

**博时标普 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2025 年中期报告
2025 年 6 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	5
2.6 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	31
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	32
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	53
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	53
7.10 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55

§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时标普 500ETF
场内简称	标普 500ETF
基金主代码	513500
交易代码	513500
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013 年 12 月 5 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,527,638,570.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	标普 500 指数（S&P500Index（NTR，Net total Return））（经估值汇率调整，以人民币计价）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票，投资者需承担汇率风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
披露负责人	姓名	吴曼	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
服务电话		95105568 0755-83195140	95588 010-66105798
地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街

地址	广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街
编码	518040	100140
代表人	江向阳	廖林

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

注：本基金未聘请境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	50,173,774.12
本期利润	1,108,316,629.57
加权平均基金份额本期利润	0.1273
本期加权平均净值利润率	6.46%
本期基金份额净值增长率	5.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,927,336,559.24
期末可供分配基金份额利润	0.3072
期末基金资产净值	20,001,584,737.46
期末基金份额净值	2.0993
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	319.86%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关

费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	
4.62%	0.66%	4.66%	0.65%	
10.35%	1.94%	10.53%	1.94%	
5.10%	1.57%	5.55%	1.56%	
14.21%	1.27%	15.21%	1.27%	
74.78%	1.10%	80.50%	1.10%	
319.86%	1.12%	368.18%	1.13%	

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

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限
	任职日期	离任日期	
指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2015-10-08	-	18.3

基金经理助理	2023-03-06	2025-04-15	8.9

--	--	--	--

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 23 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，美国经济大幅波动中仍具韧性，美股从下跌后反弹继续创下新高。经济数据方面，由于“抢进口”的影响，美国 GDP 环比折年率 1 季度为-0.5%（2021Q1 以来首次收缩），2 季度反弹至 3.0%，显著高于彭博一致预期的 2.4%。消费较为稳定，商品、服务消费均边际回暖，耐用品改善明显。此外，7 月份消费者信心指数创下 2 月份以来新高。关税和利率环境对投资有所拖累，存货和建筑投资转负，设备投资增速也有所回落。通胀方面，通胀在 2 季度温和回升，6 月 CPI 同比 2.7%，前值 2.4%，核心 PCE 在 2 季度同比增速为 2.5%，较 1 季度的 3.5%有所回落，但仍高于美联储 2%的目标。货币政策方面，上半年美联储暂停降息，从 4 月开始进一步放缓缩表。从指数表现上来看，上半年标普 500 指数和纳斯达克 100 指数上涨均创下历史新高。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 2.0993 元，份额累计净值为 4.1986 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 5.10%，同期业绩基准增长率 5.55%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，美国经济增长预计将持续放缓，但依然保持韧性。经济方面，美国金融条件仍较为宽松，财政继续扩张，下半年财政脉冲可能会环比改善，关税收入的增加可以抵消支出。通胀方面，未来几个月可能会温和走高，关税的影响会逐步体现。货币政策方面，从 CME 隐含利率预期看市场预期 10 月将开始降息，目前关税对通胀影响路径已经基本确定，美联储很可能在 9-10 月开始降息。整体来看，短期市场受到降息预期、关税不确定性、科技公司财报盈利指引各种因素相互干扰，长期在经济增长稳定的背景下，美股仍具有较强韧性。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进

行评价，保证基金估值的公平、合理。

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年6月30日	2025年6月30日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	395,754,474.61	
结算备付金		100,180,798.77	
存出保证金		30,619,832.84	
交易性金融资产	6.4.6.2	19,596,400,600.64	
其中：股票投资		19,596,400,600.64	
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	6.4.6.3	-	
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	
其他债权投资		-	
其他权益工具投资	6.4.6.5	-	
应收清算款		-	
应收股利		9,046,517.28	
应收申购款		-	
递延所得税资产		-	
其他资产	6.4.6.6	-	
资产总计		20,132,002,224.14	
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	2025年6月30日
负债：			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债	6.4.6.3	-	
卖出回购金融资产款		-	
应付清算款		108,122,860.86	
应付赎回款		-	
应付管理人报酬		9,481,938.69	
应付托管费		3,160,646.20	
应付销售服务费		-	
应付投资顾问费		-	
应交税费		-	
应付利润		-	
递延所得税负债		-	
其他负债	6.4.6.7	9,652,040.93	
负债合计		130,417,486.68	
净资产：		-	
实收基金	6.4.6.8	4,763,819,284.32	

其他综合收益		-	
未分配利润	6.4.6.9	15,237,765,453.14	
净资产合计		20,001,584,737.46	
负债和净资产总计		20,132,002,224.14	

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0993 元，基金份额总额 9,527,638,570.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上期 2024年1月1日至2024年6月30日
一、营业总收入		1,179,040,718.61	
1. 利息收入		4,964,191.17	
其中：存款利息收入	6.4.6.10	4,964,191.17	
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）		122,543,240.06	
其中：股票投资收益	6.4.6.11	21,777,895.17	
基金投资收益	6.4.6.12	-	
债券投资收益	6.4.6.13	-	
资产支持证券投资收益	6.4.6.14	-	
贵金属投资收益		-	
衍生工具收益	6.4.6.15	-2,558,706.71	
股利收益	6.4.6.16	103,324,051.60	
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）	6.4.6.17	1,058,142,855.45	
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-41,396,647.56	
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	34,787,079.49	
减：二、营业总支出		70,724,089.04	
1. 管理人报酬		50,955,460.25	
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	
2. 托管费		17,555,633.60	
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	6.4.6.19	-	
7. 税金及附加		12,148.15	
8. 其他费用	6.4.6.20	2,200,847.04	
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,108,316,629.57	
减：所得税费用		-	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,108,316,629.57	
五、其他综合收益的税后净额		-	
六、综合收益总额		1,108,316,629.57	

6.3 净资产变动表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	
	3,964,319,284.66	-	11,873,360,847.45	
	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	3,964,319,284.66	-	11,873,360,847.45	
减少以“-”	799,499,999.66	-	3,364,404,605.69	
	-	-	1,108,316,629.57	
交易产生的 产减少以	799,499,999.66	-	2,256,087,976.12	
	921,499,999.63	-	2,594,986,002.68	
	-121,999,999.97	-	-338,898,026.56	
额持有人分 变动（净资 ）	-	-	-	
结转留存收	-	-	-	
	4,763,819,284.32	-	15,237,765,453.14	
	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	
	2,647,319,284.10	-	5,793,425,387.38	

	-	-	-	
	-	-	-	
	-	-	-	
	2,647,319,284.10	-	5,793,425,387.38	
减少以“-”	1,039,500,000.44	-	4,072,920,387.55	
	-	-	1,652,221,381.77	
交易产生的 产减少以	1,039,500,000.44	-	2,420,699,005.78	
	1,046,500,000.43	-	2,435,840,802.96	
	-6,999,999.99	-	-15,141,797.18	
额持有人分 变动（净资 ）	-	-	-	
结转留存收	-	-	-	
	3,686,819,284.54	-	9,866,345,774.93	

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、境外上市交易的跟踪同一标的指数的公募基金。本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪

同一标的指数的股指期货等金融衍生工具、法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：标普 500 指数（S&P 500 Index（NTR, Net total Return））（经估值汇率调整，以人民币计价）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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。

6.4.4 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。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从境内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。

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

(3) 对基金取得的境内企业债券利息收入，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。对基金从境内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。对基金持有的境内上市公司限售股，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。

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

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

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

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

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	395,754,474.61
等于：本金	395,709,994.03

加：应计利息	44,480.58
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	395,754,474.61

注：于 2025 年 06 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 52,116,018.52(折合人民币 373,077,730.18)。

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

	本期末 2025年6月30日		
	成本	应计利息	公允价值
	14,414,663,766.92	-	19,596,400,600
	-	-	-
交易所市场	-	-	-
银行间市场	-	-	-
合计	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	-	-	-
	14,414,663,766.92	-	19,596,400,600

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

	本期末 2025年6月30日		
	合同/名义 金额	公允价值	
		资产	负债
	-	-	-
	-	-	-
	371,750,464.75	-	-
	-	-	-
	371,750,464.75	-	-

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。

6.4.6.3.2 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)	
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	172.00	
合计	-	-	
减：可抵销期货暂收款	-	-	
净额	-	-	

注：买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他权益工具投资

6.4.6.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.6.6 其他资产

无余额。

6.4.6.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,138.35
其他应付款	9,547,902.58
合计	9,652,040.93

6.4.6.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,928,638,570.00	3,964,319,284.66

本期申购	1,843,000,000.00	921,499,999.63
本期赎回（以“-”号填列）	-244,000,000.00	-121,999,999.97
本期末	9,527,638,570.00	4,763,819,284.32

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）。

6.4.6.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未
上年度末	2,394,245,353.13	9,479,115,494.32	
本期期初	2,394,245,353.13	9,479,115,494.32	
本期利润	50,173,774.12	1,058,142,855.45	
本期基金份额交易产生的变动数	482,917,431.99	1,773,170,544.13	
其中：基金申购款	556,352,316.88	2,038,633,685.80	
基金赎回款	-73,434,884.89	-265,463,141.67	
本期已分配利润	-	-	
本期末	2,927,336,559.24	12,310,428,893.90	

6.4.6.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,963,551.51
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	639.66
其他	-
合计	4,964,191.17

6.4.6.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	137,914,008.84
减：卖出股票成本总额	115,254,914.34
减：交易费用	881,199.33
买卖股票差价收入	21,777,895.17

6.4.6.12 基金投资收益

无发生额。

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.6.14 资产支持证券投资收益

6.4.6.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.15 衍生工具收益

6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
期货投资收益	-2,558,706.71
合计	-2,558,706.71

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	103,324,051.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	103,324,051.60

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	1,018,286,617.82
——股票投资	1,018,286,617.82
——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	39,856,237.63
——权证投资	-
——期货投资	39,856,237.63
4. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,058,142,855.45

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	34,787,079.49

合计	34,787,079.49
----	---------------

6.4.6.19 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费用	1,633.65
指数使用费	2,095,075.04
合计	2,200,847.04

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
布朗兄弟哈里曼银行（“BBH”）	境外资产托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
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
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“博时标普 500ETF 联接”）	基金管理人管理的其他基金

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	50,955,460.25	35,095,241.52
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,367,756.10	12,448.70
应支付基金管理人的净管理费	48,587,704.15	35,082,792.82

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

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

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,555,633.60	14,623,017.34

注：于本期及上年度可比期间，截至 2025 年 1 月 26 日止，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

自 2025 年 1 月 27 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 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

	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基
公司—博 式指数证	3,995,686,061.00	41.94%	4,057,389,461.00	

	2, 229, 428. 00	0. 02%	2, 151, 698. 00	
--	-----------------	--------	-----------------	--

