

**博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放
式指数证券投资基金联接基金
(原博时中债 0-3 年国开行债券指数证券
投资基金)**

2023 年第 2 季度报告

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：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 博时中债 0-3 年国开行债券 ETF 联接 |
| 基金主代码 | 012692 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 4 月 17 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 61,671,977.05 份 |
| 投资目标 | 通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数即中债-0-3 年国开行债券指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。主要有资产配置策略、目标 ETF 投资策略、债券投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债-0-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 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。本基金预期风险和预期收益低于 |

| | | |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| | 股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 杭州银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时中债 0-3 年国开行债券 ETF 联接 A | 博时中债 0-3 年国开行债券 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012692 | 012693 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 44,242,210.49 份 | 17,429,766.56 份 |

2.2 博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金（转型前）

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| 基金简称 | 博时中债 0-3 年国开行 | |
| 基金主代码 | 012692 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 9 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 178,789,951.92 份 | |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差控制在 3% 以内。 | |
| 投资策略 | 本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。主要有资产配置策略、债券投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 中债-0-3 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 杭州银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时中债 0-3 年国开行 A | 博时中债 0-3 年国开行 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012692 | 012693 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 172,416,123.73 份 | 6,373,828.19 份 |

2.3 目标基金基本情况

博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

| | |
|---------|-------------------------------|
| 基金名称 | 博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159650 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 8 月 26 日 |

| | |
|--------------|------------------|
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2022 年 10 月 28 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 | 杭州银行股份有限公司 |

2.4 目标基金产品说明

博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

| | |
|--------|---|
| 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。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差控制在 3% 以内。 |
| 投资策略 | 本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法为主，选取标的指数成分债券和备选成分债券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金投资于待偿期为 0-3 年（含 3 年）的标的指数成份券和备选成份债券的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。 |
| 业绩比较基准 | 中债-0-3 年国开行债券指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

单位：人民币元

| | | |
|--------|--|-----------------|
| 主要财务指标 | 报告期 | |
| | (2023 年 4 月 17 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日) | |
| | 博时中债 0-3 年国开行债券 | 博时中债 0-3 年国开行债券 |

| | ETF 联接 A | ETF 联接 C |
|----------------|---------------|---------------|
| 1.本期已实现收益 | 286,344.40 | 12,298.81 |
| 2.本期利润 | 700,854.75 | 9,037.87 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0065 | 0.0065 |
| 4.期末基金资产净值 | 45,110,771.09 | 17,744,171.22 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0196 | 1.0180 |

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

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

3.1.2 博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2023 年 4 月 1 日-2023 年 4 月 16 日) | |
|----------------|---|-----------------|
| | 博时中债 0-3 年国开行 A | 博时中债 0-3 年国开行 C |
| 1.本期已实现收益 | -505,931.52 | -20,221.26 |
| 2.本期利润 | 80,357.36 | 2,951.13 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0004 | 0.0005 |
| 4.期末基金资产净值 | 174,727,739.19 | 6,454,126.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0134 | 1.0126 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

（报告期：2023年4月17日-2023年6月30日）

3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 博时中债 0-3 年国开行债券 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.62% | 0.03% | 0.90% | 0.02% | -0.28% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.62% | 0.03% | 0.90% | 0.02% | -0.28% | 0.01% |

2. 博时中债 0-3 年国开行债券 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.54% | 0.03% | 0.90% | 0.02% | -0.36% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.54% | 0.03% | 0.90% | 0.02% | -0.36% | 0.01% |

