

# 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告  
2023 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	9
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>9</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	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内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>10</b>
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	36
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.....	36
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.12 投资组合报告附注.....	36
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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.....	38
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>

<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
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 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	38
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
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 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 其他重大事件 .....	40
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>41</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 .....	41
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	42
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>42</b>
12.1 备查文件目录 .....	42
12.2 存放地点 .....	43
12.3 查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时创业板 ETF
场内简称	创业板 ETF 博时
基金主代码	159908
交易代码	159908
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2018 年 12 月 10 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	849,229,029.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 7 月 13 日

注：本基金由原深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金转型而来。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、本基金主要采用完全复制法进行投资，采用完全复制法，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。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。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过 2%。</p> <p>2、衍生品投资策略。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。</p> <p>3、融资及转融通证券出借策略。</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即创业板指数收益率。
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，属于高风险/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，主要采用完全复制策略，跟踪创业板指数，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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	孙麒清	陆志俊

负责人	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216
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	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188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	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		518040	200336
法定代表人		江向阳	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的互联网网址	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(2023年1月1日至2023年6月30日)
本期已实现收益	-24,506,049.74
本期利润	-95,425,939.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1427
本期加权平均净值利润率	-6.71%
本期基金份额净值增长率	-5.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	859,301,631.83
期末可供分配基金份额利润	1.0119
期末基金资产净值	1,708,530,660.83
期末基金份额净值	2.0119
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	72.47%

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。

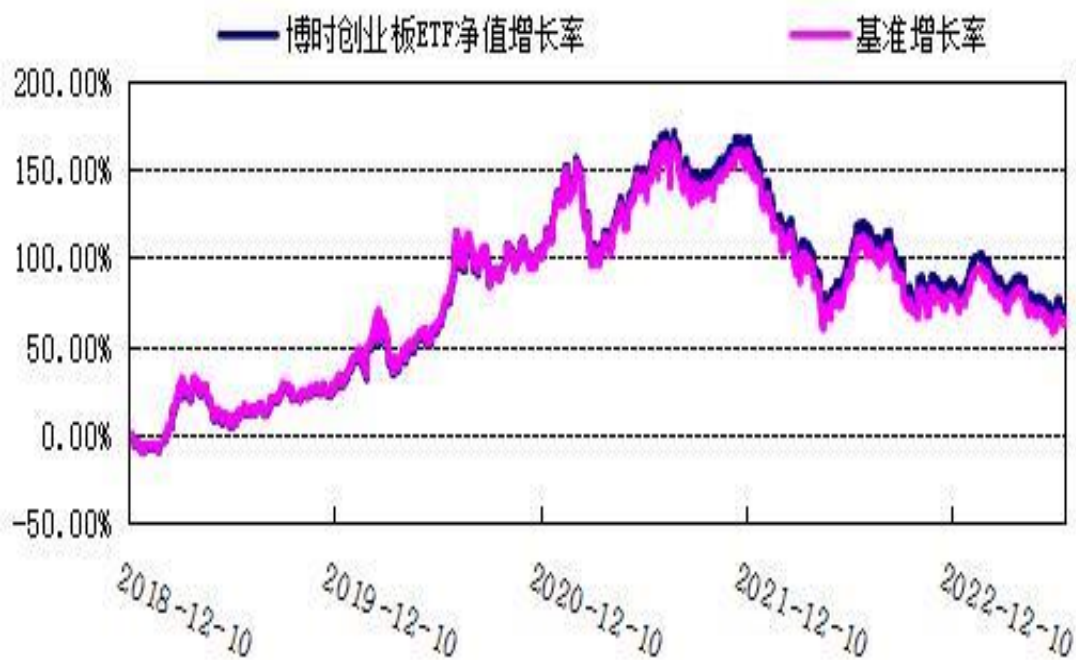
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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	1.20%	1.37%	0.98%	1.37%	0.22%	0.00%
过去三个月	-7.16%	1.12%	-7.69%	1.12%	0.53%	0.00%
过去六个月	-5.23%	1.08%	-5.61%	1.08%	0.38%	0.00%
过去一年	-20.69%	1.29%	-21.19%	1.30%	0.50%	-0.01%
过去三年	-3.98%	1.68%	-9.15%	1.69%	5.17%	-0.01%
自基金合同生效起至今	72.47%	1.70%	65.17%	1.72%	7.30%	-0.02%

