

博时沪港深成长企业混合型证券投资基金 2020 年中期报告 2020 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 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	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	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
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	9
§5 托管人报告	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	9
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	9
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	27
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	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	28
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	33
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	34
§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	35
§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	36
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	38
§ 12 备查文件目录	38
12.1 备查文件目录	38
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	博时沪港深成长企业混合型证券投资基金
基金简称	博时沪港深成长企业混合
基金主代码	001824
交易代码	001824
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 2 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,680,854.69 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极挖掘 A 股和港股市场（通过港股通）的成长性行业和企业所蕴含的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次：首先是大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业发展规律和内在逻辑，在不同行业之间进行动态配置；最后是个股选择策略和债券投资策略。
业绩比较基准	中国债券总财富指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率×60%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，具有中高等风险/收益的特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	李申
	联系电话	0755-83169999	021-60637102
	电子邮箱	service@bosera.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	021-60637111
传真		0755-83195140	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		江向阳	田国立

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
----------------	------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	121,899.45
本期利润	521,700.82
加权平均基金份额本期利润	0.1676
本期加权平均净值利润率	13.29%
本期基金份额净值增长率	19.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	695,595.79
期末可供分配基金份额利润	0.2595
期末基金资产净值	3,940,060.33
期末基金份额净值	1.470
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	47.00%

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

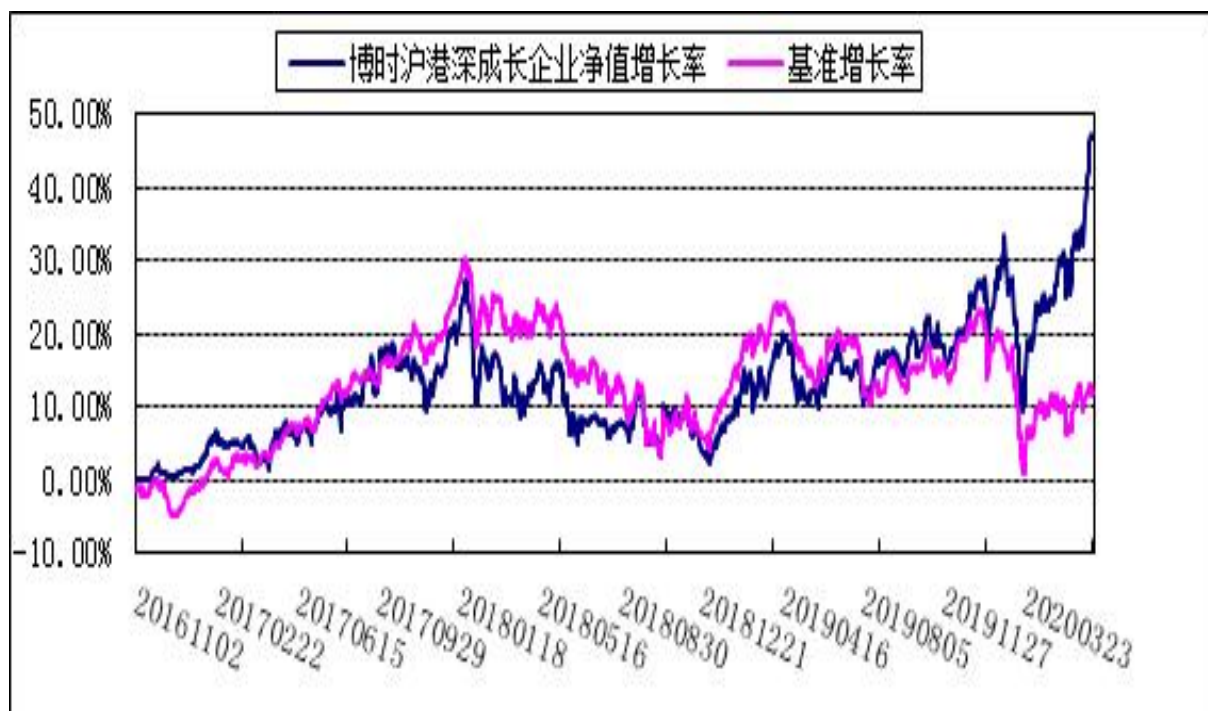
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	15.38%	1.36%	5.20%	1.01%	10.18%	0.35%
过去三个月	23.01%	1.38%	4.57%	1.06%	18.44%	0.32%
过去六个月	19.90%	1.76%	-7.08%	1.34%	26.98%	0.42%
过去一年	26.29%	1.35%	-5.83%	1.06%	32.12%	0.29%
过去三年	38.29%	1.17%	3.87%	0.92%	34.42%	0.25%
自基金合同生效起至今	47.00%	1.08%	12.18%	0.86%	34.82%	0.22%