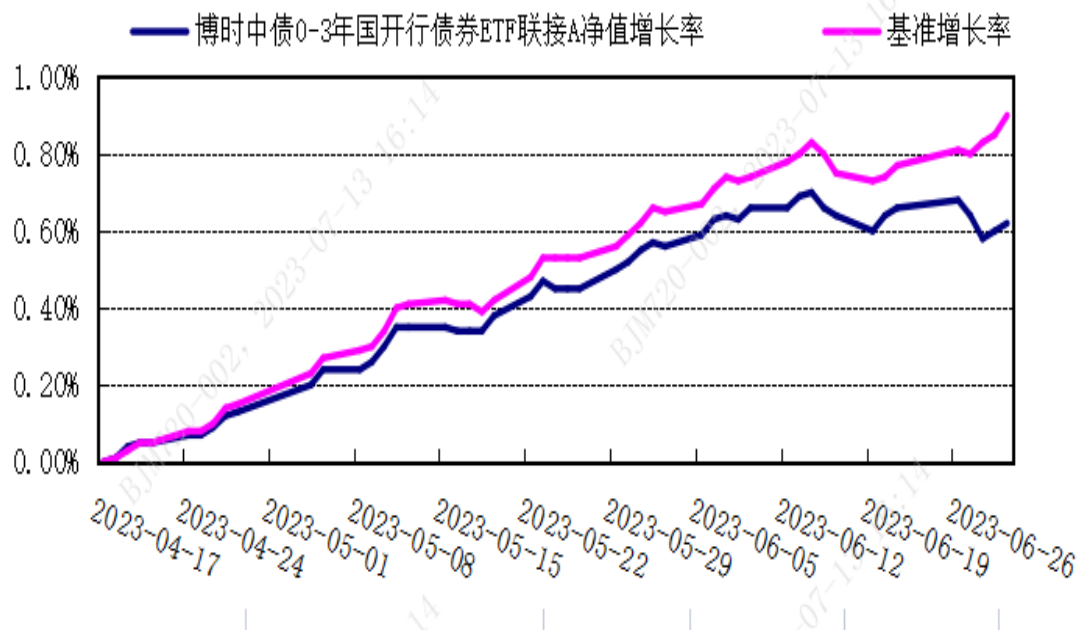
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金

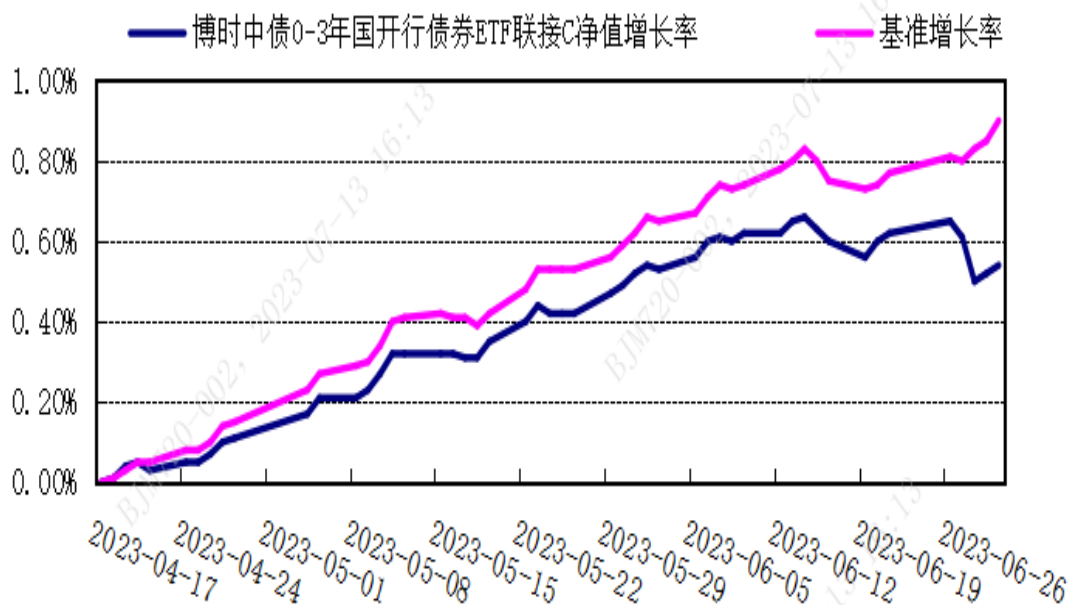
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 4 月 17 日-2023 年 6 月 30 日)

