

博时富时中国 A 股指数证券投资基金

2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月三十一日

§ 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 2018 年 3 月 30 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。

本报告期自 2017 年 9 月 29 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
§ 4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§ 5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§ 6 审计报告.....	16
6.1 审计意见.....	16
6.2 形成审计意见的基础.....	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	16
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	17
§ 7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§ 8 投资组合报告.....	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67

8.6 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	67
8.7 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	67
8.8 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	67
8.9 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	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 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情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 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	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 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	8,976,215.05 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	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29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深南大道 7088号招商银行大厦29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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特 殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中 心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	516,890.73
本期利润	438,577.59
加权平均基金份额本期利润	0.0080
本期加权平均净值利润率	0.80%
本期基金份额净值增长率	0.77%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末

期末可供分配利润	69,043.60
期末可供分配基金份额利润	0.0077
期末基金资产净值	9,045,258.65
期末基金份额净值	1.0077
3.1.3 累计期末指标	2017 年末
基金份额累计净值增长率	0.77%

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

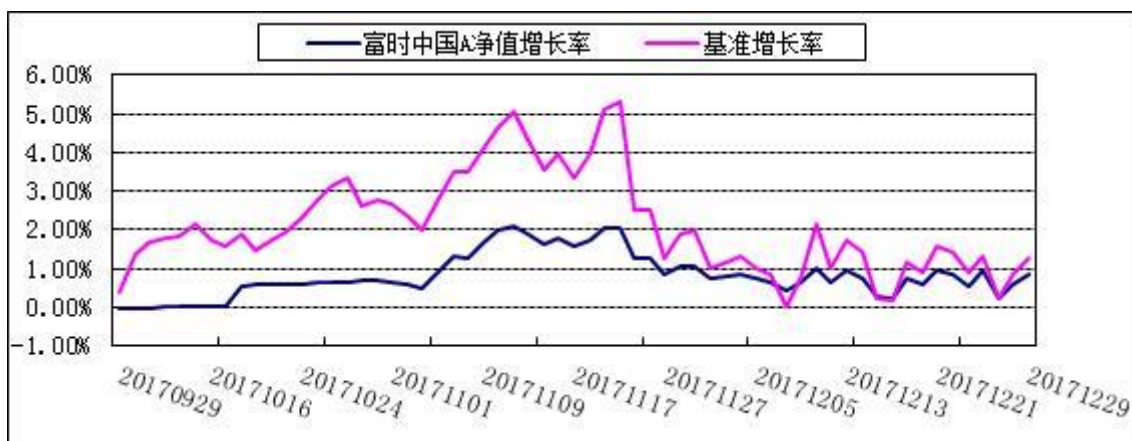
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.77%	0.26%	0.89%	0.69%	-0.12%	-0.43%
自基金合同生效起至今	0.77%	0.26%	1.26%	0.68%	-0.49%	-0.42%

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

博时富时中国 A 股指数证券投资基金

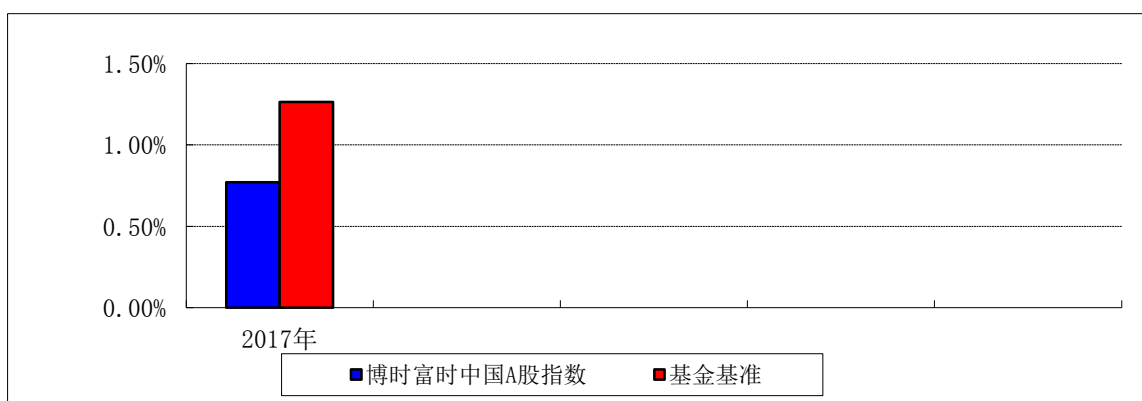
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2017 年 9 月 29 日至 2017 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时富时中国 A 股指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2017 年 9 月 29 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2017 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 192 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，管理资产总规模约 7587 亿元人民币，其中非货币公募基金规模约 2254 亿元人民币，累计分红逾 828 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2017 年 4 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时上证 50ETF、博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率分别为 30.41%、28.81%，同类排名分别为前 1/8 和前 1/6；博时裕富沪深 300 指数(A 类)今年以来净值增长率排名前 1/6；股票型分级子基金里，博时中证银行指数分级(B)今年以来净值增长率为 43.97%，同类基金中排名前 1/6；混合偏股型基金中，博时主题行业混合(LOF)今年以来净值增长率为 31.96%，同类基金排名位居前 1/6，博时行业轮动混合今年以来净值增长率为 27.90%，同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时外延增长主题灵活配置混合基金今年以来净值增长率分别为 32.12%，同类基金排名位于前 1/12，博时互联网主题灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)基金今年以来净值增长率分别为 23.79%、24.01%，同类基金中排名位于前 1/3。

黄金基金类，博时黄金 ETF(D 类)今年以来净值增长率 4.00%，同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时裕盛纯债债券今年以来净值增长率为 3.63%，同类 170 只基金中排名前 10，博时聚润纯债债券今年以来净值增长率分别为 3.45%，同类基金排名位于前 1/10，博时裕昂纯债债券、博时裕创纯债债券等今年以来净值增长率排名前 1/8，博时裕安纯债债券、博时智臻纯债债券等今年以来净值增长率排名前 1/6；货币基金类，博时合利货币、博时外服货币今年以来净值增长率分别为 4.26%、4.23%，在 227 只同类基金排名中位列第 8 位与第 11 位。

QDII 基金方面，博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时亚洲票息收益债券(QDII)(美元)，今年以来净值增长率分别为 0.23%、6.38%，同类排名均位于前 2/4。

2、其他大事件

2017 年 12 月 13 日—12 月 15 日，由华尔街见闻主办的“2017 全球投资峰会及颁奖典礼活动”和由时代周报主办的“2017(南翔)年度盛典暨 2017‘金桔奖’颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金分别斩获“年度卓越公募基金”和“最佳财富管理机构”两项颇具份量的公司大奖。

2017 年 12 月 8 日，由经济观察报与上海国际信托有限公司联合主办的“观察家金

融峰会”暨“2016-2017 中国卓越金融奖”颁奖典礼在北京召开，博时基金实力荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2017 年 12 月 5 日，北京商报联手北京市品牌协会主办的“2017 北京金融论坛暨年度北京金融业十大品牌评选”在京揭晓。博时基金凭借优秀的品牌建设及卓越的品牌推广力，在本次论坛中荣获“品牌推广卓越奖”。

2017 年 11 月 27 日，由南方都市报和中国金融改革研究院共同主办的 2017 年（第三届）CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金在此次大会上荣获“年度最佳基金公司大奖”，值得一提的是，这是博时基金第三次获得该项殊荣。

2017 年 11 月 24 日，由《新财富》杂志社主办的“第十五届新财富最佳分析师”评选颁奖盛典在深圳举行博时基金捧得新财富十五周年特别大奖——3i 最智慧投资机构。

2017 年 10 月 19 日，外汇交易中心公布 2017 年第三季度银行间本币市场活跃交易商名单。博时基金管理有限公司荣誉入选“债券市场活跃交易商”。

2017 年 9 月 24 日，由南方财经全媒体集团和 21 世纪传媒举办的 21 世纪国际财经峰会在深圳举行，博时基金荣获“2017 年度基金管理公司金帆奖”。

2017 年 8 月 6 日，首届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行，在基金公司综合奖方面，博时基金获得“群星奖”；在基金公司单项奖方面，博时基金获得“纯债型基金管理奖”、“一级债基金管理奖”、“二级债基金管理奖”三大奖项；在基金产品单项奖方面，博时信用债券 A/B（050011）获得“二级债基金”奖，博时裕富沪深 300 指数 A（050002）获“指数型基金”奖；在本次五星基金明星经理奖的颁奖环节，由于博时外服货币、博时双月薪定期支付债券以及博时信用债券 A/B 在 2017 年第二季度持续获得济安金信五星评级，三只基金的基金经理魏桢、过钧及陈凯杨更是因此获得“五星基金明星奖”的荣誉称号。

2017 年 6 月 23 日，由南方日报社主办的“2017 年南方金融峰会暨第六届金榕奖颁奖典礼”在广州举行，博时基金获得“年度资产管理优秀奖”。

2017 年 6 月 17 日，由中国证券报主办的“全球配置时代海外投资动力与机遇——首届海外基金金牛奖颁奖典礼暨高端论坛”在深召开，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司荣获“一年期海外金牛私募管理公司（固定收益策略）”。

2017 年 5 月 12 日，由中国基金报主办的第四届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在深召开。博时摘得“2016 年度十大明星基金公司奖”和“2016 年度固定收益投资明星团队奖”两项公司类大奖，博时双月薪和博时稳定价值获“三年持续回报普通

债券型明星基金奖”、博时新财富获“2016 年度绝对收益明星基金奖”、博时信用债纯债获“2016 年度积极债券型明星基金奖”、博时信用债券获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2017 年 4 月 25 日，在由中国基金报主办的第四届中国基金业英华奖颁奖典礼暨高峰论坛上，博时基金过钧获评“三年期二级债最佳基金经理”、“五年期二级债最佳基金经理”，陈凯杨获评“三年期纯债型最佳基金经理”。

