

博时创业板交易型开放式指数证券投资
基金联接基金
2020 年中期报告
2020 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：二〇二〇年八月三十一日

§ 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 2020 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 2020 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	5
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	6
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末投资目标基金明细	34
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.4 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	35
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.7 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	39
7.8 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	39
7.9 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	39
7.10 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	39
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.13 投资组合报告附注	40
§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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.3 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	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
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	44
§12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
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	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	博时创业板 ETF 联接	
基金主代码	050021	
交易代码	050021	
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金	
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	87,689,314.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时创业板 ETF 联接 A	博时创业板 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	050021	006733
报告期末下属分级基金的份额总额	66,035,717.75 份	21,653,596.71 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于博时创业板交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即创业板指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于博时创业板交易型开放式指数证券投资基金，方便特定的客户群通过本基金投资博时创业板交易型开放式指数证券投资基金。本基金不参与博时创业板交易型开放式指数证券投资基金的投资管理。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，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。
业绩比较基准	创业板指数。
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 负责人	姓名	孙麒清	陆志俊
	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	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	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 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（2020年1月1日至2020年6月30日）	
	博时创业板 ETF 联接 A	博时创业板 ETF 联接 C
本期已实现收益	2,421,642.99	809,564.03
本期利润	28,442,169.41	8,810,085.22
加权平均基金份额本期利润	0.5048	0.4112
本期加权平均净值利润率	29.92%	24.41%
本期基金份额净值增长率	33.93%	33.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	博时创业板 ETF 联接 A	博时创业板 ETF 联接 C
期末可供分配利润	28,117,855.22	9,206,747.28
期末可供分配基金份额利润	0.4258	0.4252
期末基金资产净值	131,008,178.99	42,941,396.06
期末基金份额净值	1.9839	1.9831
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
	博时创业板 ETF 联接 A	博时创业板 ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	74.33%	84.63%

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

博时创业板 ETF 联接 A

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	15.95%	1.04%	15.95%	1.08%	0.00%	-0.04%
过去三个月	28.63%	1.29%	28.58%	1.32%	0.05%	-0.03%
过去六个月	33.93%	1.91%	33.72%	1.95%	0.21%	-0.04%
过去一年	56.88%	1.56%	57.79%	1.59%	-0.91%	-0.03%

自基金合同生效起至今	74.33%	1.63%	77.01%	1.67%	-2.68%	-0.04%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

博时创业板 ETF 联接 C

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	15.95%	1.04%	15.95%	1.08%	0.00%	-0.04%
过去三个月	28.62%	1.29%	28.58%	1.32%	0.04%	-0.03%
过去六个月	33.91%	1.91%	33.72%	1.95%	0.19%	-0.04%
过去一年	56.83%	1.56%	57.79%	1.59%	-0.96%	-0.03%
自基金合同生效起至今	84.63%	1.64%	86.35%	1.68%	-1.72%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

