

博时创业板交易型开放式指数证券投资 基金

2020 年年度报告
2020 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
§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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	16
6.1 审计意见.....	16
6.2 形成审计意见的基础.....	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	16
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	55

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末上市基金前十名持有人	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	57
§10 开放式基金份额变动	57
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	62
13.1 备查文件目录	62
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§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	134,229,029.00 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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、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。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过 2%。</p> <p>2、衍生品投资策略。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。</p> <p>3、融资及转融通证券出借策略。 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。</p> <p>4、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	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。
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。</p> <p>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。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	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	luzj@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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年 12 月 10 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	47,234,392.50	6,395,449.58	-4,653,598.19
本期利润	104,266,676.17	20,224,102.64	-2,947,433.23
加权平均基金份额本期利润	0.9696	0.2977	-0.0838
本期加权平均净值利润率	45.45%	21.63%	-7.49%
本期基金份额净值增长率	68.13%	42.81%	-7.25%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末

期末可供分配利润	137,412,748.01	35,556,371.17	2,967,349.12
期末可供分配基金份额利润	1.0237	0.5451	0.0819
期末基金资产净值	348,691,552.93	100,785,400.17	39,196,378.12
期末基金份额净值	2.5977	1.5451	1.0819
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	122.71%	32.46%	-7.25%

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

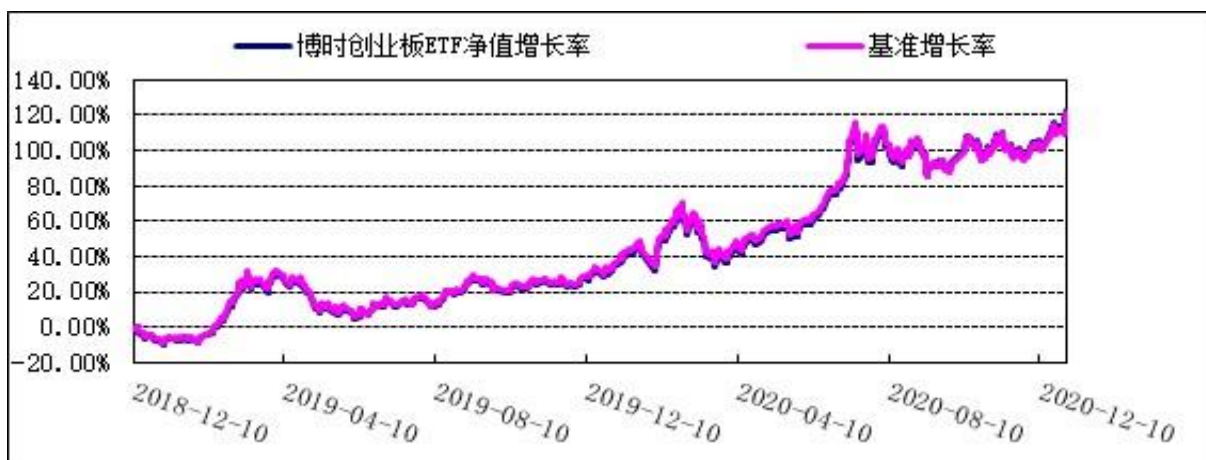
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.55%	1.60%	15.21%	1.61%	0.34%	-0.01%
过去六个月	23.98%	1.86%	21.66%	1.88%	2.32%	-0.02%
过去一年	68.13%	1.94%	64.96%	1.96%	3.17%	-0.02%
自基金合同生效起至今	122.71%	1.77%	121.19%	1.79%	1.52%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为创业板指数收益率。

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

自基金转型以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 12 月 10 日至 2020 年 12 月 31 日)



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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2018 年 12 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命，“做投资价值的发现者”是博时的理念。截至 2020 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 246 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 13294 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 4012 亿元人民币，累计分红逾 1373 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。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2020 年 4 季末：

博时旗下权益类基金业绩表现优异，参与银河证券 2020 年业绩排名的 112 只主动权益类基金全年平均收益 32.86%，其中 28 只基金年内收益超过 50%，16 只收益超过 60%，7 只超过 70%，2 只收益超过 80%，1 只产品收益超过 104%。从业绩同类排名来看，52 只基金业绩同类排名在前 2/3，

36 只基金业绩同类排名在前 1/2，8 只基金业绩同类排名前 10，1 只基金业绩同类排名第 1。

其中，博时丝路主题股票(C 类)2020 年净值增长率同类排名第 1，博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类)同类排名第 3，博时军工主题股票同类排名第 5，博时汇悦回报混合、博时新兴成长混合、博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时回报灵活配置混合、博时弘泰定期开放混合、博时丝路主题股票(A 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)同类排名均在前 1/4。

博时固定收益类基金表现同样可圈可点，参与银河证券 2020 年度业绩排名的 136 只债券基金全年平均收益 3.48%，超过中证全债及中证综合债指数的涨幅。25 只基金 2020 年全年收益超过 4%，19 只基金年内收益超过 5%，5 只基金年内收益超过 10%，2 只基金年内收益超过 20%。从相对排名来看，70 只基金 2020 年业绩同类排名前 1/2，44 只基金同类排名前 1/4，19 只基金同类排名前 1/10，12 只基金同类排名前 10，1 只基金同类排名第 1。

其中，博时安丰 18 个月定期开放债券(A 类-LOF)同类排名第 1，博时双月薪定期支付债券、博时月月薪定期支付债券同类排名第 2，博时安瑞 18 个月定期开放债券(A 类)第 4，博时信用债券、博时稳健回报债券(LOF)、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时富祥纯债债券(A 类)、博时安泰 18 个月定期开放债券(A 类)、博时裕泰纯债债券、博时裕腾纯债债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时聚盈纯债债券、博时聚源纯债债券(A 类)等产品同类排名均在前 1/10。

博时大中华亚太精选股票(QDII)(美元) (000927)、博时大中华亚太精选股票(QDII) (050015) 2020 年分别实现收益 28.68%、20.48%。博时亚洲票息收益债券(QDII)(美元)同类排名前 1/4。

指数型基金当中，参与银河证券 2020 年业绩排名的 56 只被动指数型基金全年平均收益 17.24%，对各类指数实现了有效地跟踪。

2、 其他大事件

2020 年 12 月 31 日，在中国证券业协会主办，中国期货业协会、中国证券投资基金业协会协办的第七届证券期货科学技术奖中，博时基金、金证财富《新一代投资决策支持系统》荣获证券期货科学技术奖三等奖。

