

**博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金  
2023 年中期报告  
2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## § 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§4 管理人报告</b>	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58

7.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	60
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录 .....	64
12.2 存放地点 .....	65
12.3 查阅方式 .....	65

## § 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	109,695,098.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 31 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	2,038,769.09
本期利润	30,240,207.10
加权平均基金份额本期利润	0.2779
本期加权平均净值利润率	3.84%
本期基金份额净值增长率	3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	220,481,363.63
期末可供分配基金份额利润	2.0099
期末基金资产净值	776,956,986.47
期末基金份额净值	7.0829
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	39.62%

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

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

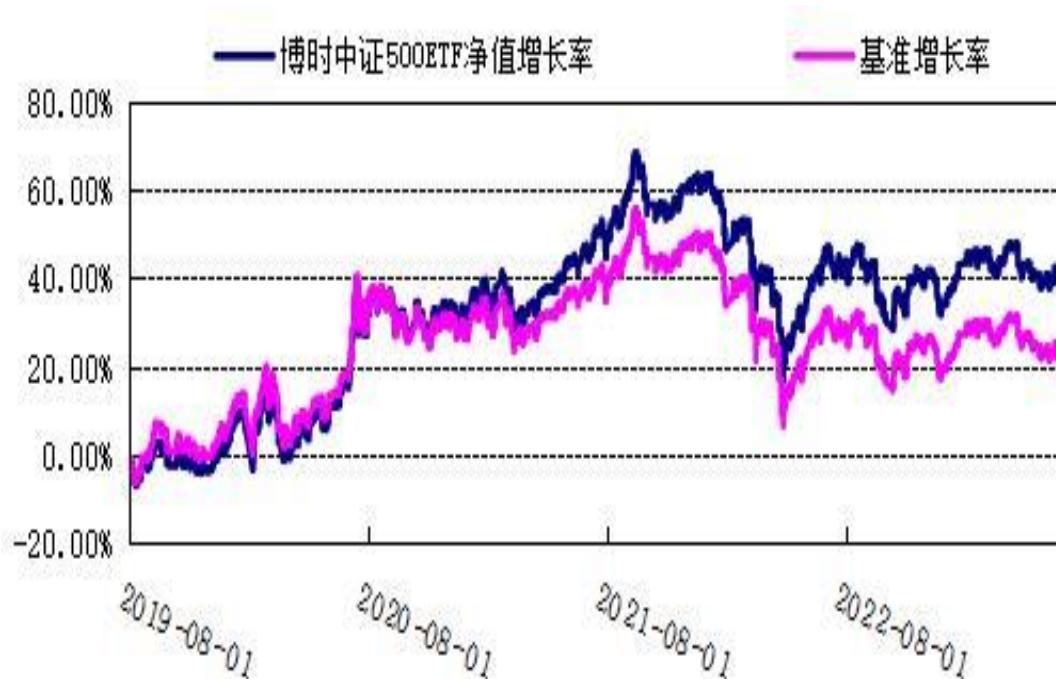
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.02%	0.93%	-0.81%	0.93%	0.79%	0.00%
过去三个月	-3.93%	0.82%	-5.38%	0.83%	1.45%	-0.01%
过去六个月	3.86%	0.78%	2.29%	0.79%	1.57%	-0.01%
过去一年	-4.25%	0.95%	-7.06%	0.96%	2.81%	-0.01%
过去三年	18.89%	1.18%	2.29%	1.19%	16.60%	-0.01%
自基金合同生效起至今	39.62%	1.24%	22.34%	1.26%	17.28%	-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



### § 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 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 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	-	16.3	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015

					年 10 月 8 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 5 月 11 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日—至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 21 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 28 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022 年 1 月 10 日—至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 3 月 3 日—至今)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022 年 7 月 26 日—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)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	6.9	王萌先生,博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 89 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

2023 年上半年，美国通胀持续下行，经济指标改善，在龙头科技公司的带领下美股大幅反弹。其他海外市场在上半年表现出色，日经指数创 1991 年以来的新高，纳斯达克和标普 500 指数也有不错表现。国内方面，经济仍在修复，但供给回升快于需求，需求驱动不足。在国内经济复苏放缓的背景下 A 股市场整体处于低位盘整状态。小盘和价值风格表现强劲，国证 2000 指数、中证 1000 指数以及红利指数在上半年均录得正收益。相比较而言，大盘成长风格持续走弱。板块之间的结构分化加剧，受估值驱动因素影响的“中特估”相关板块走势强劲。得益于人工智能科技的突破进展以及相关应用场景的落地，科技板块表现亮眼，受到市场关注。消费和新能源板块持续走弱。根据中信一级行业指数显示，2023 年上半年涨幅靠前的行业是通信、传媒、计算机、家电和机械等，涨幅靠后的行业有消费者服务、房地产、农林牧渔、建材和基础化工等。受人民币贬值以及国内经济增速不及预期的影响，港股市场在年初冲高后回落，恒生指数在上半年录得负收益。电讯和能源板块涨幅领先，医疗保健、地产建筑和必须性消费板块跌幅较大。本基金为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 7.0829 元，份额累计净值为 1.3962 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 3.86%，同期业绩基准增长率 2.29%。

## 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 2023 年下半年，美国经济仍具有较强韧性。流动性方面，美联储借款逐步到期、继续缩表，以及新发国债都会使得金融流动性重新收缩。下半年盈利韧性交易可能仍是主逻辑，而软着陆的前景将缓解分子端的压力，对美股偏利好。国内方面，受疫情政策放开影响，消费环境发生了改变，接触性消费快速增长，叠加政策推动，消费潜力进一步释放。在稳经济、促恢复、扩内需等政策支撑下，市场预期好转，内需稳定恢复，加之降息等政策出台，支撑信贷规模扩张。随着宏观稳经济政策协同发力，整体经济继续稳步恢复，有效需求不足的问题有望得到缓解，经济内生修复动能有望加强，恢复和扩大需求是未来经济持续回升向好的关键所在。

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。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	23,968,615.49	26,138,742.80

结算备付金		8,413,788.34	6,742,123.73
存出保证金		4,636,749.34	5,180,465.30
交易性金融资产	6.4.3.2	740,318,104.35	718,681,672.18
其中：股票投资		740,318,104.35	718,681,672.18
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.3.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.3.4	—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资	6.4.3.5	—	—
应收清算款		300,370.11	215,514.30
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.3.6	1,217.93	—
资产总计		777,638,845.56	756,958,518.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> 2023年6月30日	<b>上年度末</b> 2022年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.3.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		857.43	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		94,825.29	99,592.07
应付托管费		31,608.42	33,197.33
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		2,429.22	2.26
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.3.7	552,138.73	583,421.66
负债合计		681,859.09	716,213.32
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	556,475,622.84	562,563,139.57
其他综合收益		—	—

未分配利润	6.4.3.9	220,481,363.63	193,679,165.42
净资产合计		776,956,986.47	756,242,304.99
<b>负债和净资产总计</b>		<b>777,638,845.56</b>	<b>756,958,518.31</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 7.0829 元，基金份额总额 109,695,098.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
<b>一、营业收入</b>		31,228,210.15	-62,924,508.14
1. 利息收入		122,523.27	116,557.39
其中：存款利息收入	6.4.3.10	115,921.80	114,166.20
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		-	-
证券出借利息收入		6,601.47	2,391.19
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,777,733.19	-26,235,197.82
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-5,804,112.08	-31,074,699.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	48,590.64
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	64,947.18	-2,974,479.96
股利收益	6.4.3.15	8,516,898.09	7,765,390.57
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	28,201,438.01	-37,368,507.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	126,515.68	562,640.07
<b>减：二、营业总支出</b>		988,003.05	842,626.45
1. 管理人报酬		585,254.03	489,145.96
2. 托管费		195,084.65	163,048.64
3. 销售服务费		-	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		263.86	8.97
8. 其他费用	6.4.3.19	207,400.51	190,422.88
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		30,240,207.10	-63,767,134.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		30,240,207.10	-63,767,134.59
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		30,240,207.10	-63,767,134.59

### 6.3 净资产(基金净值)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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	562,563,139.57	-	193,679,165.42	756,242,304.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	562,563,139.57	-	193,679,165.42	756,242,304.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,087,516.73	-	26,802,198.21	20,714,681.48
(一)、综合收益总额	-	-	30,240,207.10	30,240,207.10
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-6,087,516.73	-	-3,438,008.89	-9,525,525.62
其中：1. 基金申购款	24,350,067.04	-	9,597,990.37	33,948,057.41

