

博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2019 年半年度报告 2019 年 6 月 29 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 29 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	4
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	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	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	27
7.1 期末基金资产组合情况	27
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	28
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	28
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	34
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	34
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	34
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	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	34
7.12 投资组合报告附注	35
§8 基金份额持有人信息	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	35
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	35
§9 开放式基金份额变动	36
§10 重大事件揭示	36

10.1 基金份额持有人大会决议	36
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	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4 基金投资策略的改变	36
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	36
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	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	37
10.8 其他重大事件	37
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	38
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	38
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	39
§ 12 备查文件目录	39
12.1 备查文件目录	39
12.2 存放地点	39
12.3 查阅方式	39

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时富时中国 A 股指数证券投资基金
基金简称	博时富时中国 A 股指数
基金主代码	005183
交易代码	005183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 29 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	2,382,483.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金，采用组合复制法，按照成份股在富时中国 A 股指数中的基准权重构建指数化投资组合，同时为实现对标的指数更好的跟踪，本基金将辅以适当的替代性策略调整组合。
业绩比较基准	95%×富时中国 A 股指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街1号
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	证券时报
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 29 日）
本期已实现收益	-41,502.71
本期利润	533,117.52
加权平均基金份额本期利润	0.1444
本期加权平均净值利润率	18.07%
本期基金份额净值增长率	16.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 29 日)
期末可供分配利润	-576,892.42
期末可供分配基金份额利润	-0.2421
期末基金资产净值	1,930,923.57
期末基金份额净值	0.8105
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 29 日)
基金份额累计净值增长率	-18.95%

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。

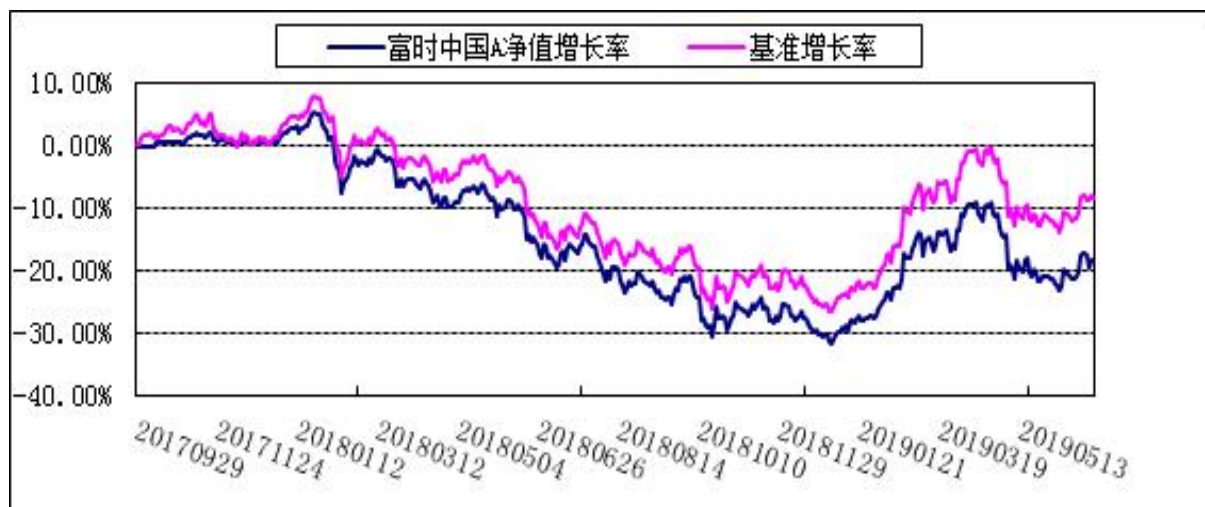
3.2 基金净值表现

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

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	2.71%	1.33%	4.02%	1.08%	-1.31%	0.25%
过去三个月	-6.45%	1.56%	-3.12%	1.46%	-3.33%	0.10%
过去六个月	16.15%	1.51%	22.99%	1.46%	-6.84%	0.05%
过去一年	-3.74%	1.44%	4.74%	1.43%	-8.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	-18.95%	1.24%	-8.17%	1.25%	-10.78%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：95%×富时中国 A 股指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。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



§ 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(L0F) (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	2018-06-12	-	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

