

博时创业板交易型开放式指数  
证券投资基金  
(原深证基本面 200 交易型开放式指数  
证券投资基金转型)  
2018 年年度报告摘要  
2018 年 12 月 31 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

送出日期：二〇一九年三月二十九日

## § 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。本年度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 2019 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

自 2018 年 12 月 10 日起，《深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效且《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》同时生效，深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金正式变更为博时创业板交易型开放式指数证券投资基金。原深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日止，博时创业板交易型开放式指数证券投资基金本报告期自 2018 年 12 月 10 日至 2018 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 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	博时创业
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	36,229,029.00 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

#### 2.1.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

基金简称	博时深证基本面 200ETF
场内简称	深 F200
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	2011 年 6 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	34,229,029.00 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

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

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。
--	---

## 2.2.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

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	本基金为完全被动式指数基金，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	深证基本面 200 指数（价格指数）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及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，跟踪深证基本面 200 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

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

# § 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

### 3.1.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	2018 年 12 月 10 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-4,653,598.19
本期利润	-2,947,433.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0838
本期基金份额净值增长率	-7.25%
3.1.1.2 期末数据和指标	2018 年末

期末可供分配基金份额利润	0.0819
期末基金资产净值	39,196,378.12
期末基金份额净值	1.0819

注：本基金合同生效日为 2018 年 12 月 10 日，基金合同生效日起未满一年。

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。

### 3.1.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-3,414,212.56	1,462,590.37	-2,541,109.22
本期利润	-11,626,753.50	12,959,862.05	-3,558,836.22
加权平均基金份额本期利润	-0.3296	0.3414	-0.1037
本期基金份额净值增长率	-24.52%	28.81%	-7.55%
3.1.2.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 9 日	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1664	0.5453	0.1997
期末基金资产净值	39,926,056.95	55,212,442.05	44,664,941.03
期末基金份额净值	1.1664	1.5453	1.1997

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

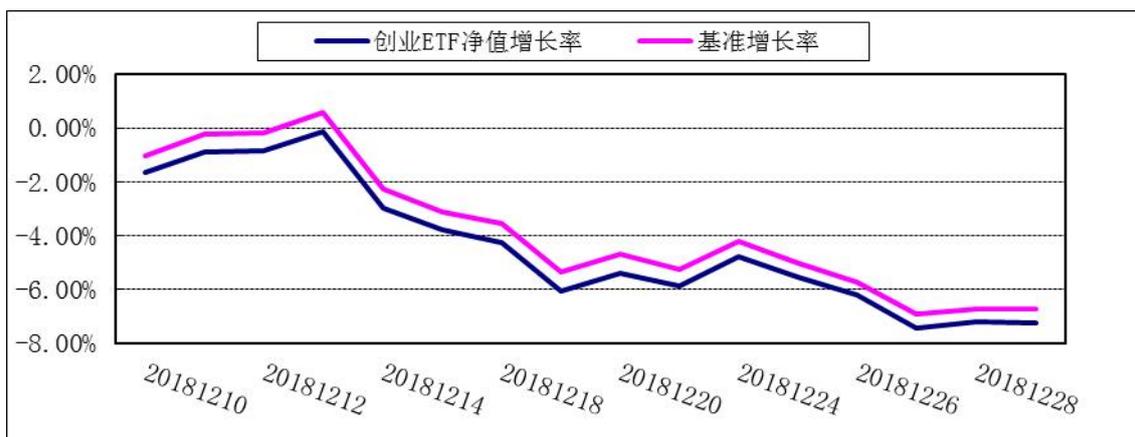
### 3.2.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

#### 3.2.1.1 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
自基金合同生效起至今	-7.25%	1.09%	-6.75%	1.06%	-0.50%	0.03%

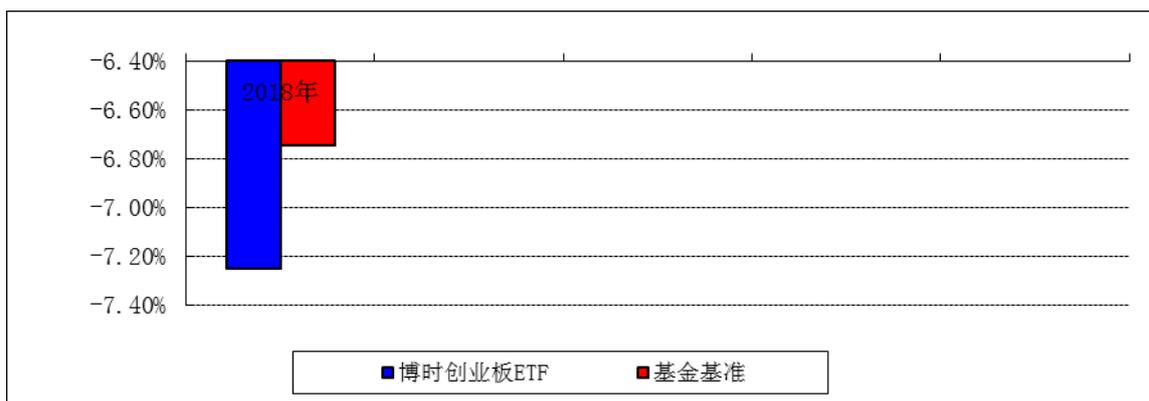
注：本基金的业绩比较基准为创业板指数。

### 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



注：本基金合同于 2018 年 12 月 10 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第十三条（二）投资范围、（五）投资限制的约定。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。

