

博时汇悦回报混合型证券投资基金  
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 29 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
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 .....	10
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	10
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 .....	10
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 .....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	13
6.4 报表附注 .....	13
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	29
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 .....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	32
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 .....	32
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 .....	32
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 .....	32
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 .....	32
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	33
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	33
7.12 投资组合报告附注 .....	33
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>34</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	34
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 .....	34
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>34</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>34</b>

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	34
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 .....	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	35
10.4 基金投资策略的改变 .....	35
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	35
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 .....	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	35
10.8 其他重大事件 .....	36
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>36</b>
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 .....	37
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	37
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>37</b>
12.1 备查文件目录 .....	37
12.2 存放地点 .....	37
12.3 查阅方式 .....	37

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时汇悦回报混合型证券投资基金
基金简称	博时汇悦回报混合
基金主代码	006813
交易代码	006813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 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	132,980,137.17 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过跟踪考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势、外汇占款等）及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，判断经济周期当前所处的位置及未来发展方向，并通过监测重要行业的产能利用与经济景气轮动研究，调整股票资产和固定收益资产的配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富（总值）指数收益率×35%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

### 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 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,306,392.92
本期利润	2,207,165.83
加权平均基金份额本期利润	0.0101
本期加权平均净值利润率	1.01%
本期基金份额净值增长率	-0.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,174,735.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0088
期末基金资产净值	131,805,401.62
期末基金份额净值	0.9912
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-0.88%

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。

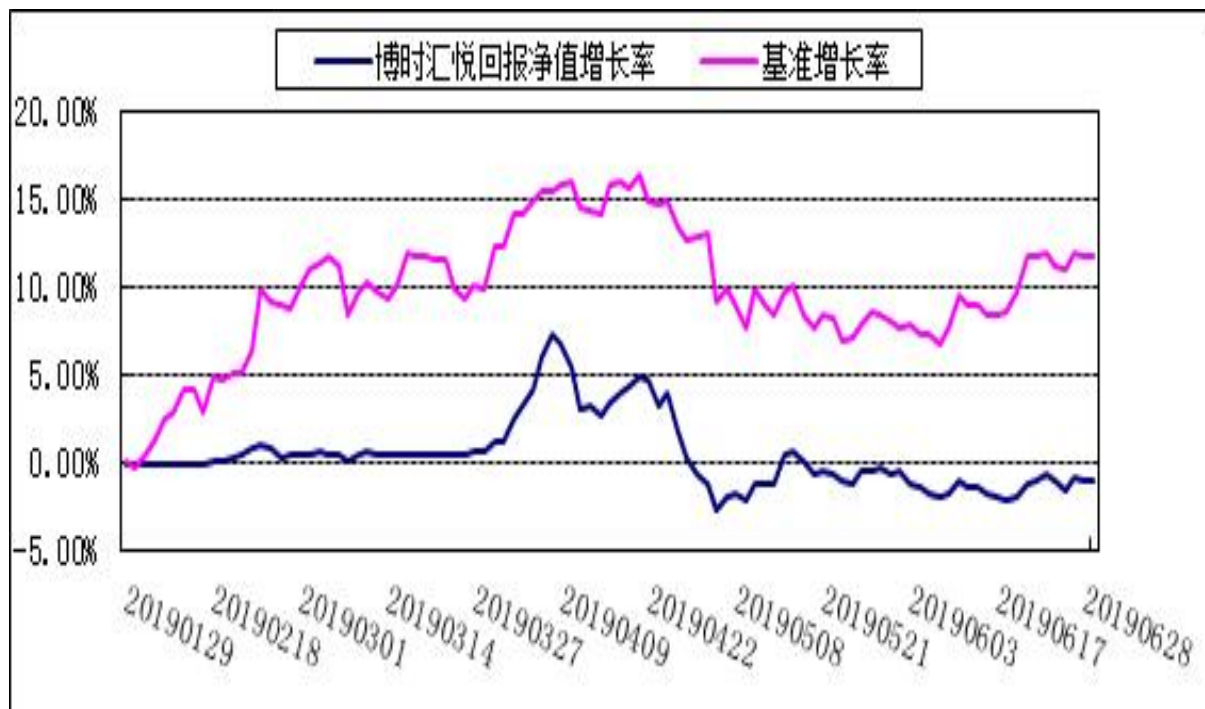
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-0.49%	0.42%	3.69%	0.71%	-4.18%	-0.29%
过去三个月	-2.20%	0.79%	-0.55%	0.91%	-1.65%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-0.88%	0.62%	11.81%	0.97%	-12.69%	-0.35%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富（总值）指数收益率×35%。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 55%、10%和 35%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



