

博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年半年度报告 2019 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十七日

§ 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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§9 开放式基金份额变动	43

§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	博时中证 500 指数增强	
基金主代码	005062	
交易代码	005062	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	240,314,909.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005062	005795
报告期末下属分级基金的份额总额	178,537,815.35 份	61,777,093.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，包括（一）股票投资策略、（二）债券投资策略、（三）股指期货投资策略、（四）权证投资策略、（五）融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	本基金的标的指数为：中证 500 指数。本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	王永民
	联系电话	0755-83169999	010-66594896
	电子邮箱	service@bosera.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594942
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	5999 号基金大厦 21 层	
邮政编码	518040	100818
法定代表人	张光华	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	12,077,417.99	3,053,374.81
本期利润	24,140,265.32	4,208,068.15
加权平均基金份额本期利润	0.1434	0.0913
本期加权平均净值利润率	16.63%	10.55%
本期基金份额净值增长率	18.79%	18.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	-22,241,269.05	-7,950,738.92
期末可供分配基金份额利润	-0.1246	-0.1287
期末基金资产净值	156,296,546.30	53,826,354.96
期末基金份额净值	0.8754	0.8713
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	-12.46%	-10.99%

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

博时中证 500 指数增强 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	1.83%	1.28%	0.75%	1.32%	1.08%	-0.04%
过去三个月	-6.74%	1.65%	-10.21%	1.72%	3.47%	-0.07%
过去六个月	18.79%	1.61%	17.87%	1.70%	0.92%	-0.09%
过去一年	-0.86%	1.56%	-4.70%	1.60%	3.84%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-12.46%	1.45%	-22.47%	1.45%	10.01%	0.00%

博时中证 500 指数增强 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	1.80%	1.28%	0.75%	1.32%	1.05%	-0.04%
过去三个月	-6.84%	1.66%	-10.21%	1.72%	3.37%	-0.06%
过去六个月	18.56%	1.61%	17.87%	1.70%	0.69%	-0.09%
过去一年	-1.25%	1.56%	-4.70%	1.60%	3.45%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-10.99%	1.53%	-18.09%	1.55%	7.10%	-0.02%

注：博时中证 500 指数增强 C 类自 2018 年 4 月 3 日起有份额。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×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。

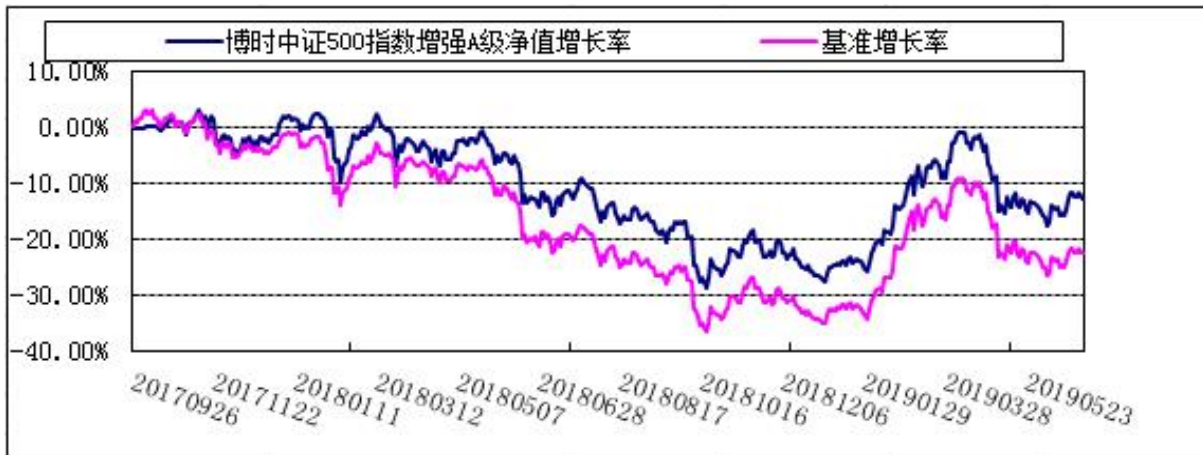
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

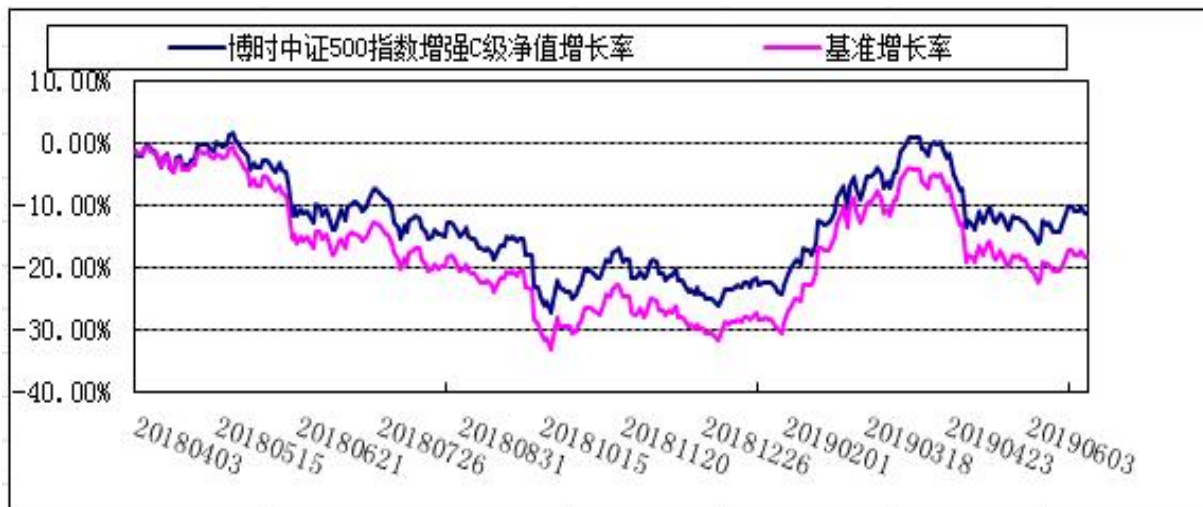
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 9 月 26 日至 2019 年 6 月 30 日)

博时中证 500 指数增强 A



博时中证 500 指数增强 C



§ 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 2019 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 185 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 9345 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公司公募资产管理总规模逾 2699 亿元人民币，累计分红逾 980 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。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 2 季末：

博时旗下权益类基金业绩亮眼，54 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年以来净值增长率银河同类排名在前 1/2，31 只银河同类排名在前 1/4，15 只银河同类排名在前 1/10，

15 只银河同类排名在前 10。其中，博时回报灵活配置混合、博时乐臻定期开放混合、博时医疗保健行业混合今年来净值增长率分别在 145 只、61 只、14 只同类产品中排名第 1；博时量化平衡混合、博时弘泰定期开放混合、博时上证 50ETF 联接(A 类)、博时上证 50ETF 联接(C 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 今年来净值增长率分别在 102 只、61 只、46 只、34 只、15 只同类产品中排名第 3；博时特许价值混合(A 类)今年来净值增长率在 414 只同类产品中排名第 20；博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时上证 50ETF、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时颐泰混合(C 类)、博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/10；博时颐泰混合(A 类)、博时新兴消费主题混合、博时鑫瑞灵活配置混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时文体娱乐主题混合、博时新兴成长混合、博时鑫瑞灵活配置混合(A 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时裕益灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

