

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
2021 年中期报告
2021 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：二〇二一年八月三十一日

§ 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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	9
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	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
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	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	36
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	36
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	37
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	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37
§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末上市基金前十名持有人	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
§9 开放式基金份额变动	39

§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
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	19,173,003.00 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	<p>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。</p> <p>本基金其他的投资策略包括债券（除可转换债券）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、融资、融券及转融通证券出借投资策略、流通受限证券投资策略和存托凭证投资策略等。</p>
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	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于中高风险中高收益的开放式基金。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，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。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦

	5999号基金大厦21层	
邮政编码	518040	518040
法定代表人	江向阳	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	4,203,389.39
本期利润	-71,635.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0031
本期加权平均净值利润率	-0.24%
本期基金份额净值增长率	-0.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	4,780,044.85
期末可供分配基金份额利润	0.2493
期末基金资产净值	23,953,047.85
期末基金份额净值	1.2493
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	24.93%

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

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

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

3.2 基金净值表现

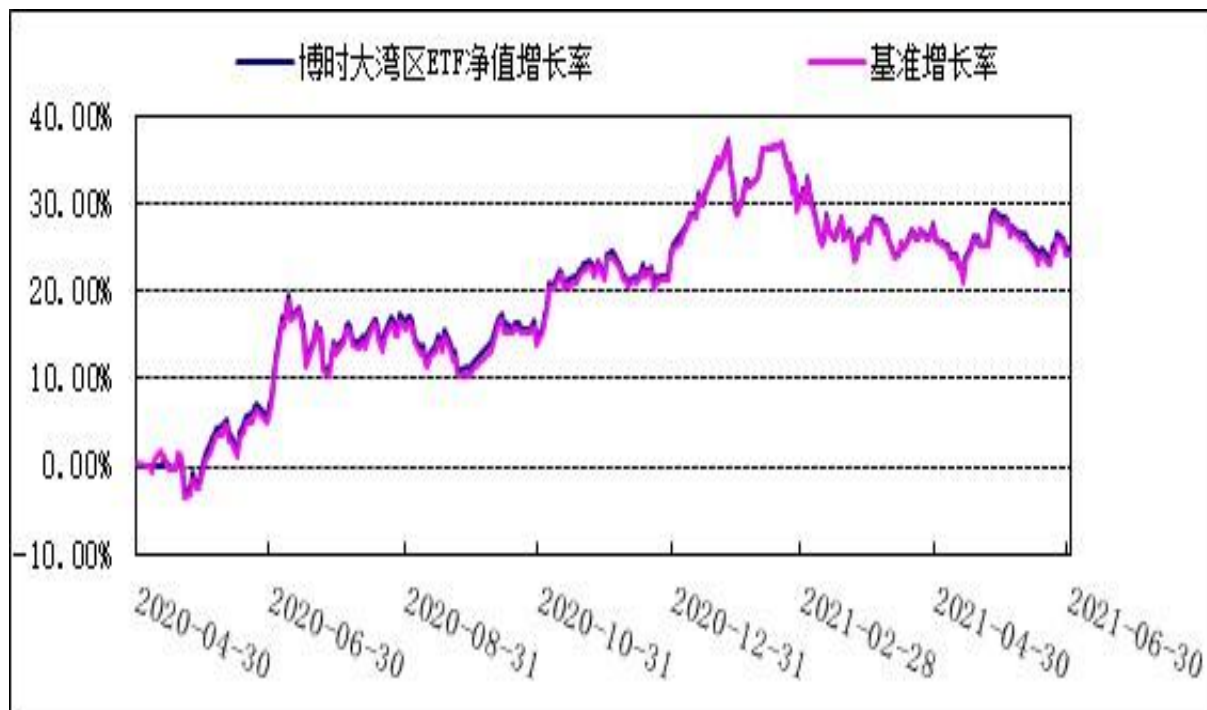
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.64%	0.63%	-2.82%	0.64%	0.18%	-0.01%
过去三个月	-0.79%	0.80%	-1.07%	0.81%	0.28%	-0.01%

过去六个月	-0.29%	1.06%	-0.60%	1.08%	0.31%	-0.02%
过去一年	16.69%	1.10%	17.08%	1.10%	-0.39%	0.00%
自基金合同生效起至今	24.93%	1.09%	24.29%	1.11%	0.64%	-0.02%

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“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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颁奖典礼在北京举办,博时基金凭借在ESG投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果,荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	基金经理	2020-04-30	-	14.3	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)、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)、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)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 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)的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 24 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

