

# 博时平衡配置混合型证券投资基金

## 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>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
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	4
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>	<b>5</b>
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>	<b>6</b>
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	9
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	9
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	29
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	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	33
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	33
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五名贵金属投资明细	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	33
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	33
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	34
7.12 投资组合报告附注	34
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	<b>34</b>
8.1 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	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	35
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	35
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b>	<b>35</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b>	<b>35</b>
10.1 基金份额持有人大会决议	35

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 .....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	35
10.4 基金投资策略的改变 .....	35
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	35
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 .....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	36
10.8 其他重大事件 .....	39
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>40</b>
11.1 备查文件目录 .....	40
11.2 存放地点 .....	40
11.3 查阅方式 .....	40

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时平衡配置混合型证券投资基金
基金简称	博时平衡配置混合
基金主代码	050007
交易代码	050007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 5 月 31 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	696,616,576.96 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报。
投资策略	本基金遵循经济周期性波动规律，通过定性与定量分析，动态把握不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置。在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期持续稳定增长。
业绩比较基准	45%×富时中国 A600 指数+50%×中国债券总指数+5%×同业存款利息率
风险收益特征	本基金的预期风险低于股票基金，预期收益高于债券基金。本基金属于证券投资基金中的中等风险、中等收益品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	洪渊
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
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	-87,976,150.05
本期利润	-89,891,917.90
加权平均基金份额本期利润	-0.1282
本期加权平均净值利润率	-14.69%
本期基金份额净值增长率	-12.46%
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	-80,682,177.12
期末可供分配基金份额利润	-0.1158
期末基金资产净值	615,934,399.84
期末基金份额净值	0.884
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	156.49%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

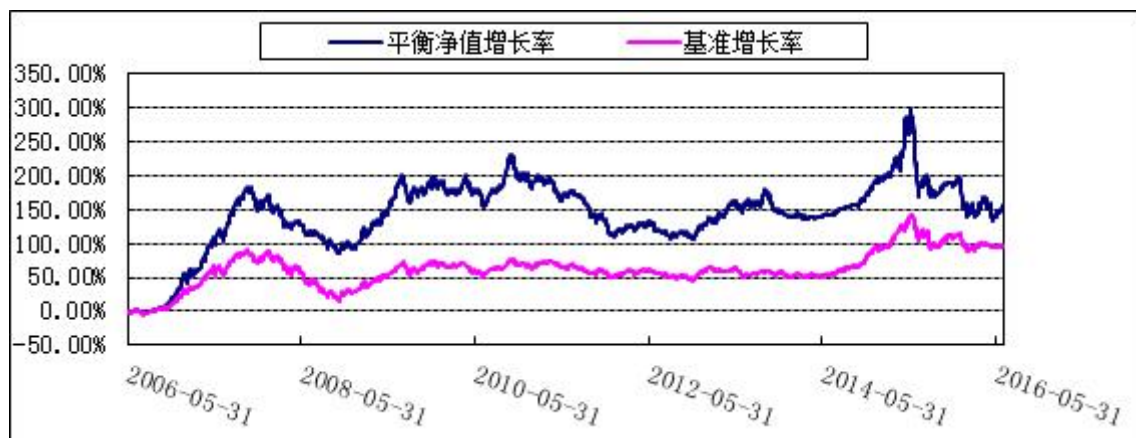
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.49%	0.87%	0.11%	0.48%	4.38%	0.39%
过去三个月	-1.45%	1.23%	-1.14%	0.51%	-0.31%	0.72%
过去六个月	-12.46%	1.72%	-7.57%	0.88%	-4.89%	0.84%
过去一年	-19.47%	1.49%	-11.91%	1.05%	-7.56%	0.44%
过去三年	2.62%	1.20%	30.07%	0.82%	-27.45%	0.38%
自基金合同生效起至今	156.49%	1.09%	97.50%	0.87%	58.99%	0.22%

注：本基金的业绩比较基准为：45%×富时中国 A600 指数+50%×中国债券总指数+5%×同业存款息率。

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 45%、50%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