2. 基金赎回款	-30,437,583.77	-	-13,035,999.26	-43,473,583.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	556,475,622.84	-	220,481,363.63	776,956,986.47
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日				
项目	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	379,937,636.75	-	242,327,458.32	622,265,095.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	379,937,636.75	-	242,327,458.32	622,265,095.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	146,100,402.24	-	-1,309,982.77	144,790,419.47
(一)、综合收益总额	-	-	-63,767,134.59	-63,767,134.59
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	146,100,402.24	-	62,457,151.82	208,557,554.06
其中：1. 基金申购款	344,959,283.00	-	142,092,141.26	487,051,424.26
2. 基金赎回款	-198,858,880.76	-	-79,634,989.44	-278,493,870.20
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产 (基金净值)	526,038,038.99	-	241,017,475.55	767,055,514. 54
---------------------	----------------	---	----------------	--------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 江向阳, 主管会计工作负责人: 徐卫, 会计机构负责人: 佴方方

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按

照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

#### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	23,968,615.49
等于： 本金	23,966,393.39
加： 应计利息	2,222.10
减： 坏账准备	—
定期存款	—
等于： 本金	—
加： 应计利息	—
减： 坏账准备	—
其中： 存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于： 本金	—
加： 应计利息	—
减： 坏账准备	—
合计	23,968,615.49

##### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	785,748,961.29	—	740,318,104.35	-45,430,856.94
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	785,748,961. 29	-	740,318,104.35	-45,430,856.94

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				备注	
	合同/名义 金额	公允价值				
		资产	负债			
利率衍生工具	-	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	-	
权益衍生工具	30,946,200.00	-	-	-	-	
---股指期货	30,946,200.00	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	-	
合计	30,946,200.00	-	-	-	-	

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

##### 6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2312	IC2312	26.00	30,805,840.00	-140,360.00
合计	-	-	-	-140,360.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-140,360.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.3.5 其他权益工具投资

##### 6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

#### 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	—
其他应收款	1,217.93
待摊费用	—
合计	1,217.93

#### 6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	131,660.33
其中：交易所市场	131,660.33
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	331,218.25
合计	552,138.73

#### 6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	110,895,098.00	562,563,139.57
本期申购	4,800,000.00	24,350,067.04
本期赎回(以“-”号填列)	-6,000,000.00	-30,437,583.77
本期末	109,695,098.00	556,475,622.84

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

#### 6.4.3.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	399,938,991.67	-206,259,826.25	193,679,165.42
本期利润	2,038,769.09	28,201,438.01	30,240,207.10
本期基金份额交易产生的变动数	-4,289,406.38	851,397.49	-3,438,008.89
其中：基金申购款	17,340,594.77	-7,742,604.40	9,597,990.37
基金赎回款	-21,630,001.15	8,594,001.89	-13,035,999.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	397,688,354.38	-177,206,990.75	220,481,363.63

#### 6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	44,666.57
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	71,077.61
其他	177.62
合计	115,921.80

#### 6.4.3.11 股票投资收益

##### 6.4.3.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,950,544.30
股票投资收益——赎回差价收入	-853,567.78
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	-5,804,112.08

##### 6.4.3.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	116,099,169.01
减：卖出股票成本总额	120,770,829.42
减：交易费用	278,883.89
买卖股票差价收入	-4,950,544.30

**6.4.3.11.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	43,473,583.03
减：现金支付赎回款总额	22,424,222.03
减：赎回股票成本总额	21,902,928.78
减：交易费用	—
赎回差价收入	-853,567.78

**6.4.3.12 债券投资收益**
**6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无发生额。

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

无发生额。

**6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无发生额。

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

无发生额。

**6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	64,947.18

**6.4.3.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,516,898.09
其中：证券出借权益补偿收入	2,550.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	8,516,898.09

**6.4.3.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	27,224,118.01
——股票投资	27,224,118.01
——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	977,320.00
——权证投资	—
——股指期货	977,320.00
4. 其他	—
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	28,201,438.01

#### 6.4.3.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	—
替代损益	126,515.68
合计	126,515.68

#### 6.4.3.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.3.19 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
其他	234.56
指数使用费	117,050.80
银行汇划费	855.00
合计	207,400.51

## 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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	39,861,050.18	17.87%	392,570,944.35	60.35%

#### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	8,486.89	5.96%	3,371.69	2.56%
关联方名称	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	82,961.43	30.54%	47,968.85	21.53%

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

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

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	585,254.03	489,145.96
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	195,084.65	163,048.64

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

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日		份额单位：份
	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	
招商证券	682,697.00	0.62%	1,232,706.00	1.11%	
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	90,199,505.00	82.23%	87,685,705.00	79.07%	

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

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日	期末余额	2022年1月1日至2022年6月30日	期末余额
招商银行-活期存款	23,968,615.49	44,666.57	26,550,987.23	34,150.78

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

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	7,523.00	189,955.75
上年度可比期间					

2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
招商证券股份有限公司	002948	青岛银行	网下发行	20,490.00	65,568.00
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	4,658.00	173,417.34
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末(2023 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	4,180.00	241,018.80	241,018.80	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,676.00	124,755.68	124,755.68	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241.00	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	4,801.00	95,347.86	86,706.06	-
301200	朗威	2023-	5 个交易	新股	25.82	25.82	2,754	71,10	71,10	-

2	股份	06-28	易日	未上市			.00	8.28	8.28	
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	7 个交 易日	新股 未上 市	36.90	36.90	1,775 .00	65,49 7.50	65,49 7.50	-
68848 5	九州 一轨	2023- 01-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.47	15.17	3,580 .00	62,54 2.60	54,30 8.60	-
68847 2	阿特 斯	2023- 06-02	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.10	17.04	2,964 .00	32,90 0.40	50,50 6.56	-
68846 9	中芯 集成	2023- 04-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	5.69	5.41	8,515 .00	48,45 0.35	46,06 6.15	-
68836 1	中科 飞测	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.60	64.67	695.0 0	16,40 2.00	44,94 5.65	-
30132 5	曼恩 斯特	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限售	76.80	107.9 5	364.0 0	27,95 5.20	39,29 3.80	-
30135 8	湖南 裕能	2023- 02-01	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.77	42.89	890.0 0	21,15 5.30	38,17 2.10	-
68844 3	智翔 金泰	2023- 06-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	37.88	29.49	1,144 .00	43,33 4.72	33,73 6.56	-
30129 1	明阳 电气	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	38.13	31.03	1,046 .00	39,88 3.98	32,45 7.38	-
30130 1	川宁 生物	2022- 12-20	6 个月	首次 公开 发行 限售	5.00	8.96	3,574 .00	17,87 0.00	32,02 3.04	-
68814 6	中船 特气	2023- 04-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	36.15	38.13	808.0 0	29,20 9.20	30,80 9.04	-

68848 4	南芯 科技	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.99	36.71	820.0 0	32,79 1.80	30,10 2.20	-
68857 6	西山 科技	2023- 05-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	135.8 0	120.4 1	240.0 0	32,59 2.00	28,89 8.40	-
68853 1	日联 科技	2023- 03-24	6 个月	首次 公开 发行 限售	152.3 8	135.9 7	208.0 0	31,69 5.04	28,28 1.76	-
30148 6	致尚 科技	2023- 06-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	57.66	57.66	465.0 0	26,81 1.90	26,81 1.90	-
68858 2	芯动 联科	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.74	40.68	648.0 0	17,32 7.52	26,36 0.64	-
68835 2	颀中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	12.10	12.07	2,098 .00	25,38 5.80	25,32 2.86	-
30124 6	宏源 药业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	50.00	30.71	813.0 0	40,65 0.00	24,96 7.23	-
00128 7	中电 港	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.88	21.02	1,133 .00	13,46 0.04	23,81 5.66	-
30129 3	三博 脑科	2023- 04-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	29.60	71.42	333.0 0	9,856 .80	23,78 2.86	-
30130 3	真兰 仪表	2023- 02-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.80	22.32	1,058 .00	28,35 4.40	23,61 4.56	-
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.17	23.50	956.0 0	20,23 8.52	22,46 6.00	-
30130	美利	2023-	6 个月	首次	32.34	31.86	687.0	22,21	21,88	-