					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。
万琼	基金经理	2017-09-29	-	12.3	万琼女士，硕士。2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理。现任博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日一至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日一至今)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日一至今)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日一至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015年10月8日一至今)、博时标普 500 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)、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017年9月29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，全球股市普涨，国际方面，标普 500 上涨 17.35%，日经指数微涨 6.45%，恒生指数上涨 10.43%，英国富时 100 上涨 10.37%，法国 CAC40 上涨 17.09%，德国 DAX 指数上涨 17.42%。国内 A 股方面，一季度受贸易摩擦态势缓和、资本市场利好政策密集推出、全球流动性宽松预期等因素影响，A 股市场情绪高涨，估值出现大幅度提升。但二季度开始，受贸易摩擦反复，华为、银行接管等事件影响，投资者的风险偏好明显下降，北上资金整体流出，A 股回落震荡。汇率方面，人民币汇率大幅度震荡。债券市场方面，上半年收益率整体处于震荡趋势，一季度受通胀预期影响，收益率水平整体上行，但随着四月基本面数据强于预期引起货币政策宽松趋缓预期，五、六月经贸摩擦加剧增加经济数据走弱预期，债券收益率呈现出先显著上行后震荡下行的走势，债市波动放大。

行情方面，2019 年上半年，市场整体上涨，大盘蓝筹表现较为稳健，上证 50 上涨 27.80%，沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 500 上涨 18.77%，中证 1000、创业板指则分别上涨 20.12%、20.87%。行业方面，中信一级行业中食品饮料上涨 60.90%，非银行金融、农林牧渔、家电涨幅紧随其后，分别上涨 44.69%、43.28%、39.80%，涨幅较为靠后的行业有钢铁、汽车、传媒和建筑，涨幅分别是 10.24%、9.85%、7.97%、6.59%。

本基金为被动跟踪指数的基金，以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的收益。在本报告期内，本基金仍处于建仓期，根据基金申赎情况，逐步增加成份股仓位，由于基金赎回金额较大，基金整体仓位不高。基金规模稳定后，会逐步增加仓位至合同要求。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 06 月 29 日，本基金基金份额净值为 0.8105 元，份额累计净值为 0.8105 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 16.15%，同期业绩基准增长率 22.99%。

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，宏观方面，5、6 月官方制造业 PMI 持平，较 4 月小幅下行，保持在 50 以下，经济基本面稍显薄弱。当前市场对于国内金融监管政策、货币政策改善再融资情况、稳定经济预期，已经有了较为明确的认识。后续左右市场的，最主要的是中美贸易谈判进展情况及基本面见底修复情况。中美经贸关系暂时缓和，利好市场情绪改善。但前期征税造成的负面效果仍在发酵，在内部稳增长压力下，下半年政策预计偏积极，社融存量增速维持回升态势，整体经济有望在下半年弱复苏，企业利润回升大体同步，但政策为应对中美关系趋势性改变会留足空间，但复苏的力度和持续性不乐观。

结合技术面和资金的情况看，下半年市场仍处在一个震荡的存量竞争格局中，对 A 股维持中性偏乐观判断。大小盘风格上，建议配置大盘蓝筹股为主，回避小盘股，特别是基本面质地较差的品种。结构上，稳中求进，配置大银行、大地产、水电、高速公路、铁路以及有政策刺激预期的家电、汽车行业龙头。另外，随着贸易战第二波冲击逐步减弱，也可以关注优质科技龙头。

在投资策略上，博时富时中国 A 股指数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，紧密跟踪富时中国 A 股指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过博时富时中国 A 股指数基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本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

本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基金持有人少于 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博时富时中国 A 股指数证券投资基金（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合规守信、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：博时富时中国 A 股指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 29 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 29 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.4.1	210,787.95	398,246.34
结算备付金		-	15,870.16
存出保证金		994.72	232.47
交易性金融资产	6.4.4.2	1,831,239.58	2,947,174.60
其中：股票投资		1,831,239.58	2,947,174.60
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	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收证券清算款		91,910.78	-
应收利息	6.4.4.5	44.44	95.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	19,980.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.6	-	-
资产总计		2,134,977.47	3,381,598.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 29 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		-	-
应付赎回款		75,022.29	-
应付管理人报酬		2,022.25	2,723.41
应付托管费		404.46	544.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.4.7	826.95	2,664.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.8	125,777.95	243,150.18
负债合计		204,053.90	249,082.89
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.4.9	2,382,483.02	4,489,195.07
未分配利润	6.4.4.10	-451,559.45	-1,356,679.19
所有者权益合计		1,930,923.57	3,132,515.88
负债和所有者权益总计		2,134,977.47	3,381,598.77

