

# 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  
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

## §1 重要提示及目录

---

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	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
<b>§4 管理人报告</b> .....	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合规守信情况的说明.....	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.....	11
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.....	12
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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
<b>§6 审计报告</b> .....	14
6.1 审计意见.....	14
6.2 形成审计意见的基础.....	14
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 净资产变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65

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 .....	66
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 .....	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	66
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	71
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
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 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录 .....	75
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## §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	107,695,098.00 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	<p>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。</p> <p>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%。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	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	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
登载基金年度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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	6,871,629.85	-5,047,025.38	-29,275,841.33
本期利润	90,008,623.33	-36,331,073.90	-122,804,041.55
加权平均基金份额本期利润	0.7490	-0.3266	-1.2189
本期加权平均净值利润率	11.76%	-4.67%	-17.09%
本期基金份额净值增长率	8.55%	-4.83%	-17.92%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	212,396,328.25	166,779,894.11	193,679,165.42
期末可供分配基金份额利润	1.9722	1.4171	1.7465
期末基金资产净值	758,726,089.78	763,838,962.00	756,242,304.99
期末基金份额净值	7.0451	6.4900	6.8194
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	38.88%	27.94%	34.43%

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

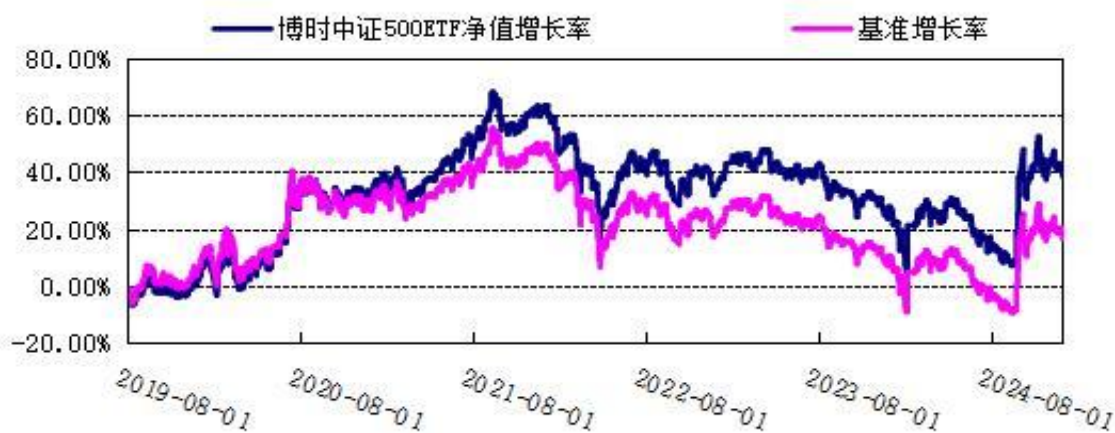
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.23%	2.00%	-0.30%	2.03%	0.53%	-0.03%
过去六个月	17.38%	1.99%	15.84%	2.01%	1.54%	-0.02%
过去一年	8.55%	1.81%	5.46%	1.82%	3.09%	-0.01%
过去三年	-15.21%	1.39%	-22.20%	1.40%	6.99%	-0.01%
过去五年	33.72%	1.36%	8.70%	1.37%	25.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	38.88%	1.34%	16.78%	1.35%	22.10%	-0.01%

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

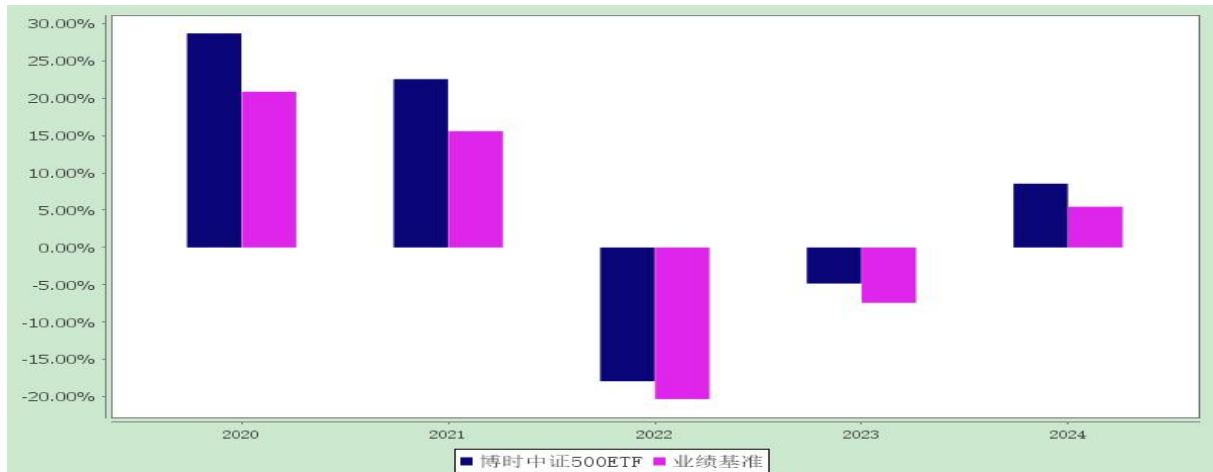
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年8月1日至2024年12月31日)



#### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16089 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

#### 其他大事件

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

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

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2019-08-01	-	17.8	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

				<p>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</p>
--	--	--	--	---

					月 19 日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 (QDII) (2023 年 9 月 26 日—至今)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	8.4	王萌先生, 博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定, 并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产, 为基金持有人谋求最大利益。本报告期内, 由于证券市场波动等原因, 本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况, 基金管理人在规定期限内进行了调整, 对基金份额持有人利益未造成损害。

## 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 132 次, 均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内, 未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年，中国经济面临增长压力，整体呈现“外强内弱”的格局，出口表现较好，但消费和投资增长乏力，房地产市场持续走弱。具体来看，一季度经济增速平稳回升，呈现良好开局；二季度和三季度增速放缓，国内有效需求不足的现象较为突出。受制于地产景气下滑、土地财政持续缩水、化债压力较大，居民消费偏弱，投资增长乏力，但高端技术制造业生产投资增速保持较高水平；四季度在政策发力作用下增速重新走高。出口是经济增长最大的亮点，房地产销售和投资仍未出现改善，成为经济主要的拖累项。消费在以旧换新等政策刺激下四季度出现复苏。货币政策全年维持宽松，中小企业融资环境持续改善，财政政策自 9 月 24 日以来出现积极变化。海外方面，全球经济延续缓慢复苏，美国经济依然强韧，通胀持续下行，经济指标向好，美股继续表现优异。消费托底美国 GDP，AI 产业链的快速发展带动相关龙头企业业绩持续超预期。

市场表现方面，中国市场全年波动较大。行情结构分化较大，科技、金融表现出色，消费板块继续表现不佳。行业上看，银行、非银行金融、家电、通信和交通运输全年涨幅居前，医药、农林牧渔、消费者服务、房地产和食品饮料相对落后。主要宽基指数中偏大盘的上证 50、科创 50、沪深 300 和创业板指涨幅均超过 10%，偏小盘的中证 2000、科创 100 表现不佳，全年收益为负。风格上，大盘价值占优。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 7.0451 元，份额累计净值为 1.3888 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 8.55%，同期业绩基准增长率 5.46%。

