

博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2018 年半年度报告 2018 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 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 2018 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§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	26
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	32
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	33
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	33
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
7.13 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	36
10.8 其他重大事件	37
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	37
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	37
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	37
§ 12 备查文件目录	37
12.1 备查文件目录	37
12.2 存放地点	37
12.3 查阅方式	38

§ 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	4,167,834.09 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com

基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所
-------------	---------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-362,490.71
本期利润	-667,041.28
加权平均基金份额本期利润	-0.1339
本期加权平均净值利润率	-13.98%
本期基金份额净值增长率	-16.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-658,491.73
期末可供分配基金份额利润	-0.1580
期末基金资产净值	3,509,342.36
期末基金份额净值	0.8420
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-15.80%

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。

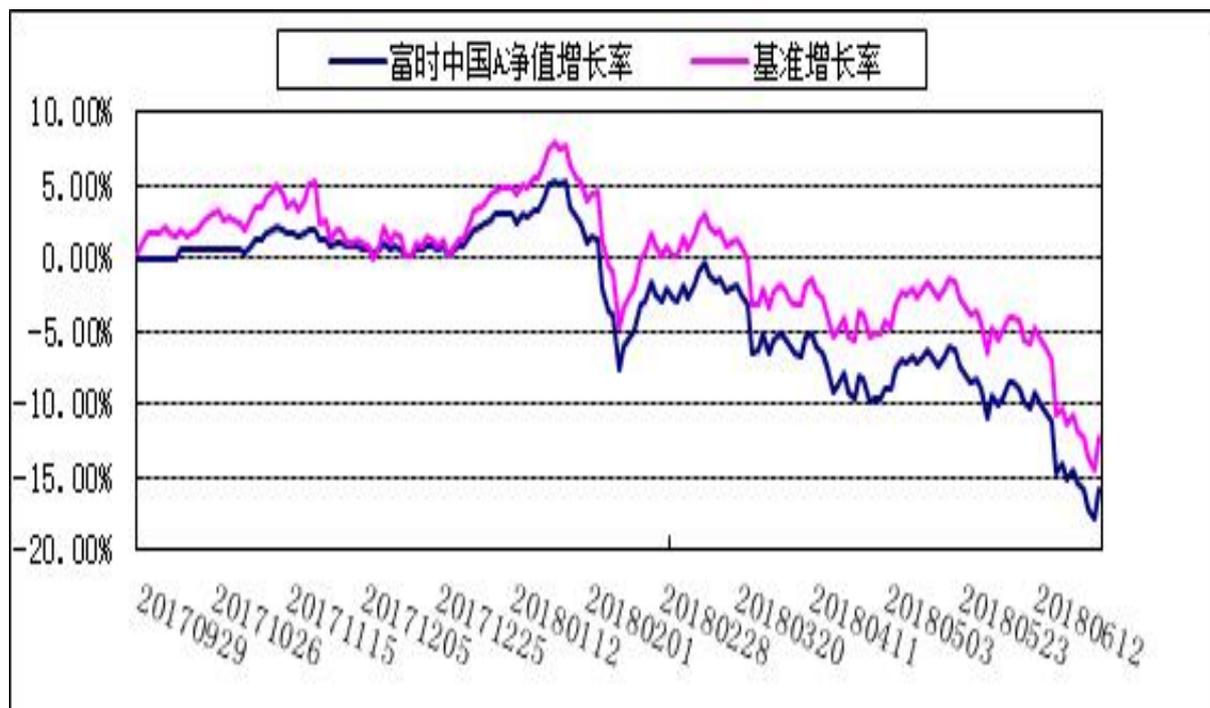
3.2 基金净值表现

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	-7.14%	1.33%	-7.96%	1.29%	0.82%	0.04%
过去三个月	-11.28%	1.08%	-10.65%	1.08%	-0.63%	0.00%
过去六个月	-16.44%	1.09%	-13.43%	1.09%	-3.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	-15.80%	0.90%	-12.33%	0.97%	-3.47%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准为：95%×富时中国 A 股指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



注：本基金的基金合同于 2017 年 09 月 29 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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 2018 年 06 月 30 日，博时基金公司共管理 185 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 8461 亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾 1947 亿元人民币，累计分红逾 872 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 2018 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时中证银联智惠大数据 100 指数(A 类)、博时裕富沪深 300 指数(A 类)等今年以来净值增长率同类排名为前 1/4；股票型分级子基金里，博时中证银行分级指数(B 级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前 1/3；混合偏股型基金中，博时创业成长混合(C 类)今年以来净值增长率同类基金排名第一，博时创业成长混合(A 类)今年以来净值增长率同类基金排名位居前 1/10，博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前 1/3；混合灵活配置型基金中，博时裕益灵