## § 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		
魏凤春	宏观策略部总经理/基金经理	2015-11-30	-	8.8	1993 年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，曾任投资经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理、博时抗通胀增强回报（QDII-FOF）基金、博时平衡配置混合基金的基金经理。
张李陵	基金经理	2015-07-16	-	4	2006 年起先后在招商银行、融通基金工作。2014 年加入博时基金管理有限公司，历任投资经理、投资经理兼基金经理助理。现任博时稳定价值债券基金、博时平衡配置混合基金、博时信用债纯债债券基金的基金经理。
刘思甸	基金经理	2016-04-20	-	6	2010 年从北京大学博士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、宏观研究员、高级宏观分析师、投资经理助理、投资经理。现任博时平衡配置混合型证券投资基金的基金经理。
陈雷	基金经理	2015-02-13	2016-04-20	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。
鲁旭	资深宏观分析师兼基金经理助理	2015-08-24	-	4	2012 年 7 月加入博时基金管理有限公司，现任宏观策略部资深宏观分析师兼基金经理助理。
余军	投资经理	2015-08-24	2016-05-26	5	2011 年起在博时基金博士后工作站工作。2013 年 7 月加入博时基金管理有限公司，现任宏观策略部投资经理。

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遵规守信情况的说明

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

### 4.3 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

在第一季度，本基金因为年初保持相对较低仓位，规避计算机和传媒行业，在市场反弹中风格和仓位保持相对较佳，表现尚可。但总的来看，对熔断没有研究、汇率动向跟踪不够及时，以及组合风控不够完善，年初本可以更早、更坚决的降低仓位。这部分暴露出来的问题，是在未来的投资中必须避免的。

但到 2016 年第二季度，业绩表现不佳。对监管政策的变化敏感性低，对产业上的新变化敏感性低，以及对此前运作较为成功的、市场策略指导下的量化投资方式了解不够深刻、过于仓促付诸实践，最终致使业绩在 4 月 20 日到 5 月 18 日之间出现明显下滑，并导致半年业绩较第一季度明显下滑。

在 5 月中旬之后，针对上述问题，本基金的策略做了调整。量化选股部分注重在新监管态势下股票更加重视质量的特点，并且跳过行业选择，避免了选择行业逻辑和量化选择个股逻辑不一致的问题；在基于产业跟踪的主题投资中花的时间、仓位也是大幅增加。

总体股票仓位在这段时间基本恒定。主要考虑到市场对诸多看起来是利好和看起来是利空的因素并未明显跟随，在策略上唯一较为稳定的趋势就是并购溢价的不断下降，但这是市场结构上的变化，而非市场重心的变化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.884 元，份额累计净值为 2.341 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-12.46%，同期业绩基准增长率-7.57%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就市场本身的行为而言，A 股当前对看起来是利多、利空的消息都比较钝化。持续盘整的市场，伴随总体并非高昂的士气、公募基金新发行市场几乎枯竭的状态，在市场总体估值较低的时候，往往是筑历史大底的特征。只是 A 股、尤其是中小创的总体估值仍然处于不可持续的状态，只是说用时间还是用持续的下跌消化而已，这样的过程并未结束。直到现在，

创业板指的换手率与去年年中和年底相比，并没有明显下降。

对于看多的参与者而言，市场在出现利空时并未下跌，这就是上涨的理由。我们认为这种偏技术层面的理解，对把握短期市场趋势有一定帮助，但在季度的层面存在风险。有些时候上涨是上涨的理由，有些时候不是；区别在于上涨是否通过提高市场的关注度来发现本已存在的、支持市场估值上移的信息和理解——正如后面宏观的展望所展示的，这并非当前市场的现状。

总体来讲，未来一段时间的投资，在市场趋势尚可的时候，本基金保持较为中性的仓位，等待合适的时间减仓，规避可能会到来的市场风险。在个股选择上重视中短期业绩预期的提升，拿出一定的仓位参与主题投资。

不管未来 A 股对一些因素的反映是否依然迟钝，对“传统”的宏观策略所关心的问题，本基金的看法如下：

#### 一、短期

1. 经济增长在第三季度大概率不会低于市场的预期
2. 以 CPI 价格指数为指标的通胀率在第三季度开始大概率会重回上升
3. 在宣称人民币汇率基本稳定的同时，人民币兑一篮子汇率下行的趋势若以今年前六个月贬值 5% 的速度继续，市场预期的再次混乱恐难以避免；当前人民币汇率管理的色彩仍然居于主导
4. 货币信贷会维持上半年的扩张力度，但财政的宽松程度已经接近政府能接受的上限，直接形式的财政支出扩张或者收入缩减，空间已经极小
5. 去产能政策会得到较好的执行；广义方面基础设施投资 PPP 模式必须获得成功，在这方面已无退路可言；即便地产销量下行，房地产总量政策几乎没有宽松的可能。政府在转型方面的主要精力，仍然在推动的新产业发展、培育经济发展新动力，尤其是科技方面；生态、环保方面投入只会更多