1、博时中债 0-3 年国开行债券 ETF 联接 A



2、博时中债 0-3 年国开行债券 ETF 联接 C



注：本基金的基金合同于 2023 年 4 月 17 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。

3.2.2 博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金（转型前）

（报告期：2023年4月1日-2023年4月16日）

3.2.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 博时中债 0-3 年国开行 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 |
|-----------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 (20230117-20230416) | 0.53% | 0.02% | 0.65% | 0.02% | -0.12% | 0.00% |
| 过去六个月 (20231017-20230416) | 0.54% | 0.04% | 0.70% | 0.04% | -0.16% | 0.00% |
| 过去一年 (20220417-20230416) | 2.10% | 0.03% | 2.21% | 0.03% | -0.11% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 (20210909-20230416) | 4.07% | 0.03% | 4.00% | 0.03% | 0.07% | 0.00% |

2. 博时中债 0-3 年国开行 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 |
|-----------------------------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 (20230117-20230416) | 0.51% | 0.02% | 0.65% | 0.02% | -0.14% | 0.00% |
| 过去六个月 (20231017-20230416) | 0.49% | 0.04% | 0.70% | 0.04% | -0.21% | 0.00% |
| 过去一年 (20220417-20230416) | 2.00% | 0.03% | 2.21% | 0.03% | -0.21% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 (20210909-20230416) | 3.89% | 0.03% | 4.00% | 0.03% | -0.11% | 0.00% |

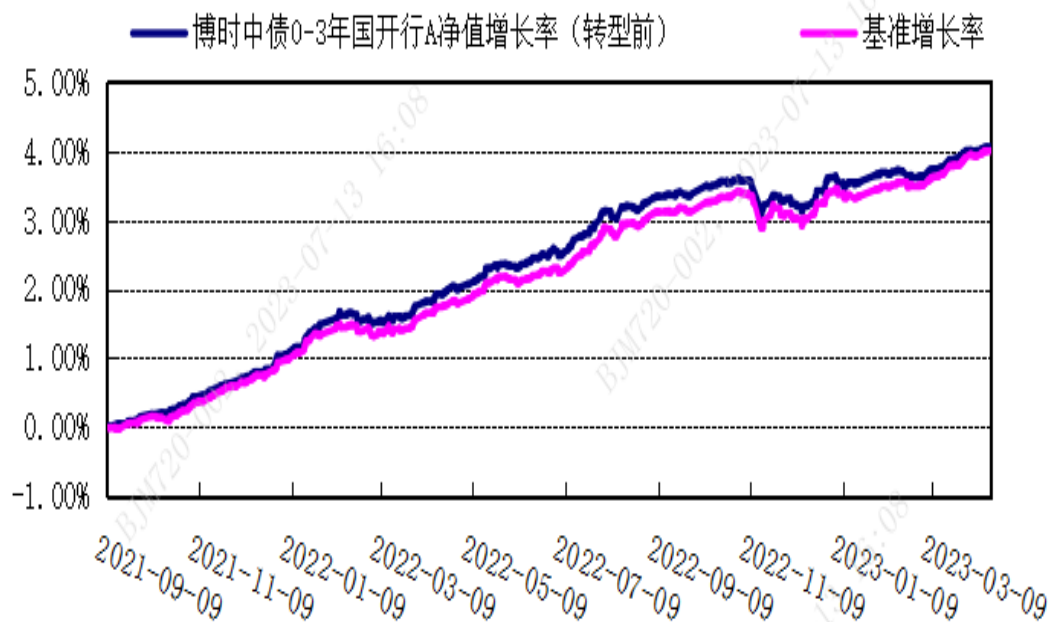
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金

