

博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

2020 年中期报告
2020 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 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 信息披露方式	5
2.5 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	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	27
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	31
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	31
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	31
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	31
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	31
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	31
7.12 投资组合报告附注	32
§8 基金份额持有人信息	32
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	32
8.2 期末上市基金前十名持有人	33
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	33
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	33
§9 开放式基金份额变动	33

§ 10 重大事件揭示	34
10.1 基金份额持有人大会决议	34
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	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	34
10.4 基金投资策略的改变	34
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	34
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	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	34
10.8 其他重大事件	35
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	36
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	36
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	37
§ 12 备查文件目录	37
12.1 备查文件目录	37
12.2 存放地点	37
12.3 查阅方式	37

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时创业板 ETF
场内简称	创业板 BS
基金主代码	159908
交易代码	159908
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2018 年 12 月 10 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	92,229,029.00 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	2011-07-13

注：本基金由原深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金转型而来。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，采用完全复制法，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。
业绩比较基准	创业板指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/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，主要采用完全复制策略，跟踪创业板指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	陆志俊
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	luz.j@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		518040	200336
法定代表人		江向阳	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	12,570,855.22
本期利润	42,277,427.85
加权平均基金份额本期利润	0.5244
本期加权平均净值利润率	29.66%
本期基金份额净值增长率	35.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	69,208,528.60
期末可供分配基金份额利润	0.7504
期末基金资产净值	193,248,396.72
期末基金份额净值	2.0953
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	79.62%

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

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

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

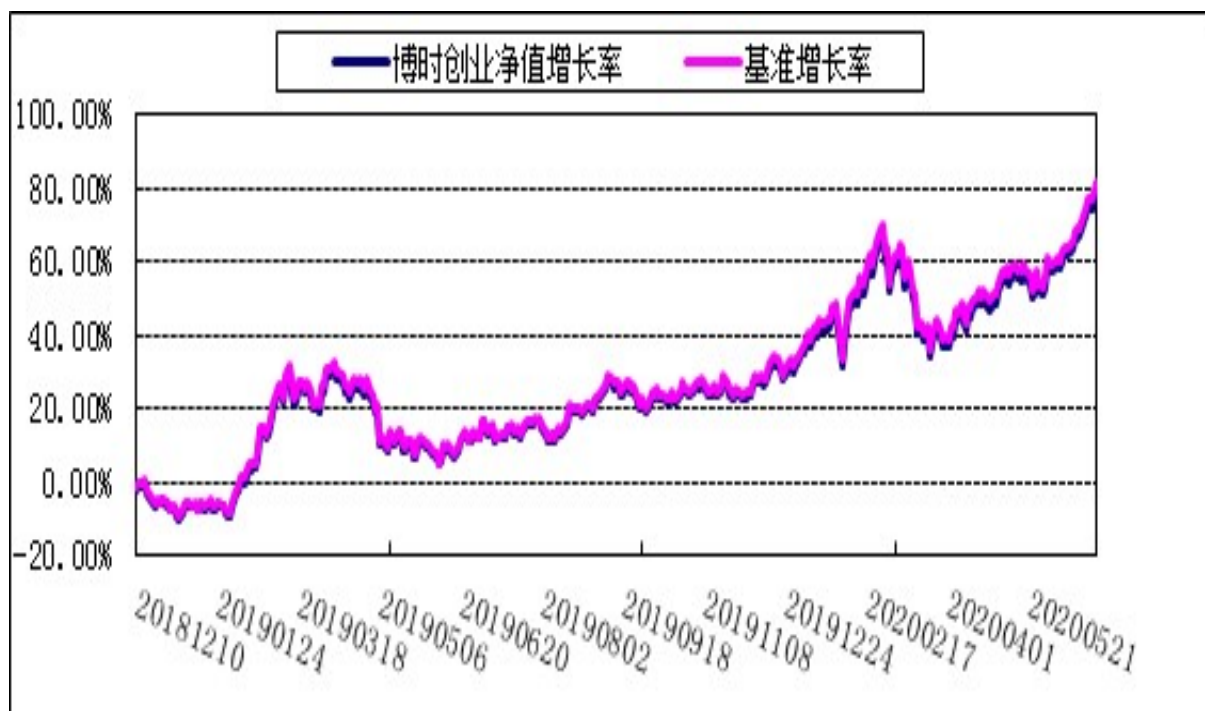
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	16.93%	1.11%	16.85%	1.14%	0.08%	-0.03%
过去三个月	30.55%	1.37%	30.25%	1.39%	0.30%	-0.02%
过去六个月	35.61%	2.02%	35.60%	2.05%	0.01%	-0.03%
过去一年	60.39%	1.65%	61.31%	1.67%	-0.92%	-0.02%
自基金合同生效起至今	79.62%	1.74%	81.82%	1.76%	-2.20%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即创业板指数收益率。