博时固定收益类基金业绩表现稳健，58 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率银河同类排名前 1/2，29 只银河同类排名在前 1/4，16 只银河同类排名在前 1/10，10 只银河同类排名在前 10。债券型基金中，博时转债增强债券(A 类)、博时转债增强债券(C 类)今年来净值增长率分别在 28 只、15 只同类产品中排名第 1，且分别在全市场参与业绩排名的 1928 只债券基金中排名第 3、第 4；博时安盈债券(A 类)、博时安盈债券(C 类) 今年来净值增长率分别在同类产品中排第 2、第 3；博时安弘一年定期开放债券(A 类)、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时安心收益定期开放债券(A 类)、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券今年来净值增长率分别在 239 只同类产品中排名第 3、第 7、第 14、第 18、第 23；博时裕泰纯债债券、博时裕顺纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时富祥纯债债券、博时裕腾纯债债券今年来净值增长率分别在 352 只同类产品中排名第 6、第 11、第 12、第 26、第 28；博时安弘一年定期开放债券(C 类) 今年来净值增长率在 58 只同类产品中排名第 3；博时信用债券(A/B 类)、博时信用债券(C 类) 今年来净值增长率在 228 只、163 只同类产品中均排名第 11；博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕瑞纯债债券、博时裕创纯债债券、博时双月薪定期支付债券、博时安心收益定期开放债券(C 类)、博时裕盛纯债债券、博时裕恒纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时安丰 18 个月定期开放债券(A 类-LOF)等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。货币型基金中，博时合惠货币(B 类)今年来净值增长率在 296 只同类产品中排名第 8，博时合惠货币(A 类)、博时现金宝货币(B 类)、博时现金宝货币(A 类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 今年来净值增长率同类排名第 3。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF 今年来净值增长率同类排名第 2、博时亚洲票息收益债券、博时亚洲票息收益债券(美元) 今年来净值增长率均在同类排名第 7。

2、其他大事件

2019 年 6 月 20 日，由中国基金报独家主办的第六届中国基金业“英华奖”评选隆重揭晓，博时基金在此次英华奖中揽获 6 项最佳基金经理大奖。其中，博时基金蔡滨拿下“三年期股票投资最佳基金经理”；陈凯杨荣膺“五年期纯债投资最佳基金经理”；何凯则一举揽获“三年期海外固收投资最佳基金经理”和“五年期海外固收投资最佳基金经理”两项桂冠；过钧则再度获得“三年期二级债投资最佳基金经理”和“五年期二级债投资最佳基金经理”称号。

2019 年 4 月 25 日，由上海证券报主办的第十六届“金基金”奖的评选结果如期揭晓，博时基金在评选中一举夺得最具份量的公司奖项“2018 年度金基金·TOP 公司奖”，博时主题行业

(160505) 继去年获得“三年期金基金分红奖”后拿下“2018 年度金基金·十年期偏股混合型基金奖”，同时，博时裕瑞纯债债券(001578) 获得“2018 年度金基金·一年期债券基金奖”。

2019 年 4 月 14 日，第十六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主题行业混合(LOF)(160505) 荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”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。

2019 年 3 月 21 日，由证券时报主办的第六届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在北京隆重举行，同时第十四届中国基金业明星基金奖和中国公募基金首届英华奖也随之揭晓。博时基金凭借出色的资产管理能力和优秀的业绩表现，一举摘得“2018 年度十大明星基金公司”称号。在英华奖的评选中，博时基金在获评“2018 年度最佳电商业务发展基金公司”奖的同时，还凭借博时基金 20 周年品牌传播项目拿下了“2018 年度最佳营销策划案例(最佳综合)”奖。此外，博时慈善基金会公益助学项目获得了“2018 年度最佳社会公益实践案例”。在产品奖方面，助力央企结构转型和改革的博时央企结构调整 ETF 获评英华奖“2018 年度最佳创新基金产品”；博时裕瑞纯债债券获得“2018 年度普通债券型明星基金”奖；博时宏观回报债券则凭借同类可比基金第一的佳绩喜获“2018 年度积极债券型明星基金”奖；博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时双月薪定期支付债券双双以过去五年稳居同类前列的好成绩分别拿下“五年持续回报 QDII 明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”称号；博时裕恒纯债债券则摘得“三年期持续回报普通债券型明星基金”。

2019 年 2 月 25 日，博时国际在“投资洞见与委托”(Insights&Mandate) 举办的第二届专业投资奖评选活动中荣获“2019 年度最佳机构法人投资经理”，并凭借博时国际于 2018 年 5 月 10 日共同成立的“博时—东方红大中华债券基金”获“最佳创新产品”大奖。

2019 年 1 月 23 日，由深圳市福田区金融发展事务署首届举办的“香蜜湖金融科技创新奖”颁奖典礼在深圳福田隆重举行，《博时基金基于大数据技术升级量化投资技术》项目荣获优秀项目奖，博时基金采用金融科技为业务赋能的创新成果获得行业 and 地方政府高度认可。

2019 年 1 月 11 日，中央国债登记结算有限责任公司(以下简称“中债登”) 公布了《2018 年度中债优秀成员评选结果》。凭借在债券市场上的深厚积淀和优异的投研业绩，博时基金获评年度“优秀资产管理人”称号，全行业获此殊荣的基金公司仅有 10 家。

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		
桂征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2017-09-26	-	9.9	桂征辉先生，硕士。2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（2015 年 7 月 21 日一至今）、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金（2015 年 7 月 21 日一至今）、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金（2016 年 5 月 20 日一至今）、博时中证 500 指数增强型证券投资基金（2017 年 9 月 26 日一至今）、博时富时中国 A 股指数证券投资基金（2018 年 6 月 12 日一至今）的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2019 年上半年，A 股市场先扬后抑，近期进入震荡期，最终收于 2980 点左右。风格方面，前期上涨中小盘及创业板涨幅更加明显，而后期调整中，大盘相对抗跌，反转效应明显。行业方面食品饮料、非银金融、农业等行业大幅跑赢市场，传媒及建筑行业表现落后。本基金在严格控制与指数跟踪偏离的基础上，利用数量化手段对组合进行管理，相对基准获得了稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 06 月 30 日，本基金 A 级类基金份额净值为 0.8754 元，份额累计净值为 0.8754 元，本基金 C 级类基金份额净值为 0.8713 元，份额累计净值为 0.8713 元。报告期内，本基金 A 级类基金份额净值增长率为 18.79%，本基金 C 级类基金份额净值增长率为 18.56%，同期业绩基准增长率 17.87%。