7	信	04-14		公开发行限售			0	7.58	7.82	
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	首次公开发行限售	43.67	53.05	410.00	17,904.70	21,750.50	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	75.00	90.76	221.00	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	125.80	118.03	163.00	20,505.40	19,238.89	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	首次公开发行限售	87.41	53.24	357.00	31,204.18	19,006.68	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	首次公开发行限售	46.16	35.72	493.00	22,756.88	17,609.96	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	首次公开发行限售	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	首次公开发行限售	6.58	7.58	2,148.00	14,133.84	16,281.84	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	首次公开发行限售	19.99	16.90	921.00	18,410.79	15,564.90	-
301332	德玛	2023-05-09	6 个月	首次公开发行限售	14.81	13.73	1,122.00	16,616.82	15,405.06	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	首次公开	16.24	16.95	879.00	14,274.96	14,899.05	-

				发行 限售						
30130 5	朗坤 环境	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.25	19.69	753.0 0	19,01 3.25	14,82 6.57	-
30141 9	阿莱 德	2023- 02-02	6 个月	首次 公开 发行 限售	24.80	43.85	330.0 0	8,184 .00	14,47 0.50	-
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.16	16.21	888.0 0	12,57 4.08	14,39 4.48	-
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.18	14.59	959.0 0	10,72 1.62	13,99 1.81	-
30138 7	光大 同创	2023- 04-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	58.32	45.36	307.0 0	17,90 4.24	13,92 5.52	-
30139 5	仁信 新材	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.68	26.68	520.0 0	13,87 3.60	13,87 3.60	-
30121 0	金杨 股份	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	57.88	49.17	281.0 0	16,26 4.28	13,81 6.77	-
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	20.92	19.16	721.0 0	15,08 3.32	13,81 4.36	-
30138 2	蜂助 手	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.80	32.84	408.0 0	9,710 .40	13,39 8.72	-
30132 0	豪江 智能	2023- 06-01	6 个月	首次 公开 发行 限售	13.06	20.62	642.0 0	8,384 .52	13,23 8.04	-
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次 公开 发行	26.66	31.50	418.0 0	11,14 3.88	13,16 7.00	-

				限售						
68862 9	华丰 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	9.26	18.59	708.0 0	6,556 .08	13,16 1.72	-
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	10.68	12.34	1,016 .00	10,85 0.88	12,53 7.44	-
30136 0	荣旗 科技	2023- 04-17	6 个月	首次 公开 发行 限售	71.88	92.60	134.0 0	9,631 .92	12,40 8.40	-
30134 5	涛涛 车业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	73.45	46.64	266.0 0	19,53 7.70	12,40 6.24	-
30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	19.99	583.0 0	11,65 4.17	11,65 4.17	-
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.86	23.85	472.0 0	10,31 7.92	11,25 7.20	-
60313 5	中重 科技	2023- 03-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.80	17.89	628.0 0	11,17 8.40	11,23 4.92	-
30114 1	中科 磁业	2023- 03-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	41.20	42.69	262.0 0	10,79 4.40	11,18 4.78	-
30148 8	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.78	39.78	262.0 0	10,42 2.36	10,42 2.36	-
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.28	29.87	336.0 0	8,494 .08	10,03 6.32	-
68847 9	友车 科技	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限售	33.99	29.49	332.0 0	11,28 4.68	9,790 .68	-

30123 2	飞沃 科技	2023- 06-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	72.50	58.42	165.0 0	11,96 2.50	9,639 .30	-
30135 5	南王 科技	2023- 06-02	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.55	16.75	563.0 0	9,880 .65	9,430 .25	-
30135 7	北方 长龙	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	50.00	48.39	190.0 0	9,500 .00	9,194 .10	-
30138 6	未来 电器	2023- 03-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	29.99	23.79	378.0 0	11,33 6.22	8,992 .62	-
30132 3	新莱 福	2023- 05-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.06	39.36	228.0 0	8,905 .68	8,974 .08	-
30137 3	凌玮 科技	2023- 01-20	6 个月	首次 公开 发行 限售	33.73	31.85	277.0 0	9,343 .21	8,822 .45	-
60106 5	江盐 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	10.36	11.84	741.0 0	7,676 .76	8,773 .44	-
30117 0	锡南 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	34.00	34.93	250.0 0	8,500 .00	8,732 .50	-
68853 5	华海 诚科	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	35.00	51.23	161.0 0	5,635 .00	8,248 .03	-
60113 3	柏诚 股份	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.66	12.26	664.0 0	7,742 .24	8,140 .64	-
30120 2	朗威 股份	2023- 06-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.82	25.82	306.0 0	7,900 .92	7,900 .92	-
30129	美硕	2023-	6 个月	首次	37.40	36.07	215.0	8,041	7,755	-

5	科技	06-19		公开发行限售			0	.00	.05	
30120 3	国泰 环保	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	46.13	34.40	225.0 0	10,37 9.25	7,740 .00	-
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	36.90	36.90	198.0 0	7,306 .20	7,306 .20	-
30142 8	世纪 恒通	2023- 05-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.35	30.60	229.0 0	6,034 .15	7,007 .40	-
00138 0	华纬 科技	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	28.84	30.78	170.0 0	4,902 .80	5,232 .60	-
60312 5	常青 科技	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.98	24.53	160.0 0	4,156 .80	3,924 .80	-
00132 8	登康 口腔	2023- 03-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	20.68	25.49	145.0 0	2,998 .60	3,696 .05	-
00128 2	三联 锻造	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	27.93	33.03	105.0 0	2,932 .65	3,468 .15	-
00136 0	南矿 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	15.38	14.87	177.0 0	2,722 .26	2,631 .99	-
60313 7	恒尚 节能	2023- 04-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	15.90	17.09	139.0 0	2,210 .10	2,375 .51	-
00132 4	长青 科技	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	18.88	19.60	114.0 0	2,152 .32	2,234 .40	-
00136 7	海森 药业	2023- 03-30	6 个月	首次 公开	44.48	39.48	55.00	2,446 .40	2,171 .40	-

				发行限售						
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	首次公开发行限售	14.58	16.13	122.00	1,778.76	1,967.86	-

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

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

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

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

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	*ST 中天	2023-05-19	重大事项停牌	0.01	3000-12-31		537,300.00	1,162,804.48	5,373.00	-
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	76,000.00	435,383.45	529,720.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
1	688777	中控技术	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 13 日	62.78	7,600.00	477,128.00
2	300418	昆仑万维	2023 年 7 月 5 日	40.28	10,400.00	418,912.00
3	002463	沪电股份	2023 年 7 月 11 日	20.94	20,000.00	418,800.00
4	688256	寒武纪	2023 年 7 月 12 日	188.00	2,200.00	413,600.00

5	600516	方大炭素	2023 年 7 月 13 日	6.20	45,800.00	283,960.00
6	688390	固德威	2023 年 7 月 13 日	166.86	1,600.00	266,976.00
7	002624	完美世界	2023 年 7 月 5 日	16.89	14,900.00	251,661.00
8	002281	光迅科技	2023 年 7 月 11 日	37.09	3,000.00	111,270.00
合计					105,500.00	2,642,307.00

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，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文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理与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。

### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.9.3 流动性风险

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

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合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。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内

变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

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

###### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	23,968,615.49	-	-	-	23,968,615.49
结算备付金	8,413,788.34	-	-	-	8,413,788.34
存出保证金	15,873.34	-	-	4,620,876.00	4,636,749.34
交易性金融资产	-	-	-	740,318,104.35	740,318,104.35
应收清算款	-	-	-	300,370.11	300,370.11
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,217.93	1,217.93
<b>资产总计</b>	<b>32,398,277.17</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>745,240,568.39</b>	<b>777,638,845.56</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	857.43	857.43
应付管理人报酬	-	-	-	94,825.29	94,825.29
应付托管费	-	-	-	31,608.42	31,608.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,429.22	2,429.22
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	552,138.73	552,138.73
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>681,859.09</b>	<b>681,859.09</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>32,398,277.17</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>744,558,709.30</b>	<b>776,956,986.47</b>
<b>上年度末 2022年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	26,138,742.80	-	-	-	26,138,742.80
结算备付金	6,742,123.73	-	-	-	6,742,123.73
存出保证金	44,955.70	-	-	5,135,509.60	5,180,465.30
交易性金融资产	-	-	-	718,681,672.18	718,681,672.18
应收清算款	-	-	-	215,514.30	215,514.30
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>32,925,822.23</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>724,032,696.08</b>	<b>756,958,518.31</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	99,592.07	99,592.07
应付托管费	-	-	-	33,197.33	33,197.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	2.26	2.26
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	583,421.66	583,421.66
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>716,213.32</b>	<b>716,213.32</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>32,925,822.23</b>			<b>723,316,482.76</b>	<b>756,242,304.99</b>

