

博时回报灵活配置混合型证券投资基金

2016 年年度报告(摘要)

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十七日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时回报混合
基金主代码	050022
交易代码	050022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 11 月 8 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,138,498,898.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	为投资者的资产实现保值增值、提供全面超越通货膨胀的收益回报。
投资策略	本基金将通过综合观察流动性指标、产出类指标和价格类指标来预测判断流动性变化方向、资产价格水平的变化趋势和所处阶段，提前布局，进行大类资产的配置。各类指标包括但不限于：（1）流动性指标主要包括：各国不同层次的货币量增长、利率水平、货币政策和财政政策的变化、汇率变化；（2）产出类指标主要包括：GDP 增长率、工业增加值、发电量、产能利用率、国家各项产业政策等；（3）价格类指标：CPI 与 PPI 走势、商品价格和其他资产价格的变化等。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款基准利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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	中国建设银行股份有限公司
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	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-8,095,430.65	33,861,232.06	23,271,089.94
本期利润	-11,858,255.51	29,686,421.40	43,897,556.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0836	0.5955	0.1712
本期基金份额净值增长率	-11.40%	29.80%	26.90%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0210	0.8412	0.3991
期末基金资产净值	3,072,466,680.60	70,704,837.58	133,501,707.18
期末基金份额净值	0.979	1.878	1.529

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

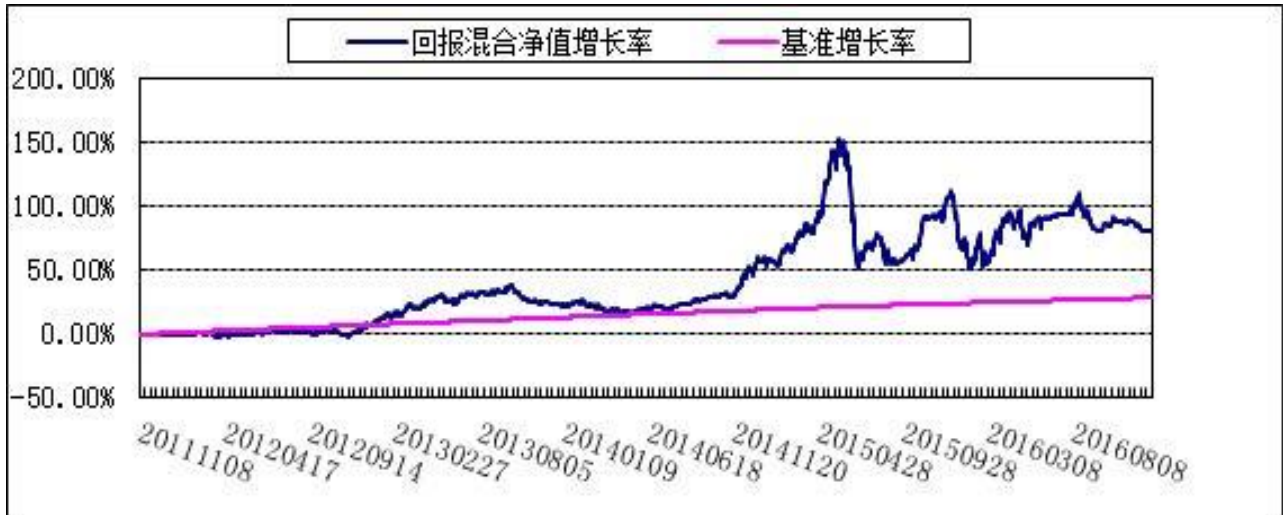
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.17%	0.70%	1.13%	0.02%	-0.96%	0.68%
过去六个月	-5.41%	0.92%	2.26%	0.01%	-7.67%	0.91%
过去一年	-11.40%	1.90%	4.50%	0.01%	-15.90%	1.89%
过去三年	45.93%	1.63%	15.59%	0.02%	30.34%	1.61%
过去五年	80.56%	1.34%	27.83%	0.02%	52.73%	1.32%
自基金合同生效起至今	81.10%	1.32%	28.79%	0.02%	52.31%	1.30%

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

博时回报灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

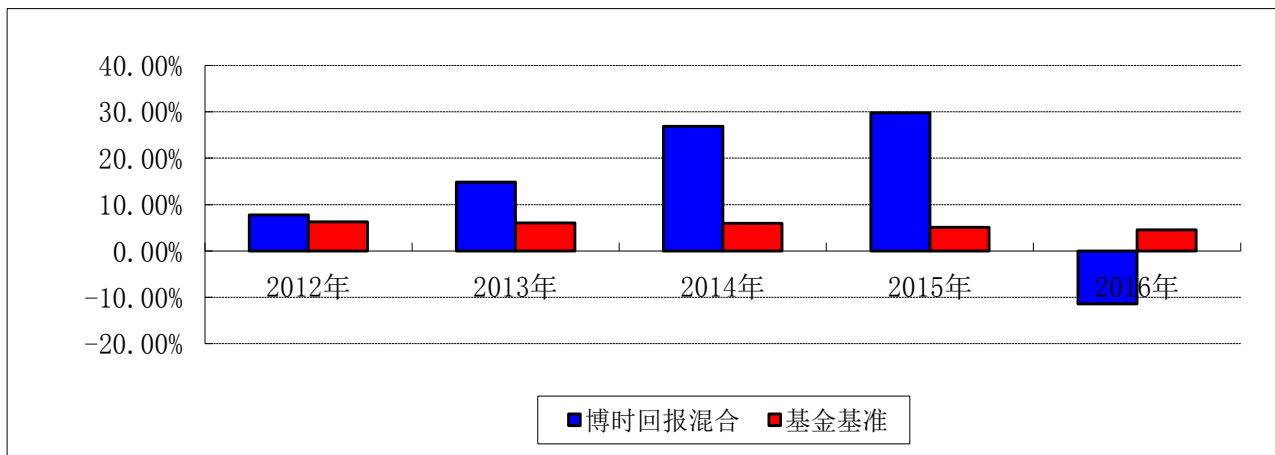
(2011 年 11 月 8 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时回报灵活配置混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2011 年 11 月 8 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2016年	6.849	3,172,470,989.96	10,168,430.82	3,182,639,420.78	2015年度分红
2015年	0.800	4,999,964.17	1,637,228.66	6,637,192.83	2014年度分红
2014年	0.360	9,885,475.49	2,877,891.50	12,763,366.99	2013年度分红
合计	8.009	3,187,356,429.62	14,683,550.98	3,202,039,980.60	-

