博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金2018年第3季度报告

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	博时上证超大盘ETF联接
基金主代码	050013
交易代码	050013
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金
基金合同生效日	2009年12月29日
报告期末基金份额总额	182,604,822.90份
投资目标	通过主要投资于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即上证超级大盘指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金，标的指数即上证超级大盘指数成份股及备选成份股等，新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，紧密跟踪标的指数的表现，以期获得标的指数所表征的市场组合所代表的市场平均水平的投资收益。
业绩比较基准	上证超级大盘指数收益率X95%+银行活期存款税后利率X5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪上证超级大盘指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510020
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2009年12月29日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年3月19日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。
业绩比较基准	上证超级大盘指数（价格指数）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证超级大盘指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日-2018年9月30日）
1.本期已实现收益	130,280.37
2.本期利润	13,996,373.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0767
4.期末基金资产净值	180,547,421.93
5.期末基金份额净值	0.9887

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。

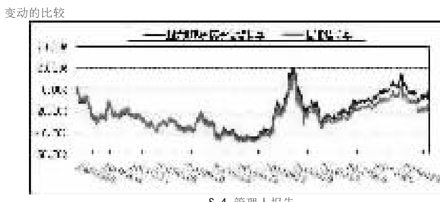
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	8.41%	1.19%	6.57%	1.29%	1.84%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	基金经理	2015-06-08	-	11.3	万琼女士，硕士。2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理。现任博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015.06.08-至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015.06.08-至今)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015.06.08-至今)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015.06.08-至今)、博时标普500交易型开放式指数证券投资基金(2015.10.08-至今)、博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015.10.08-至今)、博时富时中国A股指数证券投资基金(2017.09.29-至今)的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第3季度，国内经济数据持续下滑，经济下行压力显现。9月份PMI指数大幅回落，9月中采制造业PMI降至50.8，9月财新PMI降至50，两者均为过去两年的次低值，意味着制造业景气出现了明显的下滑，经济下行承压。国际油价大幅上涨，势必会带动国内成品油和相关化工产品价格提升。过去两个月，由于降雨和猪瘟疫等因素的影响，食品价格涨幅超预期，预计9月CPI或将突破2.5%，通胀压力加大。国际方面，美联储如期进行年底第3次加息，美债利率创出新高，全球货币紧缩加码。美元走强和美债利率上升使得资金回流美国，加剧新兴市场资金流出压力。汇率方面，人民币兑美元继续大幅贬值，贬值趋势主要集中在7月份，但最近两汇率已经稳住，由人民币贬值而引起的市场担忧也有所缓解。

3季度股票市场交易较为清淡，投资者追逐龙头效应明显，出现大小盘跷跷板行情。大盘上涨，而中小盘普跌，市场大小盘分化明显，上证50上涨5.11%，其他宽基指数全部下跌。其中沪深300指数下跌2.05%，中证500、中证1000、创业板指则分别下跌7.99%、11.08%、12.16%。行业方面，中信一级行业中，银行、石油石化、非银行金融、钢铁和国防军工表现靠前，涨跌幅分别为12.41%、11.60%、5.46%、4.26%、4.08%，而家电、纺织服装、电子元器件、医药及传媒领跌，跌幅分别是17.34%、15.34%、14.91%、14.34%和13.70%。

本基金主要投资于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金，以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的收益。在报告期内，本基金严格按照基金合同，以不低于基金资产净值90%的资产都投资于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金，保证投资收益紧贴标的指数；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

展望2018年第4季度，制造业景气度仍不容乐观。从中观高频行业数据看，几乎各项指标都有所变差，仅价格指标有所改善，9月出厂价格为54.3%，相对上季度末53.3%有所上升。可以看出，经济基本面仍在底部，但产品价格有所上行，站在当下时点展望，接下来经济增长压力继续加大，国内需求和生产均有走弱。货币政策方面，央行宣布了年内第3次降准，有助于4季度信贷结构优化以及社会融资增速回稳。此外，由于贸易战升级与否前期对政策的选择产生了明显的影响，而美国对2000亿美元征税已经靴子落地，预计4季度对行情的边际影响减弱。再加上政策面偏暖的可能性较大，阶段性反弹仍在途中。股市已向下超调较多，建议逢低逐渐增持。

