

博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金

2023 年中期报告
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§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	6
§4 管理人报告	6
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42

7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 博时
基金主代码	515130
交易代码	515130
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 3 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,463,181.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。其它投资策略包括：债券（除可转换债券）投资策略、存托凭证投资策略、资产支持证券的投资策略、可转换债券投资策略、衍生品投资策略、港股通标的股票投资策略、融资、融券及转融通证券出借、流通受限证券投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即沪深 300 指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪沪深 300 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	王小飞
	联系电话	0755-83169999	021-60637103
	电子邮箱	service@bosera.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	95105568	021-60637228
传真	0755-83195140	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	江向阳	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	277,294.12
本期利润	427,162.91
加权平均基金份额本期利润	0.0069
本期加权平均净值利润率	0.57%
本期基金份额净值增长率	0.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,483,873.32
期末可供分配基金份额利润	0.1702
期末基金资产净值	78,947,054.32
期末基金份额净值	1.1702
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	17.02%

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

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

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

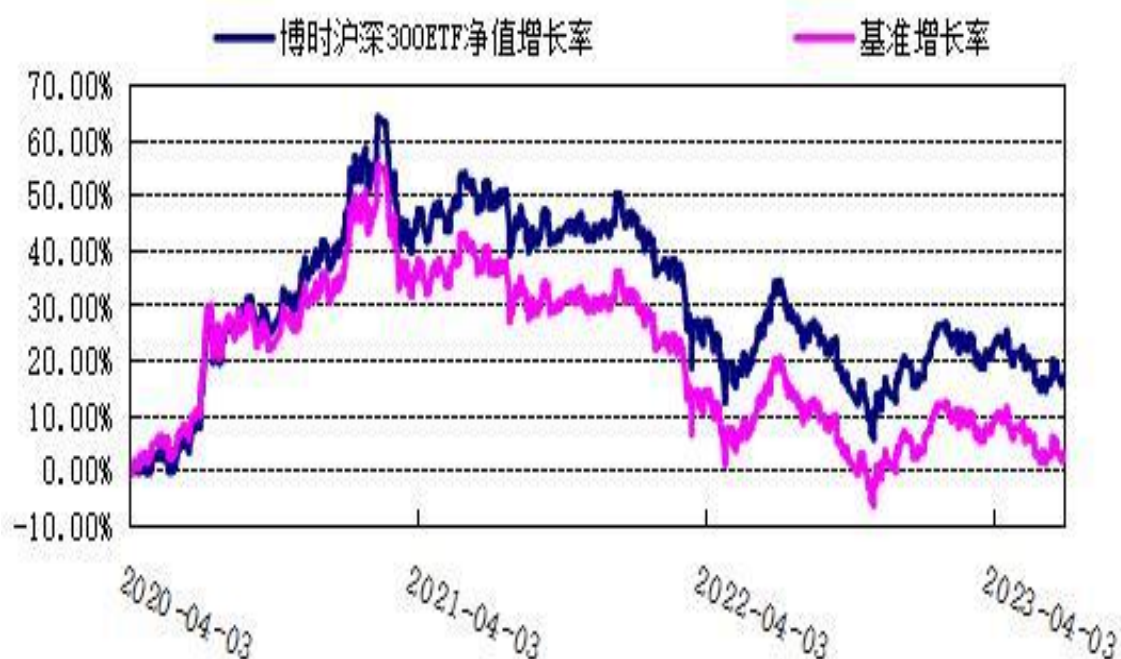
字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.03%	0.86%	1.16%	0.87%	0.87%	-0.01%
过去三个月	-4.18%	0.82%	-5.15%	0.83%	0.97%	-0.01%
过去六个月	0.08%	0.83%	-0.75%	0.84%	0.83%	-0.01%
过去一年	-12.76%	0.98%	-14.33%	0.99%	1.57%	-0.01%
过去三年	6.88%	1.19%	-7.72%	1.20%	14.60%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.02%	1.17%	2.89%	1.18%	14.13%	-0.01%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 14767 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2020-04-03	2023-03-08	16.3	万琼女士，硕士。2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017 年 9 月 29 日-2019 年 9 月 5 日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2019 年 10 月 11 日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板

					指数证券投资基金(2021年4月2日-2023年3月8日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年10月8日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015年10月8日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019年8月1日一至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019年12月30日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年3月18日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2021年5月11日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年5月17日一至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年6月8日一至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月21日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月28日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022年1月10日一至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022年3月3日一至今)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金(QDII)(2022年7月26日一至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023年4月19日一至今)的基金经理。
唐屹兵	基金经理	2022-07-2 2	-	8.0	唐屹兵先生, 硕士。2015 年从美国罗格斯大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、投资经理助理、