2020 年 12 月，大众证券报“2020 中国基金风云榜”揭晓，博时基金获“2020 年度十大风云基金公司”，博时医疗保健行业获“2020 年度十大风云基金产品”。

2020 年 12 月 23 日，在信息时报“金狮奖”中，博时基金荣获“年度最具核心竞争力基金公司”。

2020 年 12 月 15 日，“聚中国 投未来 2021 新财富资产管理年会”在深圳举办，博时基金荣获 2020 新财富最智慧投资机构。

2020 年 12 月 11 日，由证券时报 券商中国主办的“2020 中国金融科技先锋榜”隆重揭晓，博时基

金荣登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2020 年 12 月 10 日，金融界“第五届智能金融国际论坛暨 2020 金融界领航中国年度盛典”，博时基金荣获四项大奖。博时基金董事长江向阳获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金荣获“杰出年度创新基金公司奖”、“杰出年度基金公司奖”、“杰出年度海外投资基金公司奖”。

2020 年 12 月 10 日，香港中资基金业协会（HKCAMA）和彭博（Bloomberg）2020 年度“离岸中资基金大奖”中，博时国际荣膺“最佳跨境业务”大奖，“博时-东方红大中华债券基金”荣膺“最佳总回报-大中华区固定收益（1 年）”亚军。

2020 年 12 月 8 日，北京商报社主办的“数字金融 争渡未来 2020 年度北京金融论坛”在北京举办，博时基金荣获 2020 年度北京金融业十大品牌 产品创新卓越奖。

2020 年 12 月 2 日，经济观察报举办的 2020 卓越金融企业盛典举行，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”称号。

2020 年 11 月 28 日，由 21 世纪经济报道主办的第五届财经“金帆奖”评选中，博时基金荣获“2020 年度卓越基金管理公司”。

2020 年 11 月 27 日，国际金融报“第三届 CSR 先锋论坛暨 2020 先锋奖项颁奖典礼”在北京举办，凭借在社会责任方面的贡献，博时基金荣获 2020 年度社会责任先锋案例。

2020 年 11 月 20 日，2020 第一财经金融价值榜 颁奖典礼在上海举办，博时基金获选“2020 年度第一财经金融价值榜”年度基金公司管理人。

2020 年 11 月 19 日，由思维财经&投资者网主办的思维财经投资者年会暨“金桥奖”颁奖盛典上，博时基金荣获“金桥奖 年度最具投资价值基金公司”。

2020 年 11 月，联合国负责任投资原则组织(UN PRI)发布 2020 年度签署方评估报告。博时基金在衡量公司整体 ESG 管理水平的“战略与治理”模块，获得了首批最高评价“A+”评定。

2020 年 10 月 28 日，由《中国基金报》主办的“2020 中国机构投资者峰会”在上海浦东香格里拉酒店举行。第七届中国基金业英华奖中，博时基金陈凯杨荣获“五年期纯债投资最佳基金经理”，过均荣获“五年期二级债投资最佳基金经理”，何凯荣获“三年期海外固收投资最佳基金经理”及“五年期海外固收投资最佳基金经理”。第二届中国公募基金英华奖中，博时基金荣获“2019 年度最佳营销策划案例（最佳创意）”、“2019 年度最佳社会公益实践案例”、“2019 年度最佳电商业务发展基金公司”、“2019 年度最佳创新基金产品”、“2019 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”、“2019 年度最佳指数增强基金”奖项。

2020 年 10 月 23 日，国际金融报主办的“2020 国际先锋金融机构高峰论坛暨颁奖典礼”在上海举办，博时基金董事长江向阳荣获“金融行业先锋领袖”、博时基金荣获“先锋证券投资机构”。

2020 年 10 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2020 中国金融每经峰会资本市场高峰论坛暨 2020 中国金鼎奖颁奖典礼”在上海举行，博时基金成功斩获“固收+最具人气基金公司奖”和“最具影响力基金公司-专户一对多”奖项，博时基金投资经理王晓冬荣获“最具实力权益类专户基金经理”奖项。

2020 年 9 月 22 日，由《投资时报》及标点财经研究院联合主办的“见未来 2020 第三届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典”在京举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获三项大奖。博时获评“金禧奖 2020 卓越公募基金公司”、“金禧奖 2020 优秀固收类基金团队”、“金禧奖 2020 大湾区特别贡献奖”。

2020 年 9 月 15 日，《上海证券报》第十七届“金基金”奖颁奖典礼在上海隆重举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金及子公司博时资本共荣获三项大奖。博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。博时资本张存相荣获“金阳光 三年卓越私募基金经理（MOM 类）”奖项。

2020 年 8 月 6 日，《经济观察报》“见圳四十年---深圳经济特区成立 40 周年特别盛典”在深圳举办，博时基金荣获“致敬深圳经济特区成立四十周年卓越企业”奖项。

2020 年 7 月 9 日，新浪财经“2020 中国基金业开放与发展高峰论坛暨基金业致敬资本市场 30 周年峰会”在云端举办，届时公布了 2020 中国基金业金麒麟奖，博时基金荣获“2020 十大风云基金公司”，此外，博时基金王俊荣获“2020 最受青睐股票基金经理”奖项，博时基金赵云阳、桂征辉、王祥均荣获“2020 最受青睐指数与 ETF 基金经理”奖项。

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颁奖典礼在北京举办，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	-	8.6	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—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—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—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—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—至今)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 10 日—至今)、博时中证智能消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细

则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 111 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 年全球经济及金融市场一直受新型冠状病毒（COVID-19）影响。疫情于第一季爆发，各国的封城、社交区隔等防疫政策令经济重创，一度动摇全球投资者的信心，全球股市于 3 月份暴跌。随后各国央行实行大放水，推出异常宽松的货币政策，主要包括减息和量化宽松等措施，成功稳住市场。全球经济也于上半年深度衰退后，在第三季经济也开始反弹，虽然部份国家出现疫情反复，但疫苗研发有进展，股市普遍继续反复向上。截至年底，全球主要市场股指都收复失地，甚至屡创新高。全年来看，美国标普 500 上涨 16.26%、纳斯达克上涨 43.64%、日经 225 上涨 16.01%，而欧洲股指表现差强人意，德国 DAX 上涨 3.55%、法国 CAC40 则下跌 7.14%、英国富时 100 下跌 14.34%。

A 股方面，受宽松的流动性推动，主流指数全线上涨，偏大盘的上证 50 上涨 18.85%、沪深 300 指数上涨 27.21%，偏小盘的中证 500 和中证 1000 分别上涨 20.87%、19.39%，而重仓科技和医药的