§ 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 164 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，管理资产总规模逾 6250 亿元人民币，其中公募基金规模逾 3760 亿元人民币，累计分红逾 781 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，截至 2016 年年末，博时旗下共 94 只（份额分开计算）成立满一年的基金产品参与分类排名。其中排名在同类前 1/2 的产品共有 60 只（主动权益 17 只，债券 16 只，指数 20 只，货币 3 只，QDII 基金 4 只），约 64%；排名在前 1/3 的产品共有 45 只，约 48%；排名前 1/4 的产品共有 34 只，约 36%。博时旗下各类产品均有表现突出的产品位居行业前列。

黄金基金类，博时黄金 ETF(D 类) 今年以来净值增长率 19.10%，在同类 8 只排名第 1。

固收方面，长期标准债券型基金里，博时双月薪定期支付债券，今年以来净值增长率为 6.54%，在同类 61 只中排名第 2；博时信用债纯债（A 类），今年以来净值增长率为 4.23%，在同类中排名第 4；中短期标准债券型基金，博时安盈债券(A 类) 今年以来净值增长率为 2.02%，在同类 66 只排名第 1；普通债券型基金里，博时稳定价值债券（A 类）今年以来净值增长率为 2.31%，在同类排名前 1/3；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率为 3.03%，同类 194 只排名第 6。

QDII 基金，博时标普 500ETF 今年以来净值增长率 18.34%，同类排名前 1/4。博时亚洲票息收益债券(QDII) 今年以来净值增长率 14.43%，同类排名第 3。

2、 其他大事件

•2016 年 12 月 27 日，2016 金融新媒体峰会暨金 V 榜 2016 颁奖典礼在广州举行，博时基金荣获“最具传播力基金公司”奖项。

•2016 年 12 月 13 日，由中国经营报主办的“2016 第十四届中国企业竞争力年会暨金融

高峰论坛”在北京举行，博时基金荣获“2016 卓越竞争力品牌建设金融机构”奖项。

- 2016 年 12 月 9 日，在证券日报主办的“第十二届中国证券市场年会”上，博时基金荣膺中国证券市场“2016 年度最全能公募基金龙鼎奖”。

- 2016 年 12 月 8 日，金融界网站主办的首届智能金融国际论坛暨第五届金融界“领航中国”年度盛典，博时基金荣获“2016 年杰出品牌奖”。

- 2016 年 12 月 6 日，全国社会保障基金理事会发布公告，博时成为基本养老保险基金首批证券投资管理机构之一。

- 2016 年 12 月 1 日，由《经济观察报》主办的“2015-2016 年度观察家金融峰会”在沪举办，博时基金再次独家蝉联“卓越固定收益投资团队奖”。

- 2016 年 11 月 25 日，由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的 2016 年（第二届）CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金再次蝉联“年度最佳基金公司大奖”。

- 2016 年 11 月 23 日，由新浪财经主办的“2016 新浪全球资产管理论坛”在京举行，“2016 中国（首届）波特菲勒奖综合评选”结果揭晓。博时基金荣获“2016 最具互联网创新基金公司”、基金经理过钧获评“2016 最佳债券基金经理”、何凯获“2016 最佳 QDII 基金经理”。本届波特菲勒奖博时基金共斩获三项大奖，成为获奖最多的公募基金公司之一。

- 2016 年 11 月 17 日，全国社保基金境内投资管理人 2016 年座谈会在上海举行，博时基金副总裁董良泓荣获“五年服务社保奖”，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予 5 人，董良泓先生是自 2015 年之后再次蝉联该奖项。

- 2016 年 9 月 7 日，第二届结构性融资与资产证券化论坛暨 2016 年度资产证券化·介甫奖颁奖典礼上，“博时资本-平安银行橙鑫橙 e 资产支持专项计划”荣获“应收账款类最受投资者欢迎产品”和“最佳风控产品”两项大奖。

- 2016 年 8 月 5 日，由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨‘金帆奖’系列颁奖典礼上，博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖（博时资本）三项大奖。

- 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，博时基金荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

•2016 年 4 月 15 日，由中国基金报主办的第三届中国基金业英华奖评选揭晓，博时基金经理过钧先生获评三年期二级债基最佳基金经理、五年期二级债基最佳基金经理。

•2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈雷	基金经理	2014-12-08	2016-04-20	8.5	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，历任数据分析员、研究员、资深研究员、基金经理助理、博时回报灵活配置混合型证券投资基金、博时平衡配置混合型证券投资基金的基金经理。现任博时行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。
王晓冬	投资经理	2014-12-08	2016-01-20	7.7	2008 年起先后在上海理成资产管理有限公司、兴业证券从事行业研究工作。2011 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、资深研究员、基金经理助理、博时行业轮动混合型证券投资基金、博时回报灵活配置混合

					型证券投资基金、博时卓越品牌混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。现任投资经理。
兰乔	基金经理	2015-11-30	-	6.4	2010 年从清华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、高级研究员、资深研究员、基金经理助理、资本品组组长。现任博时回报混合基金兼博时卓越品牌混合 (LOF) 基金、博时工业 4.0 主题股票基金的基金经理。
陈伟	高级研究员 兼基金经理 助理	2015-06-15	-	3.5	2013 年 7 月从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，曾任研究员，现任研究部高级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。

博时基金管理有限公司于 2017 年 1 月 12 日发布公告称，尹哲先生担任本基金基金经理，兰乔先生不再担任本基金的基金经理。

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，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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 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 年中国经济在深化改革和结构突破中悄然度过。回首过去的 2016 年中国经济实现了 6.7% 的较高速增长，各项改革也在如期推进，资本市场也在制度建设方面取得了重要的成就。A 股从 2016 年的熔断之后就进行了缓慢回升，在这过程中结构性机会层出不穷。新能源汽车成为 A 股上半年的主要投资方向、供给侧改革等行业成为 A 股市场全面的热点。回报混合在资本市场熔断之后采取了较为积极的进攻策略，在这其中有效的参与了新能源汽车行业的投资，取得了阶段性的成果。同时我们也对次新股进行了前瞻性研究，也挖掘到了部分行业独特，盈利能力突出且大幅上涨的个股，也取得了一定的超额收益。16 年的下半年，我们认为随着新股发行节奏的加快，市场的估值体系发生了较为深刻的变化，回报混合果断的降低了股票仓位，进行了有效的调仓，调仓的方向主要是核心蓝筹，避免了市场系统性动荡的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.979 元，累计份额净值为 1.780 元，报告期内净值增长率为-11.40%，同期业绩基准涨幅为 4.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望了 2017 年我们认为在国内货币政策偏紧的大背景下，A 股难觅系统性投资机会。因此，我们将积极寻找中国改革的结构性机会。一方面我们认为在财政政策刺激的背景下很多 PPP 项目将会在 17 年快速落地，这也是国家深化改革和盘活实体经济的重要举措；另一方面，我也在认为在新股加速发行的大背景下，部分优质公司和个股将会成为我们未来寻找成长股的“主战场”，我们将采取自下而上的方式寻找符合中国经济转型背景下成长股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2016 年，我公司根据法律、法规的规定，制定、修订和完善了《博时货币市场基金投资管理制度》、《博时基金国债期货投资管理流程手册》、《博时基金国债期货风险管理流程手册》、