					基金经理助理。现任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(2022年7月22日一至今)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2022年7月22日一至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2022年7月22日一至今)、博时创业板指数证券投资基金(2022年7月22日一至今)、博时中证可持续发展100交易型开放式指数证券投资基金(2022年7月22日一至今)、博时沪深300交易型开放式指数证券投资基金(2022年7月22日一至今)、博时上证科创板新材料交易型开放式指数证券投资基金(2022年9月30日一至今)、博时中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金(2023年3月23日一至今)、博时中证机器人指数型发起式证券投资基金(2023年4月4日一至今)、博时上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金(2023年5月18日一至今)、博时北证50成份指数型发起式证券投资基金(2023年5月23日一至今)的基金经理，博时中证银行指数证券投资基金(LOF)的基金经理助理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	6.9	王萌先生，博士。2016年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 89 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年 A 股市场呈现明显的结构行情特征，人工智能相关的 TMT 板块涨幅大幅领先于其他板块，中国特色估值体系相关板块如石油石化、建筑也有不错表现。受二季度经济复苏不及影响的房地产、建材和化工以及消费相关的消费者服务、农林牧渔和食品饮料上半年表现相对落后。主要宽基指数中证 1000 和科创 50 相对领先，创业板指相对落后。风格上大盘价值表现最好。海外主要市场上半年表现出色，日经指数创 1991 年以来新高，纳斯达克指数涨幅也超 30%。本基金为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.1702 元，份额累计净值为 1.1702 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩基准增长率-0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济经历了疫后快速恢复以及后续动能减弱两个阶段。以 PMI 新订单指数为例，1-2 月 PMI 新订单指数从去年底的 43.9 大幅反弹至 1 月的 50.9 和 2 月的 54.1。4 月经济动能走弱，新订单指数大幅回落，从 3 月的 53.6 降至 48.8。展望下半年，三季度国内经济相比二季度有望出现环比改善，上市公司迎来盈利底。本轮 PPI 于 2021 年 10 月见顶，下行周期持续 19 个月，今年 5 月 PPI 同比下跌 4.6%，根据历史经验看，在没有系统性危机的情况下，本轮 PPI 下行不管是从时间周期还是幅度均已具备底部条件。本轮库存周期在 2022 年 4 月触顶，目前已下行 12 个月。后续如果经济继续低位运行，会推动企业加速主动去库存，库存有望加速见底；如果经济边际好转，则企业会进入被动去库存阶段，从历史上看在被动去库存阶段，企业盈利、股市均会出现反弹。PPI 和库存周期与工业企业盈利高度相关，在 PPI 和库存周期

见底的情况下，工业企业盈利在三季度有望见底反弹。在流动性充裕、企业盈利见底反弹以及股市整体估值处于低位的背景下，权益市场下半年迎来配置良机。在投资策略上，本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	1,212,218.49	924,228.22
结算备付金		166,261.43	151,579.83
存出保证金		6,967.97	13,808.28
交易性金融资产	6.4.3.2	77,926,114.45	74,536,717.10
其中：股票投资		77,926,114.45	74,536,717.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		-	-
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		79,311,562.34	75,626,333.43
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,728.85	9,535.50
应付托管费		3,242.94	3,178.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	351,536.23	238,964.89
负债合计		364,508.02	251,678.90
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	67,463,181.00	64,463,181.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	11,483,873.32	10,911,473.53
净资产合计		78,947,054.32	75,374,654.53
负债和净资产总计		79,311,562.34	75,626,333.43

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1702 元，基金份额总额 67,463,181.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
一、营业总收入		663,511.90	-13,958,211.19
1. 利息收入		2,909.29	15,753.24

其中：存款利息收入	6.4.3.10	2,909.29	15,753.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		504,475.95	-15,819,944.41
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-399,803.10	-15,151,745.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	49,568.71
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-1,194,123.46
股利收益	6.4.3.15	904,279.05	476,356.33
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	149,868.79	2,081,240.25
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	6,257.87	-235,260.27
减：二、营业总支出		236,348.99	233,147.09
1. 管理人报酬		55,923.10	53,480.46
2. 托管费		18,641.04	17,826.78
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.3.19	161,784.85	161,839.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		427,162.91	-14,191,358.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		427,162.91	-14,191,358.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		427,162.91	-14,191,358.28

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	64,463,181.00	-	10,911,473.53	75,374,654.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	64,463,181.00	-	10,911,473.53	75,374,654.53
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	3,000,000.00	-	572,399.79	3,572,399.79
（一）、综合收益总 额	-	-	427,162.91	427,162.91
（二）、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数（净值减 少以“-”号填列）	3,000,000.00	-	145,236.88	3,145,236.88
其中：1. 基金申购款	15,000,000.00	-	3,008,929.64	18,008,929.64
2. 基金赎回款	-12,000,000.00	-	-2,863,692.76	-14,863,692.76
（三）、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动（净值减少以 “-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	67,463,181.00	-	11,483,873.32	78,947,054.32
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			

