

博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年年度报告 2019 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：二〇二〇年三月二十七日

§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 2020 年 3 月 25 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 2019 年 1 月 1 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	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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	61
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	61
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	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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的情况	62
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§12 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	博时中证 500 指数增强	
基金主代码	005062	
交易代码	005062	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 26 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	450,012,178.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	005062	005795
报告期末下属分级基金的份额总额	297,003,514.86 份	153,008,663.90 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，在对标的指数有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。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 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，包括（一）股票投资策略、（二）债券投资策略、（三）股指期货投资策略、（四）权证投资策略、（五）融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	本基金的标的指数为：中证 500 指数。本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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。

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	孙麒麟	许俊
	联系电话	0755-83169999	010-66594319
	电子邮箱	service@bosera.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105568	95566

传真	0755-83195140	010-66594942
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518040	100818
法定代表人	张光华	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 号领展企业广场 2 座普华永道中心 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	2019 年		2018 年		2017 年 9 月 26 日（基金合同生效日） 至 2017 年 12 月 31 日	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	36,131,399.18	16,748,290.15	-16,965,880.55	-3,766,003.00	-1,399,974.68	-
本期利润	65,690,661.03	27,308,022.98	-32,815,793.61	-3,965,653.01	246,420.87	-
加权平均基金份额本期利润	0.2994	0.2740	-0.2392	-0.1673	0.0012	-
本期加权平均净值利润率	32.54%	29.38%	-26.96%	-20.54%	0.12%	-
本期基金份额净值增长率	39.99%	39.43%	-25.51%	-24.93%	-1.07%	-
3.1.2 期末	2019 年末		2018 年末		2017 年末	

数据和指标	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	9,173,000.97	3,726,545.49	-42,347,845.20	-9,660,952.44	-2,041,060.58	-
期末可供分配基金份额利润	0.0309	0.0244	-0.2631	-0.2651	-0.0129	-
期末基金资产净值	306,385,133.76	156,784,927.06	118,622,003.76	26,780,754.08	156,278,468.26	-
期末基金份额净值	1.0316	1.0247	0.7369	0.7349	0.9893	-
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	3.15%	4.68%	-26.31%	-24.93%	-1.07%	-

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

1. 博时中证 500 指数增强 A：

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	8.59%	0.87%	6.29%	0.88%	2.30%	-0.01%
过去六个月	17.84%	1.02%	6.12%	1.03%	11.72%	-0.01%
过去一年	39.99%	1.34%	25.09%	1.39%	14.90%	-0.05%
自基金合同生效起至今	3.15%	1.36%	-17.72%	1.37%	20.87%	-0.01%

2. 博时中证 500 指数增强 C：

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	8.48%	0.87%	6.29%	0.88%	2.19%	-0.01%
过去六个月	17.61%	1.02%	6.12%	1.03%	11.49%	-0.01%
过去一年	39.43%	1.34%	25.09%	1.39%	14.34%	-0.05%
自基金合同生效起至今	4.68%	1.40%	-13.08%	1.42%	17.76%	-0.02%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：自 2018 年 4 月 3 日起，本基金新增 C 类新增份额。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。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。

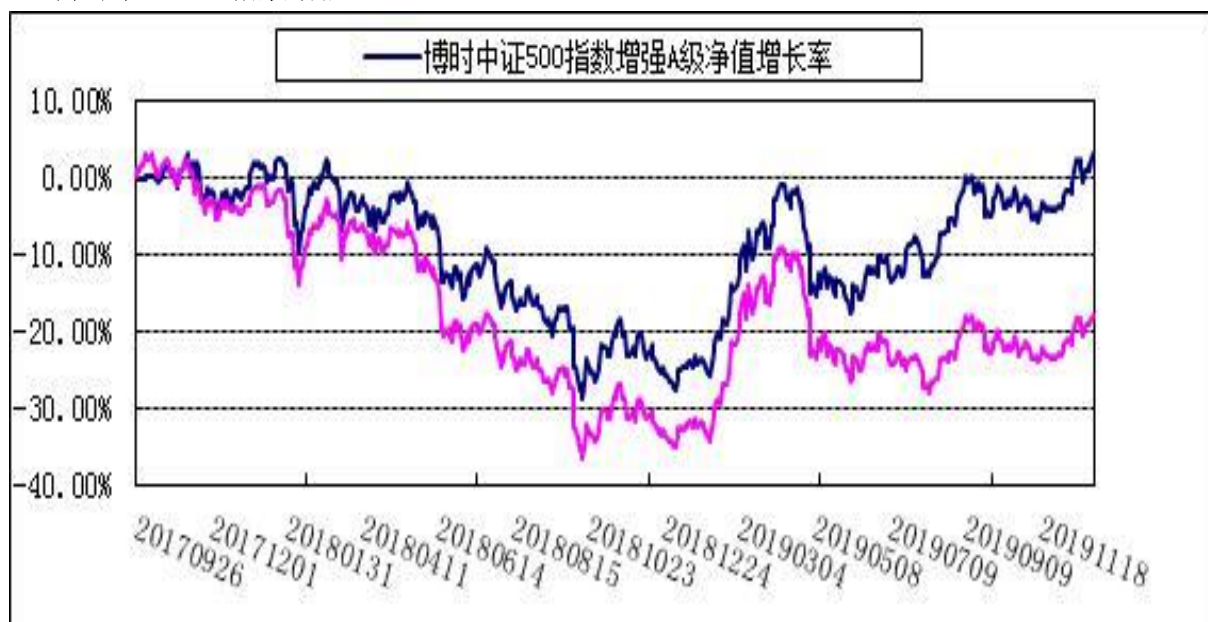
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时中证 500 指数增强型证券投资基金

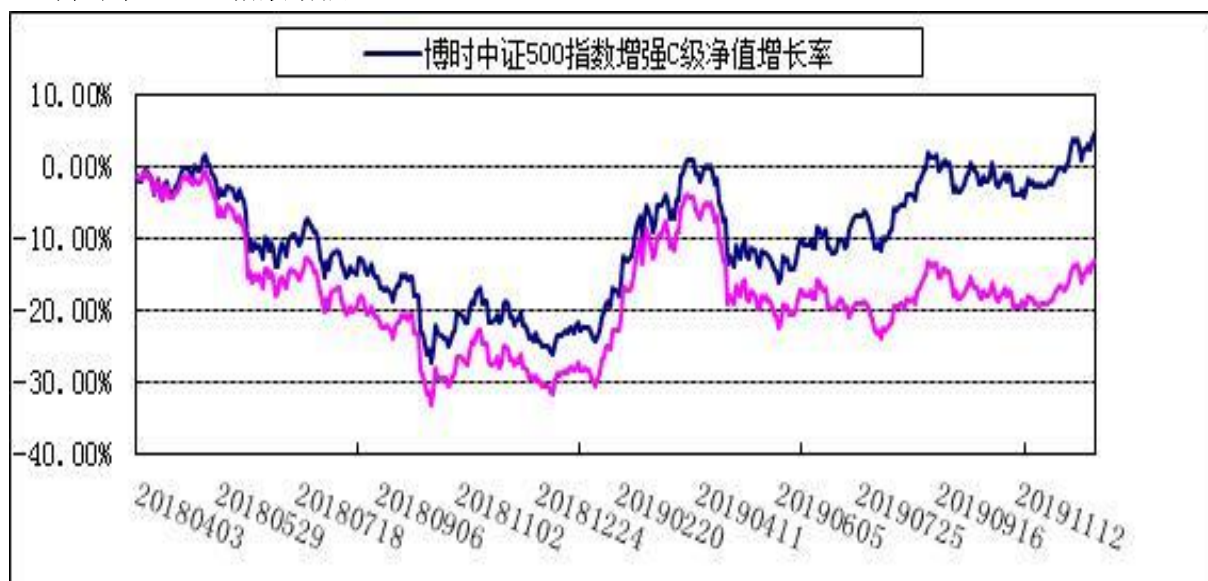
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 9 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日)