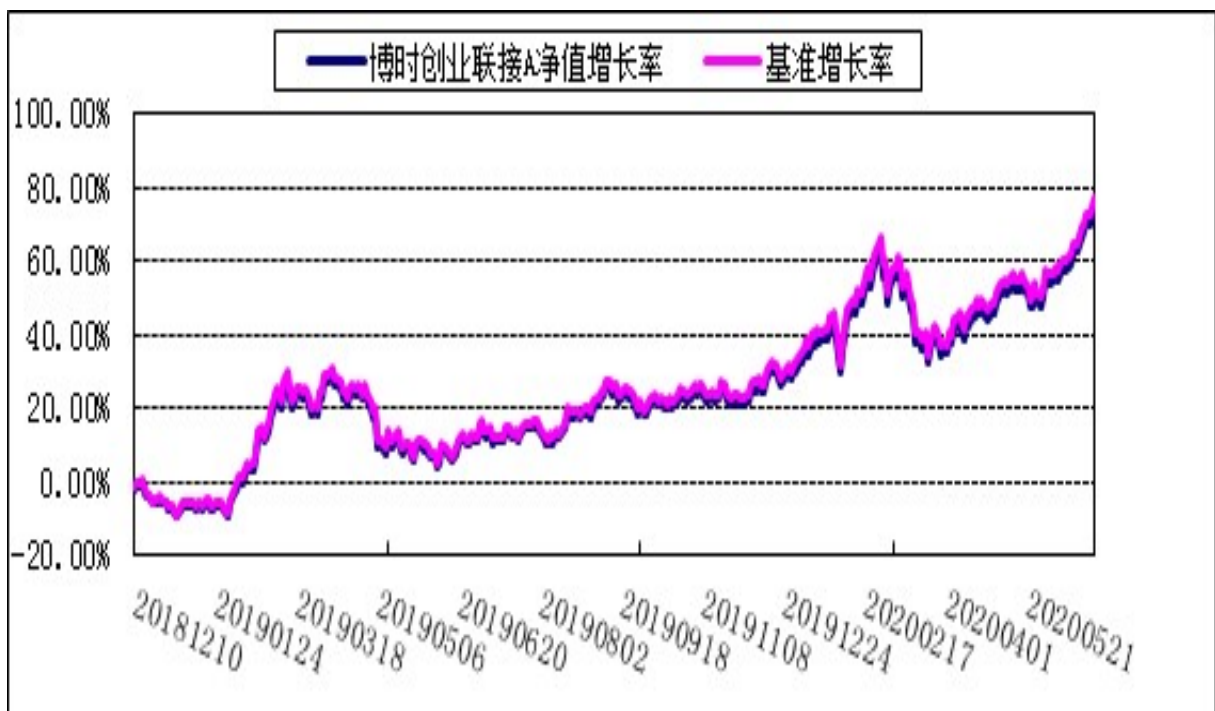
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

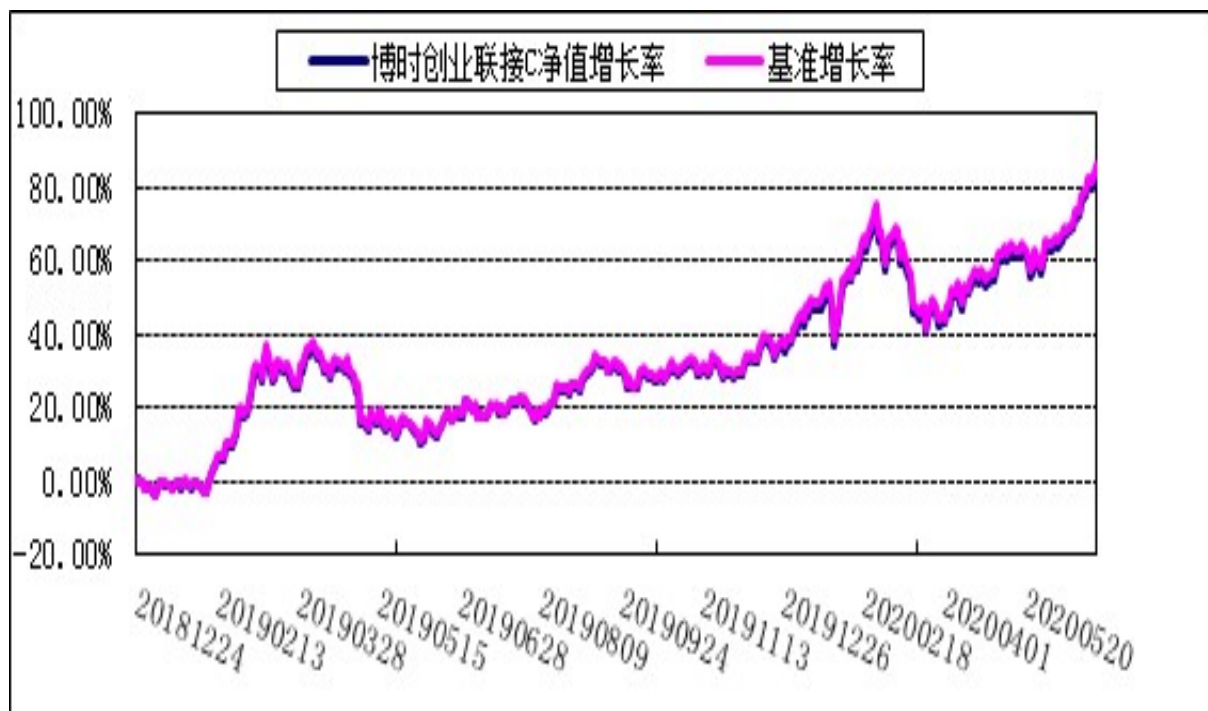
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 12 月 10 日至 2020 年 6 月 30 日)