	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	193,463,181.00	-	89,799,168.47	283,262,349.47
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	193,463,181.00	-	89,799,168.47	283,262,349.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-150,000,000.00	-	-74,961,000.07	-224,961,000.07
(一)、综合收益总额	-	-	-14,191,358.28	-14,191,358.28
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-150,000,000.00	-	-60,769,641.79	-210,769,641.79
其中: 1. 基金申购款	39,000,000.00	-	10,563,217.45	49,563,217.45
2. 基金赎回款	-189,000,000.00	-	-71,332,859.24	-260,332,859.24
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	43,463,181.00	-	14,838,168.40	58,301,349.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：佘方方

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

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

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按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。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	1,212,218.49
等于：本金	1,212,107.34
加：应计利息	111.15
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,212,218.49

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	83,875,192.54	-	77,926,114.45	-5,949,078.09
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		83,875,192.54	-	77,926,114.45	-5,949,078.09

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,796.38
其中：交易所市场	9,796.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
应付指数使用费	210,000.00

应付 IOPV 计算与发布费	49,916.99
合计	351,536.23

6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,463,181.00	64,463,181.00
本期申购	15,000,000.00	15,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-12,000,000.00	-12,000,000.00
本期末	67,463,181.00	67,463,181.00

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）。

6.4.3.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,370,558.43	-2,459,084.90	10,911,473.53
本期利润	277,294.12	149,868.79	427,162.91
本期基金份额交易产生的变动数	582,589.88	-437,353.00	145,236.88
其中：基金申购款	3,042,603.38	-33,673.74	3,008,929.64
基金赎回款	-2,460,013.50	-403,679.26	-2,863,692.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,230,442.43	-2,746,569.11	11,483,873.32

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	1,535.39
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	1,294.66	
其他	79.24	
合计	2,909.29	

6.4.3.11 股票投资收益

6.4.3.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	-313,920.44

股票投资收益——赎回差价收入	-85,882.66
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	-399,803.10

6.4.3.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	9,892,452.36
减：卖出股票成本总额	10,175,579.45
减：交易费用	30,793.35
买卖股票差价收入	-313,920.44

6.4.3.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	14,863,692.76
减：现金支付赎回款总额	5,958,258.76
减：赎回股票成本总额	8,991,316.66
减：交易费用	-
赎回差价收入	-85,882.66

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	904,279.05
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	904,279.05

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	149,868.79
——股票投资	149,868.79
——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	149,868.79

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	6,257.87
合计	6,257.87

6.4.3.18 信用减值损失

无。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	22,315.49

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV 计算与发布费	9,916.99
指数使用费	70,000.00
银行汇划费	45.00
合计	161,784.85

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	2,077,592.36	9.76%	-	-

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

无。

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	1,781.75	9.27%	1,222.37	12.48%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	55,923.10
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	18,641.04

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明
6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况
6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用自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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	5,725,450.00	8.49%	7,888,158.00	12.24%

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

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	1,212,218.49	1,535.39	1,971,311.75	5,338.03

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股 份有限公司	600030	中信证券	配股	3,690.00	53,246.70

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 27,700.00 股建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 162,954.00 元，估值总额为人民币 173,402.00 元，占基金资产净值的比例为 0.22%；持有 15,350.00 股招商证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 223,669.80 元，估值总额为人民币 208,299.50 元，占基金资产净值的比例为 0.26%。

（上年度末：本基金持有 26,800.00 股建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 155,150.66 元，估值总额为人民币 150,884.00 元，占基金资产净值的比例为 0.20%；持有 14,850.00 股招商证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 218,390.31 元，估值总额为人民币 197,505.00 元，占基金资产净值的比例为 0.26%。）

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪沪深 300 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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

6.4.9.2 信用风险

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

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

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

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,212,218.49	-	-	-	1,212,218.49
结算备付金	166,261.43	-	-	-	166,261.43
存出保证金	6,967.97	-	-	-	6,967.97
交易性金融资产	-	-	-	77,926,114.45	77,926,114.45
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,385,447.89	-	-	77,926,114.45	79,311,562.34
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,728.85	9,728.85
应付托管费	-	-	-	3,242.94	3,242.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	351,536.23	351,536.23
负债总计	-	-	-	364,508.02	364,508.02
利率敏感度缺	1,385,447.89	-	-	77,561,606.4	78,947,054.

