

博时沪深 300 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	11
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	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	41
§9 开放式基金份额变动	41

§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	44
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	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时沪深 300ETF
场内简称	证券简称：HS300E，扩位证券简称：沪深 300ET
基金主代码	515130
交易代码	515130
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 3 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	49,463,181.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 11 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	李申
	联系电话	0755-83169999	021-60637102
	电子邮箱	service@bosera.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	021-60637111
传真		0755-83195140	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码	518040	100033
法定代表人	江向阳	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	56,222,203.27
本期利润	21,482,098.91
加权平均基金份额本期利润	0.1726
本期加权平均净值利润率	11.42%
本期基金份额净值增长率	3.64%
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	23,826,382.75
期末可供分配基金份额利润	0.4817
期末基金资产净值	75,164,619.27
期末基金份额净值	1.5196
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	51.96%

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

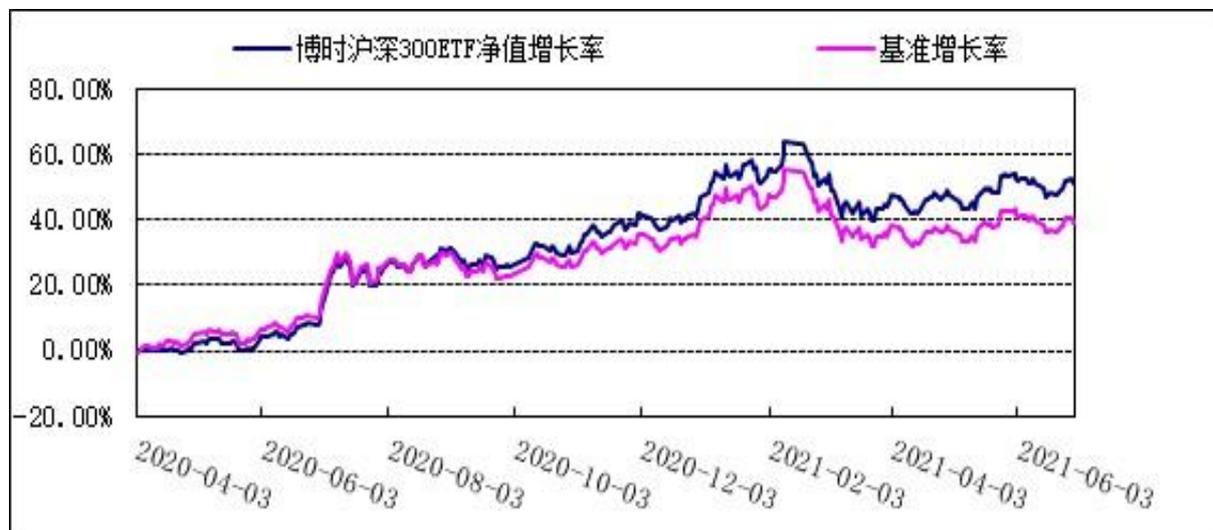
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.21%	0.80%	-2.02%	0.80%	0.81%	0.00%
过去三个月	5.62%	0.99%	3.48%	0.98%	2.14%	0.01%
过去六个月	3.64%	1.32%	0.24%	1.31%	3.40%	0.01%

过去一年	38.79%	1.34%	25.46%	1.33%	13.33%	0.01%
自基金合同生效起至今	51.96%	1.25%	39.88%	1.26%	12.08%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即沪深 300 指数收益率。

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 3 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	2020-04-03	-	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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

过去持续多时的“白马抱团”行情，在今年上半年逐渐出现瓦解松动，市场风格在上半年也出现了较大的波动。整体看，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%。从行业看，周期板块整体表现最好，按照中

信行业分类，钢铁、基础化工涨幅超过 20%，煤炭、有色金属也有 15%以上的涨幅。另外，处于高景气度的电力设备和新能源行业上半年涨幅也超过了 20%。

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。货币政策上半年保持稳健，但在 7 月央行超预期降准后，市场对流动性的预期发生了一定的变化，市场流动性整体处于较为充裕的状态。房地产市场仍然面临来自政策较大的压力。

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 1.5196 元，份额累计净值为 1.5196 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 3.64%，同期业绩基准增长率为 0.24%。

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。在流动性边际宽松，而增速边际放缓的宏观背景下，预计下半年 A 股主要延续上半年的震荡格局，部分受益国家政策未来能维持高增速的板块以及部分基本面良好的低估值板块存在结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	6.4.3.1	2,516,040.32	14,845,718.81
结算备付金		659,386.88	2,799,564.82
存出保证金		635,361.78	1,952,779.47

交易性金融资产	6.4.3.2	71,566,827.76	662,244,848.14
其中：股票投资		71,525,127.76	662,036,848.14
基金投资		-	-
债券投资		41,700.00	208,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		38,283.33	20,299,798.23
应收利息	6.4.3.5	2,301.22	9,011.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		75,418,201.29	702,151,720.61
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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	13,376,487.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,277.44	40,864.73
应付托管费		3,092.49	13,621.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	73,534.12	237,929.18
应交税费		5,938.12	59,177.07
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	161,739.85	85,000.00
负债合计		253,582.02	13,813,080.12
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	49,463,181.00	469,463,181.00
未分配利润	6.4.3.10	25,701,438.27	218,875,459.49
所有者权益合计		75,164,619.27	688,338,640.49
负债和所有者权益总计		75,418,201.29	702,151,720.61