在投资策略上，超大盘联接基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，通过投资于超大盘ETF紧密跟踪上证超大盘指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过超大盘联接基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年09月30日，本基金基金份额净值为0.9887元，份额累计净值为0.9887元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为8.41%，同期业绩基准增长率6.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,903,309.44	1.60
	其中：股票	2,903,309.44	1.60
2	基金投资	167,553,292.51	92.53
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,209,414.72	5.09
8	其他各项资产	1,420,521.38	0.78
9	合计	181,086,538.05	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金	股票指数型	交易型开放式指数基金	博时基金管理有限公司	167,553,292.51	92.80

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,485.00	0.01
C	制造业	2,741,177.44	1.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,074.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,972.00	0.01
J	金融业	107,601.00	0.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,903,309.44	1.61

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600485	信威集团	252,971	2,691,611.44	1.49
2	601318	中国平安	800	54,800.00	0.03
3	600887	伊利股份	700	17,976.00	0.01
4	600030	中信证券	900	15,021.00	0.01
5	600104	上汽集团	400	13,312.00	0.01
6	601166	兴业银行	800	12,760.00	0.01
7	600036	招商银行	400	12,276.00	0.01
8	601088	中国神华	600	12,234.00	0.01
9	601186	中国铁建	900	10,035.00	0.01
10	600028	中国石化	1,100	7,832.00	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 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。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 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仓股指期货。

5.11 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仓国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,664.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,793.92
5	应收申购款	1,416,062.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,420,521.38

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	2,691,611.44	1.49	公告重大事项

5.12.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	184,090,164.74
报告期基金总申购份额	9,033,033.93
减：报告期基金总赎回份额	10,518,375.77
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	182,604,822.90

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。"为国民创造财富"是博时的使命。博时的投资理念是"做投资价值的发现者"。截至2018年09月30日，博时基金公司共管理177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8169亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾1964亿元人民币，累计分红逾894亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至2018年3季末：

博时旗下权益类基金业绩表现持续稳健。今年以来A股市场剧烈震荡，在参与银河排名的99只权益产品（各类份额分开计算）中，共49只银河同类排名前1/2。其中，股票型基金里，博时国企改革主题、博时丝路主题、博时工业4.0、博时军工主题业绩均排名银河同类前1/4；混合型基金当中，博时沪港深成长、博时汇智回报、博时新收益、博时鑫泰、博时新策略等多只基金业绩排名银河同类前1/8，博时新兴消费、博时裕隆、博时乐臻、博时新策略、博时鑫瑞、博时鑫丰、博时新价值等多只基金业绩排名银河同类前1/4，博时精选、博时创业成长、博时沪港深价值优选、博时鑫源、博时鑫润、博时新起点等多只基金业绩排名银河同类前1/2；指数型基金当中，博时上证超大盘ETF及其联接基金、中证银行分级指数等产品业绩排名银河同类前1/10，博时上证50ETF及其联接基金业绩排名银河同类前1/6，博时裕富沪深300指数业绩排名银河同类前1/3，博时银智大数据100指数、博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF、博时上证800证保分级等多只产品业绩排名银河同类前1/2。

博时固定收益类基金业绩表现优异。总计106只各类型债券基金中共有86只（各类份额分开计算）今年以来收益率超过全市场债券平均收益率（3.25%），16只货币基金中共有11只（各类份额分开计算）今年以来收益率超过全市场货币基金平均收益率（2.79%），在参与银河排名的115只固收产品（各类份额分开计算）中，有55只产品银河同类排名前1/2。其中，博时裕瑞纯债、博时利发纯债、博时裕康纯债今年以来净值增长率为7.38%、6.48%、6.02%，同类309只基金中分别排名第3、第10、第20位，博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率分别为6.07%、4.65%、4.36%，同类210只基金中分别排名第5、第17、第23位，博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)今年以来净值增长率分别为5.68%、4.36%，同类148只基金中分别排名第4、第14，博时裕利纯债债券、博时富瑞纯债债券今年以来净值增长率分别为5.81%、5.76%，同类排名前1/8；货币基金类，博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率为3.15%，在312只同类基金排名中位列第14位。

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

QDII基金方面，博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类)，今年以来净值增长率同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年9月7日，由证券时报主办的"2018中国AI金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋"榜颁奖典礼在深圳举行，凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维，博时基金副总裁王德英获得了"2018中国金融科技领军人物先锋"的荣誉。

