

博时行业轮动混合型证券投资基金

2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十五日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时行业轮动混合
基金主代码	050018
交易代码	050018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 10 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
报告期末基金份额总额	220,755,217.19 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入分析经济周期不同阶段的关键驱动因素和不同行业股价波动的关键驱动因子,把握周期性行业与稳定性行业轮动、周期性行业内部轮动的规律,力争实现在经济周期和行业景气波动下的资产稳定增值。
投资策略	本基金具体投资策略分三个层次:首先是大类资产的配置,即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例;其次是行业配置,即根据行业轮动的规律和经济发展的内在逻辑,在经济周期的不同阶段,配置不同的行业;最后是个股选择策略和债券投资策略。行业轮动策略是本基金的核心策略。本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,股票型基金的风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于高风险、高收益的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-6,248,477.11
本期利润	-284,439.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0013
本期基金份额净值增长率	-2.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1604
期末基金资产净值	221,547,085.82
期末基金份额净值	1.004

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，计入费用后持有人的实际收益水平要低于所列数字。

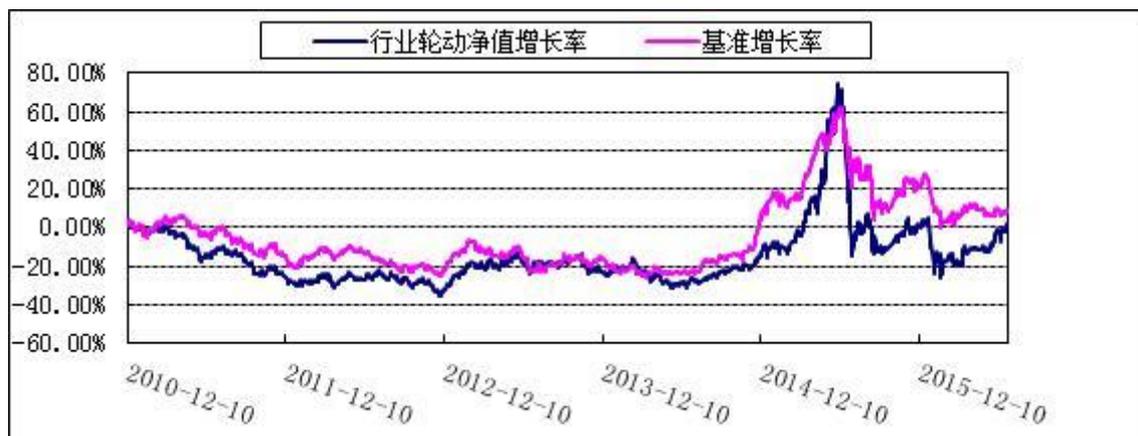
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.02%	2.14%	-0.23%	0.79%	5.25%	1.35%
过去三个月	13.45%	1.48%	-1.50%	0.81%	14.95%	0.67%
过去六个月	-2.14%	2.55%	-12.05%	1.47%	9.91%	1.08%
过去一年	-16.26%	2.47%	-22.57%	1.84%	6.31%	0.63%
过去三年	30.05%	2.03%	40.37%	1.47%	-10.32%	0.56%
自基金合同生效起至今	0.40%	1.68%	9.29%	1.30%	-8.89%	0.38%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80% + 中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



注：本基金合同于 2010 年 12 月 10 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条（二）投资范围、（八）投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 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。资产管理净值总规模达 4,598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 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，2016 年二季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博

时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

固定收益方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债基金今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；指数债券型基金里，博时上证企债 30ETF 今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第四，博时现金收益货币，今年以来净值增长率在同类 194 只基金中排名前 2/5；博时安丰 18 定期开放债券，今年以来净值增长率在同类 45 只中排名第四。

QDII 基金中，博时亚洲票息，今年以来至 6 月 30 日净值增长 7.12%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名第二。

2、其他大事件

- 2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

- 由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

- 2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金凭借在固定收益投资领域的突出表现，荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

- 2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。wind 数据显示，2015 年博时基金旗下 10 只纯债产品平均收益率达 12.65%，其中 6 只定期开放债基平均收益率更高达 15.17%，博时安丰 18 个月定期开放债券和博时双月薪双双夺得同类基金收益榜冠军。