回顾上半年，虽然国内以及全球疫情出现了一定的反复，特别是印度出现了 Delta 变异毒株，但整体看不管是国内还是全球经济从疫情中逐渐复苏仍是主线。上半年国内经济延续了去年下半年以来良好的增长状态，上半年 GDP 同比增长 12.7%，相比 2019 年两年平均增长 5.3%。规模以上工业增加值同比增加 15.90%，两年平均增长 6.5%。6 月的 PMI 为 50.9，自去年 3 月以来持续保持在 50 以上。货币政策整体保持稳健，市场流动性充裕。上半年，美国经济正快速从疫情影响中恢复，最新公布的 6 月份经济数据也反应美国经济正处在良好的复苏中。

从 A 股市场来看，过去持续多时的“白马抱团”行情，上半年逐渐出现瓦解松动，市场风格也出现了较大的波动。以创业板为代表的中小盘成长风格表现最好。创业板指上半年上涨 17.2%，中证 500 上涨 6.93%，而沪深 300 只微涨 0.24%，上证 50 则下跌 3.9%。从港股市场来看，上半年港股前高后低，恒生指数上涨 5.86%，恒生中国企业指数下跌 0.7%。能源行业以及医疗保健行业表现出色，涨幅均超过 20%。从海外市场来看，标普 500 在美国经济全面复苏的推动下上半年上涨 14.41%，纳斯达克指数上涨 12.54%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.2493 元，份额累计净值为 1.2493 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-0.29%，同期业绩基准增长率-0.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计随着疫苗的逐步普及，受疫情影响中断的海外产能逐步恢复，支撑疫情后中国经济超预期增长的出口面临边际放缓，同时，上半年大宗商品等原材料价格大幅上涨对企业经营造成的压力，也将在下半年逐渐体现。但下半年流动性相比上半年会更加充裕。香港情况和国内稍有不同，从基本面看，随着疫情的逐渐消除，下半年内地和香港将有望逐步迎来通关的正常化，这将对香港经济的恢复提供重要支撑。但由于香港的货币政策主要受美国影响，考虑到美国经济良好的恢复势头，以及潜在的通胀风险，美元流动性面临拐点。综上，我们预计下半年 A 股和港股维持震荡走势。

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

本基金在本报告期内出现连续了 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

§ 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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	521,204.80	848,898.01
结算备付金		-	-
存出保证金		6,198.88	30,864.03
交易性金融资产	6.4.7.2	23,504,318.28	34,539,096.00
其中：股票投资		23,504,318.28	34,539,096.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	53.19	106.10
应收股利		35,358.38	8,278.06
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,616.24	-
资产总计		24,142,749.77	35,427,242.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2.61	7.20
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,978.23	4,589.90
应付托管费		992.74	1,529.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,006.87	10,846.98
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	180,721.47	113,199.06
负债合计		189,701.92	130,173.11
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	19,173,003.00	28,173,003.00
未分配利润	6.4.7.10	4,780,044.85	7,124,066.09
所有者权益合计		23,953,047.85	35,297,069.09
负债和所有者权益总计		24,142,749.77	35,427,242.20

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2493 元，基金份额总额 19,173,003.00 份。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 30 日（基金合同 生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		188,834.47	12,921,026.47
1. 利息收入		3,479.58	104,436.98
其中：存款利息收入	6.4.3.11	3,479.15	104,436.98
债券利息收入		0.43	-
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）		4,727,657.34	6,287,529.00
其中：股票投资收益	6.4.3.12	4,525,108.97	4,912,941.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	1,076.87	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	405.73	-
股利收益	6.4.3.15	201,065.77	1,374,587.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-4,275,025.17	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）	6.4.3.17	-267,277.28	2,485,343.44
减：二、费用		260,470.25	1,282,616.95
1. 管理人报酬		22,235.41	59,183.28
2. 托管费		7,411.83	19,727.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	48,775.38	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		1.46	-
7. 其他费用	6.4.3.19	182,046.17	64,573.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-71,635.78	11,638,409.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-71,635.78	11,638,409.52

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	28,173,003.00	7,124,066.09	35,297,069.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-71,635.78	-71,635.78
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）	-9,000,000.00	-2,272,385.46	-11,272,385.46
其中：1. 基金申购款	18,000,000.00	6,572,162.99	24,572,162.99
2. 基金赎回款	-27,000,000.00	-8,844,548.45	-35,844,548.45
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）	19,173,003.00	4,780,044.85	23,953,047.85
项目	上年度可比期间		
	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：孙献，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[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。

6.4.3 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
	2021年6月30日
活期存款	521,204.80
定期存款	-
其他存款	-
合计	521,204.80

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,486,586.84	23,504,318.28	2,017,731.44
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	21,486,586.84	23,504,318.28	2,017,731.44

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
	2021年6月30日
应收活期存款利息	50.39
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	-
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	2.80
合计	53.19

6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,006.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,006.87

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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 IOPV 计算与发布费	9,916.99
应付指数使用费	126,173.50
预提费用	44,630.98
合计	180,721.47

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	28,173,003.00	28,173,003.00
本期申购	18,000,000.00	18,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-27,000,000.00	-27,000,000.00
本期末	19,173,003.00	19,173,003.00