#### 3.2.2 自基金转型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 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元

人民币，累计分红逾 1851 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		
尹浩	基金经理	2019-10-11	-	10.9	尹浩先生，硕士。2012 年起先后在华宝证券、国金证券工作。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 10 月 11 日-2023 年 3 月 8 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(2019 年 10 月 11 日-2023 年 3 月 8 日)的基金经理。现任博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 10 月 11 日一至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 10 月 11 日一至今)、博时中证 5G 产业 50 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 27 日一至今)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 10 日一至今)、博时中证智能消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 30 日一至今)、博时中证 5G 产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021 年 7 月 14 日一至今)、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 7 月 15 日一至今)、博时中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 8 月 19 日一至今)、博时中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 9 月 24 日一至今)、博时中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021 年 11 月 30 日一至今)、博时国证龙头家电交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 12 月 13 日一至今)、博时中证湖北新旧动能转换交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 12 月 29 日一至今)、博时中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 7 月 1 日一至今)、博时中证成渝地区双城经济圈成份交易型开放式指数



					证券投资基金(2022年8月15日一至今)、博时中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2023年1月6日一至今)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	6.9	王萌先生, 博士。2016年毕业后加入博时基金管理有限公司。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。

#### 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 89 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

2023 年上半年 A 股市场呈现明显的结构行情特征, 人工智能相关的 TMT 板块涨幅大幅领先于其他板块, 中国特色估值体系相关板块如石油石化、建筑也有不错表现。受经济复苏不及预期影响的房地产、建材和化工以及消费相关的消费者服务、农林牧渔和食品饮料上半年表现相对落后。主要宽基指数中证 1000 和科创 50 相对领先, 创业板指相对落后。风格上大盘价值表现最好。海外主要市场上半年表现出色, 日经指数创 1991 年以来新高, 纳斯达克指数涨幅也超 30%。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。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日, 本基金基金份额净值为 2.0119 元, 份额累计净值为 2.0119 元。报告期内, 本基金基金份额净值增长率为-5.23%, 同期业绩基准增长率-5.61%。

#### 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，国内经济相比上半年有望出现环比改善，上市公司迎来盈利底。本轮 PPI 于 2021 年 10 月见顶，下行周期持续 19 个月，根据历史经验看，在没有系统性危机的情况下，本轮 PPI 下行不管是从时间周期还是幅度均已具备底部条件。本轮库存周期在 2022 年 4 月触顶，目前已下行 12 个月。后续如果经济继续低位运行，会推动企业加速主动去库存，库存有望加速见底；如果经济边际好转，则企业会进入被动去库存阶段，从历史上看在被动去库存阶段，企业盈利、股市均会出现反弹。PPI 和库存周期与工业企业盈利高度相关，在 PPI 和库存周期见底的情况下，工业企业盈利在下半年有望见底反弹。指数预计随企业盈利呈现震荡上行，但结构性机会重于大势。结构上沿着成长与高股息两条主线布局，成长板块关注估值较低、周期向上的行业；高股息关注新一轮国企改革和价值提升板块。在投资策略上，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。

#### 4.6 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

本报告期内，基金托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由基金管理人编制并经托管人复核审查的有关本报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	12,879,356.56	9,802,406.48
结算备付金		137,715.65	90,931.05
存出保证金		4,046.89	10,438.21
交易性金融资产	6.4.3.2	1,696,937,370.27	1,091,168,661.04
其中：股票投资		1,696,937,370.27	1,091,168,661.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		22,880.18	142,148.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.3.6	4,343.02	2,083.20
资产总计		1,709,985,712.57	1,101,216,668.61
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,606.20	78.17
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		683,271.45	464,946.29
应付托管费		136,654.27	92,989.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		612.09	96.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	631,907.73	488,590.90
负债合计		1,455,051.74	1,046,701.29
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	849,229,029.00	518,229,029.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	859,301,631.83	581,940,938.32
净资产合计		1,708,530,660.83	1,100,169,967.32
<b>负债和净资产总计</b>		<b>1,709,985,712.57</b>	<b>1,101,216,668.61</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0119 元，基金份额总额 849,229,029.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
<b>一、营业总收入</b>		-90,894,673.00	-71,552,340.92
1. 利息收入		74,270.65	31,869.28
其中：存款利息收入	6.4.3.10	44,095.31	31,826.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		30,175.34	42.29
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,074,899.72	-21,892,802.94