1、博时中证 500 指数增强 A



2、博时中证 500 指数增强 C

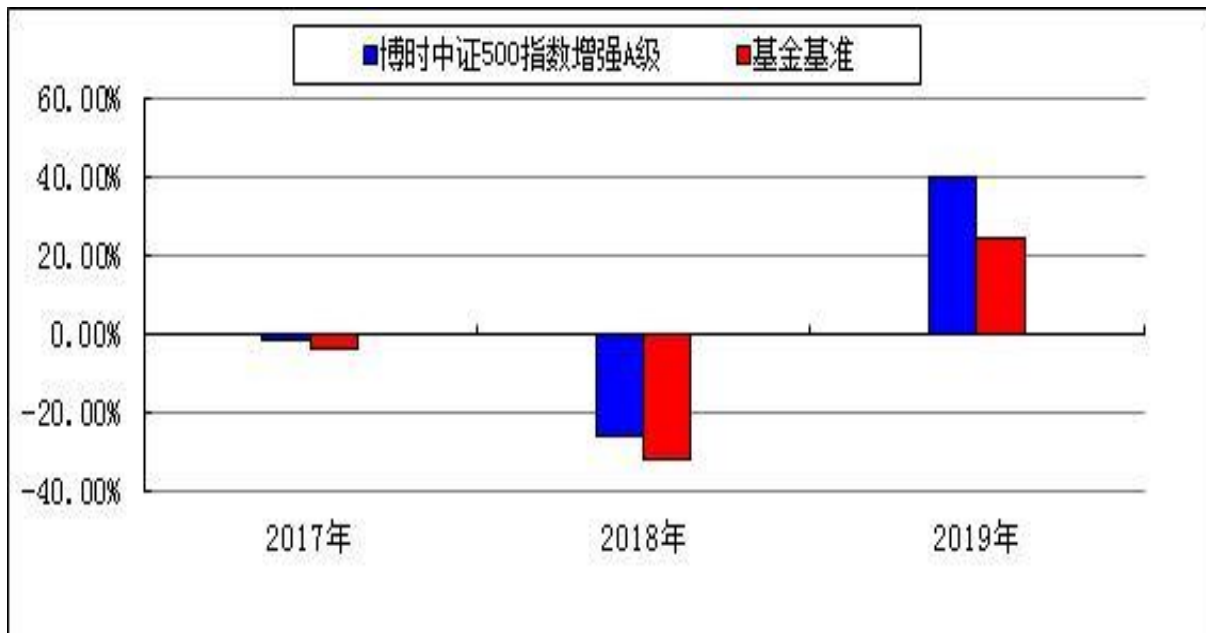


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

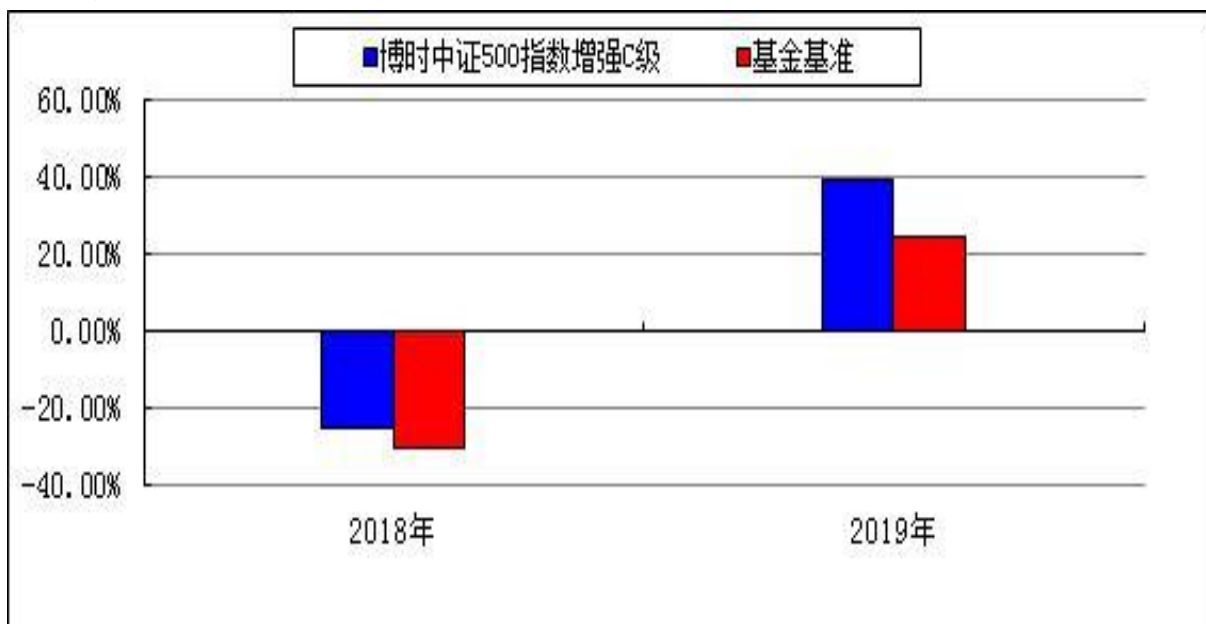
博时中证 500 指数增强型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时中证 500 指数增强 A



2、博时中证 500 指数增强 C



注：本基金的基金合同于 2017 年 9 月 26 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，“做投资价值的发现者”是博时的理念。截至 2019 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 199 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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 10668 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 3270 亿元人民币，累计分红逾 1206 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 4 季末：

博时旗下权益类基金业绩表现优异，70 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 30%，38 只产品净值增长率超过 40%，10 只产品净值增长率超过 60%，4 只产品净值增长率超过 80%，2 只产品净值增长率超过 90%；从相对排名来看，62 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，32 只产品同类排名在前 1/4，13 只产品同类排名在前 10，2 只产品同类排名第 1。

其中，博时回报混合、博时医疗保健混合 2019 年净值增长率均同类排名第 1，博时弘泰定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 同类排名第 2，博时文体娱乐主题混合、博时丝路主题股票(C 类)、博时乐臻定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时弘盈定期开放混合(C 类)、博时特许价值混合(A 类)、博时中证银联智惠大数据 100 指数(C 类)、博时量化平衡混合、博时中证淘金大数据 100 指数(I 类)同类排名分别为第 4、第 4、第 7、第 7、第 7、第 8、第 8、第 10、第 10，博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时裕益灵活配置混合同类排名均在前 1/10，博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(C 类)、博时互联网主题灵活配置混合、博时新兴消费主题混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时颐泰混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时新兴成长混合、博时颐泰混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(A 类)、博时鑫瑞灵活配置混合(C 类)、博时战略新兴产业混合、博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时沪港深优质企

业灵活配置混合(A类)、博时策略灵活配置混合等产品 2019 年来净值增长率同类排名均在前 1/4。此外,博时裕隆灵活配置混合、博时主题行业混合(LOF)、博时汇智回报灵活配置混合、博时外延增长主题灵活配置混合、博时产业新动力灵活配置混合(A类)等产品不仅 2019 年业绩表现较好,成立以来年化回报亦可观,长期投资价值凸显。

博时固定收益类基金表现同样可圈可点,67 只产品(各类份额分开计算,不含 QDII,下同)2019 年净值增长率超过 4%,19 只产品净值增长率超过 6%,8 只产品净值增长率超过 10%,2 只产品净值增长率超过 30%;从相对排名来看,68 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2,40 只产品同类排名在前 1/4,18 只产品同类排名在前 1/10,6 只产品同类排名前 5,1 只产品同类排名第 1。

其中,博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)2019 年净值增长率同类排名第 1,博时安盈债券(A类)、博时安盈债券(C类)、博时月薪定期支付债券、博时转债增强债券(C类)、博时安心收益定期开放债券(C类)同类排名分别排在第 2、第 3、第 4、第 4、第 5,博时富瑞纯债债券(A类)、博时转债增强债券(A类)、博时信用债券(C类)、博时安心收益定期开放债券(A类)、博时裕顺纯债债券、博时合惠货币(B类)、博时信用债券(A/B类)同类排名分别排在第 6、第 6、第 7、第 8、第 9、第 9、第 9,博时裕腾纯债债券、博时裕泰纯债债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时裕创纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时富祥纯债债券、博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时信用债纯债债券(A类)、博时信用债纯债债券(C类)同类排名均在前 1/10,博时稳健回报债券(LOF)(C类)、博时合惠货币(A类)、博时裕安纯债债券、博时稳健回报债券(LOF)(A类)、博时合鑫货币、博时聚瑞纯债 6 个月定期开放债券发起式、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类)、博时外服货币、博时富业纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时安丰 18 个月定期开放债券(A类-LOF)、博时裕盛纯债债券、博时富腾纯债债券、博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时安瑞 18 个月定期开放债券(A类)、博时天颐债券(C类)、博时安泰 18 个月定期开放债券(A类)、博时宏观回报债券(C类)、博时景兴纯债债券、博时裕达纯债债券等产品同类排名均在前 1/4。

博时旗下 QDII 基金继续表现突出,博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接(C类)、博时标普 500ETF 联接(A类)2019 年净值增长率分别超过或接近 30%,同类排名分别为第 4、第 6、第 14;博时亚洲票息收益债券(人民币)2019 年净值增长率超过 10%,同类排名第 7。

商品型基金当中,博时黄金 ETF、博时黄金 ETF 联接(A类)、博时黄金 ETF 联接(C类)2019 年均较好地跟上了黄金上涨行情,净值增长率均超过 18%,其中博时黄金 ETF 净值增长率同类排名第 3。

2、其他大事件

2019 年 12 月 26 日，界面新闻在京举办“2019 中国优金融奖”颁奖盛典，博时基金凭借“政策响应、行业领先、实体支持、创新赋能”等方面的综合卓越表现，荣获“年度基金公司”大奖以及“2019 中国好品牌”。

2019 年 12 月 21 日，和讯网“第十七届财经风云榜金融峰会”在上海举办，博时基金荣获“年度卓越影响力基金公司”，博时基金葛晨获“年度卓越公募基金经理”。

2019 年 12 月 20 日，华夏时报“华夏机构投资者年会暨第十三届金蝉奖颁奖典礼”在北京举办。博时基金荣获“年度投研领先公募基金公司”。

2019 年 12 月 12 日，投资者网“2019 中国投资年度排名颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金荣获“年度值得信任卓越基金公司”。

2019 年 12 月 10 日，投资时报“见未来”——2019 第二届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典在京举办，博时基金荣获投资时报颁发的 2019 年度金禧奖“2019 最佳公募基金公司奖”。