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）。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,932,020.45	1,192,045.64	7,124,066.09
本期利润	4,203,389.39	-4,275,025.17	-71,635.78
本期基金份额交易产生的	-3,213,938.67	941,553.21	-2,272,385.46

变动数			
其中：基金申购款	4,273,453.14	2,298,709.85	6,572,162.99
基金赎回款	-7,487,391.81	-1,357,156.64	-8,844,548.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,921,471.17	-2,141,426.32	4,780,044.85

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		2,455.78
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		898.18
其他		125.19
合计		3,479.15

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		2,205,617.89
股票投资收益——赎回差价收入		2,319,491.08
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		4,525,108.97

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		16,815,420.85
减：卖出股票成本总额		14,609,802.96
买卖股票差价收入		2,205,617.89

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
赎回基金份额对价总额		35,844,548.45
减：现金支付赎回款总额		24,628,692.45
减：赎回股票成本总额		8,896,364.92
赎回差价收入		2,319,491.08

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
----	----------------------------	--

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,077.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,000.00
减：应收利息总额	0.43
买卖债券差价收入	1,076.87

6.4.3.13.2 债券投资收益——申购差价收入

无发生额。

6.4.3.13.3 资产支持证券投资收益

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出权证成交总额	417.90
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	12.17
买卖权证差价收入	405.73

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	201,065.77
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	201,065.77

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,274,590.19
——股票投资	-4,274,590.19
——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	-434.98
——权证投资	-434.98
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	-4,275,025.17
----	---------------

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-267,277.28
合计	-267,277.28

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	48,775.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	48,775.38

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行汇划费	140.00
指数使用费	52,974.44
注册登记费	74,383.76
IOPV 计算及发布费用	9,916.99
合计	182,046.17

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

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。

6.4.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020 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	10,365,167.70	30.89%	-	-

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 2021年1月1日至2021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	7,580.23	30.10%	947.43	18.92%
关联方名称	上年度可比期间 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020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	-	-	-	-

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 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	22,235.41	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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 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	7,411.83	19,727.76

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固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,967,498.00	10.26%	2,356,975.00	8.37%

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

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	521,204.80	2,455.78	344,087.96	82,726.25

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

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日,本基金持有 8,900 股招商证券的 A 股普通股,成本总额为人民币 182,505.17 元,估值总额为人民币 169,278.00 元,占基金资产净值的比例为 0.71%。持有 2,200 股招商证券的 H 股普通股,成本总额为人民币 17,041.58 元,估值总额为人民币 19,770.22 元,占基金资产净值的比例为 0.08%。持有 10,400 股招商银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 499,279.68 元,估值总额为人民币 563,576.00 元,占基金资产净值的比例为 2.35%。持有 8,000 股招商银行的 H 股普通股,成本总额为人民币 280,066.23 元,估值总额为人民币 441,002.40 元,占基金资产净值的比例为 1.84%(2020 年 12 月 31 日:本基金持有 13,800 股招商证券的 A 股普通股,成本总额为人民币 230,315.25 元,估值总额为人民币 322,092.00 元,占基金资产净值的比例为 0.91%。持有 3,600 股招商证券的 H 股普通股,成本总额为人民币 27,579.62 元,估值总额为人民币 35,146.89 元,占基金资产净值的比例为 0.10%。持有 15,900 股招商银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 540,251.39 元,估值总额为人民币 698,805.00 元,占基金资产净值的比例为 1.98%。持有 12,000 股招商银行的 H 股普通股,成本总额为人民币 399,284.83 元,估值总额为人民币 494,884.32 元,占基金资产净值的比例为 1.40%)。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末(2021 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。

6.4.9.2 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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额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 2021 年 6 月 30 日 资产	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
银行存款	521,204.80	-	-	-	521,204.80

结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	6,198.88	-	-	-	6,198.88
交易性金融资产	-	-	-	23,504,318.28	23,504,318.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	53.19	53.19
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	35,358.38	35,358.38
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	527,403.68	-	-	23,615,346.09	24,142,749.77
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2.61	2.61
应付管理人报酬	-	-	-	2,978.23	2,978.23
应付托管费	-	-	-	992.74	992.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,006.87	5,006.87
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,721.47	180,721.47
负债总计	-	-	-	189,701.92	189,701.92
利率敏感度缺口	527,403.68	-	-	23,425,644.17	23,953,047.85
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	848,898.01	-	-	-	848,898.01
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	30,864.03	-	-	-	30,864.03
交易性金融资产	-	-	-	34,539,096.00	34,539,096.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	106.10	106.10
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	8,278.06	8,278.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	879,762.04	-	-	34,547,480.16	35,427,242.20
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	7.20	7.20
应付管理人报酬	-	-	-	4,589.90	4,589.90
应付托管费	-	-	-	1,529.97	1,529.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,846.98	10,846.98
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	113,199.06	113,199.06
负债总计	-	-	-	130,173.11	130,173.11
利率敏感度缺口	879,762.04	-	-	34,417,307.05	35,297,069.09