博时创业板 ETF 联接 A



博时创业板 ETF 联接 C



注：本基金合同于 2018 年 12 月 10 日生效。本基金由原博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获 “中国年度最佳 CEO” (Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang)，博时基金（国际）有限公司荣获 “香港最佳中资基金公司” (Winner, Hong Kong Best China Fund House)，博时信用债基金荣获 “中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）” (Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund)。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获 “七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星 “2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报 “开放 普惠 科技” 2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获 “2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获 “2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尹浩	基金经理	2019-10-11	-	8.0	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。现任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 日一至今）、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 日一至今）、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)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，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 93 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

2020 年上半年，受新冠疫情冲击，全球资本市场跌宕起伏，波动较大，多数发达市场收跌。国际方面，美国标普 500 下跌 4.04%，而科技指数纳斯达克指数上涨 12.11%，日经 225 指数下跌 5.78%，欧洲股市中英国富时 100 下跌 18.20%，德国 DAX 指数下跌 7.08%，法国 CAC40 下跌 17.43%。香港恒生指数下跌 13.35%。国内 A 股方面，在率先走出新冠疫情后复产复工稳步推进及宽松预期下，市场整体表现尚可。结构上，在复产复工与疫情反复共同交织叠加宽松预期背景下，科技、医药、消费板块共同发力。债券市场方面，同样受疫情和应对经济活动疲软影响，债券收益

率震荡下行，10 年期国债收益率从 3.14 下行至 2.82。

行情方面，2020 年上半年，市场整体处于上涨行情，在主流宽基指数中，仅偏大盘的上证 50 下跌，跌幅为 3.95%，而沪深 300 上涨 1.64%，偏中小盘的中证 500 上涨 11.33%，中证 1000 上涨 13.52%，科技、医药集中的创业板指表现最好，上涨 35.60%。风格指数方面，中盘成长表现最好，上涨 18.00%，大盘价值表现最弱，下跌 12.62%。行业方面，中信一级行业中，医药、消费者服务、食品饮料、电子、计算机表现最为抢眼，分别上涨 41.56%、26.32%、25.41%、24.22%、22.92%。而石油石化、煤炭、银行、非银金融、房地产下跌，跌幅分别是 17.47%、15.53%、13.02%、10.67%、8.54%。

本基金主要投资于交易型开放式指数证券投资基金，以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的收益。在报告期内，本基金严格按照基金合同，以不低于基金资产净值 90% 的资产都投资于交易型开放式指数证券投资基金，保证投资收益紧贴标的指数；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.9839 元，份额累计净值为 1.9839 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.9831 元，份额累计净值为 1.9831 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 33.93%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 33.91%，同期业绩基准增长率 33.72%。

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 2020 年下半年，海外疫情蔓延出使经济衰退风险持续上升，预计未来美联储将继续保持流动性充盈，在此背景下或推动外资持续流入 A 股。国内方面，宽松财政政策开始发力，二季度流动性边际有所收紧，但受失业率上行压力，预计央行仍将保持流动性宽松。A 股市场风格整体分化尽管有所弥合，高低估值板块差异仍较大，现阶段估值与基本面存在一定背离。

我们对 A 股长期表现偏乐观，但需注意仓位的灵活性，把握结构性机会。投资风格上，围绕内循环等内需主题机会，继续重点配置行业龙头公司，长期配置消费、医药、科技的基础性配置，但需注意高低估值板块估值收敛。结构上把握两条主线，一条主线是关注受益于疫情后的内需恢复的可选消费板块（包括消费者服务、汽车等）和自主可控的科技、医药板块（包括消费电子、云计算、智能家居、医疗设备等）。另一条主线是逐步复苏后存在业绩预期差的周期板块（包括建筑建材、机械、化工等）以及后周期低估值板块（包括银行、非银金融等）。

在投资策略上，本基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，通过投资

于 ETF 紧密跟踪标的指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过本基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

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副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、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