注：本基金的业绩比较基准为：中国债券总财富指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率×60%。

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 20%、20%、60%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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12150 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 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO” (Winner, China CEO

of the Year-Jiang Xiangyang)，博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020年3月31日，《中国证券报》第十七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信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020年3月26日，Morningstar 晨星（中国）2020年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类428只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020年度激进债券型基金奖”。

2020年1月10日，新京报“开放 普惠 科技”2019金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019年度杰出社会责任影响力企业”。

2020年1月4日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在ESG投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
牟星海	权益投资国际组负责人/基金经理	2019-06-10	-	26.8	牟星海先生，硕士。1993年起先后在美国保诚金融控股公司、美银证券、美国雷曼兄弟控股公司、光大控股公司、布鲁克投资公司、先锋投资合伙公司、申万宏源（香港）公司、新韩法国巴黎资产管理公司、申万宏源（香港）公司从事研究、投资、管理等工作。2019年加入博时基金管理有限公司。现任权益投资国际组负责人兼博时沪港深成长企业混合型证券投资基金（2019年6月10日一至今）、博时大中华亚太精选股票证券投资基金（2020年5月21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、取信于社会的原則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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 93 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

2020 年上半年突发的全球性新冠疫情给很多行业及企业带来不同程度的危和机。受损的行业包括消费中的餐饮和旅游等服务业，传统制造业，及经济相关度较高的金融和中小微企业。受益的行业包括医疗器械，新冠检测，互联网服务，及必选消费等行业。全球范围内，中国抗疫情的成绩最为显著，成为首个第二季度获 GDP 正增长的主要国家和经济体。抗疫成功使得社会信心迅速恢复，是二季度经济复苏的基础。

投资策略上，继续看好经济转型升级中的科技创新和新基建领域，包括新型消费，互联网服务和游戏，5G，云计算，创新医药，医疗设备，新能源汽车，光伏，金融科技等领域中的长期机会。相对回避中美相关性高的传统行业、高负债类、重资产及重资源类、估值过高类的股票，偏向于基本面稳健，下跌风险可控，短期和长期优势确定性较高，分红率较高，商业模式新型的企业。上半年市场结构性机会较多，下半年经济复苏的周期性机会可盼望。保持中高仓位的股票配置。关注的风险包括中美地缘政治竞争，疫情在中国的二次爆发，等等。

港股市场经历了自去年六月后一年的本地闹事，目前基本已回归稳定阶段。新国安法出台后，有力的打击了在港分裂反动势力，稳定香港政治经济局面，提振投资者信心，流动性明显提升，中资外资积极流入港股市场。另外，中概股的集体回归也将很大程度提振香港资本市场的吸引力和信心，提供更多优质龙头标的。港股市场目前整体估值仍然相对低，恒指的各类估值指标均低于历史平均及落后于 A 股及美股市场。在经济触底反弹之际，我们认为是相对较好的资产和投资领域。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.470 元，份额累计净值为 1.470 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 19.90%，同期业绩基准增长率-7.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度和下半年，建议继续在不确定中寻找确定性机会。今年美国大选和故意抹黑甩锅中国给

三季度制造了一些不确定性，短期会不时影响市场情绪。另外需密切关注全球防疫控制及对中国企业的影响。在这些大环境下，仍然保持经济触底回升的下半年预测，中国和国际各国政策相对支持，股市应震荡向上，周期和金融板块值得关注和增持。我们继续相信中国经济相关度高的资产将优于欧美资产，中国不仅在需求端还是供给端都表现好于西方国家，最具有修复的确定性。在全球停产期间，中国制造业产能恢复的最先，经济复苏周期领先于欧美并起到典范作用，因此中国股市在下半年应该得到全球投资者的青睐和追求。港股作为中国股市中的核心资产，价值凸显，应该得到更多国内外投资者的配置。从宏观和微观层面看，中国经济及重要企业将在明后年仍有很好的发展空间。

