

博时行业轮动混合型证券投资基金

2016 年年度报告

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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 管理层对财务报表的责任	14
6.2 注册会计师的责任	14
6.3 审计意见	15
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	43
8.3 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	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
8.7 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	55

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	55
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	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§ 9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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的情况	56
§ 10 开放式基金份额变动	57
§ 11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	61
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时行业轮动混合型证券投资基金
基金简称	博时行业轮动混合
基金主代码	050018
交易代码	050018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 10 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	229,891,306.38 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入分析经济周期不同阶段的关键驱动因素和不同行业股价波动的关键驱动因子，把握周期性行业与稳定性行业轮动、周期性行业内部轮动的规律，力争实现在经济周期和行业景气波动下的资产稳定增值。
投资策略	本基金具体投资策略分三个层次：首先是大类资产的配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业轮动的规律和经济发展的内在逻辑，在经济周期的不同阶段，配置不同的行业；最后是个股选择策略和债券投资策略。行业轮动策略是本基金的核心策略。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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		中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话	95105568	010-67595096	
传真	0755-83195140	010-66275853	
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号 楼	
邮政编码	518040	100033	
法定代表人	张光华	王洪章	

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	基金管理人及基金托管人住所

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	7,343,753.19	-4,545,818.90	48,296,606.42
本期利润	-670,827.38	-10,353,602.41	43,621,339.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0028	-0.0394	0.0994
本期加权平均净值利润率	-0.29%	-3.63%	12.98%
本期基金份额净值增长率	-1.85%	13.00%	16.11%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-22,640,688.62	-28,299,292.87	-31,519,321.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0985	-0.1405	-0.0934
期末基金资产净值	231,438,209.30	206,587,050.17	306,271,462.48
期末基金份额净值	1.007	1.026	0.908
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	0.70%	2.60%	-9.20%

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

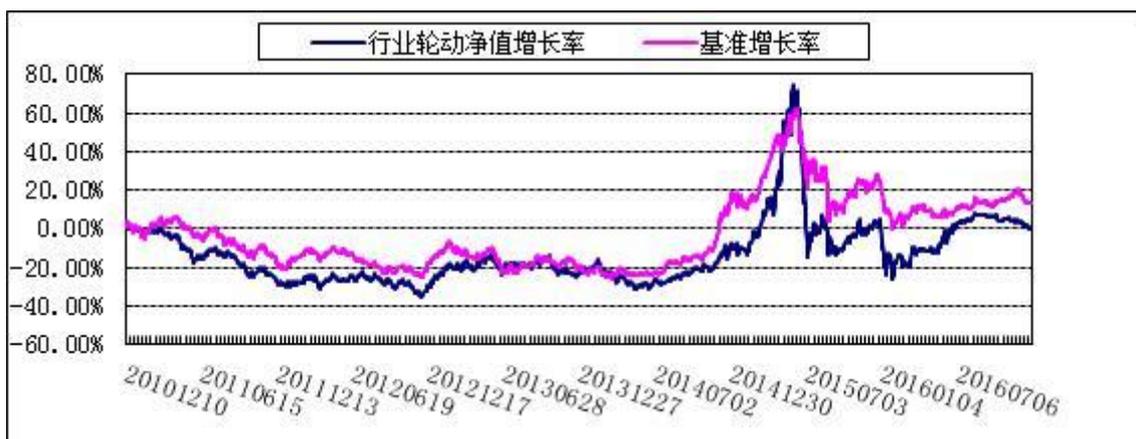
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

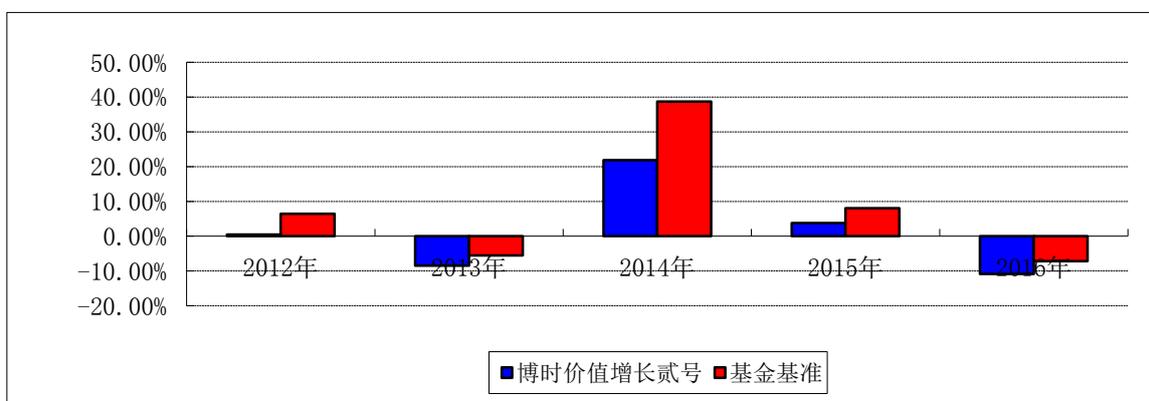
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.27%	0.50%	1.02%	0.58%	-6.29%	-0.08%
过去六个月	0.30%	0.48%	3.99%	0.61%	-3.69%	-0.13%
过去一年	-1.85%	1.81%	-8.54%	1.12%	6.69%	0.69%
过去三年	28.77%	1.99%	40.40%	1.43%	-11.63%	0.56%
过去五年	39.47%	1.72%	40.72%	1.30%	-1.25%	0.42%
自基金合同生效起至今	0.70%	1.61%	13.65%	1.26%	-12.95%	0.35%

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



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



§ 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		
王晓冬	投资经理	2014-08-29	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。
陈雷	基金经理	2014-08-29	-	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。

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，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