注：本基金的基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关约定。截止报告期末基金尚未完成建仓。

## § 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、博时鑫源灵活配置混合 (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和地方政府高度认可。

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		
吴渭	事业部投资副总监/基金经理	2019-01-29	-	12.0	吴渭先生，硕士。2007 年起先后在泰信基金、博时基金、民生加银基金、招商基金从事投资研究工作。2015 年 3 月再次加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部绝对收益组投资副总监、股

					票投资部主题组投资副总监。现任事业部投资副总监兼博时汇智回报灵活配置混合型证券投资基金(2017年4月12日一至今)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2019年1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

管理人偏向绝对收益策略。

一季度流动性充裕，风险偏好提升，企业盈利展望偏乐观，管理人提高权益资产比重，主要配置景气向上的行业。

二季度流动性边际收紧，国际形势复杂，企业盈利能力展望偏负面，叠加一季度权益市场涨幅较大，管理人降低了权益资产仓位，主要配置仍然是景气向上的行业。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.9912 元，份额累计净值为 0.9912 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-0.88%，同期业绩基准增长率 11.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去几年宏观经济稳中向好，未来两个季度不会改变这种趋势。

展望下半年流动性边际变化不大，因为国际形势变化较快，风险偏好会出现阶段性较大波动，企业盈利会分化加剧，权益资产行业之间会明显分化，投资策略上仍然持有景气度较高行业中的头部公司。

#### 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

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”）在博时汇悦回报混合型证券投资基金（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：博时汇悦回报混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	24,035,493.80
结算备付金		5,363,046.74
存出保证金		83,487.24
交易性金融资产	6.4.7.2	51,226,662.18
其中：股票投资		51,226,662.18
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	51,700,000.00
应收证券清算款		213,650.43
应收利息	6.4.7.5	7,193.43
应收股利		-
应收申购款		8,235.60
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>132,637,769.42</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		-
短期借款		-
交易性金融负债		-

衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		288,789.10
应付管理人报酬		164,207.08
应付托管费		27,367.88
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	312,786.42
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	39,217.32
<b>负债合计</b>		<b>832,367.80</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	6.4.7.9	132,980,137.17
未分配利润	6.4.7.10	-1,174,735.55
<b>所有者权益合计</b>		<b>131,805,401.62</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>132,637,769.42</b>

注：1. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 132,980,137.17 份，基金份额净值 0.9912 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：博时汇悦回报混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>4,536,593.69</b>
1. 利息收入		1,711,043.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,360,772.64
债券利息收入		88.70
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		350,182.50
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,067,855.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	830,941.62
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	40,350.60
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	196,563.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	900,772.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 17	856, 921. 52
<b>减：二、费用</b>		<b>2, 329, 427. 86</b>
1. 管理人报酬		1, 376, 782. 19
2. 托管费		229, 463. 75
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	678, 524. 26
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0. 33
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	44, 657. 33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2, 207, 165. 83</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2, 207, 165. 83</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时汇悦回报混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）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）	345, 857, 413. 94	-	345, 857, 413. 94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2, 207, 165. 83	2, 207, 165. 83
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）	-212, 877, 276. 77	-3, 381, 901. 38	-216, 259, 178. 15
其中：1. 基金申购款	10, 541, 375. 14	364, 013. 67	10, 905, 388. 81
2. 基金赎回款	-223, 418, 651. 91	-3, 745, 915. 05	-227, 164, 566. 96
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）	132, 980, 137. 17	-1, 174, 735. 55	131, 805, 401. 62

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 基金基本情况

博时汇悦回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]第 1561 号《关于准予博时汇悦回报混合型证券投资基金募集的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时汇悦回报混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 345,793,535.61 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2019)验字第 60669135\_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时汇悦回报混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 345,857,413.94 份基金份额,其中认购资金利息折合 63,878.33 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时汇悦回报混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪/深港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债、次级债、中小企业私募债等)、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的 45%-90%;港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%;权证投资比例为基金资产净值的 0-3%;每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×55%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2019 年 8 月 27 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时汇悦回报混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。



本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

###### (2) 金融负债的分类

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

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

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证

券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 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	24,035,493.80
定期存款	-
其他存款	-
合计	24,035,493.80

#### 6.4.7.2 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	50,325,889.27	51,226,662.18	900,772.91
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		50,325,889.27	51,226,662.18	900,772.91

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	51,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	51,700,000.00	-

#### 6.4.7.5 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	4,742.53
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	2,413.30
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	37.60
合计	7,193.43

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 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	312,786.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	312,786.42