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5196 元，基金份额总额 49,463,181.00 份。

6.2 利润表

会计主体：博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 4 月 3 日（基金合同 生效日）至 2020 年 6 月 30 日

一、收入		22,726,789.59	12,643,312.08
1. 利息收入		35,124.05	185,258.71
其中：存款利息收入	6.4.3.11	35,063.92	185,257.42
债券利息收入		60.13	1.29
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）		54,555,755.01	9,013,442.57
其中：股票投资收益	6.4.3.12	53,475,475.68	8,154,872.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	33,089.90	-
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	576,349.51	25,048.54
股利收益	6.4.3.15	470,839.92	833,521.38
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-34,740,104.36	3,451,822.31
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	2,876,014.89	-7,211.51
减：二、费用		1,244,690.68	606,926.09
1. 管理人报酬		146,059.10	57,471.22
2. 托管费		48,686.40	19,157.08
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	878,739.92	467,007.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,074.96	90.17
7. 其他费用	6.4.3.19	169,130.30	63,200.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,482,098.91	12,036,385.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,482,098.91	12,036,385.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	469,463,181.00	218,875,459.49	688,338,640.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,482,098.91	21,482,098.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-420,000,000.00	-214,656,120.13	-634,656,120.13

值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	135,000,000.00	62,755,804.06	197,755,804.06
2. 基金赎回款	-555,000,000.00	-277,411,924.19	-832,411,924.19
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)	49,463,181.00	25,701,438.27	75,164,619.27
项目	上年度可比期间 2020年4月3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)	265,463,181.00	-	265,463,181.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,036,385.99	12,036,385.99
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)	-222,000,000.00	-7,910,355.56	-229,910,355.56
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	33,563.53	3,033,563.53
2. 基金赎回款	-225,000,000.00	-7,943,919.09	-232,943,919.09
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)	43,463,181.00	4,126,030.43	47,589,211.43

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[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]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。

(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。

(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	2,516,040.32
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	2,516,040.32	

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	69,099,956.76	71,525,127.76	2,425,171.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	41,700.00	41,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	41,700.00	41,700.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	69,141,656.76	71,566,827.76	2,425,171.00

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,115,680.00	-	-	-
股指期货	3,115,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,115,680.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2109	沪深300期货2109合约	2.00	3,099,840.00	-15,840.00
减：可抵销期货暂收款				-15,840.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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	251.59
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,941.96
应收债券利息	3.07
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	104.60
合计	2,301.22

6.4.3.6 其他资产

无余额。

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	73,534.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	73,534.12

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	70,000.00
预提费用	81,822.86
合计	161,739.85

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	469,463,181.00	469,463,181.00
本期申购	135,000,000.00	135,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-555,000,000.00	-555,000,000.00
本期末	49,463,181.00	49,463,181.00

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

6.4.3.10 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	76,479,968.44	142,395,491.05	218,875,459.49
本期利润	56,222,203.27	-34,740,104.36	21,482,098.91
本期基金份额交易产生的变动数	-108,875,788.96	-105,780,331.17	-214,656,120.13
其中：基金申购款	44,917,117.67	17,838,686.39	62,755,804.06
基金赎回款	-153,792,906.63	-123,619,017.56	-277,411,924.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,826,382.75	1,875,055.52	25,701,438.27

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	11,938.75
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	21,416.13
其他	1,709.04
合计	35,063.92

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	30,520,785.15
股票投资收益——赎回差价收入	22,954,690.53
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	53,475,475.68

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	362,897,965.25
减：卖出股票成本总额	332,377,180.10
买卖股票差价收入	30,520,785.15

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	832,411,924.19
减：现金支付赎回款总额	327,767,342.19
减：赎回股票成本总额	481,689,891.47
赎回差价收入	22,954,690.53

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	640,064.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	606,900.00
减：应收利息总额	74.42
买卖债券差价收入	33,089.90

6.4.3.13.2 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

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	576,349.51

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	470,839.92
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	470,839.92

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	-33,995,804.36
——股票投资	-33,995,804.36
——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	-744,300.00
——权证投资	-
——股指期货	-744,300.00
4. 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	-34,740,104.36

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	2,876,014.89
合计	2,876,014.89

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	878,739.92
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	878,739.92

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	7,390.45
指数使用费	70,000.00
IOPV 计算与发布费	9,916.99
合计	169,130.30

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
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
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人

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

无。

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	上年度可比期间 2020年4月3日（基金合同生效日）
----	-------------------------	-------------------------------

	30日	至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,059.10	57,471.22
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3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	48,686.40	19,157.08

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	3,255,558.00	6.58%	4,510,458.00	0.96%

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3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
中国建设银行-活期存款	2,516,040.32	11,938.75	2,197,048.38	114,277.12

