

# 博时国企改革主题股票型证券投资基金

## 2016 年半年度报告

### 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十五日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
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 .....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	10
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	10
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 .....	10
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 .....	10
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	10
6.1 资产负债表 .....	10
6.2 利润表 .....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	12
6.4 报表附注 .....	13
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	27
7.1 期末基金资产组合情况 .....	27
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	27
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	28
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
7.10 期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	41
7.11 期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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情况 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	43
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	43
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43

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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	43
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	43
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.....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8	其他重大事件.....	45
§ 11	<b>备查文件目录</b> .....	46
11.1	备查文件目录.....	46
11.2	存放地点.....	46
11.3	查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时国企改革主题股票型证券投资基金
基金简称	博时国企改革股票
基金主代码	001277
交易代码	001277
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 20 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,623,084,172.63 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对国企改革事件催生的各类持续性和阶段性投资机会的深入研究,运用量化手段,结合自下而上的研究,实施多策略的组合管理,投资受益于中国国企改革的标的,以分享中国经济体制改革带来的财富增长,寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略分五个方面:首先是资产配置策略,强调通过把握中国国企改革带来的各种投资机遇、结合公司分析和投资价值分析,使用量化的分析模型和策略,进行前瞻性的决策;二是股票投资策略,紧密围绕中国国企改革的基本面分析为基础,运用量化的方法,通过多条投资主线,设计量化策略,实施多策略的组合管理;三是债券投资策略,通过采用积极主动的投资策略,结合宏观经济变化趋势,货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,权衡到期收益率与市场流动性,精选个券并构建和调整债券组合,在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性;最后是金融衍生品投资策略和资产支持证券的投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	95588
传真	0755-83195140	(010) 66105798
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518040	100140

法定代表人	张光华	易会满
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

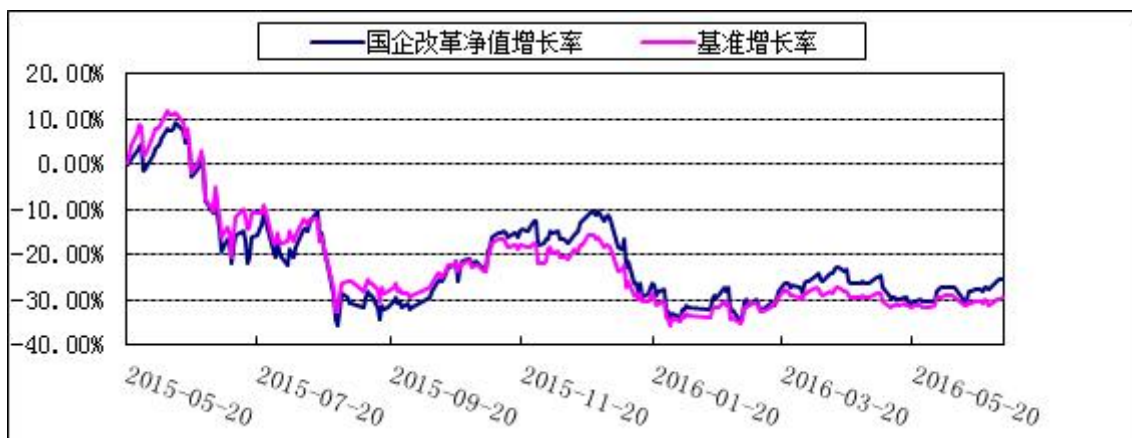
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-354,500,912.14
本期利润	-359,569,305.85
加权平均基金份额本期利润	-0.1340
本期加权平均净值利润率	-18.57%
本期基金份额净值增长率	-15.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-775,216,646.75
期末可供分配基金份额利润	-0.2955
期末基金资产净值	1,961,244,823.20
期末基金份额净值	0.748
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-25.20%

### 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	3.89%	1.27%	-0.36%	0.88%	4.25%	0.39%
过去三个月	1.08%	1.31%	-1.75%	0.91%	2.83%	0.40%
过去六个月	-15.00%	2.15%	-13.76%	1.66%	-1.24%	0.49%
过去一年	-20.34%	2.52%	-26.06%	2.07%	5.72%	0.45%
自基金合同生效起至今	-25.20%	2.55%	-29.60%	2.18%	4.40%	0.37%

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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 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		
王俊	研究部总经理 / 基金经理	2015-05-20	2016-06-08	8.2	2008 年从上海交通大学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、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理、博时国企改革股票基金、博时丝路主题股票基金的基金经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合 (LOF) 基金的基金经理。
林景艺	基金经理	2015-05-20	-	6	2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理，现任博时国企改革股票基金的基金经理。
周江	研究员兼基金经理助理	2015-07-27	-	1.2	2014 年 1 月至 2015 年 4 月在平安磐海资本工作，任策略研究部策略研究员。2015 年 4 月 23 日加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部研究员兼基金经理助理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2016 年以来，市场波动性呈递减的趋势，行业和主题概念间的轮动显著加快，投资者情

绪处于频繁变化中，整体风险偏好较 2015 年显著降低。上半年市场在经历一月份暴跌之后，恐慌情绪有所缓解，在三月份反弹之后市场步入震荡盘整区间。板块方面，食品饮料、银行、有色、煤炭等呈现出较好的抗跌性，传媒、计算机、餐饮旅游、交运等行业跌幅较大。

本基金作为股票型基金今年以来一直保持 80%以上的股票仓位，在市场剧烈的波动中我们维持相对均衡的风格配置，在关注标的业绩改善和成长潜力的同时也注意控制整体组合的估值风险，行业配置较为灵活。在投资策略上我们运用量化方法，围绕兼并重组、治理优化、业绩改善和资产重估四条投资主线，紧密跟踪国企改革主题，保持价值投资理念，并根据市场实际变化情况来调整基金的策略配置，力求战胜基准，为投资者创造价值。

#### 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 0.748 元，累计份额净值为 0.748 元，报告期内净值增长率为-15.00%，同期业绩基准涨幅为-13.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，英国脱欧之后，各国央行维稳措施逐步推出，美国基本面数据不及预期，联储加息预期进一步被抑制，宏观环境相对温和，国内供给侧改革与国企改革相辅相成逐步展开，通胀预期有所降低。市场情绪方面，在经历一月份暴跌和三月份反弹之后，市场情绪趋于稳定，预期下半年投资者风险偏好会略有提高。整体市场估值中枢相对 2015 年有所下降，但是部分股票的估值依然在历史中位数以上，低估值且具有业绩稳定性的板块和个股更加值得关注。

#### 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、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

本报告期内，本基金托管人在对博时国企改革主题股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，博时国企改革主题股票型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时国企改革主题股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时国企改革主题股票型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：博时国企改革主题股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	211,743,891.57	194,758,726.22
结算备付金		61,638,309.11	65,493,722.18
存出保证金		16,375,714.53	19,496,926.12
交易性金融资产	6.4.3.2	1,699,994,331.99	2,067,921,461.07
其中：股票投资		1,699,054,634.99	2,067,921,461.07
基金投资		-	-
债券投资		939,697.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	50,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	70,302.99	83,556.13
应收股利		-	-
应收申购款		74,329.24	1,052,816.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,989,896,879.43</b>	<b>2,398,807,208.45</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,042,647.46	2,695,730.02
应付管理人报酬		2,360,573.78	3,032,431.56
应付托管费		393,428.96	505,405.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	16,573,555.28	10,758,908.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	281,850.75	158,772.24
<b>负债合计</b>		<b>28,652,056.23</b>	<b>17,151,247.39</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	2,623,084,172.63	2,704,927,332.22
未分配利润	6.4.3.10	-661,839,349.43	-323,271,371.16
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,961,244,823.20</b>	<b>2,381,655,961.06</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,989,896,879.43</b>	<b>2,398,807,208.45</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.748 元，基金份额总额 2,623,084,172.63 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时国企改革主题股票型证券投资基金