注：报告截止日 2019 年 6 月 29 日，基金份额净值 0.8105 元，基金份额总额 2,382,483.02 份。

6.2 利润表

会计主体：博时富时中国 A 股指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 29 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 29 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		758,421.42	-406,355.25
1. 利息收入		1,716.72	2,561.44
其中：存款利息收入	6.4.4.11	1,716.72	2,559.97
债券利息收入		-	1.47
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）		172,788.29	-116,978.84
其中：股票投资收益	6.4.4.12	149,721.27	-158,514.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.13	-	602.96
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.14	-	-
股利收益	6.4.4.15	23,067.02	40,932.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	574,620.23	-304,550.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.17	9,296.18	12,612.72

减：二、费用		225,303.90	260,686.03
1. 管理人报酬		14,685.39	23,574.82
2. 托管费		2,937.08	4,715.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.4.18	8,788.14	11,276.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.4.19	198,893.29	221,119.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		533,117.52	-667,041.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		533,117.52	-667,041.28

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时富时中国 A 股指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 29 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 29 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）	4,489,195.07	-1,356,679.19	3,132,515.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	533,117.52	533,117.52
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）	-2,106,712.05	372,002.22	-1,734,709.83
其中：1. 基金申购款	3,156,744.14	-681,198.62	2,475,545.52
2. 基金赎回款	-5,263,456.19	1,053,200.84	-4,210,255.35
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）	2,382,483.02	-451,559.45	1,930,923.57
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）	8,976,215.05	69,043.60	9,045,258.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-667,041.28	-667,041.28
三、本期基金份额交易产	-4,808,380.96	-60,494.05	-4,868,875.01

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	182,761.60	-13,278.72	169,482.88
2. 基金赎回款	-4,991,142.56	-47,215.33	-5,038,357.89
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）	4,167,834.09	-658,491.73	3,509,342.36

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 会计报表的编制基础

根据《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》以及基金管理人博时基金管理有限公司于 2019 年 6 月 26 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2019 年 6 月 30 日进入财产清算程序，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2019 年 6 月 29 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

6.4.2 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。

6.4.3 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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 29 日
活期存款	210,787.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	210,787.95

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 29 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,558,396.13	1,831,239.58	272,843.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,558,396.13	1,831,239.58	272,843.45

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.4.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.4.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月29日
应收活期存款利息	44.08
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	-
应收债券利息	-
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	0.36
合计	44.44

6.4.4.6 其他资产

无余额。

6.4.4.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月29日
交易所市场应付交易费用	826.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	826.95

6.4.4.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月29日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	537.95
其他应付款	35,040.00
应付指数使用费	-
预提费用	90,200.00
合计	125,777.95

6.4.4.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 29 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,489,195.07	4,489,195.07
本期申购	3,156,744.14	3,156,744.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-5,263,456.19	-5,263,456.19
本期末	2,382,483.02	2,382,483.02

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.4.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,025,755.25	-330,923.94	-1,356,679.19
本期利润	-41,502.71	574,620.23	533,117.52
本期基金份额交易产生的变动数	490,365.54	-118,363.32	372,002.22
其中：基金申购款	-722,239.74	41,041.12	-681,198.62
基金赎回款	1,212,605.28	-159,404.44	1,053,200.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-576,892.42	125,332.97	-451,559.45

6.4.4.11 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 29 日
活期存款利息收入	1,657.01
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	35.07
其他	24.64
合计	1,716.72

6.4.4.12 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 29 日
卖出股票成交总额	3,900,306.62
减：卖出股票成本总额	3,750,585.35
买卖股票差价收入	149,721.27

6.4.4.13 债券投资收益

无发生额。

6.4.4.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.4.15 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 29 日
股票投资产生的股利收益	23,067.02

基金投资产生的股利收益	-
合计	23,067.02

6.4.4.16 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29日
1. 交易性金融资产	574,620.23
——股票投资	574,620.23
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	574,620.23

