

博时新兴成长混合型证券投资基金 2019 年半年度报告 2019 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 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	5
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	10
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	27
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	28
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	30
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	30
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	30
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	31
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	31
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	31
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	31
7.12 投资组合报告附注	31
§8 基金份额持有人信息	32
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	32
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	32
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	32
§9 开放式基金份额变动	32
§10 重大事件揭示	32

10.1 基金份额持有人大会决议	33
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	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	33
10.4 基金投资策略的改变	33
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	33
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	33
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	33
10.8 其他重大事件	35
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	36
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	36
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	36
§ 12 备查文件目录	36
12.1 备查文件目录	36
12.2 存放地点	36
12.3 查阅方式	36

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时新兴成长混合型证券投资基金
基金简称	博时新兴成长混合
基金主代码	050009
交易代码	050009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 7 月 6 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,085,588,253.68 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济正处于长期稳定增长周期，本基金通过深入研究并积极投资于全市场各类行业中的新兴高速增长企业，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过“自上而下”的宏观分析，以及定性分析与定量分析相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行配置。本基金将分析和预测众多宏观经济变量，包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等，并关注国家财政、税收、货币、汇率以及股权分置改革政策和其它证券市场政策等。本基金将在此基础上决定股票、固定收益证券和现金等大类资产在给定区间内的动态配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	陆志俊
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		518040	200336
法定代表人		张光华	彭纯

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
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、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	259,069,354.72
本期利润	809,945,205.77
加权平均基金份额本期利润	0.1569
本期加权平均净值利润率	26.47%
本期基金份额净值增长率	33.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,737,497,456.80
期末可供分配基金份额利润	0.3417
期末基金资产净值	3,141,716,393.53
期末基金份额净值	0.618
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.81%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

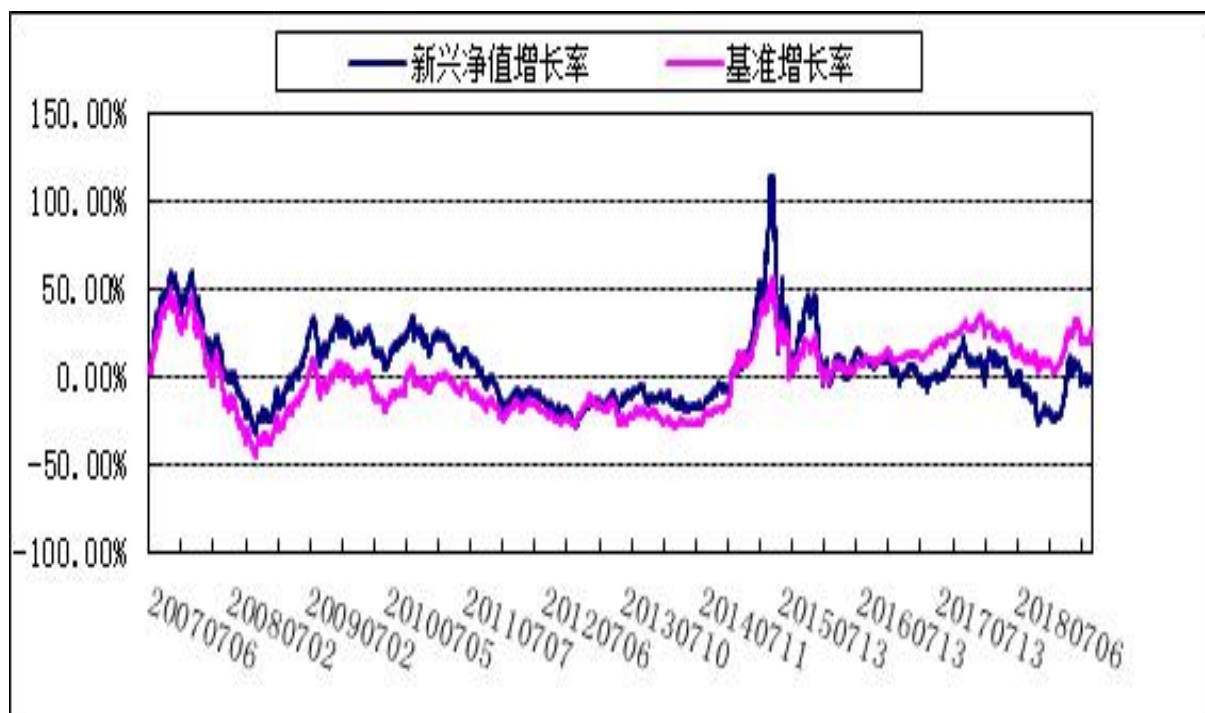
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.48%	1.47%	4.45%	0.92%	-4.93%	0.55%
过去三个月	-4.19%	1.76%	-0.77%	1.22%	-3.42%	0.54%
过去六个月	33.48%	1.84%	21.78%	1.23%	11.70%	0.61%
过去一年	0.49%	1.80%	8.89%	1.22%	-8.40%	0.58%
过去三年	-11.08%	1.48%	19.82%	0.88%	-30.90%	0.60%
自基金合同生效起至今	0.81%	1.67%	26.67%	1.40%	-25.86%	0.27%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。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 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2019 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 185 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 9345 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 2699 亿元人民币，累计分红逾 980 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 2 季末：