《博时基金流动性风险管理制度》、《关联交易管理办法》、《交易部公平交易管理制度》、《博时ETF基金风险管理制度》、《博时基金反洗钱工作手册》、《开放式基金业务规则》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：本基金收益每年最多分配4次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%；若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金管理人已于 2016 年 12 月 24 日发布公告，以 2016 年 12 月 9 日已实现的可分配利润为基准，本基金每 10 份基金份额发放红利 6.849 元人民币。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 3,182,639,420.78 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	2,270,579,779.94	8,591,842.64
结算备付金	1,301,878.12	127,162.43
存出保证金	267,999.23	76,542.48
交易性金融资产	1,089,336,766.39	65,587,074.47
其中：股票投资	1,063,041,558.59	50,824,687.67
基金投资	-	-
债券投资	26,295,207.80	14,762,386.80
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	700,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	676,015.49	102,007.41
应收股利	-	-
应收申购款	46,601.16	194,481.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,062,209,040.33	74,679,110.98
	本期末	上年度末
负债和所有者权益	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	665,143,946.75	3,180,959.67
应付赎回款	319,497,795.39	348,013.78
应付管理人报酬	1,346,568.26	82,783.96
应付托管费	224,428.04	13,797.30
应付销售服务费	-	-

应付交易费用	2,185,596.75	207,411.41
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,344,024.54	141,307.28
负债合计	989,742,359.73	3,974,273.40
所有者权益：	-	-
实收基金	3,138,498,898.27	37,644,632.03
未分配利润	-66,032,217.67	33,060,205.55
所有者权益合计	3,072,466,680.60	70,704,837.58
负债和所有者权益总计	4,062,209,040.33	74,679,110.98

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.979 元，基金份额总额 3,138,498,898.27 份。

7.2 利润表

会计主体：博时回报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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-2,657,252.93	32,747,952.08
1. 利息收入	1,684,839.14	750,738.16
其中：存款利息收入	691,879.81	109,264.10
债券利息收入	632,853.89	631,118.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	360,105.44	10,355.56
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,712,776.91	36,022,924.01
其中：股票投资收益	-4,293,341.75	34,296,904.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	809,408.33	1,329,248.29
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	771,156.51	396,771.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,762,824.86	-4,174,810.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,133,509.70	149,100.57
减：二、费用	9,201,002.58	3,061,530.68
1. 管理人报酬	2,621,271.07	1,248,609.30

2. 托管费	436,878.50	208,101.59
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,777,905.37	1,235,775.68
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	364,947.64	369,044.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-11,858,255.51	29,686,421.40
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-11,858,255.51	29,686,421.40

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时回报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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	37,644,632.03	33,060,205.55	70,704,837.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,858,255.51	-11,858,255.51
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）	3,100,854,266.24	3,095,405,253.07	6,196,259,519.31
其中：1. 基金申购款	4,752,410,941.08	3,156,774,015.15	7,909,184,956.23
2. 基金赎回款	-1,651,556,674.84	-61,368,762.08	-1,712,925,436.92
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）	-	-3,182,639,420.78	-3,182,639,420.78
五、期末所有者权益（基金净值）	3,138,498,898.27	-66,032,217.67	3,072,466,680.60
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	87,297,893.25	46,203,813.93	133,501,707.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	29,686,421.40	29,686,421.40

期利润)			
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)	-49,653,261.22	-36,192,836.95	-85,846,098.17
其中：1. 基金申购款	39,586,806.65	30,503,926.39	70,090,733.04
2. 基金赎回款	-89,240,067.87	-66,696,763.34	-155,936,831.21
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)	-	-6,637,192.83	-6,637,192.83
五、期末所有者权益(基金净值)	37,644,632.03	33,060,205.55	70,704,837.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、

债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、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,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。

7.4.3 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	1,029,751,303.04	21.99%	11,012,935.25	1.29%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	22,528.88	0.03%	-	-

7.4.4.1.4 债券回购交易

无。

7.4.4.1.5 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12月31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	796,833.96	22.57%	404,119.28	18.49%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	8,054.55	1.18%	8,054.55	3.88%

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,621,271.07	1,248,609.30
其中：支付销售机构的客户维护费	570,120.92	468,505.53

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。

7.4.4.2.2 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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	436,878.50	208,101.59

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

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,270,579,779.94	618,801.03	8,591,842.64	100,704.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	16,671	66,684.00	66,684.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002567	唐人神	2016-12-22	重大事项	12.64	2017-01-03	12.75	218,300	2,702,721.94	2,759,312.00	-
002795	永和智控	2016-12-02	重大资产重组	91.60	2017-03-22	82.44	31,700	2,749,583.00	2,903,720.00	-
300537	广信材料	2016-10-12	重大资产重组	48.79	2017-01-13	43.91	63,548	2,958,533.12	3,100,506.92	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(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 12 月 31 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 1,054,211,335.67 元，属于第二层次的余额为 35,125,430.72 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 45,245,619.52 元，第二层次 20,341,454.95 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 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,063,041,558.59	26.17
	其中：股票	1,063,041,558.59	26.17
2	固定收益投资	26,295,207.80	0.65
	其中：债券	26,295,207.80	0.65
	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	700,000,000.00	17.23
	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	2,271,881,658.06	55.93
7	其他各项资产	990,615.88	0.02
8	合计	4,062,209,040.33	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	70,601,779.20	2.30

C	制造业	335,317,832.21	10.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	96,745,281.26	3.15
E	建筑业	64,553,510.75	2.10
F	批发和零售业	96,333.68	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	45,608,031.69	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,269,533.36	0.11
J	金融业	446,849,256.44	14.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	1,063,041,558.59	34.60

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,501,488	124,057,719.84	4.04
2	601166	兴业银行	6,007,003	96,953,028.42	3.16
3	601288	农业银行	30,005,140	93,015,934.00	3.03
4	600887	伊利股份	5,201,669	91,549,374.40	2.98
5	601398	工商银行	14,996,527	66,134,684.07	2.15
6	600028	中国石化	12,000,400	64,922,164.00	2.11
7	600000	浦发银行	3,999,200	64,827,032.00	2.11
8	600068	葛洲坝	7,005,314	64,378,835.66	2.10
9	600900	长江电力	5,002,285	63,328,928.10	2.06
10	600276	恒瑞医药	1,354,164	61,614,462.00	2.01