- 2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇”315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。

- 2016 年 1 月 18 日，大众证券报“2015 中国基金风云榜”上，博时创业成长（050014）荣获 2015 “最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰 18 个月定开债（160515）荣获 2015 “最佳固定收益型基金”奖。

- 2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖盛典在

京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈雷	基金经理	2014-08-29	-	8	2007 年起华信惠悦咨询公司工作。2008 年加入博时基金管理有限公司，历任数据分析师、研究员、资深研究员、基金经理助理、博时回报灵活配置混合型证券投资基金、博时平衡配置混合型证券投资基金的基金经理。现任博时行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。
王晓冬	投资经理	2014-08-29	2016-01-20	7.2	2008 年起先后在上海理成资产管理有限公司、兴业证券从事行业研究工作。2011 年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、博时行业轮动混合型证券投资基金、博时回报灵活配置混合型证券投资基金、博时卓越品牌混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。现任投资经理。

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

16 年上半年市场震荡较大，本基金也相应调整了组合的投资策略，集中从电子、新能源汽车、传媒等行业挖掘投资机会；

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.004 元，累计份额净值为 1.004 元，报告期内净值增长率为-2.14%，同期业绩基准涨幅为-12.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在基建投入和地产销售复苏的带动下，国内经济继续保持趋稳的趋势；但由于国内投资回报率仍然难以系统性的回升，因此我们认为经济的复苏将会是一个相对较弱的平衡，仅仅为国内经济结构的转变留出一定的缓冲时间。

从市场来看，市场短期内进入反弹趋势，这和市场对后续的流动性预期的修正以及对改革的预期回升有关。但从中期来看，我们认为市场进入分化阶段，以外延并购和主题投资盈利模式主导的中小创相关个股过去 3 年的盈利模式走到了后段，机会在于盈利模式能够兑现的新兴行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	13,079,685.59	10,880,542.12
结算备付金	2,483,358.13	2,946,367.34

存出保证金	334,090.84	396,953.37
交易性金融资产	208,690,515.43	194,977,830.15
其中：股票投资	208,690,515.43	194,977,830.15
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	3,819.22	4,959.86
应收股利	-	-
应收申购款	337,393.13	40,628.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	224,928,862.34	209,247,281.16
负债和所有者权益	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	435.00	8.88
应付赎回款	1,428,456.80	1,038,047.40
应付管理人报酬	269,379.83	268,848.95
应付托管费	44,896.65	44,808.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,359,807.54	1,154,673.29
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	278,800.70	153,844.32
负债合计	3,381,776.52	2,660,230.99
所有者权益：	-	-
实收基金	220,755,217.19	201,426,847.11
未分配利润	791,868.63	5,160,203.06
所有者权益合计	221,547,085.82	206,587,050.17
负债和所有者权益总计	224,928,862.34	209,247,281.16

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.004 元，基金份额总额 220,755,217.19 份。

6.2 利润表

会计主体：博时行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月

	30 日	月 30 日
一、收入	4,856,164.07	50,154,778.91
1. 利息收入	174,225.70	239,558.35
其中：存款利息收入	174,225.70	205,461.26
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	34,097.09
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,417,055.20	121,502,384.32
其中：股票投资收益	-1,703,468.26	121,158,826.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	286,413.06	343,557.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5,964,038.02	-72,148,798.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	134,955.55	561,634.53
减：二、费用	5,140,603.16	6,441,980.04
1. 管理人报酬	1,489,185.39	2,572,353.26
2. 托管费	248,197.57	428,725.46
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,217,295.47	3,242,977.48
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	185,924.73	197,923.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-284,439.09	43,712,798.87
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-284,439.09	43,712,798.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	201,426,847.11	5,160,203.06	206,587,050.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-284,439.09	-284,439.09
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）	19,328,370.08	-4,083,895.34	15,244,474.74