创业板指表现最为抢眼，全年上涨 64.96%。行业方面，中信一级行业表现分化明显，其中表现居前的是电力设备及新能源、食品饮料、消费者服务、国防军工、医药，涨幅分别为 88.34%、88.06%、81.06%、72.47%、50.40%，跌幅较为靠前的行业是综合金融、房地产、通信、建筑、纺织服装，跌幅分别为 18.11%、9.49%、8.72%、6.78%、2.51%。

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 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 2.5977 元，份额累计净值为 2.5977 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 68.13%，同期业绩基准增长率 64.96%。

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 2021 年，宏观层面，当前疫苗逐渐落地，其效果会慢慢显现带来海外疫情慢慢好转，全球的修复弹性有望逐渐释放。2021 年，国内宏观政策保持可持续性，政策环境大起大落的担忧得到实质性缓解，重点关注结构性信用出清压力和微观流动性变化趋势。2021 年的核心任务是构建双循环格局，供需两端发力，打造高水平供需动态平衡。供给侧方面以科技自主为支撑，强化国家战略科技力量，增强产业链供应链自主可控能力。需求侧管理重点是摆脱过去靠投资拉动模式，更多依靠消费升级、公共服务等。中美关系方面，新总统上任第一年往往聚焦国内事务，外部处于乐观窗口。

我们认为 A 股将整体波动向上，市场结构较之前相对均衡，企业盈利增速持续好转，基本面或成为市场主要驱动力，内外循环驱动预计将成为主旋律，权益市场仍有较为丰富的机会。重点关注三条主线：（1）从疫情中恢复且受益于通胀的产业，包括有色、化工、金融等周期板块，以及航空、影视、餐饮旅游、医疗等服务业板块；（2）双循环体系+国内经济率先复苏的制造业，包括高端制造、光伏及新能源板块；（3）科技成长仍是应重点关注的方向，短期关注业绩释放的消费电子、军工等板块，长期关注国产替代、自主可控背景下的半导体、新材料等。

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，希望通过本基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告。

2020 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《博时基金定向增发投资管理制度》、《衍生品投资及风险管理制度》等制度文件，修订了《科创板投资管理制度》、《黄金租赁业务管理制度》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设和完善“博时产品管理系统”、“新一代决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：每一基金份额享有同等分配权；本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红；当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记机构对场内份额收益分配另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，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

2020 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、利润分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 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 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 23644 号

博时创业板交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“博时创业板 ETF”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了博时创业板 ETF 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博时创业板 ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

基金管理人治理层负责监督博时创业板 ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时创业板 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时创业板 ETF 不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天
 会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

张 振 波

中国·上海市

注册会计师

2021 年 3 月 30 日

沈 兆 杰

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,053,856.21	1,014,013.17
结算备付金		19,420.52	-
存出保证金		8,331.78	242.81
交易性金融资产	7.4.7.2	345,866,124.12	100,124,256.21
其中：股票投资		345,810,024.12	100,084,956.21
基金投资		-	-
债券投资		56,100.00	39,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		253,406.52	-
应收利息	7.4.7.5	859.25	273.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		349,201,998.40	101,138,786.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		147,819.15	43,315.77
应付托管费		29,563.84	8,663.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	41,006.71	16,406.76
应交税费		2,055.77	0.23
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	290,000.00	285,000.00
负债合计		510,445.47	353,385.90
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	134,229,029.00	65,229,029.00
未分配利润	7.4.7.10	214,462,523.93	35,556,371.17
所有者权益合计		348,691,552.93	100,785,400.17
负债和所有者权益总计		349,201,998.40	101,138,786.07

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.5977 元，基金份额总额 134,229,029.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		106,101,197.61	21,270,219.57
1.利息收入		255,108.58	10,752.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	20,941.58	10,747.68
债券利息收入		27.16	5.22
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		234,139.84	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		48,746,015.80	7,368,567.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	47,627,438.28	6,686,980.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	40,546.29	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,078,031.23	681,587.09
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	57,032,283.67	13,828,653.06
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	67,789.56	62,246.13
减：二、费用		1,834,521.44	1,046,116.93
1. 管理人报酬		1,132,514.79	463,541.30
2. 托管费		226,503.01	92,708.26
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	162,197.94	69,757.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		843.06	0.02
7. 其他费用	7.4.7.19	312,462.64	420,110.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		104,266,676.17	20,224,102.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		104,266,676.17	20,224,102.64

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31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)	-	104,266,676.17	104,266,676.17
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)	69,000,000.00	74,639,476.59	143,639,476.59
其中：1.基金申购款	181,500,000.00	204,173,111.29	385,673,111.29
2.基金赎回款	-112,500,000.00	-129,533,634.70	-242,033,634.70
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)	134,229,029.00	214,462,523.93	348,691,552.93
项目	上年度可比期间		

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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)	-	20,224,102.64	20,224,102.64
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)	29,000,000.00	12,364,919.41	41,364,919.41
其中：1.基金申购款	149,000,000.00	61,887,551.39	210,887,551.39
2.基金赎回款	-120,000,000.00	-49,522,631.98	-169,522,631.98
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)	65,229,029.00	35,556,371.17	100,785,400.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时创业板交易型开放式指数证券投资基金以下简称“本基金”)是由深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金转型而来。根据《深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》，原深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金为契约型开放式基金。根据基金管理人博时基金管理有限公司于 2018 年 12 月 4 日发布的《博时基金管理有限公司关于深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2018 年 12 月 3 日表决通过了《关于深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2018 年 12 月 10 日起，深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金正式转型并更名为博时创业板交易型开放式指数证券投资基金。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2011]207 号文审核同意，深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金于 2011 年 7 月 13 日在深交所挂牌交易。根据《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金将继续在深圳证券交易所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数创业板指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、权证、股指期货、期权、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中：投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)的资产比例不低于基金资产净值的 85%，权证、股指期货、期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率。

本基金的基金管理人博时基金管理有限公司以深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金为目标 ETF，募集成立了博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金已转型为博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“博时创业板 ETF 联接基金”)，博时创业板 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2021 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申

购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末

可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益评价日核定的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率达到 1% 以上，方可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人以基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。若自基金合同生效日起不满 3 个月，可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息

红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	3,053,856.21	1,014,013.17
定期存款	-	-
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	-	-
合计	3,053,856.21	1,014,013.17