博时旗下权益类基金业绩亮眼，54 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率银河同类排名在前 1/2，31 只银河同类排名在前 1/4，15 只银河同类排名在前 1/10，15 只银河同类排名在前 10。其中，博时回报灵活配置混合、博时乐臻定期开放混合、博时医疗保健行业混合今年来净值增长率分别在 145 只、61 只、14 只同类产品中排名第 1；博时量化平衡混合、博时弘泰定期开放混合、博时上证 50ETF 联接(A 类)、博时上证 50ETF 联接(C 类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 今年来净值增长率分别在 102 只、61 只、46 只、34 只、15 只同类产品中排名第 3；博时特许价值混合

(A类) 今年来净值增长率在 414 只同类产品中排名第 20; 博时鑫源灵活配置混合(C类)、博时鑫源灵活配置混合(A类)、博时上证 50ETF、博时新起点灵活配置混合(A类)、博时颐泰混合(C类)、博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/10; 博时颐泰混合(A类)、博时新兴消费主题混合、博时鑫瑞灵活配置混合(C类)、博时新起点灵活配置混合(C类)、博时鑫泽灵活配置混合(C类)、博时文体娱乐主题混合、博时新兴成长混合、博时鑫瑞灵活配置混合(A类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A类)、博时创新驱动灵活配置混合(C类)、博时鑫泽灵活配置混合(A类)、博时裕益灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A类)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

博时固定收益类基金业绩表现稳健, 58 只产品(各类份额分开计算, 不含 QDII, 下同) 今年来净值增长率银河同类排名前 1/2, 29 只银河同类排名在前 1/4, 16 只银河同类排名在前 1/10, 10 只银河同类排名在前 10。债券型基金中, 博时转债增强债券(A类)、博时转债增强债券(C类) 今年来净值增长率分别在 28 只、15 只同类产品中排名第 1, 且分别在全市场参与业绩排名的 1928 只债券基金中排名第 3、第 4; 博时安盈债券(A类)、博时安盈债券(C类) 今年来净值增长率分别在同类产品中排第 2、第 3; 博时安弘一年定期开放债券(A类)、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时安心收益定期开放债券(A类)、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券今年来净值增长率分别在 239 只同类产品中排名第 3、第 7、第 14、第 18、第 23; 博时裕泰纯债债券、博时裕顺纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时富祥纯债债券、博时裕腾纯债债券今年来净值增长率分别在 352 只同类产品中排名第 6、第 11、第 12、第 26、第 28; 博时安弘一年定期开放债券(C类) 今年来净值增长率在 58 只同类产品中排名第 3; 博时信用债券(A/B类)、博时信用债券(C类) 今年来净值增长率在 228 只、163 只同类产品中均排名第 11; 博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕瑞纯债债券、博时裕创纯债债券、博时双月薪定期支付债券、博时安心收益定期开放债券(C类)、博时裕盛纯债债券、博时裕恒纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时安丰 18 个月定期开放债券(A类-LOF) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。货币型基金中, 博时合惠货币(B类) 今年来净值增长率在 296 只同类产品中排名第 8, 博时合惠货币(A类)、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类) 等基金今年来净值增长率排名在银河同类前 1/4。