报告期内本基金采取了相对灵活的仓位控制和行业选择，阶段性地把握不同市场背景下的投资机会，以希望能够为持有人贡献正的绝对收益和相对较低的净值回撤。具体地，本基金上半年积极参与 1 月市场大幅下跌之后提供的新兴行业投资机会，而下半年则在经济回升新兴行业估值偏贵的背景下以持有受益于主板盈利能力回升的行业为主，全年来看本基金相对市场有一定的相对收益但非常遗憾未能取得绝对收益。特别地，本基金业绩在下半年表现不太理想，主要原因在于对回撤的控制使得对机会的把握不够理想，尤其是错过 PPP 行业的投资机会。今后在回撤控制和机会把握上，本基金将采取更平衡的策略以使得变现优化。

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 1.007 元，累计份额净值为 1.007 元，

报告期内净值增长率为-1.85%，同期业绩基准涨幅为-8.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济层面，16 年 9 月以来，宏观经济的复苏得到微观数据的持续验证，包括发电量、铁路货运量、重卡工程机械销量等数据均出现明显的回升。流动性层面，受到国内防风险的导向和美国市场利率预期上升的影响，市场对流动性收紧的预期逐步形成。

市场展望角度，由于实业从业人员普遍对经济的预期较低导致本轮复苏的持续时间较长，经济复苏的趋势仍然在持续，这有利于宏观经济敏感性行业的盈利回升。流动性层面，防风险背景下货币政策中性定调，难以观察到明显的放松。因此我们认为短期内经济敏感性的行业仍然将表现较好，而中期成长性较高的成长性行业在估值进一步收缩后也将迎来机会。目前本基金在持仓上仍然以金融、建筑、消费、环保等行业个股为主，这部分行业和个股将受益于盈利的回升且估值较为合理。

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

本基金收益分配原则：在符合有关基金分红条件的前提下，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。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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

普华永道中天审字(2017)第 21544 号

博时行业轮动混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的博时行业轮动混合型证券投资基金(原博时行业轮动股票型证券投资基金，以下简称“博时行业轮动混合”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日资产负债表、2016 年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是博时行业轮动混合的基金管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国

注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述博时行业轮动混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时行业轮动混合 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

薛 竞

中国·上海市黄浦区湖滨路 202 号
普华永道中心 11 楼

注册会计师

2017 年 3 月 24 日

张 振 波

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	9,333,063.18	10,880,542.12
结算备付金		3,342,222.94	2,946,367.34
存出保证金		409,115.06	396,953.37
交易性金融资产	7.4.7.2	143,137,556.57	194,977,830.15
其中：股票投资		143,137,556.57	194,977,830.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		78,398,273.50	-
应收利息	7.4.7.5	7,426.79	4,959.86
应收股利		-	-
应收申购款		27,426.79	40,628.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		234,655,084.83	209,247,281.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	8.88

应付赎回款		681,897.28	1,038,047.40
应付管理人报酬		303,185.56	268,848.95
应付托管费		50,530.91	44,808.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,028,785.28	1,154,673.29
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	152,476.50	153,844.32
负债合计		3,216,875.53	2,660,230.99
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	229,891,306.38	201,426,847.11
未分配利润	7.4.7.10	1,546,902.92	5,160,203.06
所有者权益合计		231,438,209.30	206,587,050.17
负债和所有者权益总计		234,655,084.83	209,247,281.16

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.007 元，基金份额总额 229,891,306.38 份。

7.2 利润表

会计主体：博时行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		10,654,789.10	964,794.09
1. 利息收入		656,223.71	498,104.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	485,830.53	464,007.50
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		170,393.18	34,097.09
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,721,483.96	5,545,002.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,781,693.66	5,124,049.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	939,790.30	420,953.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-8,014,580.57	-5,807,783.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	291,662.00	729,470.17
减：二、费用		11,325,616.48	11,318,396.50
1. 管理人报酬		3,502,333.84	4,263,860.55
2. 托管费		583,722.29	710,643.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	6,870,060.16	5,959,260.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	369,500.19	384,632.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-670,827.38	-10,353,602.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-670,827.38	-10,353,602.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时行业轮动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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）	201,426,847.11	5,160,203.06	206,587,050.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-670,827.38	-670,827.38
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）	28,464,459.27	-2,942,472.76	25,521,986.51
其中：1. 基金申购款	284,167,180.06	-13,450,988.07	270,716,191.99
2. 基金赎回款	-255,702,720.79	10,508,515.31	-245,194,205.48
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）	229,891,306.38	1,546,902.92	231,438,209.30
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）	337,341,442.75	-31,069,980.27	306,271,462.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	-10,353,602.41	-10,353,602.41

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)	-135,914,595.64	46,583,785.74	-89,330,809.90
其中：1. 基金申购款	563,637,882.22	213,192,534.18	776,830,416.40
2. 基金赎回款	-699,552,477.86	-166,608,748.44	-866,161,226.30
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)	201,426,847.11	5,160,203.06	206,587,050.17

注：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 主管会计工作负责人：王德英 会计机构负责人：成江

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时行业轮动混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第1242号《关于核准博时行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时行业轮动股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集包括认购资金利息共募集1,400,439,291.65元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第340号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时行业轮动股票型证券投资基金基金合同》于2010年12月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额(包括认购资金利息折算部分)为1,400,439,291.65份基金份额。本基金的基金管理人为博

时基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，博时行业轮动股票型证券投资基金于 2015 年 08 月 07 日公告后更名为博时行业轮动混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时行业轮动混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、固定收益类证券、回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-40%，债券等固定收益类证券投资范围主要包括国债、金融债、公司债、中央银行票据、企业债、短期融资券、可转换债券、资产证券化产品等；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时行业轮动混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除

的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	9,333,063.18	10,880,542.12
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	9,333,063.18	10,880,542.12

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	146,333,105.66	143,137,556.57	-3,195,549.09
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	146,333,105.66	143,137,556.57	-3,195,549.09
项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	190,158,798.67	194,977,830.15	4,819,031.48
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	190,158,798.67	194,977,830.15	4,819,031.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,558.32	3,293.35
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	1,665.96	1,470.05
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	202.51	196.46
合计	7,426.79	4,959.86