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。

6.4.9.6 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

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
期末余额	当期利息收入	期末余额	
144, 600, 461. 92	4, 963, 551. 51	758, 311, 066. 31	
251, 154, 012. 69	-	74, 118, 996. 52	

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。

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票，投资者需承担汇率风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的

建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

6.4.12.2 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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	395,754,474.61	-	-	-	395,754,474.61
结算备付金	-	-	-	100,180,798.77	100,180,798.77
存出保证金	-	-	-	30,619,832.84	30,619,832.84
交易性金融资产	-	-	-	19,596,400,600.64	19,596,400,600.64
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	9,046,517.28	9,046,517.28
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	395,754,474.61	-	-	-19,736,247,749.53	20,132,002,224.14
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	108,122,860.86	108,122,860.86
应付管理人报酬	-	-	-	9,481,938.69	9,481,938.69
应付托管费	-	-	-	3,160,646.20	3,160,646.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	9,652,040.93	9,652,040.93
负债总计	-	-	-	130,417,486.68	130,417,486.68
利率敏感度缺口	395,754,474.61	-	-	-19,605,830,262.85	20,001,584,737.46
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	857,518,349.36	-	-	-	857,518,349.36
结算备付金	-	-	-	43,979,844.60	43,979,844.60
存出保证金	-	-	-	49,941,811.55	49,941,811.55
交易性金融资产	-	-	-	14,898,853,405.59	14,898,853,405.59
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	8,224,700.55	8,224,700.55
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	857,518,349.36	-	-	-15,000,999,762.29	15,858,518,111.65
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	485,256.55	485,256.55
应付管理人报酬	-	-	-	8,112,365.29	8,112,365.29
应付托管费	-	-	-	3,380,152.21	3,380,152.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	1,281,414.62	1,281,414.62
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	7,578,790.87	7,578,790.87
负债总计	-	-	-	20,837,979.54	20,837,979.54
利率敏感度缺口	857,518,349.36	0.00	0.00	14,980,161,782.75	15,837,680,132.11

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

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
		市场利率上升 25 个基点	-
		市场利率下降 25 个基点	-

注：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）。

6.4.12.4.2 外汇风险

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

6.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	373,077,730.18	373,077,730.18
结算备付金	100,180,798.77	100,180,798.77
存出保证金	30,619,832.84	30,619,832.84
交易性金融资产	19,596,400,600.64	19,596,400,600.64
应收股利	9,046,517.28	9,046,517.28
应收清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-
资产合计	20,109,325,479.71	20,109,325,479.71
以外币计价的负债		
应付赎回款	-	-
应付清算款	106,135,485.46	106,135,485.46
应付利息	-	-
其他负债	9,547,902.58	9,547,902.58
负债合计	115,683,388.04	115,683,388.04
资产负债表外汇风险敞口净额	19,993,642,091.67	19,993,642,091.67
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
货币资金	784,714,425.35	784,714,425.35

结算备付金	43,979,844.60	43,979,844.60
存出保证金	49,941,811.55	49,941,811.55
交易性金融资产	14,898,853,405.59	14,898,853,405.59
应收股利	8,224,700.55	8,224,700.55
应收证券清算款	-	-
应收申购款	-	-
应收利息	-	-
其他资产	-	-
资产合计	15,785,714,187.64	15,785,714,187.64
以外币计价的负债		
应付赎回款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付利息	-	-
其他负债	7,488,790.87	7,488,790.87
负债合计	7,488,790.87	7,488,790.87
资产负债表外汇风险敞口净额	15,778,225,396.77	15,778,225,396.77

6.4.12.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 99,968	增加约 78,968
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 99,968	减少约 78,968

注：以上金额为四舍五入后的结果。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
股票投资	19,596,400,600.64	97.97	14,898,853,405.59	97.97
债券投资	-	-	-	-
基金投资	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
	19,596,400,600.64	97.97	14,898,853,405.59	97.97

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	除标普 500 净总收益指数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）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 103,228	增加约 77
	业绩比较基准下降 5%	减少约 103,228	减少约 77

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日
第一层次	19,596,400,600.64
第二层次	—
第三层次	—
合计	19,596,400,600.64

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	19,596,400,600.64	
	其中：普通股	19,221,231,304.42	
	存托凭证	-	
	优先股	-	
	房地产信托凭证	375,169,296.22	
2	基金投资	-	
3	固定收益投资	-	
	其中：债券	-	
	资产支持证券	-	
4	金融衍生品投资	-	
	其中：远期	-	
	期货	-	
	期权	-	
	权证	-	
5	买入返售金融资产	-	
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	
6	货币市场工具	-	
7	银行存款和结算备付金合计	495,935,273.38	
8	其他各项资产	39,666,350.12	
9	合计	20,132,002,224.14	

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元		
国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	19,596,400,600.64	97.97
合计	19,596,400,600.64	97.97

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元		
行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	587,056,348.57	2.94
公用事业	472,268,617.84	2.36
房地产	403,391,323.63	2.02
原材料	370,823,747.74	1.85
工业	1,558,936,723.93	7.79
非日常生活消费品	2,047,175,688.06	10.24
日常消费品	1,086,289,696.01	5.43
医疗保健	1,838,413,577.80	9.19
金融	2,768,985,497.95	13.84
信息技术	6,530,501,373.04	32.65
电信业务	1,932,558,006.07	9.66
合计	19,596,400,600.64	97.97

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

公司名称（英文）	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值
NVIDIA CORP	NVIDIA CORP	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	1,280,338.00	1,448,045,907.60
MICROSOFT CORP	MICROSOFT CORP	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	390,236.00	1,389,536,437.32
APPLE INC	APPLE INC	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	784,154.00	1,151,710,474.62
AMAZON.COM INC	AMAZON.COM INC	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	496,414.00	779,630,723.44
ALPHABET INC	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	305,597.00	385,528,975.16
ALPHABET INC	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	246,346.00	312,825,930.25
META PLATFORMS INC-CLASS A	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	纳斯达克交易所	美国	114,003.00	602,356,633.51
BROADCOM INC	BROADCOM INC	AVGO US	纳斯达克交易所	美国	246,871.00	487,142,666.65
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	96,313.00	334,922,016.28
TESLA INC	TESLA INC	TSLA US	纳斯达克交易所	美国	147,034.00	334,355,444.80
JPMORGAN CHASE & CO	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	纽约证券交易所	美国	145,963.00	302,924,272.06
ELI LILLY & CO	ELI LILLY & CO	LLY US	纽约证券交易所	美国	41,280.00	230,356,577.95
VISA INC-CLASS A SHARES	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	纽约证券交易所	美国	89,794.00	228,225,901.55
NETFLIX INC	NETFLIX INC	NFLX US	纳斯达克交易所	美国	22,347.00	214,224,957.11
EXXON MOBIL CORP	EXXON MOBIL CORP	XOM US	纽约证券交易所	美国	226,321.00	174,651,254.84
MASTERCARD INC - A	MASTERCARD INC - A	MA US	纽约证券交易所	美国	42,506.00	170,989,042.79
COSTCO WHOLESALE CORP	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	纳斯达克交易所	美国	23,297.00	165,096,158.72
WALMART INC	WALMART INC	WMT US	纽约证券交易所	美国	227,019.00	158,906,014.51
PROCTER & GAMBLE CO/THE	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	纽约证券交易所	美国	123,126.00	140,426,206.72
JOHNSON & JOHNSON	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	纽约证券交易所	美国	126,343.00	138,153,057.22
HOME DEPOT INC	HOME DEPOT INC	HD US	纽约证券交易所	美国	52,224.00	137,068,630.33
ORACLE CORP	ORACLE CORP	ORCL US	纽约证券交易	美国	85,387.00	133,637,888.82

			所			
ABBVIE INC	ABBVIE INC	ABBV US	纽约证券交易所	美国	92,709.00	123,189,803.09
BANK OF AMERICA CORP	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	纽约证券交易所	美国	344,067.00	116,550,959.40
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PLTR US	纳斯达克交易所	美国	111,726.00	109,028,973.69
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	PM US	纽约证券交易所	美国	81,774.00	106,616,599.22
UNITEDHEALTH GROUP INC	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	纽约证券交易所	美国	47,638.00	106,388,442.04
CISCO SYSTEMS INC	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	纳斯达克交易所	美国	208,845.00	103,725,723.74
GENERAL ELECTRIC	GENERAL ELECTRIC	GE US	纽约证券交易所	美国	55,970.00	103,127,638.46
COCA-COLA CO/THE	COCA-COLA CO/THE	KO US	纽约证券交易所	美国	203,378.00	103,005,048.87
INTL BUSINESS MACHINES CORP	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	纽约证券交易所	美国	48,789.00	102,955,138.54
SALESFORCE.COM INC	SALESFORCE.COM INC	CRM US	纽约证券交易所	美国	50,413.00	98,410,140.18
WELLS FARGO & CO	WELLS FARGO & CO	WFC US	纽约证券交易所	美国	170,897.00	98,017,467.13
ABBOTT LABORATORIES	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	纽约证券交易所	美国	91,375.00	88,966,463.37
CHEVRON CORP	CHEVRON CORP	CVX US	纽约证券交易所	美国	85,285.00	87,420,530.77
ADVANCED MICRO DEVICES	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	纳斯达克交易所	美国	85,094.00	86,438,939.60
WALT DISNEY CO/THE	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	纽约证券交易所	美国	94,390.00	83,793,588.50
LINDE PLC	LINDE PLC	LIN US	纳斯达克交易所	美国	24,723.00	83,036,446.57
INTUIT INC	INTUIT INC	INTU US	纳斯达克交易所	美国	14,678.00	82,759,380.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	纽约证券交易所	美国	16,106.00	81,601,035.31
SERVICENOW INC	SERVICENOW INC	NOW US	纽约证券交易所	美国	10,871.00	80,006,358.23
MCDONALD'S CORP	MCDONALD'S CORP	MCD US	纽约证券交易所	美国	37,539.00	78,513,875.67
AT&T INC	AT&T INC	T US	纽约证券交易所	美国	378,011.00	78,312,495.02
MERCK & CO. INC.	MERCK & CO. INC.	MRK US	纽约证券交易所	美国	131,869.00	74,726,836.04
UBER TECHNOLOGIES INC	UBER TECHNOLOGIES INC	UBER US	纽约证券交易所	美国	109,814.00	73,344,482.89
INTUITIVE SURGICAL INC	INTUITIVE SURGICAL INC	ISRG US	纳斯达克交易所	美国	18,822.00	73,218,611.93
BOOKING HOLDINGS INC	BOOKING HOLDINGS INC	BKNG US	纳斯达克交易	美国	1,716.00	71,115,936.54