2020 年上半年度，基金托管人在博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2020 年上半年度，博时基金管理有限公司在博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2020 年上半年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的半年度报告中财务指标、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联接基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	8,513,574.88	6,246,903.76
结算备付金		14,889.01	26,994.35
存出保证金		23,550.05	5,016.14
交易性金融资产	6.4.3.2	166,082,990.63	86,546,612.83
其中：股票投资		6,893,790.24	617,321.00
基金投资		157,386,500.39	85,929,291.83
债券投资		1,802,700.00	-
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		360.05	-
应收利息	6.4.3.5	59,580.61	1,257.84
应收股利		-	-
应收申购款		4,264,353.37	1,063,054.58
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		178,959,298.60	93,889,839.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		9.14	-
应付赎回款		4,887,435.13	1,362,413.14
应付管理人报酬		4,426.39	2,502.26
应付托管费		885.26	500.46
应付销售服务费		882.67	449.87
应付交易费用	6.4.3.7	18,843.99	11,994.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	97,240.97	145,720.61
负债合计		5,009,723.55	1,523,580.93
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.3.9	87,689,314.46	62,358,992.18
未分配利润	6.4.3.10	86,260,260.59	30,007,266.39
所有者权益合计		173,949,575.05	92,366,258.57
负债和所有者权益总计		178,959,298.60	93,889,839.50

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 87,689,314.46 份。其中 A 类基金份额净值 1.9839 元，基金份额总额 66,035,717.75 份；C 类基金份额净值 1.9831 元，基金份额总额 21,653,596.71 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联接基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
一、收入		37,443,722.05	4,478,770.63
1. 利息收入		35,248.47	20,327.85
其中：存款利息收入	6.4.3.11	32,838.94	20,327.85
债券利息收入		2,409.53	-
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）		3,237,567.63	3,117,708.31
其中：股票投资收益	6.4.3.12	823,988.42	1,718,898.21
基金投资收益	6.4.3.13	2,406,131.30	1,377,733.11
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	7,447.91	21,076.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	34,021,047.61	1,208,379.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	149,858.34	132,355.35
减：二、费用		191,467.42	185,800.51
1. 管理人报酬		26,973.96	16,492.46
2. 托管费		5,394.76	3,298.46
3. 销售服务费		5,970.16	3,060.94
4. 交易费用	6.4.3.19	92,278.11	99,022.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.20	60,850.43	63,926.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,252,254.63	4,292,970.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,252,254.63	4,292,970.12

6.3 所有者权益（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联接基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 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）	62,358,992.18	30,007,266.39	92,366,258.57
二、本期经营活动产生的	-	37,252,254.63	37,252,254.63

基金净值变动数（本期利润）			
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）	25,330,322.28	19,000,739.57	44,331,061.85
其中：1. 基金申购款	118,299,937.18	83,177,139.54	201,477,076.72
2. 基金赎回款	-92,969,614.90	-64,176,399.97	-157,146,014.87
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）	87,689,314.46	86,260,260.59	173,949,575.05
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	31,929,776.39	1,895,262.87	33,825,039.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,292,970.12	4,292,970.12
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）	34,175,200.02	11,301,014.11	45,476,214.13
其中：1. 基金申购款	94,769,234.32	32,793,500.26	127,562,734.58
2. 基金赎回款	-60,594,034.30	-21,492,486.15	-82,086,520.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	66,104,976.41	17,489,247.10	83,594,223.51

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：王德英，会计机构负责人：成江

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 2020年6月30日
活期存款	8,513,574.88
定期存款	-
其他存款	-
合计	8,513,574.88

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,618,718.62	6,893,790.24	275,071.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,803,420.00	1,802,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,803,420.00	1,802,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	111,614,291.59	157,386,500.39	45,772,208.80
其他	-	-	-
合计	120,036,430.21	166,082,990.63	46,046,560.42

注：本基金持有的目标ETF的份额按估值日目标ETF份额净值确定。本基金可采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF份额的买卖。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,078.71
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	6.70
应收债券利息	57,484.60

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	10.60
合计	59,580.61

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	18,843.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	18,843.99

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,568.63
应付证券出借违约金	-
其他应付款	25,000.00
预提费用	59,672.34
合计	97,240.97

6.4.3.9 实收基金

博时创业板 ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	48,574,874.47	48,574,874.47
本期申购	74,060,668.09	74,060,668.09
本期赎回（以“-”号填列）	-56,599,824.81	-56,599,824.81
本期末	66,035,717.75	66,035,717.75