2019 年 12 月 5 日，金融界“大变局·大视野·大未来”——第四届智能金融国际论坛暨 2019 金融界“领航中国”年度盛典在北京举行，博时基金斩获四项大奖，博时基金荣获“杰出年度基金公司奖”，凭借在金融科技方面的杰出贡献，获得“杰出年度智能金融品牌奖”，博时基金总经理江向阳荣获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金王俊荣获“杰出年度基金经理奖”。

2019 年 12 月 5 日，21 世纪财经“金帆奖”颁奖典礼在广州举行，博时基金凭借在业内所取得的突出成就与贡献，获得“2019 年度基金管理公司金帆奖”。

2019 年 11 月 29 日，《经济观察报》在北京举办了“卓越金融企业”颁奖典礼，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2019 年 11 月 29 日，北京商报“寻路未来金融”——2019 年度北京金融论坛在京举办，博时基金凭借优秀的投研能力及全面的产品布局，荣获“北京金融业十大金融品牌——产品创新奖”。

2019 年 11 月 28 日，新浪财经 2019 新浪金麒麟论坛•ESG 峰会在北京举办，会上公布了 2019 中国企业 ESG“金责奖”评选名单，意在嘉奖那些对中国 ESG 事业做出卓越贡献的企业和机构，博时基金荣获 2019 中国企业 ESG 金责奖——“责任投资最佳基金公司奖”。

2019 年 11 月 22 日，2019 年度中国金融发展论坛暨金鼎奖颁奖典礼在北京举行，在资产管理领域甄选出了一批优质的标杆企业。群雄逐鹿百舸争流，博时基金跻身新资管时代的佼佼者，成功斩获“普惠金融奖”和“最佳海外固收产品奖”两项荣誉。

2019 年 11 月 15 日，中国经济网“2019 中国金融服务于创新论坛”在北京举办，博时基金荣获“金融服务 100 强”及“金融创新 100 强”称号。

2019 年 11 月 15 日，2019 年度第一财经金融价值榜（CFV）颁奖典礼在上海举行，博时基金凭

借优秀的资产管理能力摘得“年度金融机构”奖项。

2019 年 11 月 9 日，人民日报社《国际金融报》和河南省商丘市人民政府共同主办的“第三届资本市场扶贫高峰论坛”在商丘市举办，博时基金荣获“年度扶贫企业奖”。

2019 年 10 月，由中国网主办的 2019 年度第二届“中国网之优秀金融扶贫先锋榜”评选活动圆满结束，经过多轮线上投票和业内专家、学者的专业评审，博时基金荣获“精准扶贫先锋机构”奖。

2019 年 9 月 27 日，《证券时报》主办的“2019 中国 AI 金融探路者峰会暨第三届中国金融科技先锋榜”颁奖典礼在深圳举行，博时基金凭借“新一代投资决策支持平台”项目，获登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2019 年 8 月 17 日，第二届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行，博时基金斩获基金公司综合奖“群星奖”、“众星奖”、“五星奖”，基金产品单项奖“货币型基金管理奖”、“QDII 基金管理奖”以及 2 项“五星基金明星奖”等 7 项大奖，彰显出老牌基金公司强大的实力底蕴。

2019 年 7 月 5 日，2019 金牛基金高峰论坛暨第十六届中国基金金牛奖颁奖典礼在北京进行，博时基金研究部总经理王俊和固定收益总部专户组投资总监张李陵分别获得“人气金牛”奖项，两位各自管理的绩优产品博时主题行业混合(LOF)(160505)和博时信用债纯债债券(050027)分别荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖和“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

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”奖。

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		
桂征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2017-09-26	-	10.5	桂征辉先生，硕士。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。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时中证

					银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日—至今)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 144 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年全年，A 股市场先扬后抑，下半年步入震荡，最终收于 3050 点左右。风格方面，前期

上涨中，科技板块及小盘涨幅更加明显；而后期下跌，大盘相对抗跌，反转效应明显。行业方面食品饮料、家电、电子等行业大幅跑赢市场，建筑及钢铁行业表现落后。本基金在严格控制与指数跟踪偏离的基础上，利用数量化手段对组合进行管理，相对基准获得了稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金 A 级类基金份额净值为 1.0316 元，份额累计净值为 1.0316 元，本基金 C 级类基金份额净值为 1.0247 元，份额累计净值为 1.0247 元。报告期内，本基金 A 级类基金份额净值增长率为 39.99%，本基金 C 级类基金份额净值增长率为 39.43%，同期业绩基准增长率为 25.09%。

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 2020 年一季度，我国经济下行的压力依旧存在，经济中长期下行的趋势没有改变。政策方面，中央经济工作会议继续提积极财政政策和稳健的货币政策，这也确定了全年基调。货币方面，央行宣布降准，预计 1 季度社融增长和结构持续改善，结合近期 PMI 回升，1 季度经济增速有望企稳。行业及板块方面，“核心资产”中的周期股、金融地产值得重视，同时科技创新作为经济转型的重要支点将进一步得到加强。市场方面，春季躁动已经开始，同时密切关注中美贸易战进展。

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。

2019 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《基金中基金投资管理办法》、《科创板投资管理制度》、《反洗钱政策手册》等制度文件。修订了《博时基金管理有限公司章程》、《法定信息披露制度及流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”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。

4.8 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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博时中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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(2020)第 23113 号

博时中证 500 指数增强型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

我们审计了博时中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“博时中证 500 指数增强”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度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,公允反映了博时中证 500 指数增强 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度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,我们独立于博时中证 500 指数增强,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

博时中证 500 指数增强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中证 500 指数增强的持续经营能力,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中证 500 指数增强、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中证 500 指数增强的财务报告过程。

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，就可能导致对博时中证 500 指数增强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中证 500 指数增强基金不能持续经营。

(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
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

张 振 波

中国·上海市

注册会计师

2020 年 3 月 26 日

沈 兆 杰

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
资 产:		-	-
银行存款	7.4.7.1	23,092,397.15	8,934,631.19
结算备付金		2,803,577.84	399,052.11
存出保证金		109,802.81	50,339.17
交易性金融资产	7.4.7.2	441,167,502.88	136,543,967.74
其中: 股票投资		436,538,727.28	135,820,219.74
基金投资		-	-
债券投资		4,628,775.60	723,748.00
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		12,837.60	-
应收利息	7.4.7.5	110,783.42	3,489.29
应收股利		-	-
应收申购款		1,394,396.28	253,698.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		468,691,297.98	146,185,178.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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	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		4,004,592.38	92,741.28
应付管理人报酬		392,983.08	125,006.38
应付托管费		78,596.62	25,001.28
应付销售服务费		58,114.95	9,237.54
应付交易费用	7.4.7.7	734,616.01	140,366.12
应交税费		30,523.16	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	221,810.96	390,068.04
负债合计		5,521,237.16	782,420.64
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	450,012,178.76	197,411,555.48
未分配利润	7.4.7.10	13,157,882.06	-52,008,797.64
所有者权益合计		463,170,060.82	145,402,757.84

负债和所有者权益总计		468,691,297.98	146,185,178.48
------------	--	-----------------------	-----------------------

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 450,012,178.76 份，其中 A 类基金份额净值 1.0316 元，A 类基金份额总额 297,003,514.86 份；C 类基金份额净值 1.0247 元，C 类基金份额总额 153,008,663.90 份。

7.2 利润表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		100,875,994.64	-33,307,815.00
1.利息收入		255,086.79	98,645.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	254,739.56	77,643.45
债券利息收入		347.23	17,326.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,675.00
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		60,352,454.10	-17,428,899.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	55,031,308.14	-19,016,425.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	132,022.51	71,198.53
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	2,420,621.35	-
股利收益	7.4.7.15	2,768,502.10	1,516,327.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	40,118,994.68	-16,049,563.07
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	149,459.07	72,002.17
减：二、费用		7,877,310.63	3,473,631.62
1. 管理人报酬		2,941,500.78	1,362,139.04
2. 托管费		588,300.22	272,427.80
3. 销售服务费		370,757.79	57,441.92
4. 交易费用	7.4.7.18	3,591,145.60	1,237,390.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8,714.39	0.28
7. 其他费用	7.4.7.19	376,891.85	544,232.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		92,998,684.01	-36,781,446.62

列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		92,998,684.01	-36,781,446.62

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	197,411,555.48	-52,008,797.64	145,402,757.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	92,998,684.01	92,998,684.01
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）	252,600,623.28	-27,832,004.31	224,768,618.97
其中：1.基金申购款	582,809,495.30	-48,036,921.22	534,772,574.08
2.基金赎回款	-330,208,872.02	20,204,916.91	-310,003,955.11
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）	450,012,178.76	13,157,882.06	463,170,060.82
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	157,963,010.16	-1,684,541.90	156,278,468.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-36,781,446.62	-36,781,446.62
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）	39,448,545.32	-13,542,809.12	25,905,736.20
其中：1.基金申购款	179,879,573.25	-24,937,842.40	154,941,730.85
2.基金赎回款	-140,431,027.93	11,395,033.28	-129,035,994.65
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）	197,411,555.48	-52,008,797.64	145,402,757.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 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

博时中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1137 号《关于准予博时中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 指数增强型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 383,070,076.74 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 344 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 383,128,088.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 58,011.66 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。