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	277,450,881.68	345,810,024.12	68,359,142.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	56,100.00	56,100.00
	银行间市场	-	-
	合计	56,100.00	56,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	277,506,981.68	345,866,124.12	68,359,142.44
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	88,758,097.44	100,084,956.21	11,326,858.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	39,300.00	39,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	39,300.00	39,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	88,797,397.44	100,124,256.21	11,326,858.77

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	620.57	268.34
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	9.91	-
应收债券利息	5.88	5.43
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	218.82	-
其他	4.07	0.11
合计	859.25	273.88

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	41,006.71	16,406.76
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	41,006.71	16,406.76

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
其他应付款	25,000.00	25,000.00
应付指数使用费	105,000.00	100,000.00
预提费用	160,000.00	160,000.00
合计	290,000.00	285,000.00

7.4.7.9 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12月31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	181,500,000.00	181,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-112,500,000.00	-112,500,000.00
本期末	134,229,029.00	134,229,029.00

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

7.4.7.10 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	47,234,392.50	57,032,283.67	104,266,676.17
本期基金份额交易产生的变动数	51,330,533.85	23,308,942.74	74,639,476.59
其中：基金申购款	141,572,837.48	62,600,273.81	204,173,111.29
基金赎回款	-90,242,303.63	-39,291,331.07	-129,533,634.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	137,412,748.01	77,049,775.92	214,462,523.93

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
	活期存款利息收入	20,217.97
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	664.58	1,505.70
其他	59.03	35.55
合计	20,941.58	10,747.68

7.4.7.12 股票投资收益
7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
	股票投资收益——买卖股票差价收入	8,885,327.08
股票投资收益——赎回差价收入	38,742,111.20	8,005,851.77

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	47,627,438.28	6,686,980.39

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	57,132,971.32	23,105,369.20
减：卖出股票成本总额	48,247,644.24	24,424,240.58
买卖股票差价收入	8,885,327.08	-1,318,871.38

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	242,033,634.70	169,522,631.98
减：现金支付赎回款总额	320,861.70	61,642.98
减：赎回股票成本总额	202,970,661.80	161,455,137.23
赎回差价收入	38,742,111.20	8,005,851.77

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	146,773.89	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	106,200.00	-
减：应收利息总额	27.60	-
买卖债券差价收入	40,546.29	-

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,078,031.23	681,587.09
其中：证券出借权益补偿收入	19,140.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,078,031.23	681,587.09

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	57,032,283.67	13,828,653.06
——股票投资	57,032,283.67	13,828,653.06
——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	57,032,283.67	13,828,653.06

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	67,789.56	62,246.13
合计	67,789.56	62,246.13

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	162,197.94	69,757.35
银行间市场交易费用	-	-
合计	162,197.94	69,757.35

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	100.00	110.00
指数使用费	152,362.64	200,000.00
上市费	-	60,000.00
合计	312,462.64	420,110.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人
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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,132,514.79	463,541.30
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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	226,503.01	92,708.26

注：支付基金托管人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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 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
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	120,573,665.00	89.83%	55,614,065.00	85.26%
招商证券	1,634,313.00	1.22%	428,910.00	0.66%

注：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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	3,053,856.21	20,217.97	1,014,013.17	9,206.43

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券
7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	首次公开发行限售	25.70	88.29	1,530.00	39,321.00	135,083.70	-
300880	迦南智能	2020-08-25	2021-03-01	首次公开发行限售	9.73	34.73	3,732.00	36,312.36	129,612.36	-
300869	康泰	2020-08-12	2021-02-24	首次公开	10.16	110.88	862.00	8,757.92	95,578.56	-

	医学			发行限售						
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	首次公开发行限售	118.27	603.36	109.00	12,891.43	65,766.24	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225.00	34,701.00	34,701.00	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	首次公开发行限售	36.81	65.67	478.00	17,595.18	31,390.26	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	首次公开发行限售	19.34	31.97	884.00	17,096.56	28,261.48	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946.00	26,056.94	26,056.94	-
300894	火星入	2020-12-24	2021-07-01	首次公开发行限售	14.07	36.97	628.00	8,835.96	23,217.16	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	首次公开发行限售	21.34	37.84	585.00	12,483.90	22,136.40	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	首次公开发行限售	33.61	38.70	515.00	17,309.15	19,930.50	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	首次公开发行限售	3.64	16.40	1,143.00	4,160.52	18,745.20	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	首次公开发行限售	43.76	51.10	328.00	14,353.28	16,760.80	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	首次公开发行限售	26.66	60.01	272.00	7,251.52	16,322.72	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	首次公开发行限售	44.47	74.52	210.00	9,338.70	15,649.20	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	首次公开发行限售	30.72	41.32	369.00	11,335.68	15,247.08	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	首次公开发行限售	41.26	43.28	334.00	13,780.84	14,455.52	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	首次公开发行限售	138.02	126.67	114.00	15,734.28	14,440.38	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	首次公开发行限售	14.69	48.85	286.00	4,201.34	13,971.10	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	首次公开发行限售	71.71	90.85	149.00	10,684.79	13,536.65	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	首次公开发行限售	20.08	37.33	353.00	7,088.24	13,177.49	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	首次公开发行限售	27.97	30.12	427.00	11,943.19	12,861.24	-

300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	首次公开发行限售	20.09	36.62	350.00	7,031.50	12,817.00	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	首次公开发行限售	10.58	27.12	466.00	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	首次公开发行限售	10.33	25.79	440.00	4,545.20	11,347.60	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	首次公开发行限售	13.47	35.08	276.00	3,717.72	9,682.08	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	首次公开发行限售	14.17	32.31	291.00	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	首次公开发行限售	16.05	31.58	287.00	4,606.35	9,063.46	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480.00	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	首次公开发行限售	18.59	45.67	147.00	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387.00	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行限售	10.76	10.76	359.00	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行限售	13.39	13.39	217.00	2,905.63	2,905.63	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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
123083	朗新转债	2020-12-09	2021-01-06	新债未上市	100.00	100.00	231.00	23,100.00	23,100.00	-
123090	三诺转债	2020-12-21	2021-01-12	新债未上市	100.00	100.00	330.00	33,000.00	33,000.00	-

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》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，基金减持持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》的有关规定)；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、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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

