

# 博时中证红利交易型开放式指数证券投资 基金

**2022 年中期报告**  
**2022 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：二〇二二年八月三十一日

## § 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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 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 .....	6
<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 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	10
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
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 .....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	41
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47

7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时中证红利 ETF
场内简称	红利 ETF 博时
基金主代码	515890
交易代码	515890
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 20 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	205,443,897.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 4 月 20 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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。其他投资策略包括：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、港股通标的股票投资策略、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、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证红利指数收益率。
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，跟踪中证红利指数，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	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	证券时报
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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	6,141,467.08
本期利润	10,916.36
加权平均基金份额本期利润	0.0001
本期加权平均净值利润率	0.00%
本期基金份额净值增长率	1.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	69,309,011.33
期末可供分配基金份额利润	0.3374
期末基金资产净值	274,752,908.33
期末基金份额净值	1.3374
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	39.87%

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

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

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

字。

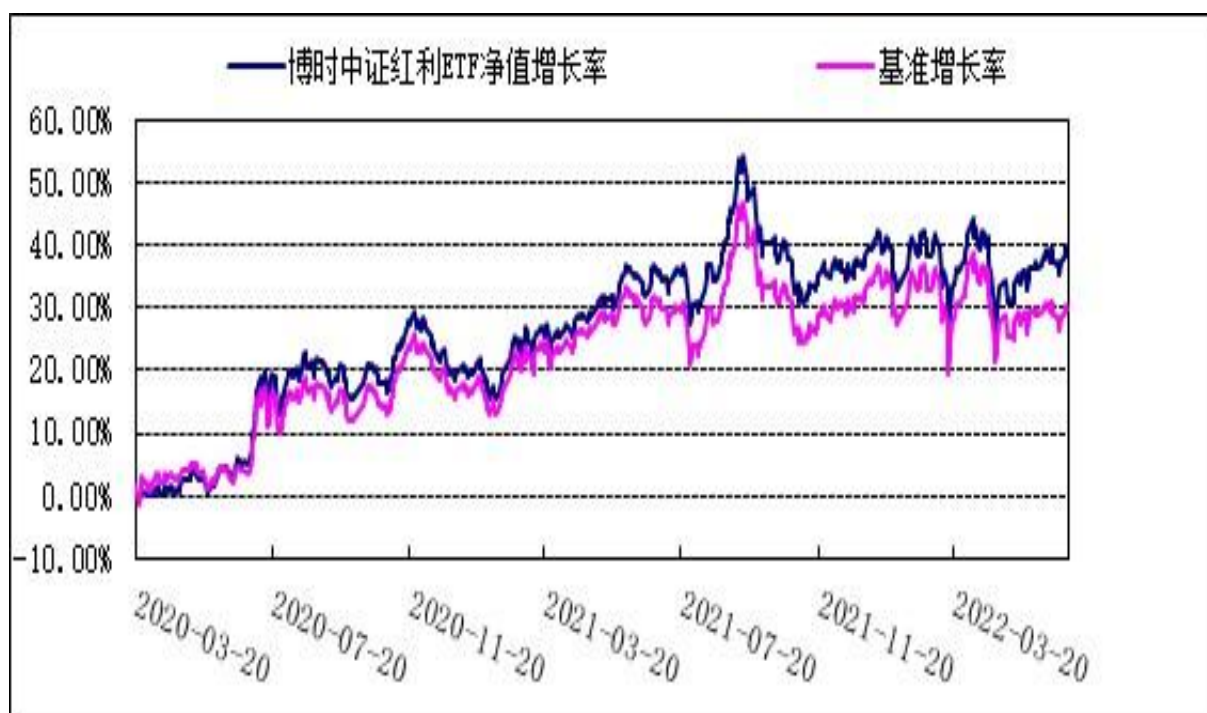
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.53%	0.83%	0.71%	0.84%	1.82%	-0.01%
过去三个月	-0.44%	1.44%	-3.71%	1.44%	3.27%	0.00%
过去六个月	1.21%	1.46%	-1.99%	1.48%	3.20%	-0.02%
过去一年	2.88%	1.30%	-0.91%	1.32%	3.79%	-0.02%
自基金合同生效起至今	39.87%	1.13%	30.03%	1.17%	9.84%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证红利指数收益率。

#### 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



## § 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 2022 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 327 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 16491 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5557 亿元人民币，累计分红逾 1678 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2020-03-20	-	15.3	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)、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)、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)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 30 日-2022 年 5 月 27 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼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)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月21日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021年12月28日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022年1月10日一至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022年3月3日一至今)的基金经理。
唐屹兵	基金经理助理	2021-07-05	-	7.0	唐屹兵先生,2014年6月硕士毕业后加入博时基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员、投资经理助理,现任基金经理助理。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。管理人于2022年7月22日发布公告称,聘任唐屹兵先生担任本基金基金经理,与万琼女士共同担任本基金基金经理。