## 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 2025 年，随着相关政策的陆续落地有望带动国内经济持续改善。一方面是政策陆续落地后的政策红利，另一方面，在 Deepseek 等国产大模型性能超预期后，中国有望在这一轮 AI 竞赛中迎头赶上，AI 渗透率的提升不仅能推动企业效率提高、利润率上升，同时反过来会促进国内 AI 相关资本支出的提升，带动国内科技产业的发展，对中国经济增长特别是企业盈利修复有积极作用。相比海外市场，中国资产过去几年表现落后，估值相比海外市场也处于持续折价状态，2025 年在政策积极有为、中国科技创新成果超预期的背景下，中国资产有望迎来业绩和估值的双击，对全年市场表现相对乐观。结构上，建议关注三条主线，一条主线是科技成长，关注 AI 应用、具身智能机器人、半导体等领域；一条主线是经济修复，关注受益经济预期改善的消费、家电、汽车等顺周期资产；

另外，在险资布局和长债利率下行趋势下，红利资产具备较高的配置性价比。

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，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则为：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合规守信、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[2025]200Z1051 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 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

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

## 6.2 形成审计意见的基础

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

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时中证 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

薛竞 吴琳杰

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

2025 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	7,363,303.05	29,827,335.78
结算备付金		26,808,972.04	5,425,157.83
存出保证金		4,505,700.26	4,888,085.29
交易性金融资产	7.4.7.2	720,958,657.19	724,453,321.11
其中：股票投资		720,958,657.19	724,453,321.11
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		2,990,115.79	150,313.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	4,288.32
资产总计		762,626,748.33	764,748,501.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
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		3,142,120.33	1.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		101,970.72	96,883.10
应付托管费		33,990.22	32,294.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		86,156.93	554.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	536,420.35	779,806.00
负债合计		3,900,658.55	909,539.62
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	546,329,761.53	597,059,067.89
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	212,396,328.25	166,779,894.11
净资产合计		758,726,089.78	763,838,962.00
负债和净资产总计		762,626,748.33	764,748,501.62

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 7.0451 元，基金份额总额 107,695,098.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>91,958,978.28</b>	<b>-34,356,884.51</b>
1.利息收入		270,433.56	223,422.09
其中：存款利息收入	7.4.7.9	270,433.56	223,422.09
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）		9,051,211.99	-3,466,409.21
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-8,592,536.35	-13,094,367.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
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	2,559,021.84	-2,369,995.97
股利收益	7.4.7.14	15,050,486.44	11,903,074.12
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	94,880.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	83,136,993.48	-31,284,048.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-499,660.75	170,151.13
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,950,354.95</b>	<b>1,974,189.39</b>
1. 管理人报酬		1,150,883.55	1,167,129.21
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		383,627.94	389,043.00
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		9,354.40	581.83
8. 其他费用	7.4.7.18	406,489.06	417,435.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>90,008,623.33</b>	<b>-36,331,073.90</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>90,008,623.33</b>	<b>-36,331,073.90</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>90,008,623.33</b>	<b>-36,331,073.90</b>

### 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	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
项目	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	562,563,139.57	193,679,165.42	756,242,304.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	562,563,139.57	193,679,165.42	756,242,304.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	34,495,928.32	-26,899,271.31	7,596,657.01

（一）、综合收益总额	-	-36,331,073.90	-36,331,073.90
（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）	34,495,928.32	9,431,802.59	43,927,730.91
其中：1.基金申购款	79,137,717.85	26,899,904.65	106,037,622.50
2.基金赎回款	-44,641,789.53	-17,468,102.06	-62,109,891.59
（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	597,059,067.89	166,779,894.11	763,838,962.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

博时中证 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×95%。

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产的分类

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

###### 债务工具

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

###### 以摊余成本计量：

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

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

###### 权益工具

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

## （2）金融负债

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

## （3）衍生金融工具

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

#### 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[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。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。

(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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	7,363,303.05	29,827,335.78
等于：本金	7,362,654.79	29,824,201.01
加：应计利息	648.26	3,134.77
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	7,363,303.05	29,827,335.78

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	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
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	828,989,424.58	-	724,453,321.11	-104,536,103.47
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	828,989,424.58	-	724,453,321.11	-104,536,103.47

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	30,310,000.00	-	-	-
---股指期货	30,310,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,310,000.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	33,008,200.00	-	-	-
---股指期货	33,008,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,008,200.00	-	-	-

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。

#### 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
IC2503	IC2503	26.00	29,512,080.00	-797,920.00
合计	-	-	-	-797,920.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-797,920.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	4,288.32
待摊费用	-	-
合计	-	4,288.32

**7.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	131,243.61	150,212.73
其中：交易所市场	131,243.61	150,212.73
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	175,000.00	182,000.00
应付指数使用费	230,176.74	447,593.27
合计	536,420.35	779,806.00

**7.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,695,098.00	597,059,067.89
本期申购	59,200,000.00	300,317,493.50
本期赎回（以“-”号填列）	-69,200,000.00	-351,046,799.86
本期末	107,695,098.00	546,329,761.53

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	419,771,888.49	-252,991,994.38	166,779,894.11
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	419,771,888.49	-252,991,994.38	166,779,894.11
本期利润	6,871,629.85	83,136,993.48	90,008,623.33
本期基金份额交易产生的变动数	-36,366,196.74	-8,025,992.45	-44,392,189.19
其中：基金申购款	203,371,739.48	-101,033,482.81	102,338,256.67
基金赎回款	-239,737,936.22	93,007,490.36	-146,730,445.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	390,277,321.60	-177,880,993.35	212,396,328.25

### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	46,373.46	96,869.98
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	223,658.69	126,246.65
其他	401.41	305.46
合计	270,433.56	223,422.09

### 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,868,075.90	-11,038,301.59
股票投资收益——赎回差价收入	2,275,539.55	-2,056,065.84
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	-8,592,536.35	-13,094,367.43

#### 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	479,837,529.57	235,514,786.14
减：卖出股票成本总额	490,107,171.38	246,025,375.22
减：交易费用	598,434.09	527,712.51
买卖股票差价收入	-10,868,075.90	-11,038,301.59

#### 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	497,777,245.72	62,109,891.59
减：现金支付赎回款总额	254,208,625.72	31,817,046.59
减：赎回股票成本总额	241,293,080.45	32,348,910.84

减：交易费用	-	-
赎回差价收入	2,275,539.55	-2,056,065.84

#### 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

无发生额。

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

#### 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	2,559,021.84	-2,369,995.97

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	15,050,486.44	11,903,074.12
其中：证券出借权益补偿收入	-	6,370.05
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,050,486.44	11,903,074.12

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	83,414,313.48	-31,881,128.52
——股票投资	83,414,313.48	-31,881,128.52
——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	-277,320.00	597,080.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-277,320.00	597,080.00
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	83,136,993.48	-31,284,048.52

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-499,660.75	170,151.13
合计	-499,660.75	170,151.13

#### 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	62,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	557.32	469.53
银行汇划费	755.00	1,540.00
指数使用费	230,176.74	233,425.82
合计	406,489.06	417,435.35

## 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
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司
博时中证 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 年第五次临时股东大会决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

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

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 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	462,324,670.27	48.97%	266,939,297.99	55.75%

#### 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 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%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	153,987.24	49.81%	142,158.20	94.64%

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	1,150,883.55	1,167,129.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	177.86	-
应支付基金管理人的净管理费	1,150,705.69	1,167,129.21

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	383,627.94	389,043.00

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						
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	-	-
上年度可比期间						
2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,752,597.00	3.00~6.00	4.42	3,137.35	23,840.00	51.61