#### 二、中期

1. 债务。结合法律、监管的变化，结合行政力量的适当使用，结合创新经济的健康发展，中国的债务问题是可以解决的。从更长期看，一个经济的债务耐受率，与经济的波动性、产权保护的严格程度、债务处置是否便利、征信和信用基础设施是否健全、风险管理市场是否完备甚至于整个社会的凝聚力密切相关，一个对中国的未来保持乐观态度的投资者应该预期债务比 GDP 比例会更高、预期股权融资比 GDP 比例会更高。

2. 增长和中等收入陷阱。实践证明，任何一个国家超过五年的经济增长预测都是非常困

难的，相比之下，长期的通胀预测会容易的多。对中国而言，唯一能讲的是当前人均 GDP 按照购买力平价计算不到美国的 1/4，这是潜力。潜力不代表能达到。中等收入陷阱的理论认为到某一个收入水平，国家容易陷入增长停滞。事实是在任何一个收入水平，国家陷入增长停滞的概率都是一样的。路是走出来的，任何一个阶段经济都会有自己的问题，脚踏实地解决好就行。与中等收入陷阱相关的说法，是转型期经济增长会出现明显下滑。我的看法，一是经济在任何时期都在转型，那些让人眷恋的黄金时代，实际上也伴随着剧烈的变化，二是讲经济转型时期的增长下滑的历史，等同于讲某些国家经济增长低谷时的状态，这些历史都并非必然。任何低谷都有它经济结构上的变化，同样，任何繁荣期都有它结构上的变化。一句话，只有顺利和不顺利的转型，没有转型期和非转型期。国家和公司一样，要过的好，就得永远为创新而折腾。

#### 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

本基金报告期内共进行 1 次分红，以 2015 年 12 月 31 日可分配利润为基准，每 10 份分红 0.21 元。

#### 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平衡配置混合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，博时平衡配置混合型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时平衡配置混合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。本报告期内，博时平衡配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 14,592,947.58 元。

#### 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平衡配置混合型证券投资基金 2016 上半年报告中财务指标、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：博时平衡配置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	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	106,975,127.09	33,205,830.30
结算备付金		6,125,747.74	-
存出保证金		652,631.83	548,778.73
交易性金融资产	6.4.3.2	522,942,453.31	675,932,400.63
其中：股票投资		334,977,952.91	408,683,121.13
基金投资		-	-
债券投资		187,964,500.40	267,249,279.50

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	-	-
应收证券清算款		-	8,231,769.88
应收利息	6.4.3.5	4,856,656.25	5,904,452.51
应收股利		-	-
应收申购款		57,489.19	54,074.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>641,610,105.41</b>	<b>723,877,306.54</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		18,413,156.76	-
应付赎回款		1,118,527.82	1,061,235.72
应付管理人报酬		739,964.50	922,962.18
应付托管费		123,327.41	153,827.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	4,729,609.67	853,244.66
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	551,119.41	450,602.71
<b>负债合计</b>		<b>25,675,705.57</b>	<b>3,441,872.28</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.3.9	696,616,576.96	696,684,845.29
未分配利润	6.4.3.10	-80,682,177.12	23,750,588.97
<b>所有者权益合计</b>		<b>615,934,399.84</b>	<b>720,435,434.26</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>641,610,105.41</b>	<b>723,877,306.54</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.884 元，基金份额总额 696,616,576.96 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时平衡配置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	附注号	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
<b>一、收入</b>		<b>-77,083,892.73</b>	<b>209,589,579.73</b>
1. 利息收入		6,174,422.65	15,000,447.07
其中：存款利息收入	6.4.3.11	383,012.94	442,543.14
债券利息收入		5,786,307.49	14,297,834.96
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		5,102.22	260,068.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-81,351,734.49	338,676,495.05
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-88,318,989.12	331,662,943.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	4,565,105.43	5,621,378.52
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	-	-
股利收益	6.4.3.15	2,402,149.20	1,392,173.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-1,915,767.85	-144,212,645.42
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	9,186.96	125,283.03
<b>减：二、费用</b>		<b>12,808,025.17</b>	<b>17,842,383.91</b>
1. 管理人报酬		4,565,739.54	9,789,978.93
2. 托管费		760,956.54	1,631,663.21
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	7,260,040.61	6,189,412.77
5. 利息支出		1,904.44	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,904.44	-
6. 其他费用	6.4.3.19	219,384.04	231,329.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-89,891,917.90</b>	<b>191,747,195.82</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-89,891,917.90</b>	<b>191,747,195.82</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时平衡配置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）	696,684,845.29	23,750,588.97	720,435,434.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-89,891,917.90	-89,891,917.90
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）	-68,268.33	52,099.39	-16,168.94
其中：1. 基金申购款	28,003,482.03	-3,319,558.92	24,683,923.11
2. 基金赎回款	-28,071,750.36	3,371,658.31	-24,700,092.05
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）	-	-14,592,947.58	-14,592,947.58
五、期末所有者权益（基	696,616,576.96	-80,682,177.12	615,934,399.84

