

# 博时行业轮动混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要 2017 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十四日

## § 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	297,606,389.61 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	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-8,967,420.75
本期利润	12,057,066.51
加权平均基金份额本期利润	0.0426
本期基金份额净值增长率	8.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1066
期末基金资产净值	324,651,534.86
期末基金份额净值	1.091

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交易基金的各项费用，计入费用后持有人的实际收益水平要低于所列数字。

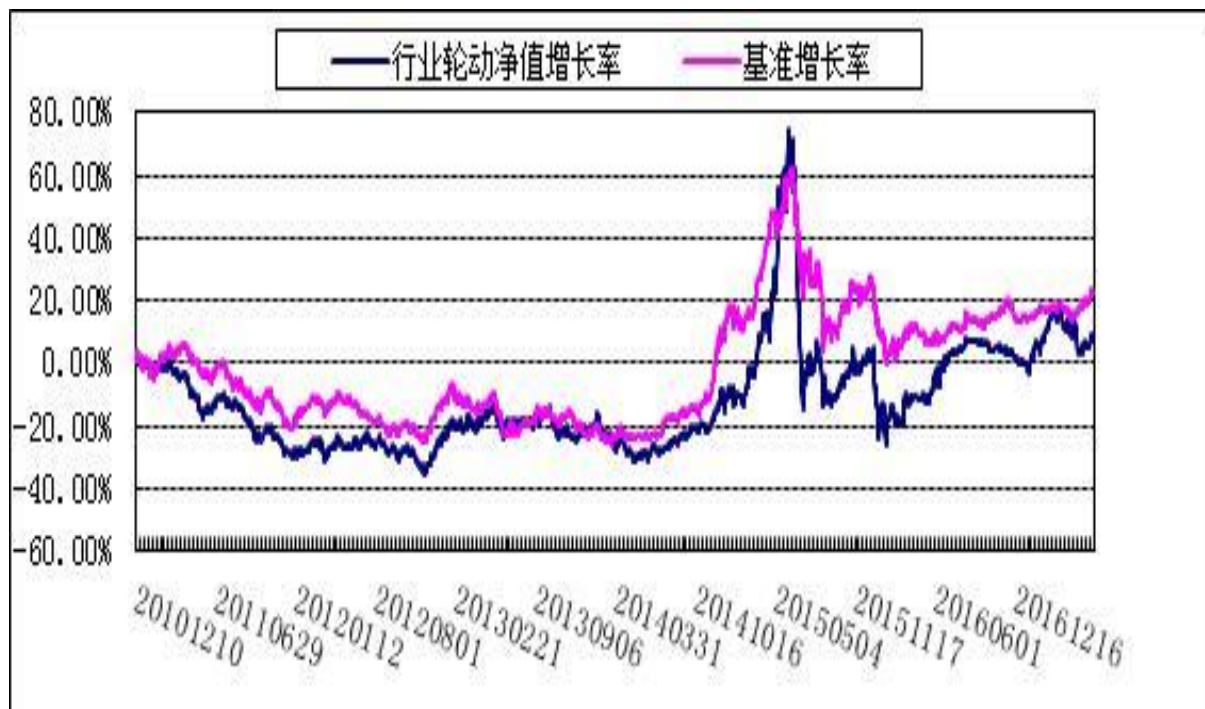
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.60%	0.84%	4.19%	0.54%	0.41%	0.30%
过去三个月	-4.97%	1.17%	4.84%	0.50%	-9.81%	0.67%
过去六个月	8.34%	1.11%	8.42%	0.46%	-0.08%	0.65%
过去一年	8.67%	0.85%	12.75%	0.54%	-4.08%	0.31%
过去三年	50.07%	1.98%	59.38%	1.40%	-9.31%	0.58%
自基金合同生效起至今	9.10%	1.58%	23.22%	1.22%	-14.12%	0.36%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