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,028,785.28	1,154,673.29
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,028,785.28	1,154,673.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,476.50	3,844.32
其他应付款	-	-
预提费用	150,000.00	150,000.00
合计	152,476.50	153,844.32

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	201,426,847.11	201,426,847.11
本期申购	284,167,180.06	284,167,180.06

本期赎回（以“-”号填列）	-255,702,720.79	-255,702,720.79
本期末	229,891,306.38	229,891,306.38

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-28,299,292.87	33,459,495.93	5,160,203.06
本期利润	7,343,753.19	-8,014,580.57	-670,827.38
本期基金份额交易产生的变动数	-1,685,148.94	-1,257,323.82	-2,942,472.76
其中：基金申购款	-40,596,016.33	27,145,028.26	-13,450,988.07
基金赎回款	38,910,867.39	-28,402,352.08	10,508,515.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,640,688.62	24,187,591.54	1,546,902.92

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	445,046.36	398,197.73
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	35,188.49	31,167.63
其他	5,595.68	34,642.14
合计	485,830.53	464,007.50

7.4.7.12 股票投资收益

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

卖出股票成交总额	2,489,331,702.83	2,153,025,845.39
减：卖出股票成本总额	2,472,550,009.17	2,147,901,796.02
买卖股票差价收入	16,781,693.66	5,124,049.37

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	939,790.30	420,953.47
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	939,790.30	420,953.47

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-8,014,580.57	-5,807,783.51
——股票投资	-8,014,580.57	-5,807,783.51
——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	-8,014,580.57	-5,807,783.51
----	---------------	---------------

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	244,668.35	497,492.05
转换费收入	46,993.65	231,978.12
合计	291,662.00	729,470.17

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	6,870,060.16	5,959,260.43
银行间市场交易费用	-	-
股指期货交易费用	-	-
合计	6,870,060.16	5,959,260.43

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	13,500.19	16,632.17
中债公司银行间账户维护费	6,000.00	18,000.00
合计	369,500.19	384,632.17

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号), 要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号), 2017 年 7 月 1 日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股票

		票成交总 额的比例		成交总额的 比例
招商证券	1,097,082,476.71	22.33%	43,916,837.82	1.02%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 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	874,097.23	22.16%	446,186.47	21.99%
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	32,116.76	0.96%	32,116.76	2.78%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月	2015年1月1日至2015年12月

	月31日	31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,502,333.84	4,263,860.55
其中：支付销售机构的客户维护费	1,151,333.67	1,313,485.37

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 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	583,722.29	710,643.35

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：

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 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12月31日		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
中国建设银行股份有限公司	9,333,063.18	445,046.36	10,880,542.12	398,197.73

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	网下中签	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	网下中签	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	网下中签	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	网下中签	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	网下中签	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	网下中签	23.16	23.16	1,008.00	23,345.28	23,345.28	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	网下中签	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	网下中签	7.87	7.87	4,819.00	37,925.53	37,925.53	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	网下中签	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	网下中签	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	网下中签	9.30	9.30	1,006.00	9,355.8	9,355.8	
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	网下中签	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	网下中签	4.94	4.94	1,380.00	6,817.2	6,817.2	
300591	万里	2016-12-30	2017-	网下	3.07	3.07	2,397	7,358	7,358	

	马		01-10	中签			.00	.79	.79	
合计								421,780.42	421,780.42	

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000821	京山轻机	2016-12-05	重大资产重组	16.24	-	-	320,562	5,169,384.92	5,205,926.88	
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大资产重组	23.07	2017-01-06	19.60	358,200	8,002,415.00	8,263,674.00	
300537	广信材料	2016-10-12	重大资产重组	48.79	2017-01-13	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	
合计								13,181,210.48	13,519,561.84	

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在经济周期和行业景气波动下的资产稳定增值的投资目标。

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，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，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。

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 12 月 31 日，本基金无债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2016 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,333,063.18	-	-	-	9,333,063.18

结算备付金	3,342,222.94	-	-	-	3,342,222.94
存出保证金	409,115.06	-	-	-	409,115.06
交易性金融资产	-	-	-	143,137,556.57	143,137,556.57
应收证券清算款				78,398,273.50	78,398,273.50
应收利息	-	-	-	7,426.79	7,426.79
应收申购款	-	-	-	27,426.79	27,426.79
资产总计	13,084,401.18	-	-	221,570,683.65	234,655,084.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	681,897.28	681,897.28
应付管理人报酬	-	-	-	303,185.56	303,185.56
应付托管费	-	-	-	50,530.91	50,530.91
应付交易费用	-	-	-	2,028,785.28	2,028,785.28
其他负债	-	-	-	152,476.50	152,476.50
负债总计	-	-	-	3,216,875.53	3,216,875.53
利率敏感度缺口	13,084,401.18	-	-	218,353,808.12	231,438,209.30
上期末					
2015年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,880,542.12	-	-	-	10,880,542.12
结算备付金	2,946,367.34	-	-	-	2,946,367.34
存出保证金	396,953.37	-	-	-	396,953.37
交易性金融资产	-	-	-	194,977,830.15	194,977,830.15
应收利息	-	-	-	4,959.86	4,959.86
应收申购款	-	-	-	40,628.32	40,628.32
资产总计	14,223,862.83	-	-	195,023,418.33	209,247,281.16
负债					
应付证券清算款				8.88	8.88
应付赎回款	-	-	-	1,038,047.40	1,038,047.40
应付管理人报酬	-	-	-	268,848.95	268,848.95
应付托管费	-	-	-	44,808.15	44,808.15
应付交易费用	-	-	-	1,154,673.29	1,154,673.29
其他负债	-	-	-	153,844.32	153,844.32
负债总计	-	-	-		2,660,230.99