2017 年 4 月 20 日，博时基金在 2017 中国基金业峰会暨第十四届中国“金基金”奖颁奖典礼上，获得“2016 年度金基金·TOP 公司奖”。

2017 年 4 月 8 日，在第十四届中国基金业金牛奖颁奖典礼上，博时基金被评为“2016 年度固定收益投资金牛基金公司”，旗下博时卓越品牌混合（160512）被评为“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”、博时主题行业（160505）获“2016 年度开放式混合型金牛基金”、博时信用债券（050011）获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”、博时信用债纯债债券（050027）获“2016 年度开放式债券型金牛基金”。

2017 年 3 月 10 日，由中国工商银行私人银行部举办的“第十八届资本市场投资论坛会议”在杭州落下帷幕。工行私行对管理人的过往表现给予充分肯定并对 2016 年表现突出的管理人进行了表彰，博时基金荣获“2016 年度优秀管理人奖”。

2017 年 2 月 22 日，第二届中国基金业营销创新高峰论坛暨“金果奖”颁奖典礼在京举办，博时基金一举斩获最佳品牌形象建设奖、最具创新精神奖、最佳自媒体建设奖三项大奖。

2017 年 1 月 19 日，深交所召开了新一代交易系统上线运行总结会，会上介绍了深交所新一代交易系统运行情况，并表彰了在新一代交易系统上线过程中，积极参与各项准备和测试工作，为系统顺利上线做出突出贡献的单位和个人。博时基金被授予新一代交易系统建设先行者、突出贡献单位殊荣。博时基金信息技术部车宏原、陈小平、祁晓东被授予突出贡献奖殊荣。

2017 年 1 月 16 日，博时基金荣登中央国债登记结算有限责任公司评选的“优秀资产管理机构”榜单，成为全国十家获此殊荣的基金公司之一。

2017 年 1 月 12 日，由华夏时报、新浪财经联合主办的“第十届金蝉奖颁奖典礼”上，博时基金荣获“2016 年度市场营销力公司”奖项。

2017 年 1 月 10 日，由信息时报主办的“2016 年度金狮奖金融行业风云榜”颁奖典礼于广州盛大举办，博时基金斩获“年度最佳投研基金公司”大奖。

2017 年 1 月 6 日，由东方财富网、天天基金网主办的“2016 东方财富风云榜”评选活动于广州举行，博时基金荣膺“2016 年度最佳基金公司”大奖，同时，旗下产品博时银智 100 荣获“2016 年度最受欢迎新发基金奖”。

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		
万琼	基金经理	2017-09-29	-	10.9	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，历任投资助理，基金经理助理。现任博时上证超大盘 ETF 基金、博时上证超大盘 ETF 联接基金、博时上证自然资源 ETF 基金、博时上证自然资源 ETF 联接基金、博时标普 500ETF 基金、博时标普 500ETF 联接(QDII)基金、博时富时中国 A 股指数基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明

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，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 公平交易制度和控制方法

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

同投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年是资本市场结构分化的一年，宏观主旋律是“结构变化、金融监管”。2017 年前三季度 6.9% 的经济增长好于年初预期。除了外部环境较为有利，净出口对我国经济增长拉动由负转正外，我国经济结构也发生一些变化。具体来说，（1）2017 年前三季度制造业、新兴产业及消费相关服务业增长更快，而建筑业、金融业与房地产业增速显著回落；（2）工业生产明显反弹，制造业 PMI 连续处于景气区间，工业企业利润仍保持高速增长。从资金面的角度看，中性偏紧平衡的货币政策叠加金融去杠杆的持续推进，货币增速显著回落，全年资金面偏紧。从汇率角度看，人民币兑美元汇率回归双向波动，2017 年以来人民币对美元累计升值 5% 以上，打破了 2016 年的持续贬值预期，资金外流压力较小。

宏观经济的结构性变化映射到股票市场，带来了股市的“冰火两重天”结构性行情，2017 年全年，3000 多只股票中，仅有 700 多只的涨幅为正，行情集中度较高，上涨个股主要集中在高景气的白马龙头股，白酒、白色家电表现异常抢眼。分季度看，第一季度，在一带一路政策催化下，一带一路主题表现抢眼；受益于军工政策、航母下水等影响，军工行业也出现了不错的上涨。第二季度，受市场对经济悲观预期影响，资金抱团于白酒、白电状态明显；而金融板块在金融去杠杆压制下触底反弹；主题上，在国家推出雄安新区发展战略背景下，雄安新区概念板块表现较好；第三季度，大宗商品上涨，市场对经济预期乐观，周期板块呈现出全面开花行情，有色金属、钢铁煤炭涨幅领先。主题上，5G 概念、与新能源相关的锂电池、稀土永磁表现较好；第四季度，宏观经济数据回落叠加资金面紧张，资金又出现抱团取暖，白酒、白电、保险等板块表现较好。

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 2017 年 12 月 31 日,本基金基金份额净值为 1.0077 元,份额累计净值为 1.0077 元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为 0.77%,同期业绩基准增长率 1.26%。

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 2018 年,宏观方面,中国经济社会将更加注重经济发展质量和公平,注重污染防治、重大风险化解,结构性供给侧改革的重心由做减法到做加法转移,这些宏观政策变化推动中国经济在投资、消费,增长模式等多方面呈现出有别于以往的特点,主要体现在:(1)官员考核不再仅仅关注 GDP 增长,也看质量;(2)通过精准扶贫,缩小收入差距,提高居民消费支出,促使经济长期稳定增长;(3)固定资产投资将会稳步下滑。预计 2018 年宏观经济将会触底企稳。流动性方面,在金融去杠杆的大背景下,2018 年货币政策仍将位置紧平衡态势,利率水平可能在高位震荡,触顶回落。汇率方面,人民币汇率双向良性波动,资金外流压力较小。企业盈利方面,由于驱动 2017 年企业盈利回升的投资和供给侧改革弱化,同时 2017 年的基数较高,预计 2018 年企业盈利大概率下滑,但仍有看点,金融板块盈利有可能回升、消费板块盈利有望继续维持超预期,而信息科技板块有可能出现预期差。

在总体宏观经济和流动性难有较大的改善情况下,2018 年仍将是存量博弈,维持结构性行情。与 2017 年的行情主要受结构性盈利好转驱动不同的是,2018 年的行情受到流动性的影响程度会加大。流动性主要关注两个方面:(1)债券利率水平;(2)资管新规下的理财资金、保险资金等绝对收益资金以及 MSCI 带来的资金流入。根据流动性可能存在的变化,我们预计 2018 年的行情分成三段:第一阶段,供给收缩带来的价格上涨、一季度的宏观经济数据真空期,叠加流动性相对有所缓解,风险偏好有可能上行,石油石化、煤炭钢铁等周期板块以及金融板块预计将有所表现;第二阶段,二季度经济数据回落、利率水平高企,使得具有稳定业绩的食品饮料、家电、金融等龙头股更具吸引力;第三阶段,三四季度经济数据企稳、利率水平高位回落,会凸显增长前景较高的股票吸引力,行情出现从大盘龙头股向中盘高增长股票扩散的现象。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

2017 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《投资者适当性管理制度》、《非标投资业务投资管理流程手册》、《债券信用风险处置预案》。修订了《黄金租赁业务管理制度》、《债券池管理办法》、《反洗钱工作管理办法》、《风险管理委员会制度》、《博时基金管理有限公司费用开支管理规定》、《博时基金大宗交易制度》、《博时基金关于规范全国银行间债券市场交易对手范围的管理规定》、《博时基金管理有限公司基金资产估值委员会制度》等制度文件。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管

理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，曾于 2017 年 10 月 24 日至 2017 年 12 月 29 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形；曾于 2017 年 11 月 17 日至 2017 年 12 月 29 日出现了连续 20 个工作日持有人少于 200 人的情形。

§ 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本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 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21347 号

博时富时中国 A 股指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了博时富时中国 A 股指数证券投资基金(以下简称“博时富时中国 A 股指数基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了博时富时中国 A 股指数基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博时富时中国 A 股指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时富时中国 A 股指数基金的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时富时中国 A 股指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时富时中国 A 股指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时富时中国 A 股指数基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对博时富时中国 A 股指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时富时中国 A 股指数基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天 注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)

张 振 波

注册会计师

中国 · 上海市

2018 年 3 月 23 日

林 佳 璐

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		-
银行存款	7.4.7.1	3,983,912.74
结算备付金		-
存出保证金		5,387.21
交易性金融资产	7.4.7.2	5,554,207.91
其中：股票投资		5,550,420.95
基金投资		-
债券投资		3,786.96
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	1,780.04
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		9,545,287.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日
负 债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		298,699.45
应付管理人报酬		16,603.36
应付托管费		3,320.69
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	21,667.33
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	159,738.42
负债合计		500,029.25
所有者权益:		-

实收基金	7.4.7.9	8,976,215.05
未分配利润	7.4.7.10	69,043.60
所有者权益合计		9,045,258.65
负债和所有者权益总计		9,545,287.90

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0077 元，基金份额总额 8,976,215.05 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 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：2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		852,547.61
1. 利息收入		304,344.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	82,697.41
债券利息收入		0.75
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		221,646.69
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		113,913.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	113,492.35
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	421.00

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-78,313.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	512,602.55
减：二、费用		413,970.02
1. 管理人报酬		160,041.39
2. 托管费		32,008.31
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	36,360.64
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	185,559.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		438,577.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		438,577.59

7.3 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：2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	202,737,368.02	-	202,737,368.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	438,577.59	438,577.59
三、本期基金份额交易	-193,761,152.97	-369,533.99	-194,130,686.96

产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	10,700,309.53	205,041.79	10,905,351.32
2. 基金赎回款	-204,461,462.50	-574,575.78	-205,036,038.28
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)	8,976,215.05	69,043.60	9,045,258.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 江向阳 主管会计工作负责人: 王德英 会计机构负责人: 成江

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时富时中国 A 股指数证券投资基金(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[2015]2169 号《关于准予博时富时中国 A 股指数证券投资基金注册的批复》和机构部函[2017]1100 号《关于博时富时中国 A 股指数证券投资基金延期募集备案的回函》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《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 202,660,938.19 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 296 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 202,737,368.02 份基金份额,其中认购资金利息折合 76,429.83 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《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》的有关规定,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。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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）。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。本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的标的指数为：富时中国 A 股指数。本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{富时中国 A 股指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