根据基金管理人博时基金管理有限公司 2018 年 3 月 24 日《博时基金管理有限公司关于博时中证 500 指数增强型证券投资基金增加基金份额类别并修改法律文件的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2018 年 3 月 31 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费（原基金份额自动转入 A 类基金份额）；C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。投资者可自行选择申购的基金份额类别，但不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证 500 指数增强型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，以中证 500 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)。本基金可参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,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 80%,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,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或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:中证 500 指数。本基金业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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 2020 年 3 月 26 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<年度报告和中期报告>》、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》、《博时中证 500 指数增强型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 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度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。

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变动计入当期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及由基金管理人缴纳的增值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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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、债券投资和资产支持证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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

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 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	23,092,397.15	8,934,631.19
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	23,092,397.15	8,934,631.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		410,822,437.52	436,538,727.28	25,716,289.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,629,238.20	4,628,775.60	-462.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,629,238.20	4,628,775.60	-462.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		415,451,675.72	441,167,502.88	25,715,827.16
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		150,235,135.26	135,820,219.74	-14,414,915.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	712,000.00	723,748.00	11,748.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	712,000.00	723,748.00	11,748.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		150,947,135.26	136,543,967.74	-14,403,167.52

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

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,670.96	2,080.74
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	1,881.82	197.56
应收债券利息	102,176.30	1,186.02
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	54.34	24.97
合计	110,783.42	3,489.29

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	734,616.01	140,366.12
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	734,616.01	140,366.12

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,810.96	68.04
应付证券出借违约金	-	-
其他应付款	-	-

应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
预提费用	170,000.00	340,000.00
合计	221,810.96	390,068.04

7.4.7.9 实收基金

博时中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	160,969,848.96	160,969,848.96
本期申购	305,759,017.65	305,759,017.65
本期赎回（以“-”号填列）	-169,725,351.75	-169,725,351.75
本期末	297,003,514.86	297,003,514.86

博时中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	36,441,706.52	36,441,706.52
本期申购	277,050,477.65	277,050,477.65
本期赎回（以“-”号填列）	-160,483,520.27	-160,483,520.27
本期末	153,008,663.90	153,008,663.90

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

博时中证 500 指数增强 A

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	-22,166,996.27	-20,180,848.93	-42,347,845.20
本期利润	36,131,399.18	29,559,261.85	65,690,661.03
本期基金份额交易产生的变动数	-4,791,401.94	-9,169,794.99	-13,961,196.93
其中：基金申购款	-13,625,527.55	-11,328,196.83	-24,953,724.38
基金赎回款	8,834,125.61	2,158,401.84	10,992,527.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,173,000.97	208,617.93	9,381,618.90

博时中证 500 指数增强 C

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	-5,096,794.16	-4,564,158.28	-9,660,952.44
本期利润	16,748,290.15	10,559,732.83	27,308,022.98
本期基金份额交易产生的变	-7,924,950.50	-5,945,856.88	-13,870,807.38

动数			
其中：基金申购款	-13,303,737.82	-9,779,459.02	-23,083,196.84
基金赎回款	5,378,787.32	3,833,602.14	9,212,389.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,726,545.49	49,717.67	3,776,263.16

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	211,822.47	68,807.09
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	39,420.00	7,318.85
其他	3,497.09	1,517.51
合计	254,739.56	77,643.45

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,274,113,182.94	461,630,659.55
减：卖出股票成本总额	1,219,081,874.80	480,647,084.80
买卖股票差价收入	55,031,308.14	-19,016,425.25

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,161,456.90	4,717,067.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,027,900.00	4,608,030.00
减：应收利息总额	1,534.39	37,838.55
买卖债券差价收入	132,022.51	71,198.53

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
----	---	--

股指期货投资收益	2,420,621.35	-
----------	--------------	---

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,768,502.10	1,516,327.58
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,768,502.10	1,516,327.58

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	40,118,994.68	-16,049,563.07
——股票投资	40,131,205.28	-16,043,796.67
——债券投资	-12,210.60	-5,766.40
——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	40,118,994.68	-16,049,563.07

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	128,257.24	69,946.00
基金转换费收入	21,201.83	2,056.17
合计	149,459.07	72,002.17

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	3,591,145.60	1,237,390.57
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,591,145.60	1,237,390.57

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	6,891.85	4,232.01
指数使用费	200,000.00	200,000.00
开户费	-	-
合计	376,891.85	544,232.01

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，按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，指数许可使用费的收取下限为每季人民币 50,000.00 元。

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，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

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、基金销售机构
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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	1,639,164,691.19	60.23%	-	-

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	6,661,642.90	98.10%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	1,198,723.81	60.23%	485,234.08	66.05%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息

服务等。”

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,941,500.78	1,362,139.04
其中：支付销售机构的客户维护费	589,978.09	224,033.39

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	588,300.22	272,427.80

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	243,237.14	243,237.14
合计	-	243,237.14	243,237.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C	合计
博时基金	-	55,718.45	55,718.45
合计	-	55,718.45	55,718.45

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	23,092,397.15	211,822.47	8,934,631.19	68,807.09

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 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（2019 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
601658	邮储银行	2019-12-02	2020-06-10	首次公开发行	5.50	5.71	796,578.00	4,381,179.00	4,548,460.38	-

				限售						
003816	中国广核	2019-08-14	2020-02-27	首次公开发行限售	2.49	3.53	562,958.00	1,401,765.42	1,987,241.74	-
601916	浙商银行	2019-11-18	2020-05-26	首次公开发行限售	4.94	4.66	294,195.00	1,453,323.30	1,370,948.70	-
688388	嘉元科技	2019-07-16	2020-01-22	首次公开发行限售	28.26	54.90	24,307.00	686,915.82	1,334,454.30	-
601077	渝农商行	2019-10-16	2020-04-29	首次公开发行限售	7.36	6.26	147,778.00	1,087,646.08	925,090.28	-
688015	交控科技	2019-07-16	2020-01-22	首次公开发行限售	16.18	32.32	12,549.00	203,042.82	405,583.68	-
688366	昊海生科	2019-10-23	2020-04-30	首次公开发行限售	89.23	79.78	2,711.00	241,902.53	216,283.58	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	43.98	43.98	4,306.00	189,377.88	189,377.88	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-07-06	首次公开发行限售	28.21	28.21	3,153.00	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	5.74	5.74	1,146.00	6,578.04	6,578.04	-

注：1、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》，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，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。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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 0.50%，年跟踪误差不超过 7.5%，实现对中证 500 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人中国银行，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 2019 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占基金资产净值的比例为 0.00%(2018 年 12 月 31 日：0.50%)。

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 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。

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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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和资产支持证券投资的公允价值。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 12 月 31 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 12 月 31 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。

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、存出保证金及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,092,397.15	-	-	-	23,092,397.15
结算备付金	2,803,577.84	-	-	-	2,803,577.84
存出保证金	109,802.81	-	-	-	109,802.81
交易性金融资产	4,628,775.60	-	-	436,538,727.28	441,167,502.88
应收证券清算款	-	-	-	12,837.60	12,837.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	110,783.42	110,783.42
应收申购款	-	-	-	1,394,396.28	1,394,396.28
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	30,634,553.40	-	-	438,056,744.58	468,691,297.98
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,004,592.38	4,004,592.38
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	392,983.08	392,983.08
应付托管费	-	-	-	78,596.62	78,596.62
应付销售服务费	-	-	-	58,114.95	58,114.95
应交税费	-	-	-	30,523.16	30,523.16
应付交易费用	-	-	-	734,616.01	734,616.01
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	221,810.96	221,810.96
负债总计	-	-	-	5,521,237.16	5,521,237.16
利率敏感度缺口	30,634,553.40	-	-	432,535,507.42	463,170,060.82
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	8,934,631.19	-	-	-	8,934,631.19

结算备付金	399,052.11	-	-	-	399,052.11
存出保证金	50,339.17	-	-	-	50,339.17
交易性金融资产	-	-	723,748.00	135,820,219.74	136,543,967.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,489.29	3,489.29
应收申购款	-	-	-	253,698.98	253,698.98
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,384,022.47	-	723,748.00	136,077,408.01	146,185,178.48
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	92,741.28	92,741.28
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	125,006.38	125,006.38
应付托管费	-	-	-	25,001.28	25,001.28
应付销售服务费	-	-	-	9,237.54	9,237.54
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	140,366.12	140,366.12
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	390,068.04	390,068.04
负债总计	-	-	-	782,420.64	782,420.64
利率敏感度缺口	9,384,022.47	-	723,748.00	135,294,987.37	145,402,757.84

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 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.00%(2018 年 12 月 31 日：0.50%)，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)。

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。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2019 年 12 月 31 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	436,538,727.28	94.25	135,820,219.74	93.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	723,748.00	0.50
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	436,538,727.28	94.25	136,543,967.74	93.91

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 2,183	增加约 710
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 2,183	减少约 710

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 2019 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 425,465,762.57 元，属于第二层次的余额为 15,701,740.31 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 136,493,821.94 元，第二层次 50,145.80 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 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(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。

§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	436,538,727.28	93.14
	其中：股票	436,538,727.28	93.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,628,775.60	0.99