2018年9月6-9日，在阿拉善生态基金会主办，深圳证券信息、全景网协办，深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的"2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛"中，由4名博时员工朱盟（信息技术部）、过钧（固定收益总部）、王飞（信息技术部）、王盼（信息技术部）组成的代表队，成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠，率先全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018年8月，全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获A档，三个社保委托组合获评"综合考评A档"，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获3项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的"10年长期贡献社保表彰"，用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合，含金量极高。同时，董良泓本人还摘得"10年贡献社保表彰"的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予2人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评"3年贡献社保表彰"。

2018年7月19日，由中国证券投资基金业协会主办的"中国基金业20周年——发展中的思考与启示"主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得"优秀基金管理人"大奖；副总经理王德英此次荣获"杰出专业人士"的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜"优秀基金产品"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

9.1.2《博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

9.1.3《博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

博时丝路主题股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

博时丝路主题股票型证券投资基金2018年第3季度报告

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时丝路主题股票	
基金主代码	001236	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月22日	
报告期末基金份额总额	1,257,444,106.21份	
投资目标	本基金通过重点投资受益于中国资本输出的标的，在严控风险和良好流动性的情况下，力求为基金持有人创造良好的投资回报。	
投资策略	本基金为股票型基金。投资策略主要包括资产配置策略、行业选择策略和个股选择策略三部分。其中，资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。在行业选择层面，主要是结合宏观和政策环境判断，研究中国对外资本输出和金融贸易开放进程和产业路径，形成行业配置思路。在个股投资层面，本基金将坚持估值与成长相结合，对企业基本面和长期竞争力进行严格评判。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×90%+中国债券总指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险/预期收益特征的开放式基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时丝路主题股票A	博时丝路主题股票C
下属分级基金的交易代码	001236	002556
报告期末下属分级基金的份额总额	1,254,000,776.34份	3,443,329.87份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	博时丝路主题股票A	博时丝路主题股票C
1.本期已实现收益	-68,987,099.65	-186,848.53
2.本期利润	-66,576,872.57	-165,734.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0530	-0.0495
4.期末基金资产净值	1,048,449,661.53	2,873,673.79
5.期末基金份额净值	0.836	0.835

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。

所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 本报告期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. 博时丝路主题股票A：

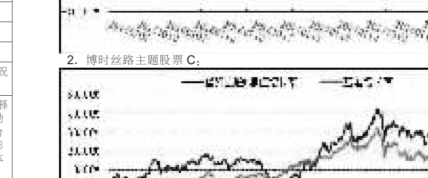
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.96%	1.25%	-1.70%	1.22%	-4.26%	0.03%

2. 博时丝路主题股票C：

阶段	净值增长率①	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	-6.07%	1.25%	-1.70%	1.22%	-4.37%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

1. 博时丝路主题股票A：



2. 博时丝路主题股票C：

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沙炜	基金经理	2015-05-22	-	10.0	沙炜先生，硕士。2008年从中国科学院硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、资深研究员、基金经理助理、原材料组组长、研究部副总经理、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2015.08.04-2017.06.27)基金经理。现任博时丝路主题股票型证券投资基金(2015.05.22-至今)、博时招财二号大数据保本混合型证券投资基金(2016.08.09-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遵规守信情况的说明

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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，宏观经济预期下行，中美贸易纠纷愈演愈烈，政府陆续出台一系列稳增长措施，政策导向从"去杠杆"向"稳杠杆"过渡，但严控地方债务的决心未变，经济的下行压力仍大。在此背景下，各个板块的投资逻辑均更加复杂化，市场震荡下行。

报告期内，本基金保持偏低仓位，适当增加了周期板块配置，继续持有机械、医药、计算机等质地较好的成长股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年09月30日，本基金A类基金份额净值为0.836元，份额累计净值为0.836元，本基金C类基金份额净值为0.835元，份额累计净值为0.835元。报告期内，本基金A基金份额净值增长率为-5.96%，本基金C基金份额净值增长率为-6.07%，同期业绩基准增长率-1.70%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	912,255,367.96	85.60
	其中：股票	912,255,367.96	85.60
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	76,500,000.00	7.18
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	65,380,883.84	6.13
7	其他各项资产	11,575,486.60	1.09
8	合计	1,065,711,738.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	517,709,850.28	49.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	88,016,873.94	8.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	28,565,032.08	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	122,023,357.32	11.61
J	金融业	70,171,149.00	6.67
K	房地产业	64,175,837.34	6.10
L	租赁和商务服务业	21,593,268.00	2.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	912,255,367.96	86.77