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

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 12,250 股招商证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 256,299.33 元，估值总额为人民币 232,995.00 元，占基金资产净值的比例为 0.31%。持有 22,200 股建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 154,065.76 元，估值总额为人民币 147,630.00 元，占基金资产净值的比例为 0.20%（2020 年 12 月 31 日：本基金持有 226,900 股托管人公司建设银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,477,475.24 元，估值总额为人民币 1,424,932.00 元，占基金资产净值的比例为 0.21%。持有 123,050 股基金管理人的股东公司招商证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,751,083.42 元，估值总额为人民币 2,871,987.00 元，占基金资产净值的比例为 0.42%）。

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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	首次公开发行限售	14.01	35.62	3,258.00	45,644.58	116,049.96	-
688607	康众医疗	2021-01-25	2021-08-02	首次公开发行限售	23.21	44.50	1,890.00	43,866.90	84,105.00	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	首次公开发行限售	16.49	37.79	1,499.00	24,718.51	56,647.21	-
688683	莱尔科技	2021-04-01	2021-10-12	首次公开发行限售	9.51	14.73	3,236.00	30,774.36	47,666.28	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发行限售	24.60	163.00	262.00	6,445.20	42,706.00	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	124.00	5,868.92	31,243.04	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	151.00	4,344.27	15,077.35	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	21.31	49.94	280.00	5,966.80	13,983.20	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	首次公开发行限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	首次公开发行限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-

300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	首次公开发行限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	78.00	2,205.84	9,025.38	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	首次公开发行限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	首次公开发行限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	首次公开发行限售	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	首次公开发行限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	首次公开发行限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	首次公开发行限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	首次公开发行限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	首次公开发行限售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	首次公开发行限售	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	首次公开发行限售	16.53	46.07	171.00	2,826.63	7,877.97	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	首次公开发行限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	首次公开发行限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	首次公开发行限售	18.24	28.29	162.00	2,954.88	4,582.98	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	首次公开发行限售	12.13	22.49	187.00	2,268.31	4,205.63	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行限售	4.54	11.54	358.00	1,625.32	4,131.32	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	首次公开发行限售	7.19	12.65	326.00	2,343.94	4,123.90	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	350.00	35,000.00	35,000.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债未上市	100.00	100.00	37.00	3,700.00	3,700.00	-
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	新债未上市	100.00	100.00	30.00	3,000.00	3,000.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，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；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。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》，基金持有的上市公司非公开发行股份，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其持有该次非公开发行股份数量的 50%（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〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的 2020 年 2 月 14 日（含）后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定）；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%。此外，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。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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》，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。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	12,300.00	92,093.75	68,757.00	-

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

本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金属于股票型基金，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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	38,000.00	208,000.00
AAA 以下	3,700.00	-
未评级	-	-
合计	41,700.00	208,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2021 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	2,516,040.32	-	-	-	2,516,040.32
结算备付金	659,386.88	-	-	-	659,386.88
存出保证金	635,361.78	-	-	-	635,361.78
交易性金融资产	-	-	41,700.00	71,525,127.76	71,566,827.76
应收证券清算款	-	-	-	38,283.33	38,283.33
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,301.22	2,301.22
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,810,788.98	-	41,700.00	71,565,712.31	75,418,201.29
负债					
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	-	-	-	9,277.44	9,277.44
应付托管费	-	-	-	3,092.49	3,092.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,938.12	5,938.12
应付交易费用	-	-	-	73,534.12	73,534.12
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	161,739.85	161,739.85
负债总计	-	-	-	253,582.02	253,582.02
利率敏感度缺口	3,810,788.98	-	41,700.00	71,312,130.29	75,164,619.27
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	14,845,718.81	-	-	-	14,845,718.81
结算备付金	2,799,564.82	-	-	-	2,799,564.82
存出保证金	123,507.87	-	-	1,829,271.60	1,952,779.47
交易性金融资产	-	-	208,000.00	662,036,848.14	662,244,848.14
应收证券清算款	-	-	-	20,299,798.23	20,299,798.23
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,011.14	9,011.14
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,768,791.50	-	208,000.00	684,174,929.11	702,151,720.61
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	13,376,487.58	13,376,487.58
应付管理人报酬	-	-	-	40,864.73	40,864.73
应付托管费	-	-	-	13,621.56	13,621.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	59,177.07	59,177.07
应付交易费用	-	-	-	237,929.18	237,929.18
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	85,000.00	85,000.00
负债总计	-	-	-	13,813,080.12	13,813,080.12
利率敏感度缺口	17,768,791.50	-	208,000.00	670,361,848.99	688,338,640.49

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。

6.4.9.4.1.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	71,525,127.76	95.16	662,036,848.14	96.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	41,700.00	0.06	208,000.00	0.03
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	71,566,827.76	95.21	662,244,848.14	96.21

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，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

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 374	增加约 3,400
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 374	减少约 3,400	