活配置混合基金今年以来净值增长率为 3.14%，在 166 只同类基金排名第 6，博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 4.38%，同类基金排名位居前 1/10，博时新价值灵活配置混合(A 类)、博时新策略灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率分别为 2.12%、1.93%、1.65%、1.60%，同类基金排名均位居前 1/8，博时新价值灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率为 2.07%，同类基金中排名位于前 1/6。

黄金基金类，博时黄金 ETF 联接(A 类)、博时黄金 ETF 联接(C 类)今年以来净值增长率同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时天颐债券(A 类)、博时宏观回报债券(A/B 类)、博时信用债券(A/B 类)今年以来净值增长率为 5.11%、4.56%、4.54%，同类 219 只基金中分别排名第 3、第 8、第 9 位，博时天颐债券(C 类)、博时信用债券(R 类)、博时信用债券(C 类)、博时宏观回报债券(C 类)今年以来净值增长率分别为 4.88%、4.56%、4.34%、4.23%，同类 153 只基金中分别排名第 2、第 4、第 7、第 8 位，博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为 4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%，同类排名前 1/10；货币基金类，博时兴荣货币、博时合惠货币(A 类)今年以来净值增长率分别为 2.21%、2.18%，在 315 只同类基金排名中位列第 15 位与第 24 位。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF(QDII)、博时标普 500ETF 联接(QDII)(A 类)，今年以来净值增长率同类排名分别位于前 1/5、1/4。

2、其他大事件

2018 年 6 月 8 日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017 年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018 年 5 月 24 日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业 20 年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾 23 年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业 20 年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有 20 人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继 2016 年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018 年 5 月 23 日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募 20 年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金(000277)获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券(QDII)(人民币 050030：，美元现汇：050202，美元现钞：050203)获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018 年 5 月 17 日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖(DevOps 统一研发

平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合业务接入平台)三项大奖,成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018年5月10日,由《上海证券报》主办的“2018中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上,博时基金揽获“金基金TOP基金公司”这一最具份量的公司大奖;博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报基金经理奖”。在第15届金基金奖评选中,旗下价值投资典范产品博时主题行业(160505)获得“三年期金基金分红奖”。

2018年3月26日,第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业20年卓越贡献公司”大奖。同时,旗下绩优产品博时主题行业混合(LOF)(160505)荣获“2017年度开放式混合型金牛基金”奖;博时信用债纯债债券(050027)荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018年3月22日,由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金20周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼”在北京举办,本次评选中,博时基金一举斩获本届“20周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金20年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖,同时,旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金(二级债)”奖双双收入囊中,博时聚润纯债债券则获得“2017年度普通债券型明星基金”奖。

2018年2月2日,由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办,此次论坛以“安全与创新”为主题,邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018年1月11日,由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业20年最佳创新产品奖颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”,旗下产品博时主题行业混合基金(160505)和博时黄金ETF分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”,成为当天最大赢家之一。

2018年1月9日,由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

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		
桂征辉	基金经理	2018-06-12	-	8.9	2006年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009年加入博时基金管理有限公司

					司，历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理。现任博时沪深 300 指数基金（2015.7.21-至今）兼博时中证淘金大数据 100 指数基金（2015.7.21-至今）、博时银智大数据 100 指数基金（2016.5.20-至今）、博时中证 500 指数增强基金（2017.9.26-至今）、博时富时中国 A 股指数基金（2018.6.12-至今）的基金经理。
万琼	基金经理	2017-09-29	-	11.3	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（2015.6.8-至今）、博时上证超大盘 ETF 联接基金（2015.6.8-至今）、博时上证自然资源 ETF 基金（2015.6.8-至今）、博时上证自然资源 ETF 联接基金（2015.6.8-至今）、博时标普 500ETF 基金（2015.10.8-至今）、博时标普 500ETF 联接(QDII)基金（2015.10.8-至今）、博时富时中国 A 股指数基金（2017.9.29-至今）的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，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

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

2018 年上半年，国内宏观经济仍在筑底阶段，6 月官方制造业 PMI 和新订单小幅下行，预计 6 月经济景气最多有小幅下行，考虑到去年 6 月环比增速巨大，6 月工业增加值同比增速大概率会掉到 6.0% 以下。购进价格指数显示 PPI 同比增速将有所回升。5 月工业企业的利润较 4 月有小幅上升，收入有小幅下降。国内因金融去杠杆、中美贸易战等因素，导致蓝筹股指跌幅较大，而对质押融资风险的担忧，导致中小创指也出现较为明显的下行。上证 50 和沪深 300 分别下跌 13.30%、12.94%，中证 500 下跌 16.53%，中证 1000 下跌 20.08%，而创业板指表现相对较好，仅下跌 8.33%。板块方面，受避险情绪影响，仅餐饮旅游、医药、食品饮料板块上涨，而通信、电力设备、有色金属等板块表现较差。从行情来看，前半年涨跌幅为正的仅有食品饮料、餐饮旅游、食品饮料三个行业，涨幅分别是 10.15%、4.46%、1.82%；跌幅较大的行业有综合、电力设备、通信、有色金属、机械，跌幅分别是 32.12%、27.00%、26.66%、23.21%、22.15%。