博时创业板 ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

	基金份额	账面金额
上年度末	13,784,117.71	13,784,117.71
本期申购	44,239,269.09	44,239,269.09
本期赎回（以“-”号填列）	-36,369,790.09	-36,369,790.09
本期末	21,653,596.71	21,653,596.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

博时创业板 ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,364,663.98	5,013,611.86	23,378,275.84
本期利润	2,421,642.99	26,020,526.42	28,442,169.41
本期基金份额交易产生的变动数	7,331,548.25	5,820,467.74	13,152,015.99
其中：基金申购款	30,255,933.39	21,935,597.08	52,191,530.47
基金赎回款	-22,924,385.14	-16,115,129.34	-39,039,514.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,117,855.22	36,854,606.02	64,972,461.24

博时创业板 ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,206,625.04	1,422,365.51	6,628,990.55
本期利润	809,564.03	8,000,521.19	8,810,085.22
本期基金份额交易产生的变动数	3,190,558.21	2,658,165.37	5,848,723.58
其中：基金申购款	17,929,295.10	13,056,313.97	30,985,609.07
基金赎回款	-14,738,736.89	-10,398,148.60	-25,136,885.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,206,747.28	12,081,052.07	21,287,799.35

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	31,246.91
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	669.57
其他	922.46
合计	32,838.94

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	522,302.00
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	301,686.42
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	823,988.42

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	22,549,030.44
减：卖出股票成本总额	22,026,728.44
买卖股票差价收入	522,302.00

6.4.3.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
申购基金份额总额	48,077,100.00
减：现金支付申购款总额	1,261,379.52
减：申购股票成本总额	46,514,034.06
申购差价收入	301,686.42

6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	12,793,418.50
减：卖出/赎回基金成本总额	10,387,287.20
基金投资收益	2,406,131.30

6.4.3.14 债券投资收益

无发生额。

6.4.3.15 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,447.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,447.91

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	34,021,047.61
——股票投资	255,074.44
——债券投资	-720.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	33,766,693.17
——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	34,021,047.61

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	118,281.35
基金转换费收入	31,576.99
合计	149,858.34

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	91,683.19

银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	594.92
其中：申购费	-
赎回费	-
基金交易费用	594.92
合计	92,278.11

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,178.09
合计	60,850.43

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

截至财务报告批准报出日，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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金（“目标ETF”）	基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	1,803,420.00	100.00%	-	-

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 基金交易

无。

6.4.6.1.6 应支付关联方的佣金

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 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,973.96	16,492.46
其中：支付销售机构的客户维护费	113,042.73	64,379.05

注：1. 本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，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扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的0.5%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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产) × 0.5% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代

销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,394.76	3,298.46

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.1% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.1% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时创业板 ETF 联接 A	博时创业板 ETF 联接 C	合计
招商证券	-	24.06	24.06
博时基金	-	1,512.75	1,512.75
合计	-	1,536.81	1,536.81
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时创业板 ETF 联接 A	博时创业板 ETF 联接 C	合计
博时基金	-	717.37	717.37
招商证券	-	27.81	27.81
合计	-	745.18	745.18

注：销售机构对本基金投资组合中投资于目标 ETF 部分的基金资产净值不计提销售服务费。前一日的基金资产净值为已扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额，金额为负时以零计。

A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费 C 类按前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 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自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

无。

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 2020年1月1日至2020年6月 30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	8,513,574.88	31,246.91	4,758,485.17

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

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2020年6月30日，本基金持有75,114,065.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为81.44%（2019年12月31日：本基金持有55,614,065.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为85.26%）。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所表征的市场组合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。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国交通银行，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，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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.00% (2019 年 12 月 31 日：0.00%)。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，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计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的