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 70,860,912.77 元，属于第二层次的余额为 705,914.99 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 654,116,503.98 元，第二层次 8,128,344.16 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	71,525,127.76	94.84
	其中：股票	71,525,127.76	94.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,700.00	0.06
	其中：债券	41,700.00	0.06
	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	3,175,427.20	4.21
8	其他各项资产	675,946.33	0.90
9	合计	75,418,201.29	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	746,858.46	0.99
B	采矿业	1,492,240.20	1.99
C	制造业	39,832,339.39	52.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,250,684.00	1.66
E	建筑业	865,666.44	1.15
F	批发和零售业	531,437.36	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	2,042,561.70	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,371,971.10	3.16
J	金融业	16,703,679.84	22.22
K	房地产业	1,455,053.00	1.94
L	租赁和商务服务业	1,285,621.10	1.71
M	科学研究和技术服务业	1,018,175.48	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	31,153.31	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	127,429.00	0.17
Q	卫生和社会工作	1,472,466.38	1.96
R	文化、体育和娱乐业	297,791.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	71,525,127.76	95.16

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

1	600519	贵州茅台	2,100	4,319,070.00	5.75
2	601318	中国平安	35,800	2,301,224.00	3.06
3	600036	招商银行	40,900	2,216,371.00	2.95
4	000858	五粮液	6,439	1,918,113.71	2.55
5	601012	隆基股份	14,280	1,268,635.20	1.69
6	000333	美的集团	16,300	1,163,331.00	1.55
7	600276	恒瑞医药	14,816	1,007,043.52	1.34
8	002415	海康威视	15,400	993,300.00	1.32
9	601166	兴业银行	48,010	986,605.50	1.31
10	601888	中国中免	3,221	966,622.10	1.29
11	603259	药明康德	5,972	935,155.48	1.24
12	300059	东方财富	27,344	896,609.76	1.19
13	000651	格力电器	15,900	828,390.00	1.10
14	600900	长江电力	37,600	776,064.00	1.03
15	002594	比亚迪	3,000	753,000.00	1.00
16	002475	立讯精密	16,109	741,014.00	0.99
17	600887	伊利股份	20,100	740,283.00	0.98
18	000001	平安银行	32,000	723,840.00	0.96
19	600030	中信证券	28,100	700,814.00	0.93
20	000725	京东方 A	111,800	697,632.00	0.93
21	300015	爱尔眼科	8,881	630,373.38	0.84
22	601398	工商银行	115,800	598,686.00	0.80
23	600031	三一重工	19,600	569,772.00	0.76
24	000568	泸州老窖	2,400	566,256.00	0.75
25	600309	万华化学	5,200	565,864.00	0.75
26	603501	韦尔股份	1,700	547,400.00	0.73
27	603288	海天味业	4,170	537,721.50	0.72
28	600809	山西汾酒	1,200	537,600.00	0.72
29	000002	万科 A	22,500	535,725.00	0.71
30	002714	牧原股份	8,652	526,214.64	0.70
31	601919	中远海控	16,000	488,640.00	0.65
32	300122	智飞生物	2,600	485,498.00	0.65
33	002142	宁波银行	11,900	463,743.00	0.62
34	600436	片仔癀	1,000	448,300.00	0.60
35	601328	交通银行	90,700	444,430.00	0.59
36	601899	紫金矿业	45,600	441,864.00	0.59
37	002812	恩捷股份	1,800	421,380.00	0.56
38	002304	洋河股份	2,000	414,400.00	0.55
39	002352	顺丰控股	6,000	406,200.00	0.54
40	002230	科大讯飞	5,900	398,722.00	0.53
41	300274	阳光电源	3,400	391,204.00	0.52
42	600000	浦发银行	38,800	388,000.00	0.52
43	600438	通威股份	8,900	385,103.00	0.51
44	300014	亿纬锂能	3,700	384,541.00	0.51
45	300124	汇川技术	5,150	382,439.00	0.51
46	600837	海通证券	31,900	366,850.00	0.49
47	000100	TCL 科技	46,300	354,195.00	0.47
48	000661	长春高新	900	348,300.00	0.46
49	601816	京沪高铁	64,900	343,321.00	0.46
50	000063	中兴通讯	10,200	338,946.00	0.45