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

本报告期内本基金未进行收益分配。

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连续了 60 个工作日资产净值低于五千万元的情形。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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：博时沪港深成长企业混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	140,104.61	4,449.32
结算备付金		37,737.48	157,303.93
存出保证金		3,767.04	183,499.03
交易性金融资产	6.4.3.2	3,752,656.97	3,067,775.40
其中：股票投资		3,582,401.97	2,896,500.40
基金投资		-	-
债券投资		170,255.00	171,275.00
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		267,933.13	222,572.41
应收利息	6.4.3.5	5,515.08	2,605.69
应收股利		9,873.91	-
应收申购款		131,153.32	11,882.17
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		4,348,741.54	3,650,087.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	258,998.49
应付赎回款		371,499.43	17,372.29
应付管理人报酬		1,880.80	1,660.34
应付托管费		783.66	691.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	13,906.14	11,885.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	20,611.18	34,541.21
负债合计		408,681.21	325,149.42
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.3.9	2,680,854.69	2,711,973.40
未分配利润	6.4.3.10	1,259,205.64	612,965.13
所有者权益合计		3,940,060.33	3,324,938.53
负债和所有者权益总计		4,348,741.54	3,650,087.95

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.470 元，基金份额总额 2,680,854.69 份。

6.2 利润表

会计主体：博时沪港深成长企业混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
一、收入		636,872.77	444,379.21
1. 利息收入		6,104.02	4,227.85
其中：存款利息收入	6.4.3.11	3,161.90	3,870.29
债券利息收入		2,942.12	29.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	328.42
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		219,603.46	212,607.22
其中：股票投资收益	6.4.3.12	205,378.22	190,343.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.3.15	14,225.24	22,263.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	399,801.37	221,326.64
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	11,363.92	6,217.50
减：二、费用		115,171.95	67,402.78
1. 管理人报酬		11,759.47	9,367.96
2. 托管费		4,899.76	3,903.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	76,096.94	19,596.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.09
7. 其他费用	6.4.3.19	22,415.78	34,535.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		521,700.82	376,976.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		521,700.82	376,976.43

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时沪港深成长企业混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	2,711,973.40	612,965.13	3,324,938.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	521,700.82	521,700.82
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）	-31,118.71	124,539.69	93,420.98
其中：1. 基金申购款	3,066,583.14	840,798.74	3,907,381.88
2. 基金赎回款	-3,097,701.85	-716,259.05	-3,813,960.90
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）	2,680,854.69	1,259,205.64	3,940,060.33
项目	上年度可比期间		

	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）	3,656,256.09	157,609.76	3,813,865.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	376,976.43	376,976.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,184,402.35	-129,762.31	-1,314,164.66
其中：1. 基金申购款	997,958.33	135,570.21	1,133,528.54
2. 基金赎回款	-2,182,360.68	-265,332.52	-2,447,693.20
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）	2,471,853.74	404,823.88	2,876,677.62

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 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	140,104.61
定期存款	-
其他存款	-
合计	140,104.61

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,025,094.69	3,582,401.97	557,307.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	171,428.00	170,255.00	-1,173.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	171,428.00	170,255.00	-1,173.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,196,522.69	3,752,656.97	556,134.28

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

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	61.65
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	17.16
应收债券利息	5,429.10
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	-
应收出借证券利息	-
其他	7.17
合计	5,515.08

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	13,906.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,906.14

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	720.40
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	19,890.78
合计	20,611.18

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,711,973.40	2,711,973.40
本期申购	3,066,583.14	3,066,583.14
本期赎回（以“-”号填列）	-3,097,701.85	-3,097,701.85
本期末	2,680,854.69	2,680,854.69