## 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 10 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

2022 年上半年，受俄乌冲突引发的持续高企的通胀及美联储加息节奏加快影响，海外主要市场指数全线下跌，标普 500 下跌 20.58%，纳斯达克下跌 29.51%，法国 CAC40 下跌 17.20%，德国 DAX 指数下跌 19.52%，日经 225 下跌 8.33%，香港恒生指数下跌 6.57%，英国富时 100 指数下跌 2.92%。A 股主要指数也普遍下跌，价值风格表现相对占优。汇率方面，美元兑人民币相比上年末大涨 5.04%，人民币呈现出相对贬值趋势。债券市场方面，10 年期国债收益率与上年末相比，略升 4.5 个 BP，6 月底收益率为 2.820%；美国债 10 年期收益率和上年末相比大幅上行 146 个 BP，6 月底收益率为 2.98%，全球流动性处于紧缩周期。

期间内，本基金保持平稳运作，实现对指数的紧密跟踪。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.3374 元，份额累计净值为 1.3974 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 1.21%，同期业绩基准增长率-1.99%。

## 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，海外经济面临衰退风险，特别是目前深受能源危机困扰的欧洲。相比之下，国内经济虽

同样面临较大增长压力，但政策端的空间也很大，预计国内经济下半年整体处于筑底回升趋势。从流动性看，本轮美联储的加息仍未结束，海外流动性整体处于紧缩状态。考虑到当前错综复杂的宏观环境，预计国内下半年流动性仍然将维持宽松状态。综合宏观经济和流动性的情况，预计 A 股市场下半年仍然以结构性行情为主。

从风格上看，下半年价值风格具备投资机会。以红利为代表的价值风格当前估值处于历史底部区域，在动荡的市场环境中具有很高的安全边际。同时，低市盈率指数的一致预期净利润仍有稳定增长，价值风格股票的业绩并不差。

#### 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

本基金管理人于 2022 年 6 月 16 日发布公告，以 2022 年 6 月 6 日可分配利润为基准，每 10 份基金份额发放红利 0.6000 元人民币。

#### 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

托管人声明：

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：博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.4.1	5,125,894.78	915,556.22
结算备付金		114,736.22	63,925.25
存出保证金		38,156.18	26,229.42
交易性金融资产	6.4.4.2	269,732,550.08	54,987,029.08
其中：股票投资		269,732,550.08	54,934,029.08
基金投资		-	-
债券投资		-	53,000.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收清算款		609.37	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.5	75,616.24	177.06
资产总计		275,087,562.87	55,992,917.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		77,303.68	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,202.12	4,171.56
应付托管费		11,400.73	1,390.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.6	211,748.01	99,928.57
负债合计		334,654.54	105,490.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.4.7	205,443,897.00	40,443,897.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.4.8	69,309,011.33	15,443,529.40
净资产合计		274,752,908.33	55,887,426.40
<b>负债和净资产总计</b>		<b>275,087,562.87</b>	<b>55,992,917.03</b>

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3374 元，基金份额总额 205,443,897.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至2022 年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
<b>一、营业总收入</b>		464,584.85	3,340,594.88
1. 利息收入		8,984.12	2,209.50
其中：存款利息收入	6.4.4.9	8,984.12	2,195.00
债券利息收入		-	14.50
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）		6,366,143.52	2,325,462.40
其中：股票投资收益	6.4.4.10	-1,324,929.93	1,883,158.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.11	8,717.28	12,127.44
资产支持证券投资收益	6.4.4.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.13	-	-
股利收益	6.4.4.14	7,682,356.17	430,176.25
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.15	-6,130,550.72	797,078.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	220,007.93	215,844.45
<b>减：二、营业总支出</b>		453,668.49	261,287.51
1. 管理人报酬		180,665.80	19,457.64
2. 托管费		60,221.96	6,485.89
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.4.17	-	-
7. 税金及附加		-	0.01
8. 其他费用	6.4.4.18	212,780.73	235,343.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,916.36	3,079,307.37
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		10,916.36	3,079,307.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		10,916.36	3,079,307.37