	其中：债券	4,628,775.60	0.99
	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	25,895,974.99	5.53
8	其他各项资产	1,627,820.11	0.35
9	合计	468,691,297.98	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	8,825,544.00	1.91
B	采矿业	13,324,798.00	2.88
C	制造业	239,257,487.14	51.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,575,532.74	3.36
E	建筑业	9,463,670.00	2.04
F	批发和零售业	17,080,556.50	3.69
G	交通运输、仓储和邮政业	13,879,981.19	3.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,516,268.56	6.80
J	金融业	30,177,102.36	6.52
K	房地产业	20,650,115.80	4.46
L	租赁和商务服务业	10,370,621.95	2.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,435,258.04	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,947,897.00	0.64
R	文化、体育和娱乐业	21,033,894.00	4.54
S	综合	-	-
	合计	436,538,727.28	94.25

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	601233	桐昆股份	479,400	7,186,206.00	1.55
2	600745	闻泰科技	75,400	6,974,500.00	1.51
3	600704	物产中大	1,230,400	6,459,600.00	1.39
4	600466	蓝光发展	872,840	6,432,830.80	1.39
5	000686	东北证券	688,800	6,405,840.00	1.38

6	600801	华新水泥	240,260	6,350,071.80	1.37
7	000581	威孚高科	324,600	6,183,630.00	1.34
8	600373	中文传媒	450,800	6,135,388.00	1.32
9	600643	爱建集团	634,300	6,089,280.00	1.31
10	601098	中南传媒	505,000	6,029,700.00	1.30
11	002440	闰土股份	532,500	5,964,000.00	1.29
12	000547	航天发展	578,400	5,911,248.00	1.28
13	002028	思源电气	428,100	5,894,937.00	1.27
14	600565	迪马股份	1,638,400	5,865,472.00	1.27
15	000807	云铝股份	1,116,400	5,738,296.00	1.24
16	600901	江苏租赁	904,100	5,713,912.00	1.23
17	600582	天地科技	1,786,000	5,697,340.00	1.23
18	600557	康缘药业	386,500	5,697,010.00	1.23
19	002048	宁波华翔	368,200	5,692,372.00	1.23
20	600985	淮北矿业	567,200	5,666,328.00	1.22
21	000848	承德露露	716,900	5,642,003.00	1.22
22	000060	中金岭南	1,302,500	5,600,750.00	1.21
23	000543	皖能电力	1,206,700	5,599,088.00	1.21
24	601019	山东出版	798,600	5,550,270.00	1.20
25	600350	山东高速	1,115,509	5,477,149.19	1.18
26	002818	富森美	428,963	5,426,381.95	1.17
27	600779	水井坊	103,700	5,366,475.00	1.16
28	002110	三钢闽光	567,800	5,314,608.00	1.15
29	600125	铁龙物流	879,400	5,258,812.00	1.14
30	002381	双箭股份	617,900	5,233,613.00	1.13
31	002299	圣农发展	207,300	4,991,784.00	1.08
32	600138	中青旅	392,400	4,944,240.00	1.07
33	002242	九阳股份	195,000	4,906,200.00	1.06
34	002463	沪电股份	219,600	4,877,316.00	1.05
35	000528	柳工	698,500	4,847,590.00	1.05
36	601677	明泰铝业	416,200	4,798,786.00	1.04
37	300014	亿纬锂能	94,100	4,720,056.00	1.02
38	601658	邮储银行	796,578	4,548,460.38	0.98
39	002191	劲嘉股份	380,500	4,341,505.00	0.94
40	600062	华润双鹤	325,860	4,252,473.00	0.92
41	002049	紫光国微	82,200	4,179,048.00	0.90
42	600908	无锡银行	726,500	4,032,075.00	0.87
43	600266	城建发展	495,400	4,012,740.00	0.87
44	600312	平高电气	595,700	3,848,222.00	0.83
45	300498	温氏股份	114,100	3,833,760.00	0.83
46	002129	中环股份	317,100	3,744,951.00	0.81
47	603444	吉比特	12,300	3,671,427.00	0.79
48	002128	露天煤业	421,500	3,650,190.00	0.79

49	000600	建投能源	742,200	3,629,358.00	0.78
50	600846	同济科技	389,400	3,625,314.00	0.78
51	000877	天山股份	300,600	3,562,110.00	0.77
52	600307	酒钢宏兴	1,703,500	3,509,210.00	0.76
53	002367	康力电梯	435,000	3,458,250.00	0.75
54	601966	玲珑轮胎	144,000	3,301,920.00	0.71
55	000090	天健集团	619,200	3,281,760.00	0.71
56	000997	新大陆	206,100	3,272,868.00	0.71
57	000513	丽珠集团	96,600	3,255,420.00	0.70
58	600862	中航高科	295,300	3,254,206.00	0.70
59	600584	长电科技	140,400	3,085,992.00	0.67
60	600380	健康元	287,500	2,975,625.00	0.64
61	600728	佳都科技	315,100	2,955,638.00	0.64
62	300115	长盈精密	165,700	2,947,803.00	0.64
63	002701	奥瑞金	662,081	2,919,777.21	0.63
64	603556	海兴电力	177,900	2,899,770.00	0.63
65	603118	共进股份	253,700	2,851,588.00	0.62
66	600486	扬农化工	40,200	2,758,926.00	0.60
67	300253	卫宁健康	175,600	2,630,488.00	0.57
68	600863	内蒙华电	932,200	2,563,550.00	0.55
69	600970	中材国际	366,800	2,556,596.00	0.55
70	603368	柳药股份	74,000	2,489,360.00	0.54
71	601200	上海环境	218,800	2,428,680.00	0.52
72	000988	华工科技	115,900	2,351,611.00	0.51
73	000983	西山煤电	376,600	2,308,558.00	0.50
74	300129	泰胜风能	462,800	2,249,208.00	0.49
75	002384	东山精密	96,900	2,243,235.00	0.48
76	600325	华发股份	283,800	2,222,154.00	0.48
77	300166	东方国信	166,500	2,164,500.00	0.47
78	300088	长信科技	207,400	2,129,998.00	0.46
79	300130	新国都	118,900	2,096,207.00	0.45
80	002065	东华软件	202,000	2,084,640.00	0.45
81	002609	捷顺科技	241,000	2,070,190.00	0.45
82	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	0.43
83	600757	长江传媒	314,600	1,937,936.00	0.42
84	603882	金域医学	36,800	1,884,896.00	0.41
85	002439	启明星辰	54,300	1,835,340.00	0.40
86	000966	长源电力	386,300	1,796,295.00	0.39
87	600479	千金药业	197,300	1,730,321.00	0.37
88	002273	水晶光电	106,000	1,712,960.00	0.37
89	002019	亿帆医药	104,600	1,699,750.00	0.37
90	601958	金钼股份	212,200	1,699,722.00	0.37
91	600827	百联股份	186,100	1,671,178.00	0.36

92	300296	利亚德	215,800	1,655,186.00	0.36
93	300207	欣旺达	84,400	1,647,488.00	0.36
94	600511	国药股份	59,800	1,631,942.00	0.35
95	002373	千方科技	84,700	1,527,988.00	0.33
96	002544	杰赛科技	109,200	1,487,304.00	0.32
97	002318	久立特材	158,100	1,482,978.00	0.32
98	300529	健帆生物	20,600	1,479,904.00	0.32
99	601058	赛轮轮胎	317,100	1,417,437.00	0.31
100	600376	首开股份	177,700	1,416,269.00	0.31
101	600282	南钢股份	410,300	1,415,535.00	0.31
102	600273	嘉化能源	123,700	1,391,625.00	0.30
103	300251	光线传媒	117,000	1,380,600.00	0.30
104	603328	依顿电子	121,700	1,377,644.00	0.30
105	603233	大参林	26,290	1,373,652.50	0.30
106	002821	凯莱英	10,600	1,372,700.00	0.30
107	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.30
108	002414	高德红外	64,800	1,360,800.00	0.29
109	688388	嘉元科技	24,307	1,334,454.30	0.29
110	600755	厦门国贸	180,200	1,322,668.00	0.29
111	002223	鱼跃医疗	63,600	1,292,352.00	0.28
112	002152	广电运通	122,050	1,172,900.50	0.25
113	000878	云南铜业	85,000	1,161,100.00	0.25
114	300552	万集科技	13,500	1,139,400.00	0.25
115	300020	银江股份	134,100	1,126,440.00	0.24
116	600410	华胜天成	108,900	1,122,759.00	0.24
117	601598	中国外运	257,700	1,097,802.00	0.24
118	000750	国海证券	204,400	1,091,496.00	0.24
119	002368	太极股份	24,700	961,324.00	0.21
120	300417	南华仪器	22,600	952,590.00	0.21
121	601615	明阳智能	76,800	944,640.00	0.20
122	300719	安达维尔	80,300	941,116.00	0.20
123	601717	郑煤机	144,200	932,974.00	0.20
124	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.20
125	600763	通策医疗	8,900	912,517.00	0.20
126	600012	皖通高速	154,800	910,224.00	0.20
127	600967	内蒙一机	84,400	897,172.00	0.19
128	000078	海王生物	240,400	896,692.00	0.19
129	600171	上海贝岭	56,800	894,600.00	0.19
130	300118	东方日升	60,100	832,385.00	0.18
131	002353	杰瑞股份	22,400	827,904.00	0.18
132	002100	天康生物	62,500	798,750.00	0.17
133	002913	奥士康	13,100	775,389.00	0.17
134	601000	唐山港	296,070	769,782.00	0.17

