

# 博时沪港深优质企业灵活配置混合型

## 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：招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。

基金托管人招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。

根据基金管理人 2016 年 3 月 17 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金实施基金份额分类以及相应修改基金合同和托管协议的公告》，博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金自 2016 年 3 月 22 日实施基金份额分类，具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

## 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 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	33
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	33
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 .....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	37
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	38

§ 8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	39
§ 9 开放式基金份额变动.....	40
§ 10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	41
§ 11 备查文件目录.....	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	博时沪港深优质企业基金	
基金主代码	001215	
交易代码	001215	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 14 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,519,079,119.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时沪港深优质企业 A	博时沪港深优质企业 C
下属分级基金的交易代码	001215	002555
报告期末下属分级基金的份额总额	1,519,078,390.99 份	728.67 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对符合或引领中国经济转型优质企业的深入研究，把握沪港通及后续资本市场开放政策带来的投资机会，在严格控制估值风险及流动性风险的前提下，获取基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略分三个层次：首先是大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业发展规律和内在逻辑，在不同行业之间进行动态配置；最后是个股选择策略和债券投资策略。
业绩比较基准	中国债券总财富指数收益率×40%+中证 500 指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201

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	深圳市福田区深南大道7088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	深圳市福田区深南大道7088号
邮政编码	518040	518040
法定代表人	张光华	李建红

## 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	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
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）	
	博时沪港深优质企业 A	博时沪港深优质企业 C
本期已实现收益	-268,080,326.79	-640.39
本期利润	-354,245,004.37	465.96
加权平均基金份额本期利润	-0.2289	0.0656
本期加权平均净值利润率	-33.72%	10.22%
本期基金份额净值增长率	-24.78%	3.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
	博时沪港深优质企业 A	博时沪港深优质企业 C
期末可供分配利润	-551,276,935.95	-243.22
期末可供分配基金份额利润	-0.3629	-0.3338
期末基金资产净值	1,038,010,709.50	516.85
期末基金份额净值	0.683	0.709
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
	博时沪港深优质企业 A	博时沪港深优质企业 C
基金份额累计净值增长率	-31.70%	3.65%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人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

博时沪港深优质企业 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.73%	1.15%	1.64%	0.83%	4.09%	0.32%
过去三个月	-0.73%	1.42%	0.41%	0.78%	-1.14%	0.64%
过去六个月	-24.78%	2.32%	-7.92%	1.20%	-16.86%	1.12%
过去一年	-24.86%	2.79%	-12.48%	1.36%	-12.38%	1.43%
自基金合同生效起至今	-31.70%	2.73%	-12.81%	1.38%	-18.89%	1.35%

博时沪港深优质企业 C

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	9.75%	1.38%	1.64%	0.83%	8.11%	0.55%
过去三个月	2.90%	1.51%	0.41%	0.78%	2.49%	0.73%
自基金合同生效起至今	3.65%	1.57%	1.05%	0.79%	2.60%	0.78%

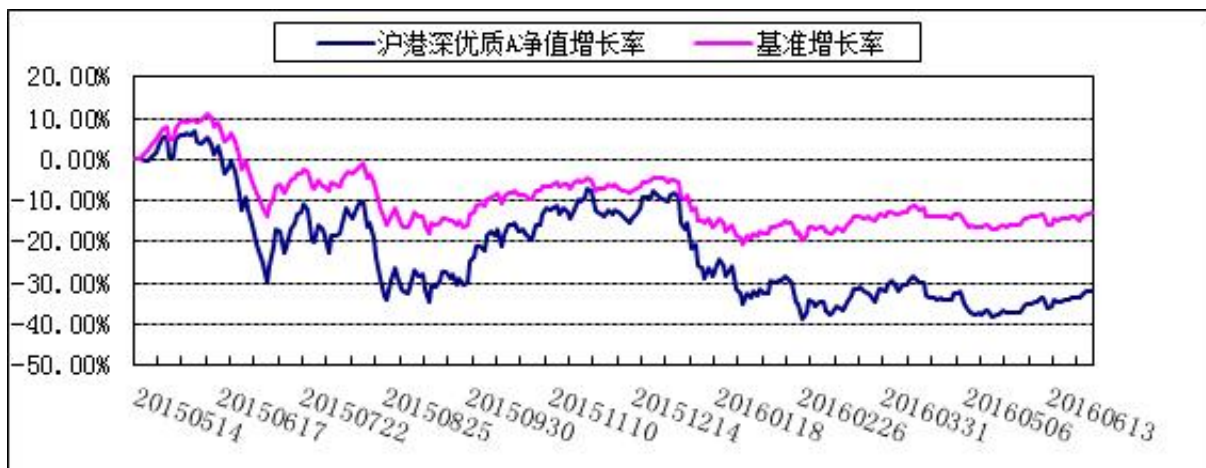
注：1、自 2016 年 3 月 22 日起对本基金实施基金份额分类，基金份额分类后，本基金将分设两类基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，分别计算基金份额净值。