			所			
TEXAS INSTRUMENTS INC	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	纳斯达克交易所	美国	47,682.00	70,868,256.14
ACCENTURE PLC-CL A	ACCENTURE PLC-CL A	ACN US	纽约证券交易所	美国	32,887.00	70,366,141.85
VERIZON COMMUNICATIONS INC	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	纽约证券交易所	美国	221,533.00	68,620,427.61
CATERPILLAR INC	CATERPILLAR INC	CAT US	纽约证券交易所	美国	24,671.00	68,561,698.46
PEPSICO INC	PEPSICO INC	PEP US	纳斯达克交易所	美国	71,982.00	68,038,937.18
AMERICAN EXPRESS CO	AMERICAN EXPRESS CO	AXP US	纽约证券交易所	美国	29,054.00	66,343,362.92
QUALCOMM INC	QUALCOMM INC	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	57,598.00	65,666,249.28
MORGAN STANLEY	MORGAN STANLEY	MS US	纽约证券交易所	美国	64,868.00	65,410,322.17
S&P GLOBAL INC	S&P GLOBAL INC	SPGI US	纽约证券交易所	美国	16,482.00	62,213,916.35
ADOBE INC	ADOBE INC	ADBE US	纳斯达克交易所	美国	22,380.00	61,981,838.98
CITIGROUP INC	CITIGROUP INC	C US	纽约证券交易所	美国	98,084.00	59,766,507.70
BOSTON SCIENTIFIC CORP	BOSTON SCIENTIFIC CORP	BSX US	纽约证券交易所	美国	77,636.00	59,694,726.13
BOEING CO/THE	BOEING CO/THE	BA US	纽约证券交易所	美国	39,600.00	59,397,681.74
PROGRESSIVE CORP	PROGRESSIVE CORP	PGR US	纽约证券交易所	美国	30,766.00	58,773,643.38
SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHW US	纽约证券交易所	美国	89,671.00	58,568,673.19
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	TMO US	纽约证券交易所	美国	19,815.00	57,513,551.82
BLACKROCK INC	BLACKROCK INC	BLK US	纽约证券交易所	美国	7,651.00	57,467,893.19
AMGEN INC	AMGEN INC	AMGN US	纳斯达克交易所	美国	28,238.00	56,440,778.91
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	纳斯达克交易所	美国	33,751.00	56,266,115.51
APPLIED MATERIALS INC	APPLIED MATERIALS INC	AMAT US	纳斯达克交易所	美国	42,668.00	55,917,476.52
GE VERNOVA INC	GE VERNOVA INC	GEV US	纽约证券交易所	美国	14,317.00	54,232,412.16
NEXTERA ENERGY INC	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	纽约证券交易所	美国	108,055.00	53,697,933.55
EATON CORP PLC	EATON CORP PLC	ETN US	纽约证券交易所	美国	20,543.00	52,498,635.18
GILEAD SCIENCES INC	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	纳斯达克交易所	美国	65,313.00	51,837,228.79
TJX COMPANIES INC	TJX COMPANIES INC	TJX US	纽约证券交易所	美国	58,625.00	51,825,409.51

			所			
PFIZER INC	PFIZER INC	PFE US	纽约证券交易所	美国	298,460.00	51,790,111.53
MICRON TECHNOLOGY INC	MICRON TECHNOLOGY INC	MU US	纳斯达克交易所	美国	58,677.00	51,770,567.47
UNION PACIFIC CORP	UNION PACIFIC CORP	UNP US	纽约证券交易所	美国	31,369.00	51,666,333.03
STRYKER CORP	STRYKER CORP	SYK US	纽约证券交易所	美国	18,060.00	51,148,753.94
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	COF US	纽约证券交易所	美国	33,552.00	51,101,834.47
PALO ALTO NETWORKS INC	PALO ALTO NETWORKS INC	PANW US	纳斯达克交易所	美国	34,766.00	50,929,961.64
COMCAST CORP-CLASS A	COMCAST CORP-CLASS A	CMCSA US	纳斯达克交易所	美国	195,510.00	49,950,934.75
DEERE & CO	DEERE & CO	DE US	纽约证券交易所	美国	13,266.00	48,289,255.03
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	CRWD US	纳斯达克交易所	美国	13,075.00	47,670,751.35
DANAHER CORP	DANAHER CORP	DHR US	纽约证券交易所	美国	33,445.00	47,294,903.73
AUTOMATIC DATA PROCESSING	AUTOMATIC DATA PROCESSING	ADP US	纳斯达克交易所	美国	21,312.00	47,050,763.26
LAM RESEARCH CORP	LAM RESEARCH CORP	LRCX US	纳斯达克交易所	美国	67,149.00	46,790,640.21
LOWE'S COS INC	LOWE'S COS INC	LOW US	纽约证券交易所	美国	29,382.00	46,666,801.30
AMPHENOL CORP-CL A	AMPHENOL CORP-CL A	APH US	纽约证券交易所	美国	63,525.00	44,906,568.92
KLA CORP	KLA CORP	KLAC US	纳斯达克交易所	美国	6,946.00	44,539,449.35
ANALOG DEVICES INC	ANALOG DEVICES INC	ADI US	纳斯达克交易所	美国	26,042.00	44,372,702.65
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	VRTX US	纳斯达克交易所	美国	13,486.00	42,979,999.60
T-MOBILE US INC	T-MOBILE US INC	TMUS US	纳斯达克交易所	美国	25,034.00	42,698,191.57
CONOCOPHILLIPS	CONOCOPHILLIPS	COP US	纽约证券交易所	美国	66,293.00	42,587,469.36
MEDTRONIC PLC	MEDTRONIC PLC	MDT US	纽约证券交易所	美国	67,313.00	42,004,332.60
BLACKSTONE INC	BLACKSTONE INC	BX US	纽约证券交易所	美国	38,303.00	41,014,216.11
CHUBB LTD	CHUBB LTD	CB US	纽约证券交易所	美国	19,553.00	40,552,718.49
MARSH & MCLENNAN COS	MARSH & MCLENNAN COS	MMC US	纽约证券交易所	美国	25,864.00	40,481,202.65
ARISTA NETWORKS INC	ARISTA NETWORKS INC	ANET US	纽约证券交易所	美国	54,096.00	39,619,713.82
INTERCONTINENTAL	INTERCONTINENTAL	ICE US	纽约证券交易	美国	30,128.00	39,569,763.97

EXCHANGE IN	EXCHANGE IN		所			
STARBUCKS CORP	STARBUCKS CORP	SBUX US	纳斯达克交易所	美国	59,643.00	39,122,379.60
AMERICAN TOWER CORP	AMERICAN TOWER CORP	AMT US	纽约证券交易所	美国	24,569.00	38,872,918.78
CONSTELLATION ENERGY	CONSTELLATION ENERGY	CEG US	纳斯达克交易所	美国	16,456.00	38,021,748.22
SOUTHERN CO/THE	SOUTHERN CO/THE	SO US	纽约证券交易所	美国	57,696.00	37,927,864.04
CME GROUP INC	CME GROUP INC	CME US	纳斯达克交易所	美国	18,929.00	37,347,926.52
ALTRIA GROUP INC	ALTRIA GROUP INC	MO US	纽约证券交易所	美国	88,457.00	37,126,174.07
INTEL CORP	INTEL CORP	INTC US	纳斯达克交易所	美国	228,989.00	36,718,990.68
PROLOGIS INC	PROLOGIS INC	PLD US	纽约证券交易所	美国	48,740.00	36,677,436.44
TRANE TECHNOLOGIES PLC	TRANE TECHNOLOGIES PLC	TT US	纽约证券交易所	美国	11,712.00	36,673,120.66
FISERV INC	FISERV INC	FI US	纽约证券交易所	美国	29,105.00	35,921,805.05
WELLTOWER INC	WELLTOWER INC	WELL US	纽约证券交易所	美国	32,635.00	35,914,542.65
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMJ US	纽约证券交易所	美国	106,926.00	35,432,239.06
DUKE ENERGY CORP	DUKE ENERGY CORP	DUK US	纽约证券交易所	美国	40,813.00	34,475,345.13
MCKESSON CORP	MCKESSON CORP	MCK US	纽约证券交易所	美国	6,570.00	34,464,110.43
KKR & CO INC	KKR & CO INC	KKR US	纽约证券交易所	美国	35,510.00	33,816,476.89
PARKER HANNIFIN CORP	PARKER HANNIFIN CORP	PH US	纽约证券交易所	美国	6,708.00	33,540,451.73
THE CIGNA GROUP	THE CIGNA GROUP	CI US	纽约证券交易所	美国	14,024.00	33,187,655.59
ELEVANCE HEALTH INC	ELEVANCE HEALTH INC	ELV US	纽约证券交易所	美国	11,864.00	33,034,229.04
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	MDLZ US	纳斯达克交易所	美国	67,973.00	32,815,731.96
CVS HEALTH CORP	CVS HEALTH CORP	CVS US	纽约证券交易所	美国	66,418.00	32,797,223.54
TRANSDIGM GROUP INC	TRANSDIGM GROUP INC	TDG US	纽约证券交易所	美国	2,946.00	32,069,135.22
DOORDASH INC - A	DOORDASH INC - A	DASH US	纳斯达克交易所	美国	18,006.00	31,774,584.75
CADENCE DESIGN SYS INC	CADENCE DESIGN SYS INC	CDNS US	纳斯达克交易所	美国	14,345.00	31,643,959.55
WASTE MANAGEMENT INC	WASTE MANAGEMENT INC	WM US	纽约证券交易所	美国	19,231.00	31,500,971.31
NIKE INC -CL B	NIKE INC -CL B	NKE US	纽约证券交易所	美国	61,820.00	31,438,372.08