其中：1. 基金申购款	147,918,815.54	-21,639,109.08	126,279,706.46
2. 基金赎回款	-128,590,445.46	17,555,213.74	-111,035,231.72
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)	220,755,217.19	791,868.63	221,547,085.82
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	337,341,442.75	-31,069,980.27	306,271,462.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,712,798.87	43,712,798.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-58,794,712.21	42,916,495.87	-15,878,216.34
其中：1. 基金申购款	484,863,828.40	215,791,164.76	700,654,993.16
2. 基金赎回款	-543,658,540.61	-172,874,668.89	-716,533,209.50
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)	278,546,730.54	55,559,314.47	334,106,045.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳 主管会计工作负责人：王德英 会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

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

除以下会计估计变更外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致：

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、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.2 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.3 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30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	223,766,478.74	9.58%	-	-

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	877,874.36	11.73%	1,715,673.91	20.34%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，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后的净额列示。

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,489,185.39	2,572,353.26
其中：支付销售机构的客户维护费	-	781,892.49

注：支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	248,197.57	428,725.46

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	13,079,685.59	156,048.86	51,699,689.58	154,622.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金在承销期内未买入关联方所承销的证券（2014 年可比期间：同）。

6.4.5 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.5.1.1 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
002805	丰元股份	2016-06-29	-	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	-	网下中签	12.98	12.98	1,676.00	21,754.48	21,754.48	-
603016	新宏泰	2016-06-23	-	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-06-30	-	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016-06-30	-	20.92	-	-	5,143.00	17,846.21	107,591.56	-
000401	冀东水泥	2015-04-05	-	10.60	-	-	453,200.00	4,590,090.00	4,803,920.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，

该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.6 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

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。

(a) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 203,728,710.31 元，属于第二层级的余额为 4,961,805.12 元，无属于第三层级的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层级 145,085,391.47 元，第二层级 49,892,438.68 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。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、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注 6.4.1），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	208,690,515.43	92.78
	其中：股票	208,690,515.43	92.78
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	-	-
	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	15,563,043.72	6.92
7	其他各项资产	675,303.19	0.30
8	合计	224,928,862.34	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	96,080.46	0.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	154,379,905.40	69.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	107,591.56	0.05
F	批发和零售业	26,266,528.41	11.86
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	26,419,680.10	11.93
J	金融业	-	-
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	1,420,729.50	0.64
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	208,690,515.43	94.20

7.3 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

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	002418	康盛股份	1,835,996	19,388,117.76	8.75
2	603012	创力集团	1,405,200	18,857,784.00	8.51
3	000829	天音控股	1,017,179	13,579,339.65	6.13
4	000606	*ST 易桥	1,291,000	12,948,730.00	5.84
5	002656	摩登大道	917,650	12,801,217.50	5.78
6	600122	宏图高科	943,500	12,624,030.00	5.70
7	000021	深科技	1,137,000	12,518,370.00	5.65
8	300468	四方精创	162,800	12,319,076.00	5.56
9	000821	京山轻机	580,000	10,219,600.00	4.61
10	002371	七星电子	204,000	8,531,280.00	3.85

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	46,490,940.21	22.50
2	600519	贵州茅台	38,719,852.93	18.74
3	600900	长江电力	31,429,491.18	15.21
4	300061	康耐特	31,388,451.72	15.19
5	000606	*ST 易桥	30,809,013.98	14.91
6	000538	云南白药	28,768,712.05	13.93
7	002530	丰东股份	25,233,426.00	12.21