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 2018 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本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》、《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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 2017 年 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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股票投资和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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,983,912.74
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,983,912.74

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,628,921.05	5,550,420.95	-78,500.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,600.00	3,786.96
	银行间市场	-	-
	合计	3,600.00	3,786.96
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,632,521.05	5,554,207.91	-78,313.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,776.65

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	
应收债券利息	0.75
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	2.64
合计	1,780.04

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	21,667.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	21,667.33

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付指数使用费	57,475.55
应付赎回费	2,262.87
预提费用	100,000.00
合计	159,738.42

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	202,737,368.02	202,737,368.02
本期申购	10,700,309.53	10,700,309.53
本期赎回（以“-”号填列）	-204,461,462.50	-204,461,462.50
本期末	8,976,215.05	8,976,215.05

注：

1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2017 年 9 月 5 日至 2017 年 9 月 8 日止期间及 2017 年 9 月 25 日至 2017 年 9 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 202,660,938.19 元。根据《博时富时中国 A 股指数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 76,429.83 元在本基金成立后，折算为 76,429.83 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》和《博时富时中国 A 股指数证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 10 月 16 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

7.4.7.10 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	516,890.73	-78,313.14	438,577.59
本期基金份额交易产生的变动数	-443,149.04	73,615.05	-369,533.99
其中：基金申购款	124,839.06	80,202.73	205,041.79
基金赎回款	-567,988.10	-6,587.68	-574,575.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,741.69	-4,698.09	69,043.60

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	69,562.95
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	13,112.81
其他	21.65
合计	82,697.41

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 9 月 29 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	12,057,692.54
减：卖出股票成本总额	11,944,200.19
股票投资收益	113,492.35

7.4.7.13 债券投资收益

无发生额。

7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	421.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	421.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-78,313.14

——股票投资	-78,500.10
——债券投资	186.96
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-78,313.14

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日
基金赎回费收入	487,927.08
基金转换费收入	24,675.47
合计	512,602.55

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. 本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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日
交易所市场交易费用	36,360.64
银行间市场交易费用	-
合计	36,360.64

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	75,000.00
银行汇划费	2,684.13
指数使用费	57,475.55
开户费	400.00
合计	185,559.68

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，由许可使用固定费和许可使用基点费组成。许可使用固定费按照 34,640 美元/年收取，许可使用基点费当本基金前一日基金资产净值大于 250,000,000 元按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 1 月 16 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	160,041.39
其中：支付销售机构的客户维护费	25,972.21

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	32,008.31

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 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

	2017年9月29日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,983,912.74	69,562.95

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	配股流通受限	11.06	53.21	30	331.80	1,596.30	

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017-12-05	2018-01-12	配债未上市	100.00	100.00	22.00	2,200.00	2,200.00	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元。

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94	-	-	600.00	22,575.27	22,764.00	-
601216	君正集团	2017-12-15	重大资产重组	4.71	-	-	3,100.00	15,215.00	14,601.00	-
600157	永泰能源	2017-11-21	重大资产重组	3.36	-	-	2,800.00	9,716.00	9,408.00	-

300383	光环新网	2017-11-07	拟披露重大事项	13.19	2018-03-19	14.51	600.00	8,208.00	7,914.00	-
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	200.00	6,038.00	5,290.00	-
600525	长园集团	2017-12-25	重要事项未公告	15.79	2018-01-10	17.30	300.00	5,526.00	4,737.00	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大资产重组	4.99	-	-	900.00	4,540.50	4,491.00	-
000401	冀东水泥	2017-11-21	重大资产重组	13.79	2018-01-15	15.17	300.00	4,491.00	4,137.00	-
002344	海宁皮城	2017-11-01	拟披露重大事项	7.93	2018-01-31	7.44	500.00	3,960.00	3,965.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	-	-	300.00	3,948.00	3,867.00	-
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大资产重组	7.62	-	-	500.00	4,878.50	3,810.00	-
002512	达华智能	2017-12-06	拟披露重大事项	18.07	2018-03-06	16.26	200.00	4,012.00	3,614.00	-
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项	6.73	2018-03-14	7.30	500.00	3,810.00	3,365.00	-
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	2018-03-22	9.36	300.00	3,459.00	3,120.00	-
600614	鹏起科技	2017-12-26	重要事项未公告	10.16	-	-	300.00	3,621.00	3,048.00	-
002358	森源电气	2017-12-07	重大资产重组	14.86	2018-03-07	15.05	200.00	3,038.00	2,972.00	-
300032	金龙机电	2017-11-27	拟披露重大事项	13.89	-	-	200.00	2,804.00	2,778.00	-
000766	通化金马	2017-11-24	重大资产重组	13.60	-	-	200.00	2,798.00	2,720.00	-
002312	*ST 三泰	2017-11-13	重大资产重组	6.79	-	-	400.00	2,620.00	2,716.00	-
002122	天马股份	2017-12-19	重大事项	8.49	-	-	300.00	3,117.00	2,547.00	-
000022	深赤湾 A	2017-11-20	重大资产重组	24.14	-	-	100.00	2,547.00	2,414.00	-
601369	陕鼓动力	2017-12-28	重要事项未公告	7.60	2018-03-02	6.85	300.00	2,106.00	2,280.00	-
300010	立思辰	2017-11-17	拟披露重大事项	11.17	2018-02-22	10.05	200.00	2,318.00	2,234.00	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大资产重组	4.78	-	-	300.00	1,737.00	1,434.00	-
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项	11.40	-	-	100.00	1,403.00	1,140.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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行中国银行，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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%。

7.4.13.3 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 market 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 2017 年 12 月 31 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 month 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。

7.4.13.3.1 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在 short 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上述比例限制)。

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 7.4.12。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%。

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。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,983,912.74	-	-	-	3,983,912.74
存出保证金	5,387.21	-	-	-	5,387.21

交易性金融资产	-	-	3,786.96	5,550,420.95	5,554,207.91
应收利息	-	-	-	1,780.04	1,780.04
资产总计	3,989,299.95	-	3,786.96	5,552,200.99	9,545,287.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	298,699.45	298,699.45
应付管理人报酬	-	-	-	16,603.36	16,603.36
应付托管费	-	-	-	3,320.69	3,320.69
应付交易费用	-	-	-	21,667.33	21,667.33
其他负债	-	-	-	159,738.42	159,738.42
负债总计	-	-	-	500,029.25	500,029.25
利率敏感度缺口	3,989,299.95	-	3,786.96	5,052,171.74	9,045,258.65

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	5,550,420.95	61.36
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	-	-
合计	5,550,420.95	61.36

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 2017 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 上升 5%	增加约 28
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1) 下降 5%	减少约 28

7.4.14 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 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 5,429,045.61 元，属于第二层次的余额为 125,162.30 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》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、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起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的销售额确定做出规

定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	5,550,420.95	58.15
	其中：股票	5,550,420.95	58.15
2	基金投资		
3	固定收益投资	3,786.96	0.04
	其中：债券	3,786.96	0.04
	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	3,983,912.74	41.74
8	其他各项资产	7,167.25	0.08
9	合计	9,545,287.90	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	---------

			比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	40,318.00	0.45
B	采矿业	239,433.00	2.65
C	制造业	2,518,559.95	27.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	190,707.00	2.11
E	建筑业	213,621.00	2.36
F	批发和零售业	167,250.00	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	230,898.00	2.55
H	住宿和餐饮业	3,229.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	266,942.00	2.95
J	金融业	1,170,974.00	12.95
K	房地产业	268,353.00	2.97
L	租赁和商务服务业	91,882.00	1.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	43,096.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,537.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	66,413.00	0.73
S	综合	16,208.00	0.18
	合计	5,550,420.95	61.36

8.3 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	601318	中国平安	2,100	146,958.00	1.62
2	600519	贵州茅台	200	139,498.00	1.54
3	601288	农业银行	22,100	84,643.00	0.94
4	601398	工商银行	13,500	83,700.00	0.93
5	000333	美的集团	1,300	72,059.00	0.80

6	600000	浦发银行	5,600	70,504.00	0.78
7	002415	海康威视	1,800	70,200.00	0.78
8	601166	兴业银行	3,900	66,261.00	0.73
9	000858	五粮液	700	55,916.00	0.62
10	000002	万科 A	1,800	55,908.00	0.62
11	601766	中国中车	4,600	55,706.00	0.62
12	601668	中国建筑	5,700	51,414.00	0.57
13	601989	中国重工	8,500	51,255.00	0.57
14	601601	中国太保	1,200	49,704.00	0.55
15	600104	上汽集团	1,500	48,060.00	0.53
16	600016	民生银行	5,600	46,984.00	0.52
17	601328	交通银行	7,400	45,954.00	0.51
18	000001	平安银行	3,200	42,560.00	0.47
19	600900	长江电力	2,500	38,975.00	0.43
20	600887	伊利股份	1,200	38,628.00	0.43
21	000725	京东方 A	6,600	38,214.00	0.42
22	600028	中国石化	6,000	36,780.00	0.41
23	002304	洋河股份	300	34,500.00	0.38
24	600276	恒瑞医药	500	34,490.00	0.38
25	600030	中信证券	1,900	34,390.00	0.38
26	002027	分众传媒	2,400	33,792.00	0.37
27	600048	保利地产	2,200	31,130.00	0.34
28	600050	中国联通	4,800	30,384.00	0.34
29	601818	光大银行	7,500	30,375.00	0.34
30	601088	中国神华	1,300	30,121.00	0.33
31	600019	宝钢股份	3,300	28,512.00	0.32
32	601336	新华保险	400	28,080.00	0.31
33	601390	中国中铁	3,300	27,687.00	0.31
34	601628	中国人寿	900	27,405.00	0.30
35	601211	国泰君安	1,400	25,928.00	0.29
36	000063	中兴通讯	700	25,452.00	0.28
37	601006	大秦铁路	2,800	25,396.00	0.28
38	601169	北京银行	3,500	25,025.00	0.28
39	601186	中国铁建	2,200	24,508.00	0.27
40	600585	海螺水泥	800	23,464.00	0.26
41	600309	万华化学	600	22,764.00	0.25
42	600690	青岛海尔	1,200	22,608.00	0.25
43	002024	苏宁云商	1,800	22,122.00	0.24
44	600015	华夏银行	2,400	21,600.00	0.24
45	601857	中国石油	2,600	21,034.00	0.23
46	000538	云南白药	200	20,358.00	0.23
47	600703	三安光电	800	20,312.00	0.22
48	600518	康美药业	900	20,124.00	0.22