监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.8。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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 2020 年 6 月 30 日，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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,513,574.88	-	-	-	8,513,574.88
结算备付金	14,889.01	-	-	-	14,889.01
存出保证金	23,550.05	-	-	-	23,550.05
交易性金融资产	1,802,700.00	-	-	164,280,290.63	166,082,990.63
应收证券清算款	-	-	-	360.05	360.05
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	59,580.61	59,580.61
应收申购款	-	-	-	4,264,353.37	4,264,353.37
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,354,713.94	-	-	168,604,584.66	178,959,298.60
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,887,435.13	4,887,435.13
应付证券清算款	-	-	-	9.14	9.14
应付管理人报酬	-	-	-	4,426.39	4,426.39
应付托管费	-	-	-	885.26	885.26
应付销售服务费	-	-	-	882.67	882.67
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	18,843.99	18,843.99
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	97,240.97	97,240.97
负债总计	-	-	-	5,009,723.55	5,009,723.55
利率敏感度缺口	10,354,713.94	-	-	-163,594,861.11	173,949,575.05
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2019 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	6,246,903.76	-	-	-	6,246,903.76
结算备付金	26,994.35	-	-	-	26,994.35
存出保证金	5,016.14	-	-	-	5,016.14
交易性金融资产	-	-	-	86,546,612.83	86,546,612.83
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,257.84	1,257.84
应收申购款	-	-	-	1,063,054.58	1,063,054.58
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,278,914.25	-	-	87,610,925.25	93,889,839.50
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,362,413.14	1,362,413.14
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,502.26	2,502.26
应付托管费	-	-	-	500.46	500.46
应付销售服务费	-	-	-	449.87	449.87
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	11,994.59	11,994.59
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	145,720.61	145,720.61
负债总计	-	-	-	1,523,580.93	1,523,580.93
利率敏感度缺口	6,278,914.25	-	-	86,087,344.32	92,366,258.57

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

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值比例为 1.04%（2019 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的基金、股票和债券，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	6,893,790.24	3.96	617,321.00	0.67
交易性金融资产—基金投资	157,386,500.39	90.48	85,929,291.83	93.03
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	164,280,290.63	94.44	86,546,612.83	93.70

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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 814	增加约 428
	业绩比较基准下降 5%	减少约 814	减少约 428

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 2020 年 6 月 30 日，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 164,280,290.63 元，属于第二层次的余额为 1,802,700.00 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 86,546,612.83 元，无第二或第三层次)。

(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股票和债券，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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：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	6,893,790.24	3.85

	其中：股票	6,893,790.24	3.85
2	基金投资	157,386,500.39	87.95
3	固定收益投资	1,802,700.00	1.01
	其中：债券	1,802,700.00	1.01
	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	8,528,463.89	4.77
8	其他各项资产	4,347,844.08	2.43
9	合计	178,959,298.60	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金	股票指数型	交易型开放式指数基金	博时基金管理有限公司	157,386,500.39	90.48

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	238,282.00	0.14
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,519,521.04	2.60
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	15,196.00	0.01
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	886,019.20	0.51
J	金融业	456,520.00	0.26
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	35,100.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	220,044.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	29,232.00	0.02

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	312,759.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	181,117.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	6,893,790.24	3.96

7.4 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	300476	胜宏科技	40,900	983,645.00	0.57
2	300760	迈瑞医疗	1,800	550,260.00	0.32
3	300059	东方财富	22,600	456,520.00	0.26
4	300750	宁德时代	2,600	453,336.00	0.26
5	300601	康泰生物	1,600	259,456.00	0.15
6	300498	温氏股份	10,400	226,720.00	0.13
7	300015	爱尔眼科	3,500	152,075.00	0.09
8	300142	沃森生物	2,900	151,844.00	0.09
9	300347	泰格医药	1,300	132,444.00	0.08
10	300661	圣邦股份	400	122,020.00	0.07
11	300014	亿纬锂能	2,400	114,840.00	0.07
12	300122	智飞生物	1,100	110,165.00	0.06
13	300759	康龙化成	1,000	98,400.00	0.06
14	300747	锐科激光	900	97,947.00	0.06
15	300003	乐普医疗	2,500	91,300.00	0.05
16	300124	汇川技术	2,300	87,377.00	0.05
17	300136	信维通信	1,600	84,832.00	0.05
18	300454	深信服	400	82,384.00	0.05
19	300413	芒果超媒	1,200	78,240.00	0.04
20	300253	卫宁健康	3,280	75,243.20	0.04
21	300433	蓝思科技	2,600	72,904.00	0.04
22	300463	迈克生物	1,200	69,876.00	0.04
23	300676	华大基因	400	62,364.00	0.04
24	300666	江丰电子	1,000	59,680.00	0.03
25	300012	华测检测	3,000	59,280.00	0.03
26	300408	三环集团	2,100	58,170.00	0.03
27	300383	光环新网	2,200	57,354.00	0.03
28	300558	贝达药业	400	55,992.00	0.03
29	300529	健帆生物	800	55,600.00	0.03
30	300616	尚品宅配	900	54,072.00	0.03
31	300033	同花顺	400	53,232.00	0.03
32	300144	宋城演艺	3,000	51,900.00	0.03