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	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 5 月 20 日（基金合同 生效日）至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-315,795,088.07</b>	<b>-181,918,582.62</b>
1. 利息收入		1,287,078.50	1,432,325.56
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,271,024.04	458,453.72
债券利息收入		498.93	33.90
资产支持证券利息收入		-	
买入返售金融资产收入		15,555.53	973,837.94
其他利息收入		-	
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-312,288,022.56	6,156,803.32
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-315,780,657.19	-8,547,676.10
基金投资收益		-	
债券投资收益	6.4.3.13	-	
资产支持证券投资收益		-	
贵金属投资收益		-	
衍生工具收益	6.4.3.14	-5,212,520.00	
股利收益	6.4.3.15	8,705,154.63	14,704,479.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-5,068,393.71	-189,507,711.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	274,249.70	
<b>减：二、费用</b>		<b>43,774,217.78</b>	<b>13,454,254.45</b>
1. 管理人报酬		14,452,448.90	5,523,469.01
2. 托管费		2,408,741.47	920,578.19
3. 销售服务费		-	
4. 交易费用	6.4.3.18	26,702,283.44	6,949,337.98
5. 利息支出		-	
其中：卖出回购金融资产支出		-	
6. 其他费用	6.4.3.19	210,743.97	60,869.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-359,569,305.85</b>	<b>-195,372,837.07</b>
减：所得税费用		-	
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-359,569,305.85</b>	<b>-195,372,837.07</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时国企改革主题股票型证券投资基金

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）	2,704,927,332.22	-323,271,371.16	2,381,655,961.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-359,569,305.85	-359,569,305.85

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）	-81,843,159.59	21,001,327.58	-60,841,832.01
其中：1. 基金申购款	84,335,253.81	-23,158,445.11	61,176,808.70
2. 基金赎回款	-166,178,413.40	44,159,772.69	-122,018,640.71
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）	2,623,084,172.63	-661,839,349.43	1,961,244,823.20
项目	上年度可比期间 2015年5月20日（基金合同生效日）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）	3,218,168,319.04	-	3,218,168,319.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-195,372,837.07	-195,372,837.07
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	3,218,168,319.04	-195,372,837.07	3,022,795,481.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	211,743,891.57
定期存款	-
其他存款	-
合计	211,743,891.57

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,638,094,714.98	1,699,054,634.99	60,959,920.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	939,697.00	141,697.00
	银行间市场	-	-
	合计	939,697.00	141,697.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,638,892,714.98	1,699,994,331.99	61,101,617.01

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			备注 (投资成本)
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
股指期货	76,926,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	76,926,760.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1609	38	44,613,520.00	3,149,440.00
IC1612	10	11,312,400.00	504,280.00
IF1609	23	21,000,840.00	425,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	4,079,240.00
股指期货投资净额	-	-	-

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	42,223.13
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	27,169.83
应收债券利息	498.93
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	411.10
合计	70,302.99

#### 6.4.3.6 其他资产

无。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	16,573,555.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,573,555.28



#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	32,946.59
其他应付款	-
预提费用	248,904.16
合计	281,850.75

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,704,927,332.22	2,704,927,332.22
本期申购	84,335,253.81	84,335,253.81
本期赎回(以“-”号填列)	-166,178,413.40	-166,178,413.40
本期末	2,623,084,172.63	2,623,084,172.63

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-444,601,669.82	121,330,298.66	-323,271,371.16
本期利润	-354,500,912.14	-5,068,393.71	-359,569,305.85
本期基金份额交易产生的变动数	23,885,935.21	-2,884,607.63	21,001,327.58
其中：基金申购款	-21,909,964.13	-1,248,480.98	-23,158,445.11
基金赎回款	45,795,899.34	-1,636,126.65	44,159,772.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-775,216,646.75	113,377,297.32	-661,839,349.43

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	831,720.00
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	431,027.81
其他	8,276.23
合计	1,271,024.04

#### 6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	9,032,687,090.23
减：卖出股票成本总额	9,348,467,747.42
买卖股票差价收入	-315,780,657.19

#### 6.4.3.13 债券投资收益

无。

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
远期投资收益	-
期货投资收益	-5,212,520.00
期权投资收益	-
合计	-5,212,520.00

#### 6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,705,154.63
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,705,154.63

#### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-7,890,673.71
——股票投资	-8,032,370.71
——债券投资	141,697.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	2,822,280.00
——权证投资	-
——股指期货	2,822,280.00
3. 其他	-
合计	-5,068,393.71

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	239,538.16
转换费收入	34,711.54
合计	274,249.70

注：对持续持有期少于 30 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于

3 个月的投资人收取，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产；赎回费未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

#### 6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	26,702,283.44
银行间市场交易费用	-
合计	26,702,283.44

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12
银行间汇划费	2,839.81
银行间账户维护费	9,000.00
合计	210,743.97

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 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5月20日（基金合同生效日）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	2,588,315,563.38	14.37%	-	-

#### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.3 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	2,410,481.21	15.02%	2,850,060.93	17.20%
关联方名称	上年度可比期间 2015年5月20日（基金合同生效日）至2015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	-	-	-	-

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。

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年5月20日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,452,448.90	5,523,469.01
其中：支付销售机构的客户维护费	6,623,033.57	2,804,715.22

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年5月20日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,408,741.47	920,578.19

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

### 6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年5月20日（基金合同生效日）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
中国工商银行	211,743,891.57	831,720.00	128,536,341.48	385,038.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 6.4.7 利润分配情况

无。

### 6.4.8 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	15,341.00	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016-6-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

#### 6.4.8.2 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600005	武钢股份	2016-06-24	重大事项	2.76	-	-	1,311,200.00	3,988,536.27	3,618,912.00	-
600019	宝钢股份	2016-06-24	重大事项	4.90	-	-	1,173,000.00	6,407,514.14	5,747,700.00	-
600166	福田汽车	2016-06-29	重大事项	5.52	2016-07-01	5.62	1,002,300.00	5,182,389.03	5,532,696.00	-
600237	铜峰电子	2016-06-29	重大重组	7.61	2016-07-07	7.42	299,200.00	2,187,828.00	2,276,912.00	-
600295	鄂尔多斯	2016-06-29	非公开发行	7.89	2016-07-14	8.46	262,500.00	2,050,917.52	2,071,125.00	-
600318	新力金融	2016-03-23	重大资产重组	26.84	-	-	16,400.00	393,965.90	440,176.00	-

600475	华光股份	2016-05-17	重大资产重组	14.85	-	-	12,600.00	203,460.05	187,110.00	-
600848	上海临港	2016-03-15	重大资产重组	15.42	2016-07-06	16.96	353,100.00	6,123,829.26	5,444,802.00	-
600853	龙建股份	2016-06-27	非公开发行	5.15	2016-07-01	5.23	1,128,500.00	5,939,052.60	5,811,775.00	-
600986	科达股份	2016-06-24	重大资产重组	15.98	2016-07-18	17.58	33,900.00	543,171.18	541,722.00	-
601611	中国核建	2016-06-29	股票异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	37,059.00	128,594.73	775,274.28	-
000401	冀东水泥	2016-04-06	重大资产重组	10.60	2016-07-14	11.32	122,000.00	1,156,767.17	1,293,200.00	-
000409	山东地矿	2016-03-11	重大资产重组	10.19	-	-	284,400.00	3,091,786.19	2,898,036.00	-
000415	渤海金控	2016-01-29	重大资产重组	6.82	2016-08-11	7.50	1,486,161.00	11,763,988.57	10,135,618.02	-
000546	金圆股份	2016-06-15	非公开发行	10.54	2016-07-12	10.95	30,600.00	266,514.52	322,524.00	-
000547	航天发展	2016-04-18	重大资产重组	15.36	-	-	19,900.00	306,483.00	305,664.00	-
000651	格力电器	2016-02-19	发行股份购买资产	22.07	-	-	304,000.00	5,786,972.78	6,709,280.00	-
000710	天兴仪表	2016-06-14	重大资产重组	22.12	-	-	89,400.00	2,159,485.60	1,977,528.00	-
000835	长城动漫	2016-02-26	重大资产重组	13.22	2016-07-22	14.54	33,800.00	472,509.00	446,836.00	-
000948	南天信息	2016-06-27	非公开发行	19.31	2016-07-12	21.00	123,700.00	2,229,933.52	2,388,647.00	-
000950	*ST 建峰	2016-03-17	重大资产重组	7.45	-	-	179,000.00	1,162,147.75	1,333,550.00	-
002059	云南旅游	2016-05-31	重大事项	8.56	-	-	261,300.00	2,154,160.34	2,236,728.00	-
002071	长城影视	2016-06-15	重大资产重组	13.64	-	-	156,100.00	2,241,969.61	2,129,204.00	-
002274	华昌化工	2016-06-08	重大资产重组	10.50	2016-07-07	10.65	288,700.00	2,645,316.47	3,031,350.00	-
002319	乐通股份	2016-06-01	重大资产重组	17.28	-	-	187,700.00	2,884,231.62	3,243,456.00	-
002576	通达动力	2016-06-13	重大资产重组	18.83	-	-	76,600.00	1,609,342.00	1,442,378.00	-
300040	九洲电气	2016-06-24	发行股份购买资产	13.73	-	-	260,900.00	3,649,659.20	3,582,157.00	-
300052	中青宝	2016-06-07	重大资产重组	22.03	-	-	98,200.00	2,208,123.92	2,163,346.00	-
300111	向日葵	2016-06-13	重大资产重组	4.90	-	-	886,100.00	4,503,488.79	4,341,890.00	-
300142	沃森生物	2016-03-21	重大资产重组	11.16	-	-	19.00	187.81	212.04	-
300166	东方国信	2016-06-07	重大资产重组	27.47	-	-	86,100.00	2,129,655.40	2,365,167.00	-
300173	智慧松德	2016-04-08	重大资产重组	16.25	-	-	16,600.00	242,417.91	269,750.00	-
300292	吴通控股	2016-01-22	购买资产	33.26	2016-07-20	36.48	6,003.00	262,053.83	199,659.78	-