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	224,546,508.83	317.58
2	601166	兴业银行	184,162,114.86	260.47
3	600276	恒瑞医药	126,604,897.16	179.06
4	601288	农业银行	120,807,885.00	170.86
5	600900	长江电力	106,056,364.06	150.00
6	601398	工商银行	103,140,218.78	145.87
7	600000	浦发银行	99,696,162.12	141.00
8	600887	伊利股份	90,411,779.59	127.87
9	600028	中国石化	68,251,962.72	96.53
10	600068	葛洲坝	62,915,629.83	88.98
11	601333	广深铁路	46,766,879.45	66.14
12	300525	博思软件	39,008,382.60	55.17
13	600489	中金黄金	35,109,755.45	49.66
14	000858	五粮液	34,694,060.75	49.07
15	600104	上汽集团	34,636,768.71	48.99
16	600820	隧道股份	33,662,179.11	47.61
17	600886	国投电力	33,370,582.86	47.20
18	000625	长安汽车	30,943,195.22	43.76
19	000876	新希望	30,855,156.01	43.64
20	300513	恒泰实达	28,247,656.54	39.95
21	300530	达志科技	22,660,221.00	32.05
22	002810	山东赫达	22,625,577.30	32.00
23	002777	久远银海	20,433,508.05	28.90
24	603737	三棵树	20,424,061.01	28.89
25	600690	青岛海尔	19,801,521.73	28.01
26	300535	达威股份	19,243,434.80	27.22
27	300516	久之洋	18,542,286.88	26.22
28	300531	优博讯	17,410,884.65	24.62
29	601328	交通银行	17,385,649.00	24.59
30	300515	三德科技	15,921,918.18	22.52
31	300499	高澜股份	14,565,642.49	20.60
32	300491	通合科技	14,017,255.00	19.83
33	000983	西山煤电	13,440,741.00	19.01
34	300484	蓝海华腾	13,406,543.00	18.96
35	000001	平安银行	13,334,433.60	18.86
36	300528	幸福蓝海	13,247,297.88	18.74
37	603012	创力集团	12,616,506.64	17.84
38	601595	上海电影	12,189,897.83	17.24
39	002808	苏州恒久	11,907,529.67	16.84
40	000538	云南白药	11,804,243.54	16.70
41	601699	潞安环能	11,773,206.20	16.65

42	300474	景嘉微	11,767,540.61	16.64
43	002787	华源控股	11,549,341.00	16.33
44	002809	红墙股份	11,094,012.05	15.69
45	300509	新美星	11,057,418.15	15.64
46	300494	盛天网络	11,042,772.65	15.62
47	002780	三夫户外	10,932,085.81	15.46
48	002788	鹭燕医药	10,764,727.60	15.22
49	603726	朗迪集团	10,614,345.22	15.01
50	300501	海顺新材	10,489,265.05	14.84
51	300540	深冷股份	10,434,125.13	14.76
52	300508	维宏股份	10,313,073.29	14.59
53	300507	苏奥传感	10,306,766.50	14.58
54	600348	阳泉煤业	10,167,924.44	14.38
55	603701	德宏股份	9,832,097.28	13.91
56	002806	华锋股份	9,796,086.00	13.85
57	300523	辰安科技	9,696,615.60	13.71
58	002795	永和智控	8,979,574.30	12.70
59	300505	川金诺	8,904,097.26	12.59
60	000002	万科 A	8,785,163.00	12.43
61	603016	新宏泰	8,708,565.74	12.32
62	300521	爱司凯	8,612,282.91	12.18
63	002673	西部证券	8,351,873.46	11.81
64	603398	邦宝益智	8,148,386.00	11.52
65	300481	濮阳惠成	8,047,075.49	11.38
66	600519	贵州茅台	7,722,381.40	10.92
67	002793	东音股份	7,691,663.43	10.88
68	300527	华舟应急	7,671,273.92	10.85
69	002762	金发拉比	7,658,669.17	10.83
70	603979	金诚信	7,612,260.99	10.77
71	603159	上海亚虹	7,418,075.90	10.49
72	300538	同益股份	7,343,284.50	10.39
73	601127	小康股份	7,316,664.16	10.35
74	300522	世名科技	7,209,314.00	10.20
75	603798	康普顿	6,876,564.62	9.73
76	300506	名家汇	6,736,525.39	9.53
77	603800	道森股份	6,610,910.00	9.35
78	603663	三祥新材	6,573,234.35	9.30
79	002530	丰东股份	6,543,041.00	9.25
80	603318	派思股份	6,497,828.00	9.19
81	300526	中潜股份	6,487,567.21	9.18
82	603131	上海沪工	6,371,302.52	9.01
83	300517	海波重科	6,316,911.84	8.93
84	603778	乾景园林	6,101,635.00	8.63

85	600016	民生银行	5,896,296.00	8.34
86	600531	豫光金铅	5,827,830.29	8.24
87	603885	吉祥航空	5,735,235.92	8.11
88	300486	东杰智能	5,652,122.10	7.99
89	002803	吉宏股份	5,632,415.93	7.97
90	300348	长亮科技	5,577,455.00	7.89
91	603030	全筑股份	5,524,998.41	7.81
92	603028	赛福天	5,509,494.57	7.79
93	300059	东方财富	5,438,482.00	7.69
94	300497	富祥股份	5,271,321.00	7.46
95	603322	超讯通信	5,226,346.95	7.39
96	002778	高科石化	5,172,976.00	7.32
97	603727	博迈科	5,160,909.56	7.30
98	002802	洪汇新材	5,115,748.58	7.24
99	603822	嘉澳环保	5,033,646.42	7.12
100	000878	云南铜业	4,933,044.00	6.98
101	002117	东港股份	4,860,766.87	6.87
102	002801	微光股份	4,801,297.00	6.79
103	002500	山西证券	4,732,499.00	6.69
104	002074	国轩高科	4,724,171.00	6.68
105	601628	中国人寿	4,707,303.76	6.66
106	603909	合诚股份	4,585,105.36	6.48
107	002805	丰元股份	4,557,310.00	6.45
108	300369	绿盟科技	4,437,274.00	6.28
109	300427	红相电力	4,347,771.50	6.15
110	600362	江西铜业	4,335,374.70	6.13
111	300459	金科娱乐	4,323,976.60	6.12
112	603515	欧普照明	4,314,884.48	6.10
113	600029	南方航空	4,312,395.00	6.10
114	601555	东吴证券	4,306,569.36	6.09
115	300503	昊志机电	4,245,067.07	6.00
116	000060	中金岭南	4,223,342.87	5.97
117	002630	华西能源	4,166,555.00	5.89
118	600188	兖州煤业	4,125,205.24	5.83
119	002821	凯莱英	4,120,061.51	5.83
120	600782	新钢股份	4,090,189.00	5.78
121	002066	瑞泰科技	4,058,976.37	5.74
122	002768	国恩股份	4,034,911.34	5.71
123	600547	山东黄金	4,021,383.00	5.69
124	603696	安记食品	4,004,441.00	5.66
125	600123	兰花科创	3,989,012.00	5.64
126	002008	大族激光	3,950,864.00	5.59
127	600570	恒生电子	3,943,377.00	5.58

