

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 年中期报告  
2020 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

## § 1 重要提示及目录

---

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 30 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	9
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	9
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>9</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	9
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>10</b>
6.1 资产负债表 .....	10
6.2 利润表 .....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	12
6.4 报表附注 .....	13
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	29
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 .....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.12 投资组合报告附注 .....	39
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	40
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>

<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	41
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>43</b>
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 .....	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	43
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>43</b>
12.1 备查文件目录 .....	43
12.2 存放地点 .....	44
12.3 查阅方式 .....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	博时大湾区 ETF
场内简称	恒生湾区
基金主代码	159809
交易代码	159809
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 30 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,173,003.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 21 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采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。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。
业绩比较基准	本基金的标的指数为恒生沪深港通大湾区综合指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即恒生沪深港通大湾区综合指数收益率。
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，跟踪恒生沪深港通大湾区综合指数，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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

邮政编码	518040	518040
法定代表人	江向阳	李建红

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	7,594,692.47
本期利润	11,638,409.52
加权平均基金份额本期利润	0.0493
本期加权平均净值利润率	4.89%
本期基金份额净值增长率	7.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,393,870.46
期末可供分配基金份额利润	0.0505
期末基金资产净值	71,913,403.46
期末基金份额净值	1.0706
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	7.06%

注：本基金成立于 2020 年 4 月 30 日。

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

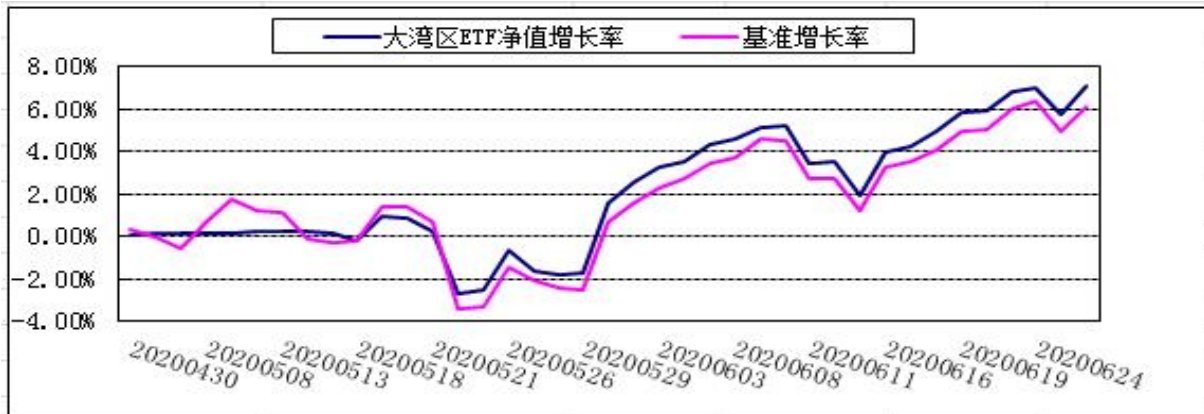
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.93%	1.12%	5.45%	1.16%	3.48%	-0.04%
自基金合同生	7.06%	1.04%	6.16%	1.22%	0.90%	-0.18%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩比较基准为恒生沪深港通大湾区综合指数收益率。

### 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



注：本基金的基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十五部分“（二）投资范围”、“（四）投资组合管理”的有关约定。截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

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

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

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



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

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

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

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	基金经理	2020-04-30	-	13.3	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)的基金经理。现任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 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日一至今)、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 日一至今) 的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 93 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

行情方面，2020 年上半年，市场整体处于上涨行情，在主流宽基指数中，仅偏大盘的上证 50 下跌，跌幅为 3.95%，而沪深 300 上涨 1.64%，偏中小盘的中证 500 上涨 11.33%，中证 1000 上涨 13.52%，科技、医药集中的创业板指表现最好，上涨 35.60%。风格指数方面，中盘成长表现最好，上涨 18.00%，大盘价值表现最弱，下跌 12.62%。行业方面，中信一级行业中，医药、消费者服务、食品饮料、电子、计

算机表现最为抢眼，分别上涨 41.56%、26.32%、25.41%、24.22%、22.92%。而石油石化、煤炭、银行、非银金融、房地产下跌，跌幅分别是 17.47%、15.53%、13.02%、10.67%、8.54%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0706 元，份额累计净值为 1.0706 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 7.06%，同期业绩基准增长率为 6.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年下半年，国内经济有望继续反弹。从流动性方面来看，海外疫情蔓延出使经济衰退风险持续上升，预计未来美联储将继续保持流动性充盈，在此背景下或推动外资持续流入 A 股。从经济基本面上来看，二季度宏观数据显示国内经济在稳步复苏，预计下半年复苏趋势仍将延续。投资仍将是下半年经济的主要驱动力，地产和基建投资增速仍将持续上升。消费增速提升或较为缓慢，可选消费仍有充足修复空间，但提升速度仍受居民收入低增长影响。出口增速有望保持韧性，未来仍取决于海外疫情和复工进度，但对于国内经济的影响或许可控。我们持续看好 A 股和港股市场。在国内经济反弹和企业盈利改善的前提下，A 股和港股有望迎来盈利驱动的上漲行情。此外，中概股回归港股浪潮也有利于提升港股估值中枢。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