135	000050	深天马 A	47,100	767,259.00	0.17
136	300690	双一科技	29,900	755,573.00	0.16
137	600845	宝信软件	22,570	742,553.00	0.16
138	002056	横店东磁	89,000	729,800.00	0.16
139	601231	环旭电子	37,100	713,433.00	0.15
140	600823	世茂股份	155,700	700,650.00	0.15
141	300002	神州泰岳	212,456	692,606.56	0.15
142	002518	科士达	64,200	685,014.00	0.15
143	000028	国药一致	14,900	675,864.00	0.15
144	000066	中国长城	42,800	665,968.00	0.14
145	002649	博彦科技	67,000	664,640.00	0.14
146	000021	深科技	53,900	656,502.00	0.14
147	300433	蓝思科技	46,900	648,158.00	0.14
148	600260	凯乐科技	46,100	625,577.00	0.14
149	300181	佐力药业	111,700	564,085.00	0.12
150	600859	王府井	40,000	559,600.00	0.12
151	600066	宇通客车	38,900	554,325.00	0.12
152	600536	中国软件	7,600	544,844.00	0.12
153	603160	汇顶科技	2,500	515,750.00	0.11
154	002724	海洋王	72,200	515,508.00	0.11
155	300543	朗科智能	21,600	500,904.00	0.11
156	600056	中国医药	37,500	489,375.00	0.11
157	600422	昆药集团	42,400	454,952.00	0.10
158	002916	深南电路	2,880	409,248.00	0.09
159	002390	信邦制药	77,500	406,875.00	0.09
160	688015	交控科技	12,549	405,583.68	0.09
161	000778	新兴铸管	92,900	387,393.00	0.08
162	600026	中远海能	57,400	366,212.00	0.08
163	002217	合力泰	60,900	337,995.00	0.07
164	300248	新开普	37,300	306,233.00	0.07
165	600446	金证股份	14,100	290,178.00	0.06
166	000766	通化金马	43,600	285,144.00	0.06
167	002371	北方华创	3,200	281,600.00	0.06
168	300009	安科生物	17,400	262,566.00	0.06
169	600521	华海药业	15,000	258,900.00	0.06
170	603986	兆易创新	1,200	245,868.00	0.05
171	600571	信雅达	23,600	224,908.00	0.05
172	688366	昊海生科	2,711	216,283.58	0.05
173	000977	浪潮信息	6,700	201,670.00	0.04
174	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.04
175	002572	索菲亚	8,800	184,360.00	0.04
176	002130	沃尔核材	34,300	169,442.00	0.04
177	300244	迪安诊断	6,800	150,484.00	0.03

178	002241	歌尔股份	7,100	141,432.00	0.03
179	002139	拓邦股份	23,000	127,880.00	0.03
180	002970	锐明技术	787	96,478.33	0.02
181	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
182	600183	生益科技	4,000	83,680.00	0.02
183	002733	雄韬股份	2,800	75,264.00	0.02
184	603920	世运电路	3,800	72,542.00	0.02
185	600572	康恩贝	8,300	51,045.00	0.01
186	600079	人福医药	2,700	36,477.00	0.01
187	002099	海翔药业	3,400	24,208.00	0.01
188	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
189	600216	浙江医药	1,400	18,690.00	0.00
190	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
191	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

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	000807	云铝股份	11,645,739.00	8.01
2	002353	杰瑞股份	11,236,844.72	7.73
3	000686	东北证券	10,685,146.75	7.35
4	000543	皖能电力	10,500,525.05	7.22
5	600026	中远海能	10,290,267.54	7.08
6	002381	双箭股份	10,080,301.00	6.93
7	002818	富森美	9,862,848.46	6.78
8	002440	闰土股份	9,788,468.00	6.73
9	603444	吉比特	9,697,919.05	6.67
10	600779	水井坊	9,695,044.33	6.67
11	600971	恒源煤电	9,636,065.14	6.63
12	000547	航天发展	9,407,699.14	6.47
13	600063	皖维高新	9,352,730.00	6.43
14	000060	中金岭南	9,085,338.20	6.25
15	601677	明泰铝业	8,998,071.62	6.19
16	002048	宁波华翔	8,885,473.15	6.11
17	600325	华发股份	8,879,265.92	6.11
18	600376	首开股份	8,818,285.48	6.06
19	600373	中文传媒	8,665,692.07	5.96
20	600565	迪马股份	8,620,067.00	5.93
21	600755	厦门国贸	8,579,401.49	5.90
22	600312	平高电气	8,488,344.47	5.84
23	000750	国海证券	8,444,759.96	5.81

24	002028	思源电气	8,040,724.42	5.53
25	600782	新钢股份	8,016,851.00	5.51
26	002299	圣农发展	7,782,776.77	5.35
27	000581	威孚高科	7,763,708.00	5.34
28	600745	闻泰科技	7,745,551.14	5.33
29	600266	城建发展	7,737,155.44	5.32
30	002004	华邦健康	7,676,203.50	5.28
31	000009	中国宝安	7,638,954.27	5.25
32	002318	久立特材	7,587,316.00	5.22
33	600557	康缘药业	7,413,229.02	5.10
34	600582	天地科技	7,389,877.00	5.08
35	000997	新大陆	7,365,306.16	5.07
36	600704	物产中大	7,352,659.00	5.06
37	002701	奥瑞金	7,320,283.61	5.03
38	002414	高德红外	7,315,089.45	5.03
39	600862	中航高科	7,273,050.00	5.00
40	000600	建投能源	7,234,761.43	4.98
41	600801	华新水泥	7,218,531.55	4.96
42	601098	中南传媒	7,077,272.44	4.87
43	002157	正邦科技	7,026,054.00	4.83
44	600901	江苏租赁	6,935,378.74	4.77
45	601958	金钼股份	6,917,820.44	4.76
46	600643	爱建集团	6,804,889.44	4.68
47	002110	三钢闽光	6,772,603.00	4.66
48	600031	三一重工	6,739,978.99	4.64
49	002191	劲嘉股份	6,738,606.29	4.63
50	000513	丽珠集团	6,731,527.73	4.63
51	600823	世茂股份	6,731,249.87	4.63
52	600282	南钢股份	6,730,079.00	4.63
53	600985	淮北矿业	6,717,685.14	4.62
54	601003	柳钢股份	6,712,721.68	4.62
55	000027	深圳能源	6,683,186.60	4.60
56	601000	唐山港	6,624,864.70	4.56
57	600486	扬农化工	6,615,865.00	4.55
58	601336	新华保险	6,612,210.80	4.55
59	600466	蓝光发展	6,609,298.20	4.55
60	601233	桐昆股份	6,568,652.00	4.52
61	600757	长江传媒	6,563,974.20	4.51
62	002129	中环股份	6,506,393.67	4.47
63	601615	明阳智能	6,486,751.70	4.46
64	600166	福田汽车	6,413,575.22	4.41
65	000528	柳工	6,373,079.00	4.38
66	600125	铁龙物流	6,352,801.00	4.37

67	600580	卧龙电驱	6,294,833.94	4.33
68	002367	康力电梯	6,274,294.00	4.32
69	601658	邮储银行	6,258,824.00	4.30
70	601966	玲珑轮胎	6,206,901.15	4.27
71	300014	亿纬锂能	6,167,710.05	4.24
72	601019	山东出版	6,162,670.02	4.24
73	000987	越秀金控	6,153,943.24	4.23
74	000848	承德露露	6,131,595.53	4.22
75	000878	云南铜业	6,099,003.32	4.19
76	600153	建发股份	6,038,853.00	4.15
77	600260	凯乐科技	6,007,492.11	4.13
78	600863	内蒙华电	6,005,679.00	4.13
79	002379	宏创控股	5,999,974.00	4.13
80	600307	酒钢宏兴	5,969,589.04	4.11
81	601811	新华文轩	5,745,060.30	3.95
82	000501	鄂武商 A	5,672,284.32	3.90
83	600765	中航重机	5,672,248.52	3.90
84	002926	华西证券	5,659,414.08	3.89
85	600350	山东高速	5,634,713.23	3.88
86	603556	海兴电力	5,534,233.01	3.81
87	002242	九阳股份	5,406,196.40	3.72
88	002152	广电运通	5,402,267.77	3.72
89	600183	生益科技	5,367,919.71	3.69
90	600039	四川路桥	5,347,573.97	3.68
91	002276	万马股份	5,336,204.03	3.67
92	000031	大悦城	5,292,151.00	3.64
93	300115	长盈精密	5,248,598.00	3.61
94	600138	中青旅	5,209,565.50	3.58
95	600908	无锡银行	5,188,220.00	3.57
96	002465	海格通信	5,156,049.50	3.55
97	600062	华润双鹤	5,146,429.49	3.54
98	002182	云海金属	5,138,526.63	3.53
99	000425	徐工机械	5,099,913.60	3.51
100	603118	共进股份	5,096,695.80	3.51
101	300498	温氏股份	5,068,372.00	3.49
102	603225	新凤鸣	5,059,769.54	3.48
103	600699	均胜电子	5,029,056.60	3.46
104	002128	露天煤业	5,014,591.00	3.45
105	002666	德联集团	4,884,668.00	3.36
106	000090	天健集团	4,884,519.16	3.36
107	000877	天山股份	4,878,904.00	3.36
108	600335	国机汽车	4,877,546.80	3.35
109	000988	华工科技	4,835,734.56	3.33