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
金净值)			
一、期初所有者权益（基金净值）	1,420,365,155.29	48,847,364.71	1,469,212,520.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	191,747,195.82	191,747,195.82
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）	-632,778,070.56	-113,847,505.25	-746,625,575.81
其中：1. 基金申购款	69,442,093.58	10,580,125.73	80,022,219.31
2. 基金赎回款	-702,220,164.14	-124,427,630.98	-826,647,795.12
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）	-	-29,189,471.59	-29,189,471.59
五、期末所有者权益（基金净值）	787,587,084.73	97,557,583.69	885,144,668.42

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 主管会计工作的负责人：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：

(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，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 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	106,975,127.09
定期存款	-
其他存款	-
合计	106,975,127.09

##### 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	319,084,479.68	334,977,952.91	15,893,473.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	68,702,817.10	69,678,500.40
	银行间市场	114,725,400.87	118,286,000.00
	合计	183,428,217.97	187,964,500.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	502,512,697.65	522,942,453.31	20,429,755.66

##### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

##### 6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

##### 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	17,010.11
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	2,756.50
应收债券利息	4,836,596.04
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	293.60
合计	4,856,656.25

#### 6.4.3.6 其他资产

无余额。

#### 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	4,729,159.67
银行间市场应付交易费用	450.00
合计	4,729,609.67

#### 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	250,000.00
应付赎回费	2,215.25
其他应付款	-
预提费用	298,904.16
合计	551,119.41

#### 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	696,684,845.29	696,684,845.29
本期申购	28,003,482.03	28,003,482.03
本期赎回(以“-”号填列)	-28,071,750.36	-28,071,750.36
本期末	696,616,576.96	696,616,576.96

注：申购含转换入份额；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	103,871,467.45	-80,120,878.48	23,750,588.97
本期利润	-87,976,150.05	-1,915,767.85	-89,891,917.90

本期基金份额交易产生的变动数	501,825.84	-449,726.45	52,099.39
其中：基金申购款	993,015.75	-4,312,574.67	-3,319,558.92
基金赎回款	-491,189.91	3,862,848.22	3,371,658.31
本期已分配利润	-14,592,947.58	-	-14,592,947.58
本期末	1,804,195.66	-82,486,372.78	-80,682,177.12

#### 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		345,216.76
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		33,603.23
其他		4,192.95
合计		383,012.94

#### 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		2,444,461,507.06
减：卖出股票成本总额		2,532,780,496.18
买卖股票差价收入		-88,318,989.12

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额		131,990,645.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额		121,899,437.47
减：应收利息总额		5,526,102.17
买卖债券差价收入		4,565,105.43

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 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		2,402,149.20
基金投资产生的股利收益		-
合计		2,402,149.20

**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	-1,915,767.85
——股票投资	5,124,673.78
——债券投资	-7,040,441.63
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,915,767.85

**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	6,550.94
转换费收入	2,636.02
合计	9,186.96

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**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	7,258,990.61
银行间市场交易费用	1,050.00
合计	7,260,040.61

**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
银行汇划费	1,879.88
银行间帐户维护费	9,000.00
上清所帐户维护费	9,600.00
合计	219,384.04

#### 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、基金注册登记机构、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、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。