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 年下半年，我国经济下行的压力依旧存在，短期内中美贸易摩擦有所缓和，但中长期风险仍在。虽然外部环境的压力可能对出口构成压力，制造业投资也难以显著改善，但是预计减税降费和财政政策的积极有望再下半年支撑消费、制造业投资并明显提振基建投资。货币方面，内外部环境对货币条件边际松动的掣肘在下半年会趋于减弱，转向逆周期调节的概率在增大。当前 A 股市场风险偏好仍有提升的空间，但应密切关注政策走向及贸易战情况。

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、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

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博时中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	27,831,938.31	8,934,631.19
结算备付金		2,280,359.53	399,052.11
存出保证金		2,168,899.92	50,339.17

交易性金融资产	6.4.3.2	178,331,518.16	136,543,967.74
其中：股票投资		178,303,518.16	135,820,219.74
基金投资		-	-
债券投资		28,000.00	723,748.00
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		-	-
应收利息	6.4.3.5	6,733.45	3,489.29
应收股利		-	-
应收申购款		5,583,081.65	253,698.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		216,202,531.02	146,185,178.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
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		4,210,569.56	-
应付赎回款		1,060,978.01	92,741.28
应付管理人报酬		163,105.74	125,006.38
应付托管费		32,621.14	25,001.28
应付销售服务费		15,885.74	9,237.54
应付交易费用	6.4.3.7	268,051.79	140,366.12
应交税费		224.63	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	328,193.15	390,068.04
负债合计		6,079,629.76	782,420.64
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	240,314,909.23	197,411,555.48
未分配利润	6.4.3.10	-30,192,007.97	-52,008,797.64
所有者权益合计		210,122,901.26	145,402,757.84
负债和所有者权益总计		216,202,531.02	146,185,178.48

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 240,314,909.23 份；其中 A 类基金份额净值 0.8754 元，基金份额总额 178,537,815.35 份；C 类基金份额净值 0.8713 元，基金份额总额 61,777,093.88 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		30,695,526.01	-10,728,375.03
1. 利息收入		67,340.15	54,321.07
其中：存款利息收入	6.4.3.11	67,149.93	34,505.50
债券利息收入		190.22	16,140.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,675.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,343,881.37	-774,441.26
其中：股票投资收益	6.4.3.12	15,780,019.62	-1,799,531.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	57,320.32	71,198.53
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	6,679.61	-
股利收益	6.4.3.15	1,499,861.82	953,891.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	13,217,540.67	-10,065,262.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	66,763.82	57,007.88
减：二、费用		2,347,192.54	1,725,706.75
1. 管理人报酬		913,690.78	648,538.89
2. 托管费		182,738.19	129,707.79
3. 销售服务费		78,585.49	334.68
4. 交易费用	6.4.3.18	993,708.26	671,163.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		24.07	0.28
7. 其他费用	6.4.3.19	178,445.75	275,961.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,348,333.47	-12,454,081.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,348,333.47	-12,454,081.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	197,411,555.48	-52,008,797.64	145,402,757.84
二、本期经营活动产生的	-	28,348,333.47	28,348,333.47

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）	42,903,353.75	-6,531,543.80	36,371,809.95
其中：1. 基金申购款	165,010,136.94	-18,718,753.09	146,291,383.85
2. 基金赎回款	-122,106,783.19	12,187,209.29	-109,919,573.90
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）	240,314,909.23	-30,192,007.97	210,122,901.26
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	157,963,010.16	-1,684,541.90	156,278,468.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,454,081.78	-12,454,081.78
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）	-24,099,404.29	-1,537,537.72	-25,636,942.01
其中：1. 基金申购款	64,351,073.84	-3,270,820.83	61,080,253.01
2. 基金赎回款	-88,450,478.13	1,733,283.11	-86,717,195.02
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）	133,863,605.87	-15,676,161.40	118,187,444.47

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。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	27,831,938.31
定期存款	-
其他存款	-
合计	27,831,938.31

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	180,011,065.01	178,303,518.16	-1,707,546.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	28,000.00	28,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	28,000.00	28,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	180,039,065.01	178,331,518.16	-1,707,546.85

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
6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,642.19
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,073.83
应收债券利息	3.13
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	-
其他	14.30
合计	6,733.45

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
----	-----

	2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	268,051.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	268,051.79

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	879.69
其他应付款	1,320.00
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	275,993.46
合计	328,193.15

6.4.3.9 实收基金

博时中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	160,969,848.96	160,969,848.96
本期申购	96,586,653.82	96,586,653.82
本期赎回（以“-”号填列）	-79,018,687.43	-79,018,687.43
本期末	178,537,815.35	178,537,815.35

博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	36,441,706.52	36,441,706.52
本期申购	68,423,483.12	68,423,483.12
本期赎回（以“-”号填列）	-43,088,095.76	-43,088,095.76
本期末	61,777,093.88	61,777,093.88

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

博时中证 500 指数增强 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	-22,166,996.27	-20,180,848.93	-42,347,845.20
本期利润	12,077,417.99	12,062,847.33	24,140,265.32
本期基金份额交易产生的变动数	-1,394,482.03	-2,639,207.14	-4,033,689.17
其中：基金申购款	-9,525,568.90	-2,201,712.38	-11,727,281.28
基金赎回款	8,131,086.87	-437,494.76	7,693,592.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,484,060.31	-10,757,208.74	-22,241,269.05

博时中证 500 指数增强 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	-5,096,794.16	-4,564,158.28	-9,660,952.44
本期利润	3,053,374.81	1,154,693.34	4,208,068.15
本期基金份额交易产生的变动数	-2,184,269.26	-313,585.37	-2,497,854.63
其中：基金申购款	-6,495,396.15	-496,075.66	-6,991,471.81
基金赎回款	4,311,126.89	182,490.29	4,493,617.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,227,688.61	-3,723,050.31	-7,950,738.92

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	59,304.63
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	7,073.17
其他	772.13
合计	67,149.93

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	372,802,675.57
减：卖出股票成本总额	357,022,655.95
买卖股票差价收入	15,780,019.62

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	770,693.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	712,000.00
减：应收利息总额	1,373.28
买卖债券差价收入	57,320.32

6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货	6,679.61

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,499,861.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,499,861.82

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,695,620.67
——股票投资	12,707,368.67
——债券投资	-11,748.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	521,920.00
——权证投资	-
——衍生工具	521,920.00
4. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	13,217,540.67

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	58,179.61
基金转换费收入	8,584.21
合计	66,763.82

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. 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。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	993,708.26
银行间市场交易费用	-
合计	993,708.26

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	56,157.67

银行汇划费	2,452.29
指数使用费	100,000.00
合计	178,445.75

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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	539,883,387.81	71.38%	-	-

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 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	770,693.60	100.00%	-	-
------	------------	---------	---	---

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	394,808.08	71.38%	159,960.87	59.68%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	913,690.78	648,538.89
其中：支付销售机构的客户维护费	211,892.23	98,183.25

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	182,738.19	129,707.79

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 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 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		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	55,427.00	55,427.00
合计	-	55,427.00	55,427.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	334.68	334.68
合计	-	334.68	334.68

注：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：

$$C \text{ 类日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 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