口				3	32
上年度末 2022 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	924,228.22	-	-	-	924,228.22
结算备付金	151,579.83	-	-	-	151,579.83
存出保证金	13,808.28	-	-	-	13,808.28
交易性金融资产	-	-	-	74,536,717.10	74,536,717.10
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,089,616.33	-	-	74,536,717.10	75,626,333.43
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,535.50	9,535.50
应付托管费	-	-	-	3,178.51	3,178.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	238,964.89	238,964.89
负债总计	-	-	-	251,678.90	251,678.90
利率敏感度缺口	1,089,616.33	-	-	74,285,038.20	75,374,654.53

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	77,926,114.45	98.71	74,536,717.10	98.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	77,926,114.45	98.71	74,536,717.10	98.89

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 386	增加约 378
业绩比较基准下降 5%	减少约 386	减少约 378	

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	77,926,114.45
第二层次	-
第三层次	-
合计	77,926,114.45

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	77,926,114.45	98.25
	其中：股票	77,926,114.45	98.25
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	1,378,479.92	1.74
8	其他各项资产	6,967.97	0.01
9	合计	79,311,562.34	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	872,099.80	1.10
B	采矿业	3,038,712.80	3.85
C	制造业	44,030,724.46	55.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,325,828.00	2.95
E	建筑业	1,850,099.80	2.34
F	批发和零售业	259,218.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,428,147.20	3.08
H	住宿和餐饮业	80,446.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,847,821.55	4.87
J	金融业	15,979,236.94	20.24
K	房地产业	1,168,562.00	1.48
L	租赁和商务服务业	728,418.13	0.92
M	科学研究和技术服务业	765,578.32	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	445,170.45	0.56
R	文化、体育和娱乐业	106,051.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	77,926,114.45	98.71

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	600519	贵州茅台	2,600	4,396,600.00	5.57
2	300750	宁德时代	10,880	2,489,235.20	3.15
3	601318	中国平安	44,700	2,074,080.00	2.63

4	600036	招商银行	51,100	1,674,036.00	2.12
5	000858	五粮液	8,039	1,314,939.23	1.67
6	000333	美的集团	20,300	1,196,076.00	1.52
7	002594	比亚迪	3,700	955,599.00	1.21
8	601166	兴业银行	60,010	939,156.50	1.19
9	600900	长江电力	40,400	891,224.00	1.13
10	600276	恒瑞医药	18,416	882,126.40	1.12
11	600030	中信证券	40,290	796,936.20	1.01
12	601899	紫金矿业	68,000	773,160.00	0.98
13	600887	伊利股份	26,300	744,816.00	0.94
14	300059	东方财富	52,403	744,122.60	0.94
15	601012	隆基绿能	24,992	716,520.64	0.91
16	601398	工商银行	144,700	697,454.00	0.88
17	600309	万华化学	7,800	685,152.00	0.87
18	000651	格力电器	18,600	679,086.00	0.86
19	002475	立讯精密	20,609	668,762.05	0.85
20	601328	交通银行	113,400	657,720.00	0.83
21	002415	海康威视	19,300	639,023.00	0.81
22	000725	京东方 A	154,800	633,132.00	0.80
23	000568	泸州老窖	3,000	628,710.00	0.80
24	000063	中兴通讯	13,200	601,128.00	0.76
25	300760	迈瑞医疗	2,000	599,600.00	0.76
26	601816	京沪高铁	101,400	533,364.00	0.68
27	603259	药明康德	8,472	527,890.32	0.67
28	002230	科大讯飞	7,600	516,496.00	0.65
29	300274	阳光电源	4,300	501,509.00	0.64
30	600028	中国石化	78,500	499,260.00	0.63
31	601668	中国建筑	86,600	497,084.00	0.63
32	300124	汇川技术	7,650	491,206.50	0.62
33	002714	牧原股份	11,252	474,271.80	0.60
34	601288	农业银行	131,800	465,254.00	0.59
35	002352	顺丰控股	10,100	455,409.00	0.58
36	000001	平安银行	40,100	450,323.00	0.57
37	601888	中国中免	4,021	444,441.13	0.56
38	002129	TCL 中环	13,350	443,220.00	0.56
39	000792	盐湖股份	22,400	429,408.00	0.54
40	601088	中国神华	13,600	418,200.00	0.53
41	002142	宁波银行	16,380	414,414.00	0.52
42	601138	工业富联	16,400	413,280.00	0.52
43	600031	三一重工	24,500	407,435.00	0.52
44	688981	中芯国际	8,008	404,564.16	0.51
45	300498	温氏股份	21,680	397,828.00	0.50
46	000002	万科 A	28,100	393,962.00	0.50
47	600048	保利发展	29,600	385,688.00	0.49