6、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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300182	捷成股份	2020-12-30	重大事项停牌	3.23	2021-01-07	3.40	230,900.00	1,179,782.93	745,807.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
2020123100010818	300750	宁德时代	2020-12-31	2021-01-14	351.11	12,000.00	4,213,320.00
2020123100010748	300059	东方财富	2020-12-31	2021-01-14	31.00	79,000.00	2,449,000.00
2020123100010782	300760	迈瑞医疗	2020-12-31	2021-01-14	426.00	4,900.00	2,087,400.00
2020123100010790	300015	爱尔眼科	2020-12-31	2021-01-14	74.89	20,700.00	1,550,223.00
2020123100010702	300124	汇川技术	2020-12-31	2021-01-14	93.30	13,100.00	1,222,230.00
2020123100010750	300122	智飞	2020-12-31	2021-01-14	147.91	7,200.00	1,064,952.00

		生物					
2020123100010708	300014	亿纬锂能	2020-12-31	2021-01-14	81.50	12,900.00	1,051,350.00
2020123100010734	300498	温氏股份	2020-12-31	2021-01-14	18.23	57,400.00	1,046,402.00
2020123100010716	300347	泰格医药	2020-12-31	2021-01-14	161.61	6,100.00	985,821.00
2020123100010772	300274	阳光电源	2020-12-31	2021-01-14	72.28	11,200.00	809,536.00
2020123100010726	300142	沃森生物	2020-12-31	2021-01-14	38.56	18,400.00	709,504.00
2020123100010822	300782	卓胜微	2020-12-31	2021-01-14	570.54	1,100.00	627,594.00
2020123100010784	300601	康泰生物	2020-12-31	2021-01-14	174.50	3,500.00	610,750.00
2020123100010804	300450	先导智能	2020-12-31	2021-01-14	83.99	6,900.00	579,531.00
2020123100010806	300413	芒果超媒	2020-12-31	2021-01-14	72.50	7,900.00	572,750.00
2020123100010498	300454	深信服	2020-12-31	2021-01-14	248.01	2,200.00	545,622.00
2020123100010504	300433	蓝思科技	2020-12-31	2021-01-14	30.61	15,900.00	486,699.00
2020123100010686	300999	金龙鱼	2020-12-31	2021-01-14	108.32	4,300.00	465,776.00
2020123100010706	300408	三环集团	2020-12-31	2021-01-14	37.25	12,400.00	461,900.00
2020123100010764	300012	华测检测	2020-12-31	2021-01-14	27.37	16,200.00	443,394.00
2020123100010800	300285	国瓷材料	2020-12-31	2021-01-14	45.11	8,800.00	396,968.00
2020123100010812	300496	中科创达	2020-12-31	2021-01-14	117.00	3,300.00	386,100.00
2020123100010768	300003	乐普医疗	2020-12-31	2021-01-14	27.18	13,700.00	372,366.00
2020123100010746	300207	欣旺达	2020-12-31	2021-01-14	30.71	11,700.00	359,307.00
2020123100010792	300253	卫宁健康	2020-12-31	2021-01-14	17.50	20,000.00	350,000.00
2020123100010732	300136	信维通信	2020-12-31	2021-01-14	35.88	9,600.00	344,448.00
2020123100010666	300529	健帆生物	2020-12-31	2021-01-14	67.82	4,700.00	318,754.00
2020123100010672	300037	新宙	2020-12-31	2021-01-14	101.40	3,100.00	314,340.00

		邦					
2020123100010502	300144	宋城演艺	2020-12-31	2021-01-14	17.72	17,500.00	310,100.00
2020123100010690	300558	贝达药业	2020-12-31	2021-01-14	107.37	2,800.00	300,636.00
2020123100010718	300308	中际旭创	2020-12-31	2021-01-14	50.86	5,900.00	300,074.00
2020123100010496	300033	同花顺	2020-12-31	2021-01-14	123.98	2,400.00	297,552.00
2020123100010808	300595	欧普康视	2020-12-31	2021-01-14	81.92	3,600.00	294,912.00
2020123100010722	300699	光威复材	2020-12-31	2021-01-14	89.05	3,300.00	293,865.00
2020123100010770	300661	圣邦股份	2020-12-31	2021-01-14	263.80	1,100.00	290,180.00
2020123100010816	300759	康龙化成	2020-12-31	2021-01-14	120.40	2,400.00	288,960.00
2020123100010676	300676	华大基因	2020-12-31	2021-01-14	128.56	2,200.00	282,832.00
2020123100010780	300073	当升科技	2020-12-31	2021-01-14	64.85	4,200.00	272,370.00
2020123100010802	300357	我武生物	2020-12-31	2021-01-14	76.70	3,100.00	237,770.00
2020123100010668	300628	亿联网络	2020-12-31	2021-01-14	73.12	3,100.00	226,672.00
2020123100010742	300383	光环新网	2020-12-31	2021-01-14	17.17	12,900.00	221,493.00
2020123100010712	300146	汤臣倍健	2020-12-31	2021-01-14	24.15	8,900.00	214,935.00
2020123100010814	300088	长信科技	2020-12-31	2021-01-14	8.89	24,100.00	214,249.00
2020123100010714	300316	晶盛机电	2020-12-31	2021-01-14	30.08	7,000.00	210,560.00
2020123100010756	300463	迈克生物	2020-12-31	2021-01-14	46.60	4,300.00	200,380.00
2020123100010682	300001	特锐德	2020-12-31	2021-01-14	29.36	6,600.00	193,776.00
2020123100010776	300271	华宇软件	2020-12-31	2021-01-14	23.87	8,000.00	190,960.00
2020123100010692	300482	万孚生物	2020-12-31	2021-01-14	89.21	2,100.00	187,341.00
2020123100010766	300070	碧水源	2020-12-31	2021-01-14	7.65	24,000.00	183,600.00
2020123100010736	300244	迪安	2020-12-31	2021-01-14	34.28	5,200.00	178,256.00