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（不包括可转换债券、可交换债券）或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-	11,855,601.55	11,855,601.55
应收股利	-	35,358.38	35,358.38
资产合计	-	11,890,959.93	11,890,959.93
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	-	11,890,959.93	11,890,959.93
项目	上年度末 2020年12月31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	-	16,655,749.26	16,655,749.26
应收股利	-	8,278.06	8,278.06
资产合计	-	16,664,027.32	16,664,027.32
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表	-	16,664,027.32	16,664,027.32

外汇风险敞口净额			
----------	--	--	--

6.4.9.4.2.2 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 59	增加约 83
	2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 59	减少约 83

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	23,504,318.28	98.13	34,539,096.00	97.85
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	23,504,318.28	98.13	34,539,096.00	97.85

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 65	增加约 146
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 65	减少约 146

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 23,504,318.28 元，属于第二层次的余额为 0.00 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 34,539,096.00 元，第二层次 0.00 元，第三层次 0.00 元）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	23,504,318.28	97.36
	其中：股票	23,504,318.28	97.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入	-	-

	返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	521,204.80	2.16
8	其他各项资产	117,226.69	0.49
9	合计	24,142,749.77	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 11,855,601.55 元，净值占比 49.50%。

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	-	-
B	采矿业	24,993.00	0.10
C	制造业	6,177,053.81	25.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	93,761.20	0.39
E	建筑业	12,719.00	0.05
F	批发和零售业	75,737.92	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	308,205.00	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	273,490.80	1.14
J	金融业	3,472,001.00	14.50
K	房地产业	784,485.00	3.28
L	租赁和商务服务业	29,292.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	169,272.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	42,120.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	95,862.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	89,724.00	0.37
	合计	11,648,716.73	48.63

7.2.2 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	2,336,430.71	9.75
房地产	1,845,973.23	7.71
非日常生活消费品	1,119,297.39	4.67
工业	676,711.53	2.83
公用事业	432,756.93	1.81
金融	4,532,786.58	18.92
日常消费品	340,998.87	1.42
信息技术	375,376.25	1.57
医疗保健	91,651.13	0.38
原材料	103,618.93	0.43
合计	11,855,601.55	49.50

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	0700	腾讯控股	4,700	2,283,893.18	9.53
2	1299	友邦保险	24,200	1,943,156.42	8.11
3	601318	中国平安	18,500	1,189,180.00	4.96
4	0388	香港交易所	2,400	924,207.90	3.86
5	000001	平安银行	39,000	882,180.00	3.68
6	000333	美的集团	9,900	706,563.00	2.95
7	2318	中国平安	11,000	696,076.52	2.91
8	000651	格力电器	11,500	599,150.00	2.50
9	600036	招商银行	10,400	563,576.00	2.35
10	300760	迈瑞医疗	1,000	480,050.00	2.00
11	3968	招商银行	8,000	441,002.40	1.84
12	002594	比亚迪	1,600	401,600.00	1.68
13	600030	中信证券	16,000	399,040.00	1.67
14	603288	海天味业	2,990	385,560.50	1.61
15	000002	万科 A	13,700	326,197.00	1.36
16	1211	比亚迪股份	1,500	289,813.46	1.21
17	300014	亿纬锂能	2,495	259,305.35	1.08
18	300124	汇川技术	3,400	252,484.00	1.05
19	0016	新鸿基地产	2,500	240,679.14	1.00
20	0291	华润啤酒	4,000	232,150.32	0.97
21	0003	香港中华煤气	22,942	230,220.33	0.96
22	002352	顺丰控股	3,200	216,640.00	0.90
23	6098	碧桂园服务	3,000	209,434.54	0.87
24	0027	银河娱乐	4,000	206,855.09	0.86
25	000100	TCL 科技	25,400	194,310.00	0.81
26	0011	恒生银行	1,500	193,583.41	0.81
27	000063	中兴通讯	5,800	192,734.00	0.80
28	1113	长实集团	4,000	178,397.95	0.74
29	600048	保利地产	14,400	173,376.00	0.72
30	600999	招商证券	8,900	169,278.00	0.71
31	2388	中银香港	7,500	164,439.81	0.69
32	1109	华润置地	6,000	157,013.50	0.66
33	1928	金沙中国有限公司	5,600	152,370.49	0.64
34	1997	九龙仓置业	4,000	150,273.65	0.63
35	300454	深信服	500	129,740.00	0.54
36	0066	港铁公司	3,500	125,956.11	0.53
37	002311	海大集团	1,500	122,400.00	0.51
38	002709	天赐材料	1,130	120,435.40	0.50
39	0268	金蝶国际	5,000	109,626.54	0.46
40	0017	新世界发展	3,250	109,116.89	0.46
41	2007	碧桂园	15,000	108,586.44	0.45
42	0868	信义玻璃	4,000	105,341.33	0.44
43	300601	康泰生物	700	104,300.00	0.44
44	603882	金域医学	600	95,862.00	0.40
45	300012	华测检测	2,900	92,452.00	0.39