#### 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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 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

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	344,087.96
结算备付金		1,964,947.46
存出保证金		160,421.94
交易性金融资产	6.4.7.2	69,359,235.00
其中：股票投资		69,359,235.00
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		5,040,304.80
应收利息	6.4.7.5	1,525.98
应收股利		298,519.02
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	84,146.16
<b>资产总计</b>		<b>77,253,188.32</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>
<b>负 债:</b>		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		4,757,251.72
应付赎回款		-
应付管理人报酬		13,413.81
应付托管费		4,471.25
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	528,443.48
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	36,204.60
<b>负债合计</b>		<b>5,339,784.86</b>
<b>所有者权益:</b>		-
实收基金	6.4.7.9	67,173,003.00
未分配利润	6.4.7.10	4,740,400.46
<b>所有者权益合计</b>		<b>71,913,403.46</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>77,253,188.32</b>

注：1. 报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0706 元，基金份额总额 67,173,003.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年 6月30日
<b>一、收入</b>		<b>12,921,026.47</b>
1. 利息收入		104,436.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	104,436.98
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）		6,287,529.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,912,941.67
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,374,587.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,043,717.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,485,343.44
<b>减：二、费用</b>		<b>1,282,616.95</b>
1. 管理人报酬		59,183.28
2. 托管费		19,727.76
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,139,132.47
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	64,573.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>11,638,409.52</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>11,638,409.52</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	391,173,003.00	-	391,173,003.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,638,409.52	11,638,409.52
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）	-324,000,000.00	-6,898,009.06	-330,898,009.06
其中：1. 基金申购款	-	-	-

2. 基金赎回款	-324,000,000.00	-6,898,009.06	-330,898,009.06
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）	67,173,003.00	4,740,400.46	71,913,403.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2116号《关于准予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注册的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币391,128,842.00元(含所募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0344号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2020年4月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为391,173,003.00份基金份额,其中认购资金利息折合44,161.00份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]414号核准,本基金于2020年5月21日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时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基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、货币市场工具(包括银行存款、同业存单等)、债券回购、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、融券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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不



低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为恒生沪深港通大湾区综合指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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 and 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.01%以上时，方可进行收益分配。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。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	344,087.96
定期存款	-
其他存款	-
合计	344,087.96

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	65,315,517.95	69,359,235.00	4,043,717.05
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	65,315,517.95	69,359,235.00	4,043,717.05

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	121.99
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	1,329.77
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	74.22
合计	1,525.98

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	84,146.16
合计	84,146.16

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	528,443.48



银行间市场应付交易费用	-
合计	528,443.48

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	17,362.04
应付指数使用费	18,842.56
合计	36,204.60

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	391,173,003.00	391,173,003.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-324,000,000.00	-324,000,000.00
本期末	67,173,003.00	67,173,003.00

注：1. 本基金自 2020 年 3 月 30 日至 2020 年 4 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 391,128,842.00 元，折合为 391,128,842.00 份基金份额。根据《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招募说明书》的规定，本基金设立募集期间内认购资金产生的利息收入人民币 44,161.00 元在本基金成立后，折合为 44,161.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《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基金合同》、《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招募说明书》以及《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开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2020 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2020 年 5 月 20 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购业务和赎回业务自 2020 年 5 月 21 日起开始办理。

#### 6.4.7.10 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
基金合同生效日			
本期利润	7,594,692.47	4,043,717.05	11,638,409.52
本期基金份额交易产生的变动数	-4,200,822.01	-2,697,187.05	-6,898,009.06
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4,200,822.01	-2,697,187.05	-6,898,009.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,393,870.46	1,346,530.00	4,740,400.46

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日

活期存款利息收入	82,726.25
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	20,873.93
其他	836.80
合计	104,436.98

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 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4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出股票成交总额	320,927,402.81
减：卖出股票成本总额	316,014,461.14
买卖股票差价收入	4,912,941.67

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	330,898,009.06
减：现金支付赎回款总额	330,898,009.06
减：赎回股票成本总额	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无发生额。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,374,587.33
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	1,374,587.33

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	4,043,717.05
——股票投资	4,043,717.05
——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	4,043,717.05

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,485,343.44
合计	2,485,343.44

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

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,139,132.47
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,139,132.47

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	15,121.80
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	15.00
指数使用费	18,842.56
注册登记费	28,353.84
IOPV 计算及发布费用	2,240.24
合计	64,573.44