49	000568	泸州老窖	300	19,800.00	0.22
50	002594	比亚迪	300	19,515.00	0.22
51	600837	海通证券	1,500	19,305.00	0.21
52	601933	永辉超市	1,900	19,190.00	0.21
53	000166	申万宏源	3,500	18,795.00	0.21
54	601985	中国核电	2,500	18,375.00	0.20
55	000776	广发证券	1,100	18,348.00	0.20
56	600009	上海机场	400	18,004.00	0.20
57	600741	华域汽车	600	17,814.00	0.20
58	002142	宁波银行	1,000	17,810.00	0.20
59	600196	复星医药	400	17,800.00	0.20
60	002230	科大讯飞	300	17,742.00	0.20
61	601888	中国国旅	400	17,356.00	0.19
62	601688	华泰证券	1,000	17,260.00	0.19
63	600010	包钢股份	7,000	17,220.00	0.19
64	600340	华夏幸福	500	15,695.00	0.17
65	002450	康得新	700	15,540.00	0.17
66	600029	南方航空	1,300	15,496.00	0.17
67	601899	紫金矿业	3,300	15,147.00	0.17
68	601216	君正集团	3,100	14,601.00	0.16
69	601012	隆基股份	400	14,576.00	0.16
70	002475	立讯精密	600	14,064.00	0.16
71	600958	东方证券	1,000	13,860.00	0.15
72	002236	大华股份	600	13,854.00	0.15
73	601939	建设银行	1,800	13,824.00	0.15
74	601669	中国电建	1,900	13,718.00	0.15
75	000895	双汇发展	500	13,250.00	0.15
76	600115	东方航空	1,600	13,136.00	0.15
77	601618	中国中冶	2,700	13,068.00	0.14
78	000069	华侨城 A	1,500	12,735.00	0.14
79	600031	三一重工	1,400	12,698.00	0.14
80	600018	上港集团	1,900	12,635.00	0.14
81	600547	山东黄金	400	12,472.00	0.14
82	601009	南京银行	1,600	12,384.00	0.14
83	601111	中国国航	1,000	12,320.00	0.14
84	002466	天齐锂业	230	12,238.30	0.14
85	600487	亨通光电	300	12,126.00	0.13
86	600795	国电电力	3,800	11,856.00	0.13
87	600816	安信信托	900	11,772.00	0.13
88	601155	新城控股	400	11,720.00	0.13
89	600660	福耀玻璃	400	11,600.00	0.13
90	601800	中国交建	900	11,520.00	0.13
91	600809	山西汾酒	200	11,398.00	0.13

92	002202	金风科技	600	11,310.00	0.13
93	600297	广汇汽车	1,400	11,228.00	0.12
94	601901	方正证券	1,600	11,024.00	0.12
95	603993	洛阳钼业	1,600	11,008.00	0.12
96	002044	美年健康	500	10,935.00	0.12
97	000963	华东医药	200	10,776.00	0.12
98	600893	航发动力	400	10,764.00	0.12
99	603288	海天味业	200	10,760.00	0.12
100	601225	陕西煤业	1,300	10,608.00	0.12
101	002714	牧原股份	200	10,572.00	0.12
102	601998	中信银行	1,700	10,540.00	0.12
103	300072	三聚环保	300	10,539.00	0.12
104	300070	碧水源	600	10,422.00	0.12
105	002241	歌尔股份	600	10,410.00	0.12
106	300059	东方财富	800	10,360.00	0.11
107	002456	欧菲科技	500	10,295.00	0.11
108	600111	北方稀土	700	10,213.00	0.11
109	300136	信维通信	200	10,140.00	0.11
110	600383	金地集团	800	10,104.00	0.11
111	002310	东方园林	500	10,085.00	0.11
112	000338	潍柴动力	1,200	10,008.00	0.11
113	002252	上海莱士	500	9,925.00	0.11
114	600221	海航控股	3,100	9,889.00	0.11
115	002008	大族激光	200	9,880.00	0.11
116	601607	上海医药	400	9,676.00	0.11
117	600085	同仁堂	300	9,672.00	0.11
118	600066	宇通客车	400	9,628.00	0.11
119	002508	老板电器	200	9,620.00	0.11
120	600886	国投电力	1,300	9,542.00	0.11
121	601377	兴业证券	1,300	9,464.00	0.10
122	600157	永泰能源	2,800	9,408.00	0.10
123	601788	光大证券	700	9,401.00	0.10
124	600705	中航资本	1,700	9,384.00	0.10
125	300015	爱尔眼科	300	9,240.00	0.10
126	600406	国电南瑞	500	9,140.00	0.10
127	002294	信立泰	200	9,038.00	0.10
128	000100	TCL 集团	2,300	8,970.00	0.10
129	000625	长安汽车	700	8,820.00	0.10
130	601919	中远海控	1,300	8,801.00	0.10
131	600606	绿地控股	1,200	8,760.00	0.10
132	300124	汇川技术	300	8,706.00	0.10
133	601992	金隅股份	1,600	8,688.00	0.10
134	002736	国信证券	800	8,680.00	0.10

135	600516	方大炭素	300	8,664.00	0.10
136	000783	长江证券	1,100	8,657.00	0.10
137	002673	西部证券	700	8,624.00	0.10
138	600271	航天信息	400	8,616.00	0.10
139	600023	浙能电力	1,600	8,528.00	0.09
140	000768	中航飞机	500	8,445.00	0.09
141	000413	东旭光电	900	8,442.00	0.09
142	600522	中天科技	600	8,364.00	0.09
143	600208	新湖中宝	1,600	8,352.00	0.09
144	600637	东方明珠	500	8,330.00	0.09
145	600176	中国巨石	500	8,145.00	0.09
146	600674	川投能源	800	8,144.00	0.09
147	600362	江西铜业	400	8,068.00	0.09
148	603799	华友钴业	100	8,023.00	0.09
149	002271	东方雨虹	200	7,992.00	0.09
150	300383	光环新网	600	7,914.00	0.09
151	000709	河钢股份	2,000	7,800.00	0.09
152	600398	海澜之家	800	7,760.00	0.09
153	002081	金螳螂	500	7,660.00	0.08
154	002001	新和成	200	7,612.00	0.08
155	002422	科伦药业	300	7,470.00	0.08
156	002468	申通快递	300	7,407.00	0.08
157	600011	华能国际	1,200	7,404.00	0.08
158	601238	广汽集团	300	7,398.00	0.08
159	600068	葛洲坝	900	7,380.00	0.08
160	002050	三花智控	400	7,336.00	0.08
161	300003	乐普医疗	300	7,248.00	0.08
162	000938	紫光股份	100	7,203.00	0.08
163	601198	东兴证券	500	7,200.00	0.08
164	002460	赣锋锂业	100	7,175.00	0.08
165	300498	温氏股份	300	7,170.00	0.08
166	002085	万丰奥威	400	7,160.00	0.08
167	600535	天士力	200	7,116.00	0.08
168	601229	上海银行	500	7,090.00	0.08
169	600352	浙江龙盛	600	7,026.00	0.08
170	002311	海大集团	300	7,020.00	0.08
171	000792	盐湖股份	500	6,955.00	0.08
172	600089	特变电工	700	6,937.00	0.08
173	600489	中金黄金	700	6,923.00	0.08
174	601018	宁波港	1,300	6,903.00	0.08
175	601633	长城汽车	600	6,894.00	0.08
176	600867	通化东宝	300	6,867.00	0.08
177	601699	潞安环能	600	6,828.00	0.08

178	002602	世纪华通	200	6,796.00	0.08
179	000418	小天鹅 A	100	6,785.00	0.08
180	000786	北新建材	300	6,750.00	0.07
181	000839	中信国安	700	6,713.00	0.07
182	002146	荣盛发展	700	6,671.00	0.07
183	000402	金融街	600	6,666.00	0.07
184	002517	恺英网络	300	6,663.00	0.07
185	000513	丽珠集团	100	6,645.00	0.07
186	600219	南山铝业	1,800	6,624.00	0.07
187	000826	启迪桑德	200	6,604.00	0.07
188	000728	国元证券	600	6,600.00	0.07
189	600061	国投资本	500	6,590.00	0.07
190	600699	均胜电子	200	6,574.00	0.07
191	000596	古井贡酒	100	6,567.00	0.07
192	600298	安琪酵母	200	6,544.00	0.07
193	000703	恒逸石化	300	6,471.00	0.07
194	600177	雅戈尔	700	6,419.00	0.07
195	002601	龙蟠佰利	400	6,408.00	0.07
196	600584	长电科技	300	6,399.00	0.07
197	600201	生物股份	200	6,348.00	0.07
198	600588	用友网络	300	6,345.00	0.07
199	600688	上海石化	1,000	6,330.00	0.07
200	600436	片仔癀	100	6,320.00	0.07
201	000671	阳光城	800	6,296.00	0.07
202	300251	光线传媒	600	6,270.00	0.07
203	601333	广深铁路	1,100	6,127.00	0.07
204	000983	西山煤电	600	6,084.00	0.07
205	601117	中国化学	900	6,075.00	0.07
206	600438	通威股份	500	6,055.00	0.07
207	300408	三环集团	300	6,048.00	0.07
208	000423	东阿阿胶	100	6,027.00	0.07
209	000028	国药一致	100	6,025.00	0.07
210	600521	华海药业	200	6,024.00	0.07
211	000425	徐工机械	1,300	6,019.00	0.07
212	300433	蓝思科技	200	5,970.00	0.07
213	000876	新希望	800	5,960.00	0.07
214	603816	顾家家居	100	5,897.00	0.07
215	600004	白云机场	400	5,880.00	0.07
216	600100	同方股份	600	5,880.00	0.07
217	300296	利亚德	300	5,847.00	0.06
218	000630	铜陵有色	2,000	5,840.00	0.06
219	002670	国盛金控	300	5,835.00	0.06
220	601555	东吴证券	600	5,832.00	0.06