#### 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自有资金投资本基金的情况

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
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	83,936,005.00	77.94%	97,049,005.00	82.46%
招商证券	218,572.00	0.20%	1,217,770.00	1.03%

注：1.除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。  
 2.持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	7,363,303.05	46,373.46	29,827,335.78	96,869.98

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 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
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	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

招商证券股份 有限公司	001378	德冠新材	网下发行	2,044.00	64,753.92
招商证券股份 有限公司	688653	康希通信	网下发行	6,478.00	68,019.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月	首次公开发行限售	21.23	65.78	957.00	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6个月	首次公开发行限售	55.18	165.78	289.00	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6个月	首次公开发行限售	8.00	56.10	804.00	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6个月	首次公开发行限售	11.25	29.44	1,406.00	15,817.50	41,392.64	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6个月	首次公开发行限售	27.08	48.95	780.00	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月	首次公开发行限售	17.58	33.06	979.00	17,210.82	32,365.74	-

001391	国货航	2024-12-23	6个月	首次公开发行限售	2.30	6.80	4,686.00	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月	首次公开发行限售	9.40	43.23	652.00	6,128.80	28,185.96	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6个月	首次公开发行限售	7.16	15.44	1,685.00	12,064.60	26,016.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	7个交易日	新股未上市	12.30	12.30	2,029.00	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-10-09	6个月	首次公开发行限售	6.88	24.84	816.00	5,614.08	20,269.44	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6个月	首次公开发行限售	18.50	56.85	279.00	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024-10-10	6个月	首次公开发行限售	14.50	59.05	267.00	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连科技	2024-11-12	6个月	首次公开发行限售	72.99	101.96	153.00	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6个月	首次公开发行限售	21.21	36.49	396.00	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科天成	2024-08-14	6个月	首次公开发行限售	11.14	40.83	350.00	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024-11-26	6个月	首次公开发行限售	22.36	44.92	306.00	6,842.16	13,745.52	-

301608	博实结	2024-07-25	6个月	首次公开发 行限售	44.50	65.38	184.00	8,188.00	12,029.92	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月	首次公开发 行限售	18.09	53.14	215.00	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024-08-27	6个月	首次公开发 行限售	19.06	33.58	332.00	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6个月	首次公开发 行限售	27.76	39.79	253.00	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6个月	首次公开发 行限售	26.50	41.98	233.00	6,174.50	9,781.34	-
301607	富特科技	2024-08-28	6个月	首次公开发 行限售	14.00	36.14	257.00	3,598.00	9,287.98	-
603194	中力股份	2024-12-17	6个月	首次公开发 行限售	20.32	28.13	291.00	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024-07-15	6个月	首次公开发 行限售	30.00	56.87	143.00	4,290.00	8,132.41	-
001279	强邦新材	2024-09-27	6个月	首次公开发 行限售	9.68	27.91	265.00	2,565.20	7,396.15	-
603395	红四方	2024-11-19	6个月	首次公开发 行限售	7.98	35.77	154.00	1,228.92	5,508.58	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6个月	首次公开发 行限售	17.39	17.95	254.00	4,417.06	4,559.30	-

603091	众鑫股份	2024-09-10	6个月	首次公开发售	26.50	44.43	94.00	2,491.00	4,176.42	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6个月	首次公开发售	40.00	41.35	100.00	4,000.00	4,135.00	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	首次公开发售	20.56	36.17	106.00	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	6个月	首次公开发售	14.65	27.35	128.00	1,875.20	3,500.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	首次公开发售	18.65	22.61	129.00	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	首次公开发售	12.30	12.30	226.00	2,779.80	2,779.80	-

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 2024 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同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

**7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
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	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>34,251,163.35</b>	-	-	<b>728,375,584.98</b>	<b>762,626,748.33</b>
<b>负债</b>					
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
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>3,900,658.55</b>	<b>3,900,658.55</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>34,251,163.35</b>	-	-	<b>724,474,926.43</b>	<b>758,726,089.78</b>
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	29,827,335.78	-	-	-	29,827,335.78
结算备付金	5,425,157.83	-	-	-	5,425,157.83
存出保证金	14,945.29	-	-	4,873,140.00	4,888,085.29
交易性金融资产	-	-	-	724,453,321.11	724,453,321.11
应收清算款	-	-	-	150,313.29	150,313.29
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,288.32	4,288.32
<b>资产总计</b>	<b>35,267,438.90</b>	-	-	<b>729,481,062.72</b>	<b>764,748,501.62</b>

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1.34	1.34
应付管理人报酬	-	-	-	96,883.10	96,883.10
应付托管费	-	-	-	32,294.37	32,294.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	554.81	554.81
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	779,806.00	779,806.00
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>909,539.62</b>	<b>909,539.62</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>35,267,438.90</b>	-	-	<b>728,571,523.10</b>	<b>763,838,962.00</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。

#### 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 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产—股票投资	720,958,657.19	95.02	724,453,321.11	94.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>720,958,657.19</b>	<b>95.02</b>	<b>724,453,321.11</b>	<b>94.84</b>

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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）	
分析		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3,708	增加约 3,677
	业绩比较基准下降 5%	减少约 3,708	减少约 3,677

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	720,345,507.02	723,315,003.29
第二层次	27,736.50	-
第三层次	585,413.67	1,138,317.82
合计	720,958,657.19	724,453,321.11

###### 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 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
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	2,204,745.89	2,204,745.89
当期购买	-	2,170,209.53	2,170,209.53
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,373.00	5,373.00
转出第三层次	-	3,752,368.49	3,752,368.49
当期利得或损失总额	-	510,357.89	510,357.89
其中：计入损益的利得或损失	-	510,357.89	510,357.89
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-

期末余额	-	1,138,317.82	1,138,317.82
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	-	-656,038.09	-656,038.09

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
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	1,132,944.82	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.55%-217.75%	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	720,958,657.19	94.54
	其中：股票	720,958,657.19	94.54
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	34,172,275.09	4.48
8	其他各项资产	7,495,816.05	0.98
9	合计	762,626,748.33	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	4,167,602.00	0.55
B	采矿业	25,326,080.50	3.34
C	制造业	447,172,574.01	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,517,212.57	3.49
E	建筑业	7,838,178.00	1.03
F	批发和零售业	17,194,608.84	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	11,051,415.17	1.46
H	住宿和餐饮业	2,267,563.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,550,618.04	8.38
J	金融业	74,783,256.10	9.86
K	房地产业	9,246,545.00	1.22
L	租赁和商务服务业	6,278,383.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	5,021,183.95	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	3,483,614.61	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,686,740.00	0.22
Q	卫生和社会工作	4,196,027.40	0.55
R	文化、体育和娱乐业	9,427,105.00	1.24
S	综合	1,749,950.00	0.23
	合计	720,958,657.19	95.02