128	601198	东兴证券	3,939,502.00	5.57
129	600958	东方证券	3,937,180.40	5.57
130	603658	安图生物	3,923,036.00	5.55
131	002286	保龄宝	3,920,927.91	5.55
132	600298	安琪酵母	3,857,579.00	5.46
133	603288	海天味业	3,855,319.00	5.45
134	600600	青岛啤酒	3,853,368.90	5.45
135	000712	锦龙股份	3,812,759.15	5.39
136	300532	今天国际	3,812,699.94	5.39
137	603258	电魂网络	3,775,225.00	5.34
138	300327	中颖电子	3,768,207.00	5.33
139	603958	哈森股份	3,728,504.12	5.27
140	300420	五洋科技	3,594,757.10	5.08
141	603866	桃李面包	3,494,090.00	4.94
142	600977	中国电影	3,445,674.00	4.87
143	300487	蓝晓科技	3,415,801.69	4.83
144	000069	华侨城 A	3,318,001.15	4.69
145	600988	赤峰黄金	3,219,404.50	4.55
146	002781	奇信股份	3,210,545.00	4.54
147	603520	司太立	3,140,513.18	4.44
148	603861	白云电器	3,136,289.68	4.44
149	601336	新华保险	3,133,712.00	4.43
150	300469	信息发展	3,049,962.36	4.31
151	300512	中亚股份	2,995,175.99	4.24
152	300383	光环新网	2,990,754.84	4.23
153	300558	贝达药业	2,989,549.65	4.23
154	603160	汇顶科技	2,987,845.80	4.23
155	603888	新华网	2,977,186.40	4.21
156	300539	横河模具	2,974,479.36	4.21
157	300541	先进数通	2,974,146.92	4.21
158	300546	雄帝科技	2,959,997.00	4.19
159	600446	金证股份	2,959,603.74	4.19
160	300377	赢时胜	2,958,845.74	4.18
161	300537	广信材料	2,958,533.12	4.18
162	002659	中泰桥梁	2,947,553.00	4.17
163	600730	中国高科	2,946,393.00	4.17
164	300407	凯发电气	2,945,865.00	4.17
165	000526	紫光学大	2,944,862.25	4.17
166	300422	博世科	2,944,324.00	4.16
167	601500	通用股份	2,921,513.16	4.13
168	603067	振华股份	2,918,979.86	4.13
169	603313	梦百合	2,918,806.59	4.13
170	603901	永创智能	2,906,566.00	4.11

171	600847	万里股份	2,875,382.00	4.07
172	002285	世联行	2,874,463.12	4.07
173	603005	晶方科技	2,861,232.00	4.05
174	002791	坚朗五金	2,856,928.29	4.04
175	002782	可立克	2,842,159.67	4.02
176	300457	赢合科技	2,834,200.00	4.01
177	002245	澳洋顺昌	2,832,884.08	4.01
178	002456	欧菲光	2,817,361.00	3.98
179	603859	能科股份	2,801,768.00	3.96
180	300553	集智股份	2,786,007.00	3.94
181	603007	花王股份	2,785,601.00	3.94
182	002207	准油股份	2,763,560.00	3.91
183	601020	华钰矿业	2,755,775.00	3.90
184	603300	华铁科技	2,740,264.00	3.88
185	002128	露天煤业	2,727,988.00	3.86
186	601666	平煤股份	2,722,520.53	3.85
187	002452	长高集团	2,716,840.40	3.84
188	300550	和仁科技	2,712,047.00	3.84
189	002548	金新农	2,706,422.00	3.83
190	002567	唐人神	2,702,721.94	3.82
191	603609	禾丰牧业	2,702,493.20	3.82
192	600990	四创电子	2,702,255.98	3.82
193	600110	诺德股份	2,701,053.00	3.82
194	601668	中国建筑	2,690,345.00	3.81
195	600185	格力地产	2,689,215.25	3.80
196	000728	国元证券	2,683,695.18	3.80
197	600376	首开股份	2,683,140.00	3.79
198	000780	平庄能源	2,662,543.00	3.77
199	000959	首钢股份	2,661,247.00	3.76
200	600121	郑州煤电	2,660,815.42	3.76
201	600497	驰宏锌锗	2,660,527.16	3.76
202	300041	回天新材	2,656,731.67	3.76
203	002797	第一创业	2,655,305.00	3.76
204	300256	星星科技	2,643,597.00	3.74
205	600435	北方导航	2,631,473.09	3.72
206	002151	北斗星通	2,631,162.04	3.72
207	600198	大唐电信	2,630,306.64	3.72
208	600155	宝硕股份	2,628,648.00	3.72
209	002736	国信证券	2,622,451.56	3.71
210	603996	中新科技	2,608,390.00	3.69
211	600305	恒顺醋业	2,581,687.31	3.65
212	002202	金风科技	2,572,127.00	3.64
213	300045	华力创通	2,500,059.52	3.54

214	603936	博敏电子	2,447,076.20	3.46
215	601811	新华文轩	2,442,431.28	3.45
216	300440	运达科技	2,421,819.79	3.43
217	603556	海兴电力	2,388,440.00	3.38
218	300559	佳发安泰	2,373,179.00	3.36
219	002817	黄山胶囊	2,342,249.44	3.31
220	002790	瑞尔特	2,330,019.76	3.30
221	002353	杰瑞股份	2,322,923.00	3.29
222	300141	和顺电气	2,279,906.00	3.22
223	601988	中国银行	2,263,063.00	3.20
224	300349	金卡股份	2,228,198.00	3.15
225	300496	中科创达	2,155,015.00	3.05
226	300081	恒信移动	2,146,496.18	3.04
227	600216	浙江医药	2,054,850.00	2.91
228	000606	*ST 易桥	2,044,245.00	2.89
229	600303	曙光股份	2,016,000.00	2.85
230	300116	坚瑞沃能	2,006,281.00	2.84
231	601669	中国电建	2,004,183.00	2.83
232	601857	中国石油	1,993,167.00	2.82
233	300542	新晨科技	1,984,428.48	2.81
234	300543	朗科智能	1,978,205.00	2.80
235	603189	网达软件	1,974,847.00	2.79
236	603738	泰晶科技	1,972,910.20	2.79
237	300352	北信源	1,966,964.00	2.78
238	603393	新天然气	1,939,628.66	2.74
239	002097	山河智能	1,937,751.00	2.74
240	300548	博创科技	1,880,829.50	2.66
241	002813	路畅科技	1,879,303.00	2.66
242	300262	巴安水务	1,871,170.42	2.65
243	000598	兴蓉环境	1,870,893.99	2.65
244	601718	际华集团	1,869,992.00	2.64
245	002816	和科达	1,862,440.53	2.63
246	603608	天创时尚	1,859,956.34	2.63
247	601901	方正证券	1,858,578.00	2.63
248	002820	桂发祥	1,812,857.13	2.56
249	002818	富森美	1,802,455.10	2.55
250	603918	金桥信息	1,797,991.70	2.54
251	300552	万集科技	1,793,656.25	2.54
252	601229	上海银行	1,787,491.00	2.53
253	300551	古鳌科技	1,786,116.00	2.53
254	002798	帝王洁具	1,784,831.92	2.52
255	603060	国检集团	1,779,589.07	2.52
256	300502	新易盛	1,769,530.48	2.50