无。

6.4.6.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	27,831,938.31	59,304.63	10,262,240.68	29,978.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股未上市	3.46	3.46	9,789.00	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股未上市	14.85	14.85	1,556.00	23,106.60	23,106.60	-
6.4.8.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113027	华钰转债	2019-06-14	2019-07-10	配债未上市	100.00	100.00	280.00	28,000.00	28,000.00	-

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。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于

0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%，实现对中证 500 指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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 2019 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投资占基金资产净值的比例为 0.01% (于 2018 年 12 月 31 日：0.50%)。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	28,000.00	-
未评级	-	-
合计	28,000.00	-

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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 2019 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 2019 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、存出保证金及债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	27,831,938.31	-	-	-	27,831,938.31

结算备付金	2,280,359.53	-	-	-	2,280,359.53
存出保证金	2,168,899.92	-	-	-	2,168,899.92
交易性金融资产	-	-	28,000.00	178,303,518.16	178,331,518.16
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	6,733.45	6,733.45
应收申购款	-	-	-	5,583,081.65	5,583,081.65
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,281,197.76	-	28,000.00	183,893,333.26	216,202,531.02
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,060,978.01	1,060,978.01
应付证券清算款	-	-	-	4,210,569.56	4,210,569.56
应付管理人报酬	-	-	-	163,105.74	163,105.74
应付托管费	-	-	-	32,621.14	32,621.14
应付销售服务费	-	-	-	15,885.74	15,885.74
应交税费	-	-	-	224.63	224.63
应付交易费用	-	-	-	268,051.79	268,051.79
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	328,193.15	328,193.15
负债总计	-	-	-	6,079,629.76	6,079,629.76
利率敏感度缺口	32,281,197.76	-	28,000.00	177,813,703.50	210,122,901.26
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,934,631.19	-	-	-	8,934,631.19
结算备付金	399,052.11	-	-	-	399,052.11
存出保证金	50,339.17	-	-	-	50,339.17
交易性金融资产	-	-	723,748.00	135,820,219.74	136,543,967.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,489.29	3,489.29
应收申购款	-	-	-	253,698.98	253,698.98
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,384,022.47	-	723,748.00	136,077,408.01	146,185,178.48
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	92,741.28	92,741.28
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	125,006.38	125,006.38
应付托管费	-	-	-	25,001.28	25,001.28
应付销售服务费	-	-	-	9,237.54	9,237.54
应交税费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	140,366.12	140,366.12
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	390,068.04	390,068.04
负债总计	-	-	-	782,420.64	782,420.64
利率敏感度缺口	9,384,022.47	-	723,748.00	135,294,987.37	145,402,757.84

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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值比例为 0.01%（2018 年 12 月 31 日：0.5%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 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。

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化。投资组合的股票选择将以指数成份股及备选成份股为主，并根据博时数量化模型对股票的回报预测，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。同时运用债券投资、股指期货投资、权证投资及融资及转融通证券出借业务投资策略，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 80%。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	178,303,518.16	84.86	135,820,219.74	93.41
交易性金融资产—债券投资	28,000.00	0.01	723,748.00	0.50
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	178,331,518.16	84.87	136,543,967.74	93.91

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上升 5%	增加约 884	增加约 710
	中证 500 指数下降 5%	减少约 884	减少约 710

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 2019 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 178,246,541.62 元，属于第二层次的余额为 84,976.54 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 136,493,821.94 元，第二层次 50,145.80 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 2019 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(2018 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	178,303,518.16	82.47
	其中：股票	178,303,518.16	82.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,000.00	0.01
	其中：债券	28,000.00	0.01
	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	30,112,297.84	13.93
8	其他各项资产	7,758,715.02	3.59
9	合计	216,202,531.02	100.00

7.2 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	4,271,299.61	2.03
B	采矿业	4,795,245.30	2.28
C	制造业	101,192,993.41	48.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,348,139.00	3.02
E	建筑业	3,046,143.76	1.45
F	批发和零售业	10,915,700.40	5.19
G	交通运输、仓储和邮政业	4,935,189.00	2.35
H	住宿和餐饮业	133,052.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,460,775.74	7.36
J	金融业	6,998,614.94	3.33
K	房地产业	8,683,205.80	4.13
L	租赁和商务服务业	6,677,221.60	3.18
M	科学研究和技术服务业	256,188.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,053,932.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	2,936,838.60	1.40
S	综合	598,979.00	0.29
	合计	178,303,518.16	84.86

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600325	华发股份	350,100	2,734,281.00	1.30
2	000686	东北证券	308,500	2,717,885.00	1.29
3	002299	圣农发展	107,300	2,716,836.00	1.29
4	600376	首开股份	297,600	2,657,568.00	1.26
5	600166	福田汽车	1,112,300	2,636,151.00	1.25
6	600282	南钢股份	731,300	2,559,550.00	1.22
7	600755	厦门国贸	291,100	2,512,193.00	1.20
8	000027	深圳能源	400,100	2,480,620.00	1.18
9	601717	郑煤机	421,000	2,403,910.00	1.14
10	000878	云南铜业	224,600	2,387,498.00	1.14
11	300058	蓝色光标	524,900	2,241,323.00	1.07
12	002340	格林美	468,300	2,205,693.00	1.05
13	000543	皖能电力	460,100	2,167,071.00	1.03
14	000425	徐工机械	482,640	2,152,574.40	1.02
15	600170	上海建工	570,051	2,143,391.76	1.02
16	600699	均胜电子	100,200	2,140,272.00	1.02
17	002707	众信旅游	313,700	1,904,159.00	0.91
18	000401	冀东水泥	106,400	1,873,704.00	0.89
19	000738	航发控制	139,700	1,871,980.00	0.89
20	600839	四川长虹	621,700	1,834,015.00	0.87
21	600466	蓝光发展	288,040	1,791,608.80	0.85
22	601000	唐山港	619,200	1,702,800.00	0.81
23	002064	华峰氨纶	303,300	1,522,566.00	0.72
24	601001	大同煤业	331,900	1,516,783.00	0.72
25	000600	建投能源	217,600	1,457,920.00	0.69
26	000501	鄂武商 A	135,300	1,454,475.00	0.69
27	601928	凤凰传媒	179,800	1,450,986.00	0.69
28	002028	思源电气	144,800	1,442,208.00	0.69
29	600582	天地科技	402,000	1,386,900.00	0.66
30	600971	恒源煤电	232,580	1,360,593.00	0.65
31	002440	闰土股份	108,700	1,354,402.00	0.64
32	600073	上海梅林	146,300	1,345,960.00	0.64
33	600026	中远海能	201,900	1,310,331.00	0.62
34	600312	平高电气	169,500	1,303,455.00	0.62
35	600751	海航科技	405,500	1,289,490.00	0.61
36	000400	许继电气	139,800	1,266,588.00	0.60
37	000987	越秀金控	138,800	1,251,976.00	0.60
38	600779	水井坊	24,000	1,219,680.00	0.58
39	000778	新兴铸管	272,700	1,210,788.00	0.58
40	002489	浙江永强	360,200	1,203,068.00	0.57
41	002405	四维图新	71,300	1,147,930.00	0.55
42	300146	汤臣倍健	58,600	1,136,840.00	0.54
43	002605	姚记扑克	108,200	1,136,100.00	0.54
44	002701	奥瑞金	240,700	1,124,069.00	0.53