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	740,318,104.35	95.28	718,681,672.18	95.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>740,318,104.35</b>	<b>95.28</b>	<b>718,681,672.18</b>	<b>95.03</b>

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3,809	增加约 3,613
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,809	减少约 3,613

## 6.4.10 公允价值

### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	737,660,389.01
第二层次	1,308,558.68
第三层次	1,349,156.66
合计	740,318,104.35

#### 6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

很小。

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	740,318,104.35	95.20
	其中：股票	740,318,104.35	95.20
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	32,382,403.83	4.16
8	其他各项资产	4,938,337.38	0.64
9	合计	777,638,845.56	100.00

注：截至报告期末，股票投资中转融通融出股票金额 2,642,307.00 元，净值占比 0.34%。

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,157,986.00	0.66
B	采矿业	27,140,693.84	3.49
C	制造业	464,550,951.48	59.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,425,507.27	3.27
E	建筑业	8,198,421.15	1.06
F	批发和零售业	23,312,853.07	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	11,101,802.99	1.43
H	住宿和餐饮业	1,379,560.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,550,381.94	7.79

J	金融业	63,091,360.70	8.12
K	房地产业	10,915,959.60	1.40
L	租赁和商务服务业	9,034,269.00	1.16
M	科学、研究和技术服务业	8,292,690.78	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	4,174,268.84	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,704,705.29	0.48
R	文化、体育和娱乐业	10,408,999.00	1.34
S	综合	3,877,693.40	0.50
	合计	740,318,104.35	95.28

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	69,700	10,277,265.00	1.32
2	688256	寒武纪	22,996	4,323,248.00	0.56
3	000988	华工科技	108,962	4,141,645.62	0.53
4	002340	格林美	556,500	3,845,415.00	0.49
5	002384	东山精密	148,400	3,843,560.00	0.49
6	002422	科伦药业	127,700	3,790,136.00	0.49
7	600372	中航电子	243,047	3,689,453.46	0.47
8	300418	昆仑万维	90,600	3,649,368.00	0.47
9	300012	华测检测	182,400	3,556,800.00	0.46
10	600157	永泰能源	2,431,400	3,452,588.00	0.44
11	300724	捷佳伟创	30,200	3,392,970.00	0.44
12	600079	人福医药	124,000	3,340,560.00	0.43
13	600489	中金黄金	315,200	3,256,016.00	0.42
14	300003	乐普医疗	142,500	3,221,925.00	0.41
15	688777	中控技术	51,038	3,204,165.64	0.41
16	600487	亨通光电	213,800	3,134,308.00	0.40
17	002738	中矿资源	61,280	3,121,603.20	0.40
18	002028	思源电气	66,591	3,111,131.52	0.40
19	600536	中国软件	65,510	3,071,108.80	0.40
20	002463	沪电股份	144,700	3,030,018.00	0.39
21	601058	赛轮轮胎	265,500	3,024,045.00	0.39
22	601555	东吴证券	434,340	3,014,319.60	0.39
23	300037	新宙邦	56,520	2,932,822.80	0.38
24	600765	中航重机	110,580	2,931,475.80	0.38
25	000066	中国长城	209,800	2,901,534.00	0.37
26	600885	宏发股份	90,300	2,876,055.00	0.37
27	000807	云铝股份	225,630	2,872,269.90	0.37
28	600482	中国动力	117,000	2,742,480.00	0.35

29	000009	中国宝安	223,720	2,700,300.40	0.35
30	688099	晶晨股份	31,819	2,682,978.08	0.35
31	000423	东阿阿胶	49,700	2,656,465.00	0.34
32	300146	汤臣倍健	110,500	2,649,790.00	0.34
33	600352	浙江龙盛	282,200	2,638,570.00	0.34
34	300058	蓝色光标	269,900	2,609,933.00	0.34
35	002966	苏州银行	397,390	2,602,904.50	0.34
36	002156	通富微电	114,700	2,592,220.00	0.33
37	002185	华天科技	278,000	2,557,600.00	0.33
38	601108	财通证券	352,600	2,552,824.00	0.33
39	600415	小商品城	297,200	2,535,116.00	0.33
40	002625	光启技术	163,400	2,493,484.00	0.32
41	002624	完美世界	147,351	2,488,758.39	0.32
42	600027	华电国际	368,900	2,467,941.00	0.32
43	300144	宋城演艺	198,500	2,461,400.00	0.32
44	600109	国金证券	282,600	2,450,142.00	0.32
45	000783	长江证券	419,600	2,433,680.00	0.31
46	600988	赤峰黄金	180,400	2,428,184.00	0.31
47	601233	桐昆股份	182,900	2,423,425.00	0.31
48	600161	天坛生物	89,200	2,421,780.00	0.31
49	601077	渝农商行	671,100	2,409,249.00	0.31
50	002008	大族激光	91,500	2,397,300.00	0.31
51	600298	安琪酵母	66,082	2,392,829.22	0.31
52	300568	星源材质	138,900	2,387,691.00	0.31
53	600418	江淮汽车	189,300	2,383,287.00	0.31
54	300285	国瓷材料	86,940	2,382,156.00	0.31
55	600096	云天化	139,100	2,374,437.00	0.31
56	002385	大北农	358,900	2,368,740.00	0.30
57	002223	鱼跃医疗	65,464	2,356,049.36	0.30
58	000630	铜陵有色	798,800	2,308,532.00	0.30
59	002407	多氟多	116,040	2,304,554.40	0.30
60	600862	中航高科	90,400	2,288,024.00	0.29
61	603882	金域医学	30,300	2,287,650.00	0.29
62	300390	天华新能	63,440	2,271,152.00	0.29
63	603444	吉比特	4,600	2,259,106.00	0.29
64	002409	雅克科技	30,900	2,251,992.00	0.29
65	603688	石英股份	19,700	2,242,648.00	0.29
66	300024	机器人	134,400	2,240,448.00	0.29
67	601162	天风证券	751,500	2,239,470.00	0.29
68	002497	雅化集团	125,000	2,222,500.00	0.29
69	000933	神火股份	170,900	2,221,700.00	0.29
70	300474	景嘉微	24,650	2,218,253.50	0.29
71	300073	当升科技	44,034	2,216,231.22	0.29
72	002240	盛新锂能	69,300	2,208,591.00	0.28

73	300395	菲利华	44,800	2,204,160.00	0.28
74	600705	中航产融	574,300	2,199,569.00	0.28
75	300604	长川科技	46,200	2,194,038.00	0.28
76	601168	西部矿业	206,600	2,171,366.00	0.28
77	002439	启明星辰	72,400	2,154,624.00	0.28
78	605358	立昂微	58,600	2,152,378.00	0.28
79	000932	华菱钢铁	449,240	2,142,874.80	0.28
80	603596	伯特利	27,000	2,140,020.00	0.28
81	600066	宇通客车	144,100	2,124,034.00	0.27
82	000975	银泰黄金	180,647	2,113,569.90	0.27
83	002600	领益智造	305,200	2,108,932.00	0.27
84	300136	信维通信	104,900	2,106,392.00	0.27
85	600060	海信视像	85,000	2,103,750.00	0.27
86	002138	顺络电子	87,300	2,087,343.00	0.27
87	002797	第一创业	364,360	2,084,139.20	0.27
88	002568	百润股份	56,900	2,068,315.00	0.27
89	002465	海格通信	199,900	2,066,966.00	0.27
90	603816	顾家家居	53,400	2,037,210.00	0.26
91	002850	科达利	15,400	2,036,650.00	0.26
92	600563	法拉电子	14,800	2,032,040.00	0.26
93	000021	深科技	101,500	2,028,985.00	0.26
94	601128	常熟银行	297,000	2,025,540.00	0.26
95	603939	益丰药房	54,720	2,024,640.00	0.26
96	600839	四川长虹	400,266	2,021,343.30	0.26
97	600160	巨化股份	146,500	2,018,770.00	0.26
98	300253	卫宁健康	186,200	2,014,684.00	0.26
99	000591	太阳能	296,600	2,010,948.00	0.26
100	300832	新产业	34,000	2,006,000.00	0.26
101	600879	航天电子	235,800	2,001,942.00	0.26
102	688567	孚能科技	92,518	1,997,463.62	0.26
103	600873	梅花生物	223,500	1,995,855.00	0.26
104	000683	远兴能源	275,000	1,977,250.00	0.25
105	688521	芯原股份	27,351	1,967,083.92	0.25
106	601990	南京证券	239,700	1,960,746.00	0.25
107	600392	盛和资源	152,000	1,956,240.00	0.25
108	002368	太极股份	47,318	1,948,082.06	0.25
109	002078	太阳纸业	181,769	1,943,110.61	0.25
110	300699	光威复材	62,980	1,942,933.00	0.25
111	600497	驰宏锌锗	386,472	1,940,089.44	0.25
112	603589	口子窖	39,300	1,939,455.00	0.25
113	300866	安克创新	22,100	1,933,750.00	0.25
114	688169	石头科技	6,023	1,931,455.64	0.25
115	601696	中银证券	180,700	1,926,262.00	0.25
116	000729	燕京啤酒	152,800	1,905,416.00	0.25