				2,660,230.99	
				192,363,187.34	206,587,050.17
利率敏感度缺口	14,223,862.83	-	-		

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予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2015 年 12 月 31 日：同)，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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的 60%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-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。针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占总期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交金额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基

金资产比例等法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。本基金的基金管理人在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金的基金管理人还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	143,137,556.57	61.85	194,977,830.15	94.38
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	-	-	-	-
合计	143,137,556.57	61.85	194,977,830.15	94.38

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 685	增加约 1,009
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 685	减少约 1,009	

7.4.14 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 129,196,214.31 元，属于第二层次的余额为 13,941,342.26 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 145,085,391.47 元，第二层次 49,892,438.68 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	143,137,556.57	61.00
	其中：股票	143,137,556.57	61.00
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	12,675,286.12	5.40
7	其他各项资产	78,842,242.14	33.60
8	合计	234,655,084.83	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	-	-
C	制造业	47,123,923.64	20.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,925.53	0.02

E	建筑业	26,692,590.19	11.53
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	208,809.70	0.09
J	金融业	64,687,166.83	27.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,377,682.00	1.89
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	143,137,556.57	61.85

8.3 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	600000	浦发银行	1,221,830	19,805,864.30	8.56
2	601166	兴业银行	669,305	10,802,582.70	4.67
3	000001	平安银行	1,175,447	10,696,567.70	4.62
4	002310	东方园林	599,544	8,483,547.60	3.67
5	002659	中泰桥梁	358,200	8,263,674.00	3.57
6	300197	铁汉生态	621,107	7,875,636.76	3.40
7	601398	工商银行	1,617,941	7,135,119.81	3.08
8	002007	华兰生物	197,300	7,053,475.00	3.05
9	601288	农业银行	2,251,000	6,978,100.00	3.02
10	601328	交通银行	1,181,800	6,818,986.00	2.95
11	600887	伊利股份	382,953	6,739,972.80	2.91
12	300203	聚光科技	220,100	6,724,055.00	2.91
13	002588	史丹利	565,400	6,417,290.00	2.77

14	000821	京山轻机	320,562	5,205,926.88	2.25
15	002470	金正大	563,640	4,452,756.00	1.92
16	600057	象屿股份	380,668	4,377,682.00	1.89
17	000858	五粮液	77,772	2,681,578.56	1.16
18	002518	科士达	116,900	2,500,491.00	1.08
19	000418	小天鹅 A	75,404	2,437,057.28	1.05
20	601988	中国银行	681,153	2,343,166.32	1.01
21	300322	硕贝德	112,319	2,075,655.12	0.90
22	600477	杭萧钢构	204,392	2,054,139.60	0.89
23	600996	贵广网络	10,750	201,992.50	0.09
24	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.05
25	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.04
26	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03
27	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.03
28	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.03
29	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.03
30	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.03
31	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
32	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.02
33	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.02
34	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
35	603689	皖天然气	4,819	37,925.53	0.02
36	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.02
37	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
38	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
39	603239	N 仙通	747	23,493.15	0.01
40	603228	景旺电子	1,008	23,345.28	0.01
41	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
42	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
43	603929	N 亚翔	2,193	15,592.23	0.01
44	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.01
45	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
46	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
47	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
48	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
49	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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	600900	长江电力	78,819,498.46	38.15
2	600000	浦发银行	74,701,362.77	36.16
3	601166	兴业银行	67,357,545.30	32.60
4	600519	贵州茅台	52,592,100.20	25.46
5	600276	恒瑞医药	46,490,940.21	22.50
6	000001	平安银行	40,137,479.63	19.43
7	300061	康耐特	37,296,138.98	18.05
8	000821	京山轻机	36,331,946.11	17.59
9	600887	伊利股份	33,335,338.17	16.14
10	600489	中金黄金	33,142,990.58	16.04
11	300008	天海防务	32,398,209.93	15.68
12	000606	*ST 易桥	30,809,013.98	14.91
13	603288	海天味业	30,549,572.39	14.79
14	000538	云南白药	28,768,712.05	13.93
15	002630	华西能源	26,120,068.80	12.64
16	002530	丰东股份	25,233,426.00	12.21
17	002371	七星电子	25,142,702.77	12.17
18	600362	江西铜业	24,999,788.79	12.10
19	002656	摩登大道	24,446,788.64	11.83
20	002667	鞍重股份	24,410,150.60	11.82
21	000829	天音控股	24,395,498.26	11.81
22	601318	中国平安	24,054,654.99	11.64
23	601398	工商银行	23,963,267.04	11.60
24	601988	中国银行	23,753,142.00	11.50
25	601288	农业银行	23,310,149.00	11.28
26	601069	西部黄金	23,123,716.25	11.19
27	000926	福星股份	22,858,925.72	11.07
28	002131	利欧股份	21,650,363.11	10.48
29	600477	杭萧钢构	21,433,294.60	10.37
30	300516	久之洋	20,823,166.38	10.08
31	000021	深科技	20,281,344.06	9.82
32	300379	东方通	19,909,251.50	9.64
33	300164	通源石油	19,067,776.13	9.23
34	300264	佳创视讯	18,604,244.05	9.01
35	002310	东方园林	18,516,805.40	8.96
36	300527	华舟应急	17,855,485.57	8.64
37	002009	天奇股份	17,527,648.86	8.48
38	600801	华新水泥	17,182,488.92	8.32
39	300197	铁汉生态	16,326,049.83	7.90
40	300444	双杰电气	16,061,722.08	7.77
41	600547	山东黄金	15,792,397.27	7.64
42	300383	光环新网	15,492,702.41	7.50
43	603012	创力集团	15,129,096.03	7.32