			所			
ARTHUR J GALLAGHER & CO	ARTHUR J GALLAGHER & CO	AJG US	纽约证券交易所	美国	13,443.00	30,806,127.10
3M CO	3M CO	MMM US	纽约证券交易所	美国	28,258.00	30,796,282.31
SYNOPSYS INC	SYNOPSYS INC	SNPS US	纳斯达克交易所	美国	8,117.00	29,789,966.70
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	SHW US	纽约证券交易所	美国	12,106.00	29,756,268.30
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	RCL US	纽约证券交易所	美国	13,122.00	29,414,852.62
EQUINIX INC	EQUINIX INC	EQIX US	纳斯达克交易所	美国	5,135.00	29,241,008.67
MOODY'S CORP	MOODY'S CORP	MCO US	纽约证券交易所	美国	8,120.00	29,156,339.25
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	ORLY US	纳斯达克交易所	美国	44,880.00	28,956,783.26
AON PLC-CLASS A	AON PLC-CLASS A	AON US	纽约证券交易所	美国	11,333.00	28,943,372.91
WILLIAMS COS INC	WILLIAMS COS INC	WMB US	纽约证券交易所	美国	64,098.00	28,820,490.53
CINTAS CORP	CINTAS CORP	CTAS US	纳斯达克交易所	美国	18,018.00	28,746,587.15
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	CMG US	纽约证券交易所	美国	70,757.00	28,441,157.53
HOWMET AEROSPACE INC	HOWMET AEROSPACE INC	HWM US	纽约证券交易所	美国	21,199.00	28,246,188.19
EMERSON ELECTRIC CO	EMERSON ELECTRIC CO	EMR US	纽约证券交易所	美国	29,533.00	28,187,953.12
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	COIN US	纳斯达克交易所	美国	11,104.00	27,860,132.70
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	UPS US	纽约证券交易所	美国	38,525.00	27,837,744.46
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	PNC US	纽约证券交易所	美国	20,765.00	27,711,021.49
COLGATE-PALMOLIVE CO	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL US	纽约证券交易所	美国	42,539.00	27,680,839.40
GENERAL DYNAMICS CORP	GENERAL DYNAMICS CORP	GD US	纽约证券交易所	美国	13,234.00	27,630,967.87
PAYPAL HOLDINGS INC	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	51,054.00	27,162,114.22
US BANCORP	US BANCORP	USB US	纽约证券交易所	美国	81,808.00	26,499,791.38
MOTOROLA SOLUTIONS INC	MOTOROLA SOLUTIONS INC	MSI US	纽约证券交易所	美国	8,771.00	26,399,876.37
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	JCI US	纽约证券交易所	美国	34,554.00	26,125,979.89
ZOETIS INC	ZOETIS INC	ZTS US	纽约证券交易所	美国	23,371.00	26,091,002.75
ECOLAB INC	ECOLAB INC	ECL US	纽约证券交易所	美国	13,243.00	25,543,273.00

			所			
FORTINET INC	FORTINET INC	FTNT US	纳斯达克交易所	美国	33,360.00	25,247,087.93
HCA HEALTHCARE INC	HCA HEALTHCARE INC	HCA US	纽约证券交易所	美国	9,097.00	24,948,155.53
AUTODESK INC	AUTODESK INC	ADSK US	纳斯达克交易所	美国	11,234.00	24,895,530.37
ILLINOIS TOOL WORKS	ILLINOIS TOOL WORKS	ITW US	纽约证券交易所	美国	14,002.00	24,783,033.83
VISTRA CORP	VISTRA CORP	VST US	纽约证券交易所	美国	17,821.00	24,725,002.71
EOG RESOURCES INC	EOG RESOURCES INC	EOG US	纽约证券交易所	美国	28,668.00	24,546,692.51
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	BK US	纽约证券交易所	美国	37,549.00	24,490,210.51
NEWMONT CORP	NEWMONT CORP	NEM US	纽约证券交易所	美国	58,448.00	24,376,324.98
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	APO US	纽约证券交易所	美国	23,709.00	24,078,637.11
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	HLT US	纽约证券交易所	美国	12,480.00	23,794,636.62
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	APD US	纽约证券交易所	美国	11,679.00	23,581,707.93
FREEMPORT-MCMORAN INC	FREEMPORT-MCMORAN INC	FCX US	纽约证券交易所	美国	75,446.00	23,412,803.34
AUTOZONE INC	AUTOZONE INC	AZO US	纽约证券交易所	美国	879.00	23,358,870.95
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	MAR US	纳斯达克交易所	美国	11,931.00	23,334,663.00
CSX CORP	CSX CORP	CSX US	纳斯达克交易所	美国	98,676.00	23,049,245.10
AXON ENTERPRISE INC	AXON ENTERPRISE INC	AXON US	纳斯达克交易所	美国	3,884.00	23,020,045.75
ROPER TECHNOLOGIES INC	ROPER TECHNOLOGIES INC	ROP US	纳斯达克交易所	美国	5,647.00	22,914,288.31
TRAVELERS COS INC/THE	TRAVELERS COS INC/THE	TRV US	纽约证券交易所	美国	11,896.00	22,783,360.10
CARRIER GLOBAL CORP	CARRIER GLOBAL CORP	CARR US	纽约证券交易所	美国	41,866.00	21,935,185.54
NORFOLK SOUTHERN CORP	NORFOLK SOUTHERN CORP	NSC US	纽约证券交易所	美国	11,836.00	21,688,130.66
AIRBNB INC-CLASS A	AIRBNB INC-CLASS A	ABNB US	纳斯达克交易所	美国	22,659.00	21,466,436.98
KINDER MORGAN INC	KINDER MORGAN INC	KMI US	纽约证券交易所	美国	101,520.00	21,366,187.52
TRUIST FINANCIAL CORP	TRUIST FINANCIAL CORP	TFC US	纽约证券交易所	美国	68,762.00	21,161,382.69
QUANTA SERVICES INC	QUANTA SERVICES INC	PWR US	纽约证券交易所	美国	7,785.00	21,070,285.35
AMERICAN ELECTRIC POWER	AMERICAN ELECTRIC POWER	AEP US	纳斯达克交易所	美国	28,043.00	20,829,676.79

			所			
DIGITAL REALTY TRUST INC	DIGITAL REALTY TRUST INC	DLR US	纽约证券交易所	美国	16,635.00	20,759,793.61
NXP SEMICONDUCTORS NV	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI US	纳斯达克交易所	美国	13,266.00	20,749,118.63
REGENERON PHARMACEUTICALS	REGENERON PHARMACEUTICALS	REGN US	纳斯达克交易所	美国	5,453.00	20,493,819.05
ALLSTATE CORP	ALLSTATE CORP	ALL US	纽约证券交易所	美国	13,914.00	20,051,434.32
REALTY INCOME CORP	REALTY INCOME CORP	O US	纽约证券交易所	美国	47,416.00	19,554,687.75
WORKDAY INC-CLASS A	WORKDAY INC-CLASS A	WDAY US	纳斯达克交易所	美国	11,373.00	19,539,541.87
CENCORA INC	CENCORA INC	COR US	纽约证券交易所	美国	9,056.00	19,438,760.24
AFLAC INC	AFLAC INC	AFL US	纽约证券交易所	美国	25,543.00	19,283,584.55
MARATHON PETROLEUM CORP	MARATHON PETROLEUM CORP	MPC US	纽约证券交易所	美国	16,128.00	19,178,047.46
ONEOK INC	ONEOK INC	OKE US	纽约证券交易所	美国	32,803.00	19,168,646.86
CORTEVA INC	CORTEVA INC	CTVA US	纽约证券交易所	美国	35,830.00	19,116,396.31
AMERIPRISE FINANCIAL INC	AMERIPRISE FINANCIAL INC	AMP US	纽约证券交易所	美国	5,000.00	19,103,797.89
REPUBLIC SERVICES INC	REPUBLIC SERVICES INC	RSG US	纽约证券交易所	美国	10,668.00	18,833,098.87
FEDEX CORP	FEDEX CORP	FDX US	纽约证券交易所	美国	11,572.00	18,830,205.65
TE CONNECTIVITY PLC	TE CONNECTIVITY PLC	TEL US	纽约证券交易所	美国	15,571.00	18,801,064.78
PACCAR INC	PACCAR INC	PCAR US	纳斯达克交易所	美国	27,558.00	18,753,122.99
SEMPRA	SEMPRA	SRE US	纽约证券交易所	美国	34,259.00	18,582,325.59
BECTON DICKINSON AND CO	BECTON DICKINSON AND CO	BDX US	纽约证券交易所	美国	15,051.00	18,558,919.26
SIMON PROPERTY GROUP INC	SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG US	纽约证券交易所	美国	16,118.00	18,548,860.93
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	纽约证券交易所	美国	30,258.00	18,539,215.00
UNITED RENTALS INC	UNITED RENTALS INC	URI US	纽约证券交易所	美国	3,412.00	18,401,902.89
PHILLIPS 66	PHILLIPS 66	PSX US	纽约证券交易所	美国	21,396.00	18,272,632.89
DOMINION ENERGY INC	DOMINION ENERGY INC	D US	纽约证券交易所	美国	44,784.00	18,119,788.76
FASTENAL CO	FASTENAL CO	FAST US	纳斯达克交易所	美国	60,211.00	18,103,111.51
GENERAL MOTORS CO	GENERAL MOTORS CO	GM US	纽约证券交易所	美国	50,502.00	17,790,577.20

			所			
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	LHX US	纽约证券交易所	美国	9,811.00	17,617,251.89
PAYCHEX INC	PAYCHEX INC	PAYX US	纳斯达克交易所	美国	16,824.00	17,518,662.22
PUBLIC STORAGE	PUBLIC STORAGE	PSA US	纽约证券交易所	美国	8,288.00	17,408,748.50
SCHLUMBERGER LTD	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	纽约证券交易所	美国	71,445.00	17,286,880.78
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	EW US	纽约证券交易所	美国	30,786.00	17,236,284.23
WW GRAINGER INC	WW GRAINGER INC	GWV US	纽约证券交易所	美国	2,297.00	17,104,982.76
METLIFE INC	METLIFE INC	MET US	纽约证券交易所	美国	29,609.00	17,045,741.77
CUMMINS INC	CUMMINS INC	CMI US	纽约证券交易所	美国	7,228.00	16,945,623.16
KEURIG DR PEPPER INC	KEURIG DR PEPPER INC	KDP US	纳斯达克交易所	美国	71,321.00	16,879,064.36
TARGET CORP	TARGET CORP	TGT US	纽约证券交易所	美国	23,849.00	16,842,065.78
CROWN CASTLE INC	CROWN CASTLE INC	CCI US	纽约证券交易所	美国	22,864.00	16,814,253.69
MSCI INC	MSCI INC	MSCI US	纽约证券交易所	美国	4,063.00	16,774,708.87
FAIR ISAAC CORP	FAIR ISAAC CORP	FICO US	纽约证券交易所	美国	1,279.00	16,736,526.47
MONSTER BEVERAGE CORP	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	纳斯达克交易所	美国	36,861.00	16,529,014.40
KROGER CO	KROGER CO	KR US	纽约证券交易所	美国	32,153.00	16,510,127.51
EXELON CORP	EXELON CORP	EXC US	纳斯达克交易所	美国	52,996.00	16,472,556.53
VERISK ANALYTICS INC	VERISK ANALYTICS INC	VRSK US	纳斯达克交易所	美国	7,346.00	16,380,874.05
IDEXX LABORATORIES INC	IDEXX LABORATORIES INC	IDXX US	纳斯达克交易所	美国	4,225.00	16,221,648.89
COPART INC	COPART INC	CPRT US	纳斯达克交易所	美国	46,161.00	16,215,089.96
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	FIS US	纽约证券交易所	美国	27,594.00	16,081,276.19
KIMBERLY-CLARK CORP	KIMBERLY-CLARK CORP	KMB US	纳斯达克交易所	美国	17,419.00	16,075,763.64
FORD MOTOR CO	FORD MOTOR CO	F US	纽约证券交易所	美国	205,034.00	15,925,156.86
VALERO ENERGY CORP	VALERO ENERGY CORP	VLO US	纽约证券交易所	美国	16,450.00	15,829,160.75
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	PEG US	纽约证券交易所	美国	26,189.00	15,781,778.12
ROSS STORES INC	ROSS STORES INC	ROST US	纳斯达克交易	美国	17,272.00	15,774,417.22