### 3.2.1.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于 2018 年 12 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.2.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

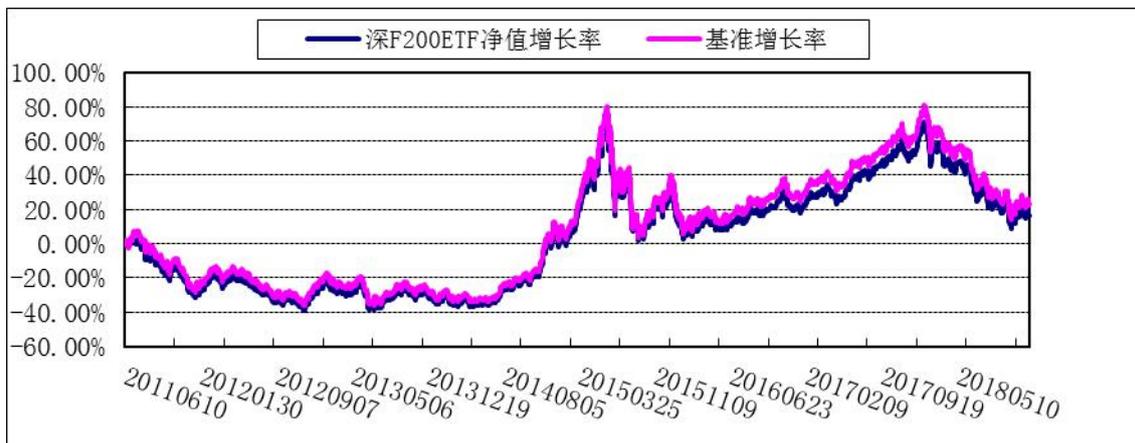
### 3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月 (2018/9/10-2018/12/9)	-3.20%	1.72%	-2.45%	1.76%	-0.75%	-0.04%
过去六个月 (2018/6/10-2018/12/9)	-18.85%	1.61%	-19.16%	1.64%	0.31%	-0.03%
过去一年 (2017/12/10-2018/12/9)	-22.20%	1.46%	-22.38%	1.48%	0.18%	-0.02%
过去三年 (2015/12/10-2018/12/9)	-5.00%	1.30%	-3.40%	1.32%	-1.60%	-0.02%
过去五年	60.93%	1.57%	62.53%	1.63%	-1.60%	-0.06%

(2013/12/10-2018/12/9)						
自基金合同生效起至今 (2011/6/10-2018/12/9)	16.64%	1.51%	22.96%	1.56%	-6.32%	-0.05%

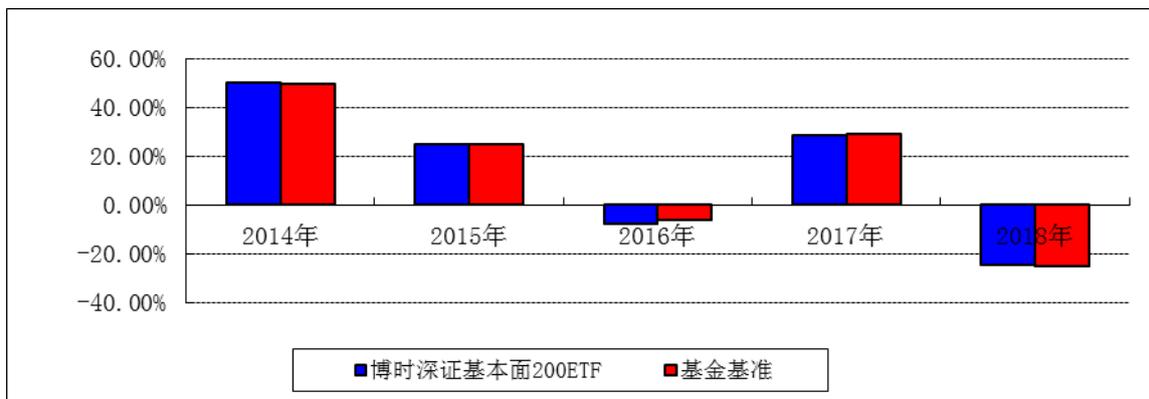
注：本基金的业绩比较基准为深证基本面 200 指数。

### 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



注：本基金于 2018 年 12 月 10 日正式转型为博时创业板交易型开放式指数证券投资基金。

### 3.2.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

### 3.3.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

无。

### 3.3.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

无。

## § 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 2018 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 181 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 8638 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 2439 亿元人民币，累计分红逾 916 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，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

#### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2018 年 4 季末：

博时固定收益类基金业绩表现亮眼。在参与银河排名的 107 只固收产品（各类份额分开计算）中，有 54 只产品银河同类排名前 1/2。债券型基金中，博时宏观回报债券 A/B 类、博时宏观回报债券 C 类 2018 年全年净值增长率均分别在 200 只、142 只同类基金中排名第 1，博时天颐债券 A 类 2018 年全年净值增长率在 200 只同类基金中排名第 4，博时天颐债券 C 类 2018 年全年净值增长率在 142 只同类基金中排名第 5，博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕康纯债债券、博时双月薪定期支付债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/10，博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时富益纯债债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/8；货币型基金中，博时合惠货币 B 类、博时现金宝货币 B 类 2018 年全年净值增长率分别在 291 只同类基金中排名第 8、第 29，博时合惠货币 A 类 2018 年全年净值增长率在 311 只同类基金中排名第 11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018 年 A 股市场震荡下行，博时旗下参与银河排名的 83 只权益产品（各类份额分开计算）中，56 只银河同类排名在前 1/2。其中，股票型基金里，博时工业 4.0 主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前 1/4；混合型基金中，博时乐臻定开混合 2018 年全年净值增长率在 44 只同类基金中均排名第 4，博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略 A 类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰 A 类等基金业绩排名在银河同类前 1/4；指数基金中，博时上证超大盘 ETF 及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时上证 50ETF 及其联接基金 A 类业绩排名在银河同类前 1/6，博时沪深 300 指数业绩排名在银河同类前 1/3。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率同类排名第 1。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率银河同类排名均位于前 1/3。

## 2、 其他大事件

2018 年 12 月 28 日, 由新华网主办的第十一届“中国企业社会责任峰会”暨 2018 中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的始终倡导和企业公民义务的切实履行, 老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获“2018 中国社会责任杰出企业奖”。

2018 年 12 月 22 日, 东方财富在南京举办的“2018 东方财富风云榜暨基情 20 年”颁奖典礼上, 博时基金喜获两项大奖, 博时基金江向阳总经理获得“基情 20 周年最受尊敬行业领袖”奖; 博时主题行业混合(L0F)荣登“天天基金年度产品热销榜”。

2018 年 12 月 21 日, 由华夏时报社主办的“华夏机构投资者年会暨第十二届金蝉奖颁奖盛典”在北京召开, 本次年会的主题是“金融业 2019 年: 突破与回归”, 博时基金荣获“2018 年度基金管理公司”。

2018 年 12 月 21 日, 由北京商报社、北京品牌协会主办的“科技赋能与金融生态再造”——2018 年度(第四届)北京金融论坛在京成功举办, 博时基金荣获“技术领先价值奖”。

2018 年 12 月 15 日, 第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单, 其中博时安盈债券基金(A 类: 000084、C 类: 000085)凭借年内出色的业绩表现以及在 90 后用户中的超高人气, 一举斩获“最受 90 后用户喜爱的产品奖”。

2018 年 11 月 16 日, 由《每日经济新闻》主办的“2018 公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼”在成都举行, 凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守, 博时基金一举摘得“公募 20 年特别贡献奖——创造收益”这一重磅奖项, 同时, 旗下专户板块获“专户业务最具竞争力基金公司”奖。

2018 年 11 月 1 日, 博时基金正式加入联合国责任投资原则组织(简称 UN PRI), 成为中国较早加入 UN PRI 国际组织的资产管理机构之一。

2018 年 10 月 17 日, 由南方财经全媒体集团和 21 世纪传媒举办的 21 世纪国际财经峰会暨“金帆奖”评选在深圳举行, 凭借对价值投资理念的坚守和出色的综合资管能力, 博时基金一举斩获“2018 年度基金管理公司金帆奖”这一重磅奖项。

2018 年 9 月 7 日, 由证券时报主办的“2018 中国 AI 金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行, 凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维, 博时基金副总裁王德英获得了“2018 中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018 年 9 月 6-9 日, 在阿拉善生态基金会主办, 深圳证券信息、全景网协办, 深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的“2018 第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛”中, 由 4 名博时员工朱盟(信息技术部)、过钧(固定收益总部)、王飞(信息技术部)、王盼(信息技术部)组成的代表队, 成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠, 率先

全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018 年 8 月，全国社会保障基金境内委托投资管理人 2017 年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获 A 档，三个社保委托组合获评“综合考评 A 档”，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获 3 项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10 年长期贡献社保表彰”，用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合，含金量极高。同时，董良泓本人还摘得“10 年贡献社保表彰”的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予 2 人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3 年贡献社保表彰”。

2018 年 7 月 19 日，由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业 20 周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得“优秀基金管理人”大奖；副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

2018 年 6 月 8 日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017 年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018 年 5 月 24 日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业 20 年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾 23 年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业 20 年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有 20 人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继 2016 年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018 年 5 月 23 日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募 20 年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金（000277）获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券（QDII）（人民币 050030：，美元现汇：050202，美元现钞：050203）获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018 年 5 月 17 日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技

术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖（DevOps 统一研发平台）、三等奖（证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试）以及优秀奖（新一代基金理财综合业务接入平台）三项大奖，成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018 年 5 月 10 日，由《上海证券报》主办的“2018 中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上，博时基金揽获“金基金 TOP 基金公司”这一最具份量的公司大奖；博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报基金经理奖”。在第 15 届金基金奖评选中，旗下价值投资典范产品博时主题行业（160505）获得“三年期金基金分红奖”。

2018 年 3 月 26 日，第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业 20 年卓越贡献公司”大奖。同时，旗下绩优产品博时主题行业混合（LOF）（160505）荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018 年 3 月 22 日，由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金 20 周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼”在北京举办，本次评选中，博时基金一举斩获本届“20 周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金 20 年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖，同时，旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金（二级债）”奖双双收入囊中，博时聚润纯债债券则获得“2017 年度普通债券型明星基金”奖。