51	002241	歌尔股份	7,900	337,646.00	0.45
52	300347	泰格医药	1,700	328,610.00	0.44
53	601601	中国太保	11,300	327,361.00	0.44
54	002460	赣锋锂业	2,700	326,943.00	0.43
55	600585	海螺水泥	7,900	324,295.00	0.43
56	600690	海尔智家	12,500	323,875.00	0.43
57	002271	东方雨虹	5,850	323,622.00	0.43
58	601668	中国建筑	69,300	322,245.00	0.43
59	603986	兆易创新	1,708	320,933.20	0.43
60	300142	沃森生物	5,200	320,840.00	0.43
61	603799	华友钴业	2,800	319,760.00	0.43
62	002027	分众传媒	33,900	318,999.00	0.42
63	600016	民生银行	70,300	310,023.00	0.41
64	600196	复星医药	4,000	288,520.00	0.38
65	600763	通策医疗	700	287,700.00	0.38
66	601288	农业银行	94,900	287,547.00	0.38
67	600048	保利地产	23,700	285,348.00	0.38
68	600703	三安光电	8,900	285,245.00	0.38
69	000338	潍柴动力	15,700	280,559.00	0.37
70	600919	江苏银行	39,040	277,184.00	0.37
71	002129	中环股份	7,000	270,200.00	0.36
72	688111	金山办公	682	269,253.60	0.36
73	601229	上海银行	32,800	268,960.00	0.36
74	601688	华泰证券	17,000	268,600.00	0.36
75	600050	中国联通	61,400	265,248.00	0.35
76	600570	恒生电子	2,790	260,167.50	0.35
77	600660	福耀玻璃	4,600	256,910.00	0.34
78	601211	国泰君安	14,900	255,386.00	0.34
79	600104	上汽集团	11,600	254,852.00	0.34
80	688169	石头科技	200	252,200.00	0.34
81	601766	中国中车	40,200	244,416.00	0.33
82	601169	北京银行	48,900	238,143.00	0.32
83	600999	招商证券	12,250	232,995.00	0.31
84	600019	宝钢股份	29,400	224,616.00	0.30
85	002371	北方华创	800	221,904.00	0.30
86	002311	海大集团	2,700	220,320.00	0.29
87	002049	紫光国微	1,400	215,866.00	0.29
88	601988	中国银行	69,600	214,368.00	0.29
89	601088	中国神华	10,900	212,768.00	0.28
90	300498	温氏股份	14,780	212,388.60	0.28
91	600406	国电南瑞	9,120	211,948.80	0.28
92	002410	广联达	3,100	211,420.00	0.28
93	300601	康泰生物	1,400	208,600.00	0.28
94	601818	光大银行	54,600	206,388.00	0.27
95	300450	先导智能	3,400	204,476.00	0.27
96	600745	闻泰科技	2,100	203,490.00	0.27
97	000625	长安汽车	7,500	197,100.00	0.26
98	000538	云南白药	1,700	196,724.00	0.26
99	600028	中国石化	44,200	192,712.00	0.26
100	601628	中国人寿	5,500	186,395.00	0.25

101	002821	凯莱英	500	186,300.00	0.25
102	600893	航发动力	3,500	186,165.00	0.25
103	600346	恒力石化	7,000	183,680.00	0.24
104	601658	邮储银行	35,900	180,218.00	0.24
105	600588	用友网络	5,410	179,936.60	0.24
106	601390	中国中铁	33,600	176,064.00	0.23
107	300595	欧普康视	1,700	176,035.00	0.23
108	601633	长城汽车	4,000	174,360.00	0.23
109	601009	南京银行	16,500	173,580.00	0.23
110	002493	荣盛石化	10,050	173,563.50	0.23
111	601377	兴业证券	17,700	170,982.00	0.23
112	688036	传音控股	813	170,323.50	0.23
113	601857	中国石油	32,100	169,809.00	0.23
114	600009	上海机场	3,500	168,455.00	0.22
115	300413	芒果超媒	2,400	164,640.00	0.22
116	600132	重庆啤酒	800	158,360.00	0.21
117	601225	陕西煤业	13,200	156,420.00	0.21
118	600584	长电科技	4,100	154,488.00	0.21
119	300408	三环集团	3,600	152,712.00	0.20
120	002601	龙蟠佰利	4,400	152,152.00	0.20
121	600426	华鲁恒升	4,900	151,655.00	0.20
122	601100	恒立液压	1,736	149,157.12	0.20
123	600111	北方稀土	7,200	149,040.00	0.20
124	000776	广发证券	9,800	148,372.00	0.20
125	601939	建设银行	22,200	147,630.00	0.20
126	002001	新和成	5,140	147,415.20	0.20
127	000895	双汇发展	4,600	146,280.00	0.19
128	600926	杭州银行	9,800	144,550.00	0.19
129	300433	蓝思科技	4,900	144,109.00	0.19
130	603882	金域医学	900	143,793.00	0.19
131	688012	中微公司	861	142,857.12	0.19
132	002179	中航光电	1,800	142,236.00	0.19
133	002050	三花智控	5,910	141,721.80	0.19
134	000166	申万宏源	29,800	139,464.00	0.19
135	600600	青岛啤酒	1,200	138,780.00	0.18
136	600958	东方证券	13,800	137,862.00	0.18
137	002841	视源股份	1,100	136,719.00	0.18
138	600741	华域汽车	5,200	136,604.00	0.18
139	300003	乐普医疗	4,200	134,904.00	0.18
140	000963	华东医药	2,900	133,429.00	0.18
141	002007	华兰生物	3,590	131,681.20	0.18
142	000786	北新建材	3,300	129,525.00	0.17
143	000157	中联重科	14,000	129,360.00	0.17
144	601006	大秦铁路	19,600	128,968.00	0.17
145	601336	新华保险	2,800	128,548.00	0.17
146	002607	中公教育	6,100	127,429.00	0.17
147	601901	方正证券	13,600	127,296.00	0.17
148	603806	福斯特	1,200	126,156.00	0.17
149	600015	华夏银行	20,300	125,657.00	0.17
150	601155	新城控股	3,000	124,800.00	0.17