		诊断					
2020123100010740	300024	机器人	2020-12-31	2021-01-14	12.30	13,900.00	170,970.00
2020123100010500	300618	寒锐钴业	2020-12-31	2021-01-14	94.91	1,800.00	170,838.00
2020123100010744	300418	昆仑万维	2020-12-31	2021-01-14	19.95	8,300.00	165,585.00
2020123100010752	300115	长盈精密	2020-12-31	2021-01-14	24.65	6,700.00	165,155.00
2020123100010738	300017	网宿科技	2020-12-31	2021-01-14	6.89	23,400.00	161,226.00
2020123100010710	300009	安科生物	2020-12-31	2021-01-14	14.68	10,500.00	154,140.00
2020123100010492	300315	掌趣科技	2020-12-31	2021-01-14	5.11	29,800.00	152,278.00
2020123100010796	300251	光线传媒	2020-12-31	2021-01-14	12.07	12,400.00	149,668.00
2020123100010786	300502	新易盛	2020-12-31	2021-01-14	55.48	2,600.00	144,248.00
2020123100010720	300212	易华录	2020-12-31	2021-01-14	30.65	4,700.00	144,055.00
2020123100010684	300773	拉卡拉	2020-12-31	2021-01-14	29.92	4,800.00	143,616.00
2020123100010724	300058	蓝色光标	2020-12-31	2021-01-14	6.00	23,900.00	143,400.00
2020123100010694	300296	利亚德	2020-12-31	2021-01-14	6.36	22,200.00	141,192.00
2020123100010688	300630	普利制药	2020-12-31	2021-01-14	41.89	3,200.00	134,048.00
2020123100010698	300747	锐科激光	2020-12-31	2021-01-14	87.86	1,500.00	131,790.00
2020123100010700	300223	北京君正	2020-12-31	2021-01-14	91.49	1,400.00	128,086.00
2020123100010758	300457	赢合科技	2020-12-31	2021-01-14	30.05	4,200.00	126,210.00
2020123100010774	300451	创业慧康	2020-12-31	2021-01-14	13.53	8,900.00	120,417.00
2020123100010810	300476	胜宏科技	2020-12-31	2021-01-14	21.57	5,300.00	114,321.00
2020123100010760	300294	博雅生物	2020-12-31	2021-01-14	33.54	3,400.00	114,036.00
2020123100010778	300188	美亚柏科	2020-12-31	2021-01-14	21.54	5,200.00	112,008.00
2020123100010762	300226	上海	2020-12-31	2021-01-14	65.60	1,700.00	111,520.00

		钢联					
2020123100010494	300166	东方国信	2020-12-31	2021-01-14	10.95	9,200.00	100,740.00
2020123100010794	300567	精测电子	2020-12-31	2021-01-14	54.94	1,800.00	98,892.00
2020123100010728	300474	景嘉微	2020-12-31	2021-01-14	69.91	1,400.00	97,874.00
2020123100010754	300369	绿盟科技	2020-12-31	2021-01-14	15.28	6,300.00	96,264.00
2020123100010788	300026	红日药业	2020-12-31	2021-01-14	4.58	20,900.00	95,722.00
2020123100010704	300770	新媒股份	2020-12-31	2021-01-14	70.30	1,300.00	91,390.00
2020123100010490	300113	顺网科技	2020-12-31	2021-01-14	17.15	5,200.00	89,180.00
2020123100010674	300072	三聚环保	2020-12-31	2021-01-14	5.68	14,900.00	84,632.00
2020123100010670	300010	豆神教育	2020-12-31	2021-01-14	9.76	8,400.00	81,984.00
2020123100010678	300180	华峰超纤	2020-12-31	2021-01-14	5.91	13,500.00	79,785.00
2020123100010730	300133	华策影视	2020-12-31	2021-01-14	6.18	12,600.00	77,868.00
2020121700000905	300182	捷成股份	2020-12-17	2021-01-07	3.23	24,100.00	77,843.00
2020123100010696	300748	金力永磁	2020-12-31	2021-01-14	36.34	1,900.00	69,046.00
2020123100010798	300666	江丰电子	2020-12-31	2021-01-14	49.51	1,200.00	59,412.00
2020123100010820	300761	立华股份	2020-12-31	2021-01-14	31.02	1,200.00	37,224.00
2020123100010680	300768	迪普科技	2020-12-31	2021-01-14	36.39	1,000.00	36,390.00
合计						867,600.00	34,590,563.00

注：出借证券中其他流通受限的情况详见本报告‘本基金持有的流通受限证券’部分内容。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	56,100.00	39,300.00
未评级	-	-
合计	56,100.00	39,300.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于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。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进

行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,053,856.21	-	-	-	3,053,856.21
结算备付金	19,420.52	-	-	-	19,420.52
存出保证金	8,331.78	-	-	-	8,331.78
交易性金融资产	-	-	56,100.00	345,810,024.12	345,866,124.12
应收证券清算款	-	-	-	253,406.52	253,406.52

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	859.25	859.25
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,081,608.51	-	56,100.00	346,064,289.89	349,201,998.40
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	-	-	-	147,819.15	147,819.15
应付托管费	-	-	-	29,563.84	29,563.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,055.77	2,055.77
应付交易费用	-	-	-	41,006.71	41,006.71
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	290,000.00	290,000.00
负债总计	-	-	-	510,445.47	510,445.47
利率敏感度缺口	3,081,608.51	-	56,100.00	345,553,844.42	348,691,552.93
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
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
			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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资(可转换债券、可交换债券投资除外)或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。(上年度末：同)

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	345,810,024.12	99.17	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	56,100.00	0.02	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	345,866,124.12	99.19	100,124,256.21	99.34

注：1.债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 1,749	增加约 484
2.业绩比较基准下降 5%	减少约 1,749	减少约 484	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 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

于本期末，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 344,195,687.02 元，属于第二层次的余额为 1,670,437.10 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 100,084,956.21 元，第二层次 39,300.00 元，第三层次 0.00 元）。

(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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	345,810,024.12	99.03
	其中：股票	345,810,024.12	99.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,100.00	0.02
	其中：债券	56,100.00	0.02
	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	3,073,276.73	0.88
8	其他各项资产	262,597.55	0.08
9	合计	349,201,998.40	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,376,863.17	2.98
B	采矿业	-	-
C	制造业	225,060,379.90	64.54
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	398,459.72	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	15,247.08	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,459,160.14	9.60
J	金融业	26,280,722.00	7.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,371,000.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	9,587,451.20	2.75

N	水利、环境和公共设施管理业	1,791,628.53	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	26,058,948.80	7.47
R	文化、体育和娱乐业	11,410,163.58	3.27
S	综合	-	-
	合计	345,810,024.12	99.17