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	40,443,897.00	-	15,443,529.40	55,887,426.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	40,443,897.00	-	15,443,529.40	55,887,426.40
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	165,000,000.00	-	53,865,481.93	218,865,481.93
（一）、综合收益总 额	-	-	10,916.36	10,916.36
（二）、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数（净值减 少以“-”号填列）	165,000,000.00	-	65,941,199.39	230,941,199.39
其中：1. 基金申购款	234,000,000.00	-	90,923,455.58	324,923,455.58
2. 基金赎回款	-69,000,000.00	-	-24,982,256.19	-93,982,256.19
（三）、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动（净值减少以 “-”号填列）	-	-	-12,086,633.82	-12,086,633.82
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	205,443,897.00	-	69,309,011.33	274,752,908.33



项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	28,443,897.00	-	5,662,092.02	34,105,989.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	28,443,897.00	-	5,662,092.02	34,105,989.02
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-11,000,000.00	-	609,713.14	-10,390,286.86
(一)、综合收益总额	-	-	3,079,307.37	3,079,307.37
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-11,000,000.00	-	-2,469,594.23	-13,469,594.23
其中：1. 基金申购款	70,000,000.00	-	17,690,008.29	87,690,008.29
2. 基金赎回款	-81,000,000.00	-	-20,159,602.52	-101,159,602.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	17,443,897.00	-	6,271,805.16	23,715,702.16

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

除下述会计政策和会计估计外，本基金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。

#### 6.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

##### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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。

### 6.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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。

## 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号), 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息, 金额分别为 915,556.22 元、63,925.25 元、26,229.42 元和 177.06 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息, 金额分别为 915,687.46 元、63,956.93 元、26,242.40 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 54,987,029.08 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 54,987,030.24 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 4,171.56 元、1,390.50 元、34,093.74 元和 25,834.83 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 4,171.56 元、1,390.50 元、34,093.74 元和 25,834.83 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收

利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.2.2 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。

#### 6.4.2.3 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。

#### 6.4.3 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得



的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.4 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	5,125,894.78
等于：本金	5,125,480.27
加：应计利息	414.51
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,125,894.78

#### 6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		275,840,275.53	-	269,732,550.08	-6,107,725.45
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		275,840,275.53	-	269,732,550.08	-6,107,725.45

#### 6.4.4.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.4.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.4.4 买入返售金融资产

##### 6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.4.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

#### 6.4.4.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	53,543.36
其中：交易所市场	53,543.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	56,199.79
应付指数使用费	72,087.87
应付 IOPV 计算与发布费	29,916.99
合计	211,748.01

#### 6.4.4.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,443,897.00	40,443,897.00
本期申购	234,000,000.00	234,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-69,000,000.00	-69,000,000.00
本期末	205,443,897.00	205,443,897.00

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）。

#### 6.4.4.8 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	18,707,172.81	-3,263,643.41	15,443,529.40
本期利润	6,141,467.08	-6,130,550.72	10,916.36
本期基金份额交易产生的变动数	76,311,285.84	-10,370,086.45	65,941,199.39
其中：基金申购款	108,087,572.42	-17,164,116.84	90,923,455.58
基金赎回款	-31,776,286.58	6,794,030.39	-24,982,256.19

本期已分配利润	-12,086,633.82	-	-12,086,633.82
本期末	89,073,291.91	-19,764,280.58	69,309,011.33

#### 6.4.4.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		7,092.35
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		1,613.20
其他		278.57
合计		8,984.12

#### 6.4.4.10 股票投资收益

##### 6.4.4.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,253,551.47
股票投资收益——赎回差价收入		-71,378.46
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		-1,324,929.93

##### 6.4.4.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
卖出股票成交总额		52,774,662.36
减：卖出股票成本总额		53,823,639.78
减：交易费用		204,574.05
买卖股票差价收入		-1,253,551.47

##### 6.4.4.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
赎回基金份额对价总额		93,982,256.19
减：现金支付赎回款总额		27,025,947.19
减：赎回股票成本总额		67,027,687.46
减：交易费用		-

赎回差价收入	-71,378.46
--------	------------

#### 6.4.4.11 债券投资收益

##### 6.4.4.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	5.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,711.70
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	8,717.28

##### 6.4.4.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,718.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	53,000.00
减：应计利息总额	6.74
减：交易费用	0.06
买卖债券差价收入	8,711.70

#### 6.4.4.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.4.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.4.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

#### 6.4.4.13 衍生工具收益

##### 6.4.4.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.4.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

#### 6.4.4.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	7,682,356.17
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	7,682,356.17

#### 6.4.4.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,130,550.72
——股票投资	-6,130,550.72
——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	-6,130,550.72

#### 6.4.4.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	220,007.93
合计	220,007.93

#### 6.4.4.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.4.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	36,364.00
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,280.19
中登注册登记费	74,383.76

指数使用费	70,000.00
IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	212,780.73

#### 6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.6 关联方关系

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 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

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。

#### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	124,518,004.14	73.47%	71,059,033.93	92.03%