### 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	002625	光启技术	155100	7,413,780.00	0.98
2	600418	江淮汽车	179700	6,738,750.00	0.89
3	000988	华工科技	103462	4,479,904.60	0.59
4	002384	东山精密	140600	4,105,520.00	0.54
5	300339	润和软件	82000	4,102,460.00	0.54
6	600157	永泰能源	2284600	3,906,666.00	0.51
7	600839	四川长虹	379666	3,663,776.90	0.48
8	002797	第一创业	432060	3,607,701.00	0.48
9	600487	亨通光电	202900	3,493,938.00	0.46
10	301236	软通动力	58926	3,459,545.46	0.46
11	002340	格林美	526900	3,440,657.00	0.45
12	300207	欣旺达	151800	3,386,658.00	0.45
13	002156	通富微电	109400	3,232,770.00	0.43
14	688777	中控技术	64816	3,219,410.72	0.42
15	601162	天风证券	712800	3,193,344.00	0.42
16	601555	东吴证券	408740	3,188,172.00	0.42
17	002273	水晶光电	142800	3,173,016.00	0.42
18	002966	苏州银行	387190	3,140,110.90	0.41
19	002185	华天科技	263800	3,062,718.00	0.40
20	601099	太平洋	701200	2,987,112.00	0.39
21	601933	永辉超市	466700	2,958,878.00	0.39
22	600096	云天化	132100	2,945,830.00	0.39
23	002202	金风科技	284000	2,933,720.00	0.39
24	000423	东阿阿胶	46300	2,903,936.00	0.38
25	000066	中国长城	198900	2,897,973.00	0.38
26	600536	中国软件	61410	2,867,232.90	0.38
27	600352	浙江龙盛	267900	2,756,691.00	0.36
28	601168	西部矿业	171400	2,754,398.00	0.36
29	600079	人福医药	117300	2,742,474.00	0.36
30	600885	宏发股份	86000	2,736,520.00	0.36
31	601108	财通证券	334300	2,731,231.00	0.36
32	600988	赤峰黄金	171000	2,669,310.00	0.35
33	300017	网宿科技	250900	2,652,013.00	0.35
34	002738	中矿资源	74180	2,633,390.00	0.35
35	300476	胜宏科技	62300	2,622,207.00	0.35
36	002138	顺络电子	83000	2,612,840.00	0.34
37	601577	长沙银行	289600	2,574,544.00	0.34
38	002078	太阳纸业	172269	2,561,640.03	0.34
39	002281	光迅科技	48900	2,551,113.00	0.34

40	300136	信维通信	99500	2,531,280.00	0.33
41	300474	景嘉微	26850	2,510,206.50	0.33
42	002085	万丰奥威	131100	2,484,345.00	0.33
43	689009	九号公司	51633	2,452,567.50	0.32
44	600879	航天电子	271200	2,429,952.00	0.32
45	300803	指南针	25200	2,417,940.00	0.32
46	300058	蓝色光标	259900	2,411,872.00	0.32
47	002517	恺英网络	177000	2,408,970.00	0.32
48	002444	巨星科技	74100	2,397,135.00	0.32
49	300223	北京君正	34800	2,373,360.00	0.31
50	601615	明阳智能	187000	2,358,070.00	0.31
51	603893	瑞芯微	21400	2,355,284.00	0.31
52	601128	常熟银行	310120	2,347,608.40	0.31
53	002353	杰瑞股份	63400	2,345,166.00	0.31
54	688099	晶晨股份	34119	2,343,292.92	0.31
55	300002	神州泰岳	201800	2,338,862.00	0.31
56	600109	国金证券	267500	2,335,275.00	0.31
57	000783	长江证券	341400	2,328,348.00	0.31
58	002195	岩山科技	584200	2,319,274.00	0.31
59	300024	机器人	128800	2,311,960.00	0.30
60	688617	惠泰医疗	6137	2,284,989.21	0.30
61	603160	汇顶科技	28300	2,279,282.00	0.30
62	300496	中科创达	38100	2,269,236.00	0.30
63	688120	华海清科	13902	2,265,886.98	0.30
64	002223	鱼跃医疗	62064	2,264,715.36	0.30
65	600298	安琪酵母	62782	2,263,291.10	0.30
66	002128	电投能源	115400	2,259,532.00	0.30
67	002532	天山铝业	287100	2,259,477.00	0.30
68	000728	国元证券	269100	2,249,676.00	0.30
69	002673	西部证券	275600	2,246,140.00	0.30
70	002465	海格通信	204200	2,242,116.00	0.30
71	688469	芯联集成	435542	2,234,330.46	0.29
72	601567	三星医疗	72500	2,230,100.00	0.29
73	603606	东方电缆	42300	2,222,865.00	0.29
74	688213	思特威	28329	2,201,729.88	0.29
75	601198	东兴证券	199300	2,194,293.00	0.29
76	300114	中航电测	30500	2,189,290.00	0.29
77	600765	中航重机	106680	2,183,739.60	0.29
78	600862	中航高科	86100	2,174,886.00	0.29
79	002008	大族激光	86700	2,167,500.00	0.29
80	300383	光环新网	147800	2,156,402.00	0.28
81	300012	华测检测	172900	2,149,147.00	0.28
82	000831	中国稀土	76400	2,143,020.00	0.28

83	600895	张江高科	79700	2,135,960.00	0.28
84	300866	安克创新	21770	2,125,622.80	0.28
85	002472	双环传动	69400	2,125,028.00	0.28
86	600177	雅戈尔	237800	2,116,420.00	0.28
87	301358	湖南裕能	46600	2,111,912.00	0.28
88	688047	龙芯中科	15814	2,091,875.92	0.28
89	688072	拓荆科技	13587	2,087,914.29	0.28
90	300699	光威复材	59980	2,078,307.00	0.27
91	603605	珀莱雅	24400	2,066,680.00	0.27
92	600873	梅花生物	205300	2,059,159.00	0.27
93	002595	豪迈科技	40901	2,052,821.19	0.27
94	601233	桐昆股份	173400	2,046,120.00	0.27
95	300037	新宙邦	54320	2,033,740.80	0.27
96	300395	菲利华	53700	2,019,657.00	0.27
97	000400	许继电气	73300	2,017,949.00	0.27
98	300054	鼎龙股份	77200	2,008,744.00	0.26
99	688122	西部超导	46674	1,998,580.68	0.26
100	300142	沃森生物	164700	1,989,576.00	0.26
101	300604	长川科技	45000	1,985,850.00	0.26
102	601990	南京证券	227400	1,969,284.00	0.26
103	000750	国海证券	459700	1,967,516.00	0.26
104	000009	中国宝安	212320	1,942,728.00	0.26
105	603596	伯特利	43540	1,941,448.60	0.26
106	002436	兴森科技	173600	1,928,696.00	0.25
107	688249	晶合集成	82631	1,928,607.54	0.25
108	600369	西南证券	410000	1,914,700.00	0.25
109	600153	建发股份	181900	1,913,588.00	0.25
110	601696	中银证券	171300	1,911,708.00	0.25
111	600642	申能股份	201235	1,909,720.15	0.25
112	688525	佰维存储	30649	1,899,318.53	0.25
113	002850	科达利	19400	1,894,992.00	0.25
114	002261	拓维信息	103300	1,891,423.00	0.25
115	600143	金发科技	217100	1,875,744.00	0.25
116	688521	芯原股份	35714	1,872,485.02	0.25
117	002821	凯莱英	24500	1,864,205.00	0.25
118	600398	海澜之家	246800	1,851,000.00	0.24
119	000021	深科技	96200	1,833,572.00	0.24
120	601216	君正集团	346900	1,824,694.00	0.24
121	300724	捷佳伟创	28700	1,814,127.00	0.24
122	000738	航发控制	81200	1,805,888.00	0.24
123	601997	贵阳银行	300600	1,803,600.00	0.24
124	000932	华菱钢铁	426040	1,780,847.20	0.23
125	002294	信立泰	57420	1,776,000.60	0.23