#### 6.4.7.8 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	718.83
其他应付款	-
预提费用	38,498.49
合计	39,217.32

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	345,857,413.94	345,857,413.94
本期申购	10,541,375.14	10,541,375.14
本期赎回（以“-”号填列）	-223,418,651.91	-223,418,651.91
本期末	132,980,137.17	132,980,137.17

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2019 年 1 月 2 日至 2019 年 1 月 25 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 345,793,535.61 元，折合为 345,793,535.61 份基金份额。根据《博时汇悦回报混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 63,878.33 元在本基金成立后，折算为 63,878.33 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《博时汇悦回报混合型证券投资基金基金合同》、《博时汇悦回报混合型证券投资基金招募说明书》及《博时汇悦回报混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 3 月 24 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

#### 6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,306,392.92	900,772.91	2,207,165.83
本期基金份额交易产生的变动数	-1,491,054.50	-1,890,846.88	-3,381,901.38
其中：基金申购款	215,383.12	148,630.55	364,013.67
基金赎回款	-1,706,437.62	-2,039,477.43	-3,745,915.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-184,661.58	-990,073.97	-1,174,735.55

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	126,520.87
定期存款利息收入	1,215,000.00	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	18,986.98	
其他	264.79	
合计	1,360,772.64	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元



项目	本期
	2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出股票成交总额	241,649,247.14
减：卖出股票成本总额	240,818,305.52
买卖股票差价收入	830,941.62

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月29日（基金合同生效日）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	318,442.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	278,000.00
减：应收利息总额	91.40
买卖债券差价收入	40,350.60

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	196,563.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	196,563.20

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	900,772.91
——股票投资	900,772.91
——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	900,772.91

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
基金赎回费收入	852,889.49

基金转换费收入	4,032.03
合计	856,921.52

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	交易所市场交易费用	678,524.26
银行间市场交易费用	-	
合计	678,524.26	

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	审计费用	22,700.61
信息披露费	11,297.88	
银行汇划费	4,258.84	
中债登账户维护费	6,000.00	
其他	400.00	
合计	44,657.33	

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 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。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、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、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

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。

### 6.4.10 本报告期的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例

招商证券	182,114,686.20	34.18%
------	----------------	--------

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	318,442.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	3,186,200,000.00	93.71%

#### 6.4.10.1.5 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29日（基金合同生效日）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	133,182.53	34.18%	125,816.38	40.22%

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的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,376,782.19
其中：支付销售机构的客户维护费	657,541.45

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$   
 H 为每日应计提的基金管理费  
 E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	229,463.75

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$   
 H 为每日应计提的基金托管费  
 E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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29日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	24,035,493.80	126,520.87

注：本基金的活期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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。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在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

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，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 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同责任，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，本基金无债券投资。

#### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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、债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 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
<b>资产</b>					
银行存款	24,035,493.80	-	-	-	24,035,493.80
结算备付金	5,363,046.74	-	-	-	5,363,046.74
存出保证金	83,487.24	-	-	-	83,487.24
交易性金融资产	-	-	-	51,226,662.18	51,226,662.18
应收证券清算款	-	-	-	213,650.43	213,650.43
买入返售金融资产	51,700,000.00	-	-	-	51,700,000.00
应收利息	-	-	-	7,193.43	7,193.43
应收申购款	-	-	-	8,235.60	8,235.60
<b>资产总计</b>	<b>81,182,027.78</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>51,455,741.64</b>	<b>132,637,769.42</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	288,789.10	288,789.10
应付管理人报酬	-	-	-	164,207.08	164,207.08



应付托管费	-	-	-	27,367.88	27,367.88
应付交易费用	-	-	-	312,786.42	312,786.42
其他负债	-	-	-	39,217.32	39,217.32
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>832,367.80</b>	<b>832,367.80</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>81,182,027.78</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>50,623,373.84</b>	<b>131,805,401.62</b>

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	51,226,662.18	38.87
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	-	-
<b>合计</b>	<b>51,226,662.18</b>	<b>38.87</b>

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 51,226,662.18 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期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，在第一层次和第二层次之间无重大转换。本基金本



报告期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未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

#### 6.4.14.2 承诺事项

无。

#### 6.4.14.3 其他事项

无。

## § 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	51,226,662.18	38.62
	其中：股票	51,226,662.18	38.62
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	51,700,000.00	38.98
	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	29,398,540.54	22.16
8	其他各项资产	312,566.70	0.24
9	合计	132,637,769.42	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	-	-
B	采矿业	7,100.00	0.01
C	制造业	39,275,352.18	29.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,765,000.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	5,405,210.00	4.10
K	房地产业	4,774,000.00	3.62
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	51,226,662.18	38.87