6.4.4.17 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29日
基金赎回费收入	6,590.36
基金转换费收入	2,705.82
合计	9,296.18

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。

6.4.4.18 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29日
交易所市场交易费用	8,788.14
银行间市场交易费用	-
合计	8,788.14

6.4.4.19 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29日
审计费用	35,000.00
信息披露费	-
银行汇划费	512.79
指数使用费	128,380.50
其他	35,000.00
合计	198,893.29

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

自 2019 年 6 月 30 日本基金进入清算期至 2019 年 8 月 7 日（清算期结束日）止期间，本基金由银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息收入归基金份额持有人所有，由基金管理人博时基金管理有限公司先行垫付，垫付资金孳生的利息归博时基金管理有限公司所有。结息后将由托管人退还博时基金管理有限公司，结息金额与截至清算报告批准报出日止期间预估的垫付利息产生的差额也由博时基金管理有限公司承担。

本基金最后运作日确认的应收证券清算款 91,910.78 元已于 2019 年 7 月 1 日划入本基金托管账户。本基金最后运作日确认的应付赎回款 75,022.29 元已分别于 2019 年 7 月 1 日和 7 月 2 日划付给投资人。

于 2019 年 6 月 29 日本基金持有交易性金融资产 1,831,239.58 元，均为非流通受限的股票资产。截至清算期结束日（2019 年 8 月 7 日），上述股票资产均已卖出，变现金额为 1,851,867.01 元。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 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29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	1,144,448.20	19.20%	-	-

6.4.7.1.2 权证交易

无。

6.4.7.1.3 债券交易

无。

6.4.7.1.4 债券回购交易

无。

6.4.7.1.5 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29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	836.69	19.20%	462.42	55.92%
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. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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29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	14,685.39	23,574.82
其中：支付销售机构的客户维护费	2,490.94	4,599.22

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。

6.4.7.2.2 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29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	2,937.08	4,715.06

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。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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29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	210,787.95	1,657.01	493,155.56	2,430.43

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。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

无。

6.4.9 期末（2019年6月29日）本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.10 金融工具风险及管理
6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用组合复制法，按照成份股在富时中国 A 股指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以富时中国 A 股指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对富时中国 A 股指数的有效跟踪。

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与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各

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

6.4.10.2 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 29 日，本基金未持有债券（2018 年 12 月 31 日：同）。

6.4.10.3 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 29 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.10.3.1 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该

上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.9。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 29 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 29 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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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、存出保证金等。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 29 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	210,787.95	-	-	-	210,787.95

结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	994.72	-	-	-	994.72
交易性金融资产	-	-	-	1,831,239.58	1,831,239.58
应收证券清算款	-	-	-	91,910.78	91,910.78
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	44.44	44.44
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	211,782.67	-	-	1,923,194.80	2,134,977.47
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	75,022.29	75,022.29
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,022.25	2,022.25
应付托管费	-	-	-	404.46	404.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	826.95	826.95
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	125,777.95	125,777.95
负债总计	-	-	-	204,053.90	204,053.90
利率敏感度缺口	211,782.67	-	-	1,719,140.90	1,930,923.57
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	398,246.34	-	-	-	398,246.34
结算备付金	15,870.16	-	-	-	15,870.16
存出保证金	232.47	-	-	-	232.47
交易性金融资产	-	-	-	2,947,174.60	2,947,174.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	95.18	95.18
应收申购款	-	-	-	19,980.02	19,980.02
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	414,348.97	-	-	2,967,249.80	3,381,598.77
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,723.41	2,723.41
应付托管费	-	-	-	544.70	544.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,664.60	2,664.60

应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	243,150.18	243,150.18
负债总计	-	-	-	249,082.89	249,082.89
利率敏感度缺口	414,348.97	-	-	2,718,166.91	3,132,515.88

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。

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 29 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：同），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）。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.4.3 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。

本基金为指数型基金，采用组合复制法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产总值的 90%。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。

6.4.10.4.3.1 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 29 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	1,831,239.58	94.84	2,947,174.60	94.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,831,239.58	94.84	2,947,174.60	94.08

6.4.10.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除富时中国 A 股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 29 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
富时中国 A 股指数上升 5%	增加约 9	增加约 15
富时中国 A 股指数下降 5%	减少约 9	减少约 15