商品型基金当中, 博时黄金 ETF 今年来净值增长率同类排名第 3。

QDII 基金方面, 博时标普 500ETF 今年来净值增长率同类排名第 2、博时亚洲票息收益债券、博时亚洲票息收益债券(美元) 今年来净值增长率均在同类排名第 7。

2、其他大事件

2019 年 6 月 20 日, 由中国基金报独家主办的第六届中国基金业“英华奖”评选隆重揭晓, 博时基金在此次英华奖中揽获 6 项最佳基金经理大奖。其中, 博时基金蔡滨拿下“三年期股票投资最佳基金经理”; 陈凯杨荣膺“五年期纯债投资最佳基金经理”; 何凯则一举揽获“三年期海外固收投资最佳基金经理”和“五年期海外固收投资最佳基金经理”两项桂冠; 过钧则再度获得“三年期二级债投资最佳基金经理”和“五年期二级债投资最佳基金经理”称号。

2019 年 4 月 25 日, 由上海证券报主办的第十六届“金基金”奖的评选结果如期揭晓, 博时基金在评

选中一举夺得最具份量的公司奖项“2018 年度金基金•TOP 公司奖”，博时主题行业（160505）继去年获得“三年期金基金分红奖”后拿下“2018 年度金基金•十年期偏股混合型基金奖”，同时，博时裕瑞纯债债券（001578）获得“2018 年度金基金•一年期债券基金奖”。

2019 年 4 月 14 日，第十六届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时主题行业混合（LOF）（160505）荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2019 年 3 月 21 日，由证券时报主办的第六届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在北京隆重举行，同时第十四届中国基金业明星基金奖和中国公募基金首届英华奖也随之揭晓。博时基金凭借出色的资产管理能力和优秀的业绩表现，一举摘得“2018 年度十大明星基金公司”称号。在英华奖的评选中，博时基金在获评“2018 年度最佳电商业务发展基金公司”奖的同时，还凭借博时基金 20 周年品牌传播项目拿下了“2018 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”奖。此外，博时慈善基金会公益助学项目获得了“2018 年度最佳社会公益实践案例”。在产品奖方面，助力央企结构转型和改革的博时央企结构调整 ETF 获评英华奖“2018 年度最佳创新基金产品”；博时裕瑞纯债债券获得“2018 年度普通债券型明星基金”奖；博时宏观回报债券则凭借同类可比基金第一的佳绩喜获“2018 年度积极债券型明星基金”奖；博时亚洲票息收益债券（QDII）、博时双月薪定期支付债券双双以过去五年稳居同类前列的好成绩分别拿下“五年持续回报 QDII 明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”称号；博时裕恒纯债债券则摘得“三年期持续回报普通债券型明星基金”。

2019 年 2 月 25 日，博时国际在“投资洞见与委托”（Insights&Mandate）举办的第二届专业投资奖评选活动中荣获“2019 年度最佳机构法人投资经理”，并凭借博时国际于 2018 年 5 月 10 日共同成立的“博时—东方红大中华债券基金”获“最佳创新产品”大奖。

2019 年 1 月 23 日，由深圳市福田区金融发展事务署首届举办的“香蜜湖金融科技创新奖”颁奖典礼在深圳福田隆重举行，《博时基金基于大数据技术升级量化投资技术》项目荣获优秀项目奖，博时基金采用金融科技为业务赋能的创新成果获得行业和地方政府高度认可。

2019 年 1 月 11 日，中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中债登”）公布了《2018 年度中债优秀成员评选结果》。凭借在债券市场上的深厚积淀和优异的投研业绩，博时基金获评年度“优秀资产管理人”称号，全行业获此殊荣的基金公司仅有 10 家。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾鹏	权益投资主题组负责人/基金经理	2013-01-18	-	14.3	曾鹏先生，硕士。2005 年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012 年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金（2015 年 2 月 9 日-2016 年 4 月 25 日）基金经理。现任权益投资主题组负责人兼博时