#### 6.4.6 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

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	
	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	984,705,594.19	20.10%	-	-

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

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	917,058.09	20.94%	1,003,644.86	21.22%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1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	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
当期发生的基金应支付的管理费	4,565,739.54	9,789,978.93
其中：支付销售机构的客户维护费	567,902.99	1,230,256.64

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 X 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	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
当期发生的基金应支付的托管费	760,956.54	1,631,663.21

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 X 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		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	
	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	106,975,127.09	345,216.76	42,723,563.91	409,441.53

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2016-01-19	2016-01-19	0.210	6,444,011.05	8,148,936.53	14,592,947.58	-
合计			0.210	-	8,148,936.53	14,592,947.58	-

### 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

无。

#### 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300351	永贵电器	2016-06-29	重大事项	33.93	2016-07-04	33.30	383,138.00	11,994,566.15	12,999,872.34	-
300356	光一科技	2016-05-26	重大事项	48.44	2016-08-10	44.27	113,600.00	4,486,592.83	5,502,784.00	-
合计							496,738.00	16,481,158.98	18,502,656.34	

#### 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混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及资产支持证券投资等。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，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

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。本基金的活期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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年末
--------	-----	-----



	2016年6月30日	2015年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	5,012,000.00
合计	-	5,012,000.00

注：未评级债券为国债。

#### 6.4.9.2.2 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	上年度末 2015年12月31日
AAA	4,684,400.00	43,068,000.00
AA+	123,275,100.40	117,367,207.70
AA	-	91,544,071.80
AA-	-	-
未评级	60,005,000.00	10,258,000.00
合计	187,964,500.40	262,237,279.50

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 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、组合在短时间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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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
资产					
银行存款	106,975,127.09	-	-	-	106,975,127.09
结算备付金	6,125,747.74	-	-	-	6,125,747.74
存出保证金	652,631.83	-	-	-	652,631.83
交易性金融资产	88,166,077.70	99,798,422.70	-	334,977,952.91	522,942,453.31
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,856,656.25	4,856,656.25
应收申购款	-	-	-	57,489.19	57,489.19
<b>资产总计</b>	<b>201,919,584.36</b>	<b>99,798,422.70</b>		<b>339,892,098.35</b>	<b>641,610,105.41</b>
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,413,156.76	18,413,156.76
应付赎回款	-	-	-	1,118,527.82	1,118,527.82
应付管理人报酬	-	-	-	739,964.50	739,964.50
应付托管费	-	-	-	123,327.41	123,327.41
应付交易费用	-	-	-	4,729,609.67	4,729,609.67
其他负债	-	-	-	551,119.41	551,119.41

负债总计	-	-	-	25,675,705.57	25,675,705.57
利率敏感度缺口	201,919,584.36	99,798,422.70		314,216,392.78	615,934,399.84
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
资产					
银行存款	33,205,830.30	-	-	-	33,205,830.30
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	548,778.73	-	-	-	548,778.73
交易性金融资产	32,152,164.60	223,940,058.50	11,157,056.40	408,683,121.13	675,932,400.63
应收证券清算款	-	-	-	8,231,769.88	8,231,769.88
应收利息	-	-	-	5,904,452.51	5,904,452.51
应收申购款	-	-	-	54,074.49	54,074.49
资产总计	65,906,773.63	223,940,058.50	11,157,056.40	422,873,418.01	723,877,306.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,061,235.72	1,061,235.72
应付管理人报酬	-	-	-	922,962.18	922,962.18
应付托管费	-	-	-	153,827.01	153,827.01
应付交易费用	-	-	-	853,244.66	853,244.66
其他负债	-	-	-	450,602.71	450,602.71
负债总计	-	-	-	3,441,872.28	3,441,872.28
利率敏感度缺口	65,906,773.63	223,940,058.50	11,157,056.40	419,431,545.73	720,435,434.26

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

假设	除市场利率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6月30日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 87	减少约 171
	市场利率下降 25 个基点	增加约 87	增加约 171

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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净值的 30%-60%，股权分置改革中产生的权证的投资比例不得超过基金资产净值的 3% 并计入股票投资比例，固定收益类证券(含可转换债券及可分离可转换债券)投资比例为基金资产净值的 0%-65%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 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	334,977,952.91	54.39	408,683,121.13	56.73
交易性金融资产— 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权 证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	334,977,952.91	54.39	408,683,121.13	56.73

##### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除富时中国 A600 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 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	富时中国 A600 指数下降 5%	减少约 2,341.00	减少约 2,571.00
	富时中国 A600 指数上升 5%	增加约 2,341.00	增加约 2,571.00

#### 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 316,475,296.57 元，属于第二层级的余额为 206,467,156.74 元，无属于第三层级的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层级 322,712,970.84 元，第二层级 353,219,429.79 元，无第三层级）。

###### (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。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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（2015 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	334,977,952.91	52.21
	其中：股票	334,977,952.91	52.21
2	固定收益投资	187,964,500.40	29.30
	其中：债券	187,964,500.40	29.30
	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	113,100,874.83	17.63
7	其他各项资产	5,566,777.27	0.87
8	合计	641,610,105.41	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,573,610.00	2.85
C	制造业	176,679,815.34	28.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,146,651.64	9.77
E	建筑业	6,227,580.00	1.01
F	批发和零售业	4,894,303.86	0.79
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	58,636,286.73	9.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,164,924.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,654,781.34	0.92
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	334,977,952.91	54.39

### 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	000021	深科技	2,545,378	28,024,611.78	4.55
2	300335	迪森股份	1,497,700	24,876,797.00	4.04
3	002544	杰赛科技	698,600	22,404,102.00	3.64
4	601199	江南水务	2,826,233	21,988,092.74	3.57
5	300266	兴源环境	484,207	20,259,220.88	3.29
6	600110	诺德股份	1,957,500	19,261,800.00	3.13
7	002049	紫光国芯	428,469	18,831,212.55	3.06
8	002304	洋河股份	243,900	17,541,288.00	2.85
9	002684	猛狮科技	532,944	17,310,021.12	2.81
10	000601	韶能股份	1,270,982	13,281,761.90	2.16
11	300351	永贵电器	383,138	12,999,872.34	2.11
12	002169	智光电气	486,856	11,075,974.00	1.80
13	600547	山东黄金	233,400	9,081,594.00	1.47
14	002155	湖南黄金	644,800	8,492,016.00	1.38
15	300262	巴安水务	406,500	6,227,580.00	1.01
16	300053	欧比特	328,500	5,962,275.00	0.97
17	000005	世纪星源	749,971	5,654,781.34	0.92
18	300356	光一科技	113,600	5,502,784.00	0.89
19	601222	林洋能源	131,400	5,499,090.00	0.89
20	002354	天神娱乐	61,900	5,402,632.00	0.88
21	300381	溢多利	74,100	5,346,315.00	0.87
22	603729	龙韵股份	66,200	5,164,924.00	0.84
23	002655	共达电声	306,800	4,954,820.00	0.80
24	603368	柳州医药	56,373	4,894,303.86	0.79
25	300469	信息发展	26,500	3,358,080.00	0.55
26	300104	乐视网	62,251	3,293,700.41	0.53
27	300467	迅游科技	51,000	3,155,880.00	0.51
28	300113	顺网科技	82,600	3,135,496.00	0.51

29	300245	天玑科技	140,200	3,112,440.00	0.51
30	300392	腾信股份	114,929	3,112,277.32	0.51
31	002174	游族网络	95,800	3,065,600.00	0.50
32	300352	北信源	163,900	3,060,013.00	0.50
33	002439	启明星辰	118,400	3,058,272.00	0.50
34	002657	中科金财	45,100	2,477,794.00	0.40
35	300279	和晶科技	50,907	2,417,573.43	0.39
36	002371	七星电子	40,482	1,692,957.24	0.27