6.4.11 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 29 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 1,831,239.58 元，无属于第二或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 2,915,154.60 元，第二层次 32,020.00 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 29 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	1,831,239.58	85.77
	其中：股票	1,831,239.58	85.77
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	210,787.95	9.87
8	其他各项资产	92,949.94	4.35
9	合计	2,134,977.47	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	26,890.00	1.39
B	采矿业	45,645.00	2.36
C	制造业	929,458.52	48.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,035.00	1.92
E	建筑业	37,232.00	1.93
F	批发和零售业	26,930.40	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	58,495.60	3.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	87,477.86	4.53
J	金融业	464,712.00	24.07
K	房地产业	64,043.00	3.32
L	租赁和商务服务业	21,962.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	19,494.20	1.01
R	文化、体育和娱乐业	7,760.00	0.40
S	综合	4,104.00	0.21
	合计	1,831,239.58	94.84

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	600519	贵州茅台	200	196,800.00	10.19

2	000858	五粮液	900	106,155.00	5.50
3	601318	中国平安	1,100	97,471.00	5.05
4	000333	美的集团	715	37,079.90	1.92
5	601288	农业银行	8,200	29,520.00	1.53
6	601398	工商银行	4,700	27,683.00	1.43
7	000651	格力电器	500	27,500.00	1.42
8	601166	兴业银行	1,500	27,435.00	1.42
9	600276	恒瑞医药	384	25,344.00	1.31
10	002304	洋河股份	200	24,312.00	1.26
11	601601	中国太保	600	21,906.00	1.13
12	600000	浦发银行	1,800	21,024.00	1.09
13	601888	中国国旅	200	17,730.00	0.92
14	600887	伊利股份	500	16,705.00	0.87
15	000002	万科 A	600	16,686.00	0.86
16	600585	海螺水泥	400	16,600.00	0.86
17	000568	泸州老窖	200	16,166.00	0.84
18	601328	交通银行	2,600	15,912.00	0.82
19	601668	中国建筑	2,700	15,525.00	0.80
20	600104	上汽集团	600	15,300.00	0.79
21	000001	平安银行	1,100	15,158.00	0.79
22	600016	民生银行	2,380	15,113.00	0.78
23	600900	长江电力	800	14,320.00	0.74
24	600030	中信证券	600	14,286.00	0.74
25	601628	中国人寿	500	14,160.00	0.73
26	002415	海康威视	500	13,790.00	0.71
27	601688	华泰证券	600	13,392.00	0.69
28	601766	中国中车	1,600	12,944.00	0.67
29	601088	中国神华	600	12,228.00	0.63
30	002142	宁波银行	500	12,120.00	0.63
31	002714	牧原股份	200	11,758.00	0.61
32	600436	片仔癀	100	11,520.00	0.60
33	600028	中国石化	2,100	11,487.00	0.59
34	002475	立讯精密	450	11,155.50	0.58
35	601211	国泰君安	600	11,010.00	0.57
36	601336	新华保险	200	11,006.00	0.57
37	603288	海天味业	100	10,500.00	0.54
38	600050	中国联通	1,700	10,472.00	0.54
39	002594	比亚迪	200	10,144.00	0.53
40	601818	光大银行	2,600	9,906.00	0.51
41	300033	同花顺	100	9,836.00	0.51
42	000063	中兴通讯	300	9,759.00	0.51
43	600406	国电南瑞	500	9,320.00	0.48
44	600048	保利地产	700	8,932.00	0.46
45	600570	恒生电子	130	8,859.50	0.46
46	600690	海尔智家	500	8,645.00	0.45
47	600837	海通证券	600	8,514.00	0.44
48	600009	上海机场	100	8,378.00	0.43
49	000538	云南白药	100	8,342.00	0.43
50	601229	上海银行	700	8,295.00	0.43
51	600547	山东黄金	200	8,234.00	0.43