其中：股票投资收益	6.4.3.11	-29,767,725.33	-24,650,420.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	67,917.74
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	9,692,825.61	2,689,699.93
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）	6.4.3.16	-70,919,889.44	-49,318,885.64
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	25,845.51	-372,521.62
<b>减：二、营业总支出</b>		4,531,266.18	2,121,948.98
1. 管理人报酬		3,513,404.20	1,619,064.10
2. 托管费		702,680.84	323,812.81
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	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		108.61	0.32
8. 其他费用	6.4.3.19	315,072.53	179,071.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-95,425,939.18	-73,674,289.90
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-95,425,939.18	-73,674,289.90
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-95,425,939.18	-73,674,289.90

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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）	518,229,029.00	-	581,940,938.32	1,100,169,967.32
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)	518,229,029.00	-	581,940,938.32	1,100,169,967.32
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	331,000,000.00	-	277,360,693.51	608,360,693.51
(一)、综合收益总额	-	-	-95,425,939.18	-95,425,939.18
(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)	331,000,000.00	-	372,786,632.69	703,786,632.69
其中: 1. 基金申购款	350,000,000.00	-	393,871,159.76	743,871,159.76
2. 基金赎回款	-19,000,000.00	-	-21,084,527.07	-40,084,527.07
(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)	849,229,029.00	-	859,301,631.83	1,708,530,660.83
项目	上年度可比期间 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)	199,729,029.00	-	395,158,939.62	594,887,968.62
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)	199,729,029.00	-	395,158,939.62	594,887,968.62
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	116,500,000.00	-	90,835,363.44	207,335,363.44
(一)、综合收益总额	-	-	-73,674,289.90	-73,674,289.90
(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)	116,500,000.00	-	164,509,653.34	281,009,653.34
其中: 1. 基金申购款	191,000,000.00	-	266,893,499.96	457,893,499.96
2. 基金赎回款	-74,500,000.00	-	-102,383,846.62	-176,883,846.62
(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）	316,229,029.00	-	485,994,303.06	802,223,332.06

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：徐卫，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[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[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。

(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 2023年6月30日
活期存款	12,879,356.56
等于：本金	12,876,833.28
加：应计利息	2,523.28
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	12,879,356.56

##### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,907,809,023.37	-	1,696,937,370.27	-210,871,653.10
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		1,907,809,023.37	-	1,696,937,370.27	-210,871,653.10

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

##### 6.4.3.5 其他权益工具投资

##### 6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

##### 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	4,343.02
待摊费用	-
合计	4,343.02

##### 6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	142,558.69
其中：交易所市场	142,558.69
银行间市场	-
应付利息	-

其他应付款	25,000.00
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	360,210.69
合计	631,907.73

#### 6.4.3.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	518,229,029.00	518,229,029.00
本期申购	350,000,000.00	350,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-19,000,000.00	-19,000,000.00
本期末	849,229,029.00	849,229,029.00

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）。

#### 6.4.3.9 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	722,565,376.13	-140,624,437.81	581,940,938.32
本期利润	-24,506,049.74	-70,919,889.44	-95,425,939.18
本期基金份额交易产生的变动数	460,400,023.83	-87,613,391.14	372,786,632.69
其中：基金申购款	486,630,371.49	-92,759,211.73	393,871,159.76
基金赎回款	-26,230,347.66	5,145,820.59	-21,084,527.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,158,459,350.22	-299,157,718.39	859,301,631.83

#### 6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	43,115.05
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	922.72
其他	57.54
合计	44,095.31

#### 6.4.3.11 股票投资收益

##### 6.4.3.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-25,749,452.60
股票投资收益——赎回差价收入	-4,018,272.73
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	-29,767,725.33

**6.4.3.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	104,938,309.76
减：卖出股票成本总额	130,399,055.24
减：交易费用	288,707.12
买卖股票差价收入	-25,749,452.60

**6.4.3.11.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	40,084,527.07
减：现金支付赎回款总额	-4,007.93
减：赎回股票成本总额	44,106,807.73
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,018,272.73

**6.4.3.12 债券投资收益**
**6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无发生额。

**6.4.3.13 资产支持证券投资收益**
**6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.3.13.2 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。