151	002236	大华股份	5,900	124,490.00	0.17
152	601989	中国重工	30,100	124,012.00	0.16
153	600143	金发科技	5,900	123,074.00	0.16
154	600176	中国巨石	7,930	122,994.30	0.16
155	601138	工业富联	9,800	121,618.00	0.16
156	000768	中航西飞	4,600	120,888.00	0.16
157	603993	洛阳钼业	23,300	120,228.00	0.16
158	601877	正泰电器	3,600	120,168.00	0.16
159	600760	中航沈飞	1,960	118,188.00	0.16
160	600352	浙江龙盛	8,600	118,164.00	0.16
161	600010	包钢股份	75,300	116,715.00	0.16
162	601788	光大证券	6,500	116,285.00	0.15
163	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.15
164	001979	招商蛇口	10,500	114,975.00	0.15
165	600547	山东黄金	5,960	114,551.20	0.15
166	601600	中国铝业	21,600	114,480.00	0.15
167	603369	今世缘	2,100	113,736.00	0.15
168	002008	大族激光	2,800	113,092.00	0.15
169	601186	中国铁建	15,200	112,936.00	0.15
170	601799	星宇股份	500	112,860.00	0.15
171	300529	健帆生物	1,300	112,268.00	0.15
172	002202	金风科技	9,100	110,656.00	0.15
173	601916	浙商银行	27,600	109,572.00	0.15
174	000876	新希望	7,400	108,558.00	0.14
175	002555	三七互娱	4,400	105,688.00	0.14
176	000938	紫光股份	4,760	104,148.80	0.14
177	003816	中国广核	39,000	104,130.00	0.14
178	002736	国信证券	9,500	102,125.00	0.14
179	600109	国金证券	8,000	101,520.00	0.14
180	603899	晨光文具	1,200	101,472.00	0.13
181	601066	中信建投	3,200	100,576.00	0.13
182	000069	华侨城 A	13,500	100,440.00	0.13
183	600989	宝丰能源	7,300	99,864.00	0.13
184	300136	信维通信	3,200	98,816.00	0.13
185	000425	徐工机械	15,500	98,735.00	0.13
186	601669	中国电建	25,300	97,911.00	0.13
187	600150	中国船舶	5,900	97,409.00	0.13
188	000596	古井贡酒	400	95,800.00	0.13
189	000977	浪潮信息	3,400	95,642.00	0.13
190	603659	璞泰来	700	95,620.00	0.13
191	600795	国电电力	38,900	94,527.00	0.13
192	600085	同仁堂	2,300	93,955.00	0.12
193	002384	东山精密	4,500	93,780.00	0.12
194	000783	长江证券	12,800	93,696.00	0.12
195	601238	广汽集团	7,200	93,240.00	0.12
196	603019	中科曙光	3,360	92,769.60	0.12
197	603160	汇顶科技	715	92,685.45	0.12
198	601838	成都银行	7,200	91,008.00	0.12
199	002624	完美世界	3,800	90,858.00	0.12
200	603833	欧派家居	640	90,854.40	0.12

201	600079	人福医药	3,200	90,464.00	0.12
202	600183	生益科技	3,800	88,958.00	0.12
203	600886	国投电力	9,200	88,412.00	0.12
204	688008	澜起科技	1,417	88,392.46	0.12
205	600029	南方航空	14,600	87,892.00	0.12
206	000703	恒逸石化	7,340	87,713.00	0.12
207	601985	中国核电	17,300	87,538.00	0.12
208	300677	英科医疗	700	87,360.00	0.12
209	300144	宋城演艺	5,200	87,360.00	0.12
210	601108	财通证券	8,300	87,067.00	0.12
211	601360	三六零	7,100	86,691.00	0.12
212	300558	贝达药业	800	86,592.00	0.12
213	601555	东吴证券	10,300	85,902.00	0.11
214	002600	领益智造	9,300	85,467.00	0.11
215	002414	高德红外	3,080	84,946.40	0.11
216	000066	中国长城	5,800	84,680.00	0.11
217	603517	绝味食品	1,000	84,290.00	0.11
218	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.11
219	002252	上海莱士	11,100	83,139.00	0.11
220	300676	华大基因	700	83,020.00	0.11
221	002938	鹏鼎控股	2,300	82,524.00	0.11
222	002044	美年健康	9,000	81,990.00	0.11
223	601077	渝农商行	20,400	81,396.00	0.11
224	688396	华润微	890	81,007.80	0.11
225	600522	中天科技	8,100	81,000.00	0.11
226	000728	国元证券	10,080	80,337.60	0.11
227	601607	上海医药	3,800	80,294.00	0.11
228	300033	同花顺	700	78,946.00	0.11
229	002602	世纪华通	12,280	78,837.60	0.10
230	600161	天坛生物	2,300	78,775.00	0.10
231	600332	白云山	2,300	77,855.00	0.10
232	601111	中国国航	9,900	77,022.00	0.10
233	600383	金地集团	7,500	76,800.00	0.10
234	600362	江西铜业	3,400	76,092.00	0.10
235	600872	中炬高新	1,800	75,636.00	0.10
236	300628	亿联网络	900	75,420.00	0.10
237	600115	中国东航	14,800	75,184.00	0.10
238	601800	中国交建	11,600	75,168.00	0.10
239	002508	老板电器	1,600	74,400.00	0.10
240	600845	宝信软件	1,440	73,296.00	0.10
241	600061	国投资本	8,512	72,266.88	0.10
242	000860	顺鑫农业	1,700	71,706.00	0.10
243	601727	上海电气	16,900	71,656.00	0.10
244	601618	中国中冶	23,600	70,328.00	0.09
245	601162	天风证券	14,300	69,498.00	0.09
246	000708	中信特钢	3,300	68,772.00	0.09
247	002024	苏宁易购	12,300	68,757.00	0.09
248	600705	中航资本	17,700	68,499.00	0.09
249	601021	春秋航空	1,200	68,280.00	0.09
250	603939	益丰药房	1,200	67,308.00	0.09