33	300450	先导智能	1,100	50,831.00	0.03
34	300088	长信科技	4,400	49,280.00	0.03
35	300285	国瓷材料	1,400	46,914.00	0.03
36	300496	中科创达	600	46,620.00	0.03
37	300770	新媒股份	200	44,732.00	0.03
38	300207	欣旺达	2,300	43,470.00	0.02
39	300595	欧普康视	600	41,604.00	0.02
40	300482	万孚生物	400	41,600.00	0.02
41	300628	亿联网络	600	40,956.00	0.02
42	300474	景嘉微	600	40,380.00	0.02
43	300315	掌趣科技	5,400	39,582.00	0.02
44	300271	华宇软件	1,400	39,494.00	0.02
45	300212	易华录	700	39,200.00	0.02
46	300308	中际旭创	600	37,800.00	0.02
47	300699	光威复材	600	37,638.00	0.02
48	300357	我武生物	600	37,350.00	0.02
49	300168	万达信息	1,600	35,312.00	0.02
50	300058	蓝色光标	4,500	35,100.00	0.02
51	300024	机器人	2,500	34,175.00	0.02
52	300682	朗新科技	2,000	34,040.00	0.02
53	300146	汤臣倍健	1,700	33,473.00	0.02
54	300017	网宿科技	3,900	33,111.00	0.02
55	300418	昆仑万维	1,300	32,448.00	0.02
56	300009	安科生物	1,800	32,220.00	0.02
57	300274	阳光电源	2,100	30,219.00	0.02
58	300316	晶盛机电	1,200	29,688.00	0.02
59	300010	立思辰	1,500	29,355.00	0.02
60	300070	碧水源	3,600	29,232.00	0.02
61	300244	迪安诊断	800	28,240.00	0.02
62	300773	拉卡拉	800	27,816.00	0.02
63	300115	长盈精密	1,200	27,420.00	0.02
64	300724	捷佳伟创	300	26,559.00	0.02
65	300451	创业慧康	1,400	25,886.00	0.01
66	300001	特锐德	1,200	25,128.00	0.01
67	300296	利亚德	3,900	23,673.00	0.01
68	300226	上海钢联	300	23,580.00	0.01
69	300369	绿盟科技	1,000	23,290.00	0.01
70	300073	当升科技	700	23,149.00	0.01
71	300251	光线传媒	2,100	22,911.00	0.01
72	300766	每日互动	600	22,836.00	0.01
73	300294	博雅生物	600	22,494.00	0.01
74	300457	赢合科技	700	22,316.00	0.01
75	300630	普利制药	300	22,185.00	0.01

76	300567	精测电子	300	20,475.00	0.01
77	300223	北京君正	200	20,188.00	0.01
78	300166	东方国信	1,600	19,856.00	0.01
79	300026	红日药业	3,500	19,320.00	0.01
80	300618	寒锐钴业	300	18,606.00	0.01
81	300188	美亚柏科	900	17,847.00	0.01
82	300674	宇信科技	400	17,260.00	0.01
83	300078	思创医惠	1,200	16,236.00	0.01
84	300098	高新兴	2,600	15,756.00	0.01
85	300783	三只松鼠	200	15,196.00	0.01
86	300180	华峰超纤	1,709	14,629.04	0.01
87	300133	华策影视	2,000	14,500.00	0.01
88	300324	旋极信息	2,100	13,986.00	0.01
89	300182	捷成股份	3,400	13,566.00	0.01
90	300038	数知科技	1,600	13,056.00	0.01
91	300775	三角防务	600	12,984.00	0.01
92	300633	开立医疗	300	11,895.00	0.01
93	300761	立华股份	300	11,562.00	0.01
94	300741	华宝股份	300	11,064.00	0.01
95	300072	三聚环保	2,400	10,272.00	0.01
96	300748	金力永磁	300	10,014.00	0.01
97	300768	迪普科技	200	9,258.00	0.01
98	300113	顺网科技	300	7,620.00	0.00
99	300459	金科文化	1,700	5,865.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	300498	温氏股份	4,530,249.70	4.90
2	300750	宁德时代	3,931,018.11	4.26
3	300760	迈瑞医疗	3,634,371.99	3.93
4	300059	东方财富	3,161,529.71	3.42
5	300015	爱尔眼科	1,846,427.49	2.00
6	300142	沃森生物	1,404,544.00	1.52
7	300003	乐普医疗	1,354,690.71	1.47
8	300347	泰格医药	1,290,494.97	1.40
9	300476	胜宏科技	1,248,021.00	1.35
10	300014	亿纬锂能	1,220,030.00	1.32
11	300136	信维通信	1,213,035.00	1.31
12	300601	康泰生物	1,186,642.64	1.28