221	002074	国轩高科	260	5,787.60	0.06
222	600415	小商品城	1,000	5,780.00	0.06
223	600498	烽火通信	200	5,766.00	0.06
224	000415	渤海金控	1,000	5,760.00	0.06
225	002640	跨境通	300	5,742.00	0.06
226	600959	江苏有线	700	5,726.00	0.06
227	600109	国金证券	600	5,724.00	0.06
228	600663	陆家嘴	300	5,709.00	0.06
229	300450	先导智能	100	5,697.00	0.06
230	002384	东山精密	200	5,692.00	0.06
231	600497	驰宏锌锗	800	5,680.00	0.06
232	300024	机器人	300	5,646.00	0.06
233	300274	阳光电源	300	5,631.00	0.06
234	300122	智飞生物	200	5,614.00	0.06
235	000627	天茂集团	700	5,600.00	0.06
236	300144	宋城演艺	300	5,598.00	0.06
237	000060	中金岭南	500	5,585.00	0.06
238	600153	建发股份	500	5,560.00	0.06
239	002583	海能达	300	5,553.00	0.06
240	300142	沃森生物	300	5,475.00	0.06
241	600704	物产中大	800	5,456.00	0.06
242	000825	太钢不锈	1,100	5,456.00	0.06
243	000999	华润三九	200	5,440.00	0.06
244	300266	兴源环境	200	5,400.00	0.06
245	601991	大唐发电	1,300	5,395.00	0.06
246	002013	中航机电	500	5,395.00	0.06
247	002007	华兰生物	200	5,376.00	0.06
248	000157	中联重科	1,200	5,364.00	0.06
249	600079	人福医药	300	5,352.00	0.06
250	600315	上海家化	145	5,349.05	0.06
251	002411	必康股份	200	5,334.00	0.06
252	002092	中泰化学	400	5,324.00	0.06
253	300017	网宿科技	500	5,320.00	0.06
254	002366	台海核电	200	5,290.00	0.06
255	600739	辽宁成大	300	5,280.00	0.06
256	002405	四维图新	200	5,278.00	0.06
257	600642	申能股份	900	5,274.00	0.06
258	002080	中材科技	200	5,270.00	0.06
259	601877	正泰电器	200	5,230.00	0.06
260	000046	泛海控股	700	5,222.00	0.06
261	600183	生益科技	300	5,178.00	0.06
262	600549	厦门钨业	200	5,148.00	0.06
263	601898	中煤能源	900	5,148.00	0.06

264	600919	江苏银行	700	5,145.00	0.06
265	000998	隆平高科	200	5,144.00	0.06
266	000807	云铝股份	500	5,115.00	0.06
267	601866	中远海发	1,500	5,115.00	0.06
268	600804	鹏博士	300	5,109.00	0.06
269	000883	湖北能源	1,100	5,093.00	0.06
270	600369	西南证券	1,100	5,093.00	0.06
271	000898	鞍钢股份	800	5,080.00	0.06
272	600373	中文传媒	300	5,079.00	0.06
273	000559	万向钱潮	500	5,075.00	0.06
274	600256	广汇能源	1,000	5,060.00	0.06
275	600118	中国卫星	200	5,050.00	0.06
276	002340	格林美	700	5,033.00	0.06
277	600820	隧道股份	600	5,016.00	0.06
278	002217	合力泰	500	5,000.00	0.06
279	300033	同花顺	100	4,998.00	0.06
280	600056	中国医药	200	4,978.00	0.06
281	600482	中国动力	200	4,962.00	0.05
282	000656	金科股份	1,000	4,950.00	0.05
283	600062	华润双鹤	200	4,950.00	0.05
284	600346	恒力股份	400	4,932.00	0.05
285	600583	海油工程	800	4,920.00	0.05
286	002065	东华软件	600	4,920.00	0.05
287	600835	上海机电	200	4,900.00	0.05
288	600528	中铁工业	400	4,856.00	0.05
289	002385	大北农	800	4,848.00	0.05
290	000581	威孚高科	200	4,800.00	0.05
291	002049	紫光国芯	100	4,799.00	0.05
292	600426	华鲁恒升	300	4,776.00	0.05
293	600525	长园集团	300	4,737.00	0.05
294	601718	际华集团	700	4,711.00	0.05
295	601099	太平洋	1,300	4,706.00	0.05
296	600291	西水股份	200	4,704.00	0.05
297	002439	启明星辰	200	4,670.00	0.05
298	600038	中直股份	100	4,653.00	0.05
299	600376	首开股份	500	4,645.00	0.05
300	600570	恒生电子	100	4,640.00	0.05
301	600008	首创股份	900	4,626.00	0.05
302	600977	中国电影	300	4,620.00	0.05
303	002500	山西证券	500	4,610.00	0.05
304	002268	卫士通	200	4,604.00	0.05
305	002709	天赐材料	100	4,599.00	0.05
306	002120	韵达股份	100	4,578.00	0.05

307	000039	中集集团	200	4,570.00	0.05
308	002573	清新环境	200	4,546.00	0.05
309	600808	马钢股份	1,100	4,543.00	0.05
310	002359	北讯集团	200	4,510.00	0.05
311	600060	海信电器	300	4,506.00	0.05
312	300146	汤臣倍健	300	4,506.00	0.05
313	000623	吉林敖东	200	4,500.00	0.05
314	601233	桐昆股份	200	4,498.00	0.05
315	600875	东方电气	400	4,492.00	0.05
316	000939	凯迪生态	900	4,491.00	0.05
317	000961	中南建设	700	4,487.00	0.05
318	600170	上海建工	1,200	4,464.00	0.05
319	600848	上海临港	200	4,460.00	0.05
320	002285	世联行	400	4,460.00	0.05
321	600027	华电国际	1,200	4,452.00	0.05
322	002019	亿帆医药	200	4,450.00	0.05
323	601118	海南橡胶	800	4,440.00	0.05
324	000981	银亿股份	500	4,415.00	0.05
325	600649	城投控股	500	4,400.00	0.05
326	600787	中储股份	400	4,400.00	0.05
327	000066	中国长城	600	4,374.00	0.05
328	601179	中国西电	1,000	4,370.00	0.05
329	300027	华谊兄弟	500	4,365.00	0.05
330	300182	捷成股份	500	4,305.00	0.05
331	600895	张江高科	300	4,290.00	0.05
332	002292	奥飞娱乐	300	4,287.00	0.05
333	002506	协鑫集成	1,000	4,270.00	0.05
334	000878	云南铜业	300	4,257.00	0.05
335	600160	巨化股份	400	4,252.00	0.05
336	000027	深圳能源	700	4,242.00	0.05
337	601000	唐山港	900	4,239.00	0.05
338	601881	中国银河	400	4,204.00	0.05
339	000959	首钢股份	700	4,186.00	0.05
340	000778	新兴铸管	800	4,176.00	0.05
341	601098	中南传媒	300	4,167.00	0.05
342	600338	西藏珠峰	100	4,165.00	0.05
343	000401	冀东水泥	300	4,137.00	0.05
344	600885	宏发股份	100	4,137.00	0.05
345	600612	老凤祥	100	4,116.00	0.05
346	300418	昆仑万维	200	4,114.00	0.05
347	002555	三七互娱	200	4,108.00	0.05
348	600372	中航电子	300	4,107.00	0.05
349	600827	百联股份	300	4,047.00	0.04

350	000729	燕京啤酒	600	4,044.00	0.04
351	002032	苏泊尔	100	4,038.00	0.04
352	002589	瑞康医药	300	4,035.00	0.04
353	603019	中科曙光	100	4,024.00	0.04
354	300115	长盈精密	200	4,014.00	0.04
355	601997	贵阳银行	300	4,008.00	0.04
356	000793	华闻传媒	400	4,004.00	0.04
357	000732	泰禾集团	200	4,004.00	0.04
358	000977	浪潮信息	200	3,976.00	0.04
359	002244	滨江集团	500	3,975.00	0.04
360	002344	海宁皮城	500	3,965.00	0.04
361	000960	锡业股份	300	3,960.00	0.04
362	600266	北京城建	300	3,942.00	0.04
363	002179	中航光电	100	3,938.00	0.04
364	600600	青岛啤酒	100	3,933.00	0.04
365	600259	广晟有色	100	3,929.00	0.04
366	300014	亿纬锂能	200	3,922.00	0.04
367	000750	国海证券	800	3,920.00	0.04
368	002410	广联达	200	3,920.00	0.04
369	600879	航天电子	500	3,920.00	0.04
370	002223	鱼跃医疗	200	3,920.00	0.04
371	600567	山鹰纸业	900	3,906.00	0.04
372	601880	大连港	1,400	3,906.00	0.04
373	600037	歌华有线	300	3,897.00	0.04
374	600884	杉杉股份	200	3,876.00	0.04
375	000566	海南海药	300	3,867.00	0.04
376	002595	豪迈科技	200	3,852.00	0.04
377	600409	三友化工	400	3,836.00	0.04
378	002465	海格通信	400	3,836.00	0.04
379	600566	济川药业	100	3,815.00	0.04
380	300116	坚瑞沃能	500	3,810.00	0.04
381	002408	齐翔腾达	300	3,804.00	0.04
382	600998	九州通	200	3,790.00	0.04
383	600418	江淮汽车	400	3,784.00	0.04
384	000869	张裕 A	100	3,750.00	0.04
385	601021	春秋航空	100	3,727.00	0.04
386	002152	广电运通	500	3,720.00	0.04
387	000989	九芝堂	200	3,716.00	0.04
388	002210	飞马国际	300	3,714.00	0.04
389	002078	太阳纸业	400	3,712.00	0.04
390	600435	北方导航	300	3,699.00	0.04
391	600348	阳泉煤业	500	3,690.00	0.04
392	002051	中工国际	200	3,686.00	0.04