52	600332	白云山	200	8,194.00	0.42
53	300059	东方财富	600	8,130.00	0.42
54	300015	爱尔眼科	260	8,052.20	0.42
55	002024	苏宁易购	700	8,036.00	0.42
56	601155	新城控股	200	7,962.00	0.41
57	600031	三一重工	600	7,848.00	0.41
58	601989	中国重工	1,400	7,784.00	0.40
59	300347	泰格医药	100	7,710.00	0.40
60	002032	苏泊尔	100	7,583.00	0.39
61	300498	温氏股份	200	7,172.00	0.37
62	600019	宝钢股份	1,100	7,150.00	0.37
63	000166	申万宏源	1,400	7,014.00	0.36
64	000876	新希望	400	6,948.00	0.36
65	600809	山西汾酒	100	6,905.00	0.36
66	300750	宁德时代	100	6,888.00	0.36
67	000725	京东方 A	2,000	6,880.00	0.36
68	000776	广发证券	500	6,870.00	0.36
69	002352	顺丰控股	200	6,792.00	0.35
70	002230	科大讯飞	200	6,648.00	0.34
71	600588	用友网络	247	6,639.36	0.34
72	600340	华夏幸福	200	6,514.00	0.34
73	600741	华域汽车	300	6,480.00	0.34
74	601006	大秦铁路	800	6,472.00	0.34
75	601225	陕西煤业	700	6,468.00	0.33
76	600958	东方证券	600	6,408.00	0.33
77	000963	华东医药	240	6,230.40	0.32
78	002311	海大集团	200	6,180.00	0.32
79	600015	华夏银行	800	6,160.00	0.32
80	000338	潍柴动力	500	6,145.00	0.32
81	601933	永辉超市	600	6,126.00	0.32
82	601012	隆基股份	260	6,008.60	0.31
83	601186	中国铁建	600	5,970.00	0.31
84	600383	金地集团	500	5,965.00	0.31
85	002422	科伦药业	200	5,946.00	0.31
86	600760	中航沈飞	200	5,806.00	0.30
87	600085	同仁堂	200	5,800.00	0.30
88	601111	中国国航	600	5,742.00	0.30
89	300142	沃森生物	200	5,672.00	0.29
90	601800	中国交建	500	5,660.00	0.29
91	600536	中国软件	100	5,367.00	0.28
92	002736	国信证券	400	5,264.00	0.27
93	300601	康泰生物	100	5,250.00	0.27
94	600111	北方稀土	400	5,136.00	0.27
95	600779	水井坊	100	5,082.00	0.26
96	002299	圣农发展	200	5,064.00	0.26
97	600196	复星医药	200	5,060.00	0.26
98	600600	青岛啤酒	100	4,993.00	0.26
99	002468	申通快递	200	4,988.00	0.26
100	000895	双汇发展	200	4,978.00	0.26
101	603019	中科曙光	140	4,914.00	0.25

102	002405	四维图新	300	4,830.00	0.25
103	601138	工业富联	400	4,820.00	0.25
104	000977	浪潮信息	200	4,772.00	0.25
105	600352	浙江龙盛	300	4,731.00	0.25
106	600132	重庆啤酒	100	4,716.00	0.24
107	000783	长江证券	600	4,686.00	0.24
108	600886	国投电力	600	4,662.00	0.24
109	600029	南方航空	600	4,632.00	0.24
110	300144	宋城演艺	200	4,628.00	0.24
111	600271	航天信息	200	4,610.00	0.24
112	300003	乐普医疗	200	4,604.00	0.24
113	300124	汇川技术	200	4,582.00	0.24
114	002007	华兰生物	150	4,573.50	0.24
115	601788	光大证券	400	4,568.00	0.24
116	600893	航发动力	200	4,542.00	0.24
117	600398	海澜之家	500	4,535.00	0.23
118	002271	东方雨虹	200	4,532.00	0.23
119	600703	三安光电	400	4,512.00	0.23
120	601021	春秋航空	100	4,500.00	0.23
121	601985	中国核电	800	4,448.00	0.23
122	002049	紫光国微	100	4,411.00	0.23
123	603899	晨光文具	100	4,397.00	0.23
124	002236	大华股份	300	4,356.00	0.23
125	002179	中航光电	130	4,349.80	0.23
126	300122	智飞生物	100	4,310.00	0.22
127	601360	三六零	200	4,276.00	0.22
128	601901	方正证券	600	4,266.00	0.22
129	002027	分众传媒	800	4,232.00	0.22
130	601066	中信建投	200	4,216.00	0.22
131	600061	国投资本	300	4,203.00	0.22
132	601899	紫金矿业	1,100	4,147.00	0.21
133	601009	南京银行	500	4,130.00	0.21
134	600895	张江高科	200	4,104.00	0.21
135	600038	中直股份	100	4,102.00	0.21
136	600018	上港集团	600	4,092.00	0.21
137	600010	包钢股份	2,400	4,056.00	0.21
138	601377	兴业证券	600	4,044.00	0.21
139	002120	韵达股份	130	4,006.60	0.21
140	000423	东阿阿胶	100	3,982.00	0.21
141	601618	中国中冶	1,300	3,952.00	0.20
142	300408	三环集团	200	3,890.00	0.20
143	002001	新和成	200	3,858.00	0.20
144	000938	紫光股份	140	3,815.00	0.20
145	600115	东方航空	600	3,762.00	0.19
146	002146	荣盛发展	400	3,756.00	0.19
147	600011	华能国际	600	3,738.00	0.19
148	002044	美年健康	300	3,732.00	0.19
149	002202	金风科技	300	3,729.00	0.19
150	601939	建设银行	500	3,720.00	0.19
151	600663	陆家嘴	240	3,720.00	0.19