2018 年 2 月 2 日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018 年 1 月 11 日，由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业 20 年最佳创新产品奖颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”，旗下产品博时主题行业混合基金（160505）和博时黄金 ETF 分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”，成为当天最大赢家之一。

2018 年 1 月 9 日，由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017 年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

## 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		
赵云阳	指数与量化 投资部投资 副总监/基金 经理	2018-12-10	-	8.4	赵云阳先生，硕士。2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、量化分析师兼基金经理助理、博时特许价值混合型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 2 月 9 日)、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2015 年 4 月 29 日-2016 年 5 月 30 日)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 5 月 4 日-2016 年 5 月 30 日)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 5 月 5 日-2016 年 5 月 30 日)、上证企债 30 交易型开放式指数证券投资基金(2013 年 7 月 11 日-2018 年 1 月 26 日)、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(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)、深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金(2015 年 5 月 19 日一至今)、博时中证银行指数分级证券投资基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日一至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金(2016 年 5 月 27 日一至今)、博

					时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 10 月 19 日一至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018 年 11 月 14 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(2018 年 12 月 10 日一至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 12 月 10 日一至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 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

2018 年形势较为严峻，国内经济数据继续下滑叠加中美贸易战，经济下行压力明显。12 月份中国制造业 PMI 指数回落至 49.4，已跌至荣枯线一下，意味着制造业景气出现了明显的下滑，经济下行承压。国际油价在前三季度震荡上行，但从 10 月开始，原油大幅受供给提升以及库存飙升等因素影响出现持续大幅下跌。国际市场方面，2018 年上半年美国经济强劲，股市延续上涨趋势，但总体呈震荡上行，但四季度在美联储持续加息，国债收益率持续上行，叠加长短期利率倒挂引发投资者对美国经济衰退的担忧，美股及其他发达国家股市大跌。汇率方面，上半年人民币兑美元大幅贬值，资金流出压力较大，下半年人民币汇率开始稳住，资金流出压力减小。

2018 年 A 股在 1 月底冲高后开始回落，去杠杆叠加贸易战使投资者情绪低落，呈现出缩量下跌的趋势，全年处于熊市之中。尽管大中小盘普跌，但上证 50 相对较为抗跌，宽基指数中，上证 50 下跌 19.83%，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 500、中证 1000、创业板指则分别下跌 33.32%、36.87%、28.65%。行业方面，中信一级行业中，较为抗跌的前五大行业为餐饮旅游、银行、石油石化、食品饮料和农林牧渔，跌幅分别为 3.73%、5.28%、5.51%、6.54%，而综合、电子元器件、有色金属、传媒及机械领跌，跌幅分别是 42.45%、41.31%、40.93%、38.59%和 34.84%。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，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。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份股紧密跟踪指数，利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期，我们严格按照基金合同要求，尽量降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合与目标指数的结构一致。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0819 元，累计份额净值为 1.0819 元。报告期内，本基金由深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金转型为博时创业板交易型开放式指数证券投资基金。转型前，自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日，深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金份额净值增长率为-24.52%，同期业绩基准收益率为-24.70%；转型后，自 2018 年 12 月 10 日至报告期末，博时创业板交易型开放式指数证券投资基金份额净值增长率为-7.25%，同期业绩基准增长率为-6.75%。

## 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 2019 年，中国经济增长或将持续承压。一方面，从中观高频行业数据看，2018 年 12 月

的制造业 PMI 及 PMI 所有分项指标都在变差。可以看出，接下来经济增长压力继续加大，国内需求和生产均有走弱。另一方面，央行在 2019 年开年即宣布了降准，体现了中央经济工作会议加大逆周期政策力度的执行，也反应了稳增长的决心。但当前的政策导向和实际的执行尚未有推高社会融资规模增速的明确迹象，这也意味着企业盈利情况总体难见改观。此外，中美本周在北京会进行具体的磋商，预计中美贸易谈判有可能在往好的方向发展，如果贸易谈判进展良好，有可能决定全年的投资者情绪，进而提升市场风险偏好。海外方面，鲍威尔发言偏向“鸽派”，如对货币政策调整将有“耐心”；如果造成问题，将毫不犹豫调整缩表政策，有助于全球风险偏好提升。

A 股经历了 2018 年估值大幅下挫，2019 年市场估值水平下行空间有限，企业的业绩边际变化是需重点关注。我们认为，2019 年主导 A 股走势将是盈利下行、逆周期政策以及市场风险偏好的合力。全年看，经济、盈利持续走弱的状况短时间内不会有明显改善，逆周期政策及外部环境的积极变化，有可能带来风险偏好的提高。总体来看，2019 年 A 股震荡回升的概率较大，不同板块之间的企业业绩可能会出现明显的分化，A 股市场会存在一些结构性机会。结构上关注 1) 逆周期政策方向，如 5G、基建；2) 具有较高安全垫的高股息、低估值股票；3) 业绩较为稳定，周期性较弱的板块，如医药、食品饮料等行业。