					新兴成长混合型证券投资基金 (2013 年 1 月 18 日一至今)、博时特许价值混合型证券投资基金 (2018 年 6 月 21 日一至今)、博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 (2019 年 6 月 27 日一至今) 的基金经理。
齐宁	高级研究员兼基金经理助理	2017-02-20	-	8.9	1999 年起先后在中国移动通信集团、中国电信集团、中投证券工作。2015 年 4 月加入博时基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员，现任研究部高级研究员兼基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场先扬后抑总体维持了震荡上行的趋势。一季度，在经济企稳与改革预期的推动下，市场的风险偏好有所提升，市场迎来了反弹。但很快在二季度贸易战重启以及信用收缩预期背景下，市场又经历了大幅调整。报告期内，基金在一季度维持了高仓位，二季度降到了中性仓位。结构上重点配置在 TMT、养殖、光伏、券商（互联网金融）、医药等新兴产业领域；从投资效果来看，组合基本把握住了今年市场重要的产业脉络，基金净值也取得了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.618 元，份额累计净值为 2.889 元。报告期内，

本基金基金份额净值增长率为 33.48%，同期业绩基准增长率 21.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着中美贸易谈判的重启和流动性预期放松，市场风险偏好有望逐渐回升。从全球视野来看，中国仍是全球性价比最好的投资市场。随着 MSCI 指数将 A 股权重由 5% 提升至 20%，可预期的海外资金将源源不断流入 A 股市场，将有助于提升中国 A 股市场的长期估值中枢水平并与国际资本定价接轨。从国内来看，减税政策影响意义深刻，政策红利将逐渐体现，中国经济韧性在增强。科创板的落地将开启中国版的‘纳斯达克’之路，科技创新与消费将成为未来主流。在大的历史宏观背景下，我们或正在经历从‘凯恩斯刺激’往‘里根供给侧改革’时代的转变，股权投资的机遇将逐渐凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2019 年上半年度，基金托管人在博时新兴成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019 年上半年度，博时基金管理有限公司在博时新兴成长混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2019 年上半年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时新兴成长混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：博时新兴成长混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	401,823,295.96	378,042,125.93
结算备付金		1,720,237.01	2,921,080.64
存出保证金		1,818,092.02	1,039,638.98
交易性金融资产	6.4.3.2	2,746,344,652.64	2,051,857,432.61
其中：股票投资		2,716,435,885.50	2,033,431,382.17
基金投资		-	-
债券投资		29,908,767.14	18,426,050.44
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		2,378,226.02	300,866.43
应收利息	6.4.3.5	130,297.56	101,563.08
应收股利		-	-

应收申购款		85,549.89	232,641.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		3,154,300,351.10	2,434,495,349.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	12,022,680.88
应付赎回款		3,457,235.95	2,115,768.62
应付管理人报酬		3,825,525.17	3,204,470.94
应付托管费		637,587.50	534,078.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	3,043,117.89	2,459,445.64
应交税费		47,465.23	47,350.37
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	1,573,025.83	1,650,444.15
负债合计		12,583,957.57	22,034,239.08
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	1,355,620,806.51	1,389,293,615.88
未分配利润	6.4.3.10	1,786,095,587.02	1,023,167,494.41
所有者权益合计		3,141,716,393.53	2,412,461,110.29
负债和所有者权益总计		3,154,300,351.10	2,434,495,349.37

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 号，基金份额净值 0.618 元，基金份额总额 5,085,588,253.68 份。

6.2 利润表

会计主体：博时新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
一、收入		845,522,913.61	-242,449,635.74
1. 利息收入		1,210,236.53	1,211,550.86
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,174,461.16	1,087,012.45
债券利息收入		35,775.37	19,801.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	104,737.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		293,156,409.50	36,027,340.06
其中：股票投资收益	6.4.3.12	275,386,797.72	20,772,136.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	3,243,599.59