**6.4.3.14 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**

无发生额。

**6.4.3.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,692,825.61
其中：证券出借权益补偿收入	4,000.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,692,825.61

**6.4.3.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-70,919,889.44
——股票投资	-70,919,889.44
——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	-70,919,889.44

**6.4.3.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	25,845.51
合计	25,845.51

**6.4.3.18 信用减值损失**

无。

**6.4.3.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	210,804.18
银行汇划费	130.00
合计	315,072.53

**6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明**
**6.4.4.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

**6.4.4.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“博时创业板 ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,513,404.20	1,619,064.10
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 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	702,680.84	323,812.81

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	3,007,900.00	0.35%	1,791,000.00	0.35%
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	610,242,465.00	71.86%	490,782,765.00	94.70%

注：1. 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。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
交通银行-活期存款	12,879,356.56	43,115.05	5,733,858.51	30,778.41

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

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	7,523.00	189,955.75
上年度可比期间 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
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	4,476.00	166,641.48

招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89
------------	--------	------	------	--------	-----------

#### 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

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2023 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	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
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	4,338.00	250,129.08	250,129.08	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,676.00	124,755.68	124,755.68	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241.00	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩光电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	5 个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,754.00	71,108.28	71,108.28	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7 个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	首次公开发行股票限售	23.77	42.89	1,344.00	31,946.88	57,644.16	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	首次公开发行股票限售	76.80	107.95	364.00	27,955.20	39,293.80	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	首次公开发行股票限售	38.13	31.03	1,206.00	45,984.78	37,422.18	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	首次公开发行股票限售	5.00	8.96	3,574.00	17,870.00	32,023.04	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	首次公开发行股票限售	11.88	21.02	1,386.00	16,465.68	29,133.72	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	首次公开发行股票限售	50.00	30.71	931.00	46,550.00	28,591.01	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	首次公开发行股票限售	57.66	57.66	482.00	27,792.12	27,792.12	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	首次公开发行股票限售	29.60	71.42	333.00	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	首次公开发行股票	26.80	22.32	1,058.00	28,354.40	23,614.56	-

				限售						
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	首次公开发售 限售	32.34	31.86	687.00	22,217.58	21,887.82	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	首次公开发售 限售	87.30	53.24	392.00	34,219.71	20,870.08	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	首次公开发售 限售	46.16	35.72	493.00	22,756.88	17,609.96	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	首次公开发售 限售	19.99	16.90	949.00	18,970.51	16,038.10	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	首次公开发售 限售	14.81	13.73	1,122.00	16,616.82	15,405.06	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	首次公开发售 限售	16.24	16.95	879.00	14,274.96	14,899.05	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	首次公开发售 限售	25.25	19.69	753.00	19,013.25	14,826.57	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	首次公开发售 限售	24.80	43.85	330.00	8,184.00	14,470.50	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	首次公开发售 限售	58.32	45.36	307.00	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	首次公开发售 限售	26.68	26.68	520.00	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	首次公开发售 限售	57.88	49.17	281.00	16,264.28	13,816.77	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	首次公开发售 限售	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6 个月	首次公开发售 限售	13.06	20.62	642.00	8,384.52	13,238.04	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	首次公开发售 限售	71.88	92.60	134.00	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	首次公开发售 限售	73.45	46.64	266.00	19,537.70	12,406.24	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	首次公开发售 限售	19.99	19.99	583.00	11,654.17	11,654.17	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	首次公开发售 限售	41.20	42.69	262.00	10,794.40	11,184.78	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	首次公开发售 限售	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	首次公开发售 限售	72.50	58.42	165.00	11,962.50	9,639.30	-
301355	南王科	2023-06-02	6 个月	首次公	17.55	16.75	563.00	9,880.65	9,430.25	-