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

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	560,498.44	52,466.69	612,965.13
本期利润	121,899.45	399,801.37	521,700.82
本期基金份额交易产生的变动数	13,197.90	111,341.79	124,539.69
其中：基金申购款	677,915.51	162,883.23	840,798.74
基金赎回款	-664,717.61	-51,541.44	-716,259.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	695,595.79	563,609.85	1,259,205.64

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	1,684.40
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	1,068.18	
其他	409.32	
合计	3,161.90	

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	卖出股票成交总额	19,855,196.06
减：卖出股票成本总额	19,649,817.84	
买卖股票差价收入	205,378.22	

6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,225.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,225.24

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	399,801.37
——股票投资	400,821.37
——债券投资	-1,020.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——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	399,801.37

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	7,343.20
基金转换费收入	4,020.72
合计	11,363.92

注：1. 本基金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 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	76,096.94
银行间市场交易费用	-

交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	76,096.94

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,025.00
中债登账户维护费	1,500.00
合计	22,415.78

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
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

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

无。

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,759.47	9,367.96
其中：支付销售机构的客户维护费	2,811.60	3,437.80

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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 X 0.60% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,899.76	3,903.37

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 X 0.25% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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
中国建设银行	140,104.61	1,684.40	466,005.79	3,526.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 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（2020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

无。

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。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金是混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在经济周期和行业景气波动下的资产稳定增值的投资目标。

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。

6.4.9.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	170,255.00	171,275.00
合计	170,255.00	171,275.00

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

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 2020 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。

6.4.9.3.1 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 6.4.8。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 2020 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 2020 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、存出保证金及买入返售金融资产等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	140,104.61	-	-	-	140,104.61
结算备付金	37,737.48	-	-	-	37,737.48
存出保证金	3,767.04	-	-	-	3,767.04
交易性金融资产	170,255.00	-	-	3,582,401.97	3,752,656.97
应收证券清算款	-	-	-	267,933.13	267,933.13
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	5,515.08	5,515.08
应收申购款	-	-	-	131,153.32	131,153.32
应收股利	-	-	-	9,873.91	9,873.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	351,864.13	-	-	3,996,877.41	4,348,741.54
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	371,499.43	371,499.43
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,880.80	1,880.80
应付托管费	-	-	-	783.66	783.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	13,906.14	13,906.14
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	20,611.18	20,611.18
负债总计	-	-	-	408,681.21	408,681.21
利率敏感度缺口	351,864.13	-	-	3,588,196.20	3,940,060.33
上年度末 2019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	4,449.32	-	-	-	4,449.32
结算备付金	157,303.93	-	-	-	157,303.93
存出保证金	183,499.03	-	-	-	183,499.03
交易性金融资产	171,275.00	-	-	2,896,500.40	3,067,775.40
应收证券清算款	-	-	-	222,572.41	222,572.41
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,605.69	2,605.69
应收申购款	-	-	-	11,882.17	11,882.17
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	516,527.28	-	-	3,133,560.67	3,650,087.95
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	17,372.29	17,372.29
应付证券清算款	-	-	-	258,998.49	258,998.49
应付管理人报酬	-	-	-	1,660.34	1,660.34
应付托管费	-	-	-	691.78	691.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	11,885.31	11,885.31
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	34,541.21	34,541.21
负债总计	-	-	-	325,149.42	325,149.42
利率敏感度缺口	516,527.28	-	-	2,808,411.25	3,324,938.53

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值比例为 4.32%（2019 年 12 月 31 日：5.15%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 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。本基金持有港股通标的的股票，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	3,234,445.37	3,234,445.37
应收股利	-	9,873.91	9,873.91
资产合计	-	3,244,319.28	3,244,319.28
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,244,319.28	3,244,319.28
项目	上年度末 2019年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	2,009,261.40	2,009,261.40
资产合计	-	2,009,261.40	2,009,261.40
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,009,261.40	2,009,261.40

敞口净额			
------	--	--	--

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 16	增加约 10
	所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 16	减少约 10

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。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，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 2020年6月30日		上年度末 2019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	3,582,401.97	90.92	2,896,500.40	87.11
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	3,582,401.97	90.92	2,896,500.40	87.11

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 44	增加约 18
	业绩比较基准下降 5%	减少约 44	减少约 18