126	002558	巨人网络	139500	1,770,255.00	0.23
127	688361	中科飞测	20129	1,762,293.95	0.23
128	600909	华安证券	289960	1,757,157.60	0.23
129	000878	云南铜业	144100	1,756,579.00	0.23
130	600529	山东药玻	68100	1,754,937.00	0.23
131	600497	驰宏锌锗	314272	1,750,495.04	0.23
132	600673	东阳光	155000	1,749,950.00	0.23
133	000729	燕京啤酒	144700	1,742,188.00	0.23
134	300919	中伟股份	48100	1,737,372.00	0.23
135	600141	兴发集团	79500	1,725,150.00	0.23
136	688002	睿创微纳	36614	1,721,224.14	0.23
137	603345	安井食品	21000	1,711,080.00	0.23
138	002409	雅克科技	29400	1,703,730.00	0.22
139	000623	吉林敖东	98320	1,697,986.40	0.22
140	000997	新大陆	85000	1,695,750.00	0.22
141	600155	华创云信	228800	1,693,120.00	0.22
142	002607	中公教育	496100	1,686,740.00	0.22
143	000034	神州数码	48100	1,685,905.00	0.22
144	600549	厦门钨业	87200	1,680,344.00	0.22
145	603338	浙江鼎力	26000	1,677,520.00	0.22
146	688188	柏楚电子	8635	1,677,348.75	0.22
147	002065	东华软件	230800	1,675,608.00	0.22
148	000733	振华科技	39700	1,674,149.00	0.22
149	002064	华峰化学	204100	1,669,538.00	0.22
150	300073	当升科技	41434	1,668,961.52	0.22
151	300001	特锐德	76000	1,668,200.00	0.22
152	601665	齐鲁银行	298200	1,666,938.00	0.22
153	600118	中国卫星	61000	1,665,300.00	0.22
154	601456	国联证券	122700	1,658,904.00	0.22
155	603087	甘李药业	37300	1,644,930.00	0.22
156	002318	久立特材	70200	1,643,382.00	0.22
157	002432	九安医疗	40100	1,635,278.00	0.22
158	002739	万达电影	134600	1,634,044.00	0.22
159	600563	法拉电子	13700	1,629,204.00	0.21
160	600820	隧道股份	226200	1,626,378.00	0.21
161	600704	物产中大	320600	1,622,236.00	0.21
162	600521	华海药业	90300	1,613,661.00	0.21
163	600312	平高电气	83900	1,610,880.00	0.21
164	600637	东方明珠	207500	1,610,200.00	0.21
165	600580	卧龙电驱	93600	1,608,984.00	0.21
166	600060	海信视像	80600	1,607,164.00	0.21
167	601179	中国西电	210934	1,600,989.06	0.21
168	002410	广联达	136100	1,600,536.00	0.21

169	600699	均胜电子	101400	1,588,938.00	0.21
170	002841	视源股份	42800	1,579,748.00	0.21
171	002984	森麒麟	63800	1,573,308.00	0.21
172	600132	重庆啤酒	24900	1,569,198.00	0.21
173	002385	大北农	355700	1,540,181.00	0.20
174	300003	乐普医疗	135500	1,536,570.00	0.20
175	002262	恩华药业	62900	1,531,615.00	0.20
176	601666	平煤股份	152700	1,530,054.00	0.20
177	603568	伟明环保	70037	1,514,900.31	0.20
178	002568	百润股份	54000	1,512,540.00	0.20
179	603939	益丰药房	62564	1,509,669.32	0.20
180	688180	君实生物	55233	1,509,517.89	0.20
181	603179	新泉股份	35300	1,507,310.00	0.20
182	300144	宋城演艺	162000	1,504,980.00	0.20
183	000683	远兴能源	269100	1,504,269.00	0.20
184	300763	锦浪科技	24600	1,502,322.00	0.20
185	600390	五矿资本	231300	1,491,885.00	0.20
186	002152	广电运通	127700	1,488,982.00	0.20
187	600008	首创环保	452874	1,485,426.72	0.20
188	300751	迈为股份	14100	1,482,615.00	0.20
189	600392	盛和资源	144000	1,480,320.00	0.20
190	002044	美年健康	321800	1,477,062.00	0.19
191	000039	中集集团	189650	1,473,580.50	0.19
192	002407	多氟多	122300	1,467,600.00	0.19
193	300373	扬杰科技	33700	1,466,624.00	0.19
194	000513	丽珠集团	38442	1,460,796.00	0.19
195	603129	春风动力	9300	1,460,751.00	0.19
196	603589	口子窖	37200	1,459,728.00	0.19
197	600170	上海建工	548400	1,453,260.00	0.19
198	600863	内蒙华电	335600	1,453,148.00	0.19
199	600486	扬农化工	25060	1,450,222.20	0.19
200	002624	完美世界	139851	1,444,660.83	0.19
201	300529	健帆生物	49200	1,443,528.00	0.19
202	601717	郑煤机	111200	1,443,376.00	0.19
203	600763	通策医疗	32336	1,435,718.40	0.19
204	601000	唐山港	304650	1,434,901.50	0.19
205	000960	锡业股份	101500	1,424,045.00	0.19
206	300251	光线传媒	150800	1,423,552.00	0.19
207	000426	兴业银锡	127800	1,421,136.00	0.19
208	600498	烽火通信	73000	1,420,580.00	0.19
209	000703	恒逸石化	226100	1,419,908.00	0.19
210	600816	建元信托	404800	1,416,800.00	0.19
211	600316	洪都航空	44100	1,416,492.00	0.19

212	600872	中炬高新	64200	1,413,684.00	0.19
213	603979	金诚信	38700	1,404,810.00	0.19
214	000723	美锦能源	311400	1,404,414.00	0.19
215	600516	方大炭素	290000	1,400,700.00	0.18
216	300285	国瓷材料	82140	1,399,665.60	0.18
217	603816	顾家家居	50700	1,398,306.00	0.18
218	300558	贝达药业	25800	1,391,394.00	0.18
219	002500	山西证券	221290	1,389,701.20	0.18
220	002958	青农商行	456900	1,388,976.00	0.18
221	688578	艾力斯	23185	1,388,781.50	0.18
222	300390	天华新能	60000	1,383,000.00	0.18
223	002603	以岭药业	86100	1,378,461.00	0.18
224	000830	鲁西化工	117700	1,375,913.00	0.18
225	000629	钒钛股份	477700	1,375,776.00	0.18
226	000921	海信家电	47600	1,375,640.00	0.18
227	605358	立昂微	55300	1,369,781.00	0.18
228	002025	航天电器	28200	1,369,392.00	0.18
229	688052	纳芯微	10482	1,365,804.60	0.18
230	000636	风华高科	95100	1,364,685.00	0.18
231	002155	湖南黄金	86700	1,363,791.00	0.18
232	002939	长城证券	166200	1,362,840.00	0.18
233	601966	玲珑轮胎	75200	1,356,608.00	0.18
234	002926	华西证券	162140	1,347,383.40	0.18
235	002429	兆驰股份	232700	1,345,006.00	0.18
236	000893	亚钾国际	66700	1,344,672.00	0.18
237	000591	太阳能	281700	1,340,892.00	0.18
238	601880	辽港股份	771000	1,333,830.00	0.18
239	600535	天士力	92000	1,330,320.00	0.18
240	600998	九州通	259376	1,328,005.12	0.18
241	600021	上海电力	144700	1,326,899.00	0.17
242	002203	海亮股份	123200	1,324,400.00	0.17
243	600511	国药股份	38500	1,317,470.00	0.17
244	600348	华阳股份	185650	1,316,258.50	0.17
245	600038	中直股份	33900	1,307,184.00	0.17
246	002414	高德红外	175600	1,304,708.00	0.17
247	600325	华发股份	226300	1,303,488.00	0.17
248	603927	中科软	60000	1,302,000.00	0.17
249	600380	健康元	115400	1,300,558.00	0.17
250	603077	和邦生物	635540	1,296,501.60	0.17
251	600208	衢州发展	437500	1,295,000.00	0.17
252	600970	中材国际	136000	1,289,280.00	0.17
253	600655	豫园股份	200100	1,286,643.00	0.17
254	002423	中粮资本	94600	1,266,694.00	0.17