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，紧密跟踪目标指数。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2018 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《合规管理制度》、《养老目标证券投资基金子基金选择标准与制度》等制度。修订了《合规考核管理制度》、《投资决策委员会制度》、《债券型基金投资股票管理流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基

金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；本基金场内及场外份额的收益分配方式均采用现金分红；当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.9 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

原深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金在本报告期内出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元及持有人少于 200 人的情形，针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了

解决方案。

## § 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

2018 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

2018 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018 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的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 审计报告

---

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

---

## 7.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

### 7.1.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日
资产：	
银行存款	651,790.36
结算备付金	29,784.35
存出保证金	898.69
交易性金融资产	39,194,602.72
其中：股票投资	39,194,602.72
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	141.00
应收利息	161.00
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>39,877,378.12</b>
	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	224,428.92
应付赎回款	-
应付管理人报酬	16,788.76
应付托管费	3,357.76
应付销售服务费	-
应付交易费用	59,872.03
应交税费	-
应付利息	-

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	376,552.53
<b>负债合计</b>	<b>681,000.00</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	36,229,029.00
未分配利润	2,967,349.12
<b>所有者权益合计</b>	<b>39,196,378.12</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>39,877,378.12</b>

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0819 元，基金份额总额 36,229,029.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 12 月 10 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

### 7.1.2 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：2018 年 12 月 10 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 10 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-2,806,729.79</b>
1. 利息收入	343.73
其中：存款利息收入	343.73
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	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-4,513,235.48
其中：股票投资收益	-4,510,196.17
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-3,039.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,706,164.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-3.00
<b>减：二、费用</b>	<b>140,703.44</b>

1. 管理人报酬	11,841.16
2. 托管费	2,368.25
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	101,655.93
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	24,838.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-2,947,433.23</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-2,947,433.23</b>

### 7.1.3 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

本报告期：2018 年 12 月 10 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 10 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 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）	34,229,029.00	5,697,027.95	39,926,056.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,947,433.23	-2,947,433.23
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）	2,000,000.00	217,754.40	2,217,754.40
其中：1. 基金申购款	2,500,000.00	258,779.87	2,758,779.87
2. 基金赎回款	-500,000.00	-41,025.47	-541,025.47
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）	36,229,029.00	2,967,349.12	39,196,378.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4 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

## 7.1.4 报表附注

### 7.1.4.1 重要会计政策和会计估计

#### 7.1.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 12 月 10 日(基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.1.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.1.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.1.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.1.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.1.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.1.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.1.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.1.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.1.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.1.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益评价日核定的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率达到 1%以上，方可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人按基金管理人按基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算。本基金以使收益

分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。若自基金合同生效日起不满 3 个月，可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.1.4.1.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.1.4.1.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.1.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.1.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.1.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.1.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.1.4.3 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。

#### 7.1.4.4 关联方关系

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、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司
博时创业板 ETF 联接基金	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。

7.1.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.1.4.5.2 关联方报酬

7.1.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年12月10日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,841.16
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。

7.1.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年12月10日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,368.25

注：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 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。

7.1.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.1.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.1.4.5.4.2 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 2018 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
博时创业板 ETF 联接基金	29,114,065.00	80.36%
招商证券	335,400.00	0.93%

7.1.4.5.5 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	
	2018年12月10日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入

交通银行	651,790.36	314.88
------	------------	--------

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。

#### 7.1.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.1.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.1.4.6 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.1.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.1.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017-08-21	公告重大事项	4.87	2019-01-02	4.38	46,067	233,579.75	224,346.29	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.1.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.1.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2018 年 12 月 10 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日，本基金申购基金份额的对价总额 2,758,779.87 元，其中包括以股票支付的申购款 2,734,158.00 元和以现金支付的申购款 24,621.87 元。

##### (2) 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 2018 年 12 月 31 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 38,970,256.43 元，属于第二层次的余额为 224,346.29 元，无属于第三层次的余额。

(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 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

(3)除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

### 7.2.1 资产负债表

会计主体：深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 9 日（基金转型 日前日）	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	1,865,543.63	653,492.69
结算备付金	26,752.35	1,818.18
存出保证金	898.69	521.17

交易性金融资产	38,435,364.97	54,291,357.53
其中：股票投资	38,435,364.97	54,172,557.53
基金投资	-	-
债券投资	-	118,800.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	601,282.19
应收利息	3,544.36	-66.82
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	3,617.12	-
<b>资产总计</b>	<b>40,335,721.12</b>	<b>55,548,404.94</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018年12月9日(基金转型 日前日)</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,947.60	23,943.45
应付托管费	36,182.55	52,290.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,187.47	24,750.87
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	365,346.55	234,978.36
<b>负债合计</b>	<b>409,664.17</b>	<b>335,962.89</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	34,229,029.00	35,729,029.00
未分配利润	5,697,027.95	19,483,413.05
<b>所有者权益合计</b>	<b>39,926,056.95</b>	<b>55,212,442.05</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>40,335,721.12</b>	<b>55,548,404.94</b>

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日），基金份额净值 1.1664 元，基金份额总额 34,229,029.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）止期间。