2、本基金的业绩比较基准为：中国债券总财富指数收益率×40%+中证 500 指数收益率×40%+恒生综合指数收益率×20%。

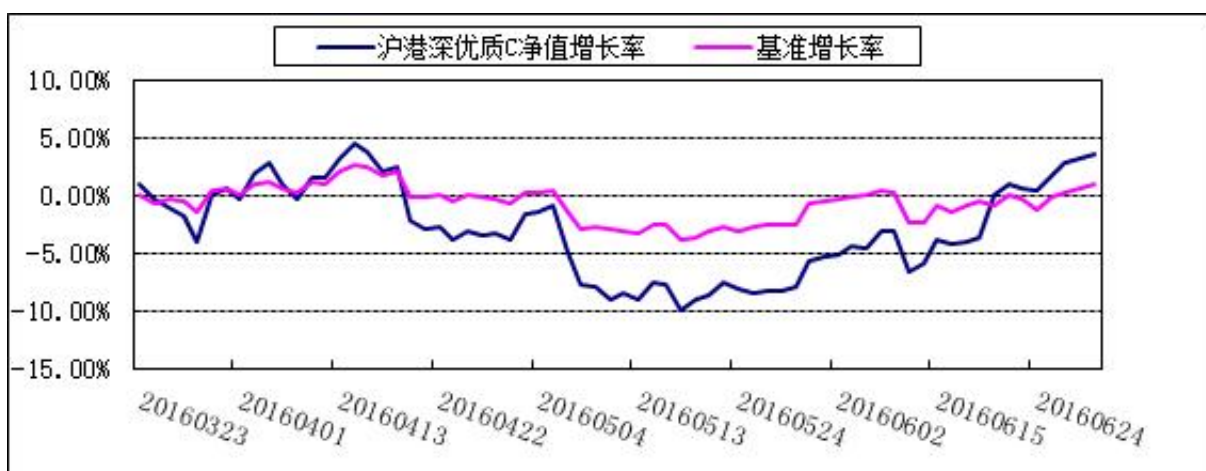
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 40%、40%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

博时沪港深优质企业 A



博时沪港深优质企业 C



注：本基金合同于 2015 年 5 月 14 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户。资产管理净值总规模达 4,598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。



## 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，2016 年二季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

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

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

## 2、其他大事件

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

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

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

2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。wind 数据显示，2015 年博时基金旗下 10 只纯债产品平均收益率达 12.65%，其中 6

只定期开放债基平均收益率更高达 15.17%，博时安丰 18 个月定期开放债券和博时双月薪双双夺得同类基金收益榜冠军。

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

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

2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅” 奖颁奖盛典在京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝” 获年度金牌创新力金融产品奖。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张溪冈	基金经理/国际组投资总监	2016-05-30	-	14.8	2001 年起先后在香港新鸿基证券有限公司、和丰顺投资有限公司工作；2009 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、投资经理、国际投资部副总经理、股票投资部国际组投资副总监。现任股票投资部国际组投资总监兼博时大中华亚太精选股票（QDII）基金、博时沪港深优质企业混合基金的基金经理。
周志超	基金经理	2016-05-30	-	10	2003 年起先后在诺安基金、信达澳银基金、广发基金、摩根士丹利华鑫基金工作。2015 年加入博时基金管理有限公司，现任博时卓越品牌混合（LOF）基金兼博时沪港深优质企业混合基金的基金经理。
招扬	基金经理/绝对收益组投资副总监	2015-05-14	2016-05-30	8.6	2004 至 2007 年曾在华为技术有限公司工作。2007 年加入博时基金管理有限公司，

					历任研究员、资本品研究组主管兼研究员、投资经理、特定资产管理部副总经理。现任股票投资部副总经理兼绝对收益组投资副总监、博时裕益灵活配置混合型证券投资基金、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A、大类资产配置：