48	600016	民生银行	102,500	384,375.00	0.49
49	600406	国电南瑞	16,617	383,852.70	0.49
50	600438	通威股份	11,100	380,841.00	0.48
51	600050	中国联通	78,800	378,240.00	0.48
52	600809	山西汾酒	2,040	377,542.80	0.48
53	600837	海通证券	39,900	367,878.00	0.47
54	601601	中国太保	14,100	366,318.00	0.46
55	600690	海尔智家	15,600	366,288.00	0.46
56	601728	中国电信	64,100	360,883.00	0.46
57	600089	特变电工	16,100	358,869.00	0.45
58	600919	江苏银行	48,740	358,239.00	0.45
59	300015	爱尔眼科	19,299	357,996.45	0.45
60	600000	浦发银行	48,500	351,140.00	0.44
61	601857	中国石油	46,800	349,596.00	0.44
62	002371	北方华创	1,100	349,415.00	0.44
63	600941	中国移动	3,700	345,210.00	0.44
64	688111	金山办公	731	345,192.82	0.44
65	600436	片仔癀	1,200	343,632.00	0.44
66	601988	中国银行	87,000	340,170.00	0.43
67	603501	韦尔股份	3,460	339,218.40	0.43
68	002304	洋河股份	2,500	328,375.00	0.42
69	601766	中国中车	50,200	326,300.00	0.41
70	603288	海天味业	6,876	322,140.60	0.41
71	601390	中国中铁	42,400	321,392.00	0.41
72	600905	三峡能源	59,100	317,367.00	0.40
73	300014	亿纬锂能	5,100	308,550.00	0.39
74	600150	中国船舶	9,200	302,772.00	0.38
75	000938	紫光股份	9,460	301,301.00	0.38
76	002466	天齐锂业	4,300	300,613.00	0.38
77	688012	中微公司	1,882	294,438.90	0.37
78	601688	华泰证券	21,300	293,301.00	0.37
79	601225	陕西煤业	16,000	291,040.00	0.37
80	603986	兆易创新	2,708	287,725.00	0.36
81	002459	晶澳科技	6,812	284,060.40	0.36
82	002027	分众传媒	41,700	283,977.00	0.36
83	601169	北京银行	61,100	282,893.00	0.36
84	002460	赣锋锂业	4,640	282,854.40	0.36
85	000338	潍柴动力	22,400	279,104.00	0.35
86	600570	恒生电子	6,274	277,875.46	0.35
87	601985	中国核电	38,900	274,245.00	0.35
88	600104	上汽集团	19,300	273,481.00	0.35
89	002050	三花智控	8,910	269,616.60	0.34
90	000625	长安汽车	20,470	264,677.10	0.34
91	002049	紫光国微	2,820	262,965.00	0.33

92	601211	国泰君安	18,600	260,214.00	0.33
93	600111	北方稀土	10,400	249,392.00	0.32
94	601919	中远海控	26,330	247,502.00	0.31
95	603019	中科曙光	4,860	247,374.00	0.31
96	000100	TCL 科技	62,000	244,280.00	0.31
97	603799	华友钴业	5,320	244,241.20	0.31
98	601628	中国人寿	6,900	241,224.00	0.31
99	002179	中航光电	5,282	239,538.70	0.30
100	600660	福耀玻璃	6,600	236,610.00	0.30
101	601229	上海银行	41,000	235,750.00	0.30
102	601818	光大银行	76,600	235,162.00	0.30
103	600585	海螺水泥	9,900	235,026.00	0.30
104	600893	航发动力	5,500	232,430.00	0.29
105	600009	上海机场	5,100	231,642.00	0.29
106	002271	东方雨虹	8,350	227,621.00	0.29
107	601989	中国重工	47,100	227,022.00	0.29
108	601658	邮储银行	45,800	223,962.00	0.28
109	002555	三七互娱	6,400	223,232.00	0.28
110	300122	智飞生物	4,950	218,790.00	0.28
111	002812	恩捷股份	2,200	211,970.00	0.27
112	600958	东方证券	21,592	209,442.40	0.27
113	000977	浪潮信息	4,300	208,550.00	0.26
114	600999	招商证券	15,350	208,299.50	0.26
115	600019	宝钢股份	36,800	206,816.00	0.26
116	600760	中航沈飞	4,564	205,380.00	0.26
117	002709	天赐材料	4,800	197,712.00	0.25
118	688036	传音控股	1,306	191,982.00	0.24
119	300316	晶盛机电	2,700	191,430.00	0.24
120	688008	澜起科技	3,327	191,036.34	0.24
121	688599	天合光能	4,418	188,250.98	0.24
122	601186	中国铁建	19,000	187,150.00	0.24
123	600426	华鲁恒升	6,100	186,843.00	0.24
124	601360	三六零	14,800	185,592.00	0.24
125	600584	长电科技	5,900	183,903.00	0.23
126	601006	大秦铁路	24,500	182,035.00	0.23
127	601600	中国铝业	32,700	179,523.00	0.23
128	000776	广发证券	12,200	179,462.00	0.23
129	002410	广联达	5,520	179,344.80	0.23
130	300896	爱美客	400	177,980.00	0.23
131	000661	长春高新	1,300	177,190.00	0.22
132	600745	闻泰科技	3,600	176,040.00	0.22
133	002241	歌尔股份	9,900	175,725.00	0.22
134	600547	山东黄金	7,460	175,160.80	0.22
135	300142	沃森生物	6,600	174,570.00	0.22