## 7.2.2 利润表

会计主体：深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-10,860,035.09</b>	<b>13,720,822.02</b>
1. 利息收入	8,775.42	10,214.98
其中：存款利息收入	8,431.32	8,354.08
债券利息收入	23.56	12.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	320.54	1,848.01
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,358,854.45	2,205,847.36
其中：股票投资收益	-3,221,273.60	1,237,164.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,329.00	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	839,090.15	968,682.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-8,212,540.94	11,497,271.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-297,415.12	7,488.00
<b>减：二、费用</b>	<b>766,718.41</b>	<b>760,959.97</b>
1. 管理人报酬	226,659.94	261,450.98
2. 托管费	45,331.99	52,290.21
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	29,330.77	44,395.59
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	465,395.71	402,823.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-11,626,753.50</b>	<b>12,959,862.05</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填</b>	<b>-11,626,753.50</b>	<b>12,959,862.05</b>

列)		
----	--	--

### 7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）		
	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）	35,729,029.00	19,483,413.05	55,212,442.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,626,753.50	-11,626,753.50
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）	-1,500,000.00	-2,159,631.60	-3,659,631.60
其中：1. 基金申购款	42,000,000.00	7,261,396.70	49,261,396.70
2. 基金赎回款	-43,500,000.00	-9,421,028.30	-52,921,028.30
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）	34,229,029.00	5,697,027.95	39,926,056.95
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	37,229,029.00	7,435,912.03	44,664,941.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,959,862.05	12,959,862.05
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）	-1,500,000.00	-912,361.03	-2,412,361.03
其中：1. 基金申购款	10,500,000.00	4,124,525.22	14,624,525.22
2. 基金赎回款	-12,000,000.00	-5,036,886.25	-17,036,886.25
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）	35,729,029.00	19,483,413.05	55,212,442.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4 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

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 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。

### 7.2.4.2 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。

#### 7.2.4.3 关联方关系

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、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司
博时深证基本面 200ETF 联接基金	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。

#### 7.2.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.2.4.4.1.1 股票交易

无。

##### 7.2.4.4.1.2 权证交易

无。

##### 7.2.4.4.1.3 债券交易

无。

##### 7.2.4.4.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月9日(基金转型日前日)		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	5,200,000.00	100.00%

##### 7.2.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 7.2.4.4.2 关联方报酬

##### 7.2.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月9日（基金转型日前日）	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	226,659.94	261,450.98
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。

##### 7.2.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月9日（基金转型日前日）	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	45,331.99	52,290.21

注：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 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。

##### 7.2.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

##### 7.2.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

###### 7.2.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

###### 7.2.4.4.4.2 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 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）		上年度末 2017 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
深证基本面 200ETF 联接基金	29,114,065.00	85.06%	30,056,365.00	84.12%

##### 7.2.4.4.5 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 2018年1月1日至2018年12月9日 (基金转型日前日)		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	1,865,543.63	7,727.98	653,492.69	8,143.13

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。

#### 7.2.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.2.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.2.4.5 期末（2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日））本基金持有的流通受限证券

##### 7.2.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.2.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017-08-21	公告重大事项	4.87	2019-01-02	4.38	46,067	233,579.75	224,346.29	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日）止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.2.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.2.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日），本基金申购基金份额的对价总额 49,261,396.70 元(2017 年度：14,624,525.22 元)，其中包括以股票支付的申购款 45,471,950.00 元和以现金支付的申购款 3,789,446.70 元(2017 年度：其中包括以股票支付的申购款 14,074,762.00 元和以现金支付的申购款 549,763.22 元)。

##### (2) 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 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日），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 38,211,018.68 元，属于第二层次的余额为 224,346.29 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次 52,741,607.73 元，第二层次 1,549,749.80 元，无第三层次）。

(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 2018 年 12 月 9 日（基金转型日前日），本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2017 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。

(3)除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

---

## 8.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2018 年 12 月 10 日-2018 年 12 月 31 日)

### 8.1.1 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	39,194,602.72	98.29
	其中：股票	39,194,602.72	98.29
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	681,574.71	1.71
8	其他各项资产	1,200.69	0.00
9	合计	39,877,378.12	100.00

### 8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,543,800.80	11.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,709,275.90	47.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	223,964.00	0.57
F	批发和零售业	-	-
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	9,702,633.00	24.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	224,346.29	0.57
L	租赁和商务服务业	254,324.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	114,000.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	1,164,002.80	2.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,851,484.00	4.72
R	文化、体育和娱乐业	2,406,771.93	6.14
S	综合	-	-
	合计	39,194,602.72	100.00

### 8.1.3 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

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	300498	温氏股份	173,560	4,543,800.80	11.59
2	300059	东方财富	178,200	2,156,220.00	5.50
3	300142	沃森生物	53,200	1,016,120.00	2.59
4	300015	爱尔眼科	37,700	991,510.00	2.53
5	300124	汇川技术	44,800	902,272.00	2.30
6	300003	乐普医疗	41,700	867,777.00	2.21
7	300408	三环集团	49,400	835,848.00	2.13
8	300122	智飞生物	21,200	821,712.00	2.10
9	300750	宁德时代	11,100	819,180.00	2.09
10	300136	信维通信	36,100	780,121.00	1.99