152	600516	方大炭素	298	3,662.42	0.19
153	600004	白云机场	200	3,640.00	0.19
154	601607	上海医药	200	3,630.00	0.19
155	000786	北新建材	200	3,626.00	0.19
156	002153	石基信息	100	3,619.00	0.19
157	000656	金科股份	600	3,618.00	0.19
158	000157	中联重科	600	3,606.00	0.19
159	601998	中信银行	600	3,582.00	0.19
160	600674	川投能源	400	3,560.00	0.18
161	600816	安信信托	700	3,535.00	0.18
162	000401	冀东水泥	200	3,522.00	0.18
163	000069	华侨城 A	500	3,475.00	0.18
164	002008	大族激光	100	3,438.00	0.18
165	600606	绿地控股	500	3,415.00	0.18
166	600346	恒力石化	280	3,404.80	0.18
167	300450	先导智能	100	3,360.00	0.17
168	600487	亨通光电	200	3,352.00	0.17
169	002506	协鑫集成	500	3,340.00	0.17
170	000513	丽珠集团	100	3,323.00	0.17
171	600535	天士力	200	3,310.00	0.17
172	600795	国电电力	1,300	3,302.00	0.17
173	002410	广联达	100	3,289.00	0.17
174	601238	广汽集团	300	3,279.00	0.17
175	002690	美亚光电	100	3,260.00	0.17
176	600705	中航资本	600	3,252.00	0.17
177	600298	安琪酵母	100	3,163.00	0.16
178	600637	东方明珠	300	3,162.00	0.16
179	000768	中航飞机	200	3,150.00	0.16
180	600362	江西铜业	200	3,148.00	0.16
181	600977	中国电影	200	3,132.00	0.16
182	600068	葛洲坝	500	3,115.00	0.16
183	600315	上海家化	100	3,115.00	0.16
184	601233	桐昆股份	200	3,102.00	0.16
185	600688	上海石化	600	3,096.00	0.16
186	000066	中国长城	300	3,084.00	0.16
187	000413	东旭光电	600	3,084.00	0.16
188	600489	中金黄金	300	3,081.00	0.16
189	600867	通化东宝	200	3,080.00	0.16
190	601555	东吴证券	300	3,075.00	0.16
191	300024	机器人	200	3,046.00	0.16
192	002368	太极股份	100	3,030.00	0.16
193	600161	天坛生物	120	3,030.00	0.16
194	002673	西部证券	300	3,024.00	0.16
195	600183	生益科技	200	3,010.00	0.16
196	601117	中国化学	500	3,010.00	0.16
197	600642	申能股份	500	3,005.00	0.16
198	600426	华鲁恒升	200	2,972.00	0.15
199	600372	中航电子	200	2,968.00	0.15
200	600369	西南证券	600	2,964.00	0.15
201	002938	鹏鼎控股	100	2,936.00	0.15

202	000999	华润三九	100	2,934.00	0.15
203	600109	国金证券	300	2,916.00	0.15
204	600739	辽宁成大	200	2,908.00	0.15
205	600919	江苏银行	400	2,904.00	0.15
206	000998	隆平高科	200	2,896.00	0.15
207	002414	高德红外	150	2,880.00	0.15
208	601880	大连港	700	1,491.00	0.08