			所			
AMETEK INC	AMETEK INC	AME US	纽约证券交易所	美国	12,128.00	15,710,856.86
YUM! BRANDS INC	YUM! BRANDS INC	YUM US	纽约证券交易所	美国	14,596.00	15,482,872.64
CBRE GROUP INC - A	CBRE GROUP INC - A	CBRE US	纽约证券交易所	美国	15,420.00	15,467,231.95
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	TTWO US	纳斯达克交易所	美国	8,895.00	15,463,655.16
CORNING INC	CORNING INC	GLW US	纽约证券交易所	美国	40,473.00	15,236,901.64
KENVUE INC	KENVUE INC	KVUE US	纽约证券交易所	美国	100,884.00	15,115,399.08
CARDINAL HEALTH INC	CARDINAL HEALTH INC	CAH US	纽约证券交易所	美国	12,531.00	15,070,341.99
XCEL ENERGY INC	XCEL ENERGY INC	XEL US	纳斯达克交易所	美国	30,273.00	14,758,107.48
OTIS WORLDWIDE CORP	OTIS WORLDWIDE CORP	OTIS US	纽约证券交易所	美国	20,725.00	14,690,803.75
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	纳斯达克交易所	美国	5,013.00	14,670,580.92
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	25,890.00	14,461,780.10
HESS CORP	HESS CORP	HES US	美国证券交易所	美国	14,555.00	14,434,956.82
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	PRU US	纽约证券交易所	美国	18,592.00	14,299,478.74
BAKER HUGHES CO	BAKER HUGHES CO	BKR US	纳斯达克交易所	美国	52,024.00	14,278,544.71
RESMED INC	RESMED INC	RMD US	纽约证券交易所	美国	7,704.00	14,228,662.44
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	MCHP US	纳斯达克交易所	美国	28,237.00	14,224,408.01
TARGA RESOURCES CORP	TARGA RESOURCES CORP	TRGP US	纽约证券交易所	美国	11,395.00	14,200,096.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	ROCKWELL AUTOMATION INC	ROK US	纽约证券交易所	美国	5,921.00	14,079,381.07
ENTERGY CORP	ENTERGY CORP	ETR US	纽约证券交易所	美国	23,439.00	13,946,740.16
NASDAQ INC	NASDAQ INC	NDAQ US	纳斯达克交易所	美国	21,700.00	13,890,647.66
DELL TECHNOLOGIES -C	DELL TECHNOLOGIES -C	DELL US	纽约证券交易所	美国	15,737.00	13,811,489.29
SYSCO CORP	SYSCO CORP	SYU US	纽约证券交易所	美国	25,444.00	13,795,542.51
ELECTRONIC ARTS INC	ELECTRONIC ARTS INC	EA US	纳斯达克交易所	美国	11,981.00	13,697,019.70
CONSOLIDATED EDISON INC	CONSOLIDATED EDISON INC	ED US	纽约证券交易所	美国	18,918.00	13,590,038.72
HARTFORD INSURANCE	HARTFORD INSURANCE	HIG US	纽约证券交易所	美国	14,915.00	13,545,975.75

GROUP INC	GROUP INC		所			
WABTEC CORP	WABTEC CORP	WAB US	纽约证券交易所	美国	8,989.00	13,471,391.01
DR HORTON INC	DR HORTON INC	DHI US	纽约证券交易所	美国	14,516.00	13,396,623.51
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	MPWR US	纳斯达克交易所	美国	2,514.00	13,162,441.37
EQT CORP	EQT CORP	EQT US	纽约证券交易所	美国	31,436.00	13,124,201.56
VULCAN MATERIALS CO	VULCAN MATERIALS CO	VMC US	纽约证券交易所	美国	6,934.00	12,946,513.36
VICI PROPERTIES INC	VICI PROPERTIES INC	VICI US	纽约证券交易所	美国	55,473.00	12,945,753.98
EBAY INC	EBAY INC	EBAY US	纳斯达克交易所	美国	24,204.00	12,901,442.53
DEXCOM INC	DEXCOM INC	DXCM US	纳斯达克交易所	美国	20,598.00	12,871,158.65
ARCH CAPITAL GROUP LTD	ARCH CAPITAL GROUP LTD	ACGL US	纳斯达克交易所	美国	19,592.00	12,769,880.06
COSTAR GROUP INC	COSTAR GROUP INC	CSGP US	纳斯达克交易所	美国	22,161.00	12,754,795.46
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	GEHC US	纳斯达克交易所	美国	24,030.00	12,741,607.17
AGILENT TECHNOLOGIES INC	AGILENT TECHNOLOGIES INC	A US	纽约证券交易所	美国	14,971.00	12,647,296.98
INGERSOLL-RAND INC	INGERSOLL-RAND INC	IR US	纽约证券交易所	美国	21,192.00	12,618,826.16
WEC ENERGY GROUP INC	WEC ENERGY GROUP INC	WEC US	纽约证券交易所	美国	16,763.00	12,503,959.55
MARTIN MARIETTA MATERIALS	MARTIN MARIETTA MATERIALS	MLM US	纽约证券交易所	美国	3,164.00	12,433,839.92
EQUIFAX INC	EQUIFAX INC	EFX US	纽约证券交易所	美国	6,522.00	12,109,567.51
GARMIN LTD	GARMIN LTD	GRMN US	纽约证券交易所	美国	8,090.00	12,087,616.81
DELTA AIR LINES INC	DELTA AIR LINES INC	DAL US	纽约证券交易所	美国	34,277.00	12,067,558.84
XYLEM INC	XYLEM INC	XYL US	纽约证券交易所	美国	12,785.00	11,839,376.60
NRG ENERGY INC	NRG ENERGY INC	NRG US	纽约证券交易所	美国	10,261.00	11,795,306.68
EXTRA SPACE STORAGE INC	EXTRA SPACE STORAGE INC	EXR US	纽约证券交易所	美国	11,148.00	11,766,312.49
M & T BANK CORP	M & T BANK CORP	MTB US	纽约证券交易所	美国	8,430.00	11,706,714.14
GARTNER INC	GARTNER INC	IT US	纽约证券交易所	美国	4,044.00	11,701,917.74
BROWN & BROWN INC	BROWN & BROWN INC	BRO US	纽约证券交易所	美国	14,717.00	11,680,499.99
ANSYS INC	ANSYS INC	ANSS US	美国证券交易	美国	4,622.00	11,620,833.42

			所			
P G & E CORP	P G & E CORP	PCG US	纽约证券交易所	美国	115,452.00	11,521,057.14
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	STX US	纳斯达克交易所	美国	11,140.00	11,509,856.22
WILLIS TOWERS WATSON PLC	WILLIS TOWERS WATSON PLC	WTW US	纳斯达克交易所	美国	5,203.00	11,415,959.01
STATE STREET CORP	STATE STREET CORP	STT US	纽约证券交易所	美国	14,986.00	11,408,025.42
IRON MOUNTAIN INC	IRON MOUNTAIN INC	IRM US	纽约证券交易所	美国	15,496.00	11,378,055.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	OLD DOMINION FREIGHT LINE	ODFL US	纳斯达克交易所	美国	9,762.00	11,341,889.69
NUCOR CORP	NUCOR CORP	NUE US	纽约证券交易所	美国	12,108.00	11,228,051.63
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	纽约证券交易所	美国	37,206.00	11,189,064.04
HUMANA INC	HUMANA INC	HUM US	纽约证券交易所	美国	6,340.00	11,095,852.91
CARNIVAL CORP	CARNIVAL CORP	CCL US	纽约证券交易所	美国	55,118.00	11,095,244.14
AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVALONBAY COMMUNITIES INC	AVB US	纽约证券交易所	美国	7,464.00	10,873,369.35
DUPONT DE NEMOURS INC	DUPONT DE NEMOURS INC	DD US	纽约证券交易所	美国	21,985.00	10,794,819.10
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	BR US	纽约证券交易所	美国	6,168.00	10,730,806.11
VENTAS INC	VENTAS INC	VTR US	纽约证券交易所	美国	23,695.00	10,711,694.16
GENERAL MILLS INC	GENERAL MILLS INC	GIS US	纽约证券交易所	美国	28,769.00	10,670,050.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	KEYS US	纽约证券交易所	美国	9,078.00	10,648,568.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	TRACTOR SUPPLY COMPANY	TSCO US	纳斯达克交易所	美国	27,860.00	10,524,374.71
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	RJF US	纽约证券交易所	美国	9,534.00	10,467,516.67
DTE ENERGY COMPANY	DTE ENERGY COMPANY	DTE US	纽约证券交易所	美国	10,899.00	10,334,738.67
FIFTH THIRD BANCORP	FIFTH THIRD BANCORP	FITB US	纳斯达克交易所	美国	35,007.00	10,307,223.66
AMERICAN WATER WORKS CO INC	AMERICAN WATER WORKS CO INC	AWK US	纽约证券交易所	美国	10,244.00	10,201,311.67
CENTENE CORP	CENTENE CORP	CNC US	纽约证券交易所	美国	26,122.00	10,150,194.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	HPE US	纽约证券交易所	美国	68,958.00	10,094,994.01
LULULEMON ATHLETICA INC	LULULEMON ATHLETICA INC	LULU US	纳斯达克交易所	美国	5,803.00	9,869,395.31
UNITED AIRLINES	UNITED AIRLINES	UAL US	纳斯达克交易	美国	17,147.00	9,774,464.19