3.2.2 自基金转型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



注：本基金合同于 2018 年 12 月 10 日生效。本基金由原深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金转型而来。

§ 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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 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 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO” (Winner, China CEO

of the Year-Jiang Xiangyang)，博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020年3月31日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020年3月26日，Morningstar 晨星（中国）2020年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类428只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020年度激进债券型基金奖”。

2020年1月10日，新京报“开放 普惠 科技”2019金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019年度杰出社会责任影响力企业”。

2020年1月4日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在ESG投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

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		
尹浩	基金经理	2019-10-11	-	8.0	尹浩先生，硕士。2012年起先后在华宝证券、国金证券工作。2015年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2019年10月11日一至今)、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(2019年10月11日一至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019年10月11日一至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2019年10月11日一至今)、博时中证5G产业50交易型开放式指数证券投资基金(2020年3月27日一至今)的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 93 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

2020 年上半年，受新冠疫情冲击，全球资本市场跌宕起伏，波动较大，多数发达市场收跌。国际方面，美国标普 500 下跌 4.04%，而科技指数纳斯达克指数上涨 12.11%，日经 225 指数下跌 5.78%，欧洲股市中英国富时 100 下跌 18.20%，德国 DAX 指数下跌 7.08%，法国 CAC40 下跌 17.43%。香港恒生指数下跌 13.35%。国内 A 股方面，在率先走出新冠疫情后复产复工稳步推进及宽松预期下，市场整体表现尚可。结构上，在复产复工与疫情反复共同交织叠加宽松预期背景下，科技、医药、消费板块共同发力。债券市场方面，同样受疫情和应对经济活动疲软影响，债券收益率震荡下行，10 年期国债收益率从 3.14 下行至 2.82。

行情方面，2020 年上半年，市场整体处于上涨行情，在主流宽基指数中，仅偏大盘的上证 50 下跌，跌幅为 3.95%，而沪深 300 上涨 1.64%，偏中小盘的中证 500 上涨 11.33%，中证 1000 上涨 13.52%，科技、医药集中的创业板指表现最好，上涨 35.60%。风格指数方面，中盘成长表现最好，上涨 18.00%，大盘价值表现最弱，下跌 12.62%。行业方面，中信一级行业中，医药、消费者服务、食品饮料、电子、计算机表现最为抢眼，分别上涨 41.56%、26.32%、25.41%、24.22%、22.92%。而石油石化、煤炭、银行、非银金融、房地产下跌，跌幅分别是 17.47%、15.53%、13.02%、10.67%、8.54%。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份股紧密跟踪指数，利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期，我们严格按照基金合同要求，尽量降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合与目标指数的结构一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 2.0953 元，份额累计净值为 2.0953 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 35.61%，同期业绩基准增长率 35.60%。

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 2020 年下半年，海外疫情蔓延出使经济衰退风险持续上升，预计未来美联储将继续保持流动性充盈，在此背景下或推动外资持续流入 A 股。国内方面，宽松财政政策开始发力，二季度流动性边际有所收紧，但受失业率上行压力，预计央行仍将保持流动性宽松。A 股市场风格整体分化尽管有所弥合，高低估值板块差异仍较大，现阶段估值与基本面存在一定背离。