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。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种，风险与预期收益都要高于平衡型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，

使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“基金资产长期稳定增长”的风险收益目标。

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

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

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.9.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日
AAA	612,865.90
AA+	326,831.10
未评级	-
合计	939,697.00

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大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，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率



敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。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。

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	211,743,891.57	-	-	-	211,743,891.57
结算备付金	61,638,309.11	-	-	-	61,638,309.11
存出保证金	16,375,714.53	-	-	-	16,375,714.53
交易性金融资产	-	-	-	1,699,994,331.99	1,699,994,331.99
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	70,302.99	70,302.99
应收申购款	-	-	-	74,329.24	74,329.24
<b>资产总计</b>	<b>289,757,915.21</b>	-	-	<b>1,700,138,964.22</b>	<b>1,989,896,879.43</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9,042,647.46	9,042,647.46
应付管理人报酬	-	-	-	2,360,573.78	2,360,573.78
应付托管费	-	-	-	393,428.96	393,428.96
应付交易费用	-	-	-	16,573,555.28	16,573,555.28
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	281,850.75	281,850.75
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>28,652,056.23</b>	<b>28,652,056.23</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>289,757,915.21</b>	-	-	<b>1,671,486,907.99</b>	<b>1,961,244,823.20</b>
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	194,758,726.22	-	-	-	194,758,726.22
结算备付金	65,493,722.18	-	-	-	65,493,722.18
存出保证金	19,496,926.12	-	-	-	19,496,926.12
交易性金融资产	-	-	-	2,067,921,461.07	2,067,921,461.07
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	83,556.13	83,556.13
应收申购款	-	-	-	1,052,816.73	1,052,816.73
<b>资产总计</b>	<b>329,749,374.52</b>	-	-	<b>2,069,057,833.93</b>	<b>2,398,807,208.45</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	2,695,730.02	2,695,730.02
应付管理人报酬	-	-	-	3,032,431.56	3,032,431.56
应付托管费	-	-	-	505,405.26	505,405.26
应付交易费用	-	-	-	10,758,908.31	10,758,908.31
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	158,772.24	158,772.24
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>17,151,247.39</b>	<b>17,151,247.39</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>329,749,374.52</b>	-	-	<b>2,051,906,586.54</b>	<b>2,381,655,961.06</b>

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.05%（2015 年 12 月 31 日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 80%-95%，其中投资于国企改革股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 06 月 30 日		2015 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	1,699,054,634.99	86.63	2,067,921,461.07	86.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	939,697.00	0.05	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,699,994,331.99	86.68	2,067,921,461.07	86.83

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2016 年 06 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 11,697	增加约 11,646
2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 11,697	减少约 11,646	

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 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 1,614,502,281.61 元，属于第二层级的余额为 85,492,050.38 元，无属于第三层级的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 1,954,887,630.94 元，第二层级的余额为 113,033,830.13 元，无属于第三层级的余额）。

###### (ii) 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。

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,699,054,634.99	85.38
	其中：股票	1,699,054,634.99	85.38
2	固定收益投资	939,697.00	0.05
	其中：债券	939,697.00	0.05
	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	273,382,200.68	13.74
7	其他各项资产	16,520,346.76	0.83
8	合计	1,989,896,879.43	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	35,989,717.44	1.84
B	采矿业	29,446,304.76	1.50
C	制造业	918,814,521.57	46.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,757,699.90	3.61
E	建筑业	107,739,850.46	5.49
F	批发和零售业	80,629,792.99	4.11
G	交通运输、仓储和邮政业	53,155,192.48	2.71
H	住宿和餐饮业	1,908,699.00	0.10

I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,792,971.87	4.78
J	金融业	133,143,614.33	6.79
K	房地产业	118,969,441.09	6.07
L	租赁和商务服务业	15,596,102.02	0.80
M	科学研究和技术服务业	6,654,880.10	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	9,136,902.66	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,152,202.00	0.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	16,331,385.68	0.83
S	综合	4,835,356.64	0.25
	合计	1,699,054,634.99	86.63

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601186	中国铁建	1,989,800	19,818,408.00	1.01
2	601390	中国中铁	2,822,894	19,675,571.18	1.00
3	000599	青岛双星	2,582,787	17,769,574.56	0.91
4	601166	兴业银行	1,094,800	16,684,752.00	0.85
5	601998	中信银行	2,912,000	16,511,040.00	0.84
6	601668	中国建筑	2,811,800	14,958,776.00	0.76
7	600000	浦发银行	958,430	14,922,755.10	0.76
8	000001	平安银行	1,687,560	14,681,772.00	0.75
9	600409	三友化工	1,915,479	12,910,328.46	0.66
10	600015	华夏银行	1,241,847	12,281,866.83	0.63
11	600644	乐山电力	1,400,605	11,456,948.90	0.58
12	600016	民生银行	1,278,800	11,419,684.00	0.58
13	600975	新五丰	1,119,600	10,244,340.00	0.52
14	000415	渤海金控	1,486,161	10,135,618.02	0.52
15	002060	粤水电	1,470,000	10,098,900.00	0.51
16	600356	恒丰纸业	934,746	10,001,782.20	0.51
17	000698	沈阳化工	1,435,085	9,385,455.90	0.48
18	000863	三湘股份	1,012,746	9,317,263.20	0.48
19	002417	三元达	608,307	9,264,515.61	0.47
20	601318	中国平安	287,192	9,201,631.68	0.47
21	002302	西部建设	1,240,355	8,955,363.10	0.46
22	600622	嘉宝集团	640,868	8,811,935.00	0.45
23	300313	天山生物	532,573	8,734,197.20	0.45
24	000066	长城电脑	676,900	8,630,475.00	0.44
25	601328	交通银行	1,463,048	8,236,960.24	0.42
26	002696	百洋股份	428,400	8,199,576.00	0.42
27	601800	XD 中国交	767,600	8,082,828.00	0.41
28	600892	大晟文化	121,900	7,840,608.00	0.40
29	601669	中国电建	1,364,400	7,790,724.00	0.40
30	600658	电子城	745,281	7,698,752.73	0.39
31	000521	美菱电器	1,255,000	7,567,650.00	0.39
32	002645	华宏科技	284,232	7,503,724.80	0.38
33	000892	星美联合	522,920	7,399,318.00	0.38