###### 6.4.7.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.7.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.7.1.4 债券回购交易

无。

###### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金



金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
招商证券	91,059.45	73.47%	31,677.70	59.16%
关联方名称	上年度可比期间 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	51,965.98	92.03%	27,560.27	97.37%

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。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	180,665.80	19,457.64
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,221.96	6,485.89

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.7.4 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

##### 6.4.7.4.1 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。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.7.5.2 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	5,788,986.00	2.82%	3,069,586.00	7.59%

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。

#### 6.4.7.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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	5,125,894.78	7,092.35	515,632.19	1,090.89

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。

#### 6.4.7.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89
上年度可比期间					
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.8 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资 形式发 放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022-06-20	2022-06-21	-	0.6000	12,086,633.82	-	12,086,633.82	-
合计				0.6000	12,086,633.82	-	12,086,633.82	-

#### 6.4.9 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单位： 股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688322	奥比中光	2022-06-30	5 个交易 日	新股未 上市	30.99	30.99	5,248.00	162,635.52	162,635.52	-
688331	荣昌生物	2022-03-24	6 个月	首次公 开发行 限售	48.00	42.94	3,201.00	153,648.00	137,450.94	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个交易 日	新股未 上市	38.46	38.46	3,051.00	117,341.46	117,341.46	-
688400	凌云光	2022-06-27	7 个交易 日	新股未 上市	21.93	21.93	4,340.00	95,176.20	95,176.20	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8 个交易 日	新股未 上市	41.52	41.52	1,418.00	58,875.36	58,875.36	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6 个月	首次公 开发行 限售	19.18	32.07	801.00	15,363.18	25,688.07	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6 个月	首次公 开发行 限售	26.86	47.07	471.00	12,651.06	22,169.97	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6 个月	首次公 开发行 限售	27.53	45.04	399.00	10,984.47	17,970.96	-
301162	国能日	2022-06-01	6 个月	首次公 开发行 限售	45.13	54.11	295.00	13,313.35	15,962.45	-

	新	4-19		开发行 限售						
301286	侨源股份	2022-0 6-06	6 个月	首次公 开发行 限售	16.91	19.79	784.00	13,257.44	15,515.36	-
301160	翔楼新材	2022-0 5-25	6 个月	首次公 开发行 限售	31.56	37.66	392.00	12,371.52	14,762.72	-
301153	中科江南	2022-0 5-10	6 个月	首次公 开发行 限售	33.68	43.98	328.00	11,047.04	14,425.44	-
301187	欧圣电气	2022-0 4-13	6 个月	首次公 开发行 限售	21.33	22.54	631.00	13,459.23	14,222.74	-
301298	东利机械	2022-0 5-27	6 个月	首次公 开发行 限售	12.68	20.83	634.00	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022-0 6-16	6 个月	首次公 开发行 限售	52.03	56.42	233.00	12,122.99	13,145.86	-
301139	元道通信	2022-0 6-30	6 个月	首次公 开发行 限售	38.46	38.46	340.00	13,076.40	13,076.40	-
301259	艾布鲁	2022-0 4-18	6 个月	首次公 开发行 限售	18.39	24.94	474.00	8,716.86	11,821.56	-
301256	华融化学	2022-0 3-14	6 个月	首次公 开发行 限售	8.05	10.08	1,115.00	8,975.75	11,239.20	-
301220	亚香股份	2022-0 6-15	6 个月	首次公 开发行 限售	35.98	39.15	285.00	10,254.30	11,157.75	-
301268	铭利达	2022-0 3-29	6 个月	首次公 开发行 限售	28.50	34.87	302.00	8,607.00	10,530.74	-
301212	联盛化学	2022-0 4-07	6 个月	首次公 开发行 限售	29.67	33.28	315.00	9,346.05	10,483.20	-
301097	天益医疗	2022-0 3-25	6 个月	首次公 开发行 限售	52.37	47.83	209.00	10,945.33	9,996.47	-
301150	中一科技	2022-0 4-14	6 个月	首次公 开发行 限售	109.04	82.76	120.00	13,084.80	9,931.20	-