393	002572	索菲亚	100	3,680.00	0.04
394	601108	财通证券	200	3,676.00	0.04
395	002221	东华能源	300	3,663.00	0.04
396	600175	美都能源	700	3,661.00	0.04
397	002127	南极电商	300	3,657.00	0.04
398	600021	上海电力	400	3,656.00	0.04
399	600166	福田汽车	1,300	3,653.00	0.04
400	300197	铁汉生态	300	3,645.00	0.04
401	600909	华安证券	500	3,635.00	0.04
402	000887	中鼎股份	200	3,634.00	0.04
403	002699	美盛文化	200	3,622.00	0.04
404	601958	金铂股份	500	3,615.00	0.04
405	600967	内蒙一机	300	3,615.00	0.04
406	002512	达华智能	200	3,614.00	0.04
407	002251	步步高	200	3,610.00	0.04
408	000997	新大陆	200	3,586.00	0.04
409	000980	众泰汽车	300	3,582.00	0.04
410	002343	慈文传媒	100	3,561.00	0.04
411	600687	刚泰控股	300	3,543.00	0.04
412	600572	康恩贝	500	3,535.00	0.04
413	000686	东北证券	400	3,508.00	0.04
414	000008	神州高铁	400	3,500.00	0.04
415	000937	冀中能源	600	3,492.00	0.04
416	000089	深圳机场	400	3,480.00	0.04
417	000591	太阳能	600	3,462.00	0.04
418	600388	龙净环保	200	3,460.00	0.04
419	600270	外运发展	200	3,456.00	0.04
420	600126	杭钢股份	500	3,435.00	0.04
421	600307	酒钢宏兴	1,200	3,432.00	0.04
422	002354	天神娱乐	200	3,420.00	0.04
423	002002	鸿达兴业	500	3,420.00	0.04
424	603077	和邦生物	1,700	3,400.00	0.04
425	002176	江特电机	300	3,396.00	0.04
426	000712	锦龙股份	200	3,396.00	0.04
427	600500	中化国际	400	3,384.00	0.04
428	600745	闻泰科技	100	3,373.00	0.04
429	002004	华邦健康	500	3,365.00	0.04
430	600380	健康元	300	3,357.00	0.04
431	600233	圆通速递	200	3,350.00	0.04
432	002624	完美世界	100	3,346.00	0.04
433	000488	晨鸣纸业	200	3,334.00	0.04
434	600499	科达洁能	300	3,327.00	0.04
435	600643	爱建集团	300	3,324.00	0.04

436	601878	浙商证券	200	3,324.00	0.04
437	002648	卫星石化	200	3,320.00	0.04
438	000988	华工科技	200	3,316.00	0.04
439	600143	金发科技	500	3,285.00	0.04
440	601168	西部矿业	400	3,280.00	0.04
441	600863	内蒙华电	1,100	3,267.00	0.04
442	000598	兴蓉环境	600	3,258.00	0.04
443	300199	翰宇药业	200	3,256.00	0.04
444	300133	华策影视	300	3,252.00	0.04
445	601928	凤凰传媒	400	3,244.00	0.04
446	002010	传化智联	200	3,236.00	0.04
447	600598	北大荒	300	3,234.00	0.04
448	300496	中科创达	100	3,232.00	0.04
449	600754	锦江股份	100	3,229.00	0.04
450	000800	一汽轿车	300	3,228.00	0.04
451	002429	兆驰股份	900	3,222.00	0.04
452	002056	横店东磁	300	3,210.00	0.04
453	600811	东方集团	700	3,206.00	0.04
454	600871	石化油服	1,200	3,204.00	0.04
455	000690	宝新能源	400	3,200.00	0.04
456	600086	东方金钰	300	3,195.00	0.04
457	600881	亚泰集团	600	3,168.00	0.04
458	601808	中海油服	300	3,168.00	0.04
459	601666	平煤股份	500	3,150.00	0.03
460	002434	万里扬	300	3,150.00	0.03
461	600717	天津港	300	3,147.00	0.03
462	600839	四川长虹	900	3,132.00	0.03
463	300159	新研股份	300	3,120.00	0.03
464	600568	中珠医疗	400	3,108.00	0.03
465	603369	今世缘	200	3,102.00	0.03
466	002038	双鹭药业	100	3,097.00	0.03
467	601611	中国核建	300	3,081.00	0.03
468	002424	贵州百灵	200	3,080.00	0.03
469	000685	中山公用	300	3,075.00	0.03
470	600252	中恒集团	700	3,073.00	0.03
471	000088	盐田港	400	3,068.00	0.03
472	002280	联络互动	400	3,064.00	0.03
473	600026	中远海能	500	3,060.00	0.03
474	600320	振华重工	500	3,050.00	0.03
475	002608	江苏国信	300	3,048.00	0.03
476	600614	鹏起科技	300	3,048.00	0.03
477	601222	林洋能源	300	3,042.00	0.03
478	600633	浙数文化	200	3,040.00	0.03

479	600597	光明乳业	200	3,030.00	0.03
480	600755	厦门国贸	300	3,030.00	0.03
481	600446	金证股份	200	3,028.00	0.03
482	600267	海正药业	200	3,028.00	0.03
483	300376	易事特	400	3,028.00	0.03
484	600312	平高电气	300	2,997.00	0.03
485	300294	博雅生物	100	2,995.00	0.03
486	000662	天夏智慧	200	2,974.00	0.03
487	002358	森源电气	200	2,972.00	0.03
488	600970	中材国际	300	2,967.00	0.03
489	600823	世茂股份	600	2,964.00	0.03
490	600377	宁沪高速	300	2,955.00	0.03
491	000078	海王生物	500	2,950.00	0.03
492	600325	华发股份	400	2,944.00	0.03
493	000902	新洋丰	300	2,934.00	0.03
494	600718	东软集团	200	2,932.00	0.03
495	300324	旋极信息	200	2,926.00	0.03
496	000021	深科技	300	2,919.00	0.03
497	600188	兖州煤业	200	2,904.00	0.03
498	601588	北辰实业	500	2,895.00	0.03
499	000009	中国宝安	400	2,892.00	0.03
500	002131	利欧股份	1,110	2,886.00	0.03
501	002299	圣农发展	200	2,880.00	0.03
502	000970	中科三环	200	2,876.00	0.03
503	600236	桂冠电力	500	2,875.00	0.03
504	002493	荣盛石化	200	2,870.00	0.03
505	000059	华锦股份	300	2,859.00	0.03
506	300458	全志科技	100	2,846.00	0.03
507	600098	广州发展	400	2,828.00	0.03
508	600801	华新水泥	200	2,826.00	0.03
509	002183	怡亚通	400	2,820.00	0.03
510	603766	隆鑫通用	400	2,808.00	0.03
511	600466	蓝光发展	300	2,805.00	0.03
512	300257	开山股份	200	2,800.00	0.03
513	000587	金洲慈航	400	2,800.00	0.03
514	600094	大名城	400	2,796.00	0.03
515	600582	天地科技	600	2,790.00	0.03
516	000921	海信科龙	200	2,784.00	0.03
517	600022	山东钢铁	1,300	2,782.00	0.03
518	600511	国药股份	100	2,780.00	0.03
519	300315	掌趣科技	500	2,780.00	0.03
520	300032	金龙机电	200	2,778.00	0.03
521	002191	劲嘉股份	300	2,775.00	0.03

522	002444	巨星科技	200	2,766.00	0.03
523	002437	誉衡药业	400	2,756.00	0.03
524	600978	宜华生活	300	2,742.00	0.03
525	300001	特锐德	200	2,738.00	0.03
526	000766	通化金马	200	2,720.00	0.03
527	000917	电广传媒	300	2,718.00	0.03
528	002312	*ST 三泰	400	2,716.00	0.03
529	600317	营口港	800	2,712.00	0.03
530	601212	白银有色	400	2,704.00	0.03
531	300168	万达信息	200	2,696.00	0.03
532	300267	尔康制药	400	2,692.00	0.03
533	600216	浙江医药	200	2,688.00	0.03
534	000975	银泰资源	200	2,672.00	0.03
535	002665	首航节能	400	2,664.00	0.03
536	002477	雏鹰农牧	600	2,664.00	0.03
537	300098	高新兴	200	2,660.00	0.03
538	601311	骆驼股份	200	2,650.00	0.03
539	000400	许继电气	200	2,638.00	0.03
540	601016	节能风电	800	2,632.00	0.03
541	600172	黄河旋风	300	2,631.00	0.03
542	002353	杰瑞股份	200	2,624.00	0.03
543	002635	安洁科技	100	2,609.00	0.03
544	600874	创业环保	200	2,602.00	0.03
545	000718	苏宁环球	600	2,598.00	0.03
546	300009	安科生物	100	2,593.00	0.03
547	002147	新光圆成	200	2,588.00	0.03
548	002445	中南文化	200	2,586.00	0.03
549	600240	华业资本	300	2,574.00	0.03
550	000758	中色股份	400	2,572.00	0.03
551	002041	登海种业	200	2,570.00	0.03
552	300026	红日药业	600	2,556.00	0.03
553	600750	江中药业	100	2,548.00	0.03
554	002122	天马股份	300	2,547.00	0.03
555	002368	太极股份	100	2,537.00	0.03
556	000012	南玻 A	300	2,535.00	0.03
557	002390	信邦制药	300	2,535.00	0.03
558	002431	棕榈股份	300	2,520.00	0.03
559	300208	恒顺众昇	200	2,520.00	0.03
560	002491	通鼎互联	200	2,520.00	0.03
561	300166	东方国信	200	2,510.00	0.03
562	600729	重庆百货	100	2,506.00	0.03
563	601258	庞大集团	1,000	2,500.00	0.03
564	002701	奥瑞金	400	2,500.00	0.03