我们对 A 股长期表现偏乐观，但需注意仓位的灵活性，把握结构性机会。投资风格上，围绕内循环等内需主题机会，继续重点配置行业龙头公司，长期配置消费、医药、科技的基础性配置，但需注意高低估值板块估值收敛。结构上把握两条主线，一条主线是关注受益于疫情后的内需恢复的可选消费板块（包括消费者服务、汽车等）和自主可控的科技、医药板块（包括消费电子、云计算、智能家居、医疗设备等）。另一条主线是逐步复苏后存在业绩预期差的周期板块（包括建筑建材、机械、化工等）以及后周期低估值板块（包括银行、非银金融等）。

在投资策略上，本基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过 ETF 为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020 年上半年度，基金托管人在博时创业板交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2020 年上半年度，博时基金管理有限公司在博时创业板交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 年上半年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时创业板交易型开放式指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	3,011,323.29	1,014,013.17
结算备付金		11,469.35	-
存出保证金		2,054.74	242.81
交易性金融资产	6.4.3.2	190,358,274.65	100,124,256.21
其中：股票投资		190,358,274.65	100,084,956.21
基金投资		-	-
债券投资		-	39,300.00

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		149,723.60	-
应收利息	6.4.3.5	585.15	273.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		193,533,430.78	101,138,786.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		37,329.55	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		72,893.42	43,315.77
应付托管费		14,578.70	8,663.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	20,669.27	16,406.76
应交税费		-	0.23
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	139,563.12	285,000.00
负债合计		285,034.06	353,385.90
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	92,229,029.00	65,229,029.00
未分配利润	6.4.3.10	101,019,367.72	35,556,371.17
所有者权益合计		193,248,396.72	100,785,400.17
负债和所有者权益总计		193,533,430.78	101,138,786.07

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0953 元，基金份额总额 92,229,029.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
一、收入		42,911,452.70	3,348,030.32
1. 利息收入		8,872.11	5,969.92
其中：存款利息收入	6.4.3.11	8,867.15	5,969.92
债券利息收入		4.96	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,230,862.12	4,804,519.65
其中：股票投资收益	6.4.3.12	12,444,162.54	4,315,080.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	11,583.05	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	775,116.53	489,438.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	29,706,572.63	-1,525,712.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-34,854.16	63,253.13
减：二、费用		634,024.85	479,877.92
1. 管理人报酬		352,714.51	204,370.64
2. 托管费		70,542.94	40,874.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	48,781.62	41,960.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	-
7. 其他费用	6.4.3.19	161,985.76	192,673.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,277,427.85	2,868,152.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,277,427.85	2,868,152.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	65,229,029.00	35,556,371.17	100,785,400.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,277,427.85	42,277,427.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	27,000,000.00	23,185,568.70	50,185,568.70

其中：1. 基金申购款	71,000,000.00	58,900,623.31	129,900,623.31
2. 基金赎回款	-44,000,000.00	-35,715,054.61	-79,715,054.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	92,229,029.00	101,019,367.72	193,248,396.72
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,229,029.00	2,967,349.12	39,196,378.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,868,152.40	2,868,152.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	39,500,000.00	17,367,197.21	56,867,197.21
其中：1. 基金申购款	128,500,000.00	53,210,275.48	181,710,275.48
2. 基金赎回款	-89,000,000.00	-35,843,078.27	-124,843,078.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	75,729,029.00	23,202,698.73	98,931,727.73

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：成江

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	活期存款	3,011,323.29
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	3,011,323.29	

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	149,324,843.25	190,358,274.65	41,033,431.40
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	149,324,843.25	190,358,274.65	41,033,431.40

注：2020 年 6 月 30 日，本基金无可退替代款估值增值余额(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	583.73
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.52
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.90
合计	585.15

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	20,669.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	20,669.27

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	-
其他应付款	25,000.00
应付指数使用费	35,000.00
预提费用	79,563.12
合计	139,563.12

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,229,029.00	65,229,029.00
本期申购	71,000,000.00	71,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-44,000,000.00	-44,000,000.00
本期末	92,229,029.00	92,229,029.00