HOLDINGS INC	HOLDINGS INC		所			
AMEREN CORPORATION	AMEREN CORPORATION	AEE US	纽约证券交易所	美国	14,196.00	9,759,919.56
IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA HOLDINGS INC	IQV US	纽约证券交易所	美国	8,631.00	9,736,836.29
PPG INDUSTRIES INC	PPG INDUSTRIES INC	PPG US	纽约证券交易所	美国	11,922.00	9,707,974.32
WARNER BROS DISCOVERY INC	WARNER BROS DISCOVERY INC	WBD US	纳斯达克交易所	美国	118,190.00	9,696,018.74
DIAMONDBACK ENERGY INC	DIAMONDBACK ENERGY INC	FANG US	纳斯达克交易所	美国	9,819.00	9,657,886.31
LENNAR CORP-A	LENNAR CORP-A	LEN US	纽约证券交易所	美国	12,191.00	9,652,989.19
GODADDY INC - CLASS A	GODADDY INC - CLASS A	GDDY US	纽约证券交易所	美国	7,480.00	9,641,551.82
TYLER TECHNOLOGIES INC	TYLER TECHNOLOGIES INC	TYL US	纽约证券交易所	美国	2,264.00	9,608,199.62
DARDEN RESTAURANTS INC	DARDEN RESTAURANTS INC	DRI US	纽约证券交易所	美国	6,145.00	9,588,412.46
SYNCHRONY FINANCIAL	SYNCHRONY FINANCIAL	SYF US	纽约证券交易所	美国	19,995.00	9,552,910.46
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM US	纽约证券交易所	美国	25,231.00	9,533,051.64
EXPAND ENERGY CORP	EXPAND ENERGY CORP	EXE US	纳斯达克交易所	美国	11,371.00	9,518,967.52
SBA COMMUNICATIONS CORP	SBA COMMUNICATIONS CORP	SBAC US	纳斯达克交易所	美国	5,642.00	9,484,910.77
SUPER MICRO COMPUTER INC	SUPER MICRO COMPUTER INC	SMCI US	纳斯达克交易所	美国	26,950.00	9,455,218.47
DOLLAR GENERAL CORP	DOLLAR GENERAL CORP	DG US	纽约证券交易所	美国	11,544.00	9,452,234.91
DOVER CORP	DOVER CORP	DOV US	纽约证券交易所	美国	7,202.00	9,446,649.34
PPL CORP	PPL CORP	PPL US	纽约证券交易所	美国	38,843.00	9,423,504.23
VERALTO CORP	VERALTO CORP	VLTO US	纽约证券交易所	美国	13,018.00	9,407,596.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	CONSTELLATION BRANDS INC-A	STZ US	纽约证券交易所	美国	8,038.00	9,360,741.70
INTERNATIONAL PAPER CO	INTERNATIONAL PAPER CO	IP US	纽约证券交易所	美国	27,712.00	9,290,094.34
NORTHERN TRUST CORP	NORTHERN TRUST CORP	NTRS US	纳斯达克交易所	美国	10,215.00	9,271,531.30
HERSHEY CO/THE	HERSHEY CO/THE	HSY US	纽约证券交易所	美国	7,768.00	9,228,148.40
ATMOS ENERGY CORP	ATMOS ENERGY CORP	ATO US	纽约证券交易所	美国	8,337.00	9,197,477.16
CBOE GLOBAL MARKETS INC	CBOE GLOBAL MARKETS INC	CBOE US	巴兹全球市场	美国	5,506.00	9,192,030.83
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	MTD US	纽约证券交易所	美国	1,091.00	9,174,601.50

HUNTINGTON BANCSHARES INC	HUNTINGTON BANCSHARES INC	HBAN US	纳斯达克交易所	美国	76,431.00	9,170,048.91
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	TDY US	纽约证券交易所	美国	2,462.00	9,029,193.87
CENTERPOINT ENERGY INC	CENTERPOINT ENERGY INC	CNP US	纽约证券交易所	美国	34,275.00	9,014,563.69
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	LYV US	纽约证券交易所	美国	8,281.00	8,967,933.86
CHURCH & DWIGHT CO INC	CHURCH & DWIGHT CO INC	CHD US	纽约证券交易所	美国	12,925.00	8,892,568.62
STERIS PLC	STERIS PLC	STE US	纽约证券交易所	美国	5,163.00	8,878,495.60
CDW CORP/DE	CDW CORP/DE	CDW US	纳斯达克交易所	美国	6,912.00	8,836,676.63
JABIL INC	JABIL INC	JBL US	纽约证券交易所	美国	5,637.00	8,800,995.45
CORPAY INC	CORPAY INC	CPAY US	纽约证券交易所	美国	3,701.00	8,791,231.98
EVERSOURCE ENERGY	EVERSOURCE ENERGY	ES US	纽约证券交易所	美国	19,295.00	8,787,524.40
VERISIGN INC	VERISIGN INC	VRSN US	纳斯达克交易所	美国	4,239.00	8,763,724.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	CINCINNATI FINANCIAL CORP	CINF US	纳斯达克交易所	美国	8,208.00	8,750,209.91
EQUITY RESIDENTIAL	EQUITY RESIDENTIAL	EQR US	纽约证券交易所	美国	17,961.00	8,677,568.23
HP INC	HP INC	HPQ US	纽约证券交易所	美国	49,508.00	8,668,818.92
WESTERN DIGITAL CORP	WESTERN DIGITAL CORP	WDC US	纳斯达克交易所	美国	18,314.00	8,389,255.40
KRAFT HEINZ CO/THE	KRAFT HEINZ CO/THE	KHC US	纳斯达克交易所	美国	45,356.00	8,383,378.62
INSULET CORP	INSULET CORP	PODD US	纳斯达克交易所	美国	3,696.00	8,312,632.75
WR BERKLEY CORP	WR BERKLEY CORP	WRB US	纽约证券交易所	美国	15,732.00	8,274,124.92
LABCORP HOLDINGS INC	LABCORP HOLDINGS INC	LH US	纽约证券交易所	美国	4,396.00	8,260,981.16
ON SEMICONDUCTOR	ON SEMICONDUCTOR	ON US	纳斯达克交易所	美国	21,937.00	8,230,372.49
HUBBELL INC	HUBBELL INC	HUBB US	纽约证券交易所	美国	2,805.00	8,200,820.93
NETAPP INC	NETAPP INC	NTAP US	纳斯达克交易所	美国	10,679.00	8,145,394.76
SMURFIT WESTROCK PLC	SMURFIT WESTROCK PLC	SW US	纽约证券交易所	美国	26,045.00	8,045,133.55
NVR INC	NVR INC	NVR US	纽约证券交易所	美国	152.00	8,036,389.82
KELLANOVA	KELLANOVA	K US	纽约证券交易所	美国	14,109.00	8,032,584.67

T ROWE PRICE GROUP INC	T ROWE PRICE GROUP INC	TROW US	纳斯达克交易所	美国	11,565.00	7,989,158.67
PULTEGROUP INC	PULTEGROUP INC	PHM US	纽约证券交易所	美国	10,526.00	7,946,561.13
REGIONS FINANCIAL CORP	REGIONS FINANCIAL CORP	RF US	纽约证券交易所	美国	47,190.00	7,945,393.14
ULTA BEAUTY INC	ULTA BEAUTY INC	ULTA US	纳斯达克交易所	美国	2,371.00	7,940,327.85
AMCOR PLC	AMCOR PLC	AMCR US	纽约证券交易所	美国	120,291.00	7,913,648.25
WATERS CORP	WATERS CORP	WAT US	纽约证券交易所	美国	3,123.00	7,803,245.67
CMS ENERGY CORP	CMS ENERGY CORP	CMS US	纽约证券交易所	美国	15,705.00	7,788,860.32
FIRSTENERGY CORP	FIRSTENERGY CORP	FE US	纽约证券交易所	美国	26,986.00	7,777,506.50
PTC INC	PTC INC	PTC US	纳斯达克交易所	美国	6,296.00	7,767,457.83
EXPEDIA GROUP INC	EXPEDIA GROUP INC	EXPE US	纳斯达克交易所	美国	6,384.00	7,708,760.74
DEVON ENERGY CORP	DEVON ENERGY CORP	DVN US	纽约证券交易所	美国	33,728.00	7,680,373.75
LEIDOS HOLDINGS INC	LEIDOS HOLDINGS INC	LDOS US	纽约证券交易所	美国	6,761.00	7,635,472.72
WILLIAMS-SONOMA INC	WILLIAMS-SONOMA INC	WSM US	纽约证券交易所	美国	6,457.00	7,551,464.61
QUEST DIAGNOSTICS INC	QUEST DIAGNOSTICS INC	DGX US	纽约证券交易所	美国	5,864.00	7,540,513.60
TEXAS PACIFIC LAND CORP	TEXAS PACIFIC LAND CORP	TPL US	纽约证券交易所	美国	990.00	7,486,650.72
EDISON INTERNATIONAL	EDISON INTERNATIONAL	EIX US	纽约证券交易所	美国	20,210.00	7,465,245.79
DOLLAR TREE INC	DOLLAR TREE INC	DLTR US	纳斯达克交易所	美国	10,375.00	7,355,747.84
GLOBAL PAYMENTS INC	GLOBAL PAYMENTS INC	GPN US	纽约证券交易所	美国	12,804.00	7,336,363.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	CITIZENS FINANCIAL GROUP	CFG US	纽约证券交易所	美国	22,770.00	7,294,309.16
COTERRA ENERGY INC	COTERRA ENERGY INC	CTRA US	纽约证券交易所	美国	40,099.00	7,285,397.56
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	MKC US	纽约证券交易所	美国	13,257.00	7,195,436.29
NISOURCE INC	NISOURCE INC	NI US	纽约证券交易所	美国	24,716.00	7,137,435.17
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	EL US	纽约证券交易所	美国	12,295.00	7,111,610.95
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	IFF US	纽约证券交易所	美国	13,428.00	7,070,043.82
FOX CORP	FOX CORP - CLASS A	FOXA US	纳斯达克交易所	美国	11,238.00	4,508,325.35