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 2020 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 3,582,401.97 元，属于第二层次的余额为 170,255.00 元，无属于第三层次的余额 (2019 年 12 月 31 日：第一层次 2,896,500.40 元，第二层次 171,275.00 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 2020 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(2019 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	3,582,401.97	82.38

	其中：股票	3,582,401.97	82.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	170,255.00	3.92
	其中：债券	170,255.00	3.92
	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	177,842.09	4.09
8	其他各项资产	418,242.48	9.62
9	合计	4,348,741.54	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 3,234,445.37 元，占基金总资产比例 74.38%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	192,328.60	4.88
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	-	-
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	155,628.00	3.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	347,956.60	8.83

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	547,050.08	13.88
工业	249,688.82	6.34
日常消费品	344,229.86	8.74
通讯业务	364,352.95	9.25
信息技术	649,912.56	16.49
医疗保健	1,079,211.10	27.39

合计	3,234,445.37	82.09
----	--------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	0700	腾讯控股	800	364,352.95	9.25
2	3690	美团点评-W	2,300	361,146.77	9.17
3	3888	金山软件	10,000	329,295.12	8.36
4	0981	中芯国际	13,000	320,617.44	8.14
5	2269	药明生物	2,000	259,051.58	6.57
6	1066	威高股份	16,000	251,963.29	6.39
7	3319	雅生活服务	7,000	249,688.82	6.34
8	1579	颐海国际	3,000	217,718.42	5.53
9	0241	阿里健康	10,000	206,437.44	5.24
10	6169	宇华教育	32,000	185,903.31	4.72
11	002624	完美世界	2,700	155,628.00	3.95
12	1873	维亚生物	16,000	126,858.55	3.22
13	3331	维达国际	5,000	126,511.44	3.21
14	1177	中国生物制药	9,000	120,026.02	3.05
15	002901	大博医疗	1,000	119,290.00	3.03
16	300782	卓胜微	180	73,038.60	1.85
17	1558	东阳光药	4,000	57,875.56	1.47
18	0853	微创医疗	2,000	56,998.66	1.45

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	0241	阿里健康	554,556.74	16.68
2	1066	威高股份	430,438.92	12.95
3	300122	智飞生物	423,645.00	12.74
4	0981	中芯国际	412,384.33	12.40
5	2400	心动公司	408,583.95	12.29
6	1717	澳优	379,866.73	11.42
7	3319	雅生活服务	372,759.62	11.21
8	002223	鱼跃医疗	357,516.00	10.75
9	002555	三七互娱	356,497.00	10.72
10	3883	中国奥园	343,068.51	10.32
11	000333	美的集团	315,371.00	9.49
12	300482	万孚生物	287,196.00	8.64
13	2382	舜宇光学科技	277,547.25	8.35
14	1398	工商银行	275,377.90	8.28
15	2020	安踏体育	258,431.78	7.77
16	2318	中国平安	256,254.34	7.71
17	3380	龙光集团	255,146.44	7.67