	技			开发行 限售						
301357	北方长 龙	2023-04-11	6 个月	首次公 开发行 限售	50.00	48.39	190.00	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电 器	2023-03-21	6 个月	首次公 开发行 限售	29.99	23.79	378.00	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	首次公 开发行 限售	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
301373	凌玮科 技	2023-01-20	6 个月	首次公 开发行 限售	33.73	31.85	277.00	9,343.21	8,822.45	-
301170	锡南科 技	2023-06-16	6 个月	首次公 开发行 限售	34.00	34.93	250.00	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股 份	2023-06-28	6 个月	首次公 开发行 限售	25.82	25.82	306.00	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科 技	2023-06-19	6 个月	首次公 开发行 限售	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环 保	2023-03-28	6 个月	首次公 开发行 限售	46.13	34.40	225.00	10,379.25	7,740.00	-
301261	恒工精 密	2023-06-29	6 个月	首次公 开发行 限售	36.90	36.90	198.00	7,306.20	7,306.20	-
301428	世纪恒 通	2023-05-10	6 个月	首次公 开发行 限售	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科 技	2023-05-09	6 个月	首次公 开发行 限售	28.84	30.78	170.00	4,902.80	5,232.60	-
001328	登康口 腔	2023-03-29	6 个月	首次公 开发行 限售	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻 造	2023-05-15	6 个月	首次公 开发行 限售	27.93	33.03	105.00	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集 团	2023-03-31	6 个月	首次公 开发行 限售	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科 技	2023-05-12	6 个月	首次公 开发行 限售	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药 业	2023-03-30	6 个月	首次公 开发行 限售	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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、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设定限售期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。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	300308	中际旭创	2023年7月4日	147.45	12,000.00	1,769,400.00
2	300418	昆仑万维	2023年7月3日	40.28	36,400.00	1,466,192.00
合计					48,400.00	3,235,592.00

#### 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

本基金是被动式投资的股票型指数基金,紧密跟踪创业板指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法,跟踪创业板指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代,力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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。

#### 6.4.9.2 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主要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于借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，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约约定到期日均为一个月以内且不付息。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。

##### 6.4.9.3.1 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 2023 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	12,879,356.56	-	-	-	12,879,356.56
结算备付金	137,715.65	-	-	-	137,715.65
存出保证金	4,046.89	-	-	-	4,046.89
交易性金融资产	-	-	-	1,696,937,370.27	1,696,937,370.27
应收清算款	-	-	-	22,880.18	22,880.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,343.02	4,343.02
<b>资产总计</b>	<b>13,021,119.10</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,696,964,593.47</b>	<b>1,709,985,712.57</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,606.20	2,606.20
应付管理人报酬	-	-	-	683,271.45	683,271.45
应付托管费	-	-	-	136,654.27	136,654.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	612.09	612.09
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	631,907.73	631,907.73
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,455,051.74</b>	<b>1,455,051.74</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>13,021,119.10</b>	-	-	<b>1,695,509,541.73</b>	<b>1,708,530,660.83</b>
<b>上年度末</b>					
<b>2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	9,802,406.48	-	-	-	9,802,406.48
结算备付金	90,931.05	-	-	-	90,931.05
存出保证金	10,438.21	-	-	-	10,438.21
交易性金融资产	-	-	-	1,091,168,661.04	1,091,168,661.04
应收清算款	-	-	-	142,148.63	142,148.63
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,083.20	2,083.20
<b>资产总计</b>	<b>9,903,775.74</b>	-	-	<b>1,091,312,892.87</b>	<b>1,101,216,668.61</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	78.17	78.17
应付管理人报酬	-	-	-	464,946.29	464,946.29
应付托管费	-	-	-	92,989.24	92,989.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	96.69	96.69
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	488,590.90	488,590.90
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,046,701.29</b>	<b>1,046,701.29</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>9,903,775.74</b>	-	-	<b>1,090,266,191.58</b>	<b>1,100,169,967.32</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。

#### 6.4.9.4.1.2 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）。

#### 6.4.9.4.2 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,696,937,370.27	99.32	1,091,168,661.04	99.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,696,937,370.27	99.32	1,091,168,661.04	99.18

##### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 8,557	增加约 5,507
业绩比较基准下降 5%	减少约 8,557	减少约 5,507	

#### 6.4.10 公允价值

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.10.2.1 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	本期末
--------------	-----

次	2023年6月30日	
第一层次		1,695,544,827.81
第二层次		788,929.18
第三层次		603,613.28
合计		1,696,937,370.27

#### 6.4.10.2.2 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。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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。

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,696,937,370.27	99.24
	其中：股票	1,696,937,370.27	99.24
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	13,017,072.21	0.76
8	其他各项资产	31,270.09	0.00
9	合计	1,709,985,712.57	100.00