6.4.3.10 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	38,847,821.66	-3,291,450.49	35,556,371.17
本期利润	12,570,855.22	29,706,572.63	42,277,427.85
本期基金份额交易产生的变动数	17,789,851.72	5,395,716.98	23,185,568.70
其中：基金申购款	47,132,238.81	11,768,384.50	58,900,623.31
基金赎回款	-29,342,387.09	-6,372,667.52	-35,715,054.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,208,528.60	31,810,839.12	101,019,367.72

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,681.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	176.44
其他	9.25
合计	8,867.15

6.4.3.12 股票投资收益
6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,096,989.83
股票投资收益——赎回差价收入	11,347,172.71
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	12,444,162.54

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	16,654,844.80
减：卖出股票成本总额	15,557,854.97

买卖股票差价收入	1,096,989.83
----------	--------------

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	79,715,054.61
减：现金支付赎回款总额	-10,838.39
减：赎回股票成本总额	68,378,720.29
赎回差价收入	11,347,172.71

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	50,893.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	39,300.00
减：应收利息总额	10.59
买卖债券差价收入	11,583.05

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	775,116.53
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	775,116.53

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	29,706,572.63
——股票投资	29,706,572.63
——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	-
——权证投资	-
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	29,706,572.63
----	---------------

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-34,854.16
合计	-34,854.16

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	48,781.62
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	48,781.62

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	60.00
指数使用费	82,362.64
合计	161,985.76

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，基金合同生效后的指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的年费率 0.03% 每日计提，指数使用许可费收取下限为每季度（自然季度）人民币 35,000 元，即不足人民币 35,000 元时按照人民币 35,000 元收取。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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、基金销售机构
博时创业板 ETF 联接基金	基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	352,714.51	204,370.64
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,542.94	40,874.12

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
招商证券	492,036.00	0.53%	428,910.00	0.66%
博时创业板 ETF 联接	75,114,065.00	81.44%	55,614,065.00	85.26%

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,011,323.29	8,681.46	1,418,041.67	4,592.93

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-

300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50% (根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定)；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪创业板指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪创业板指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法

律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理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及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国交通银行，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均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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.00% (2019 年 12 月 31 日：0.04%)。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，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 2020 年 6 月 30 日，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付息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制

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

本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 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。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 2020 年 6 月 30 日，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%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,011,323.29	-	-	-	3,011,323.29
结算备付金	11,469.35	-	-	-	11,469.35
存出保证金	2,054.74	-	-	-	2,054.74
交易性金融资产	-	-	-	190,358,274.65	190,358,274.65
应收证券清算款	-	-	-	149,723.60	149,723.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	585.15	585.15
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,024,847.38	-	-	190,508,583.40	193,533,430.78
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	37,329.55	37,329.55

应付管理人报酬	-	-	-	72,893.42	72,893.42
应付托管费	-	-	-	14,578.70	14,578.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	20,669.27	20,669.27
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	139,563.12	139,563.12
负债总计	-	-	-	285,034.06	285,034.06
利率敏感度缺口	3,024,847.38	-	-	190,223,549.34	193,248,396.72
上年度末 2019年12月 31日 资产	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
银行存款	1,014,013.17	-	-	-	1,014,013.17
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	242.81	-	-	-	242.81
交易性金融资产	-	-	39,300.00	100,084,956.21	100,124,256.21
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	273.88	273.88
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,014,255.98	-	39,300.00	100,085,230.09	101,138,786.07
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	43,315.77	43,315.77
应付托管费	-	-	-	8,663.14	8,663.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.23	0.23
应付交易费用	-	-	-	16,406.76	16,406.76
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	285,000.00	285,000.00
负债总计	-	-	-	353,385.90	353,385.90
利率敏感度缺口	1,014,255.98	-	39,300.00	99,731,844.19	100,785,400.17

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值比例为 0.00%（2019 年 12 月 31 日：0.04%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金采用完全复制法，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	190,358,274.65	98.50	100,084,956.21	99.31
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	39,300.00	0.04
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	190,358,274.65	98.50	100,124,256.21	99.34