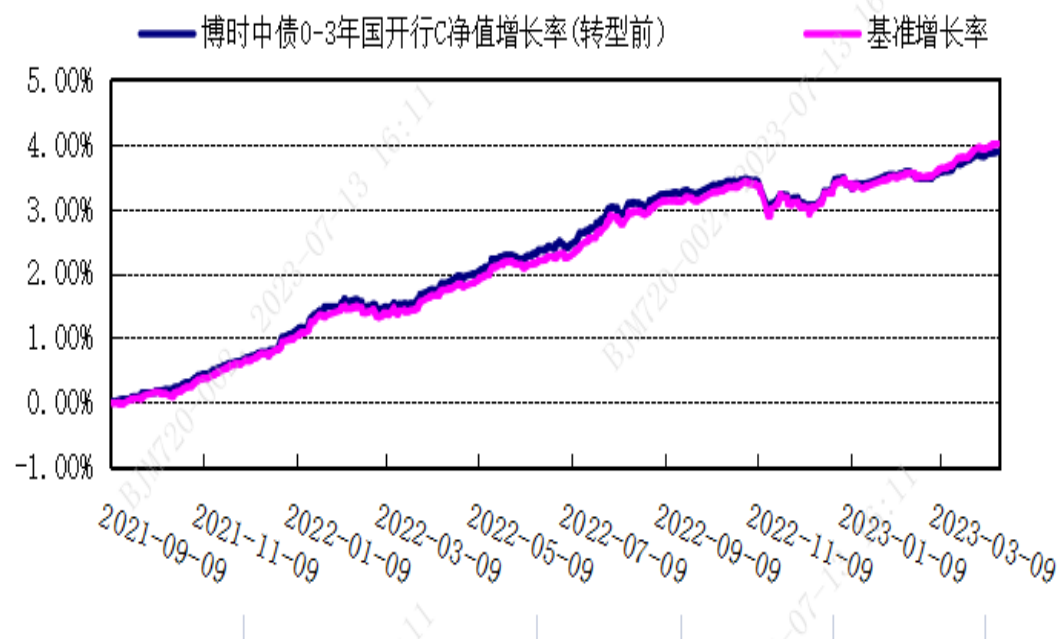
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 9 月 9 日至 2023 年 4 月 16 日)

1、博时中债 0-3 年国开行 A



2、博时中债 0-3 年国开行 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|-----|---|
| 万志文 | 基金经 理 | 2023-04-17 | - | 7.9 | <p>万志文先生，硕士。2015 年从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员兼基金经理助理、博时中债 3-5 年进出口行债券指数证券投资基金(2021 年 8 月 17 日-2022 年 8 月 4 日)、博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金(2021 年 9 月 9 日-2023 年 4 月 16 日)的基金经理。现任博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金(2020 年 10 月 26 日—至今)、博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金(2020 年 10 月 26 日—至今)、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金(2021 年 8 月 17 日—至今)、博时中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金(2021 年 8 月 17 日—至今)、博时中债 5-10 年农发行债券指数证券投资基金(2021 年 8 月 17 日—至今)、博时月月乐同业存单 30 天持有期混合型证券投资基金(2022 年 6 月 7 日—至今)、博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 8 月 26 日—至今)、博时中债 7-10 年政策性金融债指数证券投资基金(2023 年 3 月 15 日—至今)、博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2023 年 4 月 17 日—至今)的基金经理。</p> |
| 吕瑞君 | 基金经 理 | 2023-04-17 | - | 1.2 | <p>吕瑞君先生，硕士。2013 年至 2022 年在兴业银行深圳分行工作。2022 年加入博时基金管理有限公司。曾任</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金(2022 年 6 月 20 日-2023 年 4 月 16 日)基金经理。现任博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金(2022 年 6 月 20 日—至今)、博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 9 月 9 日—至今)、博时富业纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(2022 年 9 月 9 日—至今)、博时中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金(2022 年 9 月 9 日—至今)、博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2023 年 4 月 17 日—至今)的基金经理, 博时中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金、博时富业纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时中债 5-10 年农发行债券指数证券投资基金、博时中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、博时中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理助理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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, 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 52 次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2023 年二季度,宏观预期由强转弱,基本面复苏没有起色,10 年国债收益率从 2.86%持续下行至最低点 2.62%,利率曲线陡峭化。信用债配置需求仍较好,但信用利差压缩至上半年低点后被动走扩。具体来看,4 月份,市场对前期一季度信贷投放节奏前置已经有了较为充分的预期,同时基建-地产链条高频数据显示经济复苏有边际放缓迹象,跨季后资金逐步转松引导利率曲线陡峭化。5 月份,经济金融数据验证了宏观经济动能转弱预期,DR007 月均值 1.85%为上半年最低点,资金面呈现出衰退式宽松特点。利率自律机制下调通知存款、协定存款利率上限,政策着力引导银行负债成本下行。全月 1 年、10 年国债收益率分别下行 17bp、10bp,而信用债表现弱于利率债,信用利差被动走扩。6 月份,经济通胀数据延续回落趋势,政策宽松预期持续升温,央行于 6 月 13 日下调公开市场 7 天逆回购政策利率 10bp 至 1.9%略超市场预期。降息后机构止盈推动利率触底反弹,直到季末央行加大逆回购力度维护资金面稳定,利率再度下行。