565	601326	秦港股份	400	2,496.00	0.03
566	601200	上海环境	100	2,494.00	0.03
567	601689	拓普集团	100	2,474.00	0.03
568	601608	中信重工	600	2,472.00	0.03
569	000536	华映科技	500	2,470.00	0.03
570	601375	中原证券	400	2,468.00	0.03
571	603899	晨光文具	100	2,466.00	0.03
572	300002	神州泰岳	400	2,448.00	0.03
573	601228	广州港	400	2,444.00	0.03
574	002308	威创股份	200	2,440.00	0.03
575	601139	深圳燃气	300	2,430.00	0.03
576	600575	皖江物流	600	2,430.00	0.03
577	600282	南钢股份	500	2,420.00	0.03
578	600058	五矿发展	200	2,416.00	0.03
579	000022	深赤湾 A	100	2,414.00	0.03
580	002482	广田集团	300	2,406.00	0.03
581	002489	浙江永强	400	2,404.00	0.03
582	600562	国睿科技	100	2,401.00	0.03
583	300463	迈克生物	100	2,397.00	0.03
584	600350	山东高速	400	2,396.00	0.03
585	600635	大众公用	500	2,390.00	0.03
586	600053	九鼎投资	100	2,389.00	0.03
587	600737	中粮糖业	300	2,385.00	0.03
588	300288	朗玛信息	100	2,384.00	0.03
589	000158	常山北明	300	2,382.00	0.03
590	600090	同济堂	300	2,367.00	0.03
591	600515	海航基础	200	2,366.00	0.03
592	300244	迪安诊断	100	2,362.00	0.03
593	600456	宝钛股份	100	2,361.00	0.03
594	002273	水晶光电	100	2,359.00	0.03
595	000062	深圳华强	100	2,349.00	0.03
596	600006	东风汽车	400	2,340.00	0.03
597	002203	海亮股份	300	2,340.00	0.03
598	600017	日照港	600	2,328.00	0.03
599	600200	江苏吴中	200	2,310.00	0.03
600	600926	杭州银行	200	2,306.00	0.03
601	000061	农产品	300	2,298.00	0.03
602	600869	智慧能源	400	2,296.00	0.03
603	002326	永太科技	200	2,284.00	0.03
604	002657	中科金财	100	2,282.00	0.03
605	601369	陕鼓动力	300	2,280.00	0.03
606	600151	航天机电	300	2,277.00	0.03
607	002108	沧州明珠	200	2,272.00	0.03

608	300291	华录百纳	200	2,270.00	0.03
609	002375	亚厦股份	300	2,256.00	0.02
610	600198	大唐电信	200	2,252.00	0.02
611	600335	国机汽车	200	2,248.00	0.02
612	600428	中远海特	400	2,244.00	0.02
613	300010	立思辰	200	2,234.00	0.02
614	002681	奋达科技	200	2,232.00	0.02
615	002174	游族网络	100	2,230.00	0.02
616	000676	智度股份	200	2,224.00	0.02
617	300287	飞利信	300	2,223.00	0.02
618	000828	东莞控股	200	2,222.00	0.02
619	600578	京能电力	600	2,220.00	0.02
620	002503	搜于特	400	2,216.00	0.02
621	002128	露天煤业	200	2,216.00	0.02
622	600478	科力远	300	2,214.00	0.02
623	002542	中化岩土	300	2,211.00	0.02
624	300058	蓝色光标	400	2,208.00	0.02
625	600012	皖通高速	200	2,200.00	0.02
626	002707	众信旅游	200	2,178.00	0.02
627	603000	人民网	200	2,166.00	0.02
628	600125	铁龙物流	200	2,164.00	0.02
629	300078	思创医惠	200	2,158.00	0.02
630	600093	易见股份	200	2,144.00	0.02
631	002643	万润股份	200	2,138.00	0.02
632	000563	陕国投 A	500	2,125.00	0.02
633	002250	联化科技	200	2,124.00	0.02
634	002237	恒邦股份	200	2,124.00	0.02
635	601801	皖新传媒	200	2,116.00	0.02
636	600410	华胜天成	200	2,104.00	0.02
637	002303	美盈森	300	2,100.00	0.02
638	002249	大洋电机	300	2,091.00	0.02
639	600138	中青旅	100	2,087.00	0.02
640	600132	重庆啤酒	100	2,086.00	0.02
641	600180	瑞茂通	200	2,084.00	0.02
642	601116	三江购物	100	2,078.00	0.02
643	600331	宏达股份	400	2,076.00	0.02
644	002123	梦网集团	200	2,070.00	0.02
645	000723	美锦能源	300	2,067.00	0.02
646	600395	盘江股份	300	2,061.00	0.02
647	600158	中体产业	200	2,056.00	0.02
648	600269	赣粤高速	400	2,048.00	0.02
649	600155	宝硕股份	200	2,046.00	0.02
650	600594	益佰制药	200	2,044.00	0.02

651	002055	得润电子	100	2,043.00	0.02
652	002407	多氟多	100	2,042.00	0.02
653	600859	王府井	100	2,040.00	0.02
654	601163	三角轮胎	100	2,038.00	0.02
655	600039	四川路桥	500	2,035.00	0.02
656	600299	安迪苏	200	2,022.00	0.02
657	002239	奥特佳	500	2,020.00	0.02
658	600458	时代新材	200	2,014.00	0.02
659	300253	卫宁健康	300	2,013.00	0.02
660	601127	小康股份	100	2,011.00	0.02
661	002727	一心堂	100	2,010.00	0.02
662	002413	雷科防务	200	2,000.00	0.02
663	300188	美亚柏科	100	1,998.00	0.02
664	601717	郑煤机	300	1,974.00	0.02
665	300222	科大智能	100	1,973.00	0.02
666	600391	航发科技	100	1,971.00	0.02
667	600195	中牧股份	100	1,971.00	0.02
668	000987	越秀金控	200	1,970.00	0.02
669	002440	闰土股份	100	1,969.00	0.02
670	600503	华丽家族	300	1,965.00	0.02
671	002797	第一创业	200	1,960.00	0.02
672	002537	海联金汇	200	1,958.00	0.02
673	000516	国际医学	400	1,956.00	0.02
674	300207	欣旺达	200	1,952.00	0.02
675	000681	视觉中国	100	1,950.00	0.02
676	600020	中原高速	400	1,944.00	0.02
677	600517	置信电气	300	1,941.00	0.02
678	002155	湖南黄金	200	1,940.00	0.02
679	601567	三星医疗	200	1,940.00	0.02
680	601158	重庆水务	300	1,938.00	0.02
681	600862	中航高科	200	1,936.00	0.02
682	000539	粤电力 A	400	1,928.00	0.02
683	002690	美亚光电	100	1,927.00	0.02
684	600748	上实发展	300	1,923.00	0.02
685	603699	纽威股份	100	1,923.00	0.02
686	002581	未名医药	100	1,917.00	0.02
687	300297	蓝盾股份	200	1,908.00	0.02
688	002030	达安基因	100	1,858.00	0.02
689	600845	宝信软件	100	1,854.00	0.02
690	600648	外高桥	100	1,850.00	0.02
691	000541	佛山照明	200	1,840.00	0.02
692	600123	兰花科创	200	1,834.00	0.02
693	600651	飞乐音响	200	1,830.00	0.02

694	300113	顺网科技	100	1,829.00	0.02
695	600033	福建高速	500	1,825.00	0.02
696	601001	大同煤业	300	1,815.00	0.02
697	300202	聚龙股份	100	1,795.00	0.02
698	000969	安泰科技	200	1,778.00	0.02
699	601929	吉视传媒	600	1,776.00	0.02
700	603555	贵人鸟	100	1,770.00	0.02
701	002522	浙江众成	200	1,760.00	0.02
702	002195	二三四五	300	1,752.00	0.02
703	002302	西部建设	100	1,752.00	0.02
704	601966	玲珑轮胎	100	1,746.00	0.02
705	002099	海翔药业	300	1,734.00	0.02
706	002266	浙富控股	400	1,732.00	0.02
707	601886	江河集团	200	1,732.00	0.02
708	600169	太原重工	500	1,730.00	0.02
709	002276	万马股份	200	1,724.00	0.02
710	600007	中国国贸	100	1,714.00	0.02
711	000620	新华联	300	1,710.00	0.02
712	000528	柳工	200	1,706.00	0.02
713	600623	华谊集团	200	1,706.00	0.02
714	002242	九阳股份	100	1,697.00	0.02
715	600639	浦东金桥	100	1,695.00	0.02
716	002267	陕天然气	200	1,688.00	0.02
717	002414	高德红外	100	1,681.00	0.02
718	600587	新华医疗	100	1,679.00	0.02
719	600657	信达地产	300	1,674.00	0.02
720	600261	阳光照明	300	1,656.00	0.02
721	600536	中国软件	100	1,655.00	0.02
722	600108	亚盛集团	400	1,644.00	0.02
723	002036	联创电子	100	1,623.00	0.02
724	601101	昊华能源	200	1,620.00	0.02
725	002275	桂林三金	100	1,620.00	0.02
726	601908	京运通	300	1,617.00	0.02
727	000550	江铃汽车	100	1,612.00	0.02
728	600595	中孚实业	300	1,605.00	0.02
729	600580	卧龙电气	200	1,602.00	0.02
730	002073	软控股份	200	1,600.00	0.02
731	002463	沪电股份	300	1,599.00	0.02
732	002400	省广股份	300	1,599.00	0.02
733	600864	哈投股份	200	1,588.00	0.02
734	002028	思源电气	100	1,585.00	0.02
735	601231	环旭电子	100	1,577.00	0.02
736	002563	森马服饰	200	1,572.00	0.02