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 953	增加约 484
业绩比较基准下降 5%	减少约 953	减少约 484	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 129,900,623.31 元(2019 年度：210,887,551.39 元)，其中包括以股票支付的申购款 124,639,042.76 元和以现金支付的申购款 5,261,580.55 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 203,643,685.62 元和以现金支付的申购款 7,243,865.77 元)。

(2) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 190,321,758.93 元，属于第二层次的余额为 36,515.72 元，无属于第三层次的余额 (2019 年 12 月 31 日：第一层次 100,084,956.21 元，第二层次 39,300.00 元，无第三层次)。

(ii) 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(3) 除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	190,358,274.65	98.36
	其中：股票	190,358,274.65	98.36
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	3,022,792.64	1.56
8	其他各项资产	152,363.49	0.08
9	合计	193,533,430.78	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,178,129.60	4.75
B	采矿业	-	-
C	制造业	108,272,863.18	56.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	265,930.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,017,512.25	18.12
J	金融业	10,196,556.00	5.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,430,520.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	5,840,484.00	3.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,083,500.32	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,773,041.30	6.09
R	文化、体育和娱乐业	7,299,738.00	3.78
S	综合	-	-
	合计	190,358,274.65	98.50

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	68,500	11,943,660.00	6.18
2	300760	迈瑞医疗	34,178	10,448,214.60	5.41
3	300059	东方财富	504,780	10,196,556.00	5.28
4	300498	温氏股份	406,872	8,869,809.60	4.59
5	300142	沃森生物	121,800	6,377,448.00	3.30
6	300015	爱尔眼科	141,970	6,168,596.50	3.19

7	300014	亿纬锂能	100,444	4,806,245.40	2.49
8	300122	智飞生物	46,100	4,616,915.00	2.39
9	300347	泰格医药	42,710	4,351,294.80	2.25
10	300601	康泰生物	24,500	3,972,920.00	2.06
11	300124	汇川技术	93,196	3,540,516.04	1.83
12	300136	信维通信	66,700	3,536,434.00	1.83
13	300003	乐普医疗	93,400	3,410,968.00	1.77
14	300413	芒果超媒	48,240	3,145,248.00	1.63
15	300253	卫宁健康	136,190	3,124,198.60	1.62
16	300454	深信服	14,200	2,924,632.00	1.51
17	300433	蓝思科技	96,150	2,696,046.00	1.40
18	300408	三环集团	88,784	2,459,316.80	1.27
19	300383	光环新网	91,000	2,372,370.00	1.23
20	300558	贝达药业	16,800	2,351,664.00	1.22
21	300529	健帆生物	33,140	2,303,230.00	1.19
22	300033	同花顺	17,200	2,288,976.00	1.18
23	300012	华测检测	113,400	2,240,784.00	1.16
24	300661	圣邦股份	7,250	2,211,612.50	1.14
25	300676	华大基因	14,000	2,182,740.00	1.13
26	300450	先导智能	44,200	2,042,482.00	1.06
27	300144	宋城演艺	115,860	2,004,378.00	1.04
28	300088	长信科技	171,600	1,921,920.00	0.99
29	300285	国瓷材料	55,050	1,844,725.50	0.95
30	300463	迈克生物	30,400	1,770,192.00	0.92
31	300496	中科创达	22,600	1,756,020.00	0.91
32	300782	卓胜微	3,960	1,606,849.20	0.83
33	300271	华宇软件	56,100	1,582,581.00	0.82
34	300212	易华录	28,260	1,582,560.00	0.82
35	300315	掌趣科技	210,700	1,544,431.00	0.80
36	300595	欧普康视	22,200	1,539,348.00	0.80
37	300482	万孚生物	14,700	1,528,800.00	0.79
38	300207	欣旺达	80,800	1,527,120.00	0.79
39	300770	新媒股份	6,800	1,520,888.00	0.79
40	300168	万达信息	68,359	1,508,683.13	0.78
41	300628	亿联网络	21,300	1,453,938.00	0.75
42	300058	蓝色光标	183,400	1,430,520.00	0.74
43	300308	中际旭创	22,580	1,422,540.00	0.74
44	300759	康龙化成	14,400	1,416,960.00	0.73
45	300699	光威复材	22,200	1,392,606.00	0.72
46	300024	机器人	99,500	1,360,165.00	0.70
47	300017	网宿科技	158,400	1,344,816.00	0.70
48	300009	安科生物	74,300	1,329,970.00	0.69
49	300357	我武生物	21,100	1,313,475.00	0.68
50	300244	迪安诊断	35,500	1,253,150.00	0.65
51	300146	汤臣倍健	63,600	1,252,284.00	0.65
52	300316	晶盛机电	50,600	1,251,844.00	0.65
53	300773	拉卡拉	34,100	1,185,657.00	0.61
54	300010	立思辰	59,400	1,162,458.00	0.60
55	300724	捷佳伟创	13,000	1,150,890.00	0.60
56	300274	阳光电源	78,900	1,135,371.00	0.59