34	002394	联发股份	489,811	7,396,146.10	0.38
35	002259	升达林业	952,600	7,363,598.00	0.38
36	600795	国电电力	2,505,453	7,340,977.29	0.37
37	000807	云铝股份	1,113,700	7,294,735.00	0.37
38	300118	东方日升	381,200	7,189,432.00	0.37
39	000059	华锦股份	769,700	7,158,210.00	0.36
40	000906	物产中拓	588,509	6,985,601.83	0.36
41	600048	保利地产	808,302	6,975,646.26	0.36
42	601818	光大银行	1,853,237	6,968,171.12	0.36
43	000550	江铃汽车	286,042	6,967,983.12	0.36
44	600029	南方航空	961,114	6,785,464.84	0.35
45	601288	农业银行	2,117,075	6,774,640.00	0.35
46	000651	格力电器	304,000	6,709,280.00	0.34
47	600104	上汽集团	330,500	6,705,845.00	0.34
48	002006	精功科技	492,300	6,660,819.00	0.34
49	000960	锡业股份	570,000	6,589,200.00	0.34
50	603003	龙宇燃油	340,523	6,524,420.68	0.33
51	601111	XD 中国国	961,700	6,501,092.00	0.33
52	600690	青岛海尔	729,200	6,475,296.00	0.33
53	300310	宜通世纪	168,220	6,424,321.80	0.33
54	600170	上海建工	1,658,220	6,350,982.60	0.32
55	600741	华域汽车	451,128	6,320,303.28	0.32
56	600027	华电国际	1,270,300	6,287,985.00	0.32
57	600028	中国石化	1,319,360	6,227,379.20	0.32
58	000709	河钢股份	2,238,800	6,201,476.00	0.32
59	300022	吉峰农机	746,125	6,110,763.75	0.31
60	600168	武汉控股	613,600	5,988,736.00	0.31
61	002503	搜于特	479,060	5,949,925.20	0.30
62	600746	江苏索普	596,500	5,863,595.00	0.30
63	600853	龙建股份	1,128,500	5,811,775.00	0.30
64	300272	开能环保	373,014	5,755,606.02	0.29
65	601238	广汽集团	244,736	5,748,848.64	0.29
66	600019	宝钢股份	1,173,000	5,747,700.00	0.29
67	002218	拓日新能	561,700	5,729,340.00	0.29
68	300194	福安药业	262,491	5,682,930.15	0.29
69	000926	福星股份	482,000	5,653,860.00	0.29
70	000528	柳工	870,100	5,638,248.00	0.29
71	000036	华联控股	683,700	5,613,177.00	0.29
72	601567	三星医疗	380,500	5,612,375.00	0.29
73	600266	北京城建	447,000	5,583,030.00	0.28
74	600166	福田汽车	1,002,300	5,532,696.00	0.28
75	000338	潍柴动力	700,200	5,468,562.00	0.28
76	002342	巨力索具	941,800	5,462,440.00	0.28
77	000830	鲁西化工	1,204,946	5,446,355.92	0.28
78	600848	上海临港	353,100	5,444,802.00	0.28
79	300230	永利股份	186,300	5,417,604.00	0.28
80	000898	鞍钢股份	1,413,300	5,412,939.00	0.28
81	600137	浪莎股份	184,800	5,412,792.00	0.28
82	000157	中联重科	1,305,500	5,391,715.00	0.27
83	000959	首钢股份	1,440,600	5,330,220.00	0.27

84	600771	广誉远	182,900	5,329,706.00	0.27
85	600419	天润乳业	98,780	5,323,254.20	0.27
86	002103	广博股份	262,500	5,305,125.00	0.27
87	600269	赣粤高速	1,218,800	5,301,780.00	0.27
88	002001	新和成	248,500	5,250,805.00	0.27
89	600050	XD 中国联	1,370,000	5,219,700.00	0.27
90	600724	宁波富达	1,019,100	5,197,410.00	0.27
91	600621	华鑫股份	516,851	5,178,847.02	0.26
92	000679	大连友谊	416,000	5,120,960.00	0.26
93	002374	丽鹏股份	737,200	5,049,820.00	0.26
94	002110	三钢闽光	835,866	5,048,630.64	0.26
95	000951	中国重汽	526,900	5,037,164.00	0.26
96	600389	江山股份	360,450	5,010,255.00	0.26
97	002239	奥特佳	310,700	5,005,377.00	0.26
98	600702	沱牌舍得	197,300	4,979,852.00	0.25
99	002370	亚太药业	168,748	4,978,066.00	0.25
100	002579	中京电子	314,500	4,931,360.00	0.25
101	603167	渤海轮渡	494,900	4,924,255.00	0.25
102	300025	华星创业	335,749	4,814,640.66	0.25
103	300290	荣科科技	260,000	4,776,200.00	0.24
104	600222	太龙药业	590,812	4,708,771.64	0.24
105	600531	豫光金铅	561,700	4,690,195.00	0.24
106	000601	韶能股份	444,500	4,645,025.00	0.24
107	600382	广东明珠	290,300	4,644,800.00	0.24
108	600755	厦门国贸	582,000	4,626,900.00	0.24
109	300280	南通锻压	160,501	4,555,018.38	0.23
110	002213	特尔佳	229,400	4,535,238.00	0.23
111	002148	北纬通信	226,400	4,516,680.00	0.23
112	002238	天威视讯	312,061	4,515,522.67	0.23
113	002460	赣锋锂业	134,800	4,509,060.00	0.23
114	300113	顺网科技	118,100	4,483,076.00	0.23
115	300144	宋城演艺	179,400	4,468,854.00	0.23
116	600376	首开股份	397,200	4,416,864.00	0.23
117	600508	上海能源	474,200	4,395,834.00	0.22
118	300198	纳川股份	269,900	4,342,691.00	0.22
119	300111	向日葵	886,100	4,341,890.00	0.22
120	600242	中昌海运	278,600	4,307,156.00	0.22
121	002499	科林环保	217,580	4,255,864.80	0.22
122	000068	华控赛格	435,453	4,215,185.04	0.21
123	002680	长生生物	101,400	4,212,156.00	0.21
124	300062	中能电气	173,600	4,206,328.00	0.21
125	002042	华孚色纺	405,180	4,189,561.20	0.21
126	002426	胜利精密	423,500	4,171,475.00	0.21
127	000429	粤高速 A	742,922	4,086,071.00	0.21
128	002082	栋梁新材	255,179	4,052,242.52	0.21
129	600781	辅仁药业	231,000	4,026,330.00	0.21
130	000043	中航地产	486,400	4,012,800.00	0.20
131	002628	成都路桥	574,300	4,002,871.00	0.20
132	000510	金路集团	566,500	3,988,160.00	0.20
133	600093	禾嘉股份	318,300	3,950,103.00	0.20

134	002295	精艺股份	251,400	3,946,980.00	0.20
135	300143	星河生物	167,920	3,920,932.00	0.20
136	002171	楚江新材	227,400	3,918,102.00	0.20
137	002193	山东如意	238,600	3,915,426.00	0.20
138	600159	大龙地产	837,242	3,909,920.14	0.20
139	002137	麦达数字	228,900	3,882,144.00	0.20
140	600039	四川路桥	975,300	3,842,682.00	0.20
141	600152	维科精华	350,800	3,806,180.00	0.19
142	002690	美亚光电	161,000	3,709,440.00	0.19
143	600997	开滦股份	709,300	3,688,360.00	0.19
144	000544	中原环保	257,661	3,681,975.69	0.19
145	002473	圣莱达	156,600	3,656,610.00	0.19
146	300172	中电环保	394,346	3,631,926.66	0.19
147	600595	中孚实业	641,700	3,619,188.00	0.18
148	600005	武钢股份	1,311,200	3,618,912.00	0.18
149	002258	利尔化学	383,900	3,604,821.00	0.18
150	300237	美晨科技	382,600	3,604,092.00	0.18
151	600188	XD 兖州煤	328,300	3,591,602.00	0.18
152	300040	九洲电气	260,900	3,582,157.00	0.18
153	300357	我武生物	94,900	3,573,934.00	0.18
154	600438	通威股份	561,100	3,568,596.00	0.18
155	600505	西昌电力	399,286	3,561,631.12	0.18
156	600778	友好集团	364,700	3,537,590.00	0.18
157	002487	大金重工	398,200	3,524,070.00	0.18
158	600689	上海三毛	230,200	3,505,946.00	0.18
159	000813	天山纺织	286,000	3,486,340.00	0.18
160	300047	天源迪科	174,600	3,483,270.00	0.18
161	002329	皇氏集团	231,700	3,473,183.00	0.18
162	002531	天顺风能	540,260	3,463,066.60	0.18
163	000732	泰禾集团	177,900	3,458,376.00	0.18
164	002581	未名医药	126,900	3,458,025.00	0.18
165	600743	华远地产	730,970	3,457,488.10	0.18
166	600684	珠江实业	459,700	3,452,347.00	0.18
167	300063	天龙集团	115,800	3,448,524.00	0.18
168	601225	陕西煤业	667,000	3,448,390.00	0.18
169	300145	中金环境	157,325	3,442,271.00	0.18
170	600748	上实发展	356,200	3,433,768.00	0.18
171	600987	航民股份	277,900	3,368,148.00	0.17
172	000070	特发信息	127,200	3,335,184.00	0.17
173	002563	森马服饰	306,900	3,323,727.00	0.17
174	300258	精锻科技	205,626	3,322,916.16	0.17
175	000703	恒逸石化	333,700	3,293,619.00	0.17
176	600756	浪潮软件	109,400	3,292,940.00	0.17
177	601137	博威合金	243,719	3,268,271.79	0.17
178	600606	绿地控股	299,800	3,243,836.00	0.17
179	002319	乐通股份	187,700	3,243,456.00	0.17
180	002474	榕基软件	170,100	3,214,890.00	0.16
181	002627	宜昌交运	151,084	3,196,937.44	0.16
182	000690	宝新能源	470,500	3,189,990.00	0.16
183	600889	南京化纤	293,800	3,167,164.00	0.16