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 2018 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.8420 元，份额累计净值为 0.8420 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 -16.44%，同期业绩基准增长率 -13.43%。

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 年下半年，宏观经济方面，宏观政策边际上有改善，监管政策也有调整，显示政府对股市下跌有政策应对，过度悲观的情绪将得到修复，看好市场反弹，反弹中相对看好成长板块。利率方面，中美贸易争端、国内金融收缩和货币政策应对性调整，均强化了市场的避险情绪，持续推升利率债的结构性行情，利率水平有望延续下行趋势。综合考虑，中美贸易战、棚改货币化预期及人民币贬值等各类风险因素，我们认为大部分已反映到行情中，看好下半年的市场行情，投资者可关注成长板块的投资机会。结构上，总体仍均衡配置，风格可稍偏成长。但中美贸易争端前景依然迷茫，而 A 股的股权质押风险、信用风险也未得到充分清理。国内股市已处于底部，但即使有所反弹，仍建议保持仓位。

在投资策略上，博时富时中国 A 股指数基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪富时中国 A 股指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过博时富时中国 A 股指数基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金在本报告期内，于 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 6 月 29 日出现了连续 60 个工作日资产净值低于五千万元及持有人少于 200 人的情形，针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时富时中国 A 股指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	493,155.56	3,983,912.74
结算备付金		-	-
存出保证金		2,323.06	5,387.21

交易性金融资产	6.4.3.2	3,313,752.70	5,554,207.91
其中：股票投资		3,313,752.70	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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	103.76	1,780.04
应收股利		-	-
应收申购款		1,988.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		3,811,323.15	9,545,287.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		17,339.04	298,699.45
应付管理人报酬		3,031.24	16,603.36
应付托管费		606.24	3,320.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	2,876.06	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	6.4.3.8	278,128.21	159,738.42
负债合计		301,980.79	500,029.25
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	4,167,834.09	8,976,215.05
未分配利润	6.4.3.10	-658,491.73	69,043.60
所有者权益合计		3,509,342.36	9,045,258.65
负债和所有者权益总计		3,811,323.15	9,545,287.90

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,167,834.09 份，基金份额净值 0.8420 元。

6.2 利润表

会计主体：博时富时中国 A 股指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		-406,355.25

1. 利息收入		2,561.44
其中：存款利息收入	6.4.3.11	2,559.97
债券利息收入		1.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-116,978.84
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-158,514.39
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.3.13	602.96
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.3.14	-
股利收益	6.4.3.15	40,932.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-304,550.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	12,612.72
减：二、费用		260,686.03
1. 管理人报酬		23,574.82
2. 托管费		4,715.06
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.3.18	11,276.22
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.3.19	221,119.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-667,041.28
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-667,041.28

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时富时中国 A 股指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,976,215.05	69,043.60	9,045,258.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-667,041.28	-667,041.28
三、本期基金份额交易产	-4,808,380.96	-60,494.05	-4,868,875.01

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	182,761.60	-13,278.72	169,482.88
2. 基金赎回款	-4,991,142.56	-47,215.33	-5,038,357.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,167,834.09	-658,491.73	3,509,342.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深府办[2011]60号《深圳市地方教育附加征收管理暂行办法》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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	493,155.56
定期存款	-
其他存款	-
合计	493,155.56

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,696,616.41	3,313,752.70	-382,863.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,696,616.41	3,313,752.70	-382,863.71

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	102.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.10
合计	103.76

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,876.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,876.06

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	127.73
应付指数使用费	170,192.38
预提费用	107,808.10
合计	278,128.21

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,976,215.05	8,976,215.05
本期申购	182,761.60	182,761.60
本期赎回（以“-”号填列）	-4,991,142.56	-4,991,142.56
本期末	4,167,834.09	4,167,834.09

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	73,741.69	-4,698.09	69,043.60
本期利润	-362,490.71	-304,550.57	-667,041.28
本期基金份额交易产生的变动数	2,202.11	-62,696.16	-60,494.05
其中：基金申购款	-7,124.27	-6,154.45	-13,278.72
基金赎回款	9,326.38	-56,541.71	-47,215.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-286,546.91	-371,944.82	-658,491.73

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	2,430.43
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	86.07
其他	43.47
合计	2,559.97

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	4,821,607.45
减：卖出股票成本总额	4,980,121.84
买卖股票差价收入	-158,514.39

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,205.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,600.00
减：应收利息总额	2.22
买卖债券差价收入	602.96

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	40,932.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	40,932.59

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-304,550.57
——股票投资	-304,363.61
——债券投资	-186.96
——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	-304,550.57

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	12,171.18
基金转换费收入	441.54
合计	12,612.72

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	11,276.22
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	11,276.22