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	115,900	40,693,649.00	11.67
2	300059	东方财富	756,180	23,441,580.00	6.72
3	300760	迈瑞医疗	46,018	19,603,668.00	5.62
4	300015	爱尔眼科	199,150	14,914,343.50	4.28
5	300124	汇川技术	124,696	11,634,136.80	3.34
6	300122	智飞生物	68,100	10,072,671.00	2.89
7	300014	亿纬锂能	122,775	10,006,162.50	2.87
8	300498	温氏股份	547,779	9,986,011.17	2.86
9	300347	泰格医药	58,510	9,455,801.10	2.71
10	300274	阳光电源	107,000	7,733,960.00	2.22
11	300782	卓胜微	12,060	6,880,712.40	1.97
12	300142	沃森生物	175,000	6,748,000.00	1.94
13	300601	康泰生物	34,300	5,985,350.00	1.72
14	300413	芒果超媒	75,530	5,475,925.00	1.57
15	300450	先导智能	65,000	5,459,350.00	1.57
16	300454	深信服	20,400	5,059,404.00	1.45
17	300433	蓝思科技	151,250	4,629,762.50	1.33
18	300408	三环集团	119,784	4,461,954.00	1.28
19	300999	金龙鱼	41,230	4,435,387.70	1.27
20	300012	华测检测	154,600	4,231,402.00	1.21
21	300677	英科医疗	23,000	3,867,450.00	1.11
22	300285	国瓷材料	84,450	3,809,539.50	1.09
23	300496	中科创达	31,700	3,708,900.00	1.06
24	300003	乐普医疗	131,100	3,563,298.00	1.02
25	300207	欣旺达	112,200	3,445,662.00	0.99
26	300253	卫宁健康	191,970	3,359,475.00	0.96
27	300136	信维通信	92,600	3,322,488.00	0.95
28	300037	新宙邦	29,500	2,991,300.00	0.86
29	300144	宋城演艺	168,460	2,985,111.20	0.86
30	300661	圣邦股份	11,250	2,967,750.00	0.85
31	300529	健帆生物	43,740	2,966,446.80	0.85
32	300595	欧普康视	35,000	2,867,200.00	0.82

33	300308	中际旭创	56,280	2,862,400.80	0.82
34	300033	同花顺	22,900	2,839,142.00	0.81
35	300558	贝达药业	26,300	2,823,831.00	0.81
36	300699	光威复材	31,700	2,822,885.00	0.81
37	300759	康龙化成	23,000	2,769,200.00	0.79
38	300676	华大基因	20,000	2,571,200.00	0.74
39	300724	捷佳伟创	17,400	2,533,440.00	0.73
40	300073	当升科技	38,900	2,522,665.00	0.72
41	300357	我武生物	30,198	2,316,186.60	0.66
42	300628	亿联网络	29,900	2,186,288.00	0.63
43	300383	光环新网	122,300	2,099,891.00	0.60
44	300146	汤臣倍健	85,557	2,066,201.55	0.59
45	300088	长信科技	229,000	2,035,810.00	0.58
46	300316	晶盛机电	65,800	1,979,264.00	0.57
47	300001	特锐德	64,300	1,887,848.00	0.54
48	300463	迈克生物	39,400	1,836,040.00	0.53
49	300271	华宇软件	76,500	1,826,055.00	0.52
50	300070	碧水源	228,736	1,749,830.40	0.50
51	300482	万孚生物	19,200	1,712,832.00	0.49
52	300244	迪安诊断	49,265	1,688,804.20	0.48
53	300024	机器人	132,600	1,630,980.00	0.47
54	300115	长盈精密	64,917	1,600,204.05	0.46
55	300618	寒锐钴业	16,660	1,581,200.60	0.45
56	300418	昆仑万维	79,200	1,580,040.00	0.45
57	300017	网宿科技	223,700	1,541,293.00	0.44
58	300009	安科生物	100,100	1,469,468.00	0.42
59	300315	掌趣科技	284,300	1,452,773.00	0.42
60	300251	光线传媒	119,600	1,443,572.00	0.41
61	300058	蓝色光标	228,500	1,371,000.00	0.39
62	300212	易华录	44,305	1,357,948.25	0.39
63	300502	新易盛	24,400	1,353,712.00	0.39
64	300296	利亚德	211,600	1,345,776.00	0.39
65	300773	拉卡拉	44,700	1,337,424.00	0.38
66	300630	普利制药	30,489	1,277,184.21	0.37
67	300298	三诺生物	34,900	1,249,420.00	0.36
68	300775	三角防务	30,400	1,198,368.00	0.34
69	300747	锐科激光	13,500	1,186,110.00	0.34
70	300457	赢合科技	39,000	1,171,950.00	0.34
71	300451	创业慧康	85,200	1,152,756.00	0.33
72	300223	北京君正	12,100	1,107,029.00	0.32
73	300476	胜宏科技	50,900	1,097,913.00	0.31
74	300294	博雅生物	32,700	1,096,758.00	0.31
75	300188	美亚柏科	49,300	1,061,922.00	0.30

76	300226	上海钢联	15,080	989,248.00	0.28
77	300166	东方国信	88,700	971,265.00	0.28
78	300369	绿盟科技	61,400	938,192.00	0.27
79	300674	宇信科技	27,500	933,075.00	0.27
80	300770	新媒股份	13,240	930,772.00	0.27
81	300026	红日药业	200,100	916,458.00	0.26
82	300567	精测电子	16,200	890,028.00	0.26
83	300456	赛微电子	36,900	878,958.00	0.25
84	300474	景嘉微	12,300	859,893.00	0.25
85	300113	顺网科技	48,900	838,635.00	0.24
86	300072	三聚环保	143,710	816,272.80	0.23
87	300010	豆神教育	80,200	782,752.00	0.22
88	300180	华峰超纤	128,663	760,398.33	0.22
89	300182	捷成股份	230,900	745,807.00	0.21
90	300133	华策影视	120,600	745,308.00	0.21
91	300616	尚品宅配	8,900	708,974.00	0.20
92	300741	华宝股份	12,600	691,362.00	0.20
93	300666	江丰电子	13,100	648,581.00	0.19
94	300748	金力永磁	17,400	632,316.00	0.18
95	300682	朗新科技	43,100	630,122.00	0.18
96	300633	开立医疗	21,000	543,060.00	0.16
97	300766	每日互动	28,600	471,614.00	0.14
98	300768	迪普科技	11,000	400,290.00	0.11
99	300761	立华股份	12,600	390,852.00	0.11
100	300783	三只松鼠	9,300	382,137.00	0.11
101	300880	迦南智能	3,732	129,612.36	0.04
102	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03
103	300896	爱美客	109	65,766.24	0.02
104	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
105	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.01
106	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
107	300867	圣元环保	884	28,261.48	0.01
108	300894	火星号	628	23,217.16	0.01
109	300872	天阳科技	585	22,136.40	0.01
110	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
111	300871	回盛生物	515	19,930.50	0.01
112	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
113	300861	美畅股份	328	16,760.80	0.00
114	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
115	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
116	300873	海晨股份	369	15,247.08	0.00
117	300868	杰美特	334	14,455.52	0.00
118	300860	锋尚文化	114	14,440.38	0.00