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603337	杰克股份	1,865,003	63,279,551.79	6.02
2	002410	广联达	1,889,665	50,605,228.70	4.81
3	002258	利尔化学	2,368,523	45,191,418.84	4.30
4	300146	汤臣倍健	2,190,500	44,905,250.00	4.27
5	600900	长江电力	2,726,413	44,658,644.94	4.25
6	300529	健帆生物	958,747	41,849,306.55	3.98
7	601601	中国太保	1,126,200	39,991,362.00	3.80
8	600585	海螺水泥	938,825	34,539,371.75	3.29
9	002912	中新赛克	330,653	30,836,698.78	2.93
10	600845	宝信软件	1,248,684	30,605,244.84	2.91

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	11,278,206.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-47,121.96
5	应收申购款	344,402.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,575,486.60

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时丝路主题股票A	博时丝路主题股票C
本报告期期初基金份额总额	1,266,764,065.50	3,227,813.49
报告期基金总申购份额	19,462,275.97	771,405.33
减：报告期基金总赎回份额	32,225,565.13	555,888.95
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,254,000,776.34	3,443,329.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。"为国民创造财富"是博时的使命。博时的投资理念是"做投资价值的发现者"。截至2018年09月30日，博时基金公司共管理177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8169亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾1964亿元人民币，累计分红逾894亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至2018年3季末：

博时旗下权益类基金业绩表现持续稳健。今年以来A股市场剧烈震荡，在参与银河排名的99只权益产品（各类份额分开计算）中，共49只银河同类排名前1/2。其中，股票型基金里，博时国企改革主题、博时丝路主题、博时工业4.0、博时军工主题业绩均排名银河同类前1/4；混合型基金当中，博时沪港深成长、博时汇智回报、博时新收益、博时鑫泰、博时新策略等多只基金业绩排名银河同类前1/8，博时新兴消费、博时裕隆、博时乐臻、博时新策略、博时鑫瑞、博时鑫丰、博时新价值等多只基金业绩排名银河同类前1/4，博时精选、博时创业成长、博时沪港深价值优选、博时鑫源、博时鑫润、博时新起点等多只基金业绩排名银河同类前1/2；指数型基金当中，博时上证超大盘ETF及其联接基金、中证银行分级指数等产品业绩排名银河同类前1/10，博时上证50ETF及其联接基金业绩排名银河同类前1/6，博时裕富沪深300指数业绩排名银河同类前1/3，博时银智大数据100指数、博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF、博时上证800证保分级等多只产品业绩排名银河同类前1/2。

博时固定收益类基金业绩表现优异。总计106只各类型债券基金中共有86只（各类份额分开计算）今年以来收益率超过全市场债券平均收益率（3.25%），16只货币基金中共有11只（各类份额分开计算）今年以来收益率超过全市场货币基金平均收益率（2.79%），在参与银河排名的115只固收产品（各类份额分开计算）中，有55只产品银河同类排名前1/2。其中，博时裕瑞纯债、博时利发纯债、博时裕康纯债今年以来净值增长率为7.38%、6.48%、6.02%，同类309只基金中分别排名第3、第10、第20位，博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率分别为6.07%、4.65%、4.36%，同类210只基金中分别排名第5、第17、第23位，博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)今年以来净值增长率分别为5.68%、4.36%，同类148只基金中分别排名第4、第14，博时裕利纯债债券、博时富瑞纯债债券今年以来净值增长率分别为5.81%、5.76%，同类排名前1/8；货币基金类，博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率为3.15%，在312只同类基金排名中位列第14位。

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

QDII基金方面，博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类)，今年以来净值增长率同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年9月7日，由证券时报主办的"2018中国AI金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋"榜颁奖典礼在深圳举行，凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维，博时基金副总裁王德英获得了"2018中国金融科技领军人物先锋"的荣誉。

2018年9月6-9日，在阿拉善生态基金会主办，深圳证券信息、全景网协办，深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的"2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛"中，由4名博时员工朱盟（信息技术部）、过钧（固定收益总部）、王飞（信息技术部）、王盼（信息技术部）组成的代表队，成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠，率先全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018年8月，全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获A档，三个社保委托组合获评"综合考评A档"，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获3项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的"10年长期贡献社保表彰"，用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合，含金量极高。同时，董良泓本人还摘得"10年贡献社保表彰"的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予2人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评"3年贡献社保表彰"。