46	0012	恒基地产	3,000	91,861.63	0.38
47	000776	广发证券	5,900	89,326.00	0.37
48	600383	金地集团	8,600	88,064.00	0.37
49	002841	视源股份	700	87,003.00	0.36
50	600143	金发科技	3,900	81,354.00	0.34
51	002340	格林美	8,600	80,410.00	0.34
52	1193	华润燃气	2,000	77,549.86	0.32
53	300529	健帆生物	880	75,996.80	0.32
54	000009	中国宝安	4,100	74,907.00	0.31
55	601138	工业富联	6,000	74,460.00	0.31
56	0004	九龙仓集团	3,000	73,888.70	0.31
57	6030	中信证券	4,500	72,940.13	0.30
58	1268	美东汽车	2,000	70,477.18	0.29
59	6666	恒大物业	8,500	68,958.63	0.29
60	2202	万科企业	3,400	68,746.45	0.29
61	002008	大族激光	1,700	68,663.00	0.29
62	300207	欣旺达	2,100	68,376.00	0.29
63	0909	明源云	2,000	64,153.37	0.27
64	0285	比亚迪电子	1,500	63,654.12	0.27
65	0101	恒隆地产	4,000	62,772.12	0.26
66	002736	国信证券	5,800	62,350.00	0.26
67	1209	华润万象生活	1,400	61,915.07	0.26
68	0083	信和置业	6,000	61,107.96	0.26
69	000069	华侨城 A	8,200	61,008.00	0.25
70	300037	新宙邦	600	60,060.00	0.25
71	002797	第一创业	8,400	59,976.00	0.25
72	601636	旗滨集团	3,200	59,392.00	0.25
73	300676	华大基因	500	59,300.00	0.25
74	1929	周大福	4,000	59,044.40	0.25
75	002791	坚朗五金	300	58,215.00	0.24
76	0270	粤海投资	6,000	55,716.08	0.23
77	002625	光启技术	2,600	54,106.00	0.23
78	600183	生益科技	2,300	53,843.00	0.22
79	0148	建滔集团	1,500	53,793.97	0.22
80	9922	九毛九	2,000	52,837.08	0.22
81	300146	汤臣倍健	1,600	52,640.00	0.22
82	001979	招商蛇口	4,800	52,560.00	0.22
83	603160	汇顶科技	400	51,852.00	0.22
84	000066	中国长城	3,500	51,100.00	0.21
85	0867	康哲药业	3,000	51,048.11	0.21
86	002138	顺络电子	1,300	50,401.00	0.21
87	1999	敏华控股	3,200	49,685.16	0.21
88	603833	欧派家居	340	48,266.40	0.20
89	0345	VITASOYINTL	2,000	48,011.02	0.20
90	000039	中集集团	2,600	47,268.00	0.20
91	300724	捷佳伟创	400	46,404.00	0.19
92	1972	太古地产	2,400	46,230.36	0.19
93	002600	领益智造	5,000	45,950.00	0.19
94	003816	中国广核	15,800	42,186.00	0.18
95	002030	达安基因	1,984	42,140.16	0.18