45	603369	今世缘	40,200	1,121,178.00	0.53
46	600499	科达洁能	249,300	1,091,934.00	0.52
47	600801	华新水泥	53,760	1,088,640.00	0.52
48	000547	航天发展	111,000	1,061,160.00	0.51
49	002250	联化科技	95,500	1,059,095.00	0.50
50	002400	省广集团	343,300	1,023,034.00	0.49
51	600497	驰宏锌锗	200,900	1,020,572.00	0.49
52	600125	铁龙物流	156,100	1,006,845.00	0.48
53	300575	中旗股份	35,040	1,000,742.40	0.48
54	600757	长江传媒	142,000	967,020.00	0.46
55	603444	吉比特	4,500	944,820.00	0.45
56	002004	华邦健康	190,600	926,316.00	0.44
57	002049	紫光国微	19,800	873,378.00	0.42
58	603225	新凤鸣	69,800	871,802.00	0.41
59	002129	中环股份	88,900	867,664.00	0.41
60	300253	卫宁健康	61,000	864,980.00	0.41
61	002746	仙坛股份	55,763	862,653.61	0.41
62	000877	天山股份	73,100	849,422.00	0.40
63	002444	巨星科技	83,100	829,338.00	0.39
64	600536	中国软件	15,400	826,518.00	0.39
65	000997	新大陆	48,400	817,476.00	0.39
66	000960	锡业股份	73,100	816,527.00	0.39
67	002463	沪电股份	59,600	811,752.00	0.39
68	600000	浦发银行	69,300	809,424.00	0.39
69	000750	国海证券	159,700	803,291.00	0.38
70	002544	杰赛科技	60,700	789,100.00	0.38
71	002048	宁波华翔	72,700	786,614.00	0.37
72	000066	中国长城	75,200	773,056.00	0.37
73	000061	农产品	142,200	770,724.00	0.37
74	600565	迪马股份	206,300	769,499.00	0.37
75	601163	三角轮胎	59,800	749,892.00	0.36
76	600745	闻泰科技	22,300	740,806.00	0.35
77	000921	海信家电	59,300	740,064.00	0.35
78	002818	富森美	57,520	737,981.60	0.35
79	002157	正邦科技	44,100	734,706.00	0.35
80	002439	启明星辰	27,100	728,990.00	0.35
81	600096	云天化	121,900	726,524.00	0.35
82	600763	通策医疗	8,200	726,438.00	0.35
83	002268	卫士通	29,200	713,940.00	0.34
84	600260	凯乐科技	35,700	713,286.00	0.34
85	000999	华润三九	24,100	707,094.00	0.34
86	600787	中储股份	122,300	700,779.00	0.33
87	300418	昆仑万维	54,300	698,841.00	0.33
88	600633	浙数文化	74,300	694,705.00	0.33
89	002358	森源电气	68,400	694,260.00	0.33
90	600718	东软集团	53,900	690,998.00	0.33
91	600183	生益科技	45,500	684,775.00	0.33
92	000060	中金岭南	144,300	676,767.00	0.32
93	600388	龙净环保	54,500	675,255.00	0.32

94	600580	卧龙电驱	80,000	672,800.00	0.32
95	002152	广电运通	96,850	663,422.50	0.32
96	600694	大商股份	23,000	641,930.00	0.31
97	300383	光环新网	37,900	635,583.00	0.30
98	000528	柳工	95,060	633,099.60	0.30
99	600873	梅花生物	129,500	620,305.00	0.30
100	002821	凯莱英	6,300	617,904.00	0.29
101	000623	吉林敖东	36,700	601,513.00	0.29
102	000009	中国宝安	104,900	598,979.00	0.29
103	300088	长信科技	117,500	594,550.00	0.28
104	002373	千方科技	34,500	589,950.00	0.28
105	000712	锦龙股份	44,800	575,232.00	0.27
106	600460	士兰微	34,500	572,700.00	0.27
107	601002	晋亿实业	81,000	571,860.00	0.27
108	600572	康恩贝	88,800	568,320.00	0.27
109	600521	华海药业	40,300	568,230.00	0.27
110	002371	北方华创	8,200	567,850.00	0.27
111	600584	长电科技	42,900	551,265.00	0.26
112	000988	华工科技	34,700	548,954.00	0.26
113	300168	万达信息	41,600	539,552.00	0.26
114	600079	人福医药	51,100	536,550.00	0.26
115	000028	国药一致	12,800	535,424.00	0.25
116	000513	丽珠集团	16,000	531,680.00	0.25
117	300159	新研股份	106,700	531,366.00	0.25
118	002217	合力泰	95,100	525,903.00	0.25
119	002810	山东赫达	37,000	521,700.00	0.25
120	300166	东方国信	42,400	521,096.00	0.25
121	002916	深南电路	5,080	517,753.60	0.25
122	000951	中国重汽	32,200	516,810.00	0.25
123	600845	宝信软件	18,070	514,633.60	0.24
124	300002	神州泰岳	128,356	510,856.88	0.24
125	002273	水晶光电	43,700	506,046.00	0.24
126	600500	中化国际	67,400	503,478.00	0.24
127	000807	云铝股份	106,800	500,892.00	0.24
128	600380	健康元	57,900	500,835.00	0.24
129	601179	中国西电	134,900	499,130.00	0.24
130	603939	益丰药房	7,100	496,929.00	0.24
131	601811	新华文轩	40,600	495,726.00	0.24
132	600171	上海贝岭	30,300	492,375.00	0.23
133	300274	阳光电源	50,500	472,175.00	0.22
134	000969	安泰科技	55,000	464,200.00	0.22
135	002019	亿帆医药	37,600	460,600.00	0.22
136	600161	天坛生物	18,200	459,550.00	0.22
137	300115	长盈精密	43,500	456,315.00	0.22
138	600875	东方电气	42,500	451,350.00	0.21
139	300207	欣旺达	39,100	450,432.00	0.21
140	000970	中科三环	39,600	449,460.00	0.21
141	600557	康缘药业	30,000	445,800.00	0.21
142	002517	恺英网络	137,300	437,987.00	0.21