257	603919	金徽酒	1,727,813.32	2.44
258	002091	江苏国泰	1,726,386.90	2.44
259	603027	千禾味业	1,642,083.16	2.32
260	603299	井神股份	1,615,447.00	2.28
261	002783	凯龙股份	1,606,784.00	2.27
262	603568	伟明环保	1,588,138.00	2.25
263	002775	文科园林	1,587,249.00	2.24
264	000967	盈峰环境	1,586,916.00	2.24
265	300495	美尚生态	1,566,696.00	2.22
266	603508	思维列控	1,561,038.00	2.21
267	300455	康拓红外	1,556,593.00	2.20
268	300490	华自科技	1,541,678.00	2.18
269	002767	先锋电子	1,486,838.00	2.10
270	300238	冠昊生物	1,450,800.00	2.05
271	601900	南方传媒	1,447,949.37	2.05
272	601001	大同煤业	1,425,912.00	2.02
273	002785	万里石	1,425,560.00	2.02
274	600546	*ST 山煤	1,425,126.00	2.02

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

8.4.2 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	103,354,584.44	146.18
2	601166	兴业银行	87,661,961.03	123.98
3	600276	恒瑞医药	63,782,020.29	90.21
4	600900	长江电力	42,238,052.00	59.74
5	300525	博思软件	38,188,075.92	54.01
6	601398	工商银行	37,252,265.86	52.69
7	600489	中金黄金	36,050,038.57	50.99
8	600000	浦发银行	34,191,752.31	48.36
9	600820	隧道股份	33,331,187.06	47.14
10	300513	恒泰实达	28,927,360.36	40.91
11	601288	农业银行	27,246,598.00	38.54
12	300530	达志科技	22,758,580.00	32.19
13	603737	三棵树	20,114,295.36	28.45
14	002810	山东赫达	19,954,709.01	28.22
15	600690	青岛海尔	19,678,668.66	27.83
16	300535	达威股份	18,757,680.09	26.53
17	002777	久远银海	18,743,114.22	26.51
18	300516	久之洋	18,420,051.47	26.05

19	300531	优博讯	16,496,224.79	23.33
20	601328	交通银行	15,555,343.00	22.00
21	300515	三德科技	15,506,309.06	21.93
22	300491	通合科技	15,122,005.34	21.39
23	300499	高澜股份	14,860,349.15	21.02
24	603012	创力集团	14,613,845.36	20.67
25	300484	蓝海华腾	14,461,554.00	20.45
26	000983	西山煤电	14,116,238.29	19.97
27	300508	维宏股份	13,599,566.95	19.23
28	300528	幸福蓝海	13,592,725.29	19.22
29	000001	平安银行	13,166,202.40	18.62
30	300474	景嘉微	12,483,466.40	17.66
31	601595	上海电影	12,425,315.60	17.57
32	601699	潞安环能	11,860,374.88	16.77
33	002808	苏州恒久	11,780,573.87	16.66
34	002787	华源控股	11,493,623.74	16.26
35	300509	新美星	11,252,354.48	15.91
36	002809	红墙股份	10,882,419.10	15.39
37	300494	盛天网络	10,747,553.69	15.20
38	603318	派思股份	10,741,362.54	15.19
39	603726	朗迪集团	10,673,281.38	15.10
40	300507	苏奥传感	10,631,994.16	15.04
41	300540	深冷股份	10,555,438.82	14.93
42	300501	海顺新材	10,395,167.60	14.70
43	002780	三夫户外	10,270,113.38	14.53
44	600348	阳泉煤业	10,193,635.52	14.42
45	002788	鹭燕医药	10,006,630.96	14.15
46	002806	华锋股份	9,653,424.00	13.65
47	300481	濮阳惠成	9,439,477.84	13.35
48	000538	云南白药	9,414,373.64	13.32
49	300523	辰安科技	9,137,741.00	12.92
50	603701	德宏股份	9,074,203.60	12.83
51	300505	川金诺	8,810,130.19	12.46
52	000002	万科 A	8,759,131.32	12.39
53	603016	新宏泰	8,533,216.68	12.07
54	300521	爱司凯	8,104,733.12	11.46
55	002673	西部证券	8,021,090.07	11.34
56	600519	贵州茅台	7,815,689.52	11.05
57	300527	华舟应急	7,669,854.37	10.85
58	300522	世名科技	7,548,324.50	10.68
59	603159	上海亚虹	7,526,822.40	10.65
60	002793	东音股份	7,430,766.78	10.51
61	601127	小康股份	7,357,354.66	10.41