117	300118	东方日升	74,200	1,901,746.00	0.24
118	600177	雅戈尔	301,200	1,900,572.00	0.24
119	002025	航天电器	29,700	1,894,860.00	0.24
120	600516	方大炭素	305,600	1,894,720.00	0.24
121	000831	中国稀土	63,700	1,885,520.00	0.24
122	002294	信立泰	60,320	1,881,380.80	0.24
123	300017	网宿科技	264,100	1,877,751.00	0.24
124	600141	兴发集团	84,300	1,873,146.00	0.24
125	600642	申能股份	266,035	1,859,584.65	0.24
126	688390	固德威	11,091	1,850,644.26	0.24
127	000728	国元证券	283,800	1,850,376.00	0.24
128	002673	西部证券	290,600	1,845,310.00	0.24
129	002430	杭氧股份	53,383	1,834,239.88	0.24
130	600699	均胜电子	103,800	1,831,032.00	0.24
131	000629	钒钛股份	466,300	1,823,233.00	0.23
132	600170	上海建工	674,300	1,813,867.00	0.23
133	002532	天山铝业	302,700	1,813,173.00	0.23
134	600325	华发股份	183,600	1,808,460.00	0.23
135	600118	中国卫星	64,000	1,805,440.00	0.23
136	002273	水晶光电	150,800	1,800,552.00	0.23
137	002195	二三四五	620,600	1,793,534.00	0.23
138	002268	电科网安	64,000	1,783,680.00	0.23
139	601966	玲珑轮胎	80,000	1,777,600.00	0.23
140	600521	华海药业	96,500	1,776,565.00	0.23
141	600153	建发股份	162,800	1,776,148.00	0.23
142	002739	万达电影	141,600	1,775,664.00	0.23
143	002372	伟星新材	86,200	1,770,548.00	0.23
144	600166	福田汽车	520,489	1,769,662.60	0.23
145	600486	扬农化工	20,200	1,765,884.00	0.23
146	000400	许继电气	76,500	1,763,325.00	0.23
147	600143	金发科技	201,700	1,760,841.00	0.23
148	600549	厦门钨业	92,400	1,758,372.00	0.23
149	300595	欧普康视	58,100	1,754,039.00	0.23
150	000998	隆平高科	114,100	1,751,435.00	0.23
151	603000	人民网	59,870	1,748,204.00	0.23
152	600399	抚顺特钢	171,200	1,746,240.00	0.22
153	688002	睿创微纳	38,948	1,744,870.40	0.22
154	000738	航发控制	71,400	1,742,160.00	0.22
155	600637	东方明珠	222,300	1,738,386.00	0.22
156	688220	翱捷科技	23,012	1,734,874.68	0.22
157	688072	拓荆科技	4,065	1,731,568.05	0.22
158	689009	九号公司	46,658	1,719,347.30	0.22
159	002065	东华软件	243,100	1,716,286.00	0.22
160	002444	巨星科技	78,200	1,711,016.00	0.22

161	600859	王府井	86,000	1,701,940.00	0.22
162	600481	双良节能	121,700	1,701,366.00	0.22
163	601577	长沙银行	217,800	1,690,128.00	0.22
164	000997	新大陆	89,400	1,689,660.00	0.22
165	601198	东兴证券	210,200	1,685,804.00	0.22
166	688536	思瑞浦	7,728	1,684,704.00	0.22
167	002131	利欧股份	732,300	1,684,290.00	0.22
168	600499	科达制造	148,000	1,681,280.00	0.22
169	002353	杰瑞股份	66,900	1,681,197.00	0.22
170	300438	鹏辉能源	34,900	1,676,596.00	0.22
171	300383	光环新网	155,900	1,675,925.00	0.22
172	600704	物产中大	337,800	1,668,732.00	0.21
173	000960	锡业股份	107,000	1,663,850.00	0.21
174	300682	朗新科技	71,400	1,662,192.00	0.21
175	600271	航天信息	120,600	1,651,014.00	0.21
176	600021	上海电力	152,700	1,644,579.00	0.21
177	300001	特锐德	79,000	1,641,620.00	0.21
178	002373	千方科技	120,048	1,637,454.72	0.21
179	601997	贵阳银行	317,000	1,635,720.00	0.21
180	000519	中兵红箭	90,400	1,635,336.00	0.21
181	603077	和邦生物	670,140	1,628,440.20	0.21
182	688009	中国通号	280,365	1,626,117.00	0.21
183	000623	吉林敖东	100,920	1,618,756.80	0.21
184	000703	恒逸石化	238,400	1,616,352.00	0.21
185	300676	华大基因	26,900	1,613,731.00	0.21
186	002056	横店东磁	88,100	1,604,301.00	0.21
187	300088	长信科技	266,000	1,603,980.00	0.21
188	002507	涪陵榨菜	87,390	1,600,110.90	0.21
189	600380	健康元	125,500	1,595,105.00	0.21
190	600511	国药股份	41,000	1,592,850.00	0.21
191	000513	丽珠集团	40,742	1,585,271.22	0.20
192	600867	通化东宝	151,300	1,579,572.00	0.20
193	002152	广电运通	134,600	1,577,512.00	0.20
194	002281	光迅科技	42,500	1,576,325.00	0.20
195	600498	烽火通信	77,200	1,572,564.00	0.20
196	600998	九州通	151,384	1,571,365.92	0.20
197	600529	山东药玻	57,500	1,565,150.00	0.20
198	688301	奕瑞科技	5,534	1,562,967.62	0.20
199	600546	山煤国际	107,400	1,554,078.00	0.20
200	002203	海亮股份	129,200	1,551,692.00	0.20
201	600348	华阳股份	195,650	1,547,591.50	0.20
202	002299	圣农发展	80,800	1,547,320.00	0.20
203	601016	节能风电	421,190	1,545,767.30	0.20
204	000636	风华高科	100,400	1,540,136.00	0.20