18	3998	波司登	253,594.11	7.63
19	1787	山东黄金	252,960.65	7.61
20	1093	石药集团	252,434.40	7.59
21	601012	隆基股份	251,249.00	7.56
22	002624	完美世界	250,757.00	7.54
23	3888	金山软件	248,508.85	7.47
24	0777	网龙	226,759.79	6.82
25	2269	药明生物	224,738.09	6.76
26	3993	洛阳钼业	221,739.14	6.67
27	2899	紫金矿业	219,984.90	6.62
28	6169	宇华教育	214,452.90	6.45
29	1558	东阳光药	207,636.41	6.24
30	300628	亿联网络	205,667.00	6.19
31	0968	信义光能	203,247.37	6.11
32	1810	小米集团-W	194,438.25	5.85
33	1579	颐海国际	189,399.85	5.70
34	603986	兆易创新	186,349.00	5.60
35	3690	美团点评-W	185,464.84	5.58
36	1044	恒安国际	180,945.32	5.44
37	0700	腾讯控股	176,370.57	5.30
38	0288	万洲国际	173,603.07	5.22
39	2013	微盟集团	168,196.77	5.06
40	300782	卓胜微	167,433.00	5.04
41	6186	中国飞鹤	161,311.98	4.85
42	0853	微创医疗	158,651.10	4.77
43	002600	领益智造	153,849.00	4.63
44	1890	中国科培	151,898.37	4.57
45	0763	中兴通讯	149,937.34	4.51
46	600031	三一重工	147,815.00	4.45
47	2883	中海油田服务	146,339.86	4.40
48	6865	福莱特玻璃	146,282.02	4.40
49	3908	中金公司	144,989.54	4.36
50	0813	世茂集团	144,440.01	4.34
51	0884	旭辉控股集团	142,728.94	4.29
52	300014	亿纬锂能	138,132.00	4.15
53	002938	鹏鼎控股	135,921.00	4.09
54	300450	先导智能	135,788.00	4.08
55	603501	韦尔股份	133,992.00	4.03
56	000858	五粮液	130,880.00	3.94
57	1211	比亚迪股份	129,782.19	3.90
58	300659	中孚信息	127,764.00	3.84
59	002602	世纪华通	127,340.00	3.83
60	300413	芒果超媒	126,767.00	3.81
61	2313	申洲国际	126,477.35	3.80
62	2233	西部水泥	125,385.77	3.77
63	002129	中环股份	125,272.00	3.77
64	600183	生益科技	124,764.00	3.75
65	0354	中国软件国际	123,039.25	3.70
66	300760	迈瑞医疗	122,204.00	3.68
67	1177	中国生物制药	119,435.93	3.59

68	1918	融创中国	119,000.99	3.58
69	300558	贝达药业	117,730.00	3.54
70	0631	三一国际	116,961.60	3.52
71	2238	广汽集团	115,292.77	3.47
72	2338	潍柴动力	113,988.78	3.43
73	002901	大博医疗	112,516.00	3.38
74	600438	通威股份	112,500.19	3.38
75	002007	华兰生物	112,480.00	3.38
76	002607	中公教育	111,510.00	3.35
77	600585	海螺水泥	110,829.00	3.33
78	1873	维亚生物	109,670.64	3.30
79	3331	维达国际	109,131.85	3.28
80	0743	亚洲水泥（中国）	108,731.09	3.27
81	2607	上海医药	108,207.70	3.25
82	002475	立讯精密	107,904.00	3.25
83	0390	中国中铁	107,623.50	3.24
84	1833	平安好医生	106,761.43	3.21
85	002127	南极电商	106,160.00	3.19
86	603688	石英股份	105,640.00	3.18
87	002463	沪电股份	105,360.00	3.17
88	300070	碧水源	104,500.00	3.14
89	300003	乐普医疗	103,179.00	3.10
90	300601	康泰生物	102,784.00	3.09
91	002467	二六三	102,220.00	3.07
92	0728	中国电信	101,967.21	3.07
93	300454	深信服	101,604.00	3.06
94	300676	华大基因	101,323.00	3.05
95	0914	海螺水泥	100,854.69	3.03
96	300567	精测电子	97,887.00	2.94
97	1347	华虹半导体	97,646.81	2.94
98	1908	建发国际集团	95,991.71	2.89
99	0839	中教控股	95,531.23	2.87
100	300408	三环集团	95,411.00	2.87
101	1610	中粮肉食	95,049.16	2.86
102	603876	鼎胜新材	94,009.00	2.83
103	603228	景旺电子	91,674.00	2.76
104	1302	先健科技	89,858.60	2.70
105	6862	海底捞	89,723.50	2.70
106	300463	迈克生物	88,702.00	2.67
107	000725	京东方 A	88,566.00	2.66
108	2331	李宁	88,180.05	2.65
109	0285	比亚迪电子	85,522.03	2.57
110	601838	成都银行	84,800.00	2.55
111	0175	吉利汽车	84,440.71	2.54
112	0016	新鸿基地产	83,868.18	2.52
113	1797	新东方在线	82,914.17	2.49
114	6869	长飞光纤光缆	82,242.75	2.47
115	1813	合景泰富集团	81,562.95	2.45
116	6030	中信证券	81,028.20	2.44
117	000568	泸州老窖	79,981.00	2.41