注：截至报告期末，股票投资中转融通融出股票金额 3,235,592.00 元，净值占比 0.19%。

## 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	54,229,369.65	3.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,293,047,431.64	75.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	44,032.77	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,129,262.73	5.22
J	金融业	123,924,701.20	7.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	54,238,635.64	3.17
N	水利、环境和公共设施管理业	5,322,003.93	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	48,878,410.41	2.86
R	文化、体育和娱乐业	28,123,522.30	1.65
S	综合	-	-
	合计	1,696,937,370.27	99.32

### 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	300750	宁德时代	1,387,862	317,528,946.98	18.58
2	300059	东方财富	6,912,976	98,164,259.20	5.75
3	300760	迈瑞医疗	271,618	81,431,076.40	4.77
4	300124	汇川技术	1,059,944	68,059,004.24	3.98
5	300274	阳光电源	555,000	64,729,650.00	3.79
6	300498	温氏股份	2,955,279	54,229,369.65	3.17
7	300308	中际旭创	334,580	49,333,821.00	2.89
8	300015	爱尔眼科	2,274,072	42,184,035.60	2.47
9	300014	亿纬锂能	693,575	41,961,287.50	2.46
10	300122	智飞生物	612,100	27,054,820.00	1.58
11	300316	晶盛机电	340,066	24,110,679.40	1.41
12	300142	沃森生物	904,100	23,913,445.00	1.40
13	300896	爱美客	49,500	22,025,025.00	1.29
14	300408	三环集团	687,284	20,171,785.40	1.18
15	300450	先导智能	551,720	19,955,712.40	1.17
16	300347	泰格医药	298,510	19,265,835.40	1.13
17	300033	同花顺	109,100	19,123,048.00	1.12
18	300496	中科创达	192,500	18,547,375.00	1.09
19	300782	卓胜微	186,597	18,030,868.11	1.06
20	300418	昆仑万维	420,400	16,933,712.00	0.99



21	300724	捷佳伟创	138,200	15,526,770.00	0.91
22	300003	乐普医疗	680,200	15,379,322.00	0.90
23	300012	华测检测	777,928	15,169,596.00	0.89
24	300454	深信服	130,467	14,775,387.75	0.86
25	300223	北京君正	162,400	14,341,544.00	0.84
26	300661	圣邦股份	167,278	13,738,542.14	0.80
27	300037	新宙邦	263,740	13,685,468.60	0.80
28	300751	迈为股份	80,352	13,610,021.76	0.80
29	300146	汤臣倍健	548,657	13,156,794.86	0.77
30	300769	德方纳米	115,544	12,736,415.12	0.75
31	300433	蓝思科技	1,076,850	12,663,756.00	0.74
32	300999	金龙鱼	313,330	12,530,066.70	0.73
33	300207	欣旺达	766,100	12,502,752.00	0.73
34	300759	康龙化成	314,791	12,050,199.48	0.71
35	300285	国瓷材料	432,550	11,851,870.00	0.69
36	300413	芒果超媒	343,830	11,762,424.30	0.69
37	300763	锦浪科技	111,425	11,599,342.50	0.68
38	300395	菲利华	230,100	11,320,920.00	0.66
39	300073	当升科技	223,866	11,267,175.78	0.66
40	300474	景嘉微	123,600	11,122,764.00	0.65
41	300568	星源材质	637,317	10,955,479.23	0.64
42	300253	卫宁健康	973,873	10,537,305.86	0.62
43	300390	天华新能	285,070	10,205,506.00	0.60
44	300144	宋城演艺	808,860	10,029,864.00	0.59
45	300919	中伟股份	165,400	9,965,350.00	0.58
46	300832	新产业	165,100	9,740,900.00	0.57
47	300054	鼎龙股份	380,700	9,414,711.00	0.55
48	300118	东方日升	361,300	9,260,119.00	0.54
49	300604	长川科技	193,200	9,175,068.00	0.54
50	300699	光威复材	292,600	9,026,710.00	0.53
51	300136	信维通信	448,200	8,999,856.00	0.53
52	300628	亿联网络	252,820	8,866,397.40	0.52
53	300777	中简科技	186,000	8,790,360.00	0.51
54	300601	康泰生物	341,280	8,665,099.20	0.51
55	300487	蓝晓科技	136,200	8,501,604.00	0.50
56	300438	鹏辉能源	173,800	8,349,352.00	0.49
57	300595	欧普康视	271,380	8,192,962.20	0.48
58	300383	光环新网	761,300	8,183,975.00	0.48
59	300676	华大基因	129,124	7,746,148.76	0.45
60	300866	安克创新	87,200	7,630,000.00	0.45
61	300001	特锐德	366,800	7,622,104.00	0.45
62	300633	开立医疗	138,300	7,537,350.00	0.44
63	300296	利亚德	1,107,200	7,230,016.00	0.42
64	300666	江丰电子	105,300	7,156,188.00	0.42
65	300682	朗新科技	302,700	7,046,856.00	0.41
66	300088	长信科技	1,133,200	6,833,196.00	0.40
67	300558	贝达药业	140,500	6,748,215.00	0.39
68	300244	迪安诊断	260,265	6,670,591.95	0.39
69	300803	指南针	136,600	6,637,394.00	0.39
70	300373	扬杰科技	162,200	6,580,454.00	0.39