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票投资明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300498	温氏股份	3,959,803.20	10.10
2	300059	东方财富	2,041,063.56	5.21
3	300015	爱尔眼科	1,069,269.72	2.73
4	300750	宁德时代	966,427.00	2.47
5	300142	沃森生物	963,810.00	2.46
6	300003	乐普医疗	959,173.44	2.45
7	300136	信维通信	860,152.00	2.19
8	300124	汇川技术	824,432.29	2.10
9	300122	智飞生物	823,575.00	2.10
10	300408	三环集团	745,655.00	1.90
11	300024	机器人	728,319.00	1.86
12	300144	宋城演艺	670,433.00	1.71
13	300347	泰格医药	654,849.83	1.67
14	300146	汤臣倍健	639,794.00	1.63
15	300070	碧水源	633,781.00	1.62
16	300253	卫宁健康	616,902.00	1.57

17	300017	网宿科技	537,135.00	1.37
18	300383	光环新网	523,094.00	1.33
19	300296	利亚德	504,521.00	1.29
20	300072	三聚环保	495,900.05	1.27

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。

#### 8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	2,670,967.80	6.81
2	000002	万科 A	2,252,116.54	5.75
3	000001	平安银行	1,854,589.92	4.73
4	000333	美的集团	1,665,753.89	4.25
5	000100	TCL 集团	821,167.90	2.10
6	000338	潍柴动力	778,009.40	1.98
7	000776	广发证券	717,644.30	1.83
8	300498	温氏股份	677,713.00	1.73
9	000725	京东方 A	657,335.47	1.68
10	000858	五粮液	619,327.31	1.58
11	002142	宁波银行	605,315.28	1.54
12	000876	新希望	501,470.12	1.28
13	000895	双汇发展	499,121.47	1.27
14	002594	比亚迪	450,314.08	1.15
15	000709	河钢股份	449,798.55	1.15
16	001979	招商蛇口	437,023.66	1.11
17	002304	洋河股份	413,084.21	1.05
18	000625	长安汽车	395,615.50	1.01
19	000157	中联重科	389,747.25	0.99
20	002024	苏宁易购	377,896.00	0.96

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。

#### 8.1.4.3 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	39,437,371.92
卖出股票的收入（成交）总额	38,070,729.96

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。

#### 8.1.5 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。

### 8.1.6 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。

### 8.1.7 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。

### 8.1.8 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投资。

### 8.1.9 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。

### 8.1.10 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。

### 8.1.11 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。

### 8.1.12 投资组合报告附注

8.1.12.1 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。

8.1.12.2 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。

### 8.1.12.3 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	898.69
2	应收证券清算款	141.00
3	应收股利	-
4	应收利息	161.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,200.69

### 8.1.12.4 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。

### 8.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.1.12.6 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。

## 8.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 9 日)

### 8.2.1 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	38,435,364.97	95.29
	其中：股票	38,435,364.97	95.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,892,295.98	4.69
8	其他各项资产	8,060.17	0.02
9	合计	40,335,721.12	100.00

### 8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,154,291.60	2.89
B	采矿业	463,458.47	1.16
C	制造业	21,843,362.34	54.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,084,231.55	2.72
E	建筑业	382,041.00	0.96
F	批发和零售业	1,646,102.30	4.12
G	交通运输、仓储和邮政业	298,944.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	449,246.76	1.13
J	金融业	5,120,410.36	12.82
K	房地产业	5,167,729.33	12.94
L	租赁和商务服务业	496,127.72	1.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	148,593.36	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	180,826.18	0.45
S	综合	-	-
	合计	38,435,364.97	96.27

### 8.2.3 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

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	000651	格力电器	73,824	2,693,099.52	6.75
2	000002	万科A	88,682	2,247,201.88	5.63
3	000001	平安银行	181,262	1,863,373.36	4.67
4	000333	美的集团	44,407	1,708,781.36	4.28
5	300498	温氏股份	41,060	1,079,056.80	2.70
6	000100	TCL 集团	329,582	843,729.92	2.11
7	000338	潍柴动力	102,420	780,440.40	1.95
8	000776	广发证券	54,042	724,703.22	1.82
9	000725	京东方A	241,357	663,731.75	1.66
10	000858	五粮液	11,727	623,876.40	1.56

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票投资明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

### 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.2.4.1 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	000333	美的集团	2,176,494.00	3.94
2	000100	TCL 集团	345,346.00	0.63
3	000625	长安汽车	273,201.00	0.49
4	000750	国海证券	240,383.00	0.44
5	300498	温氏股份	235,382.92	0.43
6	000046	泛海控股	217,844.00	0.39
7	000725	京东方A	196,705.00	0.36
8	000550	江铃汽车	173,486.00	0.31
9	002304	洋河股份	167,187.00	0.30

10	000027	深圳能源	164,752.00	0.30
11	002027	分众传媒	158,949.00	0.29
12	000166	申万宏源	155,933.00	0.28
13	000783	长江证券	150,945.00	0.27
14	300226	上海钢联	148,549.00	0.27
15	000883	湖北能源	147,681.00	0.27
16	000031	中粮地产	145,627.33	0.26
17	000776	广发证券	143,379.00	0.26
18	000709	河钢股份	140,573.00	0.25
19	000418	小天鹅 A	136,688.00	0.25
20	002493	荣盛石化	135,580.00	0.25