143	601231	环旭电子	34,500	415,725.00	0.20
144	002399	海普瑞	19,700	413,503.00	0.20
145	002589	瑞康医药	53,300	404,547.00	0.19
146	002541	鸿路钢构	50,450	399,059.50	0.19
147	002038	双鹭药业	16,800	395,808.00	0.19
148	002191	劲嘉股份	31,700	393,397.00	0.19
149	600511	国药股份	17,100	392,787.00	0.19
150	000417	合肥百货	75,100	389,769.00	0.19
151	300055	万邦达	54,100	385,733.00	0.18
152	300010	立思辰	40,900	384,051.00	0.18
153	002368	太极股份	12,600	381,780.00	0.18
154	002635	安洁科技	28,200	380,418.00	0.18
155	600056	中国医药	27,700	373,673.00	0.18
156	601666	平煤股份	87,600	366,168.00	0.17
157	300009	安科生物	22,800	362,520.00	0.17
158	002317	众生药业	42,500	361,675.00	0.17
159	600525	长园集团	57,100	360,872.00	0.17
160	603878	武进不锈	33,400	359,050.00	0.17
161	002458	益生股份	18,100	353,131.00	0.17
162	600827	百联股份	35,800	351,198.00	0.17
163	000860	顺鑫农业	7,490	349,408.50	0.17
164	600804	鹏博士	46,400	348,928.00	0.17
165	002478	常宝股份	57,500	347,875.00	0.17
166	600993	马应龙	19,700	347,705.00	0.17
167	000727	华东科技	164,200	343,178.00	0.16
168	603198	迎驾贡酒	19,000	340,290.00	0.16
169	002280	联络互动	92,700	339,282.00	0.16
170	002234	民和股份	12,100	338,679.00	0.16
171	002797	第一创业	53,200	337,288.00	0.16
172	002030	达安基因	31,200	334,776.00	0.16
173	002332	仙琚制药	48,700	329,212.00	0.16
174	603118	共进股份	35,500	328,730.00	0.16
175	000021	深科技	39,800	323,574.00	0.15
176	300244	迪安诊断	18,700	317,526.00	0.15
177	002390	信邦制药	58,900	310,403.00	0.15
178	002603	以岭药业	26,800	310,344.00	0.15
179	300287	飞利信	78,000	309,660.00	0.15
180	600062	华润双鹤	24,160	304,657.60	0.14
181	002815	崇达技术	19,300	300,887.00	0.14
182	002056	横店东磁	39,400	299,440.00	0.14
183	601311	骆驼股份	27,200	295,120.00	0.14
184	600064	南京高科	27,500	294,525.00	0.14
185	603228	景旺电子	7,320	292,873.20	0.14
186	002302	西部建设	26,000	289,640.00	0.14
187	600597	光明乳业	26,800	288,100.00	0.14
188	300026	红日药业	82,100	283,245.00	0.13
189	300037	新宙邦	13,400	279,256.00	0.13
190	601611	中国核建	35,600	276,968.00	0.13
191	000932	华菱钢铁	56,780	270,840.60	0.13

192	600348	阳泉煤业	46,200	268,422.00	0.13
193	603659	璞泰来	5,700	268,014.00	0.13
194	600329	中新药业	18,700	267,223.00	0.13
195	600478	科力远	47,800	267,202.00	0.13
196	002505	大康农业	135,000	265,950.00	0.13
197	601615	明阳智能	24,100	261,244.00	0.12
198	603883	老百姓	4,400	257,312.00	0.12
199	300113	顺网科技	16,400	257,152.00	0.12
200	600031	三一重工	19,600	256,368.00	0.12
201	600645	中源协和	14,800	256,188.00	0.12
202	603233	大参林	5,590	251,550.00	0.12
203	600127	金健米业	49,000	244,020.00	0.12
204	002221	东华能源	28,200	242,802.00	0.12
205	600008	首创股份	68,900	242,528.00	0.12
206	600216	浙江医药	23,500	240,640.00	0.11
207	002249	大洋电机	53,800	233,492.00	0.11
208	600416	湘电股份	37,700	226,954.00	0.11
209	600405	动力源	45,000	224,550.00	0.11
210	600884	杉杉股份	20,700	220,455.00	0.10
211	002637	赞宇科技	31,000	217,310.00	0.10
212	002512	达华智能	47,700	215,604.00	0.10
213	600115	东方航空	34,200	214,434.00	0.10
214	000829	天音控股	36,700	213,594.00	0.10
215	002110	三钢闽光	22,950	213,435.00	0.10
216	600901	江苏租赁	35,000	213,150.00	0.10
217	002281	光迅科技	8,000	211,840.00	0.10
218	600563	法拉电子	5,000	205,850.00	0.10
219	000517	荣安地产	66,800	205,076.00	0.10
220	300082	奥克股份	31,100	204,949.00	0.10
221	600859	王府井	13,300	202,027.00	0.10
222	300221	银禧科技	29,200	188,340.00	0.09
223	603328	依顿电子	18,232	187,242.64	0.09
224	600271	航天信息	8,100	186,705.00	0.09
225	603396	金辰股份	8,400	184,716.00	0.09
226	600418	江淮汽车	33,900	174,924.00	0.08
227	000977	浪潮信息	7,100	169,406.00	0.08
228	603129	春风动力	8,100	168,723.00	0.08
229	600862	中航高科	18,300	164,517.00	0.08
230	600643	爱建集团	16,600	159,028.00	0.08
231	300690	双一科技	7,000	156,800.00	0.07
232	603026	石大胜华	4,800	145,248.00	0.07
233	603712	七一二	6,700	142,241.00	0.07
234	300502	新易盛	5,800	142,216.00	0.07
235	600287	江苏舜天	20,800	137,280.00	0.07
236	000708	大冶特钢	10,700	135,890.00	0.06
237	600258	首旅酒店	7,400	133,052.00	0.06
238	300014	亿纬锂能	4,100	124,886.00	0.06
239	600968	海油发展	34,886	123,845.30	0.06
240	600750	江中药业	9,425	122,619.25	0.06

241	600606	绿地控股	17,000	116,110.00	0.06
242	601699	潞安环能	14,000	111,160.00	0.05
243	000498	山东路桥	20,900	110,979.00	0.05
244	002462	嘉事堂	7,200	108,000.00	0.05
245	600587	新华医疗	6,700	106,865.00	0.05
246	002099	海翔药业	14,800	105,080.00	0.05
247	002318	久立特材	14,100	103,071.00	0.05
248	600657	信达地产	24,900	102,588.00	0.05
249	300389	艾比森	8,000	99,200.00	0.05
250	601318	中国平安	1,100	97,471.00	0.05
251	603160	汇顶科技	700	97,160.00	0.05
252	600050	中国联通	15,700	96,712.00	0.05
253	603368	柳药股份	2,800	92,064.00	0.04
254	300020	银江股份	11,400	91,884.00	0.04
255	000963	华东医药	3,340	86,706.40	0.04
256	000733	振华科技	5,200	85,696.00	0.04
257	600570	恒生电子	1,230	83,824.50	0.04
258	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
259	600535	天士力	4,700	77,785.00	0.04
260	002454	松芝股份	14,700	76,293.00	0.04
261	300003	乐普医疗	3,300	75,966.00	0.04
262	600366	宁波韵升	8,200	75,276.00	0.04
263	603045	福达合金	4,000	74,360.00	0.04
264	601668	中国建筑	12,900	74,175.00	0.04
265	000049	德赛电池	2,800	72,884.00	0.03
266	601607	上海医药	3,800	68,970.00	0.03
267	600594	益佰制药	12,800	67,200.00	0.03
268	300007	汉威科技	5,200	65,988.00	0.03
269	002020	京新药业	5,600	64,512.00	0.03
270	600129	太极集团	6,100	64,233.00	0.03
271	002262	恩华药业	5,700	61,503.00	0.03
272	000100	TCL 集团	18,200	60,606.00	0.03
273	300296	利亚德	7,400	57,942.00	0.03
274	600169	太原重工	21,600	57,672.00	0.03
275	600571	信雅达	6,000	55,920.00	0.03
276	600820	隧道股份	8,700	54,897.00	0.03
277	002655	共达电声	6,900	54,786.00	0.03
278	600435	北方导航	6,000	53,940.00	0.03
279	002093	国脉科技	5,700	52,953.00	0.03
280	603508	思维列控	800	52,064.00	0.02
281	300206	理邦仪器	7,700	51,821.00	0.02
282	000555	神州信息	4,500	51,210.00	0.02
283	300702	天宇股份	1,400	50,456.00	0.02
284	600713	南京医药	11,000	49,940.00	0.02
285	000050	深天马 A	3,700	49,728.00	0.02
286	002381	双箭股份	6,200	49,290.00	0.02
287	600332	白云山	1,200	49,164.00	0.02
288	603367	辰欣药业	3,400	49,130.00	0.02
289	002130	沃尔核材	9,400	48,974.00	0.02