301137	哈焊华通	2022-03-14	6 个月	首次公开发行限售	15.37	15.99	579.00	8,899.23	9,258.21	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6 个月	首次公开发行限售	38.39	23.90	380.00	14,588.20	9,082.00	-
301288	清研环境	2022-04-14	6 个月	首次公开发行限售	19.09	19.98	452.00	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月	首次公开发行限售	22.49	27.42	327.00	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	首次公开发行限售	26.27	32.33	277.00	7,276.79	8,955.41	-
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	首次公开发行限售	48.49	31.38	260.00	12,608.24	8,158.80	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6 个月	首次公开发行限售	35.68	29.84	262.00	9,348.16	7,818.08	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	首次公开发行限售	31.98	26.26	283.00	9,050.34	7,431.58	-
301258	富士莱	2022-03-21	6 个月	首次公开发行限售	48.30	41.68	177.00	8,549.10	7,377.36	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月	首次公开发行限售	39.88	31.09	234.00	9,331.92	7,275.06	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	首次公开发行限售	41.52	41.52	158.00	6,560.16	6,560.16	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	首次公开发行限售	56.69	41.86	144.00	8,163.36	6,027.84	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	首次公开发行限售	31.20	22.81	253.00	7,893.60	5,770.93	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	首次公开发行限售	96.36	87.82	65.00	6,263.28	5,708.30	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的

若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.10 金融工具风险及管理

#### 6.4.10.1 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，跟踪中证红利指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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



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

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

#### 6.4.10.2 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。

##### 6.4.10.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.10.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.10.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.10.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	-	53,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	53,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.10.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.10.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.10.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易



对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.10.4 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。

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022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	5,125,894.78	-	-	-	5,125,894.78
结算备付金	114,736.22	-	-	-	114,736.22
存出保证金	38,156.18	-	-	-	38,156.18
交易性金融资产	-	-	-	269,732,550.08	269,732,550.08
应收证券清算款	-	-	-	609.37	609.37
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
<b>资产总计</b>	<b>5,278,787.18</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>269,808,775.69</b>	<b>275,087,562.87</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	77,303.68	77,303.68
应付管理人报酬	-	-	-	34,202.12	34,202.12
应付托管费	-	-	-	11,400.73	11,400.73

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	211,748.01	211,748.01
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>334,654.54</b>	<b>334,654.54</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>5,278,787.18</b>	-	-	<b>269,474,121.15</b>	<b>274,752,908.33</b>
上年度末 2021 年 12 月 31 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	915,556.22	-	-	-	915,556.22
结算备付金	63,925.25	-	-	-	63,925.25
存出保证金	26,229.42	-	-	-	26,229.42
交易性金融资产	-	-	53,000.00	54,934,029.08	54,987,029.08
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	177.06	177.06
<b>资产总计</b>	<b>1,005,710.89</b>	-	<b>53,000.00</b>	<b>54,934,206.14</b>	<b>55,992,917.03</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,171.56	4,171.56
应付托管费	-	-	-	1,390.50	1,390.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	99,928.57	99,928.57
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>105,490.63</b>	<b>105,490.63</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,005,710.89</b>	-	<b>53,000.00</b>	<b>54,828,715.51</b>	<b>55,887,426.40</b>

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

#### 6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.10.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.10.4.3 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。

##### 6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	269,732,550.08	98.17	54,934,029.08	98.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	53,000.00	0.09
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	269,732,550.08	98.17	54,987,029.08	98.39

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

##### 6.4.10.4.3.2 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约1,358	增加约235
业绩比较基准下降5%	减少约1,358	减少约235	

#### 6.4.11 公允价值

##### 6.4.11.1 金融工具公允价值计量的方法

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

定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.11.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.11.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	268,798,343.26
第二层次	453,665.10
第三层次	480,541.72
合计	269,732,550.08

##### 6.4.11.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 6.4.11.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

##### 6.4.11.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。其中“应收利息”与“其他资产”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额；“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额；“交易费用”项目与“其他费用”项目的上年度可比期间金额合并列示在利润表“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

## § 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	269,732,550.08	98.05
	其中：股票	269,732,550.08	98.05
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	5,240,631.00	1.91
8	其他各项资产	114,381.79	0.04
9	合计	275,087,562.87	100.00

注：股票投资项包含可退替代款估值增值。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 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	44,435,364.00	16.17
C	制造业	103,631,128.25	37.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,644,326.00	4.60
E	建筑业	8,406,517.40	3.06
F	批发和零售业	16,022,078.00	5.83
G	交通运输、仓储和邮政业	15,665,037.80	5.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,401,898.41	1.24
J	金融业	30,408,973.00	11.07
K	房地产业	32,189,952.60	11.72
L	租赁和商务服务业	7,275.06	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,903.56	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,899,024.00	1.06
S	综合	-	-
	合计	269,732,478.08	98.17