13	300122	智飞生物	1,134,176.88	1.23
14	300124	汇川技术	1,071,127.00	1.16
15	300454	深信服	922,373.00	1.00
16	300253	卫宁健康	917,915.12	0.99
17	300383	光环新网	916,801.31	0.99
18	300413	芒果超媒	887,232.00	0.96
19	300033	同花顺	842,202.55	0.91
20	300408	三环集团	832,396.96	0.90

注：本项的“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。

7.5.2 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	300498	温氏股份	1,572,955.65	1.70
2	300750	宁德时代	1,525,667.49	1.65
3	300760	迈瑞医疗	1,219,289.00	1.32
4	300059	东方财富	1,063,082.00	1.15
5	300015	爱尔眼科	809,414.14	0.88
6	300142	沃森生物	581,922.00	0.63
7	300601	康泰生物	574,323.00	0.62
8	300124	汇川技术	465,261.00	0.50
9	300136	信维通信	451,457.00	0.49
10	300003	乐普医疗	443,832.00	0.48
11	300347	泰格医药	419,583.00	0.45
12	300122	智飞生物	398,680.00	0.43
13	300014	亿纬锂能	371,921.00	0.40
14	300661	圣邦股份	371,906.00	0.40
15	300383	光环新网	345,825.00	0.37
16	300450	先导智能	338,921.00	0.37
17	300408	三环集团	307,523.00	0.33
18	300413	芒果超媒	304,014.00	0.33
19	300253	卫宁健康	302,580.00	0.33
20	300033	同花顺	289,134.00	0.31

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。

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	61,759,659.30
卖出股票的收入（成交）总额	22,549,030.44

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。

7.6 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	1,802,700.00	1.04
	其中：政策性金融债	1,802,700.00	1.04
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,802,700.00	1.04

7.7 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	018007	国开 1801	18,000	1,802,700.00	1.04

7.8 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。

7.9 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投资。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未投资股指期货交易。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	23,550.05
2	应收证券清算款	360.05
3	应收股利	-
4	应收利息	59,580.61
5	应收申购款	4,264,353.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,347,844.08

7.13.4 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。

7.13.5 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的情况。

7.13.6 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

份额级别	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

博时创业板 ETF 联接 A	10,292	6,416.22	99,053.90	0.15%	65,936,663.85	99.85%
博时创业板 ETF 联接 C	2,577	8,402.64	358.32	0.00%	21,653,238.39	100.00%
合计	12,762	6,871.13	99,412.22	0.11%	87,589,902.24	99.89%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时创业板 ETF 联接 A	180,707.28	0.27%
	博时创业板 ETF 联接 C	94,858.41	0.44%
	合计	275,565.69	0.31%

8.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时创业板 ETF 联接 A	-
	博时创业板 ETF 联接 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时创业板 ETF 联接 A	-
	博时创业板 ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时创业板 ETF 联接 A	博时创业板 ETF 联接 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 10 日）基金份额总额	31,772,162.25	-
本报告期期初基金份额总额	48,574,874.47	13,784,117.71
本报告期基金总申购份额	74,060,668.09	44,239,269.09
减：本报告期基金总赎回份额	56,599,824.81	36,369,790.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	66,035,717.75	21,653,596.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 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》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 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》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

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	
国盛证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	84,308,689.74	100.00%	61,656.98	100.00%	-

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

经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,803,420.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务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	2020-06-29
2	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	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2020 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	2020-04-22

		子披露网	
5	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	2020-04-17
6	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	2020-03-27
7	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
8	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	2020-01-17

§ 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

无。

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创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

12.1.2 《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

12.1.3 《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

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 报告期内博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.1.6 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金各年度审计报告正本

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阅，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
二〇二〇年八月三十一日