62	300538	同益股份	7,190,439.34	10.17
63	300486	东杰智能	7,184,796.60	10.16
64	603798	康普顿	6,903,540.40	9.76
65	603800	道森股份	6,720,600.76	9.51
66	603398	邦宝益智	6,653,265.68	9.41
67	002768	国恩股份	6,509,503.71	9.21
68	603131	上海沪工	6,472,239.02	9.15
69	002795	永和智控	6,439,771.72	9.11
70	603778	乾景园林	6,339,838.00	8.97
71	603663	三祥新材	6,288,713.25	8.89
72	300526	中潜股份	6,253,688.64	8.84
73	600531	豫光金铅	6,224,888.00	8.80
74	300517	海波重科	5,976,418.12	8.45
75	600016	民生银行	5,896,296.00	8.34
76	000060	中金岭南	5,628,975.00	7.96
77	603030	全筑股份	5,582,429.75	7.90
78	603885	吉祥航空	5,483,513.13	7.76
79	300348	长亮科技	5,391,081.24	7.62
80	000878	云南铜业	5,384,547.00	7.62
81	300059	东方财富	5,367,977.00	7.59
82	603822	嘉澳环保	5,193,509.50	7.35
83	002803	吉宏股份	5,185,966.35	7.33
84	002802	洪汇新材	5,151,694.00	7.29
85	002778	高科石化	5,055,686.00	7.15
86	603322	超讯通信	5,048,300.04	7.14
87	300487	蓝晓科技	4,996,633.17	7.07
88	603028	赛福天	4,965,853.45	7.02
89	300506	名家汇	4,952,150.63	7.00
90	300497	富祥股份	4,919,271.00	6.96
91	300459	金科娱乐	4,889,469.67	6.92
92	603979	金诚信	4,702,461.60	6.65
93	601628	中国人寿	4,668,419.00	6.60
94	002117	东港股份	4,588,680.54	6.49
95	002805	丰元股份	4,564,406.34	6.46
96	002801	微光股份	4,545,632.00	6.43
97	300503	昊志机电	4,536,194.23	6.42
98	300369	绿盟科技	4,504,842.00	6.37
99	002500	山西证券	4,502,082.86	6.37
100	002074	国轩高科	4,481,295.42	6.34
101	603515	欧普照明	4,399,471.24	6.22
102	600362	江西铜业	4,335,742.70	6.13
103	603909	合诚股份	4,307,591.90	6.09
104	601555	东吴证券	4,279,554.56	6.05

105	600782	新钢股份	4,278,274.00	6.05
106	002630	华西能源	4,214,153.00	5.96
107	300427	红相电力	4,202,131.53	5.94
108	600188	兖州煤业	4,113,736.50	5.82
109	600029	南方航空	4,074,680.00	5.76
110	603658	安图生物	4,042,945.01	5.72
111	600123	兰花科创	4,019,790.00	5.69
112	002008	大族激光	4,017,326.00	5.68
113	002762	金发拉比	4,014,677.90	5.68
114	600570	恒生电子	4,001,087.00	5.66
115	600547	山东黄金	3,941,680.00	5.57
116	002286	保龄宝	3,862,672.00	5.46
117	300327	中颖电子	3,856,195.38	5.45
118	603258	电魂网络	3,832,882.00	5.42
119	600958	东方证券	3,772,286.48	5.34
120	601198	东兴证券	3,757,897.87	5.31
121	300532	今天国际	3,731,069.00	5.28
122	600600	青岛啤酒	3,724,237.00	5.27
123	603958	哈森股份	3,672,394.40	5.19
124	603288	海天味业	3,642,477.87	5.15
125	000712	锦龙股份	3,612,190.00	5.11
126	600497	驰宏锌锗	3,549,543.03	5.02
127	002502	骅威文化	3,525,368.00	4.99
128	603300	华铁科技	3,509,740.50	4.96
129	300420	五洋科技	3,425,304.60	4.84
130	300422	博世科	3,419,532.00	4.84
131	000069	华侨城 A	3,393,972.70	4.80
132	002782	可立克	3,392,466.04	4.80
133	603866	桃李面包	3,329,293.84	4.71
134	002452	长高集团	3,325,438.01	4.70
135	600977	中国电影	3,280,923.58	4.64
136	603520	司太立	3,245,852.00	4.59
137	300469	信息发展	3,243,271.86	4.59
138	600988	赤峰黄金	3,170,354.00	4.48
139	601500	通用股份	3,168,253.36	4.48
140	601336	新华保险	3,126,707.00	4.42
141	600730	中国高科	3,121,892.65	4.42
142	300512	中亚股份	3,071,733.79	4.34
143	300407	凯发电气	3,066,840.58	4.34
144	002207	准油股份	3,060,658.00	4.33
145	000526	紫光学大	3,006,668.94	4.25
146	600446	金证股份	3,004,766.00	4.25
147	603007	花王股份	2,999,313.15	4.24

148	300541	先进数通	2,993,567.84	4.23
149	300539	横河模具	2,992,011.11	4.23
150	002659	中泰桥梁	2,980,556.55	4.22
151	300256	星星科技	2,962,046.70	4.19
152	300383	光环新网	2,944,911.00	4.17
153	002781	奇信股份	2,928,512.10	4.14
154	603888	新华网	2,927,871.12	4.14
155	603160	汇顶科技	2,921,581.36	4.13
156	300558	贝达药业	2,916,726.40	4.13
157	300377	赢时胜	2,882,306.00	4.08
158	603901	永创智能	2,879,371.00	4.07
159	002285	世联行	2,870,030.86	4.06
160	002151	北斗星通	2,848,406.00	4.03
161	603005	晶方科技	2,837,413.04	4.01
162	300041	回天新材	2,828,519.72	4.00
163	603861	白云电器	2,827,233.40	4.00
164	603859	能科股份	2,808,613.00	3.97
165	600435	北方导航	2,807,110.01	3.97
166	300553	集智股份	2,803,325.00	3.96
167	002791	坚朗五金	2,801,358.54	3.96
168	002736	国信证券	2,789,334.74	3.95
169	002128	露天煤业	2,781,814.68	3.93
170	601666	平煤股份	2,777,051.62	3.93
171	300546	雄帝科技	2,775,000.00	3.92
172	603313	梦百合	2,764,965.29	3.91
173	600198	大唐电信	2,738,918.21	3.87
174	000780	平庄能源	2,735,759.00	3.87
175	300550	和仁科技	2,716,408.00	3.84
176	002797	第一创业	2,710,468.93	3.83
177	601668	中国建筑	2,690,345.00	3.81
178	600121	郑州煤电	2,690,067.06	3.80
179	600376	首开股份	2,684,137.00	3.80
180	002530	丰东股份	2,674,992.00	3.78
181	600847	万里股份	2,666,839.00	3.77
182	600305	恒顺醋业	2,661,974.80	3.76
183	000959	首钢股份	2,660,843.90	3.76
184	300045	华力创通	2,647,088.00	3.74
185	002245	澳洋顺昌	2,638,979.00	3.73
186	600185	格力地产	2,635,474.65	3.73
187	000728	国元证券	2,627,240.47	3.72
188	002456	欧菲光	2,617,959.72	3.70
189	300230	永利股份	2,531,519.84	3.58
190	002202	金风科技	2,515,499.00	3.56