57	300115	长盈精密	47,817	1,092,618.45	0.57
58	300070	碧水源	133,436	1,083,500.32	0.56
59	300451	创业慧康	57,600	1,065,024.00	0.55
60	300418	昆仑万维	42,600	1,063,296.00	0.55
61	300223	北京君正	10,300	1,039,682.00	0.54
62	300001	特锐德	48,000	1,005,120.00	0.52
63	300073	当升科技	29,700	982,179.00	0.51
64	300457	赢合科技	30,200	962,776.00	0.50
65	300226	上海钢联	12,180	957,348.00	0.50
66	300251	光线传媒	86,200	940,442.00	0.49
67	300113	顺网科技	36,300	922,020.00	0.48
68	300296	利亚德	146,700	890,469.00	0.46
69	300476	胜宏科技	36,900	887,445.00	0.46
70	300369	绿盟科技	38,100	887,349.00	0.46
71	300630	普利制药	11,850	876,307.50	0.45
72	300567	精测电子	12,700	866,775.00	0.45
73	300166	东方国信	66,100	820,301.00	0.42
74	300766	每日互动	21,000	799,260.00	0.41
75	300674	宇信科技	18,500	798,275.00	0.41
76	300026	红日药业	141,300	779,976.00	0.40
77	300294	博雅生物	20,300	761,047.00	0.39
78	300618	寒锐钴业	12,260	760,365.20	0.39
79	300747	锐科激光	6,700	729,161.00	0.38
80	300188	美亚柏科	36,600	725,778.00	0.38
81	300078	思创医惠	52,300	707,619.00	0.37
82	300133	华策影视	85,400	619,150.00	0.32
83	300180	华峰超纤	70,663	604,875.28	0.31
84	300474	景嘉微	8,900	598,970.00	0.31
85	300182	捷成股份	148,000	590,520.00	0.31
86	300098	高新兴	97,400	590,244.00	0.31
87	300324	旋极信息	86,900	578,754.00	0.30
88	300768	迪普科技	12,500	578,625.00	0.30
89	300633	开立医疗	13,800	547,170.00	0.28
90	300038	数知科技	64,500	526,320.00	0.27
91	300775	三角防务	23,300	504,212.00	0.26
92	300459	金科文化	141,011	486,487.95	0.25
93	300666	江丰电子	8,100	483,408.00	0.25
94	300748	金力永磁	13,200	440,616.00	0.23
95	300072	三聚环保	99,810	427,186.80	0.22
96	300741	华宝股份	10,500	387,240.00	0.20
97	300616	尚品宅配	5,600	336,448.00	0.17
98	300761	立华股份	8,000	308,320.00	0.16
99	300682	朗新科技	18,100	308,062.00	0.16
100	300783	三只松鼠	3,500	265,930.00	0.14
101	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
102	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
103	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
104	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
105	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
106	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00