136	600588	用友网络	8,510	174,455.00	0.22
137	601377	兴业证券	28,490	174,358.80	0.22
138	601939	建设银行	27,700	173,402.00	0.22
139	000596	古井贡酒	700	173,166.00	0.22
140	000166	申万宏源	37,200	171,864.00	0.22
141	002920	德赛西威	1,100	171,391.00	0.22
142	601009	南京银行	21,400	171,200.00	0.22
143	600011	华能国际	18,200	168,532.00	0.21
144	600010	包钢股份	93,700	167,723.00	0.21
145	001979	招商蛇口	12,800	166,784.00	0.21
146	600196	复星医药	5,300	163,770.00	0.21
147	601669	中国电建	28,400	163,016.00	0.21
148	300450	先导智能	4,500	162,765.00	0.21
149	300408	三环集团	5,500	161,425.00	0.20
150	600085	同仁堂	2,800	161,168.00	0.20
151	601800	中国交建	14,700	160,377.00	0.20
152	603659	璞泰来	4,170	159,377.40	0.20
153	002311	海大集团	3,400	159,256.00	0.20
154	300033	同花顺	900	157,752.00	0.20
155	000963	华东医药	3,600	156,132.00	0.20
156	603993	洛阳钼业	29,200	155,636.00	0.20
157	600886	国投电力	12,300	155,595.00	0.20
158	600600	青岛啤酒	1,500	155,445.00	0.20
159	000538	云南白药	2,960	155,340.80	0.20
160	000768	中航西飞	5,700	152,475.00	0.19
161	600845	宝信软件	2,974	151,108.94	0.19
162	002252	上海莱士	19,500	146,445.00	0.19
163	002493	荣盛石化	12,550	146,082.00	0.19
164	601689	拓普集团	1,800	145,260.00	0.18
165	300782	卓胜微	1,500	144,945.00	0.18
166	601100	恒立液压	2,236	143,841.88	0.18
167	000733	振华科技	1,500	143,775.00	0.18
168	600926	杭州银行	12,200	143,350.00	0.18
169	600015	华夏银行	26,300	142,283.00	0.18
170	300347	泰格医药	2,200	141,988.00	0.18
171	600795	国电电力	36,800	140,944.00	0.18
172	600176	中国巨石	9,930	140,608.80	0.18
173	002180	纳思达	4,100	140,425.00	0.18
174	600674	川投能源	9,200	138,460.00	0.18
175	000157	中联重科	20,500	138,375.00	0.18
176	600732	爱旭股份	4,480	137,760.00	0.17
177	603369	今世缘	2,600	137,280.00	0.17
178	002236	大华股份	6,900	136,275.00	0.17
179	600115	中国东航	28,300	134,708.00	0.17

180	600029	南方航空	22,300	134,469.00	0.17
181	000425	徐工机械	19,500	132,015.00	0.17
182	601066	中信建投	5,400	130,680.00	0.17
183	000301	东方盛虹	10,900	128,838.00	0.16
184	601788	光大证券	8,100	128,709.00	0.16
185	601633	长城汽车	5,100	128,367.00	0.16
186	601995	中金公司	3,600	127,872.00	0.16
187	601868	中国能建	53,600	125,424.00	0.16
188	300496	中科创达	1,300	125,255.00	0.16
189	601117	中国化学	15,100	125,028.00	0.16
190	601336	新华保险	3,400	125,018.00	0.16
191	600346	恒力石化	8,700	124,671.00	0.16
192	601877	正泰电器	4,400	121,660.00	0.15
193	002074	国轩高科	4,400	121,528.00	0.15
194	002202	金风科技	11,400	121,068.00	0.15
195	600741	华域汽车	6,500	119,990.00	0.15
196	688126	沪硅产业	5,725	119,652.50	0.15
197	601111	中国国航	14,400	118,656.00	0.15
198	002001	新和成	7,608	117,163.20	0.15
199	601618	中国中冶	29,500	117,115.00	0.15
200	603806	福斯特	3,124	116,181.56	0.15
201	688396	华润微	2,214	116,035.74	0.15
202	688223	晶科能源	8,228	115,685.68	0.15
203	300661	圣邦股份	1,400	114,982.00	0.15
204	600989	宝丰能源	9,100	114,751.00	0.15
205	600188	兖矿能源	3,800	113,696.00	0.14
206	002841	视源股份	1,700	113,628.00	0.14
207	601838	成都银行	9,300	113,553.00	0.14
208	300454	深信服	1,000	113,250.00	0.14
209	002821	凯莱英	960	113,145.60	0.14
210	601615	明阳智能	6,600	111,408.00	0.14
211	601901	方正证券	17,000	111,180.00	0.14
212	000876	新希望	9,400	109,792.00	0.14
213	688303	大全能源	2,699	109,174.55	0.14
214	605117	德业股份	720	107,676.00	0.14
215	300413	芒果超媒	3,100	106,051.00	0.13
216	600460	士兰微	3,500	105,945.00	0.13
217	600039	四川路桥	10,780	105,751.80	0.13
218	000895	双汇发展	4,300	105,307.00	0.13
219	603260	合盛硅业	1,500	105,030.00	0.13
220	002648	卫星化学	6,960	104,121.60	0.13
221	002736	国信证券	11,900	103,887.00	0.13
222	603392	万泰生物	1,552	103,627.04	0.13
223	600233	圆通速递	7,100	103,376.00	0.13