205	603338	浙江鼎力	27,400	1,534,674.00	0.20
206	603517	绝味食品	41,200	1,530,580.00	0.20
207	002595	豪迈科技	43,501	1,528,190.13	0.20
208	600739	辽宁成大	116,000	1,525,400.00	0.20
209	603712	七一二	50,200	1,516,542.00	0.20
210	002192	融捷股份	22,600	1,510,358.00	0.19
211	601636	旗滨集团	174,600	1,505,052.00	0.19
212	002080	中材科技	72,800	1,493,856.00	0.19
213	603737	三棵树	22,800	1,491,576.00	0.19
214	002531	天顺风能	97,800	1,489,494.00	0.19
215	002506	协鑫集成	507,600	1,487,268.00	0.19
216	603927	中科软	38,500	1,484,560.00	0.19
217	603885	吉祥航空	96,100	1,482,823.00	0.19
218	002432	九安医疗	42,100	1,482,341.00	0.19
219	688772	珠海冠宇	73,006	1,471,070.90	0.19
220	600863	内蒙华电	353,800	1,468,270.00	0.19
221	688516	奥特维	7,766	1,463,114.40	0.19
222	688385	复旦微电	29,124	1,459,112.40	0.19
223	600970	中材国际	114,400	1,458,600.00	0.19
224	600580	卧龙电驱	99,800	1,458,078.00	0.19
225	600655	豫园股份	211,400	1,450,204.00	0.19
226	002092	中泰化学	224,720	1,449,444.00	0.19
227	300182	捷成股份	228,700	1,443,097.00	0.19
228	300212	易华录	43,420	1,442,846.60	0.19
229	000878	云南铜业	130,300	1,439,815.00	0.19
230	002683	广东宏大	48,700	1,433,728.00	0.18
231	600820	隧道股份	238,500	1,433,385.00	0.18
232	300296	利亚德	219,200	1,431,376.00	0.18
233	300487	蓝晓科技	22,900	1,429,418.00	0.18
234	600528	中铁工业	144,600	1,428,648.00	0.18
235	600909	华安证券	305,660	1,427,432.20	0.18
236	002939	长城证券	175,000	1,422,750.00	0.18
237	002926	华西证券	170,840	1,419,680.40	0.18
238	600535	天士力	97,600	1,416,176.00	0.18
239	300244	迪安诊断	54,361	1,393,272.43	0.18
240	300748	金力永磁	46,500	1,391,280.00	0.18
241	000547	航天发展	138,573	1,385,730.00	0.18
242	603233	大参林	49,420	1,384,254.20	0.18
243	000750	国海证券	413,200	1,384,220.00	0.18
244	000893	亚钾国际	60,300	1,383,282.00	0.18
245	600329	达仁堂	30,800	1,382,612.00	0.18
246	600258	首旅酒店	72,800	1,379,560.00	0.18
247	603160	汇顶科技	29,800	1,378,250.00	0.18
248	000039	中集集团	199,750	1,376,277.50	0.18

249	600008	首创环保	477,174	1,374,261.12	0.18
250	600416	湘电股份	71,900	1,372,571.00	0.18
251	002557	洽洽食品	32,913	1,367,535.15	0.18
252	603156	养元饮品	54,900	1,356,030.00	0.17
253	000970	中科三环	105,355	1,350,651.10	0.17
254	002429	兆驰股份	245,200	1,348,600.00	0.17
255	000060	中金岭南	283,600	1,347,100.00	0.17
256	603456	九洲药业	48,800	1,336,144.00	0.17
257	601991	大唐发电	403,000	1,333,930.00	0.17
258	603893	瑞芯微	18,200	1,325,870.00	0.17
259	688200	华峰测控	8,664	1,325,592.00	0.17
260	000830	鲁西化工	125,100	1,321,056.00	0.17
261	600369	西南证券	360,200	1,314,730.00	0.17
262	603658	安图生物	25,400	1,313,942.00	0.17
263	600390	五矿资本	243,700	1,311,106.00	0.17
264	600435	北方导航	113,600	1,305,264.00	0.17
265	002500	山西证券	233,490	1,302,874.20	0.17
266	002508	老板电器	51,500	1,302,435.00	0.17
267	300558	贝达药业	27,100	1,301,613.00	0.17
268	600398	海澜之家	187,300	1,288,624.00	0.17
269	601880	辽港股份	826,000	1,288,560.00	0.17
270	002128	电投能源	97,300	1,286,306.00	0.17
271	002936	郑州银行	557,373	1,281,957.90	0.16
272	300009	安科生物	127,048	1,270,480.00	0.16
273	600038	中直股份	31,900	1,270,258.00	0.16
274	300070	碧水源	235,755	1,263,646.80	0.16
275	601717	郑煤机	100,200	1,247,490.00	0.16
276	600848	上海临港	103,800	1,240,410.00	0.16
277	002153	石基信息	88,534	1,239,476.00	0.16
278	600985	淮北矿业	107,500	1,238,400.00	0.16
279	300026	红日药业	228,050	1,236,031.00	0.16
280	603858	步长制药	59,900	1,233,341.00	0.16
281	000050	深天马 A	133,200	1,222,776.00	0.16
282	300529	健帆生物	52,500	1,216,950.00	0.16
283	002572	索菲亚	69,385	1,208,686.70	0.16
284	601179	中国西电	222,434	1,203,367.94	0.15
285	603127	昭衍新药	29,300	1,198,370.00	0.15
286	002244	滨江集团	134,900	1,189,818.00	0.15
287	300373	扬杰科技	29,300	1,188,701.00	0.15
288	688188	柏楚电子	6,255	1,179,442.80	0.15
289	601456	国联证券	129,500	1,178,450.00	0.15
290	688779	长远锂科	104,551	1,178,289.77	0.15
291	002408	齐翔腾达	184,860	1,177,558.20	0.15
292	600673	东阳光	163,300	1,177,393.00	0.15

293	002266	浙富控股	284,300	1,174,159.00	0.15
294	601958	金钼股份	104,900	1,169,635.00	0.15
295	003035	南网能源	164,100	1,168,392.00	0.15
296	600895	张江高科	83,900	1,167,888.00	0.15
297	688116	天奈科技	25,509	1,167,036.75	0.15
298	600566	济川药业	40,100	1,164,504.00	0.15
299	002019	亿帆医药	79,666	1,163,123.60	0.15
300	600827	百联股份	86,800	1,160,516.00	0.15
301	600667	太极实业	159,800	1,160,148.00	0.15
302	603267	鸿远电子	17,700	1,155,810.00	0.15
303	000155	川能动力	80,000	1,152,000.00	0.15
304	688538	和辉光电	451,482	1,146,764.28	0.15
305	002958	青农商行	421,500	1,146,480.00	0.15
306	600208	新湖中宝	461,300	1,144,024.00	0.15
307	300357	我武生物	34,000	1,143,420.00	0.15
308	601666	平煤股份	150,700	1,136,278.00	0.15
309	601000	唐山港	321,050	1,133,306.50	0.15
310	000739	普洛药业	63,700	1,130,038.00	0.15
311	600282	南钢股份	334,300	1,126,591.00	0.15
312	600171	上海贝岭	61,600	1,124,200.00	0.14
313	000887	中鼎股份	85,600	1,120,504.00	0.14
314	600755	厦门国贸	144,600	1,119,204.00	0.14
315	002155	湖南黄金	91,400	1,115,080.00	0.14
316	600378	昊华科技	29,600	1,114,144.00	0.14
317	002670	国盛金控	125,940	1,105,753.20	0.14
318	300677	英科医疗	50,040	1,100,880.00	0.14
319	600959	江苏有线	325,430	1,099,953.40	0.14
320	600316	洪都航空	46,700	1,095,115.00	0.14
321	300115	长盈精密	91,388	1,088,431.08	0.14
322	601231	环旭电子	71,900	1,075,624.00	0.14
323	300888	稳健医疗	25,740	1,072,585.80	0.14
324	600315	上海家化	36,700	1,064,667.00	0.14
325	002487	大金重工	34,500	1,063,980.00	0.14
326	002030	达安基因	106,436	1,061,166.92	0.14
327	600517	国网英大	186,000	1,060,200.00	0.14
328	603218	日月股份	55,800	1,059,642.00	0.14
329	601866	中远海发	428,867	1,059,301.49	0.14
330	000778	新兴铸管	259,520	1,058,841.60	0.14
331	000598	兴蓉环境	194,000	1,053,420.00	0.14
332	600131	国网信通	52,100	1,051,899.00	0.14
333	600056	中国医药	81,020	1,051,639.60	0.14
334	603026	胜华新材	17,700	1,048,725.00	0.13
335	300363	博腾股份	35,400	1,047,486.00	0.13
336	600582	天地科技	179,445	1,046,164.35	0.13