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	17,769,611.78	12,011,603.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	550,875,851.05	-279,775,090.76
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	280,416.53	86,564.10
减：二、费用		35,577,707.84	39,846,443.32
1. 管理人报酬		22,647,574.72	25,963,081.05
2. 托管费		3,774,595.73	4,327,180.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	9,017,975.68	9,333,938.75
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		128.69	55.05
7. 其他费用	6.4.3.19	137,433.02	222,188.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		809,945,205.77	-282,296,079.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		809,945,205.77	-282,296,079.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,389,293,615.88	1,023,167,494.41	2,412,461,110.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	809,945,205.77	809,945,205.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-33,672,809.37	-47,017,113.16	-80,689,922.53
其中：1. 基金申购款	76,166,755.03	101,093,986.66	177,260,741.69
2. 基金赎回款	-109,839,564.40	-148,111,099.82	-257,950,664.22
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）	1,355,620,806.51	1,786,095,587.02	3,141,716,393.53

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,450,174,539.92	2,191,193,645.27	3,641,368,185.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-282,296,079.06	-282,296,079.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-58,287,417.55	-92,070,694.86	-150,358,112.41
其中：1. 基金申购款	38,912,736.46	55,206,349.78	94,119,086.24
2. 基金赎回款	-97,200,154.01	-147,277,044.64	-244,477,198.65
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）	1,391,887,122.37	1,816,826,871.35	3,208,713,993.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳

主管会计工作负责人：王德英

会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 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 2019 年 6 月 30 日	
	活期存款	401,823,295.96
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	401,823,295.96	

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,571,971,719.77	2,716,435,885.50	144,464,165.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	26,290,300.00	29,908,767.14
	银行间市场	-	-
	合计	26,290,300.00	29,908,767.14
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,598,262,019.77	2,746,344,652.64	148,082,632.87

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	91,166.73
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	774.10
应收债券利息	37,538.53
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	818.20
合计	130,297.56

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,043,117.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,043,117.89

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00
应付赎回费	7,979.59
其他应付款	-
预提费用	315,046.24
合计	1,573,025.83

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,211,908,954.35	1,389,293,615.88
本期申购	285,785,700.85	76,166,755.03
本期赎回 (以“-”号填列)	-412,106,401.52	-109,839,564.40
本期末	5,085,588,253.68	1,355,620,806.51

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,519,998,938.19	-496,831,443.78	1,023,167,494.41
本期利润	259,069,354.72	550,875,851.05	809,945,205.77
本期基金份额交易产生的变动数	-41,570,836.11	-5,446,277.05	-47,017,113.16
其中：基金申购款	87,391,099.36	13,702,887.30	101,093,986.66
基金赎回款	-128,961,935.47	-19,149,164.35	-148,111,099.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,737,497,456.80	48,598,130.22	1,786,095,587.02

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,116,166.94
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	45,931.98
其他	12,362.24
合计	1,174,461.16

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,303,735,324.80
减：卖出股票成本总额	3,028,348,527.08
买卖股票差价收入	275,386,797.72

6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,769,611.78
基金投资产生的股利收益	-

合计	17,769,611.78
----	---------------

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	550,875,851.05
——股票投资	547,459,834.35
——债券投资	3,416,016.70
——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	550,875,851.05

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	261,751.34
基金转换费收入	18,665.19
合计	280,416.53

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

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

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	9,017,975.68
银行间市场交易费用	-
合计	9,017,975.68

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	56,157.67
银行汇划费	3,786.78
中债登账户维护费	13,500.00
上清所账户维护费	14,400.00
合计	137,433.02

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,647,574.72	25,963,081.05
其中：支付销售机构的客户维护费	4,931,390.77	5,628,955.22

注：支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,774,595.73	4,327,180.15

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	401,823,295.96	1,116,166.94	361,139,951.71	1,031,788.48

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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（2019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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
603993	洛阳钼业	2017-07-26	2019-07-24	非公开发行限售	3.82	3.91	19,628,534	74,980,999.88	76,747,567.94	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资回报的投资目标。

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

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

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	29,908,767.14	18,426,050.44
未评级	-	-
合计	29,908,767.14	18,426,050.44

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 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该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时

受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.8。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	401,823,295.96	-	-	-	401,823,295.96
结算备付金	1,720,237.01	-	-	-	1,720,237.01
存出保证金	1,818,092.02	-	-	-	1,818,092.02
交易性金融资产	-	14,528,736.32	15,380,030.82	2,716,435,885.50	2,746,344,652.64