71	300957	贝泰妮	71,300	6,337,144.00	0.37
72	300251	光线传媒	782,600	6,331,234.00	0.37
73	300748	金力永磁	210,140	6,287,388.80	0.37
74	300034	钢研高纳	158,100	6,227,559.00	0.36
75	300009	安科生物	588,480	5,884,800.00	0.34
76	300294	博雅生物	158,400	5,746,752.00	0.34
77	301269	华大九天	45,600	5,601,504.00	0.33
78	300529	健帆生物	241,340	5,594,261.20	0.33
79	301236	软通动力	202,100	5,499,141.00	0.32
80	300775	三角防务	162,100	5,475,738.00	0.32
81	300363	博腾股份	184,600	5,462,314.00	0.32
82	300677	英科医疗	241,640	5,316,080.00	0.31
83	300070	碧水源	988,701	5,299,437.36	0.31
84	300357	我武生物	150,898	5,074,699.74	0.30
85	300776	帝尔激光	74,360	4,825,964.00	0.28
86	300432	富临精工	398,200	4,627,084.00	0.27
87	300888	稳健医疗	108,080	4,503,693.60	0.26
88	300979	华利集团	84,300	4,108,782.00	0.24
89	301035	润丰股份	50,900	3,999,213.00	0.23
90	300376	易事特	573,300	3,841,110.00	0.22
91	300861	美畅股份	86,420	3,748,035.40	0.22
92	301155	海力风电	48,200	3,715,256.00	0.22
93	300850	新强联	99,300	3,711,834.00	0.22
94	301268	铭利达	83,000	3,475,210.00	0.20
95	300726	宏达电子	73,400	3,282,448.00	0.19
96	300171	东富龙	141,600	3,221,400.00	0.19
97	301029	怡合达	60,088	2,684,731.84	0.16
98	301095	广立微	24,000	1,983,600.00	0.12
99	301308	江波龙	19,400	1,974,144.00	0.12
100	301207	华兰疫苗	41,000	1,363,660.00	0.08
101	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.02
102	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
103	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
104	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
105	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
106	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
107	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
108	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
109	301358	湖南裕能	1,344	57,644.16	0.00
110	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
111	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
112	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
113	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
114	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
115	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
116	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
117	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
118	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
119	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
120	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00

121	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
122	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
123	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
124	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
125	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
126	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
127	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
128	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
129	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
130	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
131	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
132	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
133	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
134	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
135	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
136	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
137	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
138	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
139	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
140	301047	义翘神州	80	6,856.00	0.00
141	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
142	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
143	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
144	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
145	300747	锐科激光	75	2,286.00	0.00
146	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
147	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
148	300482	万孚生物	80	2,130.40	0.00
149	300618	寒锐钴业	60	1,944.60	0.00
150	301219	腾远钴业	10	373.60	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	300750	宁德时代	11,057,934.55	1.01
2	300633	开立医疗	8,145,616.00	0.74
3	300666	江丰电子	7,256,795.29	0.66
4	300803	指南针	6,893,236.00	0.63
5	301236	软通动力	5,884,014.00	0.53
6	301269	华大九天	5,550,338.00	0.50
7	300015	爱尔眼科	4,359,314.35	0.40
8	300919	中伟股份	4,016,223.00	0.37
9	301155	海力风电	3,842,825.00	0.35
10	301268	铭利达	3,431,852.59	0.31
11	300760	迈瑞医疗	3,301,547.00	0.30
12	301095	广立微	2,148,127.00	0.20