注：上述按行业分类的境内股票投资组合的合计项不包含可退替代款估值增值。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600188	兖矿能源	233,900	9,234,372.00	3.36
2	601088	中国神华	182,200	6,067,260.00	2.21
3	600327	大东方	1,067,400	5,390,370.00	1.96
4	600325	华发股份	706,100	5,345,177.00	1.95
5	600389	江山股份	76,100	4,621,553.00	1.68
6	600873	梅花生物	396,000	4,466,880.00	1.63
7	601666	平煤股份	327,800	4,454,802.00	1.62
8	601225	陕西煤业	204,300	4,327,074.00	1.57
9	000036	华联控股	946,030	4,086,849.60	1.49
10	600153	建发股份	305,000	3,986,350.00	1.45
11	000550	江铃汽车	242,800	3,904,224.00	1.42
12	000090	天健集团	565,400	3,895,606.00	1.42
13	600985	淮北矿业	262,200	3,817,632.00	1.39
14	600383	金地集团	278,600	3,744,384.00	1.36
15	601006	大秦铁路	546,600	3,602,094.00	1.31
16	000937	冀中能源	478,300	3,568,118.00	1.30
17	600971	恒源煤电	439,720	3,473,788.00	1.26
18	600395	盘江股份	384,000	3,367,680.00	1.23
19	601328	交通银行	673,700	3,355,026.00	1.22
20	600350	山东高速	631,800	3,316,950.00	1.21
21	002763	汇洁股份	437,000	3,281,870.00	1.19
22	600479	千金药业	338,000	3,258,320.00	1.19
23	002238	天威视讯	562,900	3,219,788.00	1.17
24	600282	南钢股份	1,005,300	3,166,695.00	1.15
25	600348	华阳股份	204,300	3,158,478.00	1.15
26	600376	首开股份	633,800	3,111,958.00	1.13
27	002003	伟星股份	327,420	3,110,490.00	1.13
28	601169	北京银行	670,600	3,044,524.00	1.11
29	601988	中国银行	917,300	2,990,398.00	1.09
30	600028	中国石化	727,000	2,966,160.00	1.08
31	600048	保利发展	166,300	2,903,598.00	1.06
32	601098	中南传媒	307,100	2,899,024.00	1.06

33	603886	元祖股份	162,000	2,854,440.00	1.04
34	600729	重庆百货	132,100	2,849,397.00	1.04
35	600019	宝钢股份	470,800	2,834,216.00	1.03
36	601216	君正集团	579,100	2,826,008.00	1.03
37	603878	武进不锈	435,752	2,780,097.76	1.01
38	601009	南京银行	253,700	2,643,554.00	0.96
39	601000	唐山港	1,013,200	2,614,056.00	0.95
40	600023	浙能电力	750,900	2,605,623.00	0.95
41	000581	威孚高科	134,100	2,581,425.00	0.94
42	601288	农业银行	834,800	2,521,096.00	0.92
43	601398	工商银行	527,600	2,516,652.00	0.92
44	600016	民生银行	670,300	2,493,516.00	0.91
45	601939	建设银行	403,100	2,442,786.00	0.89
46	600606	绿地控股	611,015	2,419,619.40	0.88
47	002303	美盈森	700,500	2,416,725.00	0.88
48	300107	建新股份	453,200	2,406,492.00	0.88
49	600027	华电国际	612,300	2,406,339.00	0.88
50	601003	柳钢股份	592,700	2,400,435.00	0.87
51	600594	益佰制药	426,300	2,387,280.00	0.87
52	600548	深高速	249,620	2,381,374.80	0.87
53	002088	鲁阳节能	113,000	2,378,650.00	0.87
54	002884	凌霄泵业	115,860	2,373,971.40	0.86
55	601998	中信银行	497,900	2,365,025.00	0.86
56	601818	光大银行	783,300	2,357,733.00	0.86
57	600177	雅戈尔	355,300	2,355,639.00	0.86
58	603858	步长制药	118,944	2,344,386.24	0.85
59	000656	金科股份	814,800	2,330,328.00	0.85
60	002737	葵花药业	148,200	2,317,848.00	0.84
61	000789	万年青	213,400	2,313,256.00	0.84
62	600377	宁沪高速	268,400	2,300,188.00	0.84
63	000402	金融街	381,700	2,271,115.00	0.83
64	600674	川投能源	187,300	2,232,616.00	0.81
65	002367	康力电梯	296,800	2,217,096.00	0.81
66	603156	养元饮品	96,600	2,194,752.00	0.80
67	600823	世茂股份	734,900	2,190,002.00	0.80
68	000961	中南建设	696,700	2,124,935.00	0.77
69	601166	兴业银行	106,700	2,123,330.00	0.77
70	002233	塔牌集团	239,700	2,121,345.00	0.77
71	000002	万科A	103,000	2,111,500.00	0.77
72	002563	森马服饰	355,400	2,103,968.00	0.77
73	600261	阳光照明	621,200	2,093,444.00	0.76
74	601668	中国建筑	393,100	2,091,292.00	0.76
75	601126	四方股份	128,600	2,084,606.00	0.76
76	600900	长江电力	89,100	2,059,992.00	0.75