44	300465	高伟达	14,914,504.00	7.22
45	300513	恒泰实达	14,875,750.00	7.20
46	600886	国投电力	14,866,723.44	7.20
47	002236	大华股份	14,850,550.41	7.19
48	600674	川投能源	14,701,016.05	7.12
49	002418	康盛股份	14,624,488.70	7.08
50	000983	西山煤电	14,421,280.50	6.98
51	000858	五粮液	14,052,354.47	6.80
52	002570	贝因美	13,754,611.08	6.66
53	000418	小天鹅 A	13,551,132.06	6.56
54	600499	科达洁能	13,493,508.41	6.53
55	002456	欧菲光	13,357,298.33	6.47
56	300468	四方精创	12,854,265.20	6.22
57	603006	联明股份	12,639,144.13	6.12
58	002036	联创电子	12,335,298.24	5.97
59	300346	南大光电	12,308,392.10	5.96
60	002643	万润股份	12,221,094.20	5.92
61	002343	慈文传媒	12,213,258.00	5.91
62	300097	智云股份	11,883,997.66	5.75
63	002588	史丹利	11,740,573.75	5.68
64	300499	高澜股份	11,566,576.75	5.60
65	000070	特发信息	10,680,747.60	5.17
66	603939	益丰药房	10,329,742.90	5.00
67	300310	宜通世纪	10,013,356.00	4.85
68	300467	迅游科技	9,970,651.14	4.83
69	300400	劲拓股份	9,861,294.14	4.77
70	000060	中金岭南	9,809,200.00	4.75
71	300011	鼎汉技术	9,752,763.06	4.72
72	603398	邦宝益智	9,566,399.40	4.63
73	300078	思创医惠	9,461,684.10	4.58
74	000810	创维数字	9,441,494.47	4.57
75	600497	驰宏锌锗	9,130,904.92	4.42
76	601139	深圳燃气	8,896,331.52	4.31
77	603007	花王股份	8,804,149.48	4.26
78	603737	三棵树	8,790,324.48	4.26
79	300532	今天国际	8,774,736.82	4.25
80	600584	长电科技	8,773,588.04	4.25
81	300523	辰安科技	8,769,974.00	4.25
82	600055	万东医疗	8,762,604.00	4.24
83	300304	云意电气	8,762,360.85	4.24
84	002494	华斯股份	8,750,594.00	4.24
85	002155	湖南黄金	8,732,212.00	4.23
86	300474	景嘉微	8,687,885.76	4.21

87	002350	北京科锐	8,616,452.00	4.17
88	300144	宋城演艺	8,611,514.04	4.17
89	002353	杰瑞股份	8,581,969.00	4.15
90	000401	冀东水泥	8,503,172.00	4.12
91	002664	信质电机	8,372,313.00	4.05
92	000409	山东地矿	8,034,831.00	3.89
93	601818	光大银行	8,023,691.00	3.88
94	002659	中泰桥梁	8,002,415.00	3.87
95	300113	顺网科技	7,825,500.10	3.79
96	600500	中化国际	7,775,471.00	3.76
97	002716	金贵银业	7,751,120.73	3.75
98	002761	多喜爱	7,706,136.38	3.73
99	600325	华发股份	7,704,104.00	3.73
100	600376	首开股份	7,695,686.59	3.73
101	600666	奥瑞德	7,675,653.23	3.72
102	600138	中青旅	7,612,311.24	3.68
103	002221	东华能源	7,560,782.08	3.66
104	300166	东方国信	7,553,288.36	3.66
105	300296	利亚德	7,552,948.47	3.66
106	002368	太极股份	7,509,669.13	3.64
107	600582	天地科技	7,408,008.00	3.59
108	600348	阳泉煤业	7,406,471.00	3.59
109	000937	冀中能源	7,402,078.00	3.58
110	000333	美的集团	7,390,086.24	3.58
111	002502	骅威文化	7,347,887.80	3.56
112	002707	众信旅游	7,300,986.96	3.53
113	002518	科士达	7,298,884.50	3.53
114	600005	武钢股份	7,292,449.00	3.53
115	000898	鞍钢股份	7,237,011.70	3.50
116	600057	象屿股份	7,193,893.64	3.48
117	601328	交通银行	7,179,056.00	3.48
118	600487	亨通光电	7,168,504.68	3.47
119	601899	紫金矿业	7,164,403.00	3.47
120	002196	方正电机	7,112,224.40	3.44
121	002323	雅百特	7,090,248.00	3.43
122	002007	华兰生物	7,041,334.25	3.41
123	002470	金正大	7,030,795.80	3.40
124	300322	硕贝德	7,028,547.80	3.40
125	601118	海南橡胶	7,011,713.60	3.39
126	002554	惠博普	6,802,920.50	3.29
127	300203	聚光科技	6,753,339.00	3.27
128	000722	湖南发展	6,741,276.29	3.26
129	002684	猛狮科技	6,646,086.71	3.22

130	002339	积成电子	6,604,744.21	3.20
131	002776	柏堡龙	6,553,924.05	3.17
132	002304	洋河股份	6,294,895.89	3.05
133	002797	第一创业	6,283,098.00	3.04
134	002741	光华科技	6,270,482.59	3.04
135	601601	中国太保	6,234,937.00	3.02
136	601788	光大证券	6,119,454.00	2.96
137	000728	国元证券	6,119,326.63	2.96
138	600061	国投安信	6,119,265.82	2.96
139	601555	东吴证券	6,117,587.00	2.96
140	601198	东兴证券	6,115,067.82	2.96
141	600462	九有股份	6,061,870.20	2.93
142	601169	北京银行	6,054,988.40	2.93
143	300327	中颖电子	5,934,621.10	2.87
144	002640	跨境通	5,933,271.05	2.87
145	600617	国新能源	5,931,044.90	2.87
146	600750	江中药业	5,920,551.00	2.87
147	000963	华东医药	5,915,759.32	2.86
148	300325	德威新材	5,883,389.47	2.85
149	600688	上海石化	5,879,320.00	2.85
150	000630	铜陵有色	5,877,694.50	2.85
151	000911	南宁糖业	5,876,429.73	2.84
152	600259	广晟有色	5,870,687.40	2.84
153	002396	星网锐捷	5,863,705.64	2.84
154	002038	双鹭药业	5,859,058.00	2.84
155	600844	丹化科技	5,853,665.97	2.83
156	300119	瑞普生物	5,835,365.01	2.82
157	600456	宝钛股份	5,809,569.62	2.81
158	600136	当代明诚	5,787,093.90	2.80
159	600718	东软集团	5,769,445.62	2.79
160	002584	西陇科学	5,766,481.08	2.79
161	300230	永利股份	5,723,175.30	2.77
162	002657	中科金财	5,595,729.30	2.71
163	002463	沪电股份	5,584,031.00	2.70
164	002751	易尚展示	5,541,636.66	2.68
165	000665	湖北广电	5,535,282.86	2.68
166	002271	东方雨虹	5,500,481.00	2.66
167	600701	*ST 工新	5,490,858.00	2.66
168	002137	麦达数字	5,483,063.00	2.65
169	000597	东北制药	5,460,963.14	2.64
170	600549	厦门钨业	5,460,913.00	2.64
171	000807	云铝股份	5,459,667.00	2.64
172	002055	得润电子	5,103,249.47	2.47