110	603328	依顿电子	4,824,607.26	3.32
111	600846	同济科技	4,779,978.68	3.29
112	601611	中国核建	4,768,385.08	3.28
113	002544	杰赛科技	4,706,263.00	3.24
114	002340	格林美	4,685,352.00	3.22
115	603198	迎驾贡酒	4,679,947.00	3.22
116	600058	五矿发展	4,646,359.30	3.20
117	600380	健康元	4,606,775.73	3.17
118	002707	众信旅游	4,596,569.01	3.16
119	000778	新兴铸管	4,549,174.97	3.13
120	002064	华峰氨纶	4,543,141.00	3.12
121	002605	姚记科技	4,457,844.36	3.07
122	002049	紫光国微	4,444,094.53	3.06
123	000401	冀东水泥	4,410,034.74	3.03
124	002019	亿帆医药	4,406,891.41	3.03
125	000933	神火股份	4,349,523.00	2.99
126	000028	国药一致	4,277,247.00	2.94
127	600216	浙江医药	4,223,654.00	2.90
128	600584	长电科技	4,217,703.56	2.90
129	002444	巨星科技	4,208,195.00	2.89
130	002489	浙江永强	4,150,780.00	2.85
131	002463	沪电股份	4,071,529.00	2.80
132	601200	上海环境	4,032,533.78	2.77
133	002244	滨江集团	3,998,199.37	2.75
134	600909	华安证券	3,983,984.00	2.74
135	002250	联化科技	3,983,119.00	2.74
136	600967	内蒙一机	3,961,800.46	2.72
137	002734	利民股份	3,918,043.12	2.69
138	002916	深南电路	3,868,698.63	2.66
139	600261	阳光照明	3,841,840.00	2.64
140	600348	阳泉煤业	3,827,719.95	2.63
141	000708	中信特钢	3,821,871.00	2.63
142	601717	郑煤机	3,820,126.55	2.63
143	601179	中国西电	3,817,024.20	2.63
144	000400	许继电气	3,787,223.95	2.60
145	000966	长源电力	3,786,947.00	2.60
146	300159	新研股份	3,782,615.00	2.60
147	603355	莱克电气	3,631,341.70	2.50
148	002384	东山精密	3,601,665.11	2.48
149	000932	华菱钢铁	3,585,350.75	2.47
150	002746	仙坛股份	3,526,390.52	2.43
151	603368	柳药股份	3,510,283.62	2.41
152	300088	长信科技	3,504,232.00	2.41

153	600056	中国医药	3,499,934.24	2.41
154	300058	蓝色光标	3,496,826.33	2.40
155	600021	上海电力	3,474,857.88	2.39
156	000078	海王生物	3,467,122.00	2.38
157	600750	江中药业	3,378,450.00	2.32
158	601928	凤凰传媒	3,361,869.00	2.31
159	600497	驰宏锌锗	3,344,296.87	2.30
160	600970	中材国际	3,337,684.31	2.30
161	002315	焦点科技	3,332,726.05	2.29
162	601311	骆驼股份	3,331,337.00	2.29
163	002405	四维图新	3,286,212.00	2.26
164	002214	大立科技	3,259,704.00	2.24
165	603369	今世缘	3,218,869.00	2.21
166	300129	泰胜风能	3,211,386.00	2.21
167	002273	水晶光电	3,106,676.69	2.14
168	600511	国药股份	3,083,187.67	2.12
169	002268	卫士通	3,066,496.49	2.11
170	300632	光莆股份	3,053,199.00	2.10
171	601058	赛轮轮胎	3,019,401.00	2.08
172	600873	梅花生物	3,012,671.00	2.07
173	300287	飞利信	3,010,700.00	2.07
174	002439	启明星辰	3,007,677.23	2.07
175	000061	农产品	2,997,504.00	2.06
176	000066	中国长城	2,991,713.78	2.06
177	601699	潞安环能	2,980,951.01	2.05
178	600728	佳都科技	2,972,224.00	2.04
179	600012	皖通高速	2,936,470.90	2.02

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	002353	杰瑞股份	11,489,998.36	7.90
2	600026	中远海能	10,382,444.94	7.14
3	600971	恒源煤电	10,004,825.86	6.88
4	600782	新钢股份	9,614,606.66	6.61
5	000009	中国宝安	9,485,667.88	6.52
6	600063	皖维高新	9,218,506.00	6.34
7	603444	吉比特	8,145,548.00	5.60
8	002004	华邦健康	7,754,290.00	5.33
9	600325	华发股份	7,686,135.41	5.29

10	600031	三一重工	7,201,336.27	4.95
11	600755	厦门国贸	7,132,640.93	4.91
12	600580	卧龙电驱	7,075,663.07	4.87
13	000027	深圳能源	6,942,395.00	4.77
14	600260	凯乐科技	6,915,000.22	4.76
15	000807	云铝股份	6,865,877.70	4.72
16	600376	首开股份	6,859,825.00	4.72
17	000750	国海证券	6,764,134.50	4.65
18	000501	鄂武商 A	6,716,687.19	4.62
19	601003	柳钢股份	6,608,038.00	4.54
20	600765	中航重机	6,597,186.43	4.54
21	600757	长江传媒	6,513,490.00	4.48
22	002318	久立特材	6,501,009.77	4.47
23	601336	新华保险	6,472,619.68	4.45
24	002605	姚记科技	6,370,882.00	4.38
25	002414	高德红外	6,310,617.00	4.34
26	000987	越秀金控	6,304,334.24	4.34
27	600823	世茂股份	6,225,028.60	4.28
28	601000	唐山港	6,207,165.02	4.27
29	002152	广电运通	6,193,611.77	4.26
30	601615	明阳智能	6,156,112.70	4.23
31	002157	正邦科技	6,155,258.87	4.23
32	600153	建发股份	5,945,723.78	4.09
33	000686	东北证券	5,895,799.46	4.05
34	000878	云南铜业	5,873,001.00	4.04
35	601717	郑煤机	5,804,641.00	3.99
36	601958	金钼股份	5,728,072.00	3.94
37	600801	华新水泥	5,726,740.14	3.94
38	600183	生益科技	5,713,217.88	3.93
39	600166	福田汽车	5,691,020.00	3.91
40	002379	宏创控股	5,644,665.00	3.88
41	000999	华润三九	5,569,665.19	3.83
42	600282	南钢股份	5,564,978.00	3.83
43	002465	海格通信	5,527,745.00	3.80
44	300058	蓝色光标	5,526,094.25	3.80
45	603198	迎驾贡酒	5,472,563.14	3.76
46	002276	万马股份	5,287,778.78	3.64
47	002926	华西证券	5,285,018.48	3.63
48	601811	新华文轩	5,239,964.07	3.60
49	002818	富森美	5,228,465.65	3.60
50	002381	双箭股份	5,193,131.00	3.57
51	000425	徐工机械	5,144,962.80	3.54
52	002182	云海金属	5,144,038.00	3.54

53	600039	四川路桥	5,114,226.77	3.52
54	000031	大悦城	5,062,375.00	3.48
55	000656	金科股份	4,957,913.04	3.41
56	603225	新凤鸣	4,935,113.08	3.39
57	002340	格林美	4,893,245.00	3.37
58	002666	德联集团	4,780,718.00	3.29
59	000060	中金岭南	4,768,346.00	3.28
60	002250	联化科技	4,747,475.88	3.27
61	600486	扬农化工	4,731,036.67	3.25
62	002064	华峰氨纶	4,695,677.00	3.23
63	603328	依顿电子	4,695,309.04	3.23
64	000933	神火股份	4,642,661.12	3.19
65	600058	五矿发展	4,638,581.00	3.19
66	600699	均胜电子	4,634,471.88	3.19
67	601611	中国核建	4,586,564.00	3.15
68	600565	迪马股份	4,512,784.83	3.10
69	002048	宁波华翔	4,485,602.51	3.08
70	000543	皖能电力	4,471,244.00	3.08
71	000513	丽珠集团	4,449,066.44	3.06
72	000400	许继电气	4,436,553.72	3.05
73	601677	明泰铝业	4,434,858.38	3.05
74	600862	中航高科	4,389,421.00	3.02
75	600779	水井坊	4,366,604.19	3.00
76	600216	浙江医药	4,354,794.47	2.99
77	002444	巨星科技	4,341,551.36	2.99
78	002544	杰赛科技	4,316,743.00	2.97
79	002707	众信旅游	4,316,589.00	2.97
80	600261	阳光照明	4,290,707.00	2.95
81	002489	浙江永强	4,254,674.00	2.93
82	600335	国机汽车	4,250,035.00	2.92
83	002440	闰土股份	4,239,799.57	2.92
84	002916	深南电路	4,221,651.44	2.90
85	000997	新大陆	4,207,356.37	2.89
86	603369	今世缘	4,201,608.00	2.89
87	000778	新兴铸管	4,145,794.16	2.85
88	600967	内蒙一机	4,113,650.34	2.83
89	600582	天地科技	4,094,982.00	2.82
90	600312	平高电气	4,081,047.00	2.81
91	002734	利民股份	4,080,180.90	2.81
92	600426	华鲁恒升	4,062,784.15	2.79
93	002701	奥瑞金	4,058,280.18	2.79
94	300088	长信科技	4,052,909.00	2.79
95	600266	城建发展	4,038,774.00	2.78