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	59,183.28
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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,727.76

注：支付基金托管人招商银行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。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 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

#### 6.4.10.4.1 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。

#### 6.4.10.4.2 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。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5.2 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 6 月 30 日	
	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	4,496,308.00	6.69%

#### 6.4.10.6 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4月30日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	344,087.96	82,726.25

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有 17,900 股招商证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 313,701.29 元，估值总额为人民币 392,905.00 元，占基金资产净值的比例为 0.55%。持有 6,000 股招商证券的 H 股普通股，成本总额为人民币 44,115.14 元，估值总额为人民币 47,571.96 元，占基金资产净值的比例为 0.07%。持有 87,000 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,956,092.49 元，估值总额为人民币 2,933,640.00 元，占基金资产净值的比例为 4.08%。持有 28,500 股招商银行的 H 股普通股，成本总额为人民币 940,342.19 元，估值总额为人民币 928,077.88 元，占基金资产净值的比例为 1.29%。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600185	格力地产	2020-06-30	重大事项	11.61	2020-07-01	12.77	9,000.00	106,560.00	104,490.00	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪恒生沪深港通大湾区综合指数，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。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### 6.4.13.3 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 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。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。

#### 6.4.13.3.1 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	344,087.96	-	-	-	344,087.96
结算备付金	1,964,947.46	-	-	-	1,964,947.46
存出保证金	160,421.94	-	-	-	160,421.94
交易性金融资产	-	-	-	69,359,235.00	69,359,235.00
应收证券清算款	-	-	-	5,040,304.80	5,040,304.80
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,525.98	1,525.98
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	298,519.02	298,519.02
其他资产	-	-	-	84,146.16	84,146.16

资产总计	2,469,457.36	-	-	74,783,730.96	77,253,188.32
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,757,251.72	4,757,251.72
应付管理人报酬	-	-	-	13,413.81	13,413.81
应付托管费	-	-	-	4,471.25	4,471.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	528,443.48	528,443.48
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	36,204.60	36,204.60
负债总计	-	-	-	5,339,784.86	5,339,784.86
利率敏感度缺口	2,469,457.36	-	-	69,443,946.10	71,913,403.46

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 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。本基金持有港股通标的的股票，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	35,518,530.24	35,518,530.24
应收股利	-	298,519.02	298,519.02
资产合计	-	35,817,049.26	35,817,049.26
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	35,817,049.26	35,817,049.26

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的
		影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2020年6月30日



所有外币均相对人民币升值 5%	增加约 179
所有外币均相对人民币贬值 5%	减少约 179

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	69,359,235.00	96.45
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	-	-
<b>合计</b>	<b>69,359,235.00</b>	<b>96.45</b>

#### 6.4.13.4.3.2 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6月30日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 319
	业绩比较基准下降 5%	减少约 319

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间，本基金无基金申购款。

##### (2) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。



第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 69,254,745.00 元，属于第二层次的余额为 104,490.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

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

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	69,359,235.00	89.78
	其中：股票	69,359,235.00	89.78
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	2,309,035.42	2.99

8	其他各项资产	5,584,917.90	7.23
9	合计	77,253,188.32	100.00

注：1、股票投资项包含可退替代款估值增值；

2、权益投资中通过深港通机制投资香港股票金额 35,518,530.24 元，占基金总资产比例 48.99%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,453,613.28	22.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	195,267.20	0.27
E	建筑业	92,099.00	0.13
F	批发和零售业	282,335.20	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,009,264.08	1.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	907,785.00	1.26
J	金融业	10,738,269.00	14.93
K	房地产业	3,141,130.00	4.37
L	租赁和商务服务业	112,218.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	353,293.00	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	203,414.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	143,200.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	208,817.00	0.29
	合计	33,840,704.76	47.06

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
电信业务	8,138,672.75	11.32
房地产	6,143,595.57	8.54
非日常生活消费品	2,509,636.20	3.49
工业	1,404,583.45	1.95
公用事业	1,557,999.80	2.17
金融	13,802,439.21	19.19
日常消费品	759,959.25	1.06
信息技术	662,298.80	0.92
医疗保健	237,727.33	0.33