337	000987	越秀资本	163,150	1,036,002.50	0.13
338	002221	东华能源	119,700	1,035,405.00	0.13
339	002249	大洋电机	180,900	1,031,130.00	0.13
340	601005	重庆钢铁	735,300	1,029,420.00	0.13
341	300251	光线传媒	127,200	1,029,048.00	0.13
342	600598	北大荒	77,100	1,027,743.00	0.13
343	688082	盛美上海	9,288	1,025,395.20	0.13
344	000027	深圳能源	154,780	1,020,000.20	0.13
345	002326	永太科技	66,600	1,018,314.00	0.13
346	000709	河钢股份	448,200	1,012,932.00	0.13
347	600906	财达证券	140,600	1,012,320.00	0.13
348	002518	科士达	25,300	1,012,253.00	0.13
349	002183	怡亚通	197,200	1,005,720.00	0.13
350	601106	中国一重	297,299	998,924.64	0.13
351	002831	裕同科技	40,540	988,770.60	0.13
352	601992	金隅集团	451,800	984,924.00	0.13
353	600718	东软集团	92,200	982,852.00	0.13
354	002690	美亚光电	38,126	981,744.50	0.13
355	600373	中文传媒	73,500	979,020.00	0.13
356	601665	齐鲁银行	248,400	973,728.00	0.13
357	000883	湖北能源	213,500	973,560.00	0.13
358	300776	帝尔激光	14,960	970,904.00	0.12
359	002511	中顺洁柔	86,700	966,705.00	0.12
360	603568	伟明环保	55,037	963,697.87	0.12
361	000825	太钢不锈	248,600	962,082.00	0.12
362	002985	北摩高科	21,658	955,550.96	0.12
363	601778	晶科科技	193,400	955,396.00	0.12
364	603883	老百姓	31,608	943,498.80	0.12
365	601928	凤凰传媒	82,700	942,780.00	0.12
366	600663	陆家嘴	95,500	942,585.00	0.12
367	603228	景旺电子	36,580	938,277.00	0.12
368	600967	内蒙一机	92,500	934,250.00	0.12
369	600737	中粮糖业	115,800	932,190.00	0.12
370	600155	华创云信	147,200	915,584.00	0.12
371	603225	新凤鸣	82,800	914,940.00	0.12
372	600297	广汇汽车	439,700	914,576.00	0.12
373	002791	坚朗五金	14,100	912,411.00	0.12
374	600801	华新水泥	73,800	911,430.00	0.12
375	300861	美畅股份	20,900	906,433.00	0.12
376	688281	华秦科技	4,470	905,175.00	0.12
377	601098	中南传媒	77,900	903,640.00	0.12
378	603529	爱玛科技	28,000	902,160.00	0.12
379	688208	道通科技	29,659	898,964.29	0.12
380	603606	东方电缆	18,300	897,249.00	0.12

381	002468	申通快递	82,900	896,978.00	0.12
382	300482	万孚生物	33,655	896,232.65	0.12
383	688778	厦钨新能	18,032	892,584.00	0.11
384	002745	木林森	96,600	888,720.00	0.11
385	000012	南玻 A	148,900	887,444.00	0.11
386	001227	兰州银行	308,800	883,168.00	0.11
387	002032	苏泊尔	17,600	880,000.00	0.11
388	603866	桃李面包	86,590	876,290.80	0.11
389	000156	华数传媒	100,500	874,350.00	0.11
390	600871	石化油服	441,300	873,774.00	0.11
391	600500	中化国际	155,800	866,248.00	0.11
392	000581	威孚高科	54,300	855,225.00	0.11
393	000401	冀东水泥	115,100	848,287.00	0.11
394	002867	周大生	47,550	845,439.00	0.11
395	301029	怡合达	18,880	843,558.40	0.11
396	600022	山东钢铁	592,200	840,924.00	0.11
397	002250	联化科技	80,000	836,800.00	0.11
398	600556	天下秀	117,700	834,493.00	0.11
399	688690	纳微科技	21,429	832,516.65	0.11
400	601118	海南橡胶	185,600	831,488.00	0.11
401	688276	百克生物	13,275	831,015.00	0.11
402	601611	中国核建	98,300	830,635.00	0.11
403	688029	南微医学	10,048	819,514.88	0.11
404	000930	中粮科技	101,100	818,910.00	0.11
405	688520	神州细胞	14,316	812,289.84	0.10
406	000785	居然之家	212,300	808,863.00	0.10
407	002010	传化智联	152,000	808,640.00	0.10
408	688006	杭可科技	26,463	806,327.61	0.10
409	300850	新强联	21,500	803,670.00	0.10
410	002423	中粮资本	99,900	799,200.00	0.10
411	601598	中国外运	171,100	797,326.00	0.10
412	601608	中信重工	188,150	792,111.50	0.10
413	600259	广晟有色	21,900	791,466.00	0.10
414	600062	华润双鹤	45,300	789,126.00	0.10
415	002505	鹏都农牧	414,500	783,405.00	0.10
416	000559	万向钱潮	143,200	780,440.00	0.10
417	002081	金螳螂	172,800	779,328.00	0.10
418	600597	光明乳业	74,800	777,920.00	0.10
419	000089	深圳机场	111,100	772,145.00	0.10
420	600782	新钢股份	207,500	769,825.00	0.10
421	603826	坤彩科技	15,300	765,000.00	0.10
422	300618	寒锐钴业	23,500	761,635.00	0.10
423	000958	电投产融	175,100	758,183.00	0.10
424	600901	江苏金租	181,300	748,769.00	0.10

425	603638	艾迪精密	36,260	744,055.20	0.10
426	600707	彩虹股份	155,600	740,656.00	0.10
427	600339	中油工程	181,600	739,112.00	0.10
428	000937	冀中能源	114,800	732,424.00	0.09
429	600409	三友化工	134,300	731,935.00	0.09
430	600095	湘财股份	93,100	726,180.00	0.09
431	000898	鞍钢股份	259,800	722,244.00	0.09
432	688052	纳芯微	4,547	720,108.39	0.09
433	601187	厦门银行	143,300	719,366.00	0.09
434	688107	安路科技	12,863	712,481.57	0.09
435	002761	浙江建投	46,900	711,942.00	0.09
436	603707	健友股份	52,587	709,924.50	0.09
437	601718	际华集团	237,900	706,563.00	0.09
438	000537	广宇发展	60,500	706,035.00	0.09
439	000415	渤海租赁	335,300	704,130.00	0.09
440	600507	方大特钢	151,698	702,361.74	0.09
441	000967	盈峰环境	137,800	695,890.00	0.09
442	001914	招商积余	46,100	693,805.00	0.09
443	600167	联美控股	99,200	691,424.00	0.09
444	688234	天岳先进	9,210	680,987.40	0.09
445	601568	北元集团	129,100	680,357.00	0.09
446	600968	海油发展	220,200	676,014.00	0.09
447	000563	陕国投 A	221,600	675,880.00	0.09
448	600808	马钢股份	261,655	672,453.35	0.09
449	601156	东航物流	51,600	670,800.00	0.09
450	002925	盈趣科技	33,840	656,496.00	0.08
451	300257	开山股份	43,200	655,344.00	0.08
452	600195	中牧股份	55,303	645,939.04	0.08
453	002705	新宝股份	35,700	643,671.00	0.08
454	603650	彤程新材	19,500	639,600.00	0.08
455	600126	杭钢股份	146,500	635,810.00	0.08
456	600764	中国海防	23,200	631,504.00	0.08
457	300442	润泽科技	20,500	630,580.00	0.08
458	603379	三美股份	26,460	622,074.60	0.08
459	002608	江苏国信	81,900	619,983.00	0.08
460	688185	康希诺	7,315	596,172.50	0.08
461	000959	首钢股份	169,700	593,950.00	0.08
462	000402	金融街	129,600	585,792.00	0.08
463	603786	科博达	8,700	571,590.00	0.07
464	002653	海思科	24,200	571,120.00	0.07
465	601828	美凯龙	117,300	561,867.00	0.07
466	002110	三钢闽光	132,900	560,838.00	0.07
467	001203	大中矿业	49,000	544,390.00	0.07
468	002563	森马服饰	87,500	544,250.00	0.07