13	301308	江波龙	2,068,029.86	0.19
14	300763	锦浪科技	1,865,611.00	0.17
15	300223	北京君正	1,642,032.00	0.15
16	300033	同花顺	1,601,138.00	0.15
17	300251	光线传媒	1,516,943.00	0.14
18	300568	星源材质	1,458,744.00	0.13
19	301207	华兰疫苗	1,439,582.00	0.13
20	300496	中科创达	1,419,846.00	0.13

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	300896	爱美客	7,460,988.00	0.68
2	300725	药石科技	4,650,796.00	0.42
3	300059	东方财富	4,509,631.00	0.41
4	300747	锐科激光	4,468,658.00	0.41
5	300482	万孚生物	4,175,623.00	0.38
6	300035	中科电气	4,143,845.00	0.38
7	300618	寒锐钴业	4,050,286.00	0.37
8	300015	爱尔眼科	3,395,164.21	0.31
9	300457	赢合科技	3,291,541.00	0.30
10	300751	迈为股份	3,049,796.80	0.28
11	300014	亿纬锂能	2,820,747.00	0.26
12	300274	阳光电源	2,653,304.00	0.24
13	301047	义翘神州	2,613,605.61	0.24
14	300661	圣邦股份	2,238,649.00	0.20
15	300498	温氏股份	2,155,208.00	0.20
16	300454	深信服	2,075,793.00	0.19
17	300122	智飞生物	2,019,597.00	0.18
18	300821	东岳硅材	1,813,809.00	0.16
19	300776	帝尔激光	1,641,193.00	0.15
20	300750	宁德时代	1,610,246.20	0.15

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	114,323,411.64
卖出股票的收入（成交）总额	104,938,309.76

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	4,046.89
2	应收清算款	22,880.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	4,343.02
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	31,270.09

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300308	中际旭创	1,769,400.00	0.10	转融通融出

#### 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		博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
12,712	66,805.30	93,099,238.00	10.96%	145,887,326.00	17.18%	610,242,465.00	71.86%

### 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
-	交通银行股份有限公司—博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	610,242,465.00	71.86%
1	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	85,034,000.00	10.01%
2	招商证券股份有限公司	3,007,900.00	0.35%
3	贾琦	2,327,800.00	0.27%
4	广发证券股份有限公司	1,615,541.00	0.19%
5	方正证券股份有限公司	1,161,325.00	0.14%
6	中国银河证券股份有限公司	1,158,000.00	0.14%
7	马啸	916,400.00	0.11%
8	许华	773,800.00	0.09%
9	陈钟	770,000.00	0.09%

10	中信证券股份有限公司	721,072.00	0.08%
----	------------	------------	-------

注：1. 以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

2. 前十名持有人为除联接基金之外的前十名持有人。

### 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（2018年12月10日）基金份额总额	34,229,029.00
本报告期期初基金份额总额	518,229,029.00
本报告期基金总申购份额	350,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	19,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	849,229,029.00

## § 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

基金管理人于 2023 年 2 月 18 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》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 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》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
兴业证券	1	153,831,963.88	72.32%	112,497.49	67.35%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	增加1个
银河证券	1	-	-	-	-	增加1个
国盛证券	1	71,896.14	0.03%	52.58	0.03%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	增加1个
国海证券	1	26,152,015.17	12.29%	24,355.44	14.58%	-
东北证券	2	410,447.83	0.19%	300.12	0.18%	增加2个
招商证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	148,135.90	0.07%	108.35	0.06%	-



国信证券	1	-	-	-	-	增加 1 个
申万宏源	1	-	-	-	-	增加 1 个
方正证券	1	31,150,516.66	14.64%	29,010.53	17.37%	增加 1 个
国泰君安	1	954,392.77	0.45%	697.97	0.42%	增加 1 个

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据本公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-27

2	关于新增中国银河证券股份有限公司为部分基金流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-20
3	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-20230601	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
4	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
5	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
6	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12
7	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东海证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-05
8	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
9	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东方财富证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-24
11	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-20
12	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
13	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
14	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
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-20230104	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

		间			份 额		
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2023-01-01~2023-06-30	490,782,765.00	119,459,700.00	-	610,242,465.00	71.86%

#### 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。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

## 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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时创业板交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时创业板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、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时创业板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  
二〇二三年八月三十一日