①股票资产配置——报告期内，本基金坚持“价值投资、精选个股”的投资策略。

②债券资产配置——报告期内，本基金未配置债券资产。

B、二级资产配置：

股票资产配置——本报告期，本基金坚持“价值投资、精选个股”的策略。重点持有低估值或者转型预期较为强烈（且估值合理）的个股，持仓以金融、轻工、纺织服装、

高端制造业为主。

#### C、报告期股票操作回顾：

2016 年上半年，A 股市场整体表现较差，年初熔断造成的连续两日暴跌，叠加人民币贬值和海外市场的无序波动，对市场信心造成了沉重打击，导致 1-2 月 A 股连续暴跌，千股跌停频现。3 月份市场触底反弹，以次新股、新能源汽车、OLED、半导体国产化为代表的主题类，与以白酒、家电为代表的大消费类板块，表现非常出色，其他板块表现则逊色的多。综合来看，上半年股市分化比较大，强势板块的表现非常强势，几乎完全不受股灾影响，而弱市板块表现十分萎靡，股价呈“L”型走势。

上半年上证综指下跌 17.23%，深证成指下跌 17.17%，创业板指下跌 17.9%。三大指数表现差异不大，但是行业分化明显，白酒上半年涨幅 2.38%，有色、煤炭、银行、家电跌幅都在 10%以内，而传媒、餐饮旅游、交运、计算机等板块的跌幅都超过 20%。概念板块方面，次新股、贵金属、新能源汽车、OLED、稀土永磁指数上半年都是录得上涨。

本基金上半年更换了基金经理，1-5 月份持仓以高估值成长股为主，6 月分之后，投资以低估值、中小市值的成长股为主，远离市场热点，仓位保持高位。上半年由于高估值成长股跌幅较大，加上调仓原因，净值表现不尽如人意，不过我们有信心在余下时间实现较好收益。

#### 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 A 类基金份额净值为 0.683，份额累计净值为 0.683 元；C 类基金份额净值为 0.709 元，份额累计净值为 0.709 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-24.78%，同期业绩基准增长率-7.92%；C 类基金份额净值增长率为 3.65%，同期业绩基准增长率 1.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，1-5 月规模以上工业增加值同比增速 5.9%，较上月小幅回升 0.1 个百分点。5 月当月工业增加值同比增速 6%，与上月持平。1-5 月规模以上工业企业利润同比增长 6.4%，增速比 1-4 月回落 0.1 个百分点。其中，5 月利润同比增长 3.7%，比上月回落 0.5 个百分点。5 月中国制造业采购经理人 PMI 指数为 50.1，与上月持平，为连续第 3 个月处于荣枯线上方。不过 5 月财新 PMI 指数终值 49.2，较上月下滑 0.2，为连续 16 个月处于收缩区间。投资方面，1-5 月固定资产投资同比增长 9.6%，回落幅度扩大到 0.9 个百分点，其中 5 月当月同比增速 7.4%，较上月回落 2.7 个百分点，5 月当月房地产开发投资同比增速 6.6%，较上月下滑 3.1 个百分点。信贷方面，5 月 M2 货币供应同比增

11.8%，预期 12.5%，前值 12.8%。5 月社会融资规模 6599 亿，预期 10000 亿，前值 7510 亿。5 月新增人民币贷款 9855 亿元，预期 7500 亿元，前值 5556 亿元。消费方面，5 月社会消费品零售总额同比名义增速 10%，扣除价格因素实际增长 7.8%，较上月略升 0.2 个百分点，表现平淡。总的来说，国内宏观经济表现继续疲软，企业层面不愿意加杠杆，加杠杆的主力变成了政府和居民个人（主要是房贷）。

证券市场方面，虽然 A 股经历了多轮的下跌洗礼，但是数据显示大部分公司估值依然处在高位，缺乏投资价值。上半年表现火爆的各色主题类个股，业绩基本是无法兑现的，上涨主要愿意短线资金的博弈行为。以钢铁有色煤炭为代表的投资产业链，面临着需求长期持续性的下滑，即使政府推动供给侧改革，其对上市公司盈利的正面影响也是有限的。以白酒、家电为代表的大消费板块，虽然估值不算贵，但是年内涨幅巨大，估值较历史平均水平也已经处于高位。