96	600872	中炬高新	1,000	42,020.00	0.18
97	002180	纳思达	1,300	41,860.00	0.17
98	300482	万孚生物	620	40,107.80	0.17
99	000012	南玻 A	3,900	39,936.00	0.17
100	0754	合生创展集团	1,300	38,508.66	0.16
101	0023	东亚银行	3,200	38,395.50	0.16
102	0144	招商局港口	4,000	37,743.15	0.16
103	601238	广汽集团	2,900	37,555.00	0.16
104	600332	白云山	1,100	37,235.00	0.16
105	002511	中顺洁柔	1,300	35,815.00	0.15
106	000050	深天马 A	2,500	35,450.00	0.15
107	0836	华润电力	4,000	35,280.19	0.15
108	0880	澳博控股	5,000	35,280.19	0.15
109	2238	广汽集团	6,000	34,797.59	0.15
110	603233	大参林	672	34,345.92	0.14
111	002456	欧菲光	3,800	33,744.00	0.14
112	3333	中国恒大	4,000	33,682.60	0.14
113	002916	深南电路	300	33,339.00	0.14
114	2689	玖龙纸业	4,000	33,150.07	0.14
115	002465	海格通信	3,500	33,110.00	0.14
116	0136	恒腾网络	6,400	33,070.19	0.14
117	002920	德赛西威	300	33,024.00	0.14
118	0010	恒隆集团	2,000	32,950.37	0.14
119	002152	广电运通	2,500	32,575.00	0.14
120	1128	永利澳门	3,200	32,537.66	0.14
121	601615	明阳智能	2,000	32,380.00	0.14
122	0763	中兴通讯	1,600	32,284.70	0.13
123	3319	雅生活服务	1,000	32,159.89	0.13
124	0683	嘉里建设	1,500	31,951.87	0.13
125	2128	中国联塑	2,000	31,885.31	0.13
126	0336	华宝国际	2,000	31,153.08	0.13
127	0008	电讯盈科	9,000	30,479.09	0.13
128	1816	中广核电力	21,000	30,229.47	0.13
129	600380	健康元	2,200	30,206.00	0.13
130	002572	索菲亚	1,200	29,040.00	0.12
131	3380	龙光地产	3,000	29,006.31	0.12
132	1888	建滔积层板	2,000	28,989.67	0.12
133	0839	中教控股	2,000	28,823.25	0.12
134	6993	蓝月亮集团	3,000	27,408.72	0.11
135	300115	长盈精密	1,320	27,192.00	0.11
136	600029	南方航空	4,400	26,488.00	0.11
137	000027	深圳能源	2,880	26,409.60	0.11
138	002850	科达利	300	26,220.00	0.11
139	1813	合景泰富集团	3,000	25,960.90	0.11
140	0014	希慎兴业	1,000	25,752.88	0.11
141	002683	宏大爆破	900	24,993.00	0.10
142	1313	华润水泥控股	4,000	24,563.00	0.10
143	002831	裕同科技	800	23,752.00	0.10
144	2777	富力地产	3,200	23,591.13	0.10
145	600004	白云机场	2,100	23,478.00	0.10

146	002294	信立泰	700	23,030.00	0.10
147	300376	易事特	2,800	22,512.00	0.09
148	0152	深圳国际	2,500	22,341.35	0.09
149	0590	六福集团	1,000	22,299.74	0.09
150	300737	科顺股份	700	22,008.00	0.09
151	002851	麦格米特	700	21,861.00	0.09
152	002429	兆驰股份	3,600	21,852.00	0.09
153	300476	胜宏科技	1,000	21,850.00	0.09
154	600325	华发股份	3,200	21,568.00	0.09
155	000999	华润三九	800	21,400.00	0.09
156	002939	长城证券	1,900	21,147.00	0.09
157	600728	佳都科技	2,800	20,748.00	0.09
158	0659	新创建集团	3,000	20,618.94	0.09
159	300348	长亮科技	1,100	20,130.00	0.08
160	3331	维达国际	1,000	19,886.71	0.08
161	6099	招商证券	2,200	19,770.22	0.08
162	600323	瀚蓝环境	900	19,611.00	0.08
163	2282	美高梅中国	2,000	19,570.52	0.08
164	002191	劲嘉股份	1,800	19,152.00	0.08
165	0123	越秀地产	2,800	19,057.96	0.08
166	1776	广发证券	2,200	18,415.59	0.08
167	002670	国盛金控	1,600	18,224.00	0.08
168	002002	鸿达兴业	4,600	18,078.00	0.08
169	002867	周大生	900	17,793.00	0.07
170	000987	越秀金控	1,400	17,724.00	0.07
171	3311	中国建筑国际	4,000	17,640.10	0.07
172	002967	广电计量	400	17,520.00	0.07
173	002249	大洋电机	3,300	17,325.00	0.07
174	000967	盈峰环境	2,500	17,175.00	0.07
175	3383	雅居乐集团	2,000	16,741.45	0.07
176	300770	新媒股份	340	16,558.00	0.07
177	0293	国泰航空	3,000	16,375.33	0.07
178	9923	移卡	400	16,258.84	0.07
179	3320	华润医药	4,000	16,109.07	0.07
180	002183	怡亚通	2,800	16,044.00	0.07
181	1055	中国南方航空股份	4,000	16,042.50	0.07
182	600446	金证股份	1,100	15,884.00	0.07
183	1310	香港宽频	2,000	15,643.10	0.07
184	600185	格力地产	2,100	15,477.00	0.06
185	600673	东阳光	3,300	14,817.00	0.06
186	1233	时代中国控股	2,000	14,777.74	0.06
187	000089	深圳机场	1,900	14,763.00	0.06
188	2314	理文造纸	3,000	14,752.78	0.06
189	600685	中船防务	700	14,560.00	0.06
190	000555	神州信息	1,000	14,470.00	0.06
191	2039	中集集团	1,000	14,278.49	0.06
192	603228	景旺电子	540	14,148.00	0.06
193	300457	赢合科技	700	13,902.00	0.06
194	1112	H & H 国际控股	500	13,542.10	0.06