255	601016	节能风电	399290	1,265,749.30	0.17
256	300146	汤臣倍健	105000	1,265,250.00	0.17
257	000060	中金岭南	269300	1,263,017.00	0.17
258	300748	金力永磁	70500	1,260,540.00	0.17
259	600859	王府井	81800	1,260,538.00	0.17
260	300567	精测电子	19600	1,260,280.00	0.17
261	002756	永兴材料	33400	1,259,848.00	0.17
262	600754	锦江酒店	46900	1,259,734.00	0.17
263	603000	人民网	56970	1,255,618.80	0.17
264	688385	复旦微电	32635	1,252,857.65	0.17
265	688278	特宝生物	17060	1,251,692.20	0.16
266	300487	蓝晓科技	26100	1,249,407.00	0.16
267	600901	江苏金租	238500	1,244,970.00	0.16
268	000519	中兵红箭	86100	1,244,145.00	0.16
269	600583	海油工程	227300	1,243,331.00	0.16
270	002683	广东宏大	46800	1,239,264.00	0.16
271	603885	吉祥航空	90200	1,235,740.00	0.16
272	600166	福田汽车	488589	1,226,358.39	0.16
273	300212	易华录	51820	1,212,588.00	0.16
274	600707	彩虹股份	147500	1,212,450.00	0.16
275	000998	隆平高科	108500	1,211,945.00	0.16
276	600546	山煤国际	101900	1,205,477.00	0.16
277	603156	养元饮品	52100	1,189,964.00	0.16
278	002439	启明星辰	75200	1,189,664.00	0.16
279	600282	南钢股份	253600	1,189,384.00	0.16
280	688220	翱捷科技	21935	1,186,464.15	0.16
281	300601	康泰生物	68800	1,179,920.00	0.16
282	601001	晋控煤业	86300	1,179,721.00	0.16
283	002507	涪陵榨菜	83180	1,175,333.40	0.15
284	300677	英科医疗	46440	1,174,003.20	0.15
285	600131	国网信通	62000	1,172,420.00	0.15
286	600004	白云机场	121500	1,166,400.00	0.15
287	000598	兴蓉环境	153500	1,165,065.00	0.15
288	603899	晨光股份	38200	1,155,550.00	0.15
289	002373	千方科技	113948	1,155,432.72	0.15
290	002653	海思科	34700	1,153,775.00	0.15
291	688017	绿的谐波	10641	1,149,866.46	0.15
292	601918	新集能源	160000	1,148,800.00	0.15
293	300765	新诺威	43200	1,148,688.00	0.15
294	688065	凯赛生物	29585	1,147,898.00	0.15
295	600867	通化东宝	142400	1,147,744.00	0.15
296	600483	福能股份	114600	1,142,562.00	0.15
297	000050	深天马 A	126400	1,141,392.00	0.15

298	603290	斯达半导	12600	1,131,732.00	0.15
299	300070	碧水源	223455	1,130,682.30	0.15
300	600737	中粮糖业	110100	1,124,121.00	0.15
301	000563	陕国投 A	315700	1,123,892.00	0.15
302	300118	东方日升	93600	1,121,328.00	0.15
303	002120	韵达股份	149000	1,120,480.00	0.15
304	601611	中国核建	123800	1,119,152.00	0.15
305	301308	江波龙	13000	1,118,000.00	0.15
306	688772	珠海冠宇	69419	1,116,257.52	0.15
307	601231	环旭电子	67300	1,110,450.00	0.15
308	601155	新城控股	92800	1,109,888.00	0.15
309	603486	科沃斯	23600	1,109,200.00	0.15
310	600566	济川药业	38100	1,107,948.00	0.15
311	601098	中南传媒	73800	1,107,738.00	0.15
312	002430	杭氧股份	50583	1,102,709.40	0.15
313	002244	滨江集团	128000	1,102,080.00	0.15
314	601156	东航物流	65100	1,098,237.00	0.14
315	603529	爱玛科技	26600	1,091,132.00	0.14
316	601991	大唐发电	382500	1,090,125.00	0.14
317	688005	容百科技	34440	1,086,582.00	0.14
318	000987	越秀资本	154750	1,086,345.00	0.14
319	002056	横店东磁	83800	1,086,048.00	0.14
320	300676	华大基因	25700	1,078,629.00	0.14
321	600598	北大荒	73100	1,078,225.00	0.14
322	600416	湘电股份	95300	1,075,937.00	0.14
323	603228	景旺电子	38480	1,071,283.20	0.14
324	000818	航锦科技	56000	1,069,600.00	0.14
325	000887	中鼎股份	81300	1,066,656.00	0.14
326	601866	中远海发	407067	1,062,444.87	0.14
327	002368	太极股份	44718	1,058,922.24	0.14
328	600435	北方导航	108300	1,057,008.00	0.14
329	600582	天地科技	170045	1,050,878.10	0.14
330	300595	欧普康视	55400	1,049,830.00	0.14
331	002831	裕同科技	38540	1,044,434.00	0.14
332	600271	航天信息	114500	1,043,095.00	0.14
333	603658	安图生物	23900	1,042,996.00	0.14
334	300009	安科生物	120548	1,041,534.72	0.14
335	002508	老板电器	48500	1,039,355.00	0.14
336	600755	厦门国贸	156100	1,036,504.00	0.14
337	002240	盛新锂能	75200	1,036,256.00	0.14
338	000958	电投产融	166300	1,036,049.00	0.14
339	002670	国盛金控	78840	1,032,015.60	0.14
340	688363	华熙生物	20203	1,031,161.12	0.14