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	83,012.91
银行汇划费	595.00
指数使用费	112,716.83
合计	221,119.93

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

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 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 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,574.82
其中：支付销售机构的客户维护费	4,599.22

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.00% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,715.06

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	493,155.56	2,430.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2018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

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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002450	康得新	2018-06-04	重大事项停牌	17.08	-	-	600.00	14,229.41	10,248.00	-
600515	海航基础	2018-01-23	重大事项停牌	11.16	2018-08-13	10.04	100.00	1,427.00	1,116.00	-
600158	中体产业	2018-03-27	重大事项停牌	11.64	2018-07-16	11.61	100.00	1,324.00	1,164.00	-
300317	珈伟股份	2018-02-05	重大事项停牌	11.90	2018-07-03	10.71	100.00	1,593.00	1,190.00	-
002143	印纪传媒	2018-02-02	重大事项停牌	12.09	2018-07-09	10.88	100.00	1,360.00	1,209.00	-
600221	海航控股	2018-01-10	重大事项停牌	3.23	2018-07-20	2.91	4,000.00	12,845.00	12,920.00	-
600751	海航科技	2018-01-12	重大事项停牌	6.49	-	-	200.00	1,204.00	1,298.00	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大事项停牌	4.78	2018-07-20	4.29	300.00	1,737.00	1,434.00	-
002239	奥特佳	2018-04-02	重大事项停牌	3.62	-	-	400.00	1,644.00	1,448.00	-
000723	美锦能源	2018-03-27	重大事项停牌	5.43	2018-07-31	4.89	300.00	2,553.00	1,629.00	-
002699	美盛文化	2018-02-05	重大事项停牌	18.76	2018-07-02	16.88	100.00	1,931.00	1,876.00	-
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项停牌	4.96	2018-08-07	4.46	400.00	3,684.00	1,984.00	-
600086	东方金钰	2018-01-19	重大事项停牌	10.04	-	-	200.00	2,147.00	2,008.00	-
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大事项停牌	2.02	2018-08-16	1.83	1,000.00	2,261.83	2,020.00	-
600335	国机汽车	2018-04-03	重大事项停牌	10.43	-	-	200.00	2,400.67	2,086.00	-
000022	深赤湾A	2017-11-20	重大事项停牌	22.82	2018-07-10	20.55	100.00	2,547.00	2,282.00	-
002210	飞马国际	2018-03-26	重大事项停牌	12.33	2018-08-13	11.07	200.00	2,621.00	2,466.00	-

002437	誉衡药业	2018-06-11	重大事项停牌	6.20	2018-08-13	5.57	400.00	2,708.00	2,480.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项停牌	8.40	2018-07-16	7.56	300.00	3,029.40	2,520.00	-
002147	新光圆成	2018-01-18	重大事项停牌	14.76	-	-	200.00	2,692.67	2,952.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	4,000.00	32,755.15	29,880.00	-
600745	闻泰科技	2018-04-17	重大事项停牌	30.48	-	-	100.00	3,101.00	3,048.00	-
002051	中工国际	2018-04-04	重大事项停牌	15.27	-	-	200.00	4,133.33	3,054.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事项停牌	16.60	2018-07-31	16.50	200.00	2,830.00	3,320.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项停牌	12.89	2018-07-09	11.60	300.00	3,948.00	3,867.00	-
300266	兴源环境	2018-02-05	重大事项停牌	19.99	2018-07-02	17.99	200.00	5,458.00	3,998.00	-
000939	*ST 凯迪	2017-11-16	重大事项停牌	4.99	2018-07-02	4.74	900.00	4,540.50	4,491.00	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	-	-	900.00	4,523.77	5,400.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	1,100.00	6,560.29	6,424.00	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项停牌	19.52	-	-	400.00	8,034.00	7,808.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项停牌	13.08	2018-08-27	13.47	700.00	14,481.02	9,156.00	-
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项停牌	23.28	2018-07-10	24.00	400.00	13,552.50	9,312.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项停牌	32.50	-	-	300.00	10,232.00	9,750.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用组合复制法，按照成份股在富时中国 A 股指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以富时中国 A 股指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对富时中国 A 股指数的有效跟踪。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险

量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券（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和资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.04%）。

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 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有卖出回购金融资产，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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的

特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 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%。

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。

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，存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日 资产	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
银行存款	493,155.56	-	-	-	493,155.56
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	2,323.06	-	-	-	2,323.06
交易性金融资产	-	-	-	3,313,752.70	3,313,752.70
应收证券清算款	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	103.76	103.76
应收申购款	-	-	-	1,988.07	1,988.07
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	495,478.62	-	-	3,315,844.53	3,811,323.15
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	17,339.04	17,339.04
应付证券清算款	-	-	-	0.00	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,031.24	3,031.24
应付托管费	-	-	-	606.24	606.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,876.06	2,876.06
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	278,128.21	278,128.21
负债总计	-	-	-	301,980.79	301,980.79
利率敏感度缺口	495,478.62	-	-	3,013,863.74	3,509,342.36
上年度末 2017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	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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：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（2017 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市