184	600481	双良节能	549,700	3,149,781.00	0.16
185	002365	永安药业	172,800	3,146,688.00	0.16
186	002124	天邦股份	292,220	3,112,143.00	0.16
187	600325	华发股份	280,300	3,102,921.00	0.16
188	600031	三一重工	612,700	3,075,754.00	0.16
189	002048	宁波华翔	134,000	3,064,580.00	0.16
190	600199	金种子酒	274,900	3,051,390.00	0.16
191	000548	湖南投资	393,000	3,049,680.00	0.16
192	002274	华昌化工	288,700	3,031,350.00	0.15
193	002093	国脉科技	243,800	3,025,558.00	0.15
194	000711	京蓝科技	135,400	3,005,880.00	0.15
195	002570	贝因美	233,800	2,990,302.00	0.15
196	600250	南纺股份	237,800	2,986,768.00	0.15
197	000673	当代东方	233,056	2,920,191.68	0.15
198	000409	山东地矿	284,400	2,898,036.00	0.15
199	000957	中通客车	63,504	2,883,081.60	0.15
200	600151	航天机电	254,800	2,879,240.00	0.15
201	002458	益生股份	64,887	2,842,699.47	0.14
202	002566	益盛药业	218,000	2,840,540.00	0.14
203	300160	秀强股份	219,800	2,828,826.00	0.14
204	000627	天茂集团	363,400	2,809,082.00	0.14
205	002236	大华股份	213,500	2,796,850.00	0.14
206	000088	盐田港	433,946	2,794,612.24	0.14
207	300324	旋极信息	129,900	2,787,654.00	0.14
208	002438	江苏神通	126,600	2,771,274.00	0.14
209	300167	迪威视讯	170,500	2,763,805.00	0.14
210	000020	深华发 A	126,900	2,756,268.00	0.14
211	300074	华平股份	227,400	2,728,800.00	0.14
212	600810	神马股份	363,900	2,718,333.00	0.14
213	300309	吉艾科技	204,500	2,715,760.00	0.14
214	002640	跨境通	154,000	2,713,480.00	0.14
215	000708	大冶特钢	241,400	2,703,680.00	0.14
216	600715	文投控股	141,000	2,702,970.00	0.14
217	300127	银河磁体	105,700	2,693,236.00	0.14
218	600962	国投中鲁	196,688	2,688,724.96	0.14
219	300354	东华测试	99,624	2,674,904.40	0.14
220	002435	长江润发	147,300	2,649,927.00	0.14
221	002079	苏州固锝	236,600	2,642,822.00	0.13
222	300048	合康变频	224,100	2,635,416.00	0.13
223	300053	欧比特	145,000	2,631,750.00	0.13
224	002545	东方铁塔	290,400	2,590,368.00	0.13
225	002300	太阳电缆	265,500	2,583,315.00	0.13
226	300131	英唐智控	218,600	2,581,666.00	0.13
227	601999	出版传媒	271,100	2,580,872.00	0.13
228	600979	广安爱众	433,829	2,559,591.10	0.13
229	002468	艾迪西	89,400	2,558,628.00	0.13
230	300215	电科院	197,700	2,546,376.00	0.13
231	000965	天保基建	429,500	2,542,640.00	0.13
232	300316	晶盛机电	194,000	2,541,400.00	0.13
233	002279	久其软件	114,300	2,535,174.00	0.13

234	601628	中国人寿	121,700	2,533,794.00	0.13
235	000980	金马股份	225,600	2,513,184.00	0.13
236	000748	长城信息	127,400	2,499,588.00	0.13
237	600816	安信信托	147,800	2,493,386.00	0.13
238	002368	太极股份	70,132	2,491,789.96	0.13
239	300136	信维通信	118,880	2,491,724.80	0.13
240	600239	云南城投	535,779	2,486,014.56	0.13
241	002401	中海科技	135,400	2,483,236.00	0.13
242	002040	南京港	171,100	2,482,661.00	0.13
243	600792	云煤能源	488,700	2,477,709.00	0.13
244	000903	云内动力	307,900	2,472,437.00	0.13
245	300042	朗科科技	72,500	2,471,525.00	0.13
246	300340	科恒股份	31,100	2,464,053.00	0.13
247	300072	三聚环保	89,100	2,462,724.00	0.13
248	000532	力合股份	135,479	2,460,298.64	0.13
249	002026	山东威达	195,200	2,453,664.00	0.13
250	600218	全柴动力	239,400	2,446,668.00	0.12
251	002369	卓翼科技	217,000	2,441,250.00	0.12
252	300037	新宙邦	37,400	2,438,106.00	0.12
253	600523	贵航股份	130,900	2,432,122.00	0.12
254	600992	贵绳股份	196,300	2,424,305.00	0.12
255	300279	和晶科技	51,000	2,421,990.00	0.12
256	600686	金龙汽车	164,400	2,421,612.00	0.12
257	002247	帝龙新材	161,900	2,407,453.00	0.12
258	002201	九鼎新材	168,400	2,396,332.00	0.12
259	600722	金牛化工	322,300	2,394,689.00	0.12
260	601601	中国太保	88,459	2,391,931.36	0.12
261	000948	南天信息	123,700	2,388,647.00	0.12
262	600761	安徽合力	236,300	2,384,267.00	0.12
263	300241	瑞丰光电	144,200	2,380,742.00	0.12
264	601798	蓝科高新	194,250	2,375,677.50	0.12
265	600082	海泰发展	410,200	2,375,058.00	0.12
266	002160	常铝股份	270,812	2,372,313.12	0.12
267	300096	易联众	129,300	2,371,362.00	0.12
268	300166	东方国信	86,100	2,365,167.00	0.12
269	600379	宝光股份	120,817	2,364,388.69	0.12
270	600131	岷江水电	231,700	2,363,340.00	0.12
271	002660	茂硕电源	156,200	2,353,934.00	0.12
272	600683	京投发展	254,517	2,351,737.08	0.12
273	000716	黑芝麻	347,200	2,347,072.00	0.12
274	600416	湘电股份	188,100	2,345,607.00	0.12
275	000586	汇源通信	106,610	2,345,420.00	0.12
276	300376	易事特	85,600	2,336,024.00	0.12
277	600302	标准股份	275,800	2,316,720.00	0.12
278	603008	喜临门	134,600	2,313,774.00	0.12
279	600558	大西洋	507,750	2,310,262.50	0.12
280	000650	仁和药业	282,900	2,308,464.00	0.12
281	600705	中航资本	391,000	2,299,080.00	0.12
282	601116	三江购物	197,444	2,298,248.16	0.12
283	002015	霞客环保	239,600	2,295,368.00	0.12