应收证券清算款	-	-	-	2,378,226.02	2,378,226.02
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	130,297.56	130,297.56
应收申购款	-	-	-	85,549.89	85,549.89
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	405,361,624.99	14,528,736.32	15,380,030.82	2,719,029,958.97	3,154,300,351.10
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,457,235.95	3,457,235.95
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,825,525.17	3,825,525.17
应付托管费	-	-	-	637,587.50	637,587.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	47,465.23	47,465.23
应付交易费用	-	-	-	3,043,117.89	3,043,117.89
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,573,025.83	1,573,025.83
负债总计	-	-	-	12,583,957.57	12,583,957.57
利率敏感度缺口	405,361,624.99	14,528,736.32	15,380,030.82	2,706,446,001.40	3,141,716,393.53
上年度末 2018年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	378,042,125.93	-	-	-	378,042,125.93
结算备付金	2,921,080.64	-	-	-	2,921,080.64
存出保证金	1,039,638.98	-	-	-	1,039,638.98
交易性金融资产	-	5,370,091.20	13,055,959.24	2,033,431,382.17	2,051,857,432.61
应收证券清算款	-	-	-	300,866.43	300,866.43
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	101,563.08	101,563.08
应收申购款	-	-	-	232,641.70	232,641.70
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	382,002,845.55	5,370,091.20	13,055,959.24	2,034,066,453.38	2,434,495,349.37
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	2,115,768.62	2,115,768.62
应付证券清算款	-	-	-	12,022,680.88	12,022,680.88
应付管理人报酬	-	-	-	3,204,470.94	3,204,470.94
应付托管费	-	-	-	534,078.48	534,078.48
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	47,350.37	47,350.37
应付交易费用	-	-	-	2,459,445.64	2,459,445.64
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	1,650,444.15	1,650,444.15
负债总计	-	-	-	22,034,239.08	22,034,239.08

利率敏感度缺口	382,002,845.55	5,370,091.20	13,055,959.24	2,012,032,214.30	2,412,461,110.29
---------	----------------	--------------	---------------	------------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 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比例为 0.95%（2018 年 12 月 31 日：0.76%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.4.2 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。本基金的所有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的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%（权证投资比例不得超过基金资产的 3%并计入股票投资比例）；债券投资比例为基金资产的 0%-35%。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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,716,435,885.50	86.46	2,033,431,382.17	84.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	29,908,767.14	0.95	18,426,050.44	0.76
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	2,746,344,652.64	87.42	2,051,857,432.61	85.05

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 14,487	增加约 10,984
沪深 300 指数下降 5%	减少约 14,487	减少约 10,984	

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 2019 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 2,669,540,108.16 元，属于第二层次的余额为 76,804,544.48 元，无属于第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第一层次 1,981,465,526.07 元，第二层次 70,391,906.54 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2018 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,716,435,885.50	86.12
	其中：股票	2,716,435,885.50	86.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,908,767.14	0.95
	其中：债券	29,908,767.14	0.95
	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	403,543,532.97	12.79
8	其他各项资产	4,412,165.49	0.14
9	合计	3,154,300,351.10	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	203,117,736.33	6.47
B	采矿业	77,110,999.19	2.45
C	制造业	1,682,652,064.93	53.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,201.84	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	273,520,298.53	8.71
J	金融业	129,140,058.94	4.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	43,442,991.59	1.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	307,402,427.55	9.78
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,716,435,885.50	86.46