原材料	301,617.88	0.42
合计	35,518,530.24	49.39

注：1、以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

2、上述按行业分类的港股通股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资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	0700	腾讯控股	17,300	7,879,132.48	10.96
2	601318	中国平安	50,800	3,627,120.00	5.04
3	2318	中国平安	36,500	2,583,893.40	3.59
4	1299	友邦保险	87,600	5,785,253.97	8.04
5	600036	招商银行	87,000	2,933,640.00	4.08
6	3968	招商银行	28,500	928,077.88	1.29
7	0388	香港交易所	8,700	2,622,486.24	3.65
8	000333	美的集团	33,900	2,026,881.00	2.82
9	000651	格力电器	33,400	1,889,438.00	2.63
10	000001	平安银行	134,700	1,724,160.00	2.40
11	600030	中信证券	55,400	1,335,694.00	1.86
12	6030	中信证券	15,500	207,560.97	0.29
13	002475	立讯精密	29,079	1,493,206.65	2.08
14	000002	万科 A	47,200	1,233,808.00	1.72
15	603288	海天味业	7,900	982,760.00	1.37
16	300760	迈瑞医疗	3,000	917,100.00	1.28
17	0003	香港中华煤气	76,850	842,374.37	1.17
18	000063	中兴通讯	17,400	698,262.00	0.97
19	0763	中兴通讯	5,400	116,902.05	0.16
20	1113	长实集团	18,500	780,717.17	1.09
21	0027	银河娱乐	16,000	770,943.36	1.07
22	0016	新鸿基地产	8,500	768,271.55	1.07
23	600048	保利地产	49,700	734,566.00	1.02
24	0011	恒生银行	5,500	653,611.99	0.91
25	1109	华润置地	24,000	643,427.14	0.89
26	2388	中银香港	27,000	607,939.99	0.85
27	002352	顺丰控股	10,700	585,290.00	0.81
28	1928	金沙中国有限公司	20,400	566,478.95	0.79
29	002594	比亚迪	7,500	538,500.00	0.75
30	000100	TCL 科技	84,500	523,900.00	0.73
31	2007	碧桂园	55,000	478,277.18	0.67
32	0291	华润啤酒	12,000	473,527.30	0.66
33	600999	招商证券	17,900	392,905.00	0.55
34	6099	招商证券	6,000	47,571.96	0.07
35	2909	新世界发展	12,250	411,778.75	0.57
36	600383	金地集团	29,800	408,260.00	0.57
37	0066	港铁公司	11,000	403,420.78	0.56

38	000776	广发证券	20,500	289,460.00	0.40
39	1776	广发证券	9,800	74,299.21	0.10
40	300014	亿纬锂能	6,995	334,710.75	0.47
41	300454	深信服	1,600	329,536.00	0.46
42	6098	碧桂园服务	10,000	328,838.40	0.46
43	300601	康泰生物	2,000	324,320.00	0.45
44	300124	汇川技术	7,800	296,322.00	0.41
45	0012	恒基地产	11,000	295,406.50	0.41
46	603160	汇顶科技	1,300	289,770.00	0.40
47	0268	金蝶国际	17,000	279,823.21	0.39
48	001979	招商蛇口	16,500	271,260.00	0.38
49	1997	九龙仓置业	8,000	270,378.24	0.38
50	0270	粤海投资	22,000	267,272.54	0.37
51	3333	中国恒大	14,000	255,763.20	0.36
52	0101	恒隆地产	15,000	251,561.38	0.35
53	1211	比亚迪股份	4,500	246,012.23	0.34
54	2202	万科企业	10,900	243,934.15	0.34
55	002456	欧菲光	13,200	242,748.00	0.34
56	002311	海大集团	4,900	233,191.00	0.32
57	600183	生益科技	7,900	231,233.00	0.32
58	002008	大族激光	5,900	212,105.00	0.29
59	600872	中炬高新	3,600	210,708.00	0.29
60	601138	工业富联	13,800	209,070.00	0.29
61	1193	华润燃气	6,000	206,894.16	0.29
62	0083	信和置业	22,000	195,932.88	0.27
63	0023	东亚银行	11,600	187,547.50	0.26
64	300012	华测检测	9,200	181,792.00	0.25
65	601238	广汽集团	7,400	66,600.00	0.09
66	2238	广汽集团	22,000	112,334.85	0.16
67	000069	华侨城 A	28,500	172,710.00	0.24
68	300529	健帆生物	2,480	172,360.00	0.24
69	300676	华大基因	1,100	171,501.00	0.24
70	002916	深南电路	1,000	167,520.00	0.23
71	0345	VITASOYINTL	6,000	162,500.98	0.23
72	000066	中国长城	12,200	161,040.00	0.22
73	002736	国信证券	14,200	160,460.00	0.22
74	1313	华润水泥控股	18,000	156,033.82	0.22
75	300482	万孚生物	1,500	156,000.00	0.22
76	1972	太古地产	8,400	151,002.59	0.21
77	002600	领益智造	14,200	150,946.00	0.21
78	002465	海格通信	11,200	144,928.00	0.20
79	300115	长盈精密	6,300	143,955.00	0.20
80	603882	金域医学	1,600	143,200.00	0.20
81	600029	南方航空	26,900	139,073.00	0.19
82	0868	信义玻璃	16,000	138,842.88	0.19
83	1128	永利澳门	11,200	136,475.24	0.19
84	002180	纳思达	4,100	134,931.00	0.19
85	300207	欣旺达	7,100	134,190.00	0.19
86	000009	中国宝安	15,200	129,352.00	0.18
87	002340	格林美	25,900	128,723.00	0.18