77	000895	双汇发展	69,100	2,024,630.00	0.74
78	002419	天虹股份	282,800	2,016,364.00	0.73
79	002146	荣盛发展	650,200	1,970,106.00	0.72
80	600066	宇通客车	227,200	1,965,280.00	0.72
81	002110	三钢闽光	321,300	1,956,717.00	0.71
82	600398	海澜之家	392,400	1,863,900.00	0.68
83	600642	申能股份	319,200	1,813,056.00	0.66
84	002372	伟星新材	75,400	1,812,616.00	0.66
85	002601	龙佰集团	88,900	1,782,445.00	0.65
86	600704	物产中大	346,900	1,779,597.00	0.65
87	002516	旷达科技	347,100	1,777,152.00	0.65
88	300193	佳士科技	186,500	1,749,370.00	0.64
89	600585	海螺水泥	48,400	1,707,552.00	0.62
90	600808	马钢股份	412,300	1,562,617.00	0.57
91	601601	中国太保	66,100	1,555,333.00	0.57
92	600886	国投电力	145,400	1,526,700.00	0.56
93	600104	上汽集团	84,100	1,497,821.00	0.55
94	000828	东莞控股	141,500	1,450,375.00	0.53
95	603355	莱克电气	51,080	1,288,748.40	0.47
96	600741	华域汽车	55,400	1,274,200.00	0.46
97	000157	中联重科	206,300	1,270,808.00	0.46
98	601636	旗滨集团	89,359	1,139,327.25	0.41
99	600688	上海石化	322,800	1,026,504.00	0.37
100	002206	海利得	152,414	963,256.48	0.35
101	688322	奥比中光	5,248	162,635.52	0.06
102	688331	荣昌生物	3,201	137,450.94	0.05
103	301139	元道通信	3,391	130,417.86	0.05
104	688400	凌云光	4,340	95,176.20	0.03
105	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
106	601089	N 福元	1,749	36,816.45	0.01
107	301238	瑞泰新材	801	25,688.07	0.01
108	301266	宇邦新材	471	22,169.97	0.01
109	301112	N 信邦	399	17,970.96	0.01
110	301162	国能日新	295	15,962.45	0.01
111	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.01
112	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.01
113	301153	中科江南	328	14,425.44	0.01
114	301187	欧圣电气	631	14,222.74	0.01
115	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
116	301302	C 华如	233	13,145.86	0.00
117	301259	艾布鲁	474	11,821.56	0.00
118	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
119	301256	华融化学	1,115	11,239.20	0.00
120	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00

121	301268	铭利达	302	10,530.74	0.00
122	301212	联盛化学	315	10,483.20	0.00
123	301097	天益医疗	209	9,996.47	0.00
124	301150	中一科技	120	9,931.20	0.00
125	301137	哈焊华通	579	9,258.21	0.00
126	301148	嘉戎技术	380	9,082.00	0.00
127	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
128	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
129	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
130	301236	软通动力	260	8,158.80	0.00
131	301216	万凯新材	262	7,818.08	0.00
132	301135	瑞德智能	283	7,431.58	0.00
133	301258	富士莱	177	7,377.36	0.00
134	301102	兆讯传媒	234	7,275.06	0.00
135	301237	和顺科技	144	6,027.84	0.00
136	301279	金道科技	253	5,770.93	0.00
137	301219	腾远钴业	65	5,708.30	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002763	汇洁股份	4,869,022.00	8.71
2	000036	华联控股	4,817,018.50	8.62
3	000550	江铃汽车	4,467,444.19	7.99
4	000090	天健集团	4,385,729.61	7.85
5	000656	金科股份	4,214,924.00	7.54
6	002238	天威视讯	4,172,578.00	7.47
7	002003	伟星股份	4,129,576.15	7.39
8	000581	威孚高科	3,589,815.00	6.42
9	000937	冀中能源	3,585,782.00	6.42
10	000961	中南建设	3,496,798.00	6.26
11	002884	凌霄泵业	3,349,129.50	5.99
12	002146	荣盛发展	3,331,735.00	5.96
13	000789	万年青	3,290,625.97	5.89
14	300107	建新股份	3,123,861.00	5.59
15	002563	森马服饰	3,105,231.00	5.56
16	002088	鲁阳节能	3,078,688.60	5.51
17	002737	葵花药业	3,056,604.00	5.47
18	002233	塔牌集团	3,041,454.00	5.44
19	000895	双汇发展	3,009,993.28	5.39