展望后市,宏观经济弱修复格局不变,市场将围绕政策和预期变化反复进行博弈。当前地产销售和投资未见起色,经济内生性修复动力不足的核心矛盾尚未解决。信贷投放趋缓叠加资产荒环境,银行等机构对债券资产的配置需求仍在。货币政策维护资金面稳定的态度未变,DR007 将继续围绕政策利率波动,但汇率贬值压力可能会制约进一步宽松的空间。三季度需密切关注政策变化,若政策集中发力刺激经济,当前主导债市的弱预期将变化,同时市场短期波动可能引发一定程度的理财赎回反馈。

组合操作上,久期跟踪好对标指数,优化持仓结构,灵活操作。当前期限利差仍然较宽,这对中长端利率债有一定保护空间,在债市基本盘未变的情况下,货币政策预计仍将维持较为宽松的环境,期限利差预计将会压缩。同时,面对实际流动性环境和预期扰动,加强组合

久期管理，保持适度久期弹性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0196 元，份额累计净值为 1.0464 元；C 类基金份额净值为 1.0180 元，份额累计净值为 1.0438 元。报告期内，本基金由博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金转型为博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金。转型前，自 2023 年 1 月 17 日至 2023 年 4 月 16 日，博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金 A 类基金份额净值增长率为 0.53%，同期业绩基准增长率 0.65%，C 类基金份额净值增长率为 0.51%，同期业绩基准增长率 0.65%；转型后，自 2023 年 4 月 17 日至报告期末，博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 类基金份额净值增长率为 0.62%，同期业绩基准增长率 0.90%，C 类基金份额净值增长率为 0.54%，同期业绩基准增长率 0.90%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

（报告期：2023年4月17日-2023年6月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|----------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 49,121,050.80 | 55.74 |
| 3 | 固定收益投资 | 1,020,561.64 | 1.16 |
| | 其中：债券 | 1,020,561.64 | 1.16 |
| | 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 | 32,819,151.29 | 37.24 |
| 8 | 其他资产 | 5,165,081.98 | 5.86 |
| 9 | 合计 | 88,125,845.71 | 100.00 |

5.1.2 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 (元) | 占基金 资产净 值比例 (%) |
|----|-------------------|-------|------------|------------|---------------|--------------------------|
| 1 | 博时中债 0-3 年国开行 ETF | 指数型基金 | 交易型开放式指数基金 | 博时基金管理有限公司 | 49,121,050.80 | 78.15 |

5.1.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值 比例(%) |
|----|-----------|--------------|------------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 1,020,561.64 | 1.62 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,020,561.64 | 1.62 |
| 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 | 1,020,561.64 | 1.62 |

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 190203 | 19 国开 03 | 10,000 | 1,020,561.64 | 1.62 |

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.8 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。

5.1.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.10.2 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。

5.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.11.3 本期国债期货投资评价

5.1.12 投资组合报告附注

5.1.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会江西监管局、中国银行保险监督管理委员会广东监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