284	600973	宝胜股份	290,080	2,285,830.40	0.12
285	002386	天原集团	319,800	2,283,372.00	0.12
286	603018	设计股份	79,100	2,282,826.00	0.12
287	002232	启明信息	149,000	2,282,680.00	0.12
288	300214	日科化学	296,400	2,282,280.00	0.12
289	600858	银座股份	278,635	2,282,020.65	0.12
290	600237	铜峰电子	299,200	2,276,912.00	0.12
291	600178	东安动力	261,100	2,276,792.00	0.12
292	002315	焦点科技	33,700	2,273,402.00	0.12
293	002709	天赐材料	32,500	2,273,050.00	0.12
294	000554	泰山石油	264,200	2,272,120.00	0.12
295	000567	海德股份	71,600	2,266,140.00	0.12
296	000812	陕西金叶	232,877	2,265,893.21	0.12
297	600099	林海股份	191,500	2,253,955.00	0.11
298	600062	华润双鹤	123,600	2,251,992.00	0.11
299	000993	闽东电力	255,000	2,251,650.00	0.11
300	002534	杭锅股份	211,275	2,250,078.75	0.11
301	300017	网宿科技	33,400	2,244,480.00	0.11
302	600692	亚通股份	147,500	2,243,475.00	0.11
303	002074	国轩高科	56,800	2,241,896.00	0.11
304	002333	罗普斯金	230,150	2,241,661.00	0.11
305	600080	金花股份	191,500	2,240,550.00	0.11
306	601003	柳钢股份	574,300	2,239,770.00	0.11
307	002059	云南旅游	261,300	2,236,728.00	0.11
308	600615	丰华股份	124,800	2,232,672.00	0.11
309	002119	康强电子	109,100	2,232,186.00	0.11
310	002643	万润股份	43,700	2,223,456.00	0.11
311	600854	春兰股份	296,100	2,211,867.00	0.11
312	300132	青松股份	275,100	2,211,804.00	0.11
313	600969	郴电国际	148,200	2,209,662.00	0.11
314	002133	广宇集团	342,300	2,204,412.00	0.11
315	002208	合肥城建	113,300	2,200,286.00	0.11
316	002102	冠福股份	175,400	2,196,008.00	0.11
317	000949	新乡化纤	546,220	2,190,342.20	0.11
318	002597	金禾实业	162,000	2,182,140.00	0.11
319	600900	长江电力	174,700	2,182,003.00	0.11
320	600502	安徽水利	296,020	2,181,667.40	0.11
321	600976	健民集团	80,700	2,166,795.00	0.11
322	600233	大杨创世	111,300	2,165,898.00	0.11
323	000023	深天地 A	83,900	2,164,620.00	0.11
324	300052	中青宝	98,200	2,163,346.00	0.11
325	600433	冠豪高新	250,100	2,160,864.00	0.11
326	300103	达刚路机	115,400	2,157,980.00	0.11
327	600661	新南洋	76,700	2,152,202.00	0.11
328	000153	丰原药业	208,200	2,146,542.00	0.11
329	002606	大连电瓷	109,400	2,132,206.00	0.11
330	002071	长城影视	156,100	2,129,204.00	0.11
331	002020	京新药业	172,000	2,127,640.00	0.11
332	600461	洪城水业	163,379	2,120,659.42	0.11
333	601579	会稽山	149,600	2,115,344.00	0.11

334	300274	阳光电源	86,400	2,108,160.00	0.11
335	002655	共达电声	130,400	2,105,960.00	0.11
336	000597	东北制药	236,600	2,101,008.00	0.11
337	600211	西藏药业	47,300	2,098,228.00	0.11
338	600197	伊力特	139,200	2,093,568.00	0.11
339	300211	亿通科技	152,100	2,088,333.00	0.11
340	000715	中兴商业	144,604	2,086,635.72	0.11
341	002420	毅昌股份	239,800	2,086,260.00	0.11
342	600605	汇通能源	108,100	2,085,249.00	0.11
343	300158	振东制药	129,100	2,084,965.00	0.11
344	603368	柳州医药	24,000	2,083,680.00	0.11
345	002083	孚日股份	330,600	2,082,780.00	0.11
346	000756	新华制药	193,700	2,078,401.00	0.11
347	600529	山东药玻	117,800	2,074,458.00	0.11
348	300331	苏大维格	72,700	2,072,677.00	0.11
349	600295	鄂尔多斯	262,500	2,071,125.00	0.11
350	300327	中颖电子	38,700	2,067,741.00	0.11
351	600757	长江传媒	246,400	2,067,296.00	0.11
352	603333	明星电缆	278,369	2,065,497.98	0.11
353	600476	湘邮科技	73,202	2,063,564.38	0.11
354	600897	厦门空港	98,400	2,062,464.00	0.11
355	002144	宏达高科	104,300	2,050,538.00	0.10
356	600097	开创国际	133,767	2,047,972.77	0.10
357	600298	安琪酵母	114,500	2,042,680.00	0.10
358	300192	科斯伍德	160,400	2,041,892.00	0.10
359	600075	新疆天业	175,600	2,021,156.00	0.10
360	000411	英特集团	109,200	2,019,108.00	0.10
361	600613	神奇制药	140,800	2,013,440.00	0.10
362	603300	华铁科技	140,500	2,011,960.00	0.10
363	000661	长春高新	18,800	2,005,584.00	0.10
364	002633	申科股份	89,200	2,000,756.00	0.10
365	002396	星网锐捷	101,400	1,997,580.00	0.10
366	300275	梅安森	88,000	1,996,720.00	0.10
367	600742	一汽富维	159,600	1,993,404.00	0.10
368	300219	鸿利光电	127,600	1,988,008.00	0.10
369	600971	恒源煤电	359,600	1,984,992.00	0.10
370	000710	天兴仪表	89,400	1,977,528.00	0.10
371	300321	同大股份	59,500	1,974,805.00	0.10
372	000759	中百集团	285,119	1,970,172.29	0.10
373	002385	大北农	241,800	1,948,908.00	0.10
374	002634	棒杰股份	183,800	1,946,442.00	0.10
375	000890	法尔胜	183,000	1,937,970.00	0.10
376	600616	金枫酒业	189,600	1,937,712.00	0.10
377	600687	刚泰控股	119,100	1,936,566.00	0.10
378	002132	恒星科技	439,950	1,935,780.00	0.10
379	300471	厚普股份	40,300	1,927,952.00	0.10
380	600167	联美控股	116,800	1,916,688.00	0.10
381	601368	绿城水务	145,400	1,912,010.00	0.10
382	002270	法因数控	117,700	1,911,448.00	0.10
383	600681	百川能源	176,100	1,908,924.00	0.10

384	002629	仁智油服	157,400	1,907,688.00	0.10
385	000488	晨鸣纸业	240,100	1,906,394.00	0.10
386	600148	长春一东	86,500	1,905,595.00	0.10
387	300207	欣旺达	73,900	1,897,013.00	0.10
388	600787	中储股份	255,200	1,896,136.00	0.10
389	300021	大禹节水	99,800	1,880,232.00	0.10
390	600617	国新能源	163,800	1,877,148.00	0.10
391	000789	万年青	303,500	1,875,630.00	0.10
392	300133	华策影视	119,900	1,866,843.00	0.10
393	002661	克明面业	112,200	1,841,202.00	0.09
394	603567	珍宝岛	83,800	1,831,030.00	0.09
395	002196	方正电机	53,100	1,815,489.00	0.09
396	600186	莲花健康	340,300	1,806,993.00	0.09
397	603698	航天工程	65,800	1,805,552.00	0.09
398	600273	嘉化能源	198,800	1,771,308.00	0.09
399	002076	雪莱特	101,100	1,688,370.00	0.09
400	600243	青海华鼎	156,600	1,597,320.00	0.08
401	600966	博汇纸业	489,000	1,589,250.00	0.08
402	600814	杭州解百	144,800	1,533,432.00	0.08
403	600459	贵研铂业	51,100	1,526,868.00	0.08
404	000686	东北证券	117,100	1,511,761.00	0.08
405	000712	锦龙股份	72,500	1,505,100.00	0.08
406	002392	北京利尔	298,300	1,473,602.00	0.08
407	002576	通达动力	76,600	1,442,378.00	0.07
408	002151	北斗星通	41,900	1,410,354.00	0.07
409	000632	三木集团	164,600	1,407,330.00	0.07
410	600643	爱建集团	140,500	1,372,685.00	0.07
411	002648	卫星石化	150,700	1,362,328.00	0.07
412	300065	海兰信	34,600	1,338,328.00	0.07
413	000950	*ST 建峰	179,000	1,333,550.00	0.07
414	002478	常宝股份	118,000	1,326,320.00	0.07
415	600747	大连控股	302,350	1,321,269.50	0.07
416	601139	深圳燃气	163,695	1,309,560.00	0.07
417	600291	西水股份	65,300	1,297,511.00	0.07
418	000401	冀东水泥	122,000	1,293,200.00	0.07
419	600569	安阳钢铁	501,194	1,293,080.52	0.07
420	601890	亚星锚链	141,900	1,289,871.00	0.07
421	300123	太阳鸟	91,300	1,281,852.00	0.07
422	002025	航天电器	51,500	1,271,535.00	0.06
423	600677	XD 航天通	68,700	1,267,515.00	0.06
424	000836	鑫茂科技	204,600	1,264,428.00	0.06
425	600706	曲江文旅	70,700	1,264,116.00	0.06
426	000656	金科股份	330,000	1,260,600.00	0.06
427	600072	钢构工程	90,100	1,253,291.00	0.06
428	600769	祥龙电业	139,100	1,242,163.00	0.06
429	000937	冀中能源	231,423	1,231,170.36	0.06
430	000333	美的集团	51,050	1,210,906.00	0.06
431	002702	海欣食品	58,700	1,191,023.00	0.06
432	601633	长城汽车	137,300	1,158,812.00	0.06
433	300287	飞利信	85,000	1,139,000.00	0.06