在投资上，我们致力于实现净值的持续性、长期的优异表现，而不是单单某一个阶段的爆发。因此，我们的投资不会局限于押注于某些特定行业，在行业属性上，我们的投资还是比较分散的。主要还是个股选择，精选那些行业前景较好、预期差较大、估值有较大安全边际的个股，并重仓持有。此外，我们认为企业并购和转型的大浪潮（尤其是后面会有越来越多的跨国并购）不会那么快结束，因此，我们也致力于挖掘并投资于那些并购和转型预期强烈、估值和市值相对合理的公司。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的

相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人—招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：博时沪港深优质企业灵活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	上年度末
----	-----	-----	------

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.3.1	194,553,391.41	104,253,301.29
结算备付金		16,739,049.88	1,608,164.98
存出保证金		2,790,769.11	1,042,010.74
交易性金融资产	6.4.3.2	819,744,251.80	1,335,371,381.72
其中：股票投资		819,744,251.80	1,335,371,381.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		10,719,911.89	-
应收利息	6.4.3.5	44,587.09	18,085.13
应收股利		1,480,965.44	-
应收申购款		167,654.08	132,239.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		1,046,240,580.70	1,442,425,183.19
<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		-	225.46
应付赎回款		1,190,803.17	2,263,200.71
应付管理人报酬		1,236,306.96	1,803,229.83
应付托管费		206,051.16	300,538.31
应付销售服务费		3.27	-
应付交易费用	6.4.3.7	5,343,210.28	4,439,135.49
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	252,979.51	157,155.18
负债合计		8,229,354.35	8,963,484.98
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.3.9	1,519,079,119.66	1,578,243,672.26
未分配利润	6.4.3.10	-481,067,893.31	-144,781,974.05
所有者权益合计		1,038,011,226.35	1,433,461,698.21

负债和所有者权益总计		1,046,240,580.70	1,442,425,183.19
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,519,079,119.66 份。其中 A 类基金份额净值 0.683 元，基金份额总额 1,519,078,390.99 份；C 类基金份额净值 0.709 元，基金份额总额 728.67 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时沪港深优质企业灵活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 5 月 14 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-336,581,766.90</b>	<b>-202,685,962.31</b>
1. 利息收入		518,168.09	513,478.92
其中：存款利息收入	6.4.3.11	415,502.71	513,478.92
债券利息收入		102,665.38	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-251,034,330.67	4,081,630.43
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-254,261,531.02	-5,068,777.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-52,344.10	-
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	3,279,544.45	9,150,408.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-86,163,571.23	-207,281,071.66
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	97,966.91	-
<b>减：二、费用</b>		<b>17,662,771.51</b>	<b>8,344,771.85</b>
1. 管理人报酬		7,857,491.70	4,533,345.08
2. 托管费		1,309,581.92	755,557.48
3. 销售服务费		6.21	-
4. 交易费用	6.4.3.18	8,285,037.42	2,988,227.53
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	210,654.26	67,641.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号</b>		<b>-354,244,538.41</b>	<b>-211,030,734.16</b>



填列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-354,244,538.41</b>	<b>-211,030,734.16</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：博时沪港深优质企业灵活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)	1,578,243,672.26	-144,781,974.05	1,433,461,698.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-354,244,538.41	-354,244,538.41
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)	-59,164,552.60	17,958,619.15	-41,205,933.45
其中：1. 基金申购款	34,608,422.24	-10,996,185.04	23,612,237.20
2. 基金赎回款	-93,772,974.84	28,954,804.19	-64,818,170.65
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)	1,519,079,119.66	-481,067,893.31	1,038,011,226.35
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 14 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)	2,322,307,856.74	-	2,322,307,856.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-211,030,734.16	-211,030,734.16
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)	2,322,307,856.74	-211,030,734.16	2,111,277,122.58

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：

(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，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印

花税。

### 6.4.3 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	194,553,391.41
定期存款	-
其他存款	-
合计	194,553,391.41

#### 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	823,301,889.67	819,744,251.80	-3,557,637.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	823,301,889.67	819,744,251.80	-3,557,637.87

#### 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	34,659.48
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	8,156.76

应收债券利息	-
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	1,770.85
合计	44,587.09

#### 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	5,343,210.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,343,210.28

#### 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	4,075.35
其他应付款	-
预提费用	248,904.16
合计	252,979.51

#### 6.4.3.9 实收基金

博时沪港深优质企业 A

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	账面金额
上年度末	1,578,243,672.26	1,578,243,672.26
本期申购	34,588,831.28	34,588,831.28
本期赎回（以“-”号填列）	-93,754,112.55	-93,754,112.55
本期末	1,519,078,390.99	1,519,078,390.99