191	603067	振华股份	2,509,824.00	3.55
192	300457	赢合科技	2,506,848.00	3.55
193	600155	宝硕股份	2,480,216.80	3.51
194	002776	柏堡龙	2,446,679.00	3.46
195	601988	中国银行	2,384,426.00	3.37
196	002817	黄山胶囊	2,375,959.04	3.36
197	002790	瑞尔特	2,356,432.50	3.33
198	300141	和顺电气	2,343,603.08	3.31
199	300440	运达科技	2,293,462.00	3.24
200	603556	海兴电力	2,291,013.00	3.24
201	603598	引力传媒	2,278,578.00	3.22
202	300559	佳发安泰	2,261,786.00	3.20
203	002353	杰瑞股份	2,257,957.00	3.19
204	601811	新华文轩	2,246,262.82	3.18
205	603996	中新科技	2,242,749.00	3.17
206	300496	中科创达	2,229,776.70	3.15
207	601718	际华集团	2,194,565.00	3.10
208	002771	真视通	2,188,995.00	3.10
209	603189	网达软件	2,184,294.00	3.09
210	601020	华钰矿业	2,088,945.00	2.95
211	002766	索菱股份	2,085,730.95	2.95
212	601669	中国电建	2,080,701.00	2.94
213	300349	金卡股份	2,080,086.00	2.94
214	600303	曙光股份	2,060,725.00	2.91
215	300116	坚瑞沃能	2,053,195.00	2.90
216	600216	浙江医药	2,039,385.50	2.88
217	300352	北信源	2,030,331.00	2.87
218	603918	金桥信息	2,021,280.14	2.86
219	300542	新晨科技	1,999,168.48	2.83
220	300081	恒信移动	1,985,684.00	2.81
221	300543	朗科智能	1,981,974.00	2.80
222	601857	中国石油	1,978,614.00	2.80
223	603738	泰晶科技	1,951,738.00	2.76
224	002813	路畅科技	1,945,334.00	2.75
225	002097	山河智能	1,939,933.60	2.74
226	300548	博创科技	1,935,101.00	2.74
227	002816	和科达	1,925,793.00	2.72
228	000598	兴蓉环境	1,914,563.00	2.71
229	601901	方正证券	1,875,918.00	2.65
230	603393	新天然气	1,864,985.82	2.64
231	002783	凯龙股份	1,864,660.00	2.64
232	603060	国检集团	1,839,180.00	2.60
233	603936	博敏电子	1,810,614.00	2.56

234	603608	天创时尚	1,792,175.00	2.53
235	300552	万集科技	1,781,436.15	2.52
236	603919	金徽酒	1,769,886.00	2.50
237	002798	帝王洁具	1,761,567.00	2.49
238	002091	江苏国泰	1,756,745.04	2.48
239	300262	巴安水务	1,753,152.40	2.48
240	603027	千禾味业	1,751,770.00	2.48
241	601229	上海银行	1,743,015.00	2.47
242	002818	富森美	1,734,640.00	2.45
243	300502	新易盛	1,716,897.66	2.43
244	300495	美尚生态	1,712,683.00	2.42
245	000606	*ST 易桥	1,704,780.68	2.41
246	300551	古鳌科技	1,694,786.00	2.40
247	603508	思维列控	1,656,005.00	2.34
248	300455	康拓红外	1,652,765.00	2.34
249	000967	盈峰环境	1,615,299.00	2.28
250	600680	上海普天	1,563,817.59	2.21
251	002820	桂发祥	1,557,671.04	2.20
252	300483	沃施股份	1,549,614.00	2.19
253	002775	文科园林	1,544,033.00	2.18
254	601900	南方传媒	1,533,996.00	2.17
255	002767	先锋电子	1,527,144.00	2.16
256	603727	博迈科	1,512,376.00	2.14
257	603568	伟明环保	1,476,362.00	2.09
258	002388	新亚制程	1,455,475.00	2.06
259	300238	冠昊生物	1,432,493.00	2.03
260	300190	维尔利	1,427,027.00	2.02
261	600884	杉杉股份	1,421,395.00	2.01

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。

8.4.3 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	2,851,074,327.31
卖出股票的收入（成交）总额	1,831,971,739.99

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。

8.5 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	26,295,207.80	0.86
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,295,207.80	0.86

8.6 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	010303	03 国债(3)	238,660	24,283,655.00	0.79
2	010107	21 国债(7)	18,900	1,989,225.00	0.06
3	101303	国债 1303	220	22,327.80	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	267,999.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	676,015.49
5	应收申购款	46,601.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	990,615.88

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
5,761	544,783.70	3,076,063,661.55	98.01%	62,435,236.72	1.99%

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	-	-

9.3 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	-

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年11月8日)基金份额总额	606,262,015.37
本报告期期初基金份额总额	37,644,632.03
本报告期基金总申购份额	4,752,410,941.08
减：本报告期基金总赎回份额	1,651,556,674.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,138,498,898.27

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 40000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
国开证券	1	1,153,537,309.08	24.64%	843,567.52	23.89%	-
招商证券	2	1,029,751,303.04	21.99%	796,833.96	22.57%	-
西南证券	1	639,210,451.89	13.65%	467,466.48	13.24%	-
华创证券	2	311,776,223.36	6.66%	227,984.75	6.46%	-
东方证券	3	267,966,646.61	5.72%	195,967.80	5.55%	-
第一创业	2	262,096,818.39	5.60%	191,672.19	5.43%	-
中信证券	4	238,857,749.56	5.10%	178,034.45	5.04%	-
海通证券	1	147,760,863.11	3.16%	108,058.03	3.06%	-
川财证券	1	126,710,616.66	2.71%	92,648.75	2.62%	-
国金证券	1	88,204,752.67	1.88%	64,494.49	1.83%	-
中信建投	2	81,227,593.89	1.73%	75,644.66	2.14%	-
高华证券	1	71,418,042.62	1.53%	66,511.82	1.88%	-
华信证券	1	55,702,516.49	1.19%	40,735.28	1.15%	-
瑞银证券	1	54,239,881.27	1.16%	50,507.43	1.43%	-
平安证券	1	42,966,741.65	0.92%	40,014.69	1.13%	-
长江证券	2	35,111,319.38	0.75%	32,700.07	0.93%	-
安信证券	1	26,636,634.03	0.57%	19,479.69	0.55%	-
国信证券	1	21,249,349.56	0.45%	15,531.89	0.44%	-
华福证券	1	15,565,067.00	0.33%	11,382.23	0.32%	-
兴业证券	1	12,138,322.09	0.26%	11,301.11	0.32%	-

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。

11.7.2 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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国开证券	13,863,064.80	20.60%	324,500,000.00	10.73%	-	-
招商证券	22,528.88	0.03%	-	-	-	-
西南证券	293,005.80	0.44%	700,000,000.00	23.14%	-	-
华创证券	16,086,941.70	23.90%	-	-	-	-
东方证券	-	-	2,000,000,000.00	66.13%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	14,396,424.00	21.39%	-	-	-	-
国金证券	8,307,999.00	12.34%	-	-	-	-
中信建投	2,658,890.10	3.95%	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	6,280,466.50	9.33%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	2,221,675.00	3.30%	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	3,169,434.50	4.71%	-	-	-	-

博时基金管理有限公司
二〇一七年三月二十七日