88	600332	白云山	3,900	126,087.00	0.18
89	0880	澳博控股	16,000	125,689.34	0.17
90	3380	龙光地产	10,000	125,323.97	0.17
91	0008	电讯盈科	31,000	125,159.55	0.17
92	1813	合景泰富集团	10,500	124,876.38	0.17
93	000513	丽珠集团	2,600	124,826.00	0.17
94	002841	视源股份	1,200	119,424.00	0.17
95	0836	华润电力	14,000	116,500.14	0.16
96	0004	九龙仓集团	8,000	115,166.52	0.16
97	0014	希慎兴业	5,000	113,494.92	0.16
98	1816	中广核电力	77,000	112,535.81	0.16
99	600380	健康元	6,800	110,432.00	0.15
100	600004	白云机场	7,200	109,728.00	0.15
101	002152	广电运通	8,400	108,696.00	0.15
102	300146	汤臣倍健	5,500	108,295.00	0.15
103	002709	天赐材料	3,200	108,128.00	0.15
104	002030	达安基因	3,940	107,483.20	0.15
105	002572	索菲亚	4,400	106,348.00	0.15
106	300724	捷佳伟创	1,200	106,236.00	0.15
107	002138	顺络电子	4,200	104,790.00	0.15
108	600185	格力地产	9,000	104,490.00	0.15
109	002797	第一创业	14,600	101,032.00	0.14
110	002511	中顺洁柔	4,500	100,350.00	0.14
111	0010	恒隆集团	6,000	98,761.13	0.14
112	3319	雅生活服务	2,750	98,092.04	0.14
113	0152	深圳国际	8,500	95,810.72	0.13
114	603233	大参林	1,160	94,215.20	0.13
115	300037	新宙邦	1,700	93,602.00	0.13
116	0148	建滔集团	5,000	91,800.72	0.13
117	0867	康哲药业	11,000	91,736.78	0.13
118	2689	玖龙纸业	14,000	89,645.00	0.12
119	0285	比亚迪电子	5,500	89,124.34	0.12
120	000050	深天马 A	5,700	87,552.00	0.12
121	1310	香港宽频	7,000	86,703.72	0.12
122	600728	佳都科技	9,500	86,545.00	0.12
123	0144	招商局港口	10,000	83,671.10	0.12
124	0683	嘉里建设	4,500	82,209.60	0.11
125	603833	欧派家居	700	81,130.00	0.11
126	002939	长城证券	6,500	80,080.00	0.11
127	600673	东阳光	11,500	79,465.00	0.11
128	002317	众生药业	4,600	78,936.00	0.11
129	000999	华润三九	2,700	78,813.00	0.11
130	1233	时代中国控股	6,000	78,482.76	0.11
131	600325	华发股份	11,000	77,660.00	0.11
132	3331	维达国际	3,000	75,906.86	0.11
133	2777	富力地产	9,200	75,800.90	0.11
134	600446	金证股份	3,900	75,660.00	0.11
135	002294	信立泰	2,500	74,150.00	0.10
136	2128	中国联塑	8,000	73,659.80	0.10
137	300457	赢合科技	2,300	73,324.00	0.10

138	1929	周大福	10,800	73,100.78	0.10
139	000967	盈峰环境	8,800	72,600.00	0.10
140	300476	胜宏科技	3,000	72,150.00	0.10
141	6049	保利物业	1,000	71,248.32	0.10
142	000012	南玻 A	13,900	69,778.00	0.10
143	0200	新濠国际发展	5,000	68,508.00	0.10
144	0659	新创建集团	11,000	67,220.05	0.09
145	300770	新媒股份	300	67,098.00	0.09
146	3383	雅居乐集团	8,000	66,644.58	0.09
147	002912	中新赛克	400	65,436.00	0.09
148	600323	瀚蓝环境	2,900	63,452.00	0.09
149	0123	越秀地产	50,000	63,027.36	0.09
150	2282	美高梅中国	6,800	62,113.92	0.09
151	002920	德赛西威	1,000	61,330.00	0.09
152	601636	旗滨集团	10,300	60,976.00	0.08
153	000061	农产品	8,200	60,762.00	0.08
154	3883	中国奥园	7,000	59,912.53	0.08
155	002831	裕同科技	2,100	57,771.00	0.08
156	1888	建滔积层板	8,000	56,925.58	0.08
157	003816	中国广核	19,100	56,536.00	0.08
158	3320	华润医药	13,500	55,121.54	0.08
159	002429	兆驰股份	11,000	54,450.00	0.08
160	000090	天健集团	7,800	53,898.00	0.07
161	000555	神州信息	3,400	52,292.00	0.07
162	0535	金地商置	40,000	52,248.77	0.07
163	300098	高新兴	8,600	52,116.00	0.07
164	002183	怡亚通	9,600	51,456.00	0.07
165	002625	光启技术	7,000	50,750.00	0.07
166	603228	景旺电子	1,440	50,673.60	0.07
167	000921	海信家电	2,800	34,048.00	0.05
168	0059	海信家电	2,000	16,441.92	0.02
169	002191	劲嘉股份	5,600	49,896.00	0.07
170	3311	中国建筑国际	12,000	49,544.99	0.07
171	002670	国盛金控	5,400	49,410.00	0.07
172	000089	深圳机场	6,400	49,024.00	0.07
173	002035	华帝股份	4,800	48,624.00	0.07
174	601333	广深铁路	21,600	48,600.00	0.07
175	600685	中船防务	2,300	38,893.00	0.05
176	0317	中船防务	2,000	9,499.78	0.01
177	1112	H & H 国际控股	1,500	48,024.11	0.07
178	1638	佳兆业集团	18,000	48,010.41	0.07
179	0590	六福集团	3,000	45,982.57	0.06
180	000027	深圳能源	9,880	45,843.20	0.06
181	0839	中教控股	4,000	45,525.85	0.06
182	601615	明阳智能	3,600	44,820.00	0.06
183	0604	深圳控股	20,000	44,758.56	0.06
184	000987	越秀金控	3,800	44,308.00	0.06
185	000078	海王生物	10,500	43,995.00	0.06
186	1055	中国南方航空股份	14,000	43,863.39	0.06
187	300633	开立医疗	1,100	43,615.00	0.06