173	002126	银轮股份	5,036,334.00	2.44
174	002216	三全食品	5,033,644.00	2.44
175	603866	桃李面包	5,031,311.00	2.44
176	300236	上海新阳	5,031,222.58	2.44
177	000801	四川九洲	4,988,125.76	2.41
178	300198	纳川股份	4,980,340.00	2.41
179	600597	光明乳业	4,899,091.00	2.37
180	603799	华友钴业	4,692,659.00	2.27
181	601021	春秋航空	4,422,300.68	2.14
182	600884	杉杉股份	4,275,162.00	2.07
183	603017	中衡设计	4,222,689.27	2.04
184	600257	大湖股份	4,219,115.07	2.04
185	002168	深圳惠程	4,212,824.90	2.04
186	002094	青岛金王	4,177,364.00	2.02

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

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	600900	长江电力	78,217,545.33	37.86
2	601166	兴业银行	57,466,905.51	27.82
3	600519	贵州茅台	55,459,926.76	26.85
4	600000	浦发银行	55,217,443.92	26.73
5	600276	恒瑞医药	45,587,082.90	22.07
6	300061	康耐特	40,119,418.90	19.42
7	300008	天海防务	33,318,838.37	16.13
8	002502	骅威文化	32,122,014.40	15.55
9	000821	京山轻机	32,019,428.01	15.50
10	600489	中金黄金	31,969,085.92	15.47
11	000606	*ST 易桥	31,267,588.47	15.14
12	603288	海天味业	30,447,030.47	14.74
13	002530	丰东股份	29,948,152.42	14.50
14	000001	平安银行	29,575,227.67	14.32
15	000538	云南白药	29,093,246.30	14.08
16	002656	摩登大道	28,087,268.41	13.60
17	002371	七星电子	26,779,966.22	12.96
18	002630	华西能源	26,541,878.91	12.85
19	600887	伊利股份	26,323,093.27	12.74
20	601318	中国平安	26,013,779.08	12.59
21	000829	天音控股	25,708,075.21	12.44
22	600362	江西铜业	24,452,351.64	11.84

23	002667	鞍重股份	24,148,642.29	11.69
24	000926	福星股份	23,183,042.70	11.22
25	002131	利欧股份	22,715,665.61	11.00
26	000021	深科技	21,537,829.52	10.43
27	601988	中国银行	21,523,617.50	10.42
28	002418	康盛股份	20,863,036.05	10.10
29	601069	西部黄金	20,697,982.56	10.02
30	300465	高伟达	20,694,136.07	10.02
31	603012	创力集团	20,379,140.33	9.86
32	300516	久之洋	19,477,491.72	9.43
33	002494	华斯股份	19,444,290.90	9.41
34	600477	杭萧钢构	19,318,621.97	9.35
35	300164	通源石油	19,166,263.76	9.28
36	300379	东方通	18,784,302.13	9.09
37	300264	佳创视讯	18,458,216.90	8.93
38	300527	华舟应急	18,148,130.34	8.78
39	002137	麦达数字	18,008,863.89	8.72
40	600801	华新水泥	17,001,271.60	8.23
41	601398	工商银行	16,942,186.00	8.20
42	002009	天奇股份	16,695,358.55	8.08
43	300310	宜通世纪	16,350,688.41	7.91
44	600661	新南洋	16,298,863.14	7.89
45	601288	农业银行	16,198,474.00	7.84
46	300444	双杰电气	15,987,819.63	7.74
47	600666	奥瑞德	15,532,756.18	7.52
48	600886	国投电力	15,222,182.47	7.37
49	300383	光环新网	15,064,259.70	7.29
50	600674	川投能源	14,917,771.97	7.22
51	600547	山东黄金	14,741,412.09	7.14
52	002570	贝因美	14,683,174.46	7.11
53	002456	欧菲光	14,665,263.10	7.10
54	603006	黎明股份	14,626,711.45	7.08
55	600499	科达洁能	14,289,370.99	6.92
56	000983	西山煤电	14,272,708.50	6.91
57	300513	恒泰实达	14,181,399.00	6.86
58	002236	大华股份	13,857,673.12	6.71
59	300113	顺网科技	13,478,017.72	6.52
60	002343	慈文传媒	13,416,152.00	6.49
61	300097	智云股份	12,606,506.65	6.10
62	300499	高澜股份	12,563,914.70	6.08
63	300468	四方精创	12,358,895.48	5.98
64	600122	宏图高科	12,236,017.07	5.92
65	300346	南大光电	11,943,863.56	5.78