8	002656	摩登大道	24,446,788.64	11.83
9	002667	鞍重股份	24,410,150.60	11.82
10	000829	天音控股	24,395,498.26	11.81
11	000926	福星股份	22,858,925.72	11.07
12	300379	东方通	19,909,251.50	9.64
13	600489	中金黄金	19,824,970.55	9.60
14	603288	海天味业	19,423,486.31	9.40
15	300264	佳创视讯	18,604,244.05	9.01
16	600801	华新水泥	17,182,488.92	8.32
17	600362	江西铜业	15,185,983.79	7.35
18	603012	创力集团	15,129,096.03	7.32
19	601069	西部黄金	15,104,920.25	7.31
20	600887	伊利股份	15,026,388.00	7.27
21	300465	高伟达	14,914,504.00	7.22
22	002418	康盛股份	14,624,488.70	7.08
23	002456	欧菲光	13,357,298.33	6.47
24	300468	四方精创	12,854,265.20	6.22
25	300008	天海防务	11,592,922.00	5.61
26	300499	高澜股份	11,566,576.75	5.60
27	000021	深科技	11,363,775.00	5.50
28	000070	特发信息	10,680,747.60	5.17
29	603939	益丰药房	10,329,742.90	5.00
30	300310	宜通世纪	10,013,356.00	4.85
31	300467	迅游科技	9,970,651.14	4.83
32	603398	邦宝益智	9,566,399.40	4.63
33	300078	思创医惠	9,461,684.10	4.58
34	000810	创维数字	9,441,494.47	4.57
35	002131	利欧股份	9,217,449.69	4.46
36	600497	驰宏锌锗	9,130,904.92	4.42
37	601139	深圳燃气	8,896,331.52	4.31
38	000821	京山轻机	8,886,135.53	4.30
39	002494	华斯股份	8,750,594.00	4.24
40	002155	湖南黄金	8,732,212.00	4.23
41	300474	景嘉微	8,687,885.76	4.21
42	000401	冀东水泥	8,503,172.00	4.12
43	002664	信质电机	8,372,313.00	4.05
44	300113	顺网科技	7,825,500.10	3.79
45	600500	中化国际	7,775,471.00	3.76
46	002761	多喜爱	7,706,136.38	3.73
47	600325	华发股份	7,704,104.00	3.73
48	600376	首开股份	7,695,686.59	3.73
49	600666	奥瑞德	7,675,653.23	3.72
50	600138	中青旅	7,612,311.24	3.68
51	002221	东华能源	7,560,782.08	3.66
52	002368	太极股份	7,509,669.13	3.64
53	000333	美的集团	7,390,086.24	3.58
54	002343	慈文传媒	7,361,713.00	3.56
55	002502	骅威文化	7,347,887.80	3.56
56	002196	方正电机	7,112,224.40	3.44
57	002323	雅百特	7,090,248.00	3.43