### 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	300118	东方日升	1,199,201	12,207,866.18	9.26
2	600519	贵州茅台	6,800	6,691,200.00	5.08
3	601318	中国平安	61,000	5,405,210.00	4.10
4	600732	ST 新梅	700,000	4,774,000.00	3.62
5	000651	格力电器	76,500	4,207,500.00	3.19
6	600438	通威股份	269,800	3,793,388.00	2.88
7	000858	五粮液	30,800	3,632,860.00	2.76
8	600993	马应龙	100,000	1,765,000.00	1.34
9	002475	立讯精密	65,500	1,623,745.00	1.23
10	000063	中兴通讯	45,100	1,467,103.00	1.11
11	603369	今世缘	52,300	1,458,647.00	1.11
12	000568	泸州老窖	17,800	1,438,774.00	1.09
13	000596	古井贡酒	11,900	1,410,269.00	1.07
14	603288	海天味业	12,800	1,344,000.00	1.02
15	600968	海油发展	2,000	7,100.00	0.01

### 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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300006	莱美药业	19,588,703.38	14.86
2	002626	金达威	14,810,398.34	11.24
3	300118	东方日升	14,079,501.02	10.68
4	600438	通威股份	12,814,888.62	9.72
5	601012	隆基股份	9,927,074.66	7.53
6	300033	同花顺	8,212,274.14	6.23
7	300433	蓝思科技	7,496,888.00	5.69
8	600309	万华化学	6,844,592.00	5.19
9	600519	贵州茅台	6,437,434.00	4.88
10	600732	ST 新梅	6,386,423.00	4.85
11	002373	千方科技	5,882,808.40	4.46
12	600422	昆药集团	5,874,592.08	4.46
13	603083	剑桥科技	5,850,346.00	4.44
14	000858	五粮液	5,840,956.00	4.43
15	601066	中信建投	5,599,523.00	4.25

16	601318	中国平安	5,321,885.00	4.04
17	300601	康泰生物	5,246,233.60	3.98
18	300122	智飞生物	5,242,142.00	3.98
19	300400	劲拓股份	5,186,836.00	3.94
20	300174	元力股份	4,900,662.81	3.72
21	300579	数字认证	4,885,855.34	3.71
22	300724	捷佳伟创	4,611,400.00	3.50
23	000651	格力电器	4,391,620.00	3.33
24	002385	大北农	4,236,677.00	3.21
25	603232	格尔软件	3,987,080.70	3.02
26	601688	华泰证券	3,965,787.00	3.01
27	601108	财通证券	3,924,420.00	2.98
28	603086	先达股份	3,909,543.00	2.97
29	002891	中宠股份	3,909,025.00	2.97
30	603000	人民网	3,894,486.11	2.95
31	603986	兆易创新	3,882,499.56	2.95
32	300107	建新股份	3,509,970.00	2.66
33	000413	东旭光电	3,472,692.62	2.63
34	002129	中环股份	3,464,840.12	2.63
35	000568	泸州老窖	3,291,792.00	2.50
36	000830	鲁西化工	2,942,410.00	2.23
37	600426	华鲁恒升	2,940,383.01	2.23
38	600176	中国巨石	2,937,407.00	2.23
39	600131	岷江水电	2,936,286.35	2.23
40	002258	利尔化学	2,934,211.00	2.23
41	002565	顺灏股份	2,931,622.00	2.22
42	002198	嘉应制药	2,931,584.00	2.22
43	300552	万集科技	2,922,480.00	2.22
44	300570	太辰光	2,917,459.80	2.21

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300006	莱美药业	19,641,047.63	14.90
2	002626	金达威	14,116,210.00	10.71
3	601012	隆基股份	10,543,096.20	8.00
4	600438	通威股份	9,174,373.00	6.96
5	300033	同花顺	8,641,745.00	6.56
6	300433	蓝思科技	7,603,020.00	5.77
7	600309	万华化学	7,031,438.00	5.33
8	600422	昆药集团	6,817,598.53	5.17
9	603083	剑桥科技	5,930,688.40	4.50
10	601066	中信建投	5,741,122.00	4.36
11	002373	千方科技	5,160,198.00	3.92
12	300400	劲拓股份	5,107,368.52	3.87
13	300601	康泰生物	4,977,988.18	3.78