66	002643	万润股份	11,937,327.94	5.78
67	300078	思创医惠	11,804,843.90	5.71
68	000858	五粮液	11,769,756.53	5.70
69	002036	联创电子	11,639,391.81	5.63
70	000070	特发信息	11,574,098.35	5.60
71	600136	当代明诚	11,155,658.83	5.40
72	300467	迅游科技	11,120,988.44	5.38
73	000418	小天鹅 A	10,876,879.65	5.27
74	603398	邦宝益智	10,866,565.31	5.26
75	603939	益丰药房	10,704,908.40	5.18
76	300474	景嘉微	10,570,736.88	5.12
77	002155	湖南黄金	10,281,813.62	4.98
78	300400	劲拓股份	10,219,333.60	4.95
79	600596	新安股份	9,981,062.75	4.83
80	600497	驰宏锌锗	9,928,582.80	4.81
81	000810	创维数字	9,914,483.97	4.80
82	002310	东方园林	9,591,138.57	4.64
83	300197	铁汉生态	9,523,048.15	4.61
84	300011	鼎汉技术	9,383,252.32	4.54
85	000060	中金岭南	9,255,204.86	4.48
86	002664	信质电机	9,142,654.73	4.43
87	603737	三棵树	8,993,976.20	4.35
88	603007	花王股份	8,918,809.30	4.32
89	600055	万东医疗	8,844,294.23	4.28
90	002368	太极股份	8,698,395.50	4.21
91	601118	海南橡胶	8,621,458.00	4.17
92	300144	宋城演艺	8,579,264.58	4.15
93	002353	杰瑞股份	8,569,339.64	4.15
94	601139	深圳燃气	8,568,393.18	4.15
95	600584	长电科技	8,530,018.26	4.13
96	002350	北京科锐	8,499,771.86	4.11
97	300304	云意电气	8,441,143.38	4.09
98	300523	辰安科技	8,278,578.40	4.01
99	300532	今天国际	8,217,693.06	3.98
100	601818	光大银行	8,215,238.00	3.98
101	000401	冀东水泥	8,166,825.00	3.95
102	002221	东华能源	8,020,342.04	3.88
103	000333	美的集团	7,600,572.90	3.68
104	002761	多喜爱	7,559,268.91	3.66
105	002716	金贵银业	7,550,156.00	3.65
106	600325	华发股份	7,510,752.93	3.64
107	300296	利亚德	7,493,021.42	3.63
108	600005	武钢股份	7,482,198.80	3.62

109	000898	鞍钢股份	7,436,993.89	3.60
110	300166	东方国信	7,400,544.40	3.58
111	600582	天地科技	7,347,864.00	3.56
112	601899	紫金矿业	7,288,775.00	3.53
113	002707	众信旅游	7,283,333.62	3.53
114	600138	中青旅	7,271,706.00	3.52
115	002323	雅百特	7,251,085.00	3.51
116	002196	方正电机	7,180,755.68	3.48
117	600750	江中药业	7,117,856.35	3.45
118	600376	首开股份	7,115,710.25	3.44
119	600500	中化国际	7,101,652.00	3.44
120	600348	阳泉煤业	7,088,282.50	3.43
121	000937	冀中能源	7,086,046.78	3.43
122	000409	山东地矿	7,019,307.36	3.40
123	002797	第一创业	6,939,956.00	3.36
124	601601	中国太保	6,876,596.87	3.33
125	002304	洋河股份	6,793,212.63	3.29
126	600682	南京新百	6,767,561.08	3.28
127	002396	星网锐捷	6,611,007.82	3.20
128	600487	亨通光电	6,588,404.38	3.19
129	002339	积成电子	6,565,786.57	3.18
130	002554	惠博普	6,516,325.19	3.15
131	000722	湖南发展	6,436,242.05	3.12
132	002668	奥马电器	6,421,036.10	3.11
133	002038	双鹭药业	6,310,928.98	3.05
134	002684	猛狮科技	6,269,686.08	3.03
135	601555	东吴证券	6,258,508.29	3.03
136	300230	永利股份	6,255,779.30	3.03
137	600617	国新能源	6,242,402.75	3.02
138	600456	宝钛股份	6,236,868.07	3.02
139	600718	东软集团	6,183,304.00	2.99
140	601788	光大证券	6,135,374.10	2.97
141	601169	北京银行	6,134,708.80	2.97
142	600061	国投安信	6,110,465.60	2.96
143	601198	东兴证券	6,099,773.20	2.95
144	000728	国元证券	6,099,757.97	2.95
145	600462	九有股份	6,089,579.98	2.95
146	002776	柏堡龙	6,086,014.34	2.95
147	300325	德威新材	5,948,610.00	2.88
148	002741	光华科技	5,865,973.50	2.84
149	002657	中科金财	5,839,222.28	2.83
150	002640	跨境通	5,833,956.60	2.82
151	002584	西陇科学	5,814,306.40	2.81

152	002463	沪电股份	5,787,069.88	2.80
153	600844	丹化科技	5,752,268.88	2.78
154	600688	上海石化	5,725,558.13	2.77
155	000807	云铝股份	5,639,099.00	2.73
156	300327	中颖电子	5,636,645.20	2.73
157	000630	铜陵有色	5,591,781.10	2.71
158	600701	*ST 工新	5,562,292.00	2.69
159	000911	南宁糖业	5,547,840.88	2.69
160	600549	厦门钨业	5,523,513.00	2.67
161	000963	华东医药	5,494,265.00	2.66
162	600259	广晟有色	5,444,764.60	2.64
163	002751	易尚展示	5,436,644.00	2.63
164	300119	瑞普生物	5,394,203.57	2.61
165	600476	湘邮科技	5,373,978.90	2.60
166	000597	东北制药	5,299,777.00	2.57
167	000665	湖北广电	5,266,376.00	2.55
168	300236	上海新阳	5,235,008.27	2.53
169	603866	桃李面包	4,949,234.91	2.40
170	002271	东方雨虹	4,939,177.00	2.39
171	000801	四川九洲	4,933,799.00	2.39
172	002126	银轮股份	4,931,220.00	2.39
173	002216	三全食品	4,902,219.89	2.37
174	600597	光明乳业	4,804,945.84	2.33
175	002094	青岛金王	4,803,264.17	2.33
176	600576	万家文化	4,670,485.55	2.26
177	300322	硕贝德	4,636,337.60	2.24
178	002588	史丹利	4,635,672.00	2.24
179	002518	科士达	4,634,876.00	2.24
180	600257	大湖股份	4,601,991.20	2.23
181	600884	杉杉股份	4,597,763.00	2.23
182	300409	道氏技术	4,551,285.49	2.20
183	002168	深圳惠程	4,499,243.10	2.18
184	300245	天玑科技	4,464,049.36	2.16
185	603799	华友钴业	4,460,292.04	2.16
186	603017	中衡设计	4,413,599.40	2.14
187	002055	得润电子	4,406,913.00	2.13
188	300342	天银机电	4,331,368.00	2.10
189	300228	富瑞特装	4,240,103.88	2.05
190	601021	春秋航空	4,224,569.76	2.04
191	600678	四川金顶	4,217,331.00	2.04
192	002125	湘潭电化	4,198,748.41	2.03