188	0548	深圳高速公路股份	6,000	42,968.22	0.06
189	1513	丽珠医药	1,200	42,858.60	0.06
190	002815	崇达技术	2,100	42,483.00	0.06
191	300085	银之杰	2,600	41,652.00	0.06
192	000006	深振业 A	6,100	41,541.00	0.06
193	0293	国泰航空	6,000	41,104.80	0.06
194	000028	国药一致	900	40,509.00	0.06
195	1052	越秀交通基建	8,000	39,533.68	0.05
196	300602	飞荣达	1,194	39,187.08	0.05
197	000031	大悦城	7,400	37,666.00	0.05
198	002421	达实智能	9,400	36,472.00	0.05
199	000810	创维数字	3,000	36,240.00	0.05
200	002042	华孚时尚	5,800	36,134.00	0.05
201	002002	大洋电机	9,900	35,739.00	0.05
202	002002	鸿达兴业	9,900	35,739.00	0.05
203	002292	奥飞娱乐	4,200	35,364.00	0.05
204	002168	惠程科技	4,200	34,482.00	0.05
205	603983	丸美股份	400	34,412.00	0.05
206	2314	理文造纸	9,000	34,199.19	0.05
207	300377	赢时胜	3,600	33,624.00	0.05
208	002867	周大生	1,500	33,255.00	0.05
209	300232	洲明科技	4,100	33,169.00	0.05
210	002503	搜于特	11,800	33,158.00	0.05
211	603043	广州酒家	1,000	32,520.00	0.05
212	601139	深圳燃气	5,000	32,500.00	0.05
213	0806	惠理集团	9,000	32,308.37	0.04
214	002611	东方精工	7,000	32,270.00	0.04
215	002672	东江环保	2,800	25,228.00	0.04
216	0895	东江环保	1,400	6,739.36	0.01
217	1668	华南城	44,000	31,751.17	0.04
218	000685	中山公用	4,100	31,570.00	0.04
219	002544	杰赛科技	2,400	31,560.00	0.04
220	3990	美的置业	1,800	31,173.88	0.04
221	0173	嘉华国际	10,000	30,508.90	0.04
222	300616	尚品宅配	500	30,040.00	0.04
223	0754	合生创展集团	4,000	29,449.31	0.04
224	0341	大家乐集团	2,000	29,303.16	0.04
225	1558	东阳光药	2,000	28,937.78	0.04
226	0665	海通国际	17,000	28,727.69	0.04
227	000088	盐田港	4,749	28,114.08	0.04
228	002416	爱施德	3,900	28,002.00	0.04
229	1686	新意网集团	5,000	27,722.90	0.04
230	002419	天虹股份	2,900	27,695.00	0.04
231	1883	中信国际电讯	12,000	26,964.75	0.04
232	1622	力高集团	8,000	26,160.92	0.04
233	002047	宝鹰股份	5,100	25,806.00	0.04
234	002717	岭南股份	5,900	25,370.00	0.04
235	603328	依顿电子	2,400	25,032.00	0.03
236	300197	铁汉生态	9,800	24,892.00	0.03
237	0440	大新金融	1,200	23,785.98	0.03