注：海尔智家股份有限公司（原名“青岛海尔股份有限公司”）公告称：公司股票简称自 2019 年 7 月 1 日起由“青岛海尔”变为“海尔智家”，股票代码“600690”不变。

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	601318	中国平安	78,874.00	2.52
2	600519	贵州茅台	73,488.00	2.35
3	000858	五粮液	49,580.00	1.58
4	600000	浦发银行	39,024.00	1.25
5	601668	中国建筑	32,136.00	1.03
6	601766	中国中车	26,640.00	0.85
7	600887	伊利股份	17,934.00	0.57
8	601088	中国神华	16,024.00	0.51
9	601211	国泰君安	15,921.00	0.51
10	600019	宝钢股份	15,686.00	0.50
11	601390	中国中铁	14,532.00	0.46
12	601628	中国人寿	13,860.00	0.44
13	000725	京东方 A	13,760.00	0.44
14	002024	苏宁易购	13,632.00	0.44
15	601989	中国重工	12,796.00	0.41
16	601857	中国石油	12,733.00	0.41
17	600015	华夏银行	12,464.00	0.40
18	000166	申万宏源	12,272.00	0.39
19	600406	国电南瑞	11,856.00	0.38
20	002027	分众传媒	11,772.00	0.38

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	601318	中国平安	115,171.00	3.68
2	601818	光大银行	61,341.00	1.96
3	000157	中联重科	57,730.00	1.84
4	601288	农业银行	53,557.00	1.71
5	600031	三一重工	50,375.00	1.61

6	000651	格力电器	48,890.00	1.56
7	600737	中粮糖业	45,850.00	1.46
8	601229	上海银行	45,530.00	1.45
9	601398	工商银行	45,326.00	1.45
10	600383	金地集团	44,594.00	1.42
11	600028	中国石化	41,537.00	1.33
12	600585	海螺水泥	41,256.00	1.32
13	600352	浙江龙盛	40,772.00	1.30
14	600900	长江电力	39,319.00	1.26
15	002498	汉缆股份	39,314.00	1.26
16	600017	日照港	39,239.00	1.25
17	600104	上汽集团	38,577.00	1.23
18	601688	华泰证券	38,481.58	1.23
19	601006	大秦铁路	38,036.00	1.21
20	600050	中国联通	35,980.00	1.15

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,066,158.45
卖出股票的收入（成交）总额	3,900,306.62

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	994.72
2	应收证券清算款	91,910.78
3	应收股利	-
4	应收利息	44.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,949.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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
65	36,653.58	-	-	2,382,483.02	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

8.3 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	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开放式基金；
2、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

基金合同生效日（2017 年 9 月 29 日）基金份额总额	202,737,368.02
本报告期期初基金份额总额	4,489,195.07
本报告期基金总申购份额	3,156,744.14
减：本报告期基金总赎回份额	5,263,456.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,382,483.02

§ 10 重大事件揭示

10.1 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 2019 年 5 月 29 日起，至 2019 年 6 月 24 日 17:00 止，会议审议通过了《关于终止博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》。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。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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	
海通证券	2	4,116,012.68	69.06%	3,009.91	69.06%	新增 2 个
招商证券	1	1,144,448.20	19.20%	836.69	19.20%	新增 1 个
方正证券	1	699,596.84	11.74%	511.69	11.74%	新增 1 个

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，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。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金份额持有人大会	证券时报	2019-06-26

	表决结果暨决议生效的公告		
2	博时富时中国 A 股指数证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券时报	2019-06-26
3	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报	2019-05-28
4	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报	2019-05-27
5	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	证券时报	2019-05-24
6	博时基金管理有限公司关于以通讯方式召开博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报	2019-05-24
7	博时富时中国 A 股指数证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（摘要）	证券时报	2019-05-13
8	博时富时中国 A 股指数证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（正文）	证券时报	2019-05-13
9	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报	2019-04-22
10	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	证券时报	2019-03-29
11	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2018 年年度报告（正文）	证券时报	2019-03-29
12	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	证券时报	2019-02-25
13	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报	2019-01-19

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 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
个人	1	2019-01-04~2019-02-13	839,506.70	145,868.93	985,375.63	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>							

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。

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富时中国 A 股指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时富时中国 A 股指数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 博时富时中国 A 股指数证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时富时中国 A 股指数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