#### 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	601199	江南水务	54,130,214.77	7.51
2	002142	宁波银行	46,075,824.98	6.40
3	000021	深科技	42,109,128.96	5.84
4	000983	西山煤电	41,269,506.15	5.73
5	002371	七星电子	35,747,390.15	4.96
6	002049	紫光国芯	35,556,152.05	4.94
7	300182	捷成股份	34,967,132.79	4.85
8	002684	猛狮科技	29,645,560.64	4.11
9	002519	银河电子	29,280,896.94	4.06
10	002111	威海广泰	28,791,926.18	4.00
11	601009	南京银行	28,778,649.86	3.99
12	300335	迪森股份	25,102,443.36	3.48
13	000948	南天信息	24,833,922.64	3.45
14	300231	银信科技	24,530,044.27	3.40
15	600801	华新水泥	23,510,224.56	3.26
16	300503	昊志机电	23,070,096.25	3.20
17	002195	二三四五	21,425,128.95	2.97
18	002169	智光电气	21,321,032.57	2.96
19	002544	杰赛科技	20,797,839.83	2.89
20	300467	迅游科技	19,023,785.90	2.64
21	002222	福晶科技	18,154,701.16	2.52
22	002572	索菲亚	18,115,682.20	2.51
23	600110	诺德股份	17,999,560.50	2.50
24	002304	洋河股份	17,904,242.58	2.49
25	600547	山东黄金	17,854,023.79	2.48
26	600395	盘江股份	17,636,970.92	2.45
27	300474	景嘉微	17,576,756.67	2.44
28	002206	海利得	17,532,864.37	2.43
29	002514	宝馨科技	17,278,888.41	2.40
30	300266	兴源环境	17,199,363.41	2.39
31	002094	青岛金王	17,091,325.62	2.37
32	002655	共达电声	16,717,045.25	2.32
33	000701	厦门信达	16,255,692.85	2.26
34	002635	安洁科技	15,763,802.58	2.19
35	300157	恒泰艾普	15,746,229.16	2.19



36	300479	神思电子	15,213,381.65	2.11
37	603008	喜临门	15,181,245.82	2.11
38	600661	新南洋	15,069,390.02	2.09
39	600476	湘邮科技	14,871,903.55	2.06
40	603729	龙韵股份	14,814,418.80	2.06
41	600652	游久游戏	14,764,679.21	2.05
42	300242	明家联合	14,544,043.31	2.02

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

#### 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	002142	宁波银行	46,657,001.86	6.48
2	000983	西山煤电	45,361,430.16	6.30
3	002371	七星电子	44,073,383.78	6.12
4	002111	威海广泰	30,757,587.65	4.27
5	601199	江南水务	30,574,086.63	4.24
6	002519	银河电子	29,731,518.78	4.13
7	300182	捷成股份	29,610,029.91	4.11
8	300503	昊志机电	28,613,892.56	3.97
9	601009	南京银行	28,400,681.65	3.94
10	000701	厦门信达	26,610,847.63	3.69
11	000948	南天信息	23,726,501.06	3.29
12	600682	南京新百	23,527,760.73	3.27
13	300231	银信科技	23,497,205.36	3.26
14	002374	丽鹏股份	22,378,404.04	3.11
15	002502	骅威文化	22,228,606.38	3.09
16	600801	华新水泥	20,958,183.61	2.91
17	002195	二三四五	20,742,629.72	2.88
18	600308	华泰股份	20,382,455.22	2.83
19	300474	景嘉微	20,012,692.94	2.78
20	002600	江粉磁材	19,837,720.65	2.75
21	002222	福晶科技	19,497,730.86	2.71
22	002094	青岛金王	19,157,077.38	2.66
23	002572	索菲亚	18,913,927.32	2.63
24	002206	海利得	18,522,891.11	2.57
25	000021	深科技	18,494,194.12	2.57
26	002049	紫光国芯	18,167,576.44	2.52
27	300301	长方集团	17,956,767.71	2.49
28	002514	宝馨科技	17,798,611.60	2.47
29	600356	恒丰纸业	17,316,603.16	2.40
30	300242	明家联合	16,751,286.43	2.33
31	600963	岳阳林纸	16,492,352.56	2.29
32	002635	安洁科技	16,356,267.07	2.27
33	300256	星星科技	16,099,084.56	2.23
34	600395	盘江股份	15,118,724.05	2.10
35	603008	喜临门	14,784,415.42	2.05
36	300449	汉邦高科	14,626,985.64	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	2,453,950,654.18
卖出股票的收入（成交）总额	2,444,461,507.06

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	60,005,000.00	9.74
	其中：政策性金融债	60,005,000.00	9.74
4	企业债券	127,959,500.40	20.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	187,964,500.40	30.52

### 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	0980144	09 汾湖债	500,000	51,835,000.00	8.42
2	160208	16 国开 08	500,000	49,840,000.00	8.09
3	122685	12 吉城投	300,010	19,089,636.30	3.10
4	122534	12 秦开发	200,200	16,436,420.00	2.67
5	070215	07 国开 15	100,000	10,165,000.00	1.65