20	002303	美盈森	2,985,154.00	5.34
21	002110	三钢闽光	2,769,564.00	4.96
22	002367	康力电梯	2,763,354.00	4.94
23	000402	金融街	2,712,426.00	4.85
24	002601	龙佰集团	2,705,913.00	4.84
25	000002	万科 A	2,521,795.00	4.51
26	300193	佳士科技	2,498,853.00	4.47
27	002419	天虹股份	2,362,762.84	4.23
28	002516	旷达科技	2,303,577.00	4.12
29	002372	伟星新材	2,172,536.00	3.89
30	000157	中联重科	1,738,796.00	3.11
31	000828	东莞控股	1,733,610.00	3.10
32	002206	海利得	1,383,543.00	2.48

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	000090	天健集团	1,521,642.00	2.72
2	002763	汇洁股份	1,453,747.00	2.60
3	000036	华联控股	1,420,955.00	2.54
4	000550	江铃汽车	1,400,778.94	2.51
5	000937	冀中能源	1,363,738.00	2.44
6	002238	天威视讯	1,307,775.67	2.34
7	002003	伟星股份	1,302,579.60	2.33
8	000895	双汇发展	1,236,645.00	2.21
9	000581	威孚高科	1,226,438.00	2.19
10	000656	金科股份	1,138,180.00	2.04
11	002737	葵花药业	1,128,104.00	2.02
12	002884	凌霄泵业	1,087,541.00	1.95
13	000789	万年青	1,082,003.00	1.94
14	000961	中南建设	1,022,676.00	1.83
15	002088	鲁阳节能	1,021,321.66	1.83
16	300107	建新股份	979,147.00	1.75
17	002146	荣盛发展	969,840.00	1.74
18	002303	美盈森	951,173.00	1.70
19	002233	塔牌集团	923,255.00	1.65
20	002563	森马服饰	921,762.00	1.65

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	122,904,201.96
卖出股票的收入（成交）总额	52,774,662.36

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	38,156.18
2	应收清算款	609.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	114,381.79

### 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
977	210,280.34	178,272,397.00	86.77%	27,171,500.00	13.23%

## 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	恒生电子股份有限公司	72,717,100.00	35.40%
2	深圳开拓者科技有限公司	41,660,000.00	20.28%
3	杭州云毅网络科技有限公司	14,823,600.00	7.22%
4	上海通怡投资管理有限公司—通怡芙蓉 3 号私募证券投资基金	14,241,500.00	6.93%
5	申万宏源证券有限公司	10,873,800.00	5.29%
6	彭政纲	10,000,000.00	4.87%
7	中国人寿资管—工商银行—国寿资产—低波优选 1 号保险资产管理产品	6,563,200.00	3.19%
8	招商证券股份有限公司	5,788,986.00	2.82%
9	杭州恒生云投资控股有限公司	3,545,900.00	1.73%
10	广发证券股份有限公司	2,866,600.00	1.40%

## 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 3 月 20 日）基金份额总额	312,443,897.00
本报告期期初基金份额总额	40,443,897.00
本报告期基金总申购份额	234,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	69,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	205,443,897.00

## § 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

本报告期内，基金管理人、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	
银河证券	2	44,965,370.30	26.53%	32,884.21	26.53%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	124,518,004.14	73.47%	91,059.45	73.47%	-
国泰君	1	-	-	-	-	-



安						
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我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
银河证券	61,718.50	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-18
2	博时基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市ETF实施申赎业务多码合一的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-17
3	博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-16

		网站	
4	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-20220430	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-30
5	博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-22
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华安证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-21
7	关于博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金新增部分券商为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-08
8	博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-30
9	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增湘财证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-25
10	博时基金管理有限公司关于调整直销网上交易定期投资业务影响部分定期投资计划的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-14
11	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中泰证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-02-22
12	博时基金管理有限公司关于部分基金在青岛农商银行直销银行开展费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-02-11
13	博时基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
14	博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-24
15	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-20220121	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-21
16	关于成立博时财富基金销售有限公司的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-20
17	博时基金管理有限公司关于暂停使用交通银行非快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-06
18	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开	证券时报、基金管理人网	2022-01-04

	通交通银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	站、证监会基金电子披露网站	
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	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01
20	博时基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01

## § 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	1	2022-01-07~ 2022-06-30	-	72,717,100.00	-	72,717,100.00	35.40%
	2	2022-01-07~ 2022-06-20; 2022-06-23~ 2022-06-30	-	19,688,900.00	-	19,688,900.00	9.58%
	3	2022-01-01~ 2022-01-09	14,823,600.00	-	-	14,823,600.00	7.22%

#### 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中证红利交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时中证红利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 博时中证红利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 报告期内博时中证红利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  
二〇二二年八月三十一日