市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的比例不低于基金资产总值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	3,313,752.70	94.43	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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,313,752.70	94.43	5,550,420.95	61.36

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金成立尚不满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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 2018 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 3,157,914.70 元，属于第二层次的余额为 155,838.00 元，无属于第三层次的余额

(2017 年 12 月 31 日：第一层次 5,429,045.61 元，第二层次 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

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 权益工具投资
2018 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	24,018.00
转出第三层次	-21,780.00
当期利得或损失总额	-2,238.00
—计入损益的利得或损失	-2,238.00
2018 年 6 月 30 日	-
2018 年 6 月 30 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益(从年初起算)	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

于 2017 年度，本基金无第三层次资产变动。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 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	3,313,752.70	86.94

	其中：股票	3,313,752.70	86.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	493,155.56	12.94
8	其他各项资产	4,414.89	0.12
9	合计	3,811,323.15	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	21,030.00	0.60
B	采矿业	163,049.80	4.65
C	制造业	1,626,784.90	46.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	95,289.50	2.72
E	建筑业	98,546.40	2.81
F	批发和零售业	82,716.80	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	108,752.00	3.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,109.30	3.96
J	金融业	654,147.60	18.64
K	房地产业	140,443.00	4.00
L	租赁和商务服务业	66,894.00	1.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	33,537.40	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,934.00	0.94
R	文化、体育和娱乐业	48,558.00	1.38
S	综合	1,960.00	0.06
	合计	3,313,752.70	94.43

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	200	146,292.00	4.17
2	601318	中国平安	1,200	70,296.00	2.00
3	601288	农业银行	15,700	54,008.00	1.54
4	601398	工商银行	9,000	47,880.00	1.36
5	000858	五粮液	600	45,600.00	1.30
6	600104	上汽集团	1,200	41,988.00	1.20

7	002415	海康威视	1,100	40,843.00	1.16
8	600276	恒瑞医药	520	39,395.20	1.12
9	601166	兴业银行	2,600	37,440.00	1.07
10	000333	美的集团	700	36,554.00	1.04
11	600000	浦发银行	3,600	34,416.00	0.98
12	000651	格力电器	700	33,005.00	0.94
13	601328	交通银行	5,600	32,144.00	0.92
14	600016	民生银行	4,400	30,800.00	0.88
15	601390	中国中铁	4,000	29,880.00	0.85
16	600900	长江电力	1,800	29,052.00	0.83
17	601668	中国建筑	5,040	27,518.40	0.78
18	600309	万华化学	600	27,252.00	0.78
19	600585	海螺水泥	800	26,784.00	0.76
20	002304	洋河股份	200	26,320.00	0.75
21	601006	大秦铁路	3,200	26,272.00	0.75
22	600028	中国石化	4,000	25,960.00	0.74
23	601888	中国国旅	400	25,764.00	0.73
24	601818	光大银行	6,800	24,888.00	0.71
25	601766	中国中车	3,000	23,100.00	0.66
26	600436	片仔癀	200	22,386.00	0.64
27	600887	伊利股份	800	22,320.00	0.64
28	601601	中国太保	700	22,295.00	0.64
29	600009	上海机场	400	22,192.00	0.63
30	600030	中信证券	1,300	21,541.00	0.61
31	000538	云南白药	200	21,392.00	0.61
32	600690	青岛海尔	1,100	21,186.00	0.60
33	601186	中国铁建	2,300	19,826.00	0.56
34	000002	万科 A	800	19,680.00	0.56
35	300015	爱尔眼科	600	19,374.00	0.55
36	600015	华夏银行	2,600	19,370.00	0.55
37	601211	国泰君安	1,300	19,162.00	0.55
38	601229	上海银行	1,200	18,912.00	0.54
39	600572	康恩贝	2,600	18,642.00	0.53
40	601158	重庆水务	3,400	18,428.00	0.53
41	002024	苏宁易购	1,300	18,304.00	0.52
42	000568	泸州老窖	300	18,258.00	0.52
43	601628	中国人寿	800	18,016.00	0.51
44	601088	中国神华	900	17,946.00	0.51
45	601169	北京银行	2,900	17,487.00	0.50
46	600867	通化东宝	720	17,258.40	0.49
47	002027	分众传媒	1,800	17,226.00	0.49
48	600050	中国联通	3,500	17,220.00	0.49
49	601336	新华保险	400	17,152.00	0.49
50	600019	宝钢股份	2,200	17,138.00	0.49
51	600048	保利地产	1,400	17,080.00	0.49
52	600741	华域汽车	700	16,604.00	0.47
53	600196	复星医药	400	16,556.00	0.47
54	600812	华北制药	3,800	16,492.00	0.47
55	601688	华泰证券	1,100	16,467.00	0.47
56	601928	凤凰传媒	2,700	16,416.00	0.47