469	688289	圣湘生物	32,149	541,389.16	0.07
470	688819	天能股份	14,573	536,869.32	0.07
471	601298	青岛港	76,000	529,720.00	0.07
472	600377	宁沪高速	53,800	528,854.00	0.07
473	601228	广州港	163,500	528,105.00	0.07
474	000656	金科股份	472,900	524,919.00	0.07
475	603056	德邦股份	33,300	513,486.00	0.07
476	600927	永安期货	31,500	512,190.00	0.07
477	000031	大悦城	139,300	509,838.00	0.07
478	600623	华谊集团	81,800	509,614.00	0.07
479	600928	西安银行	144,600	508,992.00	0.07
480	603317	天味食品	34,545	504,702.45	0.06
481	601869	长飞光纤	13,400	495,934.00	0.06
482	600350	山东高速	73,300	466,921.00	0.06
483	002399	海普瑞	40,700	466,829.00	0.06
484	601136	首创证券	32,500	460,525.00	0.06
485	000869	张裕 A	14,900	456,834.00	0.06
486	601139	深圳燃气	62,300	454,167.00	0.06
487	601969	海南矿业	66,400	436,912.00	0.06
488	001872	招商港口	25,100	433,477.00	0.06
489	600995	南网储能	38,000	418,380.00	0.05
490	002945	华林证券	29,200	399,456.00	0.05
491	000553	安道麦 A	47,200	398,368.00	0.05
492	688105	诺唯赞	12,868	392,345.32	0.05
493	002146	荣盛发展	239,600	368,984.00	0.05
494	688248	南网科技	9,082	348,657.98	0.04
495	600299	安迪苏	43,700	348,289.00	0.04
496	601158	重庆水务	62,300	346,388.00	0.04
497	301291	明阳电气	10,451	339,060.38	0.04
498	603868	飞科电器	5,100	321,759.00	0.04
499	688295	中复神鹰	8,684	318,529.12	0.04
500	603355	莱克电气	12,340	313,559.40	0.04
501	600032	浙江新能	23,500	295,160.00	0.04
502	300741	华宝股份	13,500	289,170.00	0.04
503	600956	新天绿能	33,000	287,760.00	0.04
504	301486	致尚科技	4,645	267,830.70	0.03
505	002901	大博医疗	6,200	192,696.00	0.02
506	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
507	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
508	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
509	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
510	688249	晶合集成	4,801	86,706.06	0.01
511	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
512	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01

513	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
514	688472	阿特斯	2,964	50,506.56	0.01
515	688469	中芯集成	8,515	46,066.15	0.01
516	688361	中科飞测	695	44,945.65	0.01
517	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
518	301358	湖南裕能	890	38,172.10	0.00
519	688443	智翔金泰	1,144	33,736.56	0.00
520	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
521	688146	中船特气	808	30,809.04	0.00
522	688484	南芯科技	820	30,102.20	0.00
523	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
524	688531	日联科技	208	28,281.76	0.00
525	000961	中南建设	17,600	27,632.00	0.00
526	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
527	688352	颀中科技	2,098	25,322.86	0.00
528	301246	宏源药业	813	24,967.23	0.00
529	001287	中电港	1,133	23,815.66	0.00
530	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
531	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
532	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
533	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
534	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
535	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
536	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
537	301322	绿通科技	357	19,006.68	0.00
538	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
539	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
540	601061	中信金属	2,148	16,281.84	0.00
541	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
542	301439	泓淋电力	921	15,564.90	0.00
543	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
544	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
545	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
546	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
547	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
548	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
549	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
550	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
551	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
552	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
553	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
554	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
555	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
556	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00

557	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
558	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
559	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
560	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
561	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
562	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
563	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
564	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
565	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
566	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
567	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
568	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
569	601065	江盐集团	741	8,773.44	0.00
570	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
571	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
572	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
573	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
574	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
575	603605	珀莱雅	68	7,643.20	0.00
576	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
577	000540	*ST 中天	537,300	5,373.00	0.00
578	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
579	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
580	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
581	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
582	603613	国联股份	72	2,658.96	0.00
583	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
584	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
585	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
586	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
587	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
588	300630	普利制药	72	1,407.60	0.00
589	301277	新天地	59	1,151.09	0.00
590	002603	以岭药业	40	1,027.60	0.00
591	600064	南京高科	60	396.60	0.00
592	002212	天融信	40	388.00	0.00
593	002701	奥瑞金	63	284.13	0.00
594	300376	易事特	13	87.10	0.00
595	600567	山鹰国际	21	48.09	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	3,101,569.00	0.41
2	000066	中国长城	2,893,957.00	0.38
3	600372	中航电子	2,574,264.41	0.34
4	000423	东阿阿胶	2,459,717.00	0.33
5	000933	神火股份	2,361,240.00	0.31
6	002240	盛新锂能	2,330,973.00	0.31
7	002008	大族激光	2,215,007.00	0.29
8	603882	金域医学	2,194,088.00	0.29
9	688169	石头科技	2,005,865.78	0.27
10	688220	翱捷科技	1,941,596.05	0.26
11	300395	菲利华	1,929,433.00	0.26
12	002600	领益智造	1,929,276.00	0.26
13	688536	思瑞浦	1,898,022.58	0.25
14	601966	玲珑轮胎	1,747,159.00	0.23
15	300118	东方日升	1,720,733.92	0.23
16	688072	拓荆科技	1,695,709.10	0.22
17	002432	九安医疗	1,676,730.00	0.22
18	300595	欧普康视	1,655,670.61	0.22
19	300438	鹏辉能源	1,589,888.81	0.21
20	600481	双良节能	1,508,001.00	0.20

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603345	安井食品	3,229,869.90	0.43
2	688122	西部超导	3,150,706.49	0.42
3	601607	上海医药	2,936,347.21	0.39
4	000999	华润三九	2,713,872.00	0.36
5	603605	珀莱雅	2,681,183.12	0.35
6	002603	以岭药业	2,487,299.00	0.33
7	601699	潞安环能	2,356,567.00	0.31
8	601872	招商轮船	2,309,139.00	0.31
9	603613	国联股份	2,217,784.00	0.29
10	300168	万达信息	2,125,027.00	0.28
11	688063	派能科技	2,023,264.28	0.27

12	600026	中远海能	2,016,021.00	0.27
13	601333	广深铁路	1,557,198.00	0.21
14	603606	东方电缆	1,518,748.00	0.20
15	002212	天融信	1,378,315.00	0.18
16	600201	生物股份	1,312,789.00	0.17
17	600728	佳都科技	1,272,469.00	0.17
18	002396	星网锐捷	1,119,929.00	0.15
19	688088	虹软科技	1,048,247.86	0.14
20	600064	南京高科	968,448.00	0.13

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	120,546,362.76
卖出股票的收入（成交）总额	116,099,169.01

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总资产的影响比例，将符合《基金合同》的有关规定。

体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,636,749.34
2	应收清算款	300,370.11
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	1,217.93
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,938,337.38

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300418	昆仑万维	418,912.00	0.05	转融通融出
2	688256	寒武纪	413,600.00	0.05	转融通融出

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,462	44,555.28	2,770,704.00	2.53%	16,724,889.00	15.25%	90,199,505.00	82.23%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
-	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	90,199,505.00	82.23%
1	孙雪理	1,266,376.00	1.15%
2	罗志中	1,050,000.00	0.96%
3	招商证券股份有限公司	682,697.00	0.62%
4	宋丹丹	571,700.00	0.52%
5	白巍	550,000.00	0.50%
6	中信证券股份有限公司	399,817.00	0.36%
7	长城基金—兴业银行—长城基金泓湖百世自动驾驶 1 号集合资产管理计划	384,200.00	0.35%
8	方正证券股份有限公司	364,653.00	0.33%
9	刘秀菊	320,855.00	0.29%
10	博时基金—招商银行—博时基金汇利 1 号集合资产管理计划	280,300.00	0.26%

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. 前十名持有人为除联接基金之外的前十名持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 8 月 1 日）基金份额总额	2,762,185,861.00
本报告期期初基金份额总额	110,895,098.00
本报告期基金总申购份额	4,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	109,695,098.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 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》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	3	39,861,050.18	17.87%	8,486.89	5.96%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	1,463,820.41	0.66%	1,070.63	0.75%	-
中金公司	2	173,897,844.70	77.95%	127,171.89	89.25%	增加1个
长江证券	2	4,328,650.36	1.94%	3,165.79	2.22%	增加1个
中信证券	2	3,172,255.96	1.42%	2,319.84	1.63%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	367,996.22	0.16%	269.12	0.19%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，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、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、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	2023-06-27
2	关于新增中国银河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	2023-06-20
3	博时基金管理有限公司关于旗下博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金和博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金所持停牌股票估值调整情况的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-10
4	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-20230601	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01

5	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	2023-05-27
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、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
7	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	2023-05-12
8	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-05
9	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 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	2023-04-22
10	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023-03-30
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	2023-02-18
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
13	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2023-01-20
14	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-20230104	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时中证 500 交易型	1	2023-01-01~2023-06-30	87,685,705.00	6,494,700.00	3,980,900.00	90,199,505.00	82.23%

开放式指数 证券投资基 金发起式联 接基金						
--------------------------------	--	--	--	--	--	--

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日