118	1478	丘钛科技	72,506.70	2.18
119	6098	碧桂园服务	72,000.77	2.17
120	0667	中国东方教育	71,799.86	2.16
121	0788	中国铁塔	71,311.60	2.14
122	0694	北京首都机场股份	68,929.83	2.07

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	300122	智飞生物	451,673.01	13.58
2	000333	美的集团	438,146.90	13.18
3	2400	心动公司	422,903.09	12.72
4	0241	阿里健康	407,365.35	12.25
5	3883	中国奥园	402,737.01	12.11
6	1717	澳优	397,363.54	11.95
7	002555	三七互娱	388,596.00	11.69
8	2318	中国平安	369,011.65	11.10
9	002223	鱼跃医疗	368,807.00	11.09
10	3380	龙光集团	337,068.15	10.14
11	601012	隆基股份	330,486.00	9.94
12	300450	先导智能	325,353.04	9.79
13	600031	三一重工	315,237.00	9.48
14	002129	中环股份	313,567.00	9.43
15	300482	万孚生物	280,230.00	8.43
16	1398	工商银行	279,841.18	8.42
17	2382	舜宇光学科技	274,841.26	8.27
18	1810	小米集团-W	273,285.77	8.22
19	2020	安踏体育	260,552.62	7.84
20	3993	洛阳钼业	246,792.99	7.42
21	3998	波司登	239,554.15	7.20
22	1918	融创中国	237,959.03	7.16
23	1787	山东黄金	233,837.70	7.03
24	2313	申洲国际	228,215.02	6.86
25	1066	威高股份	227,322.07	6.84
26	1093	石药集团	217,758.90	6.55
27	2899	紫金矿业	213,769.07	6.43
28	0743	亚洲水泥（中国）	203,218.80	6.11
29	0968	信义光能	200,999.42	6.05
30	1044	恒安国际	200,143.78	6.02
31	3908	中金公司	199,764.81	6.01
32	300628	亿联网络	195,406.00	5.88
33	0777	网龙	184,679.41	5.55
34	0288	万洲国际	184,276.77	5.54
35	603986	兆易创新	180,425.00	5.43
36	1890	中国科培	177,349.64	5.33
37	0981	中芯国际	176,870.47	5.32

38	3808	中国重汽	174,947.52	5.26
39	0914	海螺水泥	171,887.98	5.17
40	1347	华虹半导体	170,281.94	5.12
41	2013	微盟集团	169,334.46	5.09
42	6865	福莱特玻璃	168,784.98	5.08
43	3690	美团点评-W	164,467.05	4.95
44	0285	比亚迪电子	161,238.50	4.85
45	600183	生益科技	157,500.00	4.74
46	0813	世茂集团	156,732.02	4.71
47	0763	中兴通讯	155,476.27	4.68
48	1558	东阳光药	148,171.29	4.46
49	002602	世纪华通	145,600.00	4.38
50	300413	芒果超媒	143,617.00	4.32
51	0884	旭辉控股集团	143,415.84	4.31
52	0868	信义玻璃	142,978.18	4.30
53	6186	中国飞鹤	142,304.19	4.28
54	600438	通威股份	140,661.00	4.23
55	2883	中海油田服务	136,423.38	4.10
56	0700	腾讯控股	136,360.91	4.10
57	002127	南极电商	133,875.00	4.03
58	0631	三一国际	132,433.40	3.98
59	1211	比亚迪股份	132,185.90	3.98
60	300014	亿纬锂能	129,950.00	3.91
61	002600	领益智造	128,280.00	3.86
62	002607	中公教育	125,444.00	3.77
63	000858	五粮液	122,290.00	3.68
64	300760	迈瑞医疗	121,569.00	3.66
65	300558	贝达药业	121,306.00	3.65
66	3319	雅生活服务	120,427.86	3.62
67	300659	中孚信息	120,000.00	3.61
68	300782	卓胜微	119,627.00	3.60
69	300207	欣旺达	119,050.00	3.58
70	0728	中国电信	114,516.45	3.44
71	2233	西部水泥	114,122.76	3.43
72	300463	迈克生物	113,704.00	3.42
73	603501	韦尔股份	112,910.00	3.40
74	2607	上海医药	112,588.77	3.39
75	600585	海螺水泥	111,300.00	3.35
76	1908	建发国际集团	111,276.41	3.35
77	002475	立讯精密	110,331.00	3.32
78	603688	石英股份	109,081.00	3.28
79	0853	微创医疗	108,603.07	3.27
80	002463	沪电股份	108,000.00	3.25
81	002938	鹏鼎控股	107,912.00	3.25
82	002007	华兰生物	107,000.00	3.22
83	2238	广汽集团	106,676.65	3.21
84	002624	完美世界	104,540.00	3.14
85	002467	二六三	104,400.00	3.14
86	300454	深信服	103,475.00	3.11
87	300567	精测电子	103,375.00	3.11