119	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
120	300864	南大环境	149	13,536.65	0.00
121	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
122	300889	爱克股份	427	12,861.24	0.00
123	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
124	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
125	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
126	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
127	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
128	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
129	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
130	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
131	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300782	卓胜微	5,701,431.94	5.66
2	300750	宁德时代	5,127,499.26	5.09
3	300677	英科医疗	3,763,180.30	3.73
4	300999	金龙鱼	3,470,250.87	3.44
5	300037	新宙邦	3,135,157.39	3.11
6	300059	东方财富	2,731,518.48	2.71
7	300661	圣邦股份	2,079,740.46	2.06
8	300308	中际旭创	1,884,971.74	1.87
9	300770	新媒股份	1,659,174.20	1.65
10	300498	温氏股份	1,581,741.20	1.57
11	300502	新易盛	1,515,047.31	1.50
12	300298	三诺生物	1,363,094.00	1.35
13	300601	康泰生物	1,310,148.00	1.30
14	300014	亿纬锂能	1,293,445.30	1.28
15	300433	蓝思科技	1,159,308.00	1.15
16	300223	北京君正	1,107,677.00	1.10
17	300456	赛微电子	1,065,678.60	1.06
18	300759	康龙化成	1,038,409.00	1.03
19	300773	拉卡拉	1,013,291.00	1.01
20	300451	创业慧康	1,005,968.50	1.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	2,777,190.09	2.76
2	300059	东方财富	2,728,252.20	2.71
3	300760	迈瑞医疗	2,415,813.68	2.40
4	300168	万达信息	2,398,152.39	2.38
5	300014	亿纬锂能	1,833,757.30	1.82
6	300015	爱尔眼科	1,441,707.80	1.43
7	300124	汇川技术	1,273,032.10	1.26
8	300750	宁德时代	1,196,804.00	1.19
9	300347	泰格医药	1,121,314.00	1.11
10	300459	金科文化	887,779.14	0.88
11	300869	康泰医学	878,681.50	0.87
12	300098	高新兴	832,439.00	0.83
13	300078	思创医惠	795,810.00	0.79
14	300770	新媒股份	760,800.00	0.75
15	300136	信维通信	750,972.06	0.75
16	300003	乐普医疗	703,987.58	0.70
17	300274	阳光电源	693,145.60	0.69
18	300324	旋极信息	672,642.00	0.67
19	300408	三环集团	627,984.00	0.62
20	300999	金龙鱼	620,207.16	0.62

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	72,352,178.42
卖出股票的收入（成交）总额	57,132,971.32

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	56,100.00	0.02
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	56,100.00	0.02

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123090	三诺转债	330	33,000.00	0.01
2	123083	朗新转债	231	23,100.00	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除东方财富(300059)的发行主体外，没有出现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。

主要违规事实：2020年1月23日，因存在存在以下违规行为：一是一是未对部分投资者进行适当性评估并提出适当性匹配意见；二是提供证券投资顾问服务前未与个别客户签订证券投资顾问服务协议；三是对客户进行不实、误导性营销宣传；四是内部控制不健全，中国证券监督管理委员会上海监管局对东方财富信息股份有限公司的控股参股公司，上海东方财富证券投资咨询有限公司处以责令改正的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,331.78
2	应收证券清算款	253,406.52
3	应收股利	-
4	应收利息	859.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262,597.55

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	4,213,320.00	1.21	转融通融出
2	300059	东方财富	2,449,000.00	0.70	转融通融出
3	300760	迈瑞医疗	2,087,400.00	0.60	转融通融出
4	300015	爱尔眼科	1,550,223.00	0.44	转融通融出
5	300124	汇川技术	1,222,230.00	0.35	转融通融出
6	300122	智飞生物	1,064,952.00	0.31	转融通融出
7	300498	温氏股份	1,046,402.00	0.30	转融通融出
8	300014	亿纬锂能	1,051,350.00	0.30	转融通融出
9	300347	泰格医药	985,821.00	0.28	转融通融出
10	300274	阳光电源	809,536.00	0.23	转融通融出

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		博时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
728	184,380.53	5,188,028.00	3.87%	8,467,336.00	6.31%	120,573,665.00	89.83%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中信证券股份有限公司	1,772,027.00	1.32%
2	招商证券股份有限公司	1,634,313.00	1.22%
3	方正证券股份有限公司	1,195,748.00	0.89%
4	吴丽霞	565,500.00	0.42%
5	陈勇	500,000.00	0.37%
6	杨振山	470,000.00	0.35%
7	深圳市联君投资有限公司	400,000.00	0.30%
8	梅劲枝	297,700.00	0.22%
9	朱洪宏	253,800.00	0.19%
10	徐国忠	226,874.00	0.17%
-	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	120,573,665.00	89.83%

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年12月10日)基金份额总额	34,229,029.00
本报告期初基金份额总额	65,229,029.00
本报告期基金总申购份额	181,500,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	112,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	134,229,029.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人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；3、基金管理人于 2020 年 10 月 16 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳先生不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英先生代任博时基金管理有限公司总经理职务；4、基金管理人于 2021 年 2 月 6 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》，高阳先生任博时基金管理有限公司总经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 40,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	75,988,775.26	60.78%	55,571.62	59.14%	增加 1 个
招商证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	798,494.32	0.64%	583.95	0.62%	-
中金公司	1	12,644,702.97	10.11%	11,775.94	12.53%	-
兴业证券	1	35,598,275.74	28.47%	26,033.85	27.71%	增加 1 个
浙商证券	1	-	-	-	-	-

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，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	50,893.64	34.67%	-	-	-	-
兴业证券	95,880.25	65.33%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于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	2020-12-28
2	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的上海银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-12-22
3	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-12-10
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 20201103	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-11-03
5	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-29
6	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-28
7	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-28
8	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-28
9	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-28
10	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-28
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-16
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通中信银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-10-12
13	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-09-30
14	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	2020-09-25
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告 20200901	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-09-01
16	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-08-31

17	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-08-27
18	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的中信银行、中国银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-08-05
19	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国农业银行非快捷支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	2020-07-23
20	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-07-21
21	博时基金管理有限公司关于博时创业板交易型开放式指数证券投资基金变更基金场内简称的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-07-15
22	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联提供的光大银行通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-07-09
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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、证监会基金电子披露网	2020-05-14
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2020-01-01~2020-12-31	55,614,065.00	93,466,500.00	28,506,900.00	120,573,665.00	89.83%

产品特有风险

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

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

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

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 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
- 13.1.2 《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 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

13.1.6 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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
二〇二一年三月三十一日