博时沪港深优质企业 C

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	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	19,590.96	19,590.96
本期赎回（以“-”号填列）	-18,862.29	-18,862.29
本期末	728.67	728.67

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

博时沪港深优质企业 A

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	-300,637,572.88	155,855,598.83	-144,781,974.05
本期利润	-268,080,326.79	-86,164,677.58	-354,245,004.37
本期基金份额交易产生的变动数	17,440,963.72	518,333.21	17,959,296.93
其中：基金申购款	-10,127,472.58	-861,621.50	-10,989,094.08
基金赎回款	27,568,436.30	1,379,954.71	28,948,391.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-551,276,935.95	70,209,254.46	-481,067,681.49

博时沪港深优质企业 C

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	-	-	-
本期利润	-640.39	1,106.35	465.96
本期基金份额交易产生的变动数	397.17	-1,074.95	-677.78
其中：基金申购款	-6,246.79	-844.17	-7,090.96
基金赎回款	6,643.96	-230.78	6,413.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-243.22	31.40	-211.82

#### 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
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	72,260.60
其他	11,876.73
合计	415,502.71

#### 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	3,031,113,859.02
减：卖出股票成本总额	3,285,375,390.04
买卖股票差价收入	-254,261,531.02

#### 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	27,175,081.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,499,267.20
减：应收利息总额	728,158.42
买卖债券差价收入	-52,344.10

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

无。

#### 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	3,279,544.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,279,544.45

#### 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	-86,163,571.23
——股票投资	-86,163,571.23
——债券投资	-
——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	-86,163,571.23

#### 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	90,750.29
转换费收入	7,216.62
合计	97,966.91

注：1、对于 A 类基金份额：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取的赎回费，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 个月的投资人收取的赎回费，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，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。对于 C 类基金份额：对于持续持有 C 类基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购费补差构成，其中不低于本基金 A 类基金份额的赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产；持有期限少于 30 日的本基金 C 类基金份额的赎回费部分全额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	8,285,037.42
银行间市场交易费用	-
合计	8,285,037.42

#### 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	2,750.10
银行间账户维护费	9,000.00
合计	210,654.26

#### 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
交通银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、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

无。

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 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5月14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	7,857,491.70	4,533,345.08
其中：支付销售机构的客户维护费	3,482,888.20	1,910,400.12

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年5月14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	1,309,581.92	755,557.48

注：支付基金托管人招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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时沪港深优质企业A类	博时沪港深优质企业C类	合计
博时基金	-	6.21	6.21
合计	-	6.21	6.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015年5月14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销售服务费		
	博时沪港深优质企业A类	博时沪港深优质企业C类	合计
博时基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。

$$\text{其计算公式为：日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 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14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
招商银行	194,553,391.41	331,365.38	130,141,584.92	428,670.16

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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（上年度可比区间：无）。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

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

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
600734	实达集团	2016-04-20	公告重大事项	14.60	-	-	823,753	14,730,705.00	12,026,793.80	-

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

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

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。本基金投资的金融工具主要

包括股票投资等。本基金除了投资于 A 股市场优质企业外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。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，力争实现稳定的绝对回报。通过对符合或引领中国经济转型优质企业的深入研究，把握沪港通及后续资本市场开放政策带来的投资机会，在严格控制估值风险及流动性风险的前提下，获取基金资产的长期稳健增值。

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招商银行，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。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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，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，其余均能以合理价格适时变现。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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