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

用。

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	2,428,724,316.16
卖出股票的收入（成交）总额	2,489,331,702.83

8.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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	409,115.06
2	应收证券清算款	78,398,273.50
3	应收股利	-

4	应收利息	7,426.79
5	应收申购款	27,426.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,842,242.14

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002659	中泰桥梁	8,263,674.00	3.57	重大事项停牌

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	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
12,838.00	17,907.10	496,131.75	0.22%	229,395,174.63	99.78%

9.2 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	-	-	-
	合计	-	-

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：1. 本公司从业人员未持有本基金；

2. 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金；

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	1,400,439,291.65
本报告期期初基金份额总额	201,426,847.11
本报告期基金总申购份额	284,167,180.06
减：本报告期基金总赎回份额	255,702,720.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	229,891,306.38

§ 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、托管人无重大人事变动。

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、基金托管人、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 50,000.00 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	
招商证券	3	1,097,082,476.71	22.33%	874,097.23	22.16%	-
华创证券	2	605,929,885.79	12.33%	443,115.84	11.23%	-
上海华信证券	1	459,042,000.71	9.34%	335,698.82	8.51%	-
海通证券	1	417,036,151.17	8.49%	304,981.46	7.73%	-
兴业证券	1	318,813,385.75	6.49%	296,908.06	7.53%	-
中信证券	4	294,182,158.01	5.99%	215,387.49	5.46%	-
国信证券	1	283,266,361.52	5.76%	207,152.62	5.25%	-
高华证券	1	265,560,158.55	5.40%	247,316.34	6.27%	-
中金公司	1	200,403,260.39	4.08%	186,635.84	4.73%	-
上海证券	1	192,713,940.42	3.92%	140,930.66	3.57%	-
银河证券	1	191,852,855.94	3.90%	178,672.33	4.53%	-
国泰君安	3	138,587,749.59	2.82%	129,066.49	3.27%	-
国金证券	1	105,915,355.18	2.16%	77,456.57	1.96%	-
平安证券	1	104,961,910.20	2.14%	97,751.34	2.48%	-
中信建投	2	87,888,685.28	1.79%	81,851.02	2.07%	-
瑞银证券	1	69,749,264.03	1.42%	64,960.13	1.65%	-
东北证券	1	28,849,289.98	0.59%	21,097.68	0.53%	-

华福证券	1	21,584,026.56	0.44%	15,783.62	0.40%	-
长江证券	2	19,626,115.59	0.40%	18,277.88	0.46%	-
西南证券	1	8,079,004.69	0.16%	5,907.90	0.15%	-
国开证券	1	2,444,589.20	0.05%	1,787.45	0.05%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
湘财证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
信达证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
第一创业	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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
华创证券	-	-	90,000,000.00	21.44%	-	-
国信证券	-	-	156,800,000.00	37.35%	-	-
上海证券	-	-	173,000,000.00	41.21%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

申银万国	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
上海华信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于博时旗下部分基金参加东莞银行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	2016-12-30
2	关于博时旗下部分基金开通在工行定投业务并参加工行定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-30
3	关于博时旗下部分开放式基金增加北京恒天明泽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	2016-12-28
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投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	2016-12-22
5	关于博时旗下部分开放式基金增加浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份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	2016-12-21

6	关于博时旗下部分开放式基金增加天津国美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	2016-11-11
7	博时行业轮动混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-10-24
8	关于博时旗下部分开放式基金增加东海期货有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-10-20
9	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投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	2016-09-20
10	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海欧中联合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	2016-09-02
11	关于博时旗下部分开放式基金增加华信证券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	2016-08-30
12	博时行业轮动混合型证券投资基金 2016 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-25
13	博时行业轮动混合型证券投资基金 2016 年半年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-25
14	关于博时旗下部分开放式基金增加上海万得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	2016-07-29
15	博时行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书 2016 年第 2 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-25
16	博时行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书 2016 年第 2 号_正文	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-25
17	博时行业轮动混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-20
18	关于博时旗下部分开放式基金增加桂林银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-18
19	关于博时旗下部分开放式基金开通北京新浪仓石基金销售有限公司定投业务并参加其定投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	2016-07-15
20	关于博时旗下部分开放式基金开通上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参加其定投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	2016-07-15
21	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
22	关于博时旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-24
23	关于博时旗下部分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	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	博时行业轮动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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	博时行业轮动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
38	博时行业轮动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
39	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
40	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

41	博时行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书 2016 年第 1 号（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-23
42	博时行业轮动混合型证券投资基金更新招募说明书 2016 年第 1 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-23
43	博时基金管理有限公司关于博时行业轮动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	2016-01-22
44	博时行业轮动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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时行业轮动混合型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时行业轮动混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时行业轮动混合型证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 博时行业轮动混合型证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时行业轮动混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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

客户服务中心电话：95105568（免长途话费）

二〇一七年三月二十七日