238	002303	美盈森	5,300	23,055.00	0.03
239	002461	珠江啤酒	2,300	23,046.00	0.03
240	300297	蓝盾股份	5,600	22,456.00	0.03
241	002285	世联行	7,800	21,762.00	0.03
242	0336	华宝国际	7,000	21,739.87	0.03
243	002314	南山控股	5,600	21,056.00	0.03
244	0136	恒腾网络	160,000	21,045.66	0.03
245	000429	粤高速 A	3,000	20,970.00	0.03
246	1212	利福国际	3,500	20,365.14	0.03
247	000040	东旭蓝天	6,700	19,698.00	0.03
248	1788	国泰君安国际	21,000	19,374.06	0.03
249	3613	同仁堂国药	2,000	19,072.63	0.03
250	600548	深高速	2,000	18,280.00	0.03
251	601330	绿色动力	1,800	17,100.00	0.02
252	0059	天誉置业	18,000	16,441.92	0.02
253	600162	香江控股	8,300	16,351.00	0.02
254	0308	香港中旅	16,000	16,076.54	0.02
255	000025	特力 A	800	14,664.00	0.02
256	000881	中广核技	2,000	14,520.00	0.02
257	6055	中烟香港	1,000	14,395.81	0.02
258	300634	彩讯股份	600	13,338.00	0.02
259	0525	广深铁路股份	10,000	13,244.88	0.02
260	1381	粤丰环保	4,000	12,422.78	0.02
261	002482	广田集团	3,700	12,395.00	0.02
262	1383	太阳城集团	10,000	11,692.03	0.02
263	0215	和记电讯香港	10,000	11,235.31	0.02
264	001872	招商港口	700	10,185.00	0.01
265	0315	数码通电讯	2,500	9,476.94	0.01
266	002911	佛燃能源	600	9,120.00	0.01
267	1330	绿色动力环保	3,000	7,371.46	0.01

### 7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	0700	腾讯控股	39,172,104.99	54.47
2	1299	友邦保险	27,723,618.23	38.55
3	601318	中国平安	23,849,953.40	33.16
4	600036	招商银行	20,135,804.93	28.00
5	2318	中国平安	12,475,027.94	17.35
6	000333	美的集团	12,432,506.86	17.29
7	000651	格力电器	11,614,332.84	16.15
8	000001	平安银行	11,426,022.26	15.89
9	0388	香港交易所	10,466,484.27	14.55

10	600030	中信证券	8,136,350.71	11.31
11	000002	万科 A	6,630,460.00	9.22
12	603288	海天味业	5,565,709.92	7.74
13	002475	立讯精密	5,486,512.36	7.63
14	600048	保利地产	4,878,995.00	6.78
15	3968	招商银行	4,734,365.67	6.58
16	0003	香港中华煤气	4,701,067.17	6.54
17	000063	中兴通讯	4,330,773.00	6.02
18	300760	迈瑞医疗	4,235,507.59	5.89
19	1113	长实集团	4,066,408.16	5.65
20	0027	银河娱乐	3,814,569.18	5.30
21	0016	新鸿基地产	3,776,381.97	5.25
22	0011	恒生银行	3,387,640.66	4.71
23	1109	华润置地	3,306,368.29	4.60
24	002352	顺丰控股	3,115,736.73	4.33
25	2388	中银香港	2,970,737.19	4.13
26	1928	金沙中国有限公司	2,887,635.89	4.02
27	000100	TCL 科技	2,713,850.00	3.77
28	2007	碧桂园	2,535,277.51	3.53
29	002594	比亚迪	2,522,781.00	3.51
30	600383	金地集团	2,424,342.00	3.37
31	0291	华润啤酒	2,185,512.47	3.04
32	0066	港铁公司	2,106,928.32	2.93
33	001979	招商蛇口	2,003,395.00	2.79
34	600999	招商证券	1,987,359.00	2.76
35	300601	康泰生物	1,823,327.00	2.54
36	300454	深信服	1,819,309.31	2.53
37	0017	新世界发展	1,810,556.38	2.52
38	000776	广发证券	1,772,167.00	2.46
39	6098	碧桂园服务	1,681,736.30	2.34
40	600183	生益科技	1,586,155.00	2.21
41	0020	会德丰	1,574,707.06	2.19
42	0270	粤海投资	1,534,408.01	2.13
43	0012	恒基地产	1,471,349.85	2.05
44	300124	汇川技术	1,459,546.00	2.03
45	02311	海大集团	1,453,067.00	2.02

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	0700	腾讯控股	32,998,828.77	45.89
2	1299	友邦保险	22,907,316.96	31.85
3	601318	中国平安	20,438,853.78	28.42
4	600036	招商银行	17,695,839.18	24.61
5	000333	美的集团	10,673,674.02	14.84
6	2318	中国平安	10,185,726.36	14.16