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	600763	通策医疗	3,469,945	307,402,427.55	9.78
2	300567	精测电子	4,535,481	238,203,462.12	7.58
3	600416	湘电股份	35,027,973	210,868,397.46	6.71
4	300059	东方财富	10,099,257	136,844,932.35	4.36
5	300118	东方日升	13,287,510	135,266,851.80	4.31
6	300498	温氏股份	3,723,926	133,539,986.36	4.25
7	002773	康弘药业	3,912,614	128,803,252.88	4.10
8	601012	隆基股份	4,680,000	108,154,800.00	3.44
9	000661	长春高新	309,856	104,731,328.00	3.33
10	600438	通威股份	5,999,932	84,359,043.92	2.69
11	002311	海大集团	2,699,998	83,429,938.20	2.66
12	603019	中科曙光	2,219,907	77,918,735.70	2.48
13	603993	洛阳钼业	19,628,534	76,747,567.94	2.44
14	002299	圣农发展	2,745,204	69,508,565.28	2.21
15	002415	海康威视	2,310,300	63,718,074.00	2.03
16	002129	中环股份	6,000,048	58,560,468.48	1.86
17	300033	同花顺	499,957	49,175,770.52	1.57
18	600837	海通证券	3,383,100	48,006,189.00	1.53
19	600030	中信证券	2,000,000	47,620,000.00	1.52
20	600271	航天信息	2,031,042	46,815,518.10	1.49
21	002138	顺络电子	2,500,037	43,950,650.46	1.40
22	002236	大华股份	2,999,981	43,559,724.12	1.39
23	603136	天目湖	2,149,579	43,442,991.59	1.38
24	002463	沪电股份	3,000,000	40,860,000.00	1.30
25	601688	华泰证券	1,500,000	33,480,000.00	1.07
26	002410	广联达	1,000,000	32,890,000.00	1.05
27	002459	天业通联	2,499,892	31,598,634.88	1.01
28	603690	至纯科技	1,576,823	31,583,764.69	1.01
29	600562	国睿科技	1,936,923	29,751,137.28	0.95
30	603799	华友钴业	1,195,090	25,467,367.90	0.81
31	300609	汇纳科技	675,891	23,696,738.46	0.75
32	002428	云南锗业	3,000,000	22,890,000.00	0.73
33	300308	中际旭创	500,000	16,995,000.00	0.54
34	603739	蔚蓝生物	619,200	16,619,328.00	0.53
35	300659	中孚信息	431,700	15,692,295.00	0.50
36	600073	上海梅林	1,530,350	14,079,220.00	0.45
37	300523	辰安科技	199,954	10,769,522.44	0.34
38	300684	中石科技	500,000	10,100,000.00	0.32
39	603501	韦尔股份	92,100	5,057,211.00	0.16
40	002571	德力股份	853,200	4,803,516.00	0.15
41	300496	中科创达	151,700	4,411,436.00	0.14
42	002768	国恩股份	126,600	3,196,650.00	0.10
43	300760	迈瑞医疗	6,407	1,045,622.40	0.03
44	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
45	603068	博通集成	1,231	71,373.38	0.00
46	300761	立华股份	1,291	69,184.69	0.00
47	603681	永冠新材	1,767	40,641.00	0.00
48	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
49	603217	元利科技	584	39,268.16	0.00
50	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00

51	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
52	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
53	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
54	603967	中创物流	1,318	26,201.84	0.00
55	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
56	603121	华培动力	944	17,105.28	0.00

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	002594	比亚迪	268,360,741.89	11.12
2	300498	温氏股份	197,110,028.24	8.17
3	002234	民和股份	178,026,319.88	7.38
4	300118	东方日升	136,982,922.37	5.68
5	002773	康弘药业	133,718,981.88	5.54
6	002299	圣农发展	116,750,678.63	4.84
7	002129	中环股份	108,652,346.29	4.50
8	600131	岷江水电	103,751,866.08	4.30
9	603019	中科曙光	93,226,345.62	3.86
10	600681	百川能源	92,286,025.69	3.83
11	002138	顺络电子	91,219,578.71	3.78
12	300059	东方财富	91,109,701.68	3.78
13	000063	中兴通讯	87,287,195.90	3.62
14	002611	东方精工	87,062,326.82	3.61
15	002311	海大集团	78,288,559.90	3.25
16	600438	通威股份	77,307,603.58	3.20
17	300420	五洋停车	64,112,119.02	2.66
18	002415	海康威视	63,257,510.00	2.62
19	300776	帝尔激光	59,022,015.64	2.45
20	002459	天业通联	55,427,178.09	2.30
21	002198	嘉应制药	52,721,340.22	2.19
22	300115	长盈精密	52,075,226.82	2.16
23	603136	天目湖	50,307,866.06	2.09
24	300033	同花顺	50,165,816.62	2.08
25	000922	佳电股份	48,963,085.73	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002594	比亚迪	259,929,585.31	10.77
2	002234	民和股份	241,801,099.60	10.02
3	300059	东方财富	208,625,503.95	8.65