57	002142	宁波银行	1,000	16,290.00	0.46
58	002269	美邦服饰	5,600	16,240.00	0.46
59	601998	中信银行	2,600	16,146.00	0.46
60	000686	东北证券	2,500	16,025.00	0.46
61	600518	康美药业	700	16,016.00	0.46
62	002008	大族激光	300	15,957.00	0.45
63	000895	双汇发展	600	15,846.00	0.45
64	600395	盘江股份	2,600	15,782.00	0.45
65	000001	平安银行	1,700	15,453.00	0.44
66	002267	陕天然气	2,200	15,400.00	0.44
67	000876	新希望	2,400	15,216.00	0.43
68	000338	潍柴动力	1,700	14,875.00	0.42
69	600017	日照港	4,600	14,766.00	0.42
70	601009	南京银行	1,900	14,687.00	0.42
71	300003	乐普医疗	400	14,672.00	0.42
72	601515	东风股份	1,900	14,668.00	0.42
73	002275	桂林三金	1,000	14,600.00	0.42
74	002653	海思科	1,200	14,400.00	0.41
75	601198	东兴证券	1,100	14,344.00	0.41
76	600352	浙江龙盛	1,200	14,340.00	0.41
77	002594	比亚迪	300	14,304.00	0.41
78	000598	兴蓉环境	3,500	14,210.00	0.40
79	000725	京东方 A	4,000	14,160.00	0.40
80	601989	中国重工	3,500	14,140.00	0.40
81	600169	太原重工	5,900	13,806.00	0.39
82	000861	海印股份	5,500	13,805.00	0.39
83	000902	新洋丰	1,500	13,800.00	0.39
84	601311	骆驼股份	1,200	13,764.00	0.39
85	300122	智飞生物	300	13,722.00	0.39
86	601139	深圳燃气	2,470	13,708.50	0.39
87	600958	东方证券	1,500	13,695.00	0.39
88	002673	西部证券	1,800	13,590.00	0.39
89	002044	美年健康	600	13,560.00	0.39
90	600292	远达环保	2,300	13,501.00	0.38
91	600703	三安光电	700	13,454.00	0.38
92	600018	上港集团	2,200	13,112.00	0.37
93	600006	东风汽车	3,200	13,088.00	0.37
94	601777	力帆股份	2,500	13,075.00	0.37
95	000988	华工科技	900	13,005.00	0.37
96	600500	中化国际	1,900	12,958.00	0.37
97	600221	海航控股	4,000	12,920.00	0.37
98	600340	华夏幸福	500	12,875.00	0.37
99	002422	科伦药业	400	12,840.00	0.37
100	002099	海翔药业	2,500	12,825.00	0.37
101	600737	中粮糖业	1,700	12,818.00	0.37
102	000758	中色股份	2,800	12,600.00	0.36
103	600809	山西汾酒	200	12,578.00	0.36
104	600031	三一重工	1,400	12,558.00	0.36
105	000768	中航飞机	800	12,512.00	0.36
106	601155	新城控股	400	12,388.00	0.35

107	600426	华鲁恒升	700	12,313.00	0.35
108	600580	卧龙电气	1,600	12,192.00	0.35
109	600108	亚盛集团	4,200	12,138.00	0.35
110	000078	海王生物	2,500	12,025.00	0.34
111	600038	中直股份	300	11,997.00	0.34
112	002416	爱施德	2,040	11,974.80	0.34
113	600376	首开股份	1,700	11,951.00	0.34
114	601168	西部矿业	1,900	11,932.00	0.34
115	002215	诺普信	1,700	11,832.00	0.34
116	002308	威创股份	1,400	11,620.00	0.33
117	002153	石基信息	400	11,600.00	0.33
118	002460	赣锋锂业	300	11,574.00	0.33
119	601899	紫金矿业	3,200	11,552.00	0.33
120	601225	陕西煤业	1,400	11,508.00	0.33
121	600398	海澜之家	900	11,466.00	0.33
122	601933	永辉超市	1,500	11,460.00	0.33
123	002500	山西证券	1,700	11,458.00	0.33
124	002466	天齐锂业	230	11,405.70	0.33
125	000975	银泰资源	1,120	11,356.80	0.32
126	002236	大华股份	500	11,275.00	0.32
127	002475	立讯精密	500	11,270.00	0.32
128	600705	中航资本	2,400	11,208.00	0.32
129	000060	中金岭南	2,300	11,178.00	0.32
130	002055	得润电子	700	11,165.00	0.32
131	300070	碧水源	800	11,144.00	0.32
132	600406	国电南瑞	700	11,060.00	0.32
133	600029	南方航空	1,300	10,985.00	0.31
134	601238	广汽集团	980	10,917.20	0.31
135	600881	亚泰集团	2,900	10,817.00	0.31
136	600570	恒生电子	200	10,590.00	0.30
137	600096	云天化	2,100	10,584.00	0.30
138	600297	广汇汽车	1,800	10,548.00	0.30
139	600373	中文传媒	800	10,280.00	0.29
140	000718	苏宁环球	2,800	10,276.00	0.29
141	002450	康得新	600	10,248.00	0.29
142	600111	北方稀土	900	10,242.00	0.29
143	600657	信达地产	2,400	10,200.00	0.29
144	601567	三星医疗	1,400	10,192.00	0.29
145	600391	航发科技	700	10,185.00	0.29
146	601608	中信重工	3,900	10,140.00	0.29
147	600567	山鹰纸业	2,600	10,036.00	0.29
148	300059	东方财富	740	9,753.20	0.28
149	600516	方大炭素	400	9,752.00	0.28
150	002602	世纪华通	300	9,750.00	0.28
151	603799	华友钴业	100	9,747.00	0.28
152	600478	科力远	1,900	9,690.00	0.28
153	002001	新和成	510	9,669.60	0.28
154	300296	利亚德	750	9,660.00	0.28
155	002230	科大讯飞	300	9,621.00	0.27
156	601666	平煤股份	2,300	9,614.00	0.27