7	000651	格力电器	9,723,241.98	13.52
8	000001	平安银行	9,701,965.40	13.49
9	0388	香港交易所	9,325,759.23	12.97
10	002475	立讯精密	8,057,501.77	11.20
11	600030	中信证券	6,710,737.00	9.33
12	000002	万科 A	5,408,051.00	7.52
13	603288	海天味业	4,833,622.24	6.72
14	600048	保利地产	3,992,489.00	5.55
15	3968	招商银行	3,952,915.17	5.50
16	0003	香港中华煤气	3,710,757.29	5.16
17	300760	迈瑞医疗	3,648,574.12	5.07
18	000063	中兴通讯	3,453,034.73	4.80
19	0027	银河娱乐	3,150,886.76	4.38
20	1113	长实集团	3,113,821.60	4.33
21	0016	新鸿基地产	3,036,024.86	4.22
22	300124	汇川技术	2,870,340.57	3.99
23	002352	顺丰控股	2,777,880.00	3.86
24	1109	华润置地	2,730,111.14	3.80
25	00011	恒生银行	2,663,983.01	3.70
26	000100	TCL 科技	2,503,052.00	3.48
27	1928	金沙中国有限公司	2,417,972.29	3.36
28	2388	中银香港	2,365,309.86	3.29
29	002594	比亚迪	2,180,197.30	3.03
30	600383	金地集团	2,090,236.98	2.91
31	2007	碧桂园	2,046,604.73	2.85
32	603160	汇顶科技	1,963,177.00	2.73
33	0291	华润啤酒	1,847,263.57	2.57
34	300014	亿纬锂能	1,800,743.00	2.50
35	001979	招商蛇口	1,759,443.78	2.45
36	0066	港铁公司	1,647,938.43	2.29
37	600999	招商证券	1,637,597.00	2.28
38	0020	会德丰	1,556,405.71	2.16
39	300601	康泰生物	1,502,423.00	2.09
40	000776	广发证券	1,484,366.00	2.06
41	300454	深信服	1,477,107.00	2.05

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	371,636,137.09
卖出股票的收入（成交）总额	320,927,402.81

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 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。

## 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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、平安银行(000001)、中信证券(600030)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：2019年7月8日，因存在交易员操作失误导致银行间债券回购市场达成异常利率交易的违规行为，全国银行间同业拆借中心对招商银行股份有限公司处以通报批评的行政处罚。

主要违规事实：2020年2月3日，因存在汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员、汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平等违规行为，中国银行业监督管理委员会深圳监管局对平安银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2019年11月14日，因存在未按规定及时向证监局报告代为履行营业部负责人职责的违规行为，中国证券监督管理委员会广东监管局对中信证券股份有限公司的控股参股公司中信证券股份有限公司广州番禺万达广场证券营业部处以责令改正的行政监管措施。

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。

7.12.2 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	160,421.94
2	应收证券清算款	5,040,304.80
3	应收股利	298,519.02
4	应收利息	1,525.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	84,146.16
8	其他	-
9	合计	5,584,917.90

### 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

#### 7.12.5.1 期末指数投资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指数投资中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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
1,438	46,712.80	8,562,983.00	12.75%	58,610,020.00	87.25%

## 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	4,495,832.00	6.69%
2	杨凤明	4,089,005.00	6.09%
3	中信证券股份有限公司	3,740,219.00	5.57%
4	李亨堃	3,343,108.00	4.98%
5	张小侠	2,000,291.00	2.98%
6	刘相春	1,200,303.00	1.79%
7	贾丽莹	1,160,090.00	1.73%
8	韩家林	1,000,252.00	1.49%
9	唐晓暄	972,700.00	1.45%
10	罗杰	700,123.00	1.04%

## 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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30日）基金份额总额	391,173,003.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	324,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	67,173,003.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。



## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	531,422,502.22	76.73%	410,590.99	77.70%	新增 1 个
国泰君安	1	153,074,377.88	22.10%	111,953.01	21.19%	新增 1 个
中信证券	1	8,066,659.80	1.16%	5,899.48	1.12%	新增 1 个

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需

(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、个股分析的报告及丰富全面的信息服

务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为

公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

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

### 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	关于博时大湾区 ETF 基金新增中信证券华南为场内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	2020-05-29
5	关于博时大湾区 ETF 基金新增广发证券为场内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	2020-05-22
6	关于博时恒生沪深港通大湾区综合 ETF 基金流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-21
7	博时基金管理有限公司关于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上市交易提示公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-21
8	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开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-18
9	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上市交易公告书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-18
10	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基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-05-06
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	2020-04-17
12	关于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延长募集时间的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-10
13	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上网发售提示公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-30
14	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	2020-03-24
15	博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式	中国证券报、基金管理人网	2020-03-24

	指数证券投资基金托管协议	站、证监会基金电子披露网	
16	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	2020-03-24
17	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基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-24

## § 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

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准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设立的文件。

12.1.2 《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基金合同》

12.1.3 《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托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 报告期内博时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阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日