FOX CORP	FOX CORP - CLASS B	FOX US	纳斯达克交易所	美国	6,928.00	2,560,578.53
DOW INC	DOW INC	DOW US	纽约证券交易所	美国	37,148.00	7,041,764.78
INVITATION HOMES INC	INVITATION HOMES INC	INVH US	纽约证券交易所	美国	29,943.00	7,030,678.68
WEYERHAEUSER CO	WEYERHAEUSER CO	WY US	纽约证券交易所	美国	38,088.00	7,004,552.08
SOUTHWEST AIRLINES CO	SOUTHWEST AIRLINES CO	LUV US	纽约证券交易所	美国	29,915.00	6,947,010.40
BIOGEN INC	BIOGEN INC	BIIB US	纳斯达克交易所	美国	7,695.00	6,918,178.78
LENNOX INTERNATIONAL INC	LENNOX INTERNATIONAL INC	LII US	纽约证券交易所	美国	1,678.00	6,885,833.86
ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESSEX PROPERTY TRUST INC	ESS US	纽约证券交易所	美国	3,385.00	6,867,309.41
TAPESTRY INC	TAPESTRY INC	TPR US	纽约证券交易所	美国	10,907.00	6,856,103.84
TRIMBLE INC	TRIMBLE INC	TRMB US	纳斯达克交易所	美国	12,524.00	6,811,934.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	ZBH US	纽约证券交易所	美国	10,398.00	6,789,227.55
FIRST SOLAR INC	FIRST SOLAR INC	FSLR US	纳斯达克交易所	美国	5,631.00	6,672,930.08
FORTIVE CORP	FORTIVE CORP	FTV US	纽约证券交易所	美国	17,842.00	6,658,238.63
STEEL DYNAMICS INC	STEEL DYNAMICS INC	STLD US	纳斯达克交易所	美国	7,247.00	6,640,950.68
HALLIBURTON CO	HALLIBURTON CO	HAL US	纽约证券交易所	美国	45,175.00	6,590,683.21
MID-AMERICA APARTMENT COMM	MID-AMERICA APARTMENT COMM	MAA US	纽约证券交易所	美国	6,146.00	6,511,959.80
KEYCORP	KEYCORP	KEY US	纽约证券交易所	美国	51,839.00	6,464,469.07
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	FDS US	纽约证券交易所	美国	1,992.00	6,378,182.03
F5 INC	F5 INC	FFIV US	纳斯达克交易所	美国	3,016.00	6,354,468.16
PENTAIR PLC	PENTAIR PLC	PNR US	纽约证券交易所	美国	8,641.00	6,350,287.11
GENUINE PARTS CO	GENUINE PARTS CO	GPC US	纽约证券交易所	美国	7,290.00	6,330,707.19
PACKAGING CORP OF AMERICA	PACKAGING CORP OF AMERICA	PKG US	纽约证券交易所	美国	4,692.00	6,329,687.09
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	PFG US	纳斯达克交易所	美国	10,827.00	6,156,314.46
SNAP-ON INC	SNAP-ON INC	SNA US	纽约证券交易所	美国	2,746.00	6,117,025.70
MOLINA HEALTHCARE INC	MOLINA HEALTHCARE INC	MOH US	纽约证券交易所	美国	2,848.00	6,073,493.69

GEN DIGITAL INC	GEN DIGITAL INC	GEN US	纳斯达克交易所	美国	28,652.00	6,030,181.29
TYSON FOODS INC-CL A	TYSON FOODS INC-CL A	TSN US	纽约证券交易所	美国	15,033.00	6,019,996.18
LOEWS CORP	LOEWS CORP	L US	纽约证券交易所	美国	9,136.00	5,994,652.87
ROLLINS INC	ROLLINS INC	ROL US	纽约证券交易所	美国	14,761.00	5,961,793.90
EVERGY INC	EVERGY INC	EVRG US	纳斯达克交易所	美国	12,077.00	5,959,302.63
JACOBS SOLUTIONS INC	JACOBS SOLUTIONS INC	J US	纽约证券交易所	美国	6,313.00	5,940,520.18
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	WST US	纽约证券交易所	美国	3,769.00	5,903,391.03
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	ZBRA US	纳斯达克交易所	美国	2,669.00	5,891,619.72
DECKERS OUTDOOR CORP	DECKERS OUTDOOR CORP	DECK US	纽约证券交易所	美国	7,971.00	5,881,297.95
EXPEDITORS INTL WASH INC	EXPEDITORS INTL WASH INC	EXPD US	纽约证券交易所	美国	7,188.00	5,878,849.92
BALL CORP	BALL CORP	BALL US	纽约证券交易所	美国	14,558.00	5,845,413.67
BAXTER INTERNATIONAL INC	BAXTER INTERNATIONAL INC	BAX US	纽约证券交易所	美国	26,948.00	5,841,313.37
ALLIANT ENERGY CORP	ALLIANT ENERGY CORP	LNT US	纳斯达克交易所	美国	13,489.00	5,839,125.63
DOMINO'S PIZZA INC	DOMINO'S PIZZA INC	DPZ US	纳斯达克交易所	美国	1,798.00	5,799,745.96
NEWS CORP	NEWS CORP - CLASS A	NWSA US	纳斯达克交易所	美国	19,788.00	4,209,968.08
NEWS CORP	NEWS CORP - CLASS B	NWS US	纳斯达克交易所	美国	5,851.00	1,437,073.27
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	CF US	纽约证券交易所	美国	8,506.00	5,601,976.75
LYONDELLBASELL INDU-CL A	LYONDELLBASELL INDU-CL A	LYB US	纽约证券交易所	美国	13,495.00	5,589,583.06
APTIV PLC	APTIV PLC	APTIV US	纽约证券交易所	美国	11,430.00	5,581,951.28
CLOROX COMPANY	CLOROX COMPANY	CLX US	纽约证券交易所	美国	6,470.00	5,561,179.17
LAS VEGAS SANDS CORP	LAS VEGAS SANDS CORP	LVS US	纽约证券交易所	美国	17,805.00	5,545,735.56
HOLOGIC INC	HOLOGIC INC	HOLX US	纳斯达克交易所	美国	11,698.00	5,456,583.29
TEXTRON INC	TEXTRON INC	TXT US	纽约证券交易所	美国	9,479.00	5,448,187.90
EVEREST GROUP LTD	EVEREST GROUP LTD	EG US	纽约证券交易所	美国	2,233.00	5,432,554.52
TERADYNE INC	TERADYNE INC	TER US	纳斯达克交易所	美国	8,413.00	5,415,459.14

COOPER COS INC/THE	COOPER COS INC/THE	COO US	纳斯达克交易所	美国	10,499.00	5,348,253.34
KIMCO REALTY CORP	KIMCO REALTY CORP	KIM US	纽约证券交易所	美国	35,530.00	5,346,333.12
OMNICOM GROUP	OMNICOM GROUP	OMC US	纽约证券交易所	美国	10,248.00	5,277,614.28
AVERY DENNISON CORP	AVERY DENNISON CORP	AVY US	纽约证券交易所	美国	4,107.00	5,158,882.96
MASCO CORP	MASCO CORP	MAS US	纽约证券交易所	美国	11,077.00	5,103,478.47
IDEX CORP	IDEX CORP	IEX US	纽约证券交易所	美国	3,966.00	4,984,609.20
JUNIPER NETWORKS INC	JUNIPER NETWORKS INC	JNPR US	美国证券交易所	美国	17,380.00	4,967,949.57
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	JKHY US	纳斯达克交易所	美国	3,823.00	4,930,771.45
BEST BUY CO INC	BEST BUY CO INC	BBY US	纽约证券交易所	美国	10,118.00	4,862,273.88
ALIGN TECHNOLOGY INC	ALIGN TECHNOLOGY INC	ALGN US	纳斯达克交易所	美国	3,577.00	4,848,043.09
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	BLDR US	纽约证券交易所	美国	5,798.00	4,843,284.12
ALLEGION PLC	ALLEGION PLC	ALLE US	纽约证券交易所	美国	4,520.00	4,663,272.39
UDR INC	UDR INC	UDR US	纽约证券交易所	美国	15,834.00	4,628,050.79
TKO GROUP HOLDINGS INC	TKO GROUP HOLDINGS INC	TKO US	纽约证券交易所	美国	3,523.00	4,588,733.11
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	DOC US	纽约证券交易所	美国	36,491.00	4,574,040.52
CAMDEN PROPERTY TRUST	CAMDEN PROPERTY TRUST	CPT US	纽约证券交易所	美国	5,610.00	4,525,601.78
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	AKAM US	纳斯达克交易所	美国	7,675.00	4,382,194.26
REGENCY CENTERS CORP	REGENCY CENTERS CORP	REG US	纳斯达克交易所	美国	8,579.00	4,374,492.82
NORDSON CORP	NORDSON CORP	NDSN US	纳斯达克交易所	美国	2,838.00	4,355,163.81
MOSAIC CO/THE	MOSAIC CO/THE	MOS US	纽约证券交易所	美国	16,658.00	4,350,165.54
REVVITY INC	REVVITY INC	RVTY US	纽约证券交易所	美国	6,194.00	4,288,600.43
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	CHRW US	纳斯达克交易所	美国	6,236.00	4,283,306.79
PAYCOM SOFTWARE INC	PAYCOM SOFTWARE INC	PAYC US	纽约证券交易所	美国	2,560.00	4,240,640.10
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	JBHT US	纳斯达克交易所	美国	4,116.00	4,231,144.94
SKYWORKS SOLUTIONS INC	SKYWORKS SOLUTIONS INC	SWKS US	纳斯达克交易所	美国	7,882.00	4,204,722.83

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	ARE US	纽约证券交易 所	美国	8,087.00	4,204,666.78
POOL CORP	POOL CORP	POOL US	纳斯达克交易 所	美国	1,974.00	4,118,926.15
INCYTE CORP	INCYTE CORP	INCY US	纳斯达克交易 所	美国	8,434.00	4,111,580.57
RALPH LAUREN CORP	RALPH LAUREN CORP	RL US	纽约证券交易 所	美国	2,094.00	4,111,486.93
BUNGE GLOBAL SA	BUNGE GLOBAL SA	BG US	纽约证券交易 所	美国	7,060.00	4,057,328.40
PINNACLE WEST CAPITAL	PINNACLE WEST CAPITAL	PNW US	纽约证券交易 所	美国	6,270.00	4,015,809.24
HOST HOTELS & RESORTS INC	HOST HOTELS & RESORTS INC	HST US	纳斯达克交易 所	美国	36,440.00	4,006,800.14
VIATRIS INC	VIATRIS INC	VTRS US	纳斯达克交易 所	美国	61,872.00	3,955,247.91
SOLVENTUM CORP	SOLVENTUM CORP	SOLV US	纽约证券交易 所	美国	7,267.00	3,945,314.06
STANLEY BLACK & DECKER INC	STANLEY BLACK & DECKER INC	SWK US	纽约证券交易 所	美国	8,125.00	3,940,585.59
JM SMUCKER CO/THE	JM SMUCKER CO/THE	SJM US	纽约证券交易 所	美国	5,588.00	3,928,221.62
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	UHS US	纽约证券交易 所	美国	3,000.00	3,890,341.17
GLOBE LIFE INC	GLOBE LIFE INC	GL US	纽约证券交易 所	美国	4,334.00	3,856,143.54
CARMAX INC	CARMAX INC	KMX US	纽约证券交易 所	美国	8,001.00	3,849,517.18
EPAM SYSTEMS INC	EPAM SYSTEMS INC	EPAM US	纽约证券交易 所	美国	2,979.00	3,770,769.50
ASSURANT INC	ASSURANT INC	AIZ US	纽约证券交易 所	美国	2,663.00	3,764,821.35
BXP INC	BXP INC	BXP US	纽约证券交易 所	美国	7,648.00	3,693,913.19
CONAGRA BRANDS INC	CONAGRA BRANDS INC	CAG US	纽约证券交易 所	美国	25,084.00	3,675,722.62
HASBRO INC	HASBRO INC	HAS US	纳斯达克交易 所	美国	6,914.00	3,653,688.45
LKQ CORP	LKQ CORP	LKQ US	纳斯达克交易 所	美国	13,555.00	3,591,258.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	HII US	纽约证券交易 所	美国	2,059.00	3,559,013.53
MODERNA INC	MODERNA INC	MRNA US	纳斯达克交易 所	美国	17,872.00	3,529,823.19
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	NCLH US	纽约证券交易 所	美国	23,455.00	3,405,112.65
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	IPG US	纽约证券交易 所	美国	19,409.00	3,401,282.23
HENRY SCHEIN INC	HENRY SCHEIN INC	HSIC US	纳斯达克交易 所	美国	6,390.00	3,341,559.31