341	002572	索菲亚	59585	1,023,670.30	0.13
342	688114	华大智造	21835	1,021,659.65	0.13
343	000155	川能动力	94800	1,012,464.00	0.13
344	600258	首旅酒店	68700	1,007,829.00	0.13
345	300888	稳健医疗	23940	1,007,395.20	0.13
346	601958	金钼股份	99500	1,000,970.00	0.13
347	000883	湖北能源	200400	997,992.00	0.13
348	600685	中船防务	42100	997,770.00	0.13
349	600995	南网储能	98500	996,820.00	0.13
350	600378	昊华科技	34400	994,504.00	0.13
351	600848	上海临港	98400	993,840.00	0.13
352	002268	电科网安	61100	992,875.00	0.13
353	300573	兴齐眼药	14200	990,876.00	0.13
354	688538	和辉光电	426427	989,310.64	0.13
355	600129	太极集团	39900	986,328.00	0.13
356	603444	吉比特	4500	984,780.00	0.13
357	000739	普洛药业	60300	980,478.00	0.13
358	600739	辽宁成大	94200	974,970.00	0.13
359	600517	国网英大	176400	971,964.00	0.13
360	003031	中瓷电子	18440	966,071.60	0.13
361	603379	三美股份	25160	965,640.80	0.13
362	603298	杭叉集团	53880	963,913.20	0.13
363	601118	海南橡胶	176000	952,160.00	0.13
364	000403	派林生物	45000	950,850.00	0.13
365	000027	深圳能源	146680	950,486.40	0.13
366	600906	财达证券	133600	948,560.00	0.13
367	000778	新兴铸管	246120	945,100.80	0.12
368	000709	河钢股份	425000	939,250.00	0.12
369	601636	旗滨集团	165800	930,138.00	0.12
370	603712	七一二	47600	926,772.00	0.12
371	002299	圣农发展	63900	925,272.00	0.12
372	603728	鸣志电器	17100	923,400.00	0.12
373	688234	天岳先进	18028	923,033.60	0.12
374	600528	中铁工业	114500	922,870.00	0.12
375	600499	科达制造	118200	921,960.00	0.12
376	603737	三棵树	21600	920,160.00	0.12
377	000785	居然智家	256700	916,419.00	0.12
378	601399	国机重装	296600	913,528.00	0.12
379	002557	洽洽食品	31413	912,547.65	0.12
380	600606	绿地控股	433600	910,560.00	0.12
381	601928	凤凰传媒	78500	905,890.00	0.12
382	600329	达仁堂	29400	905,520.00	0.12
383	600373	中文传媒	72000	903,600.00	0.12

384	002080	中材科技	68900	901,212.00	0.12
385	603858	步长制药	57000	900,600.00	0.12
386	688536	思瑞浦	9733	900,302.50	0.12
387	600968	海油发展	209200	893,284.00	0.12
388	600977	中国电影	76800	891,648.00	0.12
389	688567	孚能科技	75382	874,431.20	0.12
390	601598	中国外运	162400	868,840.00	0.11
391	600884	杉杉股份	115700	861,965.00	0.11
392	600959	江苏有线	257030	861,050.50	0.11
393	603650	彤程新材	24600	860,262.00	0.11
394	688297	中无人机	21231	855,184.68	0.11
395	600871	石化油服	418900	854,556.00	0.11
396	600056	中国医药	76920	853,812.00	0.11
397	601212	白银有色	304500	846,510.00	0.11
398	600095	湘财股份	117400	845,280.00	0.11
399	600062	华润双鹤	42600	843,480.00	0.11
400	688387	信科移动	140839	839,400.44	0.11
401	002266	浙富控股	268600	838,032.00	0.11
402	000559	万向钱潮	136100	837,015.00	0.11
403	600801	华新水泥	69000	834,900.00	0.11
404	600764	中国海防	29300	829,776.00	0.11
405	002372	伟星新材	65300	824,739.00	0.11
406	000032	深桑达 A	46700	823,788.00	0.11
407	601106	中国一重	282099	820,908.09	0.11
408	000825	太钢不锈	234900	817,452.00	0.11
409	301301	川宁生物	68500	812,410.00	0.11
410	688778	厦钨新能	17663	806,139.32	0.11
411	002019	亿帆医药	75066	804,707.52	0.11
412	603688	石英股份	27950	803,003.50	0.11
413	002487	大金重工	39100	801,159.00	0.11
414	600663	陆家嘴	81000	797,040.00	0.11
415	688349	三一重能	25723	794,326.24	0.10
416	601608	中信重工	188550	791,910.00	0.10
417	603882	金域医学	28700	790,111.00	0.10
418	600808	马钢股份	247355	764,326.95	0.10
419	603456	九洲药业	55300	756,504.00	0.10
420	600925	苏能股份	141400	749,420.00	0.10
421	688561	奇安信	27729	743,969.07	0.10
422	600500	中化国际	184500	741,690.00	0.10
423	603556	海兴电力	20000	739,800.00	0.10
424	300957	贝泰妮	17300	738,537.00	0.10
425	002408	齐翔腾达	146060	734,681.80	0.10
426	002531	天顺风能	92200	729,302.00	0.10

427	688390	固德威	17806	728,265.40	0.10
428	601019	山东出版	64100	727,535.00	0.10
429	600578	京能电力	206600	727,232.00	0.10
430	688425	铁建重工	164749	724,895.60	0.10
431	601965	中国汽研	41100	724,182.00	0.10
432	001227	兰州银行	293200	721,272.00	0.10
433	600350	山东高速	69700	716,516.00	0.09
434	001286	陕西能源	77100	715,488.00	0.09
435	688516	奥特维	16515	715,264.65	0.09
436	688301	奕瑞科技	7470	713,907.90	0.09
437	603233	大参林	46820	705,109.20	0.09
438	603225	新凤鸣	62900	700,077.00	0.09
439	600098	广州发展	108300	695,286.00	0.09
440	600612	老凤祥	12800	694,656.00	0.09
441	000937	冀中能源	109200	690,144.00	0.09
442	601568	北元集团	163500	686,700.00	0.09
443	600688	上海石化	226000	682,520.00	0.09
444	603185	弘元绿能	41700	677,625.00	0.09
445	600126	杭钢股份	138400	661,552.00	0.09
446	603707	健友股份	49787	660,673.49	0.09
447	002867	周大生	44950	653,123.50	0.09
448	000967	盈峰环境	130300	647,591.00	0.09
449	603883	老百姓	38810	635,319.70	0.08
450	601139	深圳燃气	89000	628,340.00	0.08
451	600720	中交设计	70700	626,402.00	0.08
452	600339	中油工程	172000	615,760.00	0.08
453	601992	金隅集团	343300	611,074.00	0.08
454	002153	石基信息	84334	602,144.76	0.08
455	600295	鄂尔多斯	61100	596,336.00	0.08
456	002608	江苏国信	77400	593,658.00	0.08
457	688032	禾迈股份	5260	592,486.40	0.08
458	000898	鞍钢股份	245600	589,440.00	0.08
459	002563	森马服饰	83300	584,766.00	0.08
460	000537	中绿电	64000	583,680.00	0.08
461	000401	冀东水泥	109500	572,685.00	0.08
462	300140	节能环境	95500	572,045.00	0.08
463	688248	南网科技	17771	570,271.39	0.08
464	003022	联泓新科	41000	564,570.00	0.07
465	688281	华秦科技	6043	562,603.30	0.07
466	688331	荣昌生物	18593	559,835.23	0.07
467	600032	浙江新能	74200	549,080.00	0.07
468	002690	美亚光电	36526	541,315.32	0.07
469	601228	广州港	155300	526,467.00	0.07

