

博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资 基金

2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 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：二〇二四年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2024 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时国证 2000ETF
场内简称	国证 2000 指数 ETF
基金主代码	159505
交易代码	159505
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	58,104,786.00 份
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>本基金投资主要采用抽样复制策略。通过量化模型和数量化风险管理手段实现对指数的紧密跟踪。</p> <p>如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>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>当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。其他投资策略包括：债券（除可转换债券、可交换债券）投资策略、资产支</p>

	持证券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、金融衍生品投资策略、融资和转融通证券出借业务、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	国证 2000 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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪国证 2000 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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-5,807,321.22
2.本期利润	-3,975,740.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0555
4.期末基金资产净值	53,062,725.31
5.期末基金份额净值	0.9132

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（不包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。

所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 本报告期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	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.90%	2.47%	-8.83%	2.51%	2.93%	-0.04%
自基金合同生 效起至今	-8.68%	2.09%	-12.21%	2.14%	3.53%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 2023 年 11 月 23 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
唐屹兵	基金经理	2023-11-23	-	8.8	唐屹兵先生，硕士。2015 年从美国罗格斯大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、投资经理助理、基金经理助理、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 7 月 22 日-2024 年 2 月 2 日)、博时创业板指数证券投资基金(2022 年 7 月 22 日-2024 年 2 月 2 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(2022 年 7 月 22 日-2024 年 2 月 2 日)的基金经理。现任博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 7 月 22 日—至今)、博时中证红利交易型开

				放式指数证券投资基金(2022年7月22日—至今)、博时中证可持续发展100交易型开放式指数证券投资基金(2022年7月22日—至今)、博时上证科创板新材料交易型开放式指数证券投资基金(2022年9月30日—至今)、博时中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金(2023年3月23日—至今)、博时中证机器人指数型发起式证券投资基金(2023年4月4日—至今)、博时上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金(2023年5月18日—至今)、博时北证50成份指数型发起式证券投资基金(2023年5月23日—至今)、博时上证科创板100交易型开放式指数证券投资基金(2023年9月6日—至今)、博时中证医疗指数型发起式证券投资基金(2023年10月24日—至今)、博时国证2000交易型开放式指数证券投资基金(2023年11月23日—至今)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2023年11月28日—至今)、博时上证科创板100交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2023年12月1日—至今)、博时中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金(2023年12月19日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

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 59 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 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度宏观经济整体保持平稳运行，但股票市场大幅波动，特别是小盘相关指数在 1 月大幅下跌后，2 月春节后迎来一轮快速反弹。按季度看，宽基指数中上证 50 和沪深 300 相对领先，中证 2000、科创 100 等偏小盘风格的指数相对落后。行业层面，周期板块表现出色，石油石化、煤炭、有色金属和银行在一季度均取得了可观涨幅，医药、电子、房地产、计算机和化工跌幅相对较大。风格上，大盘价值占优，小盘成长回撤较大。恒生指数和恒生科技在一季度出现小幅下跌。海外市场延续去年良好表现，标普 500、纳斯达克以及日经 225 均取得不同幅度的上涨。本基金为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。

一季度国内工业、服务业以及消费维持景气，但房地产进一步走弱。一季度全国规模以上工业增加值延续了 2023 年 6 月以来的恢复态势，服务业生产指数以及社会消费品零售总额保持了稳定的增长。3 月国内制造业 PMI 重新回到扩张区间，其中出口是主要推动力量。海外方面，美国经济仍然维持了很强的增长韧性，美联储 3 月 FOMC 会议上调了增长、通胀、远期利率预期，但点阵图仍指引今年降息 3 次。展望二季度，海外补库周期有望拉动出口继续增长，随着一季度各项经济数据的企稳回升，企业投资以及居民消费信心或在二季度迎来边际提升，地产短期改善概率较低，在国内通胀仍然很低的情况下，二季度大概率处于稳信用、宽货币的状态。与去年初对整体经济以及企业盈利的高预期相比，当前投资者不管是对经济增长还是企业盈利的预期相对偏低，在这样的背景下，二季度市场表现反而有可能出现超预期的情况。特别是考虑到 A 股市场在经历 2 年多的低迷后，当前估值处于历史低位，一旦未来企业盈利出现超预期的增

长，股市向上空间大。看好 A 股市场二季度整体的配置价值。本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 03 月 31 日，本基金基金份额净值为 0.9132 元，份额累计净值为 0.9132 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-5.90%，同期业绩基准增长率为-8.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	51,277,400.08	95.98
	其中：股票	51,277,400.08	95.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,760,134.05	3.29
8	其他各项资产	386,271.14	0.72
9	合计	53,423,805.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	71,028.00	0.13
B	采矿业	383,376.00	0.72
C	制造业	35,211,018.55	66.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,271,854.00	2.40
E	建筑业	1,096,897.00	2.07

F	批发和零售业	2,966,056.00	5.59
G	交通运输、仓储和邮政业	853,061.00	1.61
H	住宿和餐饮业	40,320.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,772,654.53	10.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	720,812.00	1.36
L	租赁和商务服务业	614,145.00	1.16
M	科学研究和技术服务业	210,458.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	798,580.00	1.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	44,168.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	1,222,972.00	2.30
S	综合	-	-
	合计	51,277,400.08	96.64

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002130	沃尔核材	34,700	425,075.00	0.80
2	002335	科华数据	12,500	361,375.00	0.68
3	600458	时代新材	30,200	354,850.00	0.67
4	000034	神州数码	11,500	339,480.00	0.64
5	600595	中孚实业	97,500	337,350.00	0.64
6	688556	高测股份	10,500	326,235.00	0.61
7	002533	金杯电工	30,400	313,728.00	0.59
8	000915	华特达因	8,800	311,520.00	0.59
9	002048	宁波华翔	23,900	308,788.00	0.58
10	000589	贵州轮胎	54,500	304,655.00	0.57

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IM2404	IM2404	1.00	1,079,120.00	22,720.00	-
公允价值变动总额合计(元)					22,720.00
股指期货投资本期收益(元)					13,184.70
股指期货投资本期公允价值变动(元)					22,720.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵州轮胎股份有限公司在报告编制前一年受到修文县应急管理局的处罚。株洲时代新材料科技股份有限公司在报告编制前一年受到湖南省株洲市生态环境局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	192,101.40
2	应收证券清算款	81,465.18
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	112,704.56
8	其他	-
9	合计	386,271.14

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	79,104,786.00
报告期期间基金总申购份额	24,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	45,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,104,786.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 2024 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 372 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 15475 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 5694 亿元人民币，累计分红逾 1971 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、报告期内博时国证 2000 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

二〇二四年四月二十二日