#### 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	194,553,391.41	-	-	-	194,553,391.41
结算备付金	16,739,049.88	-	-	-	16,739,049.88
存出保证金	2,790,769.11	-	-	-	2,790,769.11
交易性金融资产	-	-	-	819,744,251.80	819,744,251.80
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,719,911.89	10,719,911.89
应收股利	-	-	-	1,480,965.44	1,480,965.44
应收利息	-	-	-	44,587.09	44,587.09
应收申购款	-	-	-	167,654.08	167,654.08
<b>资产总计</b>	<b>214,083,210.40</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>832,157,370.30</b>	<b>1,046,240,580.70</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	-	-	-	1,190,803.17	1,190,803.17
应付管理人报酬	-	-	-	1,236,306.96	1,236,306.96
应付托管费	-	-	-	206,051.16	206,051.16
应付销售服务费	-	-	-	3.27	3.27
应付交易费用	-	-	-	5,343,210.28	5,343,210.28
其他负债	-	-	-	252,979.51	252,979.51
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,229,354.35</b>	<b>8,229,354.35</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>214,083,210.40</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>823,928,015.95</b>	<b>1,038,011,226.35</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	104,253,301.29	-	-	-	104,253,301.29
结算备付金	1,608,164.98	-	-	-	1,608,164.98
存出保证金	1,042,010.74	-	-	-	1,042,010.74
交易性金融资产	-	-	-	1,335,371,381.72	1,335,371,381.72
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	18,085.13	18,085.13
应收申购款	-	-	-	132,239.33	132,239.33
<b>资产总计</b>	<b>106,903,477.01</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,335,521,706.18</b>	<b>1,442,425,183.19</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	225.46	225.46
应付赎回款	-	-	-	2,263,200.71	2,263,200.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,803,229.83	1,803,229.83
应付托管费	-	-	-	300,538.31	300,538.31
应付交易费用	-	-	-	4,439,135.49	4,439,135.49
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	157,155.18	157,155.18
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,963,484.98</b>	<b>8,963,484.98</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>106,903,477.01</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,326,558,221.20</b>	<b>1,433,461,698.21</b>

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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。本基金持有港股通标的的股票，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
	港币

	折合人民币
以外币计价的资产	
交易性金融资产	115,468,000.00
资产合计	115,468,000.00
以外币计价的负债	
应付证券清算款	-
负债合计	-
资产负债表	
外汇风险敞口净额	115,468,000.00
	上年度末 2015 年 12 月 31 日
项目	港币 折合人民币
以外币计价的资产	
交易性金融资产	510,608,065.08
资产合计	510,608,065.08
以外币计价的负债	
应付证券清算款	225.46
负债合计	225.46
资产负债表	
外汇风险敞口净额	510,607,839.62

#### 6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 577	增加约 2,553
	所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 577	减少约 2,553

#### 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。本基金投资于股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中对香港联合交易所上市股票的投资比例不超过基金资产的 40%。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	819,744,251.80	78.97	1,335,371,381.72	93.16
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>819,744,251.80</b>	<b>78.97</b>	<b>1,335,371,381.72</b>	<b>93.16</b>

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数收益率及恒生综合指数收益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
	1. 中证 500 指数收益率及恒生综合指数收益率上升 5%	增加约 4,584	增加约 8,971
2. 中证 500 指数收益率及恒生综合指数收益率下降 5%	减少约 4,584	减少约 8,971	



#### 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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 807,717,458.00 元，属于第二层次的余额为 12,026,793.80 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,290,934,302.63 元，第二层次 44,437,079.09 元，无第三层次)。

##### (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	819,744,251.80	78.35
	其中：股票	819,744,251.80	78.35
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	211,292,441.29	20.20
7	其他各项资产	15,203,887.61	1.45
8	合计	1,046,240,580.70	100.00

注：权益投资中通过沪港通机制投资香港股票金额 115,468,000.00 元，占基金总资产比例 11.04%。

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	490,977,458.00	47.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	111,226,793.80	10.72
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	19,290,000.00	1.86

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	82,782,000.00	7.98
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	704,276,251.80	67.85

注：上表按行业分类的股票投资组合仅包括在上海证券交易所和深圳证券交易所上市交易的股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	14,320,000.00	1.38
能源	47,124,000.00	4.54
医疗保健	22,610,000.00	2.18
工业	31,414,000.00	3.03
合计	115,468,000.00	11.12

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	000910	大亚科技	6,600,000	101,970,000.00	9.82
2	600382	广东明珠	6,200,000	99,200,000.00	9.56
3	002398	建研集团	6,300,000	82,782,000.00	7.98
4	002662	京威股份	4,100,000	61,951,000.00	5.97
5	002394	联发股份	3,900,000	58,890,000.00	5.67
6	000488	晨鸣纸业	7,000,000	55,580,000.00	5.35
7	000887	中鼎股份	2,500,000	55,275,000.00	5.33
8	1033 HK	中石化油服	37,400,000	47,124,000.00	4.54
9	002695	煌上煌	800,000	40,288,000.00	3.88
10	2727 HK	上海电气	11,300,000	31,414,000.00	3.03
11	000650	仁和药业	3,800,000	31,008,000.00	2.99
12	601566	九牧王	2,000,000	30,880,000.00	2.97
13	000158	常山股份	2,000,000	27,780,000.00	2.68
14	002068	黑猫股份	3,507,110	27,355,458.00	2.64
15	2196 HK	复星医药	1,400,000	22,610,000.00	2.18