290	300241	瑞丰光电	8,000	47,520.00	0.02
291	300083	劲胜智能	15,700	46,943.00	0.02
292	002308	威创股份	8,800	43,824.00	0.02
293	002236	大华股份	2,900	42,108.00	0.02
294	300657	弘信电子	1,790	40,812.00	0.02
295	000756	新华制药	5,600	40,040.00	0.02
296	002241	歌尔股份	4,500	40,005.00	0.02
297	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
298	000823	超声电子	4,200	39,354.00	0.02
299	002841	视源股份	500	38,755.00	0.02
300	300433	蓝思科技	5,400	37,638.00	0.02
301	600422	昆药集团	3,100	35,743.00	0.02
302	300396	迪瑞医疗	2,000	34,760.00	0.02
303	600080	金花股份	5,300	34,662.00	0.02
304	603863	松炆资源	1,475	34,043.00	0.02
305	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
306	000989	九芝堂	3,800	33,820.00	0.02
307	000661	长春高新	100	33,800.00	0.02
308	000930	中粮生化	4,400	33,088.00	0.02
309	002131	利欧股份	17,200	32,852.00	0.02
310	300497	富祥股份	2,180	32,721.80	0.02
311	002724	海洋王	5,500	32,120.00	0.02
312	002090	金智科技	2,700	31,860.00	0.02
313	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
314	600211	西藏药业	1,000	31,660.00	0.02
315	300075	数字政通	2,800	31,360.00	0.01
316	000411	英特集团	2,400	31,176.00	0.01
317	600351	亚宝药业	4,900	30,135.00	0.01
318	002407	多氟多	2,500	29,600.00	0.01
319	300016	北陆药业	3,300	28,644.00	0.01
320	002219	恒康医疗	9,400	28,482.00	0.01
321	300157	恒泰艾普	5,400	27,702.00	0.01
322	300006	莱美药业	5,900	27,553.00	0.01
323	002475	立讯精密	1,100	27,269.00	0.01
324	002913	奥士康	600	27,216.00	0.01
325	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
326	002649	博彦科技	3,000	26,730.00	0.01
327	002230	科大讯飞	800	26,592.00	0.01
328	600781	辅仁药业	2,400	26,472.00	0.01
329	300119	瑞普生物	2,300	25,530.00	0.01
330	300508	维宏股份	800	25,032.00	0.01
331	002189	中光学	1,100	25,014.00	0.01
332	002198	嘉应制药	3,500	24,080.00	0.01
333	000725	京东方 A	6,900	23,736.00	0.01
334	300465	高伟达	3,000	23,220.00	0.01
335	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
336	000739	普洛药业	2,300	22,609.00	0.01
337	002036	联创电子	2,470	22,600.50	0.01
338	002380	科远智慧	1,600	22,544.00	0.01

339	002546	新联电子	4,900	22,442.00	0.01
340	002654	万润科技	5,200	21,476.00	0.01
341	300468	四方精创	1,300	21,177.00	0.01
342	000701	厦门信达	3,400	20,876.00	0.01
343	600361	华联综超	5,000	20,600.00	0.01
344	002197	证通电子	2,600	19,708.00	0.01
345	002869	金溢科技	500	19,395.00	0.01
346	002288	超华科技	4,300	19,350.00	0.01
347	000850	华茂股份	4,100	18,368.00	0.01
348	300659	中孚信息	500	18,175.00	0.01
349	600252	中恒集团	6,000	17,580.00	0.01
350	000650	仁和药业	2,400	17,304.00	0.01
351	002727	一心堂	600	17,094.00	0.01
352	300053	欧比特	1,700	16,966.00	0.01
353	300181	佐力药业	2,900	16,965.00	0.01
354	600613	神奇制药	2,100	16,653.00	0.01
355	600222	太龙药业	3,500	16,485.00	0.01
356	002527	新时达	3,100	16,461.00	0.01
357	002750	龙津药业	1,400	16,226.00	0.01
358	000790	泰合健康	3,600	15,300.00	0.01
359	300130	新国都	900	14,310.00	0.01
360	002657	中科金财	800	13,920.00	0.01
361	300277	海联讯	2,000	13,880.00	0.01
362	600420	现代制药	1,500	13,380.00	0.01
363	000560	我爱我家	2,500	11,950.00	0.01
364	002788	鹭燕医药	1,500	11,940.00	0.01
365	300352	北信源	1,900	11,723.00	0.01
366	300131	英唐智控	2,200	11,660.00	0.01
367	300496	中科创达	400	11,632.00	0.01
368	002737	葵花药业	700	10,773.00	0.01
369	002518	科士达	1,200	10,752.00	0.01
370	600866	星湖科技	1,800	10,602.00	0.01
371	000590	启迪古汉	900	10,359.00	0.00
372	300110	华仁药业	2,200	10,076.00	0.00
373	002173	创新医疗	1,400	9,968.00	0.00
374	002052	同洲电子	2,300	9,936.00	0.00
375	600203	福日电子	1,600	9,712.00	0.00
376	300624	万兴科技	200	9,646.00	0.00
377	300691	联合光电	580	9,535.20	0.00
378	300128	锦富技术	2,300	9,108.00	0.00
379	002177	御银股份	1,500	8,955.00	0.00
380	300229	拓尔思	800	8,432.00	0.00
381	300232	洲明科技	800	7,744.00	0.00
382	603660	苏州科达	420	6,547.80	0.00
383	300446	乐凯新材	300	6,396.00	0.00
384	601100	恒立液压	200	6,276.00	0.00
385	300725	药石科技	100	6,233.00	0.00
386	002847	盐津铺子	200	6,172.00	0.00
387	300479	神思电子	400	5,984.00	0.00