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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有国债期货。

### 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 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	652,631.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,856,656.25
5	应收申购款	57,489.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,566,777.27

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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

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

41,184	16,914.74	10,352,537.74	1.49%	686,264,039.22	98.51%
--------	-----------	---------------	-------	----------------	--------

## 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	75,449.00	0.01%

## 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

- 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（2006年5月31日）基金份额总额	2,364,760,040.49
本报告期期初基金份额总额	696,684,845.29
本报告期基金总申购份额	28,003,482.03
减：本报告期基金总赎回份额	28,071,750.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	696,616,576.96

## § 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、基金托管人的专门基金托管部门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	
世纪证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	984,705,594.19	20.10%	917,058.09	20.94%	-
海通证券	1	982,370,637.79	20.05%	914,884.33	20.89%	-
国信证券	1	885,119,124.16	18.07%	824,315.93	18.82%	-
恒泰证券	1	610,844,685.22	12.47%	446,712.42	10.20%	-
广发证券	2	565,304,274.02	11.54%	526,475.05	12.02%	-
长江证券	2	195,233,527.40	3.99%	181,816.63	4.15%	新增 1 个
安信证券	1	165,223,607.88	3.37%	153,876.16	3.51%	-
方正证券	1	142,864,966.80	2.92%	104,477.45	2.39%	-
首创证券	1	113,157,058.35	2.31%	82,751.33	1.89%	新增 1 个
中金公司	2	99,785,937.95	2.04%	92,928.52	2.12%	-

中信建投	2	73,376,963.65	1.50%	68,319.78	1.56%	-
英大证券	1	43,050,921.09	0.88%	31,484.52	0.72%	新增 1 个
光大证券	3	37,374,862.74	0.76%	34,806.81	0.79%	-

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
世纪证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
山西	-	-	-	-	-	-

证券						
国金	-	-	-	-	-	-
证券						
宏信	-	-	-	-	-	-
证券						
浙商	-	-	-	-	-	-
证券						
开源	-	-	-	-	-	-
证券						
国海	-	-	-	-	-	-
证券						
方正	-	-	-	-	-	-
证券						
银河	-	-	-	-	-	-
证券						
德邦	-	-	-	-	-	-
证券						
华创	-	-	-	-	-	-
证券						
申银	-	-	-	-	-	-
万国						
华泰	-	-	-	-	-	-
证券						
东莞	-	-	-	-	-	-
证券						
宏源	-	-	-	-	-	-
证券						
齐鲁	-	-	-	-	-	-
证券						
长城	-	-	-	-	-	-
证券						
招商	1,117,750.78	5.56%	33,000,000.00	22.33%	-	-
证券						
海通	-	-	-	-	-	-
证券						
国信	-	-	-	-	-	-
证券						
恒泰	-	-	-	-	-	-
证券						
广发	-	-	114,800,000.00	77.67%	-	-
证券						
长江	-	-	-	-	-	-
证券						
安信	-	-	-	-	-	-
证券						
方正	-	-	-	-	-	-
证券						
首创	-	-	-	-	-	-
证券						
中金	-	-	-	-	-	-
公司						

中信建投	15,149,394.84	75.38%	-	-	-	-
英大证券	3,829,881.64	19.06%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

## 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	博时平衡配置混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-15
2	博时平衡配置混合型证券投资基金 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
3	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中信期货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	2016-03-09
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	博时平衡配置混合型证券投资基金 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
6	博时平衡配置混合型证券投资基金 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
7	关于博时旗下部分开放式基金增加北京惠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
8	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
9	关于博时旗下部分开放式基金参加江苏张家港农村商业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	2016-04-11
10	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
11	博时基金管理有限公司关于博时平衡配置混合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	2016-04-22
12	博时平衡配置混合型证券投资基金 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参加中国民生银行直销银行基金通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	2016-05-05
15	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
16	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-25



	费率优惠活动的公告		
17	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	2016-05-26
18	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
19	关于博时旗下部分开放式基金增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为代销机构公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-01
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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平衡配置混合型证券投资基金设立的文件
- 11.1.2 《博时平衡配置混合型证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时平衡配置混合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 博时平衡配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 11.1.6 报告期内博时平衡配置混合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