

博时中证民企结构调整交易型开放式指数证券投资基金

2018年第四季度报告

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
----	----	------------	--------	----

注：上述任职期间，离任日期指本基金基金经理对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金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守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规、基金合同和公司有关基金投资运作的规章制度，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运用基金资产，为基金份额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，没有损害基金份额持有人的利益。

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 报告期内本基金投资策略和运作分析

2018年四季度，国内经济数据持续下行，经济下行压力较大，12月份中国制造业PMI指数回落至49.4，已跌至荣枯线以下，意味着制造业出现了明显的下行，经济下行承压，国际油价大幅震荡提升以及库存攀升等因素影响出现持续下跌。国内市场上，在美联储持续加息、国内经济持续承压上行，叠加长期通胀预期以及投资者对美国债务违约的担忧，美债及其他权益类资产承压。汇市方面，人民币兑美元汇率继续承压，资金流出272.62亿。

四季度股市场持续调整，投资者情绪低落，呈现出缩量下跌趋势。大小盘指数跌，宽基指数中，上证指数下跌12.03%，沪深300指数下跌12.45%，中500、中1000、创业板指分别下跌12.19%、11.77%、11.29%。行业方面，中证一级行业指数中，跌幅较大的是医药、其他行业中，电力设备、房地产、通信和公用事业及公用事业板块跌幅较大，跌幅分别为3.73%、5.28%、5.51%、6.54%，而石油石化、钢铁、医药、食品饮料及基础化工板块，跌幅分别为23.06%、18.66%、10.00%、17.29%和15.65%。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，为被动跟踪标的基金。其投资目的是在跟踪少和标的指数的基础上，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合投资紧密跟踪标的，利用有效的资产配置策略防止产生跟踪误差。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,000,283,038.97	26.30
C	制造业	9,304,144,363.41	31.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,820,842,546.86	7.89
E	建筑业	6,494,692,370.16	27.98
F	批发和零售业	9,536,088,000.00	41.22
G	交通运输、仓储和邮政业	513,286,338.16	2.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	894,209,082.04	3.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	896,714,428.78	3.76
L	租赁和商务服务业	10,511,647.80	0.04
M	综合类	9,406,137,600.00	40.77
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公事业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	21,973,837,103.53	96.22

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	21,973,837,103.53	94.80
2	固定收益投资	21,973,837,103.53	94.80
3	其中:股票	21,973,837,103.53	94.80
4	其中:债券	-	-
5	货币资金	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	500,000,000.00	2.16
9	其中:应收款项的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和拆借资金合计	370,980,563.03	1.60
11	其他各项资产	319,851,844.96	1.36
12	合计	23,164,669,622.32	100.00