434	600961	株冶集团	111,000	1,131,090.00	0.06
435	300130	新国都	36,600	1,130,940.00	0.06
436	002149	西部材料	35,400	1,128,552.00	0.06
437	600850	华东电脑	37,700	1,081,613.00	0.06
438	002159	三特索道	42,300	1,073,997.00	0.05
439	600980	北矿科技	37,000	1,069,300.00	0.05
440	002242	九阳股份	58,700	1,067,166.00	0.05
441	002668	奥马电器	17,458	1,062,668.46	0.05
442	002308	威创股份	63,900	1,049,877.00	0.05
443	600623	华谊集团	52,900	1,047,949.00	0.05
444	600345	长江通信	49,100	1,037,483.00	0.05
445	002296	辉煌科技	55,900	1,014,585.00	0.05
446	600982	宁波热电	191,013	1,004,728.38	0.05
447	002017	东信和平	69,700	1,003,680.00	0.05
448	600119	长江投资	64,400	978,236.00	0.05
449	000613	大东海 A	70,300	976,467.00	0.05
450	600399	抚顺特钢	150,500	973,735.00	0.05
451	600501	航天晨光	52,700	969,680.00	0.05
452	600281	太化股份	156,000	967,200.00	0.05
453	600470	六国化工	127,800	959,778.00	0.05
454	000507	珠海港	173,027	948,187.96	0.05
455	000561	烽火电子	84,800	942,976.00	0.05
456	600727	鲁北化工	103,700	941,596.00	0.05
457	000737	南风化工	174,200	940,680.00	0.05
458	000695	滨海能源	58,900	935,921.00	0.05
459	601007	金陵饭店	74,400	932,232.00	0.05
460	000978	桂林旅游	88,500	930,135.00	0.05
461	600126	杭钢股份	154,400	926,400.00	0.05
462	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.04
463	002495	佳隆股份	95,600	726,560.00	0.04
464	600808	马钢股份	296,000	713,360.00	0.04
465	600381	ST 春天	51,600	706,404.00	0.04
466	600307	酒钢宏兴	287,700	704,865.00	0.04
467	600058	五矿发展	36,900	692,613.00	0.04
468	002142	宁波银行	45,900	678,402.00	0.03
469	601009	南京银行	71,800	674,202.00	0.03
470	600176	中国巨石	66,524	636,634.68	0.03
471	300363	博腾股份	25,100	622,982.00	0.03
472	002233	塔牌集团	75,200	603,856.00	0.03
473	002741	光华科技	22,800	580,716.00	0.03
474	600068	XD 葛洲坝	94,500	549,990.00	0.03
475	600986	科达股份	33,900	541,722.00	0.03
476	600189	吉林森工	47,400	537,042.00	0.03
477	600820	隧道股份	63,800	535,282.00	0.03
478	002081	金螳螂	52,100	522,042.00	0.03
479	600573	惠泉啤酒	38,100	505,968.00	0.03
480	600695	绿庭投资	60,100	505,441.00	0.03
481	600723	首商股份	56,500	504,545.00	0.03
482	000785	武汉中商	43,200	481,680.00	0.02
483	000557	西部创业	88,700	465,675.00	0.02

484	300446	乐凯新材	9,400	462,480.00	0.02
485	000835	长城动漫	33,800	446,836.00	0.02
486	002231	奥维通信	28,600	442,156.00	0.02
487	600318	新力金融	16,400	440,176.00	0.02
488	002593	日上集团	55,900	425,958.00	0.02
489	002745	木林森	12,400	421,476.00	0.02
490	000822	山东海化	83,100	421,317.00	0.02
491	300081	恒信移动	24,600	418,200.00	0.02
492	300395	菲利华	15,200	407,056.00	0.02
493	002536	西泵股份	26,500	399,885.00	0.02
494	603227	雪峰科技	20,800	399,360.00	0.02
495	300264	佳创视讯	30,200	395,922.00	0.02
496	002541	鸿路钢构	22,679	390,759.17	0.02
497	002516	旷达科技	62,700	378,081.00	0.02
498	002578	闽发铝业	39,800	375,314.00	0.02
499	603328	依顿电子	12,700	375,158.00	0.02
500	601012	隆基股份	25,300	330,165.00	0.02
501	300394	天孚通信	8,000	326,480.00	0.02
502	000546	金圆股份	30,600	322,524.00	0.02
503	002671	龙泉股份	25,600	316,160.00	0.02
504	600720	祁连山	46,101	309,337.71	0.02
505	300165	天瑞仪器	28,300	306,489.00	0.02
506	600651	飞乐音响	24,200	306,372.00	0.02
507	000547	航天发展	19,900	305,664.00	0.02
508	600585	海螺水泥	20,700	300,978.00	0.02
509	000672	上峰水泥	50,400	298,368.00	0.02
510	600825	新华传媒	37,500	298,125.00	0.02
511	300107	建新股份	46,400	297,888.00	0.02
512	000877	天山股份	48,200	297,876.00	0.02
513	300129	泰胜风能	42,488	297,416.00	0.02
514	002328	新朋股份	29,600	295,408.00	0.02
515	601369	陕鼓动力	45,900	292,842.00	0.01
516	002619	巨龙管业	20,700	292,491.00	0.01
517	002187	广百股份	23,700	291,984.00	0.01
518	601117	中国化学	52,700	291,431.00	0.01
519	002607	亚夏汽车	25,359	291,374.91	0.01
520	000529	广弘控股	35,600	291,208.00	0.01
521	600708	光明地产	34,700	291,133.00	0.01
522	600500	中化国际	32,200	291,088.00	0.01
523	600665	天地源	59,900	290,515.00	0.01
524	600449	宁夏建材	32,200	290,444.00	0.01
525	600550	保变电气	49,300	290,377.00	0.01
526	000419	通程控股	39,800	289,744.00	0.01
527	601008	连云港	60,800	288,192.00	0.01
528	002596	海南瑞泽	10,100	287,345.00	0.01
529	600780	通宝能源	57,200	287,144.00	0.01
530	600774	汉商集团	15,800	286,928.00	0.01
531	300437	清水源	10,500	286,755.00	0.01
532	600190	锦州港	70,700	286,335.00	0.01
533	600187	国中水务	64,200	286,332.00	0.01