16	000886	海南高速	3,000,000	19,290,000.00	1.86
17	175 HK	吉利汽车	4,000,000	14,320,000.00	1.38
18	600734	实达集团	823,753	12,026,793.80	1.16

## 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	000910	大亚科技	99,834,389.09	6.96
2	300059	东方财富	99,281,433.76	6.93
3	600382	广东明珠	89,930,880.11	6.27
4	002292	奥飞娱乐	81,861,125.79	5.71
5	002398	建研集团	76,442,873.68	5.33
6	002268	卫士通	63,902,535.57	4.46
7	2196 HK	复星医药	59,134,524.59	4.13
8	000488	晨鸣纸业	56,802,278.13	3.96
9	002368	太极股份	56,091,180.68	3.91
10	002662	京威股份	55,276,563.75	3.86
11	002394	联发股份	54,831,601.12	3.83
12	000887	中鼎股份	51,297,042.36	3.58
13	600718	东软集团	51,293,297.02	3.58
14	600549	厦门钨业	48,322,719.00	3.37
15	002413	雷科防务	43,646,219.21	3.04
16	001696	宗申动力	43,612,293.06	3.04
17	300348	长亮科技	42,749,597.10	2.98
18	600030	中信证券	41,041,772.25	2.86
19	883 HK	中国海洋石油	37,812,805.94	2.64
20	857 HK	中国石油股份	37,811,132.00	2.64
21	386 HK	中国石油化工股份	37,810,235.06	2.64
22	000558	莱茵体育	34,704,247.03	2.42
23	300113	顺网科技	33,381,820.85	2.33
24	600782	新钢股份	33,091,978.24	2.31
25	603869	北部湾旅	31,571,376.34	2.20
26	600029	南方航空	31,314,500.25	2.18
27	600016	民生银行	31,301,716.65	2.18
28	002343	慈文传媒	31,210,732.52	2.18
29	000983	西山煤电	31,201,419.27	2.18
30	600096	云天化	31,033,769.67	2.16
31	600366	宁波韵升	30,942,478.00	2.16
32	3888 HK	金山软件	30,704,455.40	2.14
33	600309	万华化学	30,415,598.50	2.12
34	002056	横店东磁	30,169,055.95	2.10

35	600536	中国软件	29,995,281.60	2.09
36	601566	九牧王	29,993,546.78	2.09
37	000673	当代东方	29,970,692.05	2.09
38	600565	迪马股份	29,826,996.87	2.08
39	002335	科华恒盛	29,621,407.25	2.07
40	000158	常山股份	29,513,192.28	2.06
41	000650	仁和药业	29,383,332.16	2.05
42	600756	浪潮软件	29,356,442.60	2.05
43	600734	实达集团	29,105,424.48	2.03
44	600376	首开股份	28,871,740.10	2.01
45	000708	大冶特钢	28,867,289.26	2.01
46	002060	粤水电	28,864,310.78	2.01
47	000597	东北制药	28,811,195.36	2.01
48	002408	齐翔腾达	28,737,102.68	2.00

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	300059	东方财富	113,839,729.25	7.94
2	600718	东软集团	107,867,990.41	7.52
3	002413	雷科防务	98,632,191.33	6.88
4	338 HK	上海石油化工股份	85,609,425.29	5.97
5	2357 HK	中航科工	76,800,708.69	5.36
6	001696	宗申动力	76,021,585.75	5.30
7	300348	长亮科技	75,492,597.25	5.27
8	3888 HK	金山软件	72,769,733.69	5.08
9	300310	宜通世纪	71,582,239.75	4.99
10	3333 HK	恒大地产	70,450,804.23	4.91
11	586 HK	海螺创业	69,331,569.31	4.84
12	002322	理工环科	68,194,676.82	4.76
13	002292	奥飞娱乐	65,090,385.57	4.54
14	002268	卫士通	53,523,891.06	3.73
15	600549	厦门钨业	49,260,903.60	3.44
16	300097	智云股份	48,535,109.78	3.39
17	600571	信雅达	45,492,370.17	3.17
18	002368	太极股份	44,397,189.46	3.10
19	883 HK	中国海洋石油	44,283,599.09	3.09
20	600030	中信证券	43,384,205.01	3.03
21	857 HK	中国石油股份	42,136,815.18	2.94