2018年7月19日，由中国证券投资基金业协会主办的"中国基金业20周年——发展中的思考与启示"主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得"优秀基金管理人"大奖；副总经理王德英此次荣获"杰出专业人士"的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜"优秀基金产品"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时丝路主题股票型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时丝路主题股票型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时丝路主题股票型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 博时丝路主题股票型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时丝路主题股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

博时中证500指数增强型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

博时中证500指数增强型证券投资基金2018年第3季度报告

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时中证500指数增强	
基金主代码	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	
报告期末基金份额总额	169,884,940.43份	
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。	
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	
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	137,746,625.20份	32,138,315.23份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	博时中证500指数增强A	博时中证500指数增强C
1.本期已实现收益	-7,360,042.48	-2,225,635.74
2.本期利润	-6,328,688.35	-1,554,498.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0488	-0.0423
4.期末基金资产净值	114,710,427.14	26,717,308.03
5.期末基金份额净值	0.8328	0.8313

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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：

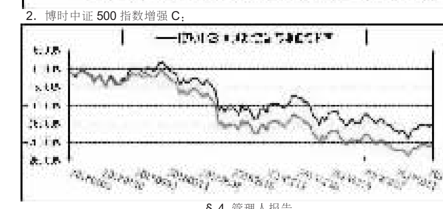
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.69%	1.25%	-7.58%	1.24%	1.89%	0.01%

2. 博时中证500指数增强C：

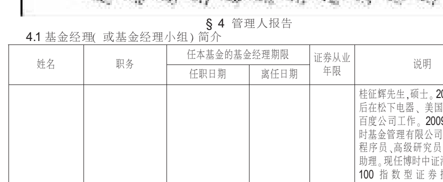
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.78%	1.25%	-7.58%	1.24%	1.80%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

1. 博时中证500指数增强A：



2. 博时中证500指数增强C：



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桂征辉	基金经理	2017-09-26	-	8.9	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。现任博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金(2015.07.21-至今)、博时裕富沪深300指数证券投资基金(2015.07.21-至今)、博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金(2016.05.20-至今)、博时中证500指数增强型证券投资基金(2017.09.26-至今)、博时富时中国A股指数证券投资基金(2018.06.12-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遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年第三季度，A股市场呈现震荡，上证综指累计跌幅0.92%，大小盘分化明显。风格方面，价值表现较好，小盘跌幅较大。行业方面，银行、石油石化等行业大幅跑赢市场，家电、纺织服装、电子元器件等行业表现落后。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年09月30日，本基金A级类基金份额净值为0.8328元，份额累计净值为0.8328元，本基金C级类基金份额净值为0.8313元，份额累计净值为0.8313元，报告期内，本基金A级基金份额净值增长率为-5.69%，本基金C级基金份额净值增长率为-5.78%，同期业绩基准增长率-7.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	131,878,719.68	92.03
	其中：股票	131,878,719.68	92.03
2	固定收益投资	746,104.80	0.52
	其中：债券	746,104.80	0.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,427,752.88	6.58
7	其他各项资产	1,242,622.76	0.87
8	合计	143,295,200.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,464,728.00	1.04
B	采矿业	4,743,097.00	3.35
C	制造业	76,747,377.16	54.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,350,853.00	3.08
E	建筑业	1,986,277.64	1.40
F	批发和零售业	13,646,098.80	9.65
G	交通运输、仓储和邮政业	4,940,359.00	3.49
H	住宿和餐饮业	773,550.00	0.55
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,860,556.48	6.27
J	金融业	1,530,100.00	1.08
K	房地产业	7,102,694.60	5.02
L	租赁和商务服务业	295,616.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	468,864.00	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,968,548.00	3.51
S	综合	-	-
	合计	131,878,719.68	93.25

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	163,600	2,815,556.00	1.99
2	601168	西部矿业	387,800	2,462,530.00	1.74
3	000999	华润三九	94,100	2,396,727.00	1.69
4	601717	郑煤机	335,500	2,358,565.00	1.67
5	600062	华润双鹤	149,260	2,346,367.20	1.66
6	600511	国药股份	87,900	2,308,254.00	1.63
7	600737	中粮糖业	314,361	2,282,260.86	1.61
8	600859	王府井	139,100	2,281,240.00	1.61
9	000848	承德露露	248,826	2,199,621.84	1.56
10	000581	威孚高科	111,200	2,173,960.00	1.54