DAYFORCE INC	DAYFORCE INC	DAY US	纽约证券交易所	美国	8,403.00	3,331,914.32
HORMEL FOODS CORP	HORMEL FOODS CORP	HRL US	纽约证券交易所	美国	15,310.00	3,315,344.52
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	ERIE US	纳斯达克交易所	美国	1,311.00	3,254,598.00
EASTMAN CHEMICAL CO	EASTMAN CHEMICAL CO	EMN US	纽约证券交易所	美国	6,062.00	3,239,903.04
GENERAC HOLDINGS INC	GENERAC HOLDINGS INC	GNRC US	纽约证券交易所	美国	3,104.00	3,182,168.36
MARKETAXESS HOLDINGS INC	MARKETAXESS HOLDINGS INC	MKTX US	纳斯达克交易所	美国	1,968.00	3,146,441.79
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	WBA US	纳斯达克交易所	美国	37,711.00	3,099,117.43
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	TAP US	纽约证券交易所	美国	8,997.00	3,097,280.89
WYNN RESORTS LTD	WYNN RESORTS LTD	WYNN US	纳斯达克交易所	美国	4,619.00	3,097,252.26
BIO-TECHNE CORP	BIO-TECHNE CORP	TECH US	纳斯达克交易所	美国	8,229.00	3,030,822.74
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	PARA US	纳斯达克交易所	美国	31,616.00	2,919,609.24
SMITH (A.O.) CORP	SMITH (A.O.) CORP	AOS US	纽约证券交易所	美国	6,103.00	2,864,683.52
MATCH GROUP INC	MATCH GROUP INC	MTCH US	纳斯达克交易所	美国	12,877.00	2,847,480.12
AES CORP	AES CORP	AES US	纽约证券交易所	美国	37,407.00	2,817,064.01
CHARLES RIVER LABORATORIES	CHARLES RIVER LABORATORIES	CRL US	纽约证券交易所	美国	2,578.00	2,800,157.55
FRANKLIN RESOURCES INC	FRANKLIN RESOURCES INC	BEN US	纽约证券交易所	美国	16,283.00	2,780,039.09
ALBEMARLE CORP	ALBEMARLE CORP	ALB US	纽约证券交易所	美国	6,179.00	2,772,081.45
FEDERAL REALTY INVS TRUST	FEDERAL REALTY INVS TRUST	FRT US	纽约证券交易所	美国	4,075.00	2,770,981.31
LAMB WESTON HOLDINGS INC	LAMB WESTON HOLDINGS INC	LW US	纽约证券交易所	美国	7,415.00	2,752,250.84
MGM RESORTS INTERNATIONAL	MGM RESORTS INTERNATIONAL	MGM US	纽约证券交易所	美国	10,861.00	2,673,807.18
INVESCO LTD	INVESCO LTD	IVZ US	纽约证券交易所	美国	23,510.00	2,654,070.28
APA CORP	APA CORP	APA US	纳斯达克交易所	美国	18,953.00	2,481,531.34
THE CAMPBELL'S COMPANY	THE CAMPBELL'S COMPANY	CPB US	纳斯达克交易所	美国	10,334.00	2,267,394.20
DAVITA INC	DAVITA INC	DVA US	纽约证券交易所	美国	2,178.00	2,220,999.32
CAESARS ENTERTAINMENT INC	CAESARS ENTERTAINMENT INC	CZR US	纳斯达克交易所	美国	10,921.00	2,219,503.81

MOHAWK INDUSTRIES INC	MOHAWK INDUSTRIES INC	MHK US	纽约证券交易所	美国	2,725.00	2,045,133.28
ENPHASE ENERGY INC	ENPHASE ENERGY INC	ENPH US	纳斯达克交易所	美国	6,887.00	1,954,795.68
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	BF/B US	纽约证券交易所	美国	9,560.00	1,841,618.57

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	AAPL US	242,617,507.71	1.53
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	229,851,428.36	1.45
3	NVIDIA CORP	NVDA US	223,737,872.43	1.41
4	AMAZON.COM INC	AMZN US	152,899,731.68	0.97
5	ALPHABET INC	GOOGL US	73,356,544.77	0.46
		GOOG US	58,488,203.21	0.37
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	104,310,789.57	0.66
7	BROADCOM INC	AVGO US	74,645,511.21	0.47
8	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	72,491,522.79	0.46
9	TESLA INC	TSLA US	63,587,215.62	0.40
10	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	51,977,231.05	0.33
11	ELI LILLY & CO	LLY US	49,786,453.43	0.31
12	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	44,364,883.54	0.28
13	EXXON MOBIL CORP	XOM US	35,164,531.65	0.22
14	COSTCO WHOLESALE CORP	COST US	33,744,865.95	0.21
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	33,453,594.56	0.21
16	NETFLIX INC	NFLX US	32,809,592.49	0.21
17	MASTERCARD INC - A	MA US	32,358,814.93	0.20
18	WALMART INC	WMT US	30,849,085.84	0.19
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	29,686,006.80	0.19
20	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	29,302,508.29	0.19

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

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

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	DFS US	18,754,627.00	0.12
2	APPLE INC	AAPL US	5,546,664.92	0.04

3	META PLATFORMS INC-CLASS A	META US	4,640,991.92	0.03
4	NVIDIA CORP	NVDA US	4,508,828.80	0.03
5	MICROSOFT CORP	MSFT US	3,723,296.97	0.02
6	ALPHABET INC	GOOG US	2,033,150.65	0.01
		GOOGL US	1,085,610.98	0.01
7	CHEVRON CORP	CVX US	2,518,598.17	0.02
8	AMAZON.COM INC	AMZN US	2,213,060.47	0.01
9	TELEFLEX INC	TFX US	2,168,951.50	0.01
10	CELANESE CORP	CE US	2,141,834.81	0.01
11	BORGWARNER INC	BWA US	2,124,701.99	0.01
12	RALLIANT CORP	RAL US	2,053,217.84	0.01
13	GENERAL MOTORS CO	GM US	1,912,073.23	0.01
14	EXXON MOBIL CORP	XOM US	1,749,723.21	0.01
15	FMC CORP	FMC US	1,718,673.40	0.01
16	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	1,675,486.11	0.01
17	SANDISK CORP	SNDK US	1,628,960.58	0.01
18	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	1,528,403.30	0.01
19	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	1,492,364.77	0.01
20	KROGER CO	KR US	1,461,631.30	0.01

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	3,790,649,303.03
卖出收入（成交）总额	137,914,008.84

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金
期货投资	S&P500 EMINI FUT Sep25	13,255,150.10	

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，因此此处公允价值实为公允价值变动金。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	30,619,832.84
2	应收清算款	—
3	应收股利	9,046,517.28
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	39,666,350.12

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.10.6 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

机构投资者		个人投资者	
持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,927,156,608.00	20.23%	3,604,795,901.00	37.77%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	UBS AG	194,882,227.00	2
2	法国巴黎银行一自有资金	106,466,092.00	1
3	中国平安财产保险股份有限公司 —传统—普通保险产品	105,115,900.00	1
4	高盛公司有限责任公司	94,883,900.00	1
5	招银理财有限责任公司—招银理 财招智睿和稳健（安盈优选）360 天持有 1 号混合类理	82,674,600.00	0
6	BARCLAYS BANK PLC	80,098,021.00	0
7	广发证券股份有限公司	61,611,754.00	0
8	百瑞信托有限责任公司—百瑞信 托广发骐骥聚盈 ETF 轮动策略 FOF1 号集合资金信托计	44,073,000.00	0
9	翠庭置业（上海）有限公司	43,339,000.00	0
10	招银理财有限责任公司—招银理 财招睿安盈优选（稳进）14 个月 持有增强型固收类理财	42,490,100.00	0
—	中国工商银行股份有限公司—博 时标普 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	3,995,686,061.00	41

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

2. 前十名持有人为除博时标普 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 5 日）基金份额总额	565,043,200.00
--------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	7,928,638,570.00
本报告期基金总申购份额	1,843,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	244,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,527,638,570.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

	股票交易		应支付该券商的佣金	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期
-	3,928,563,311.87	100.00%	878,524.53	
1	-	-	-	

1	-	-	-
---	---	---	---

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

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

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

（3）本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

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

占比例	回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
2	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-18
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250606	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
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-20250603	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
5	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-05-23
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-25
7	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-22
8	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-17
9	博时基金管理有限公司关于运用	上海证券报、基金管理人网站、	2025-04-08

	公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证监会基金电子披露网站	
10	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250408	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
12	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
13	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
14	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
15	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增江海证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
16	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
17	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-24
18	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-22
19	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-21
20	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
21	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
22	关于博时基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-19
23	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-07
24	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-05
25	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-27
26	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-26
27	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-25
28	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-24
29	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-21
30	博时标普 500 交易型开放式指数	上海证券报、基金管理人网站、	2025-02-20

	证券投资基金溢价风险提示公告	证监会基金电子披露网站	
31	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国新证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-20
32	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-19
33	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金恢复申购业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-19
34	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-19
35	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-18
36	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-17
37	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-14
38	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-14
39	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-14
40	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-13
41	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-13
42	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-12
43	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-12
44	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-11
45	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-11
46	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-10
47	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-10
48	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-07
49	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-07
50	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-06
51	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-06
52	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-05
53	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-05

54	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-27
55	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-27
56	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-27
57	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-27
58	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-27
59	博时基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率及修订基金合同及托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-27
60	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-27
61	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-24
62	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-24
63	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-23
64	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-23
65	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-22
66	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-22
67	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-22
68	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-21
69	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-21
70	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-20
71	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-20
72	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-17
73	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-17
74	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停赎回业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-17
75	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-16
76	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-16

[illegible]

§ 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		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	
中国工商银行股份有限公司－博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2025-01-01~2025-06-30	4, 0

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，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

注：1. 申购份额包含红利再投资份额和买入份额，赎回份额包含卖出份额。
2. 份额占比为四舍五入后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日