14	300724	捷佳伟创	4,739,396.00	3.60
15	300122	智飞生物	4,701,916.00	3.57
16	300579	数字认证	4,456,319.00	3.38
17	300174	元力股份	4,335,861.00	3.29
18	603986	兆易创新	4,084,206.10	3.10
19	603086	先达股份	4,007,575.00	3.04
20	002385	大北农	3,840,421.00	2.91
21	601108	财通证券	3,812,060.00	2.89
22	601688	华泰证券	3,778,410.00	2.87
23	002198	嘉应制药	3,771,431.00	2.86
24	603000	人民网	3,758,307.00	2.85
25	300552	万集科技	3,590,160.00	2.72
26	603232	格尔软件	3,572,589.61	2.71
27	002129	中环股份	3,477,746.00	2.64
28	000413	东旭光电	3,395,076.48	2.58
29	002891	中宠股份	3,393,542.00	2.57
30	300107	建新股份	3,322,901.00	2.52
31	000858	五粮液	3,119,120.00	2.37
32	600131	岷江水电	3,075,095.26	2.33
33	600176	中国巨石	3,071,729.20	2.33
34	300570	太辰光	2,939,536.00	2.23
35	600426	华鲁恒升	2,937,381.00	2.23
36	002565	顺灏股份	2,912,770.00	2.21
37	000830	鲁西化工	2,890,680.00	2.19
38	600732	ST 新梅	2,814,602.00	2.14
39	300540	深冷股份	2,720,986.00	2.06

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

#### 7.4.3 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	291,144,194.79
卖出股票的收入（成交）总额	241,649,247.14

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，除东方日升（300118）的发行主体东方日升新能源股份有限公司外，没有出现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、处罚的情形。

2019年3月23日，东方日升新能源股份有限公司发布公告称，因违反《上市公司信息披露管理办法》的相关规定，中国证券监督管理委员会宁波监管局对其处以采取责令改正的行政监管措施。

对该证券投资决策程序的说明：

根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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	83,487.24
2	应收证券清算款	213,650.43
3	应收股利	-
4	应收利息	7,193.43
5	应收申购款	8,235.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	312,566.70

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
2,047	64,963.43	10,000,000.00	7.52%	122,980,137.17	92.48%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	620,069.07	0.47%

### 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、基金投资和部门负责人未持有本基金；  
2. 本基金基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年1月29日）基金份额总额	345,857,413.94
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,541,375.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	223,418,651.91
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	132,980,137.17

## § 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。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管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 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安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	274,846,281.35	51.59%	200,995.75	51.59%	新增 1 个
招商证券	1	182,114,686.20	34.18%	133,182.53	34.18%	新增 1 个
海通证券	2	75,828,394.38	14.23%	55,452.47	14.23%	新增 2 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，我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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；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
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	318,442.00	100.00%	3,186,200,000.00	93.71%	-	-
海通证券	-	-	213,700,000.00	6.29%	-	-

### 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	证券时报	2019-05-22
2	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	证券时报	2019-05-16
3	博时汇悦回报混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报	2019-04-22
4	关于博时旗下部分基金开通直销网上交易定期投资业务的公告	证券时报	2019-03-30
5	关于博时汇悦回报混合参加部分代销机构费率优惠活动的公告	证券时报	2019-03-25
6	博时汇悦回报混合型证券投资基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告	证券时报	2019-03-22
7	博时汇悦回报混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报	2019-03-22
8	关于博时旗下部分开放式基金增加福建海峡银行股份有限公司为代销机构的公告	证券时报	2019-02-26
9	博时汇悦回报混合型证券投资基金-基金合同生效公告	证券时报	2019-01-30
10	关于博时汇悦回报混合基金增加部分券商渠道为代销机构的公告	证券时报	2019-01-22
11	关于博时汇悦回报混合基金增加部分券商渠道为代销机构的公告	证券时报	2019-01-10
12	20190107 关于博时汇悦回报混合基金增加工商银行作为代销机构的公告	证券时报	2019-01-07
13	关于博时汇悦回报混合基金增加部分券商渠道为代销机构的公告	证券时报	2019-01-07
14	20190104 关于博时汇悦回报混合基金增加中信银行为代销机构的公告	证券时报	2019-01-04
15	博时基金管理有限公司关于在直销网上交易开展博时汇悦回报混合型证券投资基金认购	证券时报	2019-01-03

	费率优惠活动的公告		
16	关于博时汇悦回报混合基金增加部分渠道为代销机构的公告	证券时报	2019-01-03
17	20190102 关于博时汇悦回报混合基金增加部分银行为代销机构的公告	证券时报	2019-01-02

## § 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汇悦回报混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时汇悦回报混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时汇悦回报混合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 报告期内博时汇悦回报混合型证券投资基金在指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）

二〇一九年八月二十七日