58	601118	海南橡胶	7,011,713.60	3.39
59	000983	西山煤电	7,007,248.50	3.39
60	002684	猛狮科技	6,646,086.71	3.22
61	002339	积成电子	6,604,744.21	3.20
62	002371	七星电子	6,415,677.00	3.11
63	002304	洋河股份	6,294,895.89	3.05
64	002797	第一创业	6,283,098.00	3.04
65	000418	小天鹅 A	6,277,201.54	3.04
66	002741	光华科技	6,270,482.59	3.04
67	601788	光大证券	6,119,454.00	2.96
68	000728	国元证券	6,119,326.63	2.96
69	600061	国投安信	6,119,265.82	2.96
70	601555	东吴证券	6,117,587.00	2.96
71	601198	东兴证券	6,115,067.82	2.96
72	600462	九有股份	6,061,870.20	2.93
73	002640	跨境通	5,933,271.05	2.87
74	600617	国新能源	5,931,044.90	2.87
75	600750	江中药业	5,920,551.00	2.87
76	000963	华东医药	5,915,759.32	2.86
77	600688	上海石化	5,879,320.00	2.85
78	000630	铜陵有色	5,877,694.50	2.85
79	000911	南宁糖业	5,876,429.73	2.84
80	600259	广晟有色	5,870,687.40	2.84
81	002396	星网锐捷	5,863,705.64	2.84
82	002038	双鹭药业	5,859,058.00	2.84
83	600844	丹化科技	5,853,665.97	2.83
84	300119	瑞普生物	5,835,365.01	2.82
85	600456	宝钛股份	5,809,569.62	2.81
86	600136	当代明诚	5,787,093.90	2.80
87	600718	东软集团	5,769,445.62	2.79
88	002584	西陇科学	5,766,481.08	2.79
89	300230	永利股份	5,723,175.30	2.77
90	002657	中科金财	5,595,729.30	2.71
91	002463	沪电股份	5,584,031.00	2.70
92	000665	湖北广电	5,535,282.86	2.68
93	002271	东方雨虹	5,500,481.00	2.66
94	600701	*ST 工新	5,490,858.00	2.66
95	002137	麦达数字	5,483,063.00	2.65
96	000597	东北制药	5,460,963.14	2.64
97	600549	厦门钨业	5,460,913.00	2.64
98	000807	云铝股份	5,459,667.00	2.64
99	002055	得润电子	5,103,249.47	2.47
100	000801	四川九洲	4,988,125.76	2.41
101	300198	纳川股份	4,980,340.00	2.41
102	600884	杉杉股份	4,275,162.00	2.07
103	603017	中衡设计	4,222,689.27	2.04
104	600257	大湖股份	4,219,115.07	2.04
105	002168	深圳惠程	4,212,824.90	2.04
106	002094	青岛金王	4,177,364.00	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	45,587,082.90	22.07
2	600519	贵州茅台	41,171,757.76	19.93
3	300061	康耐特	34,244,882.49	16.58
4	002502	骅威文化	32,122,014.40	15.55
5	600900	长江电力	30,823,653.63	14.92
6	002530	丰东股份	29,948,152.42	14.50
7	000538	云南白药	29,093,246.30	14.08
8	002667	鞍重股份	24,148,642.29	11.69
9	000926	福星股份	23,183,042.70	11.22
10	300465	高伟达	20,694,136.07	10.02
11	002494	华斯股份	19,444,290.90	9.41
12	603288	海天味业	19,274,821.47	9.33
13	600489	中金黄金	19,005,692.72	9.20
14	300379	东方通	18,784,302.13	9.09
15	000606	*ST 易桥	18,073,492.62	8.75
16	002137	麦达数字	18,008,863.89	8.72
17	600801	华新水泥	17,001,271.60	8.23
18	300310	宜通世纪	16,350,688.41	7.91
19	600661	新南洋	16,298,863.14	7.89
20	600666	奥瑞德	15,532,756.18	7.52
21	600362	江西铜业	15,196,686.64	7.36
22	002456	欧菲光	14,665,263.10	7.10
23	600887	伊利股份	14,164,404.99	6.86
24	300113	顺网科技	13,478,017.72	6.52
25	601069	西部黄金	12,867,738.91	6.23
26	300499	高澜股份	12,563,914.70	6.08
27	002656	摩登大道	12,228,365.70	5.92
28	300264	佳创视讯	12,103,077.00	5.86
29	000829	天音控股	12,066,988.00	5.84
30	300008	天海防务	11,981,674.97	5.80
31	600136	当代明诚	11,155,658.83	5.40
32	300467	迅游科技	11,120,988.44	5.38
33	603398	邦宝益智	10,866,565.31	5.26
34	603939	益丰药房	10,704,908.40	5.18
35	300474	景嘉微	10,570,736.88	5.12
36	002131	利欧股份	10,534,149.36	5.10
37	002155	湖南黄金	10,281,813.62	4.98
38	600596	新安股份	9,981,062.75	4.83
39	600497	驰宏锌锗	9,928,582.80	4.81
40	000810	创维数字	9,914,483.97	4.80
41	002664	信质电机	9,142,654.73	4.43
42	002343	慈文传媒	8,702,918.00	4.21
43	002368	太极股份	8,698,395.50	4.21
44	601118	海南橡胶	8,621,458.00	4.17
45	601139	深圳燃气	8,568,393.18	4.15