224	601607	上海医药	4,600	103,086.00	0.13
225	000786	北新建材	4,200	102,942.00	0.13
226	300207	欣旺达	6,200	101,184.00	0.13
227	003816	中国广核	32,500	101,075.00	0.13
228	002007	华兰生物	4,490	100,620.90	0.13
229	300999	金龙鱼	2,500	99,975.00	0.13
230	300769	德方纳米	900	99,207.00	0.13
231	300751	迈为股份	580	98,240.40	0.12
232	002601	龙佰集团	5,900	97,350.00	0.12
233	300433	蓝思科技	8,200	96,432.00	0.12
234	300759	康龙化成	2,500	95,700.00	0.12
235	601238	广汽集团	9,100	94,822.00	0.12
236	600383	金地集团	13,100	94,451.00	0.12
237	600332	白云山	2,900	92,452.00	0.12
238	600132	重庆啤酒	1,000	92,160.00	0.12
239	601021	春秋航空	1,600	91,952.00	0.12
240	300223	北京君正	1,000	88,310.00	0.11
241	600219	南山铝业	29,000	87,580.00	0.11
242	600763	通策医疗	900	87,174.00	0.11
243	603290	斯达半导	400	86,080.00	0.11
244	600875	东方电气	4,600	85,790.00	0.11
245	000983	山西焦煤	9,400	85,540.00	0.11
246	002756	永兴材料	1,340	83,897.40	0.11
247	300763	锦浪科技	800	83,280.00	0.11
248	600362	江西铜业	4,300	81,614.00	0.10
249	601865	福莱特	2,100	80,871.00	0.10
250	000723	美锦能源	10,700	80,678.00	0.10
251	600754	锦江酒店	1,900	80,446.00	0.10
252	601699	潞安环能	4,900	79,968.00	0.10
253	600918	中泰证券	11,500	79,465.00	0.10
254	601878	浙商证券	8,000	79,040.00	0.10
255	601872	招商轮船	13,400	77,586.00	0.10
256	601319	中国人保	13,200	77,088.00	0.10
257	601998	中信银行	12,700	75,946.00	0.10
258	600061	国投资本	10,612	75,557.44	0.10
259	000617	中油资本	10,400	75,192.00	0.10
260	000408	藏格矿业	3,300	74,481.00	0.09
261	000069	华侨城 A	16,900	74,360.00	0.09
262	601799	星宇股份	600	74,160.00	0.09
263	300628	亿联网络	2,100	73,647.00	0.09
264	600803	新奥股份	3,800	72,124.00	0.09
265	600884	杉杉股份	4,700	71,158.00	0.09
266	300601	康泰生物	2,800	71,092.00	0.09
267	603833	欧派家居	740	70,892.00	0.09

268	002938	鹏鼎控股	2,900	70,441.00	0.09
269	603486	科沃斯	900	69,993.00	0.09
270	688005	容百科技	1,274	68,821.48	0.09
271	600183	生益科技	4,800	68,160.00	0.09
272	603899	晨光股份	1,500	66,960.00	0.08
273	688363	华熙生物	749	66,780.84	0.08
274	000708	中信特钢	4,200	66,528.00	0.08
275	300919	中伟股份	1,100	66,275.00	0.08
276	601898	中煤能源	7,600	64,144.00	0.08
277	601881	中国银河	5,300	61,533.00	0.08
278	600018	上港集团	11,500	60,375.00	0.08
279	002916	深南电路	800	60,296.00	0.08
280	603185	弘元绿能	800	59,640.00	0.08
281	000877	天山股份	7,100	57,794.00	0.07
282	002120	韵达股份	5,970	57,073.20	0.07
283	601216	君正集团	13,900	56,990.00	0.07
284	002064	华峰化学	8,200	56,252.00	0.07
285	002414	高德红外	7,061	54,863.97	0.07
286	688561	奇安信	1,043	54,037.83	0.07
287	601155	新城控股	3,700	53,317.00	0.07
288	600025	华能水电	7,400	52,762.00	0.07
289	600606	绿地控股	17,368	47,762.00	0.06
290	688065	凯赛生物	739	46,010.14	0.06
291	300957	贝泰妮	500	44,440.00	0.06
292	688187	时代电气	1,059	44,329.74	0.06
293	603195	公牛集团	444	42,650.64	0.05
294	605499	东鹏饮料	200	34,580.00	0.04
295	601698	中国卫通	1,700	33,796.00	0.04
296	601808	中海油服	2,400	33,312.00	0.04
297	000800	一汽解放	3,800	31,806.00	0.04
298	300979	华利集团	600	29,244.00	0.04
299	601236	红塔证券	3,890	28,980.50	0.04
300	001289	龙源电力	600	13,500.00	0.02