388	600728	佳都科技	600	5,910.00	0.00
389	300630	普利制药	100	5,762.00	0.00
390	600479	千金药业	600	5,592.00	0.00
391	300248	新开普	700	5,460.00	0.00
392	300573	兴齐眼药	100	5,045.00	0.00
393	002139	拓邦股份	800	4,640.00	0.00
394	300634	彩讯股份	200	4,334.00	0.00
395	300290	荣科科技	500	3,580.00	0.00
396	300561	汇金科技	200	3,294.00	0.00
397	002456	欧菲光	400	3,136.00	0.00
398	300399	京天利	200	2,910.00	0.00
399	603998	方盛制药	400	2,900.00	0.00
400	300545	联得装备	100	2,383.00	0.00
401	002587	奥拓电子	400	2,268.00	0.00
402	300147	香雪制药	300	1,971.00	0.00
403	300705	九典制药	100	1,117.00	0.00
404	600110	诺德股份	200	886.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000060	中金岭南	3,659,410.20	2.52
2	000543	皖能电力	3,215,150.00	2.21
3	002299	圣农发展	3,191,527.00	2.19
4	000513	丽珠集团	3,141,794.45	2.16
5	600376	首开股份	3,120,628.97	2.15
6	600282	南钢股份	2,917,969.00	2.01
7	000686	东北证券	2,882,632.00	1.98
8	600839	四川长虹	2,780,603.00	1.91
9	300058	蓝色光标	2,778,968.60	1.91
10	002004	华邦健康	2,734,686.00	1.88
11	600260	凯乐科技	2,709,575.11	1.86
12	600166	福田汽车	2,659,822.00	1.83
13	600325	华发股份	2,611,956.00	1.80
14	000027	深圳能源	2,536,154.00	1.74
15	600699	均胜电子	2,525,178.00	1.74
16	000878	云南铜业	2,514,944.32	1.73
17	600971	恒源煤电	2,495,302.47	1.72
18	601000	唐山港	2,462,297.00	1.69
19	000425	徐工机械	2,410,993.60	1.66
20	600565	迪马股份	2,381,799.00	1.64

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。

7.4.2 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	600426	华鲁恒升	4,062,784.15	2.79
2	000060	中金岭南	3,935,082.00	2.71
3	600565	迪马股份	3,499,562.83	2.41
4	600623	华谊集团	3,492,527.23	2.40
5	600737	中粮糖业	3,407,368.66	2.34
6	600875	东方电气	3,390,069.64	2.33
7	600782	新钢股份	3,308,146.27	2.28
8	600260	凯乐科技	3,190,623.02	2.19
9	600366	宁波韵升	3,112,476.54	2.14
10	002316	亚联发展	3,092,252.80	2.13
11	600567	山鹰纸业	3,074,918.00	2.11
12	600028	中国石化	3,067,734.00	2.11
13	600582	天地科技	3,007,266.00	2.07
14	000513	丽珠集团	2,999,173.70	2.06
15	601168	西部矿业	2,987,077.27	2.05
16	000009	中国宝安	2,981,548.52	2.05
17	600808	马钢股份	2,930,826.00	2.02
18	000830	鲁西化工	2,909,813.00	2.00
19	000999	华润三九	2,886,773.19	1.99
20	000656	金科股份	2,856,226.00	1.96

注：本项的“卖出金额”均按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	386,798,585.70
卖出股票的收入（成交）总额	372,802,675.57

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	28,000.00	0.01
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	28,000.00	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113027	华钰转债	280	28,000.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1907	IC1907	18.00	17,663,040.00	521,920.00	-
公允价值变动总额合计					521,920.00
股指期货投资本期收益					6,880.00
股指期货投资本期公允价值变动					521,920.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,168,899.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,733.45
5	应收申购款	5,583,081.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,758,715.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
博时中证 500 指数增强 A	8,574	20,823.16	3,751,052.83	2.10%	174,786,762.52	97.90%
博时中证 500 指数增强 C	2,509	24,622.20	32,048,234.69	51.88%	29,728,859.19	48.12%
合计	11,083	21,683.20	35,799,287.52	14.90%	204,515,621.71	85.10%

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	博时中证 500 指数增强 A	2,321,157.11	1.30%
	博时中证 500 指数增强 C	87,901.20	0.14%
	合计	2,409,058.31	1.00%

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	博时中证 500 指数增强 A	>100
	博时中证 500 指数增强 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时中证 500 指数增强 A	-
	博时中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

注：本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 26 日）基金份额总额	383,128,088.40	-
本报告期期初基金份额总额	160,969,848.96	36,441,706.52
本报告期基金总申购份额	96,586,653.82	68,423,483.12
减：本报告期基金总赎回份额	79,018,687.43	43,088,095.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	178,537,815.35	61,777,093.88

§ 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

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	539,883,387.81	71.38%	394,808.08	71.38%	新增 2 个
广发证券	1	62,016,513.23	8.20%	45,352.43	8.20%	新增 1 个
平安证券	1	60,681,845.61	8.02%	44,367.25	8.02%	新增 1 个
方正证券	1	56,404,077.48	7.46%	41,250.48	7.46%	-
第一创业	1	25,125,032.25	3.32%	18,371.24	3.32%	新增 1 个
海通证券	2	12,283,990.67	1.62%	8,983.31	1.62%	-

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；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	770,693.60	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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	关于博时旗下部分开放式基金增加中信建投证券为代销机构的公告	证券日报	2019-06-25
2	关于博时旗下部分开放式基金增加浦领基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-05-29
3	关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-05-22
4	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-05-16
5	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（正文）	证券日报	2019-05-10
6	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（摘要）	证券日报	2019-05-10
7	关于博时旗下部分开放式基金增加贵州银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-05-08
8	关于博时旗下部分开放式基金增加郑州银行股份有限公司为代销机构的公告	证券日报	2019-04-29
9	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券日报	2019-04-22
10	关于博时旗下部分开放式基金增加包商银行股份有限公司为代销机构的公告	证券日报	2019-04-18
11	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	证券日报	2019-03-29
12	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告（正文）	证券日报	2019-03-29
13	关于博时旗下部分开放式基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-03-25
14	关于博时旗下部分基金增加浙江民泰商业银行为代销机构的公告	证券日报	2019-03-14
15	关于博时中证 500 指数增强基金增加爱建证券为代销机构的公告	证券日报	2019-03-06
16	关于博时旗下部分开放式基金增加广发银行	证券日报	2019-02-26

	股份有限公司为代销机构的公告		
17	关于博时旗下部分开放式基金增加四川天府银行股份有限公司为代销机构的公告	证券日报	2019-02-25
18	关于博时旗下部分开放式基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-02-21
19	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-02-15
20	关于博时旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-02-14
21	关于博时旗下部分开放式基金增加部分券商为代销机构的公告	证券日报	2019-02-01
22	关于博时旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-01-29
23	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券日报	2019-01-19
24	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报	2019-01-09

§ 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 中国证监会批准博时中证 500 指数增强型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时中证 500 指数增强型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时中证 500 指数增强型证券投资基金在制定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

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
二〇一九年八月二十七日