157	600521	华海药业	360	9,608.40	0.27
158	600547	山东黄金	400	9,568.00	0.27
159	600588	用友网络	390	9,558.90	0.27
160	000977	浪潮信息	400	9,540.00	0.27
161	000069	华侨城 A	1,300	9,399.00	0.27
162	601012	隆基股份	560	9,346.40	0.27
163	300072	三聚环保	400	9,312.00	0.27
164	600487	亨通光电	420	9,261.00	0.26
165	300136	信维通信	300	9,219.00	0.26
166	600383	金地集团	900	9,171.00	0.26
167	002241	歌尔股份	900	9,171.00	0.26
168	002310	东方园林	700	9,156.00	0.26
169	600718	东软集团	700	9,142.00	0.26
170	600056	中国医药	500	9,135.00	0.26
171	601800	中国交建	800	9,112.00	0.26
172	002640	跨境通	600	9,012.00	0.26
173	000100	TCL 集团	3,100	8,990.00	0.26
174	600816	安信信托	1,240	8,977.60	0.26
175	002714	牧原股份	200	8,892.00	0.25
176	600497	驰宏锌锗	1,600	8,720.00	0.25
177	002280	联络互动	1,500	8,580.00	0.24
178	002439	启明星辰	400	8,488.00	0.24
179	601699	潞安环能	900	8,334.00	0.24
180	603993	洛阳钼业	1,300	8,177.00	0.23
181	002698	博实股份	900	8,172.00	0.23
182	300251	光线传媒	800	8,144.00	0.23
183	002456	欧菲科技	500	8,065.00	0.23
184	002414	高德红外	600	8,064.00	0.23
185	600522	中天科技	900	7,929.00	0.23
186	002146	荣盛发展	900	7,857.00	0.22
187	000063	中兴通讯	600	7,818.00	0.22
188	002252	上海莱士	400	7,808.00	0.22
189	600446	金证股份	700	7,707.00	0.22
190	600208	新湖中宝	2,000	7,640.00	0.22
191	600271	航天信息	300	7,581.00	0.22
192	300418	昆仑万维	400	7,552.00	0.22
193	600633	浙数文化	900	7,506.00	0.21
194	603000	人民网	900	7,470.00	0.21
195	600862	中航高科	1,200	7,380.00	0.21
196	000662	天夏智慧	1,040	6,687.20	0.19
197	000415	渤海金控	1,100	6,424.00	0.18
198	002202	金风科技	500	6,320.00	0.18
199	601111	中国国航	700	6,223.00	0.18
200	000671	阳光城	1,000	5,970.00	0.17
201	000786	北新建材	300	5,559.00	0.16
202	000825	太钢不锈	900	5,400.00	0.15
203	601600	中国铝业	1,400	5,376.00	0.15
204	000826	启迪桑德	280	4,894.40	0.14
205	002384	东山精密	200	4,800.00	0.14
206	603019	中科曙光	100	4,587.00	0.13