470	603786	科博达	8500	525,300.00	0.07
471	600299	安迪苏	41200	517,060.00	0.07
472	301165	锐捷网络	7100	512,620.00	0.07
473	688520	神州细胞	14010	507,582.30	0.07
474	600007	中国国贸	20600	503,876.00	0.07
475	688172	燕东微	25127	503,796.35	0.07
476	688475	萤石网络	16524	498,859.56	0.07
477	600928	西安银行	137300	495,653.00	0.07
478	301267	华夏眼科	25900	493,136.00	0.06
479	600361	创新新材	126600	488,676.00	0.06
480	000959	首钢股份	160000	488,000.00	0.06
481	003035	南网能源	116700	487,806.00	0.06
482	603056	德邦股份	31800	455,694.00	0.06
483	002945	华林证券	27800	426,174.00	0.06
484	000539	粤电力 A	91400	414,042.00	0.05
485	601061	中信金属	55500	402,930.00	0.05
486	001203	大中矿业	46400	401,824.00	0.05
487	688375	国博电子	8085	399,075.60	0.05
488	600927	永安期货	30000	395,700.00	0.05
489	688819	天能股份	14308	389,463.76	0.05
490	603826	坤彩科技	20100	386,925.00	0.05
491	601858	中国科传	16100	328,118.00	0.04
492	688276	百克生物	13033	327,258.63	0.04
493	688153	唯捷创芯	9010	301,474.60	0.04
494	601158	重庆水务	59300	290,570.00	0.04
495	600956	新天绿能	31800	239,772.00	0.03
496	603868	飞科电器	5000	207,600.00	0.03
497	688295	中复神鹰	10400	207,272.00	0.03
498	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
499	688615	合合信息	289	47,910.42	0.01
500	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
501	688449	联芸科技	1406	41,392.64	0.01
502	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01
503	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
504	001391	国货航	4686	31,864.80	0.00
505	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
506	603072	天和磁材	2255	27,736.50	0.00
507	688750	金天钛业	1685	26,016.40	0.00
508	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
509	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
510	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
511	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
512	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00

513	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
514	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
515	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
516	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
517	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
518	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
519	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
520	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
521	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
522	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
523	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
524	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
525	400174	中天 3	537300	5,373.00	0.00
526	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
527	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
528	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
529	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
530	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
531	603285	键邦股份	129	2,916.69	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	688169	石头科技	11,491,077.36	1.50
2	688120	华海清科	7,129,267.25	0.93
3	688777	中控技术	5,152,655.77	0.67
4	300339	润和软件	5,083,550.00	0.67
5	688525	佰维存储	4,114,507.11	0.54
6	601567	三星医疗	4,027,580.00	0.53
7	600487	亨通光电	3,722,115.00	0.49
8	603979	金诚信	3,453,473.00	0.45
9	601099	太平洋	3,416,184.00	0.45
10	600418	江淮汽车	3,324,135.00	0.44
11	601615	明阳智能	3,278,945.00	0.43
12	603345	安井食品	3,172,728.72	0.42
13	688617	惠泰医疗	3,162,603.53	0.41
14	688065	凯赛生物	3,148,851.97	0.41
15	600872	中炬高新	2,873,736.00	0.38
16	688072	拓荆科技	2,867,784.21	0.38
17	300476	胜宏科技	2,789,420.00	0.37
18	600839	四川长虹	2,705,953.00	0.35

19	601058	赛轮轮胎	2,621,897.00	0.34
20	002085	万丰奥威	2,605,544.00	0.34

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	688169	石头科技	14,007,846.86	1.83
2	300502	新易盛	9,810,314.25	1.28
3	688120	华海清科	7,769,375.13	1.02
4	601058	赛轮轮胎	6,771,167.00	0.89
5	601077	渝农商行	6,144,370.00	0.80
6	002463	沪电股份	5,617,723.00	0.74
7	600066	宇通客车	5,453,127.00	0.71
8	002028	思源电气	5,115,551.53	0.67
9	300394	天孚通信	4,787,969.80	0.63
10	600418	江淮汽车	4,643,319.00	0.61
11	002422	科伦药业	4,511,404.00	0.59
12	000975	山金国际	3,930,743.73	0.51
13	600160	巨化股份	3,864,672.00	0.51
14	300418	昆仑万维	3,450,786.00	0.45
15	600161	天坛生物	3,255,341.00	0.43
16	000933	神火股份	3,083,858.00	0.40
17	601168	西部矿业	2,923,653.50	0.38
18	600839	四川长虹	2,923,602.00	0.38
19	600415	小商品城	2,900,722.00	0.38
20	688072	拓荆科技	2,894,863.75	0.38

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	468,518,168.43
卖出股票的收入（成交）总额	479,837,529.57

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，永泰能源集团股份有限公司在报告编制前一年受到晋中市应急管理局的处罚。江苏亨通光电股份有限公司在报告编制前一年受到上海证券交易所的通报批评。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

### 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	4,505,700.26
2	应收清算款	2,990,115.79
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	7,495,816.05

#### 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
2251	47,843.22	8,260,465.00	7.67%	15,498,628.00	14.39%	83,936,005.00	77.94%

### 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	浙商证券股份有限公司	3,018,400.00	2.80%
2	中银国际证券—中银理财—稳富固收增强（1年滚续）—中银证券—中银理财 7 号单一资产管理计划	2,500,000.00	2.32%

3	孙雪理	1,266,376.00	1.18%
4	罗志中	920,000.00	0.85%
5	广发证券股份有限公司	666,470.00	0.62%
6	宋丹丹	571,700.00	0.53%
7	白巍	520,000.00	0.48%
8	华泰证券股份有限公司	353,009.00	0.33%
9	简街香港有限公司—JSQB 有限公司 (R)	351,839.00	0.33%
10	方正证券股份有限公司	342,789.00	0.32%
-	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	83,936,005.00	77.94%

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	117,695,098.00
本报告期基金总申购份额	59,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	69,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	107,695,098.00

## §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 2024 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫先生离任公司副总经理。

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

基金管理人于 2024 年 12 月 7 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 55000 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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	462,324,670.27	48.97%	96,858.40	32.50%	-
国泰君安	1	151,547,043.51	16.05%	31,208.92	10.47%	-
长江证券	2	143,492,510.70	15.20%	87,003.44	29.20%	-

中金公司	2	133,863,651.35	14.18%	43,539.38	14.61%	-
中信建投	2	40,708,370.59	4.31%	30,363.66	10.19%	-
中信证券	2	11,697,691.57	1.24%	8,725.71	2.93%	-
银河证券	1	473,460.01	0.05%	260.23	0.09%	-
中泰证券	1	41,548.05	-	31.00	0.01%	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 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	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下 193 只基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-27
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-07
3	博时基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-18
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-14
5	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20241106	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-06
6	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停场外实物申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-25
7	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024-10-25
8	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增西南证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-17
9	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	2024-09-30
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20240925	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-25
11	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金	中国证券报、基	2024-09-25

	主流动性服务商为一般流动性服务商的公告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
12	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-09-21
13	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中 期报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-30
14	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上 海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-23
15	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开 展费率优惠活动的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-22
16	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换 等业务费率优惠的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-08-17
17	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增爱建证券 为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-26
18	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收 付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-20
19	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增信达证券 为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-07-19
20	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 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	2024-07-19
21	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品 资料概要更新	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-06-26
22	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期	中国证券报、基	2024-06-06

	内承销证券的公告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
23	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-05-25
24	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售 有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-05-15
25	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华宝证券 为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-30
26	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有 限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优 惠的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-29
27	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公 司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的 公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-29
28	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增联储证券 为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-22
29	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-22
30	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-04-13
31	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年 度报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-03-29
32	博时基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金 主流动性服务商的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-02-28
33	博时基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金	中国证券报、基	2024-01-31

	主流动性服务商的公告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
34	博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-01-22
35	关于指定博时基金管理有限公司旗下部分证券投资基金 主流动性服务商的公告	中国证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2024-01-05

## §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
招商银行股份有限公司一博时中证 500 交易型开放	1	2024-01-01~2024-12-3 1	97,049,005.0 0	8,261,700.0 0	21,374,700.0 0	83,936,005.0 0	77.94 %

式 指 数 证 券 投 资 基 金 发 起 式 联 接 基 金							
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

注：1.申购份额包含红利再投资份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证 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  
二〇二五年三月三十一日