96	600909	华安证券	4,024,004.00	2.77
97	603355	莱克电气	4,001,113.77	2.75
98	600466	蓝光发展	3,993,385.40	2.75
99	600875	东方电气	3,986,439.64	2.74
100	002244	滨江集团	3,979,083.00	2.74
101	000401	冀东水泥	3,946,229.72	2.71
102	000581	威孚高科	3,911,678.98	2.69
103	000708	中信特钢	3,804,682.51	2.62
104	600511	国药股份	3,784,229.97	2.60
105	002315	焦点科技	3,775,249.74	2.60
106	300115	长盈精密	3,725,936.00	2.56
107	000547	航天发展	3,715,383.00	2.56
108	600125	铁龙物流	3,697,888.22	2.54
109	300159	新研股份	3,690,686.00	2.54
110	600348	阳泉煤业	3,663,938.00	2.52
111	600021	上海电力	3,663,769.90	2.52
112	002746	仙坛股份	3,657,706.84	2.52
113	601179	中国西电	3,650,473.00	2.51
114	300287	飞利信	3,588,441.00	2.47
115	600694	大商股份	3,584,204.58	2.47
116	002019	亿帆医药	3,568,925.00	2.45
117	600062	华润双鹤	3,543,767.80	2.44
118	000932	华菱钢铁	3,538,475.40	2.43
119	601928	凤凰传媒	3,513,065.00	2.42
120	000738	航发控制	3,509,667.72	2.41
121	002268	卫士通	3,500,377.37	2.41
122	600623	华谊集团	3,492,527.23	2.40
123	000028	国药一致	3,482,989.98	2.40
124	601966	玲珑轮胎	3,466,791.00	2.38
125	000066	中国长城	3,457,999.59	2.38
126	000600	建投能源	3,427,872.00	2.36
127	600737	中粮糖业	3,407,368.66	2.34
128	002405	四维图新	3,297,619.85	2.27
129	600750	江中药业	3,297,458.40	2.27
130	000623	吉林敖东	3,264,650.60	2.25
131	600497	驰宏锌锗	3,223,259.58	2.22
132	600863	内蒙华电	3,202,551.00	2.20
133	002028	思源电气	3,198,924.00	2.20
134	601311	骆驼股份	3,189,985.44	2.19
135	600366	宁波韵升	3,187,337.54	2.19
136	002367	康力电梯	3,126,252.00	2.15
137	002056	横店东磁	3,124,204.00	2.15
138	600028	中国石化	3,121,882.00	2.15

139	300632	光莆股份	3,116,218.00	2.14
140	000988	华工科技	3,094,453.48	2.13
141	002316	亚联发展	3,092,252.80	2.13
142	600567	山鹰纸业	3,074,918.00	2.11
143	000061	农产品	3,069,367.30	2.11
144	600373	中文传媒	3,062,698.20	2.11
145	002214	大立科技	3,056,456.00	2.10
146	000951	中国重汽	3,026,356.00	2.08
147	002332	仙琚制药	2,999,112.00	2.06
148	000860	顺鑫农业	2,991,736.58	2.06
149	600873	梅花生物	2,988,722.00	2.06
150	601168	西部矿业	2,987,077.27	2.05
151	600056	中国医药	2,981,485.94	2.05
152	600808	马钢股份	2,930,826.00	2.02
153	000830	鲁西化工	2,909,813.00	2.00

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	1,479,669,177.06
卖出股票的收入（成交）总额	1,274,113,182.94

注：本项的“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	4,628,775.60	1.00
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,628,775.60	1.00

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	019611	19 国债 01	46,260	4,628,775.60	1.00

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投资。

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名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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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

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	109,802.81
2	应收证券清算款	12,837.60
3	应收股利	-
4	应收利息	110,783.42
5	应收申购款	1,394,396.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,627,820.11
---	----	--------------

8.12.4 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。

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

份额级别	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
博时中证 500 指数增强 A	11,372	26,117.09	97,201,462.45	32.73%	199,802,052.41	67.27%
博时中证 500 指数增强 C	8,083	18,929.69	103,840,774.02	67.87%	49,167,889.88	32.13%
合计	19,455	23,130.93	201,042,236.47	44.67%	248,969,942.29	55.33%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	博时中证 500 指数增强 A	2,146,343.63	0.72%
	博时中证 500 指数增强 C	150,725.60	0.10%
	合计	2,297,069.23	0.51%

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的情况

项目	份额级别	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	博时中证 500 指数增强 A	>100
	博时中证 500 指数增强 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时中证 500 指数增强 A	-
	博时中证 500 指数增强 C	-

	合计	-
--	----	---

注：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

项目	博时中证 500 指数增强 A	博时中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 26 日）基金份额总额	383,128,088.40	-
本报告期期初基金份额总额	160,969,848.96	36,441,706.52
本报告期基金总申购份额	305,759,017.65	277,050,477.65
减：本报告期基金总赎回份额	169,725,351.75	160,483,520.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	297,003,514.86	153,008,663.90

§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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2019 年 8 月 24 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，董良泓先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 50,000 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	1,639,164,691.19	60.23%	1,198,723.81	60.23%	新增 2 个
平安证券	2	630,634,938.43	23.17%	461,157.70	23.17%	新增 2 个
广发证券	1	358,029,201.03	13.15%	261,838.39	13.16%	新增 1 个
方正证券	1	56,404,077.48	2.07%	41,250.48	2.07%	-
第一创业	1	25,125,032.25	0.92%	18,371.24	0.92%	新增 1 个
海通证券	2	12,283,990.67	0.45%	8,983.31	0.45%	-

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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

招商证券	6,661,642.90	98.10%	-	-	-	-
平安证券	129,052.20	1.90%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（正文）	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
2	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（摘要）	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
3	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下博时中证 500 指数增强型证券投资基金法律文件的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
4	博时中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
5	博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
6	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-23
7	关于博时旗下部分开放式基金增加上海朝阳永续基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-08-31
8	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年半年度报告（正文）	证券日报、基金管理人网站	2019-08-27
9	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）	证券日报、基金管理人网站	2019-08-27
10	关于华瑞保险销售有限公司开通博时旗下部分开放式基金定投、转换业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-08-16
11	关于博时旗下部分开放式基金增加西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-08-16
12	关于博时旗下部分开放式基金增加浙江绍兴瑞丰农村商业银行	证券日报、基金管理人网站	2019-08-15

	行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告		
13	关于博时中证 500 指数增强型证券投资基金增加奕丰基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-08-15
14	20190812 关于博时旗下部分开放式基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-08-12
15	博时中证 500 指数增强型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-08-08
16	关于博时旗下部分开放式基金增加国信证券为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-08-02
17	关于博时旗下部分开放式基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-07-25
18	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2019-07-18
19	关于博时旗下部分开放式基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-07-18
20	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加上海长量基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-07-12
21	关于博时旗下部分开放式基金增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-07-10
22	关于博时旗下部分开放式基金增加华瑞保险销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-07-08
23	关于博时旗下部分开放式基金增加中信建投证券为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-06-25
24	关于博时旗下部分开放式基金增加浦领基金销售有限公司为	证券日报、基金管理人网站	2019-05-29

	代销机构并参加其费率优惠活动的公告		
25	关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-05-22
26	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-05-16
27	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（摘要）	证券日报、基金管理人网站	2019-05-10
28	博时中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（正文）	证券日报、基金管理人网站	2019-05-10
29	关于博时旗下部分开放式基金增加贵州银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-05-08
30	关于博时旗下部分开放式基金增加郑州银行股份有限公司为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-04-29
31	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2019-04-22
32	关于博时旗下部分开放式基金增加包商银行股份有限公司为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-04-18
33	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告（正文）	证券日报、基金管理人网站	2019-03-29
34	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	证券日报、基金管理人网站	2019-03-29
35	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	证券日报、基金管理人网站	2019-03-25
36	关于博时旗下部分基金增加浙江民泰商业银行为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-03-14
37	关于博时中证 500 指数增强基金增加爱建证券为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-03-06
38	关于博时旗下部分开放式基金增加广发银行股份有限公司为	证券日报、基金管理人网站	2019-02-26

	代销机构的公告		
39	关于博时旗下部分开放式基金增加四川天府银行股份有限公司为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-02-25
40	关于博时旗下部分开放式基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-02-21
41	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-02-15
42	关于博时旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-02-14
43	关于博时旗下部分开放式基金增加部分券商为代销机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-02-01
44	关于博时旗下部分开放式基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-01-29
45	博时中证 500 指数增强型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站	2019-01-19
46	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2019-01-09

§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者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-07-10~2019-07-14	26,362,539.90	44,755,565.75	0.00	71,118,105.65	15.80%

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 中国证券监督管理委员会批准博时中证 500 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《博时中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时中证 500 指数增强型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 博时中证 500 指数增强型证券投资基金各年度审计报告正本
- 13.1.6 报告期内博时中证 500 指数增强型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
二〇二〇年三月二十七日