534	601991	大唐发电	73,300	285,137.00	0.01
535	600426	华鲁恒升	32,240	284,034.40	0.01
536	600883	博闻科技	19,500	282,945.00	0.01
537	600317	营口港	84,200	282,912.00	0.01
538	000027	深圳能源	44,200	281,996.00	0.01
539	600162	香江控股	66,750	279,682.50	0.01
540	000767	漳泽电力	77,100	279,102.00	0.01
541	600425	青松建化	65,500	278,375.00	0.01
542	002260	德奥通航	10,700	277,665.00	0.01
543	000539	粤电力 A	55,300	277,606.00	0.01
544	600055	华润万东	15,680	275,340.80	0.01
545	600812	华北制药	44,300	275,103.00	0.01
546	601898	中煤能源	53,270	274,873.20	0.01
547	600794	保税科技	51,000	273,870.00	0.01
548	300173	智慧松德	16,600	269,750.00	0.01
549	600881	亚泰集团	55,300	266,546.00	0.01
550	000722	湖南发展	19,100	264,153.00	0.01
551	600604	市北高新	10,900	261,600.00	0.01
552	600802	福建水泥	32,559	260,472.00	0.01
553	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
554	300329	海伦钢琴	12,900	257,871.00	0.01
555	600678	四川金顶	20,600	248,642.00	0.01
556	600801	华新水泥	38,800	244,828.00	0.01
557	000885	同力水泥	19,100	244,671.00	0.01
558	600240	华业资本	24,400	244,488.00	0.01
559	002599	盛通股份	6,700	239,994.00	0.01
560	600487	亨通光电	18,200	228,956.00	0.01
561	600688	上海石化	37,200	226,920.00	0.01
562	600824	益民集团	38,000	226,860.00	0.01
563	600970	中材国际	33,450	210,735.00	0.01
564	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
565	300292	吴通控股	6,003	199,659.78	0.01
566	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
567	600475	华光股份	12,600	187,110.00	0.01
568	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
569	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
570	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
571	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
572	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
573	601989	中国重工	4,600	29,118.00	0.00
574	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
575	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
576	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
577	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
578	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
579	300142	沃森生物	19	212.04	0.00



## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	64,485,497.44	2.71
2	000544	中原环保	54,324,430.94	2.28
3	600686	金龙汽车	52,876,346.74	2.22
4	600743	XR 华远地	52,793,527.98	2.22
5	601601	中国太保	48,850,845.90	2.05
6	600000	浦发银行	46,891,248.60	1.97
7	600973	宝胜股份	42,799,342.54	1.80
8	600683	京投发展	40,169,278.64	1.69
9	601390	中国中铁	40,159,218.75	1.69
10	000969	安泰科技	39,728,943.92	1.67
11	600483	福能股份	39,139,220.90	1.64
12	601186	中国铁建	37,127,311.75	1.56
13	002160	常铝股份	37,114,392.25	1.56
14	600658	电子城	36,722,494.23	1.54
15	601668	中国建筑	36,550,846.54	1.53
16	000957	中通客车	36,432,094.55	1.53
17	600409	三友化工	36,123,087.66	1.52
18	601101	昊华能源	34,750,905.56	1.46
19	601166	兴业银行	34,519,864.62	1.45
20	002302	西部建设	33,076,913.97	1.39

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	601318	中国平安	76,486,788.21	3.21
2	000544	中原环保	67,751,230.36	2.84
3	601601	中国太保	67,561,040.12	2.84
4	600743	XR 华远地	61,557,553.22	2.58
5	600686	金龙汽车	60,665,283.00	2.55
6	002160	常铝股份	47,961,147.20	2.01
7	600973	宝胜股份	44,133,061.07	1.85
8	600483	福能股份	43,919,015.24	1.84
9	601788	光大证券	42,442,200.82	1.78
10	600000	浦发银行	41,946,099.76	1.76
11	000969	安泰科技	41,884,363.68	1.76
12	000957	中通客车	41,085,215.88	1.73
13	600683	京投发展	37,438,872.09	1.57
14	601166	兴业银行	37,178,174.11	1.56
15	601101	昊华能源	36,652,410.78	1.54
16	300214	日科化学	36,530,724.66	1.53
17	601009	南京银行	35,652,042.06	1.50

18	601818	光大银行	34,746,112.00	1.46
19	600016	民生银行	34,570,599.89	1.45
20	601668	中国建筑	34,360,742.25	1.44

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	8,986,669,190.45
卖出股票的收入（成交）总额	9,032,687,090.23

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	939,697.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	939,697.00	0.05

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110035	白云转债	3,760	445,597.60	0.02
2	113010	江南转债	2,810	326,831.10	0.02
3	113009	广汽转债	1,410	167,268.30	0.01

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金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 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 本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1609	IC1609	38.00	44,613,520.00	3,149,440.00	-
IF1609	IF1609	23.00	21,000,840.00	425,520.00	-

IC1612	IC1612	10.00	11,312,400.00	504,280.00	-
公允价值变动总额合计(元)					4,079,240.00
股指期货投资本期收益(元)					-5,212,520.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,822,280.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标

### 7.11 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 报告期末投资组合报告附注

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 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	16,375,714.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	70,302.99
5	应收申购款	74,329.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,520,346.76

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
40,625	64,568.23	215,644,080.08	8.22%	2,407,440,092.55	91.78%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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开放式基金	1,291,010.92	0.05%

### 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	50~100
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；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月20日)基金份额总额	3,218,168,319.04
本报告期期初基金份额总额	2,704,927,332.22
本报告期基金总申购份额	84,335,253.81
减：本报告期基金总赎回份额	166,178,413.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,623,084,172.63

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人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	
东吴证券	1	68,796.00	0.00%	64.07	0.00%	新增 1 个
长江证券	1	317,291,075.91	1.76%	295,539.20	1.84%	新增 1 个
恒泰证券	1	482,408,375.20	2.68%	352,794.89	2.20%	
国联证券	1	528,807,052.83	2.93%	386,720.41	2.41%	新增 1 个
中信证券	2	547,485,779.15	3.04%	400,390.21	2.49%	新增 1 个
英大证券	1	567,774,179.19	3.15%	415,216.96	2.59%	
国金证券	1	584,743,870.33	3.25%	544,570.74	3.39%	
中金公司	1	720,242,637.03	4.00%	670,740.66	4.18%	
安信证券	1	1,041,566,125.05	5.78%	970,013.12	6.04%	新增 1 个
国信证券	1	1,213,670,922.88	6.74%	1,130,301.44	7.04%	
首创证券	1	1,505,079,863.60	8.35%	1,100,686.38	6.86%	
光大证券	1	2,133,813,606.78	11.84%	1,987,238.83	12.38%	
招商证券	2	2,588,315,563.38	14.37%	2,410,481.21	15.02%	新增 1 个
华泰证券	3	2,693,181,377.89	14.95%	2,508,189.67	15.62%	新增 1 个
广发证券	2	3,093,043,187.15	17.17%	2,880,576.65	17.94%	
宏信证券	1					
宏源证券	1					
华西证券	1					
平安证券	1					
齐鲁证券	1					
申银万国	1					
西部证券	1					
银河证券	1					
长城证券	1					新增 1 个
中信建设	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，我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服务；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。

## 10.8 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	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-20
2	关于博时旗下部分开放式基金增加厦门银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-21
3	关于博时旗下部分开放式基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-22
4	关于博时旗下部分开放式基金增加海银基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-25
5	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2015 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
6	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2015 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
7	关于博时旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-28
8	关于博时旗下部分开放式基金增加北京葱次方资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-29
9	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳市金斧子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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-30
10	关于博时旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-01
11	关于博时旗下部分开放式基金增加北京懒猫金融信息服务有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-20
12	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-22
13	关于博时旗下部分开放式基金增加德州银行股份有限公司为代销机构并参加其申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-27
14	关于博时旗下部分开放式基金增加大连网金金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-06
15	关于博时旗下部分基金参加厦门银行股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-10
16	关于博时旗下部分开放式基金增加珠海盈米	中国证券报、上海证券报、证	2016-05-26

	财富管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	券时报	
17	关于博时旗下部分开放式基金增加新增乾道金融信息服务(北京)有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-27
18	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-06
19	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金的申购、定投、最低持有数量限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-08
20	博时基金管理有限公司关于博时国企改革主题股票型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-13
21	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-16
22	关于博时旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-24
23	关于博时旗下部分基金继续参加交通银行网上及手机银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-30

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会批准博时产业新动力混合型证券投资基金募集的文件
- 11.1.2 《博时国企改革主题股票型证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时国企改革主题股票型证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 11.1.5 博时国企改革主题股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 11.1.6 报告期内博时国企改革主题股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 11.3 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  
二〇一六年八月二十五日