195	002285	世联行	2,200	13,486.00	0.06
196	000061	农产品	2,400	13,248.00	0.06
197	601333	广深铁路	6,200	13,144.00	0.05
198	601139	深圳燃气	2,000	13,120.00	0.05
199	000090	天健集团	2,300	12,719.00	0.05
200	0548	深圳高速公路股份	2,000	12,481.20	0.05
201	1638	佳兆业集团	5,000	12,231.58	0.05
202	002416	爱施德	1,200	12,036.00	0.05
203	001914	招商积余	700	12,026.00	0.05
204	0604	深圳控股	6,000	11,932.03	0.05
205	0200	新濠国际发展	1,000	11,865.46	0.05
206	300232	洲明科技	1,300	11,609.00	0.05
207	0535	金地商置	14,000	11,532.63	0.05
208	000921	海信家电	800	11,496.00	0.05
209	000028	国药一致	300	11,352.00	0.05
210	002317	众生药业	1,300	11,193.00	0.05
211	002421	达实智能	2,900	11,136.00	0.05
212	3883	中国奥园	2,000	10,900.25	0.05
213	002351	漫步者	800	10,832.00	0.05
214	3613	同仁堂国药	1,000	10,667.27	0.04
215	300085	银之杰	600	10,590.00	0.04
216	002035	华帝股份	1,400	10,108.00	0.04
217	300377	赢时胜	900	10,026.00	0.04
218	000513	丽珠集团	200	10,004.00	0.04
219	002461	珠江啤酒	900	9,846.00	0.04
220	002912	中新赛克	240	9,832.80	0.04
221	000685	中山公用	1,200	9,792.00	0.04
222	000078	海王生物	3,000	9,780.00	0.04
223	300735	光弘科技	800	9,728.00	0.04
224	1513	丽珠医药	300	9,548.12	0.04
225	0173	嘉华国际	3,000	9,410.82	0.04
226	000881	中广核技	900	9,288.00	0.04
227	603043	广州酒家	360	9,259.20	0.04
228	000006	深振业 A	1,800	9,018.00	0.04
229	000070	特发信息	1,100	8,932.00	0.04
230	0921	海信家电	1,000	8,919.90	0.04
231	0665	海通国际	5,000	8,903.26	0.04
232	300616	尚品宅配	100	8,851.00	0.04
233	300602	飞荣达	494	8,793.20	0.04
234	6049	保利物业	200	8,770.12	0.04
235	002042	华孚时尚	1,800	8,694.00	0.04
236	001872	招商港口	500	8,460.00	0.04
237	002544	杰赛科技	600	8,004.00	0.03
238	000031	大悦城	2,200	7,920.00	0.03
239	002292	奥飞娱乐	1,200	7,776.00	0.03
240	000810	创维数字	900	7,659.00	0.03
241	1052	越秀交通基建	2,000	7,488.72	0.03
242	002503	搜于特	4,400	6,908.00	0.03
243	002243	力合科创	700	6,657.00	0.03

244	002959	小熊电器	100	6,644.00	0.03
245	1686	新意网集团	1,000	6,615.04	0.03
246	1883	中信国际电讯	3,000	6,415.34	0.03
247	300634	彩讯股份	300	6,372.00	0.03
248	1788	国泰君安国际	6,000	6,190.68	0.03
249	3813	宝胜国际	4,000	6,090.83	0.03
250	002672	东江环保	800	5,992.00	0.03
251	603328	依顿电子	800	5,960.00	0.02
252	2356	大新银行集团	800	5,704.74	0.02
253	3990	美的置业	400	5,471.76	0.02
254	601330	绿色动力	600	5,334.00	0.02
255	002419	天虹股份	800	5,248.00	0.02
256	600548	深高速	600	5,232.00	0.02
257	1212	利福国际	1,000	4,959.20	0.02
258	1558	东阳光药	600	4,278.56	0.02
259	1622	力高集团	2,000	4,193.68	0.02
260	000029	深深房 A	500	3,785.00	0.02
261	1381	粤丰环保	1,000	3,761.00	0.02
262	000025	特力 A	200	2,976.00	0.01
263	1330	绿色动力环保	1,000	2,970.53	0.01
264	0525	广深铁路股份	2,000	2,512.88	0.01
265	002911	佛燃能源	240	2,253.60	0.01
266	0895	东江环保	400	1,441.16	0.01