88	1833	平安好医生	102,751.36	3.09
89	300070	碧水源	102,000.00	3.07
90	0354	中国软件国际	101,364.04	3.05
91	0390	中国中铁	99,827.37	3.00
92	0839	中教控股	98,509.82	2.96
93	300003	乐普医疗	97,605.00	2.94
94	2338	潍柴动力	96,796.68	2.91
95	1610	中粮肉食	96,187.62	2.89
96	300601	康泰生物	95,996.00	2.89
97	300676	华大基因	94,338.00	2.84
98	1813	合景泰富集团	93,636.74	2.82
99	300136	信维通信	89,534.00	2.69
100	000725	京东方 A	87,660.00	2.64
101	000568	泸州老窖	87,600.00	2.63
102	603228	景旺电子	86,960.00	2.62
103	300408	三环集团	85,553.00	2.57
104	2331	李宁	85,303.81	2.57
105	0016	新鸿基地产	83,832.21	2.52
106	1797	新东方在线	83,207.19	2.50
107	1302	先健科技	81,957.76	2.46
108	603876	鼎胜新材	81,870.00	2.46
109	601838	成都银行	81,500.00	2.45
110	1928	金沙中国有限公司	81,176.16	2.44
111	6862	海底捞	80,834.49	2.43
112	6098	碧桂园服务	78,595.51	2.36
113	6869	长飞光纤光缆	78,583.45	2.36
114	1772	赣锋锂业	78,407.95	2.36
115	0667	中国东方教育	71,047.12	2.14
116	1233	时代中国控股	69,911.32	2.10
117	6030	中信证券	69,492.75	2.09
118	0175	吉利汽车	68,904.81	2.07
119	0001	长和	66,957.48	2.01
120	0788	中国铁塔	66,796.27	2.01

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	19,934,898.04
卖出股票的收入（成交）总额	19,855,196.06

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	170,255.00	4.32
	其中：政策性金融债	170,255.00	4.32

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	170,255.00	4.32

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

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	018007	国开 1801	1,700	170,255.00	4.32

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

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	3,767.04
2	应收证券清算款	267,933.13
3	应收股利	9,873.91
4	应收利息	5,515.08

5	应收申购款	131,153.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	418,242.48

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
499	5,372.45	0.00	0.00%	2,680,854.69	100.00%

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	419,420.85	15.65%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：本基金的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（2016年11月2日）基金份额总额	202,440,699.85
本报告期初基金份额总额	2,711,973.40
本报告期基金总申购份额	3,066,583.14

减：本报告期基金总赎回份额	3,097,701.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,680,854.69

§ 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
国泰君安	2	39,790,094.10	100.00%	33,759.33	100.00%	-

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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司业务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
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	博时沪港深成长企业混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-22
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-17
6	博时沪港深成长企业混合型证券投资基金 2019 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-27
7	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
8	博时沪港深成长企业混合型证券投资基金	证券时报、基金管理人	2020-01-17

2019 年第 4 季度报告	网站、证监会基金电子披露网
----------------	---------------

§ 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者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2020-01-09~2020-03-17	362,076.69	635,819.23	781,357.18	216,538.74	8.08%

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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沪港深成长企业混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时沪港深成长企业混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时沪港深成长企业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 博时沪港深成长企业混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时沪港深成长企业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、基金托管人处

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
二〇二〇年八月三十一日