4	300017	网宿科技	160,640,146.95	6.66
5	600131	岷江水电	155,512,946.99	6.45
6	002129	中环股份	155,403,565.34	6.44
7	000661	长春高新	129,777,948.78	5.38
8	300498	温氏股份	103,441,833.24	4.29
9	000063	中兴通讯	98,897,607.07	4.10
10	600681	百川能源	91,334,777.00	3.79
11	300567	精测电子	90,134,834.26	3.74
12	600498	烽火通信	83,799,227.04	3.47
13	600763	通策医疗	83,260,452.70	3.45
14	600271	航天信息	82,711,133.59	3.43
15	002611	东方精工	70,800,665.20	2.93
16	002299	圣农发展	69,804,647.55	2.89
17	300159	新研股份	66,919,063.58	2.77
18	002714	牧原股份	66,222,811.53	2.75
19	300776	帝尔激光	61,799,055.94	2.56
20	300750	宁德时代	61,477,112.81	2.55
21	300115	长盈精密	61,405,570.66	2.55
22	000783	长江证券	55,160,575.78	2.29
23	300420	五洋停车	53,414,931.93	2.21
24	300659	中孚信息	52,487,322.80	2.18
25	002428	云南锗业	50,569,370.49	2.10
26	000922	佳电股份	50,120,283.25	2.08

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,163,893,196.06
卖出股票的收入（成交）总额	3,303,735,324.80

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	29,908,767.14	0.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,908,767.14	0.95

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123025	精测转债	80,667	9,108,917.64	0.29
2	128035	大族转债	74,717	7,722,749.12	0.25
3	113015	隆基转债	53,280	6,805,987.20	0.22
4	128047	光电转债	54,239	6,271,113.18	0.20

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除东方日升（300118）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,818,092.02
2	应收证券清算款	2,378,226.02

3	应收股利	-
4	应收利息	130,297.56
5	应收申购款	85,549.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,412,165.49

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128035	大族转债	7,722,749.12	0.25
2	113015	隆基转债	6,805,987.20	0.22
3	128047	光电转债	6,271,113.18	0.20

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
269,449	18,874.03	31,626,025.03	0.62%	5,053,962,228.65	99.38%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	33,009.78	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金；
2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 7 月 6 日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	5,211,908,954.35
本报告期基金总申购份额	285,785,700.85
减：本报告期基金总赎回份额	412,106,401.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5,085,588,253.68

§ 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	佣金	占当期佣	

			票成交总 额的比例		金总量的 比例	
高华证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广发华福	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中富证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	2,131,924,587.99	33.00%	1,559,080.07	30.33%	-
中信证券	1	1,268,179,567.60	19.63%	927,421.00	18.04%	-
方正证券	2	1,262,347,537.71	19.54%	1,175,630.36	22.87%	-
国泰君安	2	978,174,386.93	15.14%	715,338.82	13.91%	-
国海证券	1	490,582,682.68	7.59%	456,880.07	8.89%	-
中金公司	1	146,583,409.73	2.27%	136,514.44	2.66%	-
渤海证券	1	95,912,398.97	1.48%	89,323.73	1.74%	-
申万宏源	2	86,917,103.22	1.35%	80,946.97	1.57%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据本公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
高华证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中富证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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	博时新兴成长混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报	2019-04-22

2	关于博时旗下部分开放式基金开通徽商期货有限责任公司定投业务并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-04-02
3	博时新兴成长混合型证券投资基金 2018 年年度报告（正文）	中国证券报	2019-03-29
4	博时新兴成长混合型证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	中国证券报	2019-03-29
5	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-03-29
6	关于博时旗下部分开放式基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-03-25
7	关于博时旗下部分开放式基金参加泉州银行费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-02-28
8	博时新兴成长混合型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（正文）	中国证券报	2019-02-20
9	博时新兴成长混合型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（摘要）	中国证券报	2019-02-20
10	博时新兴成长混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报	2019-01-19

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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新兴成长混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时新兴成长混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时新兴成长混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时新兴成长混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时新兴成长混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司。

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一九年八月二十七日