251	601878	浙商证券	5,100	66,708.00	0.09
252	002916	深南电路	600	66,678.00	0.09
253	600606	绿地控股	12,100	65,945.00	0.09
254	601990	南京证券	6,100	64,172.00	0.09
255	002456	欧菲光	7,100	63,048.00	0.08
256	002157	正邦科技	5,200	62,140.00	0.08
257	002463	沪电股份	4,000	61,880.00	0.08
258	000656	金科股份	10,600	61,374.00	0.08
259	600011	华能国际	14,500	61,190.00	0.08
260	603195	公牛集团	300	60,600.00	0.08
261	600521	华海药业	2,900	60,552.00	0.08
262	601933	永辉超市	12,600	59,598.00	0.08
263	600655	豫园股份	5,100	59,109.00	0.08
264	600118	中国卫星	2,000	58,520.00	0.08
265	688363	华熙生物	208	57,794.88	0.08
266	601696	中银证券	2,800	57,652.00	0.08
267	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.08
268	601216	君正集团	11,100	56,499.00	0.08
269	600848	上海临港	3,120	55,848.00	0.07
270	601995	中金公司	900	55,350.00	0.07
271	600489	中金黄金	6,400	55,168.00	0.07
272	600018	上港集团	11,500	54,855.00	0.07
273	002558	巨人网络	4,000	53,200.00	0.07
274	002120	韵达股份	3,870	52,361.10	0.07
275	601998	中信银行	10,100	51,510.00	0.07
276	601872	招商轮船	10,680	49,341.60	0.07
277	688009	中国通号	8,597	48,916.93	0.07
278	002673	西部证券	5,900	48,675.00	0.06
279	601319	中国人保	8,200	48,626.00	0.06
280	688126	沪硅产业	1,639	47,826.02	0.06
281	688683	莱尔科技	3,236	47,666.28	0.06
282	603338	浙江鼎力	800	46,952.00	0.06
283	603392	万泰生物	180	46,652.40	0.06
284	601881	中国银河	4,300	46,354.00	0.06
285	002739	万达电影	2,900	45,791.00	0.06
286	300919	中伟股份	262	42,706.00	0.06
287	600233	圆通速递	4,200	42,042.00	0.06
288	603658	安图生物	550	41,673.50	0.06
289	603233	大参林	800	40,888.00	0.05
290	300894	火星人	586	39,848.00	0.05
291	601231	环旭电子	2,200	36,982.00	0.05
292	600482	中国动力	2,100	36,582.00	0.05
293	002153	石基信息	1,540	36,205.40	0.05
294	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.05
295	002939	长城证券	3,100	34,503.00	0.05
296	600025	华能水电	5,900	34,161.00	0.05
297	600340	华夏幸福	6,450	33,798.00	0.04
298	000800	一汽解放	3,100	33,542.00	0.04
299	601236	红塔证券	2,400	32,544.00	0.04
300	002032	苏泊尔	500	31,895.00	0.04

301	300957	贝泰妮	124	31,243.04	0.04
302	601808	中海油服	2,000	28,720.00	0.04
303	002773	康弘药业	1,200	27,756.00	0.04
304	600918	中泰证券	2,500	27,050.00	0.04
305	601698	中国卫通	1,500	24,285.00	0.03
306	603087	甘李药业	200	21,316.00	0.03
307	600299	安迪苏	1,300	15,548.00	0.02
308	300953	震裕科技	151	15,077.35	0.02
309	300941	创识科技	280	13,983.20	0.02
310	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
311	300940	南极光	307	13,317.66	0.02
312	300937	药易购	244	13,105.24	0.02
313	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.02
314	002945	华林证券	900	12,438.00	0.02
315	603171	税友股份	637	12,230.40	0.02
316	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
317	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.01
318	300973	立高食品	78	9,025.38	0.01
319	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
320	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
321	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
322	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
323	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
324	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
325	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
326	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.01
327	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.01
328	300955	嘉亨家化	171	7,877.97	0.01
329	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
330	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.01
331	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.01
332	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01
333	300971	博亚精工	162	4,582.98	0.01
334	300963	中洲特材	187	4,205.63	0.01
335	300967	晓鸣股份	358	4,131.32	0.01
336	300972	万辰生物	326	4,123.90	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	000858	五粮液	10,486,366.48	1.52
2	000333	美的集团	5,035,667.85	0.73
3	000651	格力电器	3,307,537.01	0.48
4	000661	长春高新	3,289,837.00	0.48
5	600519	贵州茅台	3,113,521.00	0.45
6	000568	泸州老窖	2,830,326.37	0.41