737	300100	双林股份	100	1,566.00	0.02
738	300317	珈伟股份	100	1,566.00	0.02
739	002603	以岭药业	100	1,556.00	0.02
740	002261	拓维信息	200	1,548.00	0.02
741	000600	建投能源	200	1,542.00	0.02
742	600783	鲁信创投	100	1,535.00	0.02
743	603885	吉祥航空	100	1,529.00	0.02
744	000738	航发控制	100	1,529.00	0.02
745	002399	海普瑞	100	1,528.00	0.02
746	002419	天虹股份	100	1,526.00	0.02
747	002646	青青稞酒	100	1,522.00	0.02
748	000667	美好置业	500	1,520.00	0.02
749	600770	综艺股份	200	1,520.00	0.02
750	000543	皖能电力	300	1,506.00	0.02
751	600803	新奥股份	100	1,502.00	0.02
752	600611	大众交通	300	1,494.00	0.02
753	600812	华北制药	300	1,482.00	0.02
754	002293	罗莱生活	100	1,480.00	0.02
755	000767	漳泽电力	500	1,470.00	0.02
756	002215	诺普信	200	1,458.00	0.02
757	600601	方正科技	400	1,456.00	0.02
758	600652	游久游戏	200	1,456.00	0.02
759	600650	锦江投资	100	1,453.00	0.02
760	601777	力帆股份	200	1,452.00	0.02
761	600776	东方通信	200	1,446.00	0.02
762	002570	贝因美	200	1,440.00	0.02
763	600604	市北高新	200	1,440.00	0.02
764	603328	依顿电子	100	1,435.00	0.02
765	000564	供销大集	300	1,434.00	0.02
766	600096	云天化	200	1,432.00	0.02
767	600210	紫江企业	300	1,428.00	0.02
768	601566	九牧王	100	1,420.00	0.02
769	600316	洪都航空	100	1,416.00	0.02
770	603567	珍宝岛	100	1,413.00	0.02
771	000918	嘉凯城	200	1,400.00	0.02
772	002430	杭氧股份	100	1,397.00	0.02
773	600936	广西广电	200	1,372.00	0.02
774	002022	科华生物	100	1,361.00	0.02
775	600557	康缘药业	100	1,348.00	0.01
776	601811	新华文轩	100	1,343.00	0.01
777	002588	史丹利	200	1,338.00	0.01
778	002568	百润股份	100	1,327.00	0.01
779	600495	晋西车轴	200	1,326.00	0.01

780	000652	泰达股份	300	1,323.00	0.01
781	002143	印纪传媒	100	1,320.00	0.01
782	002642	荣之联	100	1,311.00	0.01
783	600300	维维股份	300	1,311.00	0.01
784	002329	皇氏集团	200	1,304.00	0.01
785	600343	航天动力	100	1,293.00	0.01
786	600393	粤泰股份	200	1,268.00	0.01
787	002314	南山控股	200	1,240.00	0.01
788	601107	四川成渝	300	1,236.00	0.01
789	600825	新华传媒	200	1,234.00	0.01
790	300043	星辉娱乐	200	1,224.00	0.01
791	600751	天海投资	200	1,222.00	0.01
792	000861	海印股份	400	1,204.00	0.01
793	600481	双良节能	300	1,203.00	0.01
794	600765	中航重机	100	1,202.00	0.01
795	002461	珠江啤酒	100	1,180.00	0.01
796	002839	张家港行	100	1,172.00	0.01
797	600773	西藏城投	100	1,168.00	0.01
798	600981	汇鸿集团	200	1,156.00	0.01
799	300336	新文化	100	1,142.00	0.01
800	000156	华数传媒	100	1,140.00	0.01
801	002653	海思科	100	1,137.00	0.01
802	002678	珠江钢琴	100	1,123.00	0.01
803	600662	强生控股	200	1,116.00	0.01
804	600618	氯碱化工	100	1,083.00	0.01
805	600851	海欣股份	100	1,074.00	0.01
806	601002	晋亿实业	100	1,073.00	0.01
807	600653	申华控股	400	1,072.00	0.01
808	600880	博瑞传播	200	1,054.00	0.01
809	000687	华讯方舟	100	1,051.00	0.01
810	002378	章源钨业	100	1,018.00	0.01
811	002106	莱宝高科	100	1,017.00	0.01
812	000517	荣安地产	300	1,014.00	0.01
813	002498	汉缆股份	300	993.00	0.01
814	000558	莱茵体育	200	990.00	0.01
815	002269	美邦服饰	300	987.00	0.01
816	000519	中兵红箭	100	985.00	0.01
817	002698	博实股份	100	984.00	0.01
818	601515	东风股份	100	980.00	0.01
819	300171	东富龙	100	977.00	0.01
820	300359	全通教育	100	966.00	0.01
821	000727	华东科技	400	952.00	0.01
822	600726	华电能源	300	951.00	0.01

823	002416	爱施德	100	947.00	0.01
824	600433	冠豪高新	200	928.00	0.01
825	300369	绿盟科技	100	910.00	0.01
826	600548	深高速	100	898.00	0.01
827	600292	远达环保	100	895.00	0.01
828	601969	海南矿业	100	885.00	0.01
829	000813	德展健康	100	868.00	0.01
830	002204	大连重工	200	862.00	0.01
831	300368	汇金股份	100	858.00	0.01
832	603169	兰石重装	100	839.00	0.01
833	600190	锦州港	200	830.00	0.01
834	002029	七匹狼	100	826.00	0.01
835	600483	福能股份	100	756.00	0.01
836	600576	祥源文化	100	756.00	0.01
837	600724	宁波富达	200	754.00	0.01
838	000810	创维数字	100	695.00	0.01
839	000761	本钢板材	100	520.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	1,449,387.00	16.02
2	600519	贵州茅台	939,893.00	10.39
3	601288	农业银行	311,174.00	3.44
4	601398	工商银行	311,084.00	3.44
5	600000	浦发银行	257,666.99	2.85
6	601166	兴业银行	243,436.00	2.69
7	002415	海康威视	240,373.00	2.66
8	000333	美的集团	238,511.00	2.64
9	601668	中国建筑	206,252.00	2.28
10	000002	万科 A	192,962.30	2.13
11	601766	中国中车	189,057.00	2.09
12	600104	上汽集团	181,471.00	2.01
13	601601	中国太保	177,837.00	1.97
14	600016	民生银行	175,801.00	1.94
15	601328	交通银行	175,548.00	1.94
16	000858	五粮液	171,670.39	1.90
17	600900	长江电力	152,800.00	1.69
18	000001	平安银行	149,162.00	1.65
19	000725	京东方 A	139,037.00	1.54

20	600028	中国石化	135,144.00	1.49
----	--------	------	------------	------

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

8.4.2 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	601318	中国平安	1,345,029.00	14.87
2	600519	贵州茅台	848,110.00	9.38
3	601288	农业银行	225,556.00	2.49
4	601398	工商银行	224,899.00	2.49
5	002415	海康威视	184,743.00	2.04
6	600000	浦发银行	183,732.00	2.03
7	000333	美的集团	181,325.00	2.00
8	601166	兴业银行	170,185.00	1.88
9	601668	中国建筑	152,805.00	1.69
10	000002	万科 A	142,960.00	1.58
11	601766	中国中车	141,482.00	1.56
12	000858	五粮液	137,491.00	1.52
13	600016	民生银行	131,754.00	1.46
14	600104	上汽集团	130,506.00	1.44
15	601601	中国太保	130,085.00	1.44
16	601328	交通银行	127,466.00	1.41
17	000001	平安银行	117,113.00	1.29
18	600900	长江电力	114,223.00	1.26
19	600028	中国石化	101,360.00	1.12
20	000725	京东方 A	101,022.00	1.12

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	17,573,121.24
卖出股票的收入（成交）总额	12,057,692.54

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,786.96	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,786.96	0.04

8.6 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	128024	宁行转债	22	2,200.00	0.02
2	113015	隆基转债	10	1,184.10	0.01
3	128022	众信转债	2	207.08	0.00
4	128020	水晶转债	2	195.78	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除浦发银行(600000)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。

2018年1月20日，上海浦东发展银行股份有限公司发布公告称，因成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为，银监会四川监管局对上海浦东发展银行成都分行处以罚款的行政处罚。

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。

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

8.12.3 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	5,387.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,780.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,167.25

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
148	60,650.10	-	-	8,976,215.05	100.00%

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	-	-

9.3 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、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,700,309.53

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	204,461,462.50
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	8,976,215.05

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门有重大人事变动。2017年8月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 50000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
海通证券	2	29,629,660.58	100.00%	21,667.33	100.00%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 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	-	-	1,519,700,000.00	100.00%	-	-

11.8 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开展直销柜台赎回费优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-12-23

2	博时富时中国 A 股指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-10-14
3	博时富时中国 A 股指数证券投资基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-10-14
4	博时富时中国 A 股指数证券投资基金-基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-30
5	关于博时富时中国 A 股指数证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-27
6	关于博时富时 A 股增加部分渠道为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-26
7	博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金份额发售公告 20170923	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-23
8	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修改基金合同、托管协议及招募说明书的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-23
9	博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同 20170923	证券时报	2017-09-23
10	博时富时中国 A 股指数证券投资基金托管协议 20170923	证券时报	2017-09-23
11	博时富时中国 A 股指数证券投资基金招募说明书 20170923	证券时报	2017-09-23
12	关于博时富时中国 A 股指数证券投资基金延缓募集的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-08
13	关于博时富时中国 A 股指数证券投资基金新增银河证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-05
14	博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金份额发售公告	证券时报	2017-09-02
15	博时富时中国 A 股指数证券投资基金招募说明书	证券时报	2017-09-02
16	博时富时中国 A 股指数证券投资基金托管协议	证券时报	2017-09-02
17	博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同	证券时报	2017-09-02

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
机构	1	2017-11-13~2017-12-25	-	9,804,392.59	9,804,392.59	-	-

个人	1	2017-09-29~2017-10-17	50,001,930.56	-	50,001,930.56	-	-
	2	2017-10-24~2017-11-01	10,109,016.76	-	10,109,016.76	-	-

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准博时富时中国 A 股指数证券投资基金设立的文件

13.1.2 《博时富时中国 A 股指数证券投资基金基金合同》

13.1.3 《博时富时中国 A 股指数证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 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

13.1.6 报告期内博时富时中国 A 股指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

13.3 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
二〇一八年三月三十一日