46	002221	东华能源	8,020,342.04	3.88
47	000333	美的集团	7,600,572.90	3.68
48	002761	多喜爱	7,559,268.91	3.66
49	600325	华发股份	7,510,752.93	3.64
50	300078	思创医惠	7,413,111.00	3.59
51	600138	中青旅	7,271,706.00	3.52
52	002323	雅百特	7,251,085.00	3.51
53	000983	西山煤电	7,174,321.83	3.47
54	600750	江中药业	7,117,856.35	3.45
55	600376	首开股份	7,115,710.25	3.44
56	600500	中化国际	7,101,652.00	3.44
57	002797	第一创业	6,939,956.00	3.36
58	002304	洋河股份	6,793,212.63	3.29
59	600682	南京新百	6,767,561.08	3.28
60	002396	星网锐捷	6,611,007.82	3.20
61	002668	奥马电器	6,421,036.10	3.11
62	002038	双鹭药业	6,310,928.98	3.05
63	601555	东吴证券	6,258,508.29	3.03
64	300230	永利股份	6,255,779.30	3.03
65	600617	国新能源	6,242,402.75	3.02
66	600718	东软集团	6,183,304.00	2.99
67	601788	光大证券	6,135,374.10	2.97
68	000418	小天鹅 A	6,120,575.75	2.96
69	600061	国投安信	6,110,465.60	2.96
70	601198	东兴证券	6,099,773.20	2.95
71	000728	国元证券	6,099,757.97	2.95
72	600462	九有股份	6,089,579.98	2.95
73	002640	跨境通	5,833,956.60	2.82
74	002463	沪电股份	5,787,069.88	2.80
75	600844	丹化科技	5,752,268.88	2.78
76	600688	上海石化	5,725,558.13	2.77
77	000807	云铝股份	5,639,099.00	2.73
78	000630	铜陵有色	5,591,781.10	2.71
79	600701	*ST 工新	5,562,292.00	2.69
80	000911	南宁糖业	5,547,840.88	2.69
81	600549	厦门钨业	5,523,513.00	2.67
82	000963	华东医药	5,494,265.00	2.66
83	600259	广晟有色	5,444,764.60	2.64
84	300119	瑞普生物	5,394,203.57	2.61
85	600476	湘邮科技	5,373,978.90	2.60
86	000597	东北制药	5,299,777.00	2.57
87	000665	湖北广电	5,266,376.00	2.55
88	000070	特发信息	4,950,844.00	2.40
89	002271	东方雨虹	4,939,177.00	2.39
90	002094	青岛金王	4,803,264.17	2.33
91	600576	万家文化	4,670,485.55	2.26
92	600257	大湖股份	4,601,991.20	2.23
93	600884	杉杉股份	4,597,763.00	2.23
94	300409	道氏技术	4,551,285.49	2.20
95	002168	深圳惠程	4,499,243.10	2.18

96	300245	天玑科技	4,464,049.36	2.16
97	603017	中衡设计	4,413,599.40	2.14
98	002055	得润电子	4,406,913.00	2.13
99	300342	天银机电	4,331,368.00	2.10
100	600678	四川金顶	4,217,331.00	2.04
101	002125	湘潭电化	4,198,748.41	2.03

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,172,899,084.63
卖出股票的收入（成交）总额	1,163,446,969.11

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	334,090.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,819.22
5	应收申购款	337,393.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	675,303.19

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
11,656.00	18,939.19	499,509.66	0.23%	220,255,707.53	99.77%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	511,259.47	0.23%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	50-100

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 12 月 10 日）基金份额总额	1,400,439,291.65
本报告期期初基金份额总额	201,426,847.11
本报告期基金总申购份额	147,918,815.54
减：本报告期基金总赎回份额	128,590,445.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	220,755,217.19

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海华信证券	1	444,499,980.23	19.04%	325,064.14	17.60%	-
中信证券	4	292,926,334.01	12.55%	214,217.94	11.60%	-
国信证券	1	249,086,747.88	10.67%	182,157.41	9.86%	-

海通证券	1	237,812,289.27	10.18%	173,912.71	9.42%	-
招商证券	2	223,766,478.74	9.58%	182,797.67	9.90%	-
中金公司	1	200,346,685.25	8.58%	186,583.15	10.10%	-
兴业证券	1	153,604,387.49	6.58%	143,049.75	7.75%	-
国泰君安	3	138,587,749.59	5.94%	129,066.49	6.99%	-
华创证券	2	119,912,759.42	5.14%	87,691.54	4.75%	-
国金证券	1	105,915,355.18	4.54%	77,456.57	4.19%	-
中信建投	2	87,888,685.28	3.76%	81,851.02	4.43%	-
东北证券	1	28,849,289.98	1.24%	21,097.68	1.14%	-
华福证券	1	21,584,026.56	0.92%	15,783.62	0.85%	-
长江证券	2	19,626,115.59	0.84%	18,277.88	0.99%	-
西南证券	1	8,079,004.69	0.35%	5,907.90	0.32%	新增
国开证券	1	2,444,589.20	0.10%	1,787.45	0.10%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
上海华信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-

博时基金管理有限公司
二〇一六年八月二十五日