107	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
108	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300770	新媒股份	1,376,281.00	1.37
2	300782	卓胜微	1,342,287.14	1.33
3	300223	北京君正	986,056.00	0.98
4	300773	拉卡拉	954,209.00	0.95
5	300498	温氏股份	951,132.20	0.94
6	300451	创业慧康	909,617.50	0.90
7	300759	康龙化成	763,654.00	0.76
8	300014	亿纬锂能	648,267.30	0.64
9	300674	宇信科技	637,545.00	0.63
10	300661	圣邦股份	618,885.46	0.61
11	300142	沃森生物	613,986.00	0.61
12	300628	亿联网络	604,918.24	0.60
13	300766	每日互动	567,238.00	0.56
14	300433	蓝思科技	503,479.00	0.50
15	300775	三角防务	491,580.00	0.49
16	300768	迪普科技	407,227.00	0.40
17	300308	中际旭创	354,923.00	0.35
18	300601	康泰生物	348,091.00	0.35
19	300783	三只松鼠	281,629.00	0.28
20	300747	锐科激光	261,953.00	0.26

注：本项的“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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	1,616,225.09	1.60
2	300750	宁德时代	935,302.00	0.93
3	300059	东方财富	703,674.20	0.70
4	300760	迈瑞医疗	555,617.00	0.55
5	300068	南都电源	550,468.79	0.55
6	300170	汉得信息	532,180.00	0.53
7	300203	聚光科技	487,868.00	0.48
8	300015	爱尔眼科	439,214.00	0.44
9	300003	乐普医疗	402,776.58	0.40
10	300377	赢时胜	358,142.00	0.36
11	300347	泰格医药	352,579.00	0.35
12	300226	上海钢联	320,648.00	0.32

13	300222	科大智能	294,355.00	0.29
14	300136	信维通信	274,396.00	0.27
15	300661	圣邦股份	258,732.00	0.26
16	300454	深信服	239,517.00	0.24
17	300122	智飞生物	234,487.00	0.23
18	300418	昆仑万维	230,542.00	0.23
19	300012	华测检测	216,270.00	0.21
20	300628	亿联网络	209,016.00	0.21

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	19,864,278.31
卖出股票的收入（成交）总额	16,654,844.80

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未投资股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,054.74
2	应收证券清算款	149,723.60
3	应收股利	-
4	应收利息	585.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	152,363.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
640	144,107.86	9,639,199.00	10.45%	7,475,765.00	8.11%	75,114,065.00	81.44%

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	博时基金—工商银行—诚泰财险—诚泰财产保险股份有限公司—自有资金	5,459,700.00	5.92%
2	中信证券股份有限公司	1,963,712.00	2.13%
3	广发证券股份有限公司	894,972.00	0.97%
4	方正证券股份有限公司	818,779.00	0.89%
5	陈勇	500,000.00	0.54%
6	招商证券股份有限公司	492,036.00	0.53%
7	杨振山	470,000.00	0.51%
8	杨帆	340,000.00	0.37%
9	朱洪宏	253,800.00	0.28%
10	吴丽霞	235,000.00	0.25%
-	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	75,114,065.00	81.44%

注：前十名持有人为除博时创业板 ETF 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（2018年12月10日）基金份额总额	34,229,029.00
本报告期期初基金份额总额	65,229,029.00
本报告期基金总申购份额	71,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	44,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	92,229,029.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 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》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 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》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	23,441,546.03	64.96%	17,143.19	59.28%	新增 1 个

中金公司	1	12,644,702.97	35.04%	11,775.94	40.72%	-
------	---	---------------	--------	-----------	--------	---

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我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；能根据本公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	50,893.64	100.00%	-	-	-	-

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	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直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	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务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	2020-06-01
4	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（正文）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-14
5	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（摘要）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-14
6	博时基金管理有限公司修改旗下部分交易型开放式指数证券投资基金指数使用费的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电	2020-05-14

		子披露网	
7	关于博时创业板 ETF 基金新增中信证券华南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	2020-05-11
8	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2020 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	2020-04-22
9	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	2020-04-17
10	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2019 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	2020-03-27
11	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
12	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2019 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	2020-01-17

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020-01-01~2020-06-30	55,614,065.00	27,000,000.00	7,500,000.00	75,114,065.00	81.44%

产品特有风险

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

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

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

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者

某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：本基金同时可在场内交易，因场内交易导致的投资者份额变动管理人无法获悉。

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

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时创业板交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 报告期内博时创业板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
- 12.1.6 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

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阅，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
二〇二〇年八月三十一日