271	航天信息	14,800	173,012.00	0.03
499	001221	悍高集团	1,860	107,557.40	0.02
500	001280	中国铀业	1,784	80,922.24	0.02
501	301656	联合动力	3,014	76,736.44	0.01
502	688729	屹唐股份	2,954	71,723.12	0.01
503	688809	强一股份	147	29,886.57	0.01
504	301638	南网数字	1,860	26,430.60	0.00
505	001386	马可波罗	1,261	23,366.33	0.00
506	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
507	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
508	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
509	001233	海安集团	303	15,719.64	0.00
510	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
511	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
512	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
513	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
514	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
515	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
516	001369	双欣环保	798	10,286.22	0.00
517	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
518	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
519	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
520	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
521	603418	友升股份	119	7,028.14	0.00
522	001285	瑞立科密	118	6,617.44	0.00

523	603092	德力佳	118	6,567.88	0.00
524	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
525	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
526	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
527	400174	中天 3	537,300	5,373.00	0.00
528	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
529	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
530	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
531	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
532	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
533	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
534	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688235	百济神州	7,036,027.41	0.93
2	688608	恒玄科技	6,821,012.20	0.90
3	688120	华海清科	3,838,597.06	0.51
4	002130	沃尔核材	2,491,116.00	0.33
5	000933	神火股份	2,482,599.00	0.33
6	688072	拓荆科技	2,360,723.46	0.31
7	688347	华虹公司	2,304,232.14	0.30
8	300450	先导智能	2,273,882.00	0.30
9	600363	联创光电	2,147,418.00	0.28
10	300454	深信服	2,130,299.00	0.28
11	002851	麦格米特	2,104,910.00	0.28
12	688213	思特威	2,101,992.24	0.28
13	002402	和而泰	2,066,020.00	0.27
14	300458	全志科技	2,063,835.00	0.27
15	300346	南大光电	2,021,811.80	0.27
16	600601	方正科技	1,992,083.00	0.26
17	688521	芯原股份	1,969,757.59	0.26
18	605589	圣泉集团	1,967,783.00	0.26
19	300115	长盈精密	1,920,942.00	0.25
20	300857	协创数据	1,892,545.80	0.25

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）

1	300476	胜宏科技	10,382,612.00	1.37
2	600418	江淮汽车	8,213,578.68	1.08
3	688521	芯原股份	6,332,567.11	0.83
4	688072	拓荆科技	5,967,330.57	0.79
5	688235	百济神州	5,355,108.72	0.71
6	002625	光启技术	5,190,937.00	0.68
7	603893	瑞芯微	5,064,253.00	0.67
8	688608	恒玄科技	4,991,528.92	0.66
9	688120	华海清科	4,680,746.41	0.62
10	600839	四川长虹	4,466,793.76	0.59
11	000988	华工科技	4,273,587.98	0.56
12	002384	东山精密	3,964,391.00	0.52
13	688213	思特威	3,404,075.97	0.45
14	600895	张江高科	3,310,725.00	0.44
15	600079	ST 人福	2,983,452.00	0.39
16	688047	龙芯中科	2,964,272.72	0.39
17	600988	赤峰黄金	2,912,454.00	0.38
18	300803	指南针	2,882,764.49	0.38
19	688099	晶晨股份	2,852,482.59	0.38
20	601933	永辉超市	2,787,961.00	0.37

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	272,273,311.08
卖出股票的收入（成交）总额	449,298,970.89

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,122,961.33
2	应收清算款	1,922,318.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,045,279.37

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,539	36,968.87	6,236,808.00	10.96%	9,928,485.00	17.45%	40,729,805.00	71.59%

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	长江金色晚晴（集合型）企业年金计划－上海浦东发展银行股份有限公司	1,278,300.00	2.25%
2	孙雪理	1,266,376.00	2.23%
3	招商证券股份有限公司	1,178,333.00	2.07%
4	香港中央结算有限公司	762,247.00	1.34%
5	中国农业再保险股份有限公司－农行专户四	720,000.00	1.27%
6	宋丹丹	501,700.00	0.88%
7	方正证券股份有限公司	403,290.00	0.71%
8	白巍	400,000.00	0.70%
8	罗志中	400,000.00	0.70%
10	中国银河证券股份有限公司	249,300.00	0.44%
-	招商银行股份有限公司－博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	40,729,805.00	71.59%

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

的情况，持有人为场内持有人。

2.前十名持有人为除博时中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 8 月 1 日)基金份额总额	2,762,185,861.00
本报告期期初基金份额总额	107,695,098.00
本报告期基金总申购份额	17,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	68,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	56,895,098.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2025 年 10 月 16 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》，张东先生任公司董事长（法定代表人）、代任公司总经理，离任公司总经理。江向阳先生离任公司董事长。

基金管理人于 2025 年 11 月 12 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》，陈宇先生任公司总经理。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 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 55000 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	博时基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 31 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正、暂停部分业务
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 28 日；2025 年 10 月 28 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局；中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控；合规内控

受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》;《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收；公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收
其他	-；-

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
招商证券	3	361,945,950.48	50.46%	74,577.36	50.47%	-
长江证券	2	127,782,355.14	17.81%	26,311.99	17.81%	-
国泰海通	2	112,831,859.39	15.73%	23,234.04	15.72%	增加 1 个
银河证券	1	45,335,616.43	6.32%	9,337.80	6.32%	-
中信建投	2	45,036,630.27	6.28%	9,276.60	6.28%	-
中金公司	2	23,374,409.87	3.26%	4,815.34	3.26%	-
中信证券	2	1,048,927.02	0.15%	216.15	0.15%	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

（1）本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

（2）本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

（3）本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服务协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成交金	占当期权

		债券成交总额的比例		回购成交总额的比例	额	证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	29,580.90	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-31
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-18
3	关于新增东方证券股份有限公司为部分基金流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-09
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增世纪证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-08
5	博时基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-06
6	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、	2025-11-13

		证监会基金电子披露网站	
7	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-11-12
8	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华福证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-11-12
9	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-10-28
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-10-17
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-10-16
12	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-09-30
13	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-09-04
14	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-08-29
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-08-07
16	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-07-21
17	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、	2025-06-26

		证监会基金电子披露网站	
18	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
19	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-20250606	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
20	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-20250603	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
21	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-25
22	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-22
23	博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
24	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-20250408	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
25	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
26	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
27	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-20250325	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
28	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、	2025-03-22

		证监会基金电子披露网站	
29	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-21
30	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
31	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
32	关于博时基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
33	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-22

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时中证500交易型开放	1	2025-01-01~2025-12-31	83,936,005.00	3,677,900.00	46,884,100.00	40,729,805.00	71.59%

式指数证券投资基金发起式联接基金							
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.申购份额包含买入份额，赎回份额包含卖出份额。

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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

2、《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

5、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

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

二〇二六年三月三十一日