207	000939	凯迪生态	900	4,491.00	0.13
208	300274	阳光电源	500	4,485.00	0.13
209	002049	紫光国芯	100	4,412.00	0.13
210	600959	江苏有线	800	4,080.00	0.12
211	300266	兴源环境	200	3,998.00	0.11
212	002601	龙蟠佰利	300	3,879.00	0.11
213	000566	海南海药	300	3,867.00	0.11
214	002085	万丰奥威	400	3,760.00	0.11
215	300146	汤臣倍健	200	3,320.00	0.09
216	002051	中工国际	200	3,054.00	0.09
217	600745	闻泰科技	100	3,048.00	0.09
218	002147	新光圆成	200	2,952.00	0.08
219	002221	东华能源	300	2,931.00	0.08
220	002366	台海核电	200	2,852.00	0.08
221	000793	华闻传媒	300	2,520.00	0.07
222	002437	誉衡药业	400	2,480.00	0.07
223	002210	飞马国际	200	2,466.00	0.07
224	000766	通化金马	200	2,376.00	0.07
225	000022	深赤湾 A	100	2,282.00	0.07
226	600335	国机汽车	200	2,086.00	0.06
227	600022	山东钢铁	1,000	2,020.00	0.06
228	600086	东方金钰	200	2,008.00	0.06
229	000008	神州高铁	400	1,984.00	0.06
230	000009	中国宝安	400	1,960.00	0.06
231	002699	美盛文化	100	1,876.00	0.05
232	002002	鸿达兴业	400	1,844.00	0.05
233	000401	冀东水泥	200	1,774.00	0.05
234	600614	鹏起科技	300	1,713.00	0.05
235	600682	南京新百	100	1,644.00	0.05
236	000723	美锦能源	300	1,629.00	0.05
237	002312	*ST 三泰	400	1,488.00	0.04
238	002239	奥特佳	400	1,448.00	0.04
239	600568	中珠医疗	300	1,440.00	0.04
240	000564	供销大集	300	1,434.00	0.04
241	600751	天海投资	200	1,298.00	0.04
242	002143	印纪传媒	100	1,209.00	0.03
243	300317	珈伟股份	100	1,190.00	0.03
244	600158	中体产业	100	1,164.00	0.03
245	300032	金龙机电	200	1,122.00	0.03
246	600515	海航基础	100	1,116.00	0.03
247	002413	雷科防务	200	1,078.00	0.03
248	000156	华数传媒	100	964.00	0.03
249	600880	博瑞传播	200	852.00	0.02
250	600393	粤泰股份	200	724.00	0.02
251	002122	天马股份	300	606.00	0.02

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	600519	贵州茅台	77,795.00	0.86
2	601318	中国平安	56,246.00	0.62
3	000651	格力电器	45,561.00	0.50
4	601288	农业银行	44,360.00	0.49
5	601398	工商银行	39,906.00	0.44
6	601166	兴业银行	33,689.00	0.37
7	002415	海康威视	32,297.00	0.36
8	600104	上汽集团	32,259.00	0.36
9	600000	浦发银行	30,846.00	0.34
10	600016	民生银行	27,270.00	0.30
11	601328	交通银行	26,187.00	0.29
12	601668	中国建筑	24,445.00	0.27
13	601006	大秦铁路	22,632.00	0.25
14	601766	中国中车	22,545.00	0.25
15	601818	光大银行	21,965.00	0.24
16	601158	重庆水务	21,747.00	0.24
17	600900	长江电力	21,070.00	0.23
18	601186	中国铁建	20,820.00	0.23
19	600015	华夏银行	20,554.00	0.23
20	601390	中国中铁	20,380.00	0.23

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	121,463.00	1.34
2	600519	贵州茅台	75,612.00	0.84
3	601288	农业银行	73,271.00	0.81
4	601398	工商银行	71,867.00	0.79
5	002415	海康威视	61,401.00	0.68
6	601166	兴业银行	58,632.00	0.65
7	600000	浦发银行	56,555.00	0.63
8	000002	万科 A	51,709.49	0.57
9	000333	美的集团	51,580.00	0.57
10	601989	中国重工	45,323.00	0.50
11	601668	中国建筑	45,160.00	0.50
12	600104	上汽集团	43,886.00	0.49
13	601766	中国中车	40,894.00	0.45
14	600016	民生银行	38,954.00	0.43
15	601328	交通银行	38,812.00	0.43
16	601601	中国太保	34,695.00	0.38
17	600028	中国石化	33,413.00	0.37
18	600900	长江电力	32,594.00	0.36

19	600030	中信证券	32,514.00	0.36
20	000001	平安银行	31,816.00	0.35

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	3,047,817.20
卖出股票的收入（成交）总额	4,821,607.45

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除兴业银行（601166）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4月19日，因重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等原因，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

对该股票投资决策程序的说明:

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

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,323.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	103.76
5	应收申购款	1,988.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,414.89

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 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
88	47,361.75	-	-	4,167,834.09	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人所有从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本开放式基金
 2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 9 月 29 日）基金份额总额	202,737,368.02
本报告期期初基金份额总额	8,976,215.05
本报告期基金总申购份额	182,761.60
减：本报告期基金总赎回份额	4,991,142.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,167,834.09

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	7,868,502.90	100.00%	5,754.60	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	4,205.18	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于博时富时中国 A 股指数证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-14
2	博时富时中国 A 股指数证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 1 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-12
3	博时富时中国 A 股指数证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 1 号（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-12
4	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-20
5	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2017 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
6	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2017 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
7	博时富时中国 A 股指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-20

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一八年八月二十九日