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	746,104.80	0.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	746,104.80	0.53

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113516	吴银转债	7,120	746,104.80	0.53

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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仓国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,289.55
2	应收证券清算款	970,556.05
3	应收股利	-
4	应收利息	2,338.28
5	应收申购款	242,438.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,242,622.76

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 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。

§6 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
本报告期期初基金份额总额	121,713,216.37	12,150,389.50
报告期基金总申购份额	27,042,157.61	36,671,222.28
减：报告期基金总赎回份额	11,008,748.78	16,683,296.55
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,746,625.20	32,138,315.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。"为国民创造财富"是博时的使命。博时的投资理念是"做投资价值的发现者"。截至2018年09月30日，博时基金公司共管理177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8169亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾1964亿元人民币，累计分红逾894亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至2018年3季末：

博时旗下权益类基金业绩表现持续稳健。今年以来A股市场剧烈震荡，在参与银河排名的99只权益产品（各类份额分开计算）中，共49只银河同类排名前1/2。其中，股票型基金里，博时国企改革主题、博时丝路主题、博时工业4.0、博时军工主题业绩均排名银河同类前1/4；混合型基金当中，博时沪港深成长、博时汇智回报、博时新收益、博时鑫泰、博时新策略等多只基金业绩排名银河同类前1/8，博时新兴消费、博时裕隆、博时乐臻、博时新策略、博时鑫瑞、博时鑫丰、博时新价值等多只基金业绩排名银河同类前1/4，博时精选、博时创业成长、博时沪港深价值优选、博时鑫源、博时鑫润、博时新起点等多只基金业绩排名银河同类前1/2；指数型基金当中，博时上证超大盘ETF及其联接基金、中证银行分级指数等产品业绩排名银河同类前1/10，博时上证50ETF及其联接基金业绩排名银河同类前1/6，博时裕富沪深300指数业绩排名银河同类前1/3，博时银智大数据100指数、博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF、博时上证800证保分级等多只产品业绩排名银河同类前1/2。

博时固定收益类基金业绩表现优异。总计106只各类型债券基金中共有86只（各类份额分开计算）今年以来收益率超过全市场债券平均收益率（3.25%），16只货币基金中共有11只（各类份额分开计算）今年以来收益率超过全市场货币基金平均收益率（2.79%），在参与银河排名的115只固收产品（各类份额分开计算）中，有55只产品银河同类排名前1/2。其中，博时裕瑞纯债、博时利发纯债、博时裕康纯债今年以来净值增长率为7.38%、6.48%、6.02%，同类309只基金中分别排名第3、第10、第20位，博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率分别为6.07%、4.65%、4.36%，同类210只基金中分别排名第5、第17、第23位，博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)今年以来净值增长率分别为5.68%、4.36%，同类148只基金中分别排名第4、第14，博时裕利纯债债券、博时富瑞纯债债券今年以来净值增长率分别为5.81%、5.76%，同类排名前1/8；货币基金类，博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率为3.15%，在312只同类基金排名中位列第14位。

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

QDII基金方面，博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类)，今年以来净值增长率同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年9月7日，由证券时报主办的"2018中国AI金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋"榜颁奖典礼在深圳举行，凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维，博时基金副总裁王德英获得了"2018中国金融科技领军人物先锋"的荣誉。

2018年9月6-9日，在阿拉善生态基金会主办，深圳证券信息、全景网协办，深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的"2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛"中，由4名博时员工朱盟（信息技术部）、过钧（固定收益总部）、王飞（信息技术部）、王盼（信息技术部）组成的代表队，成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠，率先全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018年8月，全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获A档，三个社保委托组合获评"综合考评A档"，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获3项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的"10年长期贡献社保表彰"，用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合，含金量极高。同时，董良泓本人还摘得"10年贡献社保表彰"的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予2人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评"3年贡献社保表彰"。

2018年7月19日，由中国证券投资基金业协会主办的"中国基金业20周年——发展中的思考与启示"主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得"优秀基金管理人"大奖；副总经理王德英此次荣获"杰出专业人士"的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜"优秀基金产品"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 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

9.1.2《博时中证500指数增强型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时中证500指数增强型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 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

9.1.6 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日