22	386 HK	中国石油化工股份	40,925,725.09	2.86
23	300104	乐视网	37,432,262.82	2.61
24	2196 HK	复星医药	35,612,311.23	2.48
25	2727 HK	上海电气	35,163,415.34	2.45
26	600366	宁波韵升	34,926,921.81	2.44
27	968 HK	信义光能	34,329,069.03	2.39
28	2382 HK	舜宇光学科技	33,735,853.48	2.35
29	600096	云天化	33,538,701.08	2.34
30	002056	横店东磁	33,105,660.20	2.31
31	002338	奥普光电	31,999,852.67	2.23
32	300113	顺网科技	31,900,589.82	2.23
33	002060	粤水电	31,576,000.39	2.20
34	600016	民生银行	31,164,900.00	2.17
35	000597	东北制药	31,121,698.44	2.17
36	002371	七星电子	31,010,660.82	2.16
37	000673	当代东方	30,909,277.25	2.16
38	600782	新钢股份	30,222,513.76	2.11
39	002221	东华能源	30,125,530.50	2.10
40	603869	北部湾旅	30,116,170.06	2.10
41	000829	天音控股	29,811,706.75	2.08
42	600309	万华化学	29,532,660.34	2.06
43	002456	欧菲光	29,189,393.93	2.04
44	600029	南方航空	29,173,390.36	2.04
45	002598	山东章鼓	28,983,145.11	2.02
46	600376	首开股份	28,888,849.56	2.02
47	002020	京新药业	28,847,723.77	2.01
48	000983	西山煤电	28,729,200.33	2.00

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,855,911,831.35
卖出股票的收入（成交）总额	3,031,113,859.02

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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投资。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未投资股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

## 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	2,790,769.11
2	应收证券清算款	10,719,911.89
3	应收股利	1,480,965.44
4	应收利息	44,587.09
5	应收申购款	167,654.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,203,887.61

### 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

份额单位：份

份额级别	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
博时沪港深 优质企业A类	23,527	64,567.45	247,163.82	0.02%	1,518,831,227.17	99.98%
博时沪港深 优质企业C类	4	182.17	-	-	728.67	100.00%
合计	23,531	64,556.51	247,163.82	0.02%	1,518,831,955.84	99.98%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从 业人员持有本基金	博时沪港深优质企业A类	25,394.35	0.00%
	博时沪港深优质企业C类	292.40	40.13%
	合计	25,686.75	0.00%

### 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	份额级别	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	博时沪港深优质企业A类	-
	博时沪港深优质企业C类	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放 式基金	博时沪港深优质企业A类	-
	博时沪港深优质企业C类	-
	合计	-

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

项目	博时沪港深优质企业 A	博时沪港深优质企业 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 14 日）基金份额总额	2,322,307,856.74	-
本报告期期初基金份额总额	1,578,243,672.26	-
本报告期基金总申购份额	34,588,831.28	19,590.96
减：本报告期基金总赎回份额	93,754,112.55	18,862.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,519,078,390.99	728.67

注：根据基金管理人 2016 年 3 月 17 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金实施基金份额分类以及相应修改基金合同和托管协议的公告》，博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金自 2016 年 3 月 22 日实施基金份额分类，具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

## § 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	
中信建投	1	3,468,175,516.46	58.91%	2,536,283.81	58.06%	-
国泰君安	1	2,418,850,173.91	41.09%	1,831,872.88	41.94%	-

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。

## 10.8 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	博时沪港深优质企业灵活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
2	博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额 2016 年境外主要市场节假日暂停申购赎回等交易类业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-22
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	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金实施基金份额分类公告的补充说明	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-25
5	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

6	博时沪港深优质企业灵活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	博时沪港深优质企业灵活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
8	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
9	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
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
12	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
13	博时沪港深优质企业灵活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
14	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
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	2016-05-25
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珠海盈米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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-26
19	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
20	博时基金管理有限公司关于博时沪港深优质企业灵活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	2016-05-31
21	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
22	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基	中国证券报、上海证券	2016-06-08

	金的申购、定投、最低持有数量限制的公告	报、证券时报	
23	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
24	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
25	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沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

11.1.2 《博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

11.1.3 《博时沪港深优质企业灵活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 博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本

11.1.6 报告期内博时沪港深优质企业灵活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