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	601318	中国平安	2,191,336.00	6.21
2	600036	招商银行	896,883.00	2.54
3	000333	美的集团	891,188.00	2.52
4	000001	平安银行	885,753.00	2.51
5	603288	海天味业	713,803.00	2.02
6	600030	中信证券	700,290.00	1.98
7	000651	格力电器	676,873.00	1.92
8	002594	比亚迪	448,518.00	1.27
9	000002	万科 A	416,121.00	1.18
10	0700	腾讯控股	376,071.30	1.07
11	300760	迈瑞医疗	343,538.00	0.97
12	600048	保利地产	328,608.00	0.93
13	600999	招商证券	324,714.50	0.92
14	300124	汇川技术	251,550.00	0.71
15	000100	TCL 科技	235,418.00	0.67
16	300014	亿纬锂能	228,266.00	0.65
17	300454	深信服	191,369.00	0.54
18	1299	友邦保险	186,402.27	0.53
19	002352	顺丰控股	183,069.00	0.52

20	000063	中兴通讯	179,035.00	0.51
----	--------	------	------------	------

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 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	2,622,685.00	7.43
2	0700	腾讯控股	1,599,023.28	4.53
3	1299	友邦保险	1,273,853.87	3.61
4	600036	招商银行	1,161,977.60	3.29
5	600030	中信证券	929,185.00	2.63
6	603288	海天味业	921,985.00	2.61
7	0388	香港交易所	592,454.17	1.68
8	600048	保利地产	445,133.00	1.26
9	600999	招商证券	427,625.64	1.21
10	2318	中国平安	423,990.68	1.20
11	3968	招商银行	254,050.11	0.72
12	600383	金地集团	219,181.00	0.62
13	600143	金发科技	209,743.00	0.59
14	603882	金城医学	194,529.00	0.55
15	1211	比亚迪股份	176,169.91	0.50
16	0027	银河娱乐	163,658.84	0.46
17	603160	汇顶科技	163,093.00	0.46
18	1113	长实集团	156,824.37	0.44
19	0016	新鸿基地产	145,970.16	0.41
20	600872	中炬高新	143,901.00	0.41

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	16,743,529.16
卖出股票的收入（成交）总额	16,815,420.85

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腾讯控股(0700)、平安银行(000001)、招商银行(600036)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：2021年3月12日，因存在腾讯控股有限公司收购猿辅导股权案构成未依法申报违法实施的经营集中，且本案不具有排除、限制竞争的效果的违规行为，国家市场监督管理总局对腾讯控股有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2021年5月28日，因存在利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品等违规行为，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对平安银行股份有限公司处以罚款的监管处罚。

主要违规事实：2021年5月21日，因存在1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产。2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品。3、理财产品之间风险隔离不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对招商银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

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

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	6,198.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	35,358.38
4	应收利息	53.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	117,226.69

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
719	26,666.21	3,815,043.00	19.90%	15,357,960.00	80.10%

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	杨凤明	4,089,005.00	21.33%
2	招商证券股份有限公司	1,967,498.00	10.26%
3	中信证券股份有限公司	1,744,430.00	9.10%
4	唐晓暄	435,100.00	2.27%

5	刘小浪	300,046.00	1.56%
6	何长华	270,005.00	1.41%
7	戴慰民	233,500.00	1.22%
8	刘党华	220,000.00	1.15%
9	王洪芬	200,013.00	1.04%
10	陈晴	200,000.00	1.04%
10	常延辉	200,000.00	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

- 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
本报告期初基金份额总额	28,173,003.00
本报告期基金总申购份额	18,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	27,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	19,173,003.00

§ 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生担任公司总经理职务。

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 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

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	
招商证券	3	10,365,167.70	30.89%	7,580.23	30.10%	新增 2 个
中信证券	1	8,207,593.79	24.46%	6,002.11	23.83%	-
国泰君安	1	5,278,441.95	15.73%	3,860.34	15.33%	-
中泰证券	1	383,975.00	1.14%	280.76	1.11%	新增 1 个
中信建投	1	9,323,771.57	27.78%	7,458.88	29.62%	-

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	4,077.30	100.00%	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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暂停申购、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站	2021-06-30
2	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 2021 年 6 月 28 日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-29
3	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 2021 年 6 月 28 日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-28
4	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
5	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增安信证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-24
7	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东吴证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-24
8	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暂停申购、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站	2021-05-18
9	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暂停申购、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站	2021-04-28
10	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
11	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
12	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 2021 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
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基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-06
14	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暂停申购、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站	2021-04-01
15	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31

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更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
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合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
18	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 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
19	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站	2021-03-30
20	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
21	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-20210310	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
22	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-20210220	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
23	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暂停申购、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站	2021-02-09
24	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站	2021-02-06
25	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新增平安证券为场内申购、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站	2021-02-02
26	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 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22
27	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新增国信证券为场内申购、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站	2021-01-15
28	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 2020 年 12 月 31 日下午暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-04

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	2	2021-02-18 ~2021-02-21	2,356,975.00	28,881,918.00	29,271,395.00	1,967,498.00	10.26%
个人	1	2021-04-23 ~2021-06-30	4,089,005.00	-	-	4,089,005.00	21.33%

产品特有风险

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

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

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

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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 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各年度审计报告正本

12.1.6 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
二〇二一年八月三十一日