7	600030	中信证券	2,598,020.00	0.38
8	002415	海康威视	2,492,954.73	0.36
9	601318	中国平安	2,467,464.00	0.36
10	000001	平安银行	2,458,099.40	0.36
11	600036	招商银行	2,425,114.00	0.35
12	300059	东方财富	2,407,912.96	0.35
13	000002	万科 A	2,235,186.04	0.32
14	002475	立讯精密	2,138,894.00	0.31
15	000725	京东方 A	2,052,515.00	0.30
16	002714	牧原股份	1,998,832.76	0.29
17	002594	比亚迪	1,949,510.00	0.28
18	002352	顺丰控股	1,753,536.86	0.25
19	300015	爱尔眼科	1,572,202.05	0.23
20	300014	亿纬锂能	1,566,272.00	0.23

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	000858	五粮液	27,284,897.55	3.96
2	000333	美的集团	19,566,297.53	2.84
3	000651	格力电器	12,544,640.08	1.82
4	300059	东方财富	9,077,364.82	1.32
5	000568	泸州老窖	9,017,834.12	1.31
6	000661	长春高新	8,728,009.96	1.27
7	000001	平安银行	8,501,019.00	1.24
8	002415	海康威视	8,325,633.35	1.21
9	000002	万科 A	8,256,087.73	1.20
10	002475	立讯精密	8,225,938.59	1.20
11	002594	比亚迪	7,592,020.60	1.10
12	002714	牧原股份	7,430,956.75	1.08
13	000725	京东方 A	6,969,236.00	1.01
14	002352	顺丰控股	6,876,838.35	1.00
15	002304	洋河股份	6,524,778.00	0.95
16	300015	爱尔眼科	5,258,977.66	0.76
17	300014	亿纬锂能	5,148,640.00	0.75
18	002142	宁波银行	4,979,357.68	0.72
19	000100	TCL 科技	4,856,523.00	0.71
20	002027	分众传媒	4,512,715.00	0.66

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	139,881,141.36
卖出股票的收入（成交）总额	362,897,965.25

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	41,700.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,700.00	0.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113050	南银转债	350	35,000.00	0.05
2	127038	国微转债	37	3,700.00	0.00
3	113049	长汽转债	30	3,000.00	0.00

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

7.10.1 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	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	2.00	3,099,840.00	-15,840.00	-
公允价值变动总额合计					-15,840.00
股指期货投资本期收益					576,349.51
股指期货投资本期公允价值变动					-744,300.00

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、兴业银行(601166)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。

主要违规事实：2020年9月11日，因存在1、为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2、为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3、违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4、违反银行卡收单外包管理规定；5、未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，中国人民银行福州中心支行对兴业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	635,361.78
2	应收证券清算款	38,283.33
3	应收股利	-
4	应收利息	2,301.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	675,946.33
---	----	------------

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
1,651	29,959.53	13,359,656.00	27.01%	36,103,525.00	72.99%

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	华泰证券股份有限公司	3,696,492.00	7.47%
2	招商证券股份有限公司	3,255,558.00	6.58%
3	浙江永安资本管理有限公司	2,207,000.00	4.46%
4	广发证券股份有限公司	2,203,691.00	4.46%
5	中信证券股份有限公司	1,853,515.00	3.75%
6	张光明	1,527,500.00	3.09%
7	熊璋	1,453,046.00	2.94%
8	倪凯奇	983,000.00	1.99%
9	李传昌	909,300.00	1.84%
10	黄菊枝	838,700.00	1.70%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 3 日）基金份额总额	265,463,181.00
本报告期期初基金份额总额	469,463,181.00
本报告期基金总申购份额	135,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	555,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	49,463,181.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人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	
瑞银证券	1	36,923,660.49	7.39%	34,455.77	7.45%	新增 1 个
中泰证券	1	49,666.08	0.01%	36.33	0.01%	新增 1 个
国泰君安	2	14,373,892.78	2.88%	13,386.13	2.90%	-
长江证券	1	10,463,094.92	2.09%	9,744.22	2.11%	-
爱建证券	2	16,016,911.31	3.21%	11,713.37	2.53%	新增 1 个
中信证券	2	421,859,472.18	84.42%	392,880.63	85.00%	新增 2 个
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；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
瑞银证券	67,201.00	10.50%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	125,491.02	19.61%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	447,372.30	69.89%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
2	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
3	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-17
4	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
5	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
6	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
7	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-08
8	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-06
9	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
10	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
11	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
12	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
13	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
14	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的	上海证券报、基金管理人	2021-03-10

	长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	网站、证监会基金电子披露网站	
16	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
17	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
18	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-28
19	博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22
20	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国信证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-15
21	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华创证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-14

§ 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	2021-01-01~2021-01-03	206,632,400.00	-	206,632,400.00	-	-
	2	2021-03-02~2021-04-01; 2021-04-06~2021-04-08; 2021-04-21~2021-04-28	35,898,600.00	-	35,898,600.00	-	-
	3	2021-01-01~2021-03-01; 2021-03-09~2021-03-14	114,000,000.00	78,000,000.00	192,000,000.00	-	-

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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时沪深 300 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 博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日