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。

#### 8.2.4.2 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	000651	格力电器	880,015.00	1.59
2	000858	五粮液	742,772.00	1.35
3	000333	美的集团	712,997.00	1.29
4	000002	万科 A	455,705.00	0.83
5	002304	洋河股份	382,415.00	0.69
6	000830	鲁西化工	367,704.00	0.67
7	000568	泸州老窖	319,256.00	0.58
8	000338	潍柴动力	268,623.00	0.49
9	002024	苏宁易购	243,264.00	0.44
10	000860	顺鑫农业	198,238.00	0.36
11	000001	平安银行	188,008.00	0.34
12	000825	太钢不锈	187,487.00	0.34
13	002422	科伦药业	167,278.00	0.30
14	002142	宁波银行	147,948.00	0.27
15	000789	万年青	144,514.75	0.26
16	000063	中兴通讯	133,818.00	0.24
17	002001	新和成	130,566.00	0.24
18	000690	宝新能源	124,858.98	0.23
19	000425	徐工机械	112,636.00	0.20
20	000792	盐湖股份	110,167.00	0.20

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。

#### 8.2.4.3 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	12,718,338.71
---------------	---------------

卖出股票的收入（成交）总额	10,374,355.73
---------------	---------------

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。

### 8.2.5 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。

### 8.2.6 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。

### 8.2.7 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。

### 8.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.2.9 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。

### 8.2.10 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。

### 8.2.11 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。

### 8.2.12 投资组合报告附注

8.2.12.1 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。

8.2.12.2 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。

### 8.2.12.3 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	898.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,544.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	3,617.12
8	其他	-

9	合计	8,060.17
---	----	----------

#### 8.2.12.4 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。

#### 8.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.2.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2018 年 12 月 10 日-2018 年 12 月 31 日)

#### 9.1.1 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
459	78,930.35	1,379,408.00	3.81%	5,735,556.00	15.83%	29,114,065.00	80.36%

#### 9.1.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	方正证券股份有限公司	619,508.00	1.71%
2	郑更新	500,000.00	1.38%
3	杨振山	470,000.00	1.30%
4	广发证券股份有限公司	424,500.00	1.17%
5	招商证券股份有限公司	335,400.00	0.93%
6	朱洪宏	253,800.00	0.70%
7	徐国忠	228,874.00	0.63%
8	王宗武	200,000.00	0.55%
9	韩伟锋	147,702.00	0.41%
10	陈焯	140,105.00	0.39%
	博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	29,114,065.00	80.36%

注：前十名持有人为除博时创业板 ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-

### 9.1.4 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

项目	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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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。

## 9.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 9 日）

### 9.2.1 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		博时深证基本面 200 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
442	77,441.24	-	-	5,114,964.00	14.94%	29,114,065.00	85.06%

### 9.2.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	杨振山	470,000.00	1.37%
2	朱洪宏	253,800.00	0.74%
3	徐国忠	228,874.00	0.67%
4	王宗武	200,000.00	0.58%
5	韩伟锋	147,702.00	0.43%
6	陈焯	140,105.00	0.41%
7	何东银	140,005.00	0.41%
8	荣红	128,026.00	0.37%
9	肖竞松	115,012.00	0.34%
10	卢媛	100,000.00	0.29%
	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	29,114,065.00	85.06%

注：前十名持有人为除博时深 200ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	-	-
------------------	---	---

#### 9.2.4 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

项目	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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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。

## § 10 开放式基金份额变动

### 10.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2018 年 12 月 10 日-2018 年 12 月 31 日）

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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,500,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	36,229,029.00

### 10.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2018 年 1 月 1 日-2018 年 12 月 9 日）

单位：份

基金合同生效日(2011 年 6 月 10 日)基金份额总额	403,229,029.00
本报告期期初基金份额总额	35,729,029.00
本报告期基金总申购份额	42,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	43,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	34,229,029.00

注：本基金于 2018 年 12 月 10 日正式转型为博时创业板交易型开放式指数证券投资基金。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间从 2018 年 10 月 29 日起，至 2018 年 12 月 2 日 17:00 止，会议审议通过了《关于深证基本面 200 交易型开放式指数证

券投资基金转型有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

## 11.2 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

自 2018 年 12 月 10 日起，“博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金”转型为“博时创业板交易型开放式指数证券投资基金”。《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及《博时创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》自该日起生效，基金投资策略相应变更。

## 11.5 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。本报告期内本基金应付审计费 40,000 元。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

#### 11.7.1.1 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	
中泰证券	1	77,508,101.88	100.00%	56,684.56	100.00%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

### 11.7.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

#### 11.7.2.1 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	
中泰证券	1	23,092,694.44	100.00%	16,884.61	100.00%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

#### 11.7.2.2 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
中泰证券	152,365.45	100.00%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 博时创业板交易型开放式指数证券投资基金

#### 12.1.1 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
博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2018-12-10~2018-12-31	29,114,065.00	-	-	29,114,065.00	80.36%

#### 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：本基金同时可在场内交易，因场内交易导致的投资者份额变动管理人无法获悉。

## 12.2 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金

### 12.2.1 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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
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	1	2018-01-01~2018-12-09	30,056,365.00	42,000,000.00	42,942,300.00	29,114,065.00	85.06%

#### 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：本基金同时可在场内交易，因场内交易导致的投资者份额变动管理人无法获悉。

### 12.3 影响投资者决策的其他重要信息

无。

博时基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十九日