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	300750	宁德时代	575,833.20	0.76
2	000858	五粮液	399,284.00	0.53
3	600519	贵州茅台	368,000.00	0.49

4	002594	比亚迪	280,280.00	0.37
5	000333	美的集团	254,285.00	0.34
6	300059	东方财富	204,613.00	0.27
7	300760	迈瑞医疗	188,392.00	0.25
8	002415	海康威视	175,699.00	0.23
9	600028	中国石化	152,208.00	0.20
10	000651	格力电器	149,299.00	0.20
11	000725	京东方 A	143,435.00	0.19
12	600941	中国移动	139,828.00	0.19
13	002352	顺丰控股	138,922.00	0.18
14	000568	泸州老窖	137,284.94	0.18
15	002475	立讯精密	136,254.00	0.18
16	600905	三峡能源	123,347.00	0.16
17	000001	平安银行	121,826.00	0.16
18	002714	牧原股份	120,990.00	0.16
19	600732	爱旭股份	120,715.00	0.16
20	600030	中信证券	115,248.00	0.15

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600519	贵州茅台	690,903.00	0.92
2	300750	宁德时代	581,365.00	0.77
3	000858	五粮液	376,975.00	0.50
4	002594	比亚迪	278,111.40	0.37
5	000333	美的集团	212,901.00	0.28
6	300059	东方财富	191,263.00	0.25
7	002602	世纪华通	182,275.00	0.24
8	300760	迈瑞医疗	160,560.00	0.21
9	600900	长江电力	151,802.00	0.20
10	002415	海康威视	149,425.00	0.20
11	002352	顺丰控股	131,697.00	0.17
12	002475	立讯精密	125,625.00	0.17
13	000651	格力电器	124,217.00	0.16
14	000725	京东方 A	122,561.00	0.16
15	000568	泸州老窖	121,917.00	0.16
16	002008	大族激光	113,521.00	0.15
17	000661	长春高新	111,932.00	0.15
18	000001	平安银行	110,575.00	0.15
19	000792	盐湖股份	108,893.00	0.14
20	300274	阳光电源	107,642.00	0.14

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	11,397,204.67
卖出股票的收入（成交）总额	9,892,452.36

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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会和中国人民银行的处罚。中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

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	6,967.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,967.97

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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,053	32,860.78	24,037,656.00	35.63%	43,425,525.00	64.37%

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	招商证券股份有限公司	5,725,450.00	8.49%
2	中信证券股份有限公司	5,002,915.00	7.42%
3	广发证券股份有限公司	3,765,491.00	5.58%
4	方正证券股份有限公司	3,023,400.00	4.48%
5	戚威	2,952,600.00	4.38%
6	博时基金—招商银行—博时基金汇利 1 号集合资产管理计划	2,582,900.00	3.83%
7	邱峰	1,800,000.00	2.67%
8	中国银河证券股份有限公司	1,606,900.00	2.38%
9	熊璋	1,453,046.00	2.15%
10	陈宗烈	1,000,000.00	1.48%

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

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（2020 年 4 月 3 日）基金份额总额	265,463,181.00
本报告期期初基金份额总额	64,463,181.00
本报告期基金总申购份额	15,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	12,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	67,463,181.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	4,303,232.66	20.21%	4,007.37	20.85%	增加 1 个
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	95,963.00	0.45%	70.16	0.36%	增加 1 个
华创证券	1	479,127.00	2.25%	350.33	1.82%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	162,821.94	0.76%	119.09	0.62%	增加 1 个
甬兴证券	1	167,364.00	0.79%	122.38	0.64%	-
民生证券	1	-	-	-	-	增加 1 个
招商证券	2	2,077,592.36	9.76%	1,781.75	9.27%	增加 1 个
国盛证券	2	220,430.00	1.04%	161.19	0.84%	增加 1 个
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	12,657,826.24	59.46%	11,788.23	61.32%	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	1,125,299.83	5.29%	822.98	4.28%	增加 1 个
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏	2	-	-	-	-	-

源						
瑞银证 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
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-16
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华福证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-30
4	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-22
6	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
7	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
8	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
9	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
10	博时基金管理有限公司关于博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
13	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增长城证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-08
14	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-08

15	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
16	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日