5.1.12.2 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。

5.1.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

| | | |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 45,449.09 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,119,632.89 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,165,081.98 |

5.1.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.12.6 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。

5.2 博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金（转型前）

（报告期：2023年4月1日-2023年4月16日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 163,830,887.67 | 90.35 |
| | 其中：债券 | 163,830,887.67 | 90.35 |
| | 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 | 17,475,040.14 | 9.64 |
| 8 | 其他资产 | 19,403.99 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 181,325,331.80 | 100.00 |

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 163,830,887.67 | 90.42 |
| | 其中：政策性金融债 | 163,830,887.67 | 90.42 |
| 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 | 163,830,887.67 | 90.42 |

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 210207 | 21 国开 07 | 800,000 | 82,478,904.11 | 45.52 |
| 2 | 200203 | 20 国开 03 | 300,000 | 30,587,515.07 | 16.88 |
| 3 | 220206 | 22 国开 06 | 300,000 | 30,488,852.05 | 16.83 |
| 4 | 190203 | 19 国开 03 | 200,000 | 20,275,616.44 | 11.19 |

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.2.9.2 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。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

5.2.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会江西监管局、中国银行保险监督管理委员会广东监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

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

5.2.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 19,403.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|-----------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 19,403.99 |

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

6.1 博时中债0-3年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

单位：份

| 项目 | 博时中债0-3年国开行 债券ETF联接A | 博时中债0-3年国开行 债券ETF联接C |
|--|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 172,416,123.73 | 6,373,828.19 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额 | 34,608,205.38 | 18,002,620.46 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额 | 162,782,118.62 | 6,946,682.09 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 44,242,210.49 | 17,429,766.56 |

注：本基金合同于2023年4月17日生效。

6.2 博时中债 0-3 年国开行债券指数证券投资基金（转型前）

单位：份

| 项目 | 博时中债0-3年国开行A | 博时中债0-3年国开行C |
|--------------|----------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 272,169,734.34 | 6,973,967.07 |

| | | |
|--------------------------|----------------|--------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 250,967.86 | 535,276.16 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 100,004,578.47 | 1,135,415.04 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 172,416,123.73 | 6,373,828.19 |

注：本基金于2023年4月17日正式转型为博时中债0-3年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.2.1 博时中债0-3年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

7.2.2 博时中债0-3年国开行债券指数证券投资基金（转型前）

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 博时中债0-3年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

8.1.1 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 | 2023-06-30~2023-06-30 | - | 13,733,470.67 | - | 13,733,470.67 | 22.27% |
| | 2 | 2023-06-30~2023-06-30 | - | 13,733,470.67 | - | 13,733,470.67 | 22.27% |

| | | | | | | | |
|--|---|-----------------------|---------------|---|---------------|--------------|--------|
| | | 23-06-30 | | | | | |
| | 3 | 2023-06-28~2023-06-29 | 9,586,224.27 | - | - | 9,586,224.27 | 15.54% |
| | 4 | 2023-04-17~2023-06-27 | 99,078,470.23 | - | 99,078,470.23 | - | - |
| | 5 | 2023-04-17~2023-04-17 | 44,219,737.10 | - | 44,219,737.10 | - | - |

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。

8.2博时中债0-3年国开行债券指数证券投资基金（转型前）

8.2.1 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 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |

| | | 区间 | | | | | |
|----|---|-----------------------|---------------|-----------|---------------|---------------|--------|
| 机构 | 1 | 2023-04-01~2023-04-16 | 99,078,470.23 | - | - | 99,078,470.23 | 55.42% |
| | 2 | 2023-04-01~2023-04-05 | 99,999,000.00 | - | 99,999,000.00 | - | - |
| | 3 | 2023-04-06~2023-04-16 | 44,154,361.97 | 65,375.13 | - | 44,219,737.10 | 24.73% |

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。

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件
- 2、《博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 3、《博时中债 0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、报告期内博时中债 0-3 年国开行债券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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二三年七月二十一日