注：本基金合同于 2010 年 12 月 10 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条（二）投资范围、（八）投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2017 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 186 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 6357.79 亿元人民币，其中公募基金规模逾 3763.55 亿元人民币，累计分红逾 814 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 2017 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率为 16.07%，在同类 104 只基金中排名前 10，博时裕富沪深 300 指数、博时上证 50ETF 等今年以来净值增长率排名前 1/5；股票型分级子基金里，博时中证银行指数分级 B 今年以来净值增长率为 20.90%，在同类 128 只基金中排名前 1/6；混合偏股型基金中，博时主题行业今年以来净值增长率为 12.13%，在同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时产业新动力、博时互联网主题基金今年以来净值增长率分别为 8.95%、8.40%，在同类基金中排名均位于前 1/4。

保本型基金中，博时保泰保本混合基金今年以来净值增长率在同类 137 只中排名前 1/3；绝对收益目标基金里，博时新起点灵活配置混合今年以来净值增长率在同类基金中排名前 10。

黄金基金类，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率 3.67%，在同类 14 只中排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债(A 类)、博时裕昂纯债债券基金今年以来净值增长率在同类 797 只排名前 1/10；普通债券型基金中，博时信用债券基金、博时天颐债券基金今年以来净值增长率在 417 只中排名前 1/10；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率在 631 只同类基金中排名前 1/4；转债基金方面，博时转债增强债券(A 类) 今年以来收益率 3.78%，同类排名第一。

QDII 基金方面，博时大中华亚太精选股票基金(QDII)、博时大中华亚太精选股票基金(QDII)(美元)，今年以来净值增长率分别为 13.46%、15.92%，同类排名前 1/2、1/4。

## 2、其他大事件

2017 年 6 月 23 日，由南方日报社主办的“2017 年南方金融峰会暨第六届金榕奖颁奖典礼”在广州举行，博时基金获得“年度资产管理优秀奖”。

2017 年 6 月 17 日，由中国证券报主办的“全球配置时代海外投资动力与机遇——首届海外基金金牛奖颁奖典礼暨高端论坛”在深召开，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司荣获“一年期海外金牛私募管理公司（固定收益策略）”。

2017 年 5 月 12 日，由中国基金报主办的第四届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在深召开。博时摘得“2016 年度十大明星基金公司奖”和“2016 年度固定收益投资明星团队奖”两项公司类大奖，博时双月薪和博时稳定价值获“三年持续回报普通债券型明星基金奖”、博时新财富获“2016 年度绝对收益明星基金奖”、博时信用债纯债获“2016 年度积极债券型明星基金奖”、博时信用债券获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2017 年 4 月 25 日，博时基金在 2017 中国基金业峰会暨第十四届中国“金基金”奖颁奖典礼上，获得“2016 年度金基金·TOP 公司奖”。

2017 年 4 月 25 日，在由中国基金报主办的第四届中国基金业英华奖颁奖典礼暨高峰论坛上，博时基金过钧获评“三年期二级债最佳基金经理”、“五年期二级债最佳基金经理”，陈凯杨获评“三年期纯债型最佳基金经理”。

2017 年 4 月 8 日，在第十四届中国基金业金牛奖颁奖典礼上，博时基金被评为“2016 年度固定收益投资金牛基金公司”，旗下博时卓越品牌混合(160512)被评为“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”、博时主题行业(160505)获“2016 年度开放式混合型金牛基金”、博时信用债券(050011)获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”、博时信用债纯债债券(050027)获“2016 年度开放式债券型金牛基金”。

2017 年 3 月 10 日，由中国工商银行私人银行部举办的“第十八届资本市场投资论坛会议”在杭州落下帷幕。工行私行对管理人的过往表现给予充分肯定并对 2016 年表现突出的管理人进行了表彰，博时基金荣获“2016 年度优秀管理人奖”。

2017 年 2 月 22 日，第二届中国基金业营销创新高高峰论坛暨“金果奖”颁奖典礼在京举办，博时基金一举斩获最佳品牌形象建设奖、最具创新精神奖、最佳自媒体建设奖三项大奖。

2017 年 1 月 19 日，深交所召开了新一代交易系统上线运行总结会，会上介绍了深交所新一代交易系



统运行情况，并表彰了在新一代交易系统上线过程中，积极参与各项准备和测试工作，为系统顺利上线做出突出贡献的单位和个人。博时基金被授予新一代交易系统建设先行者、突出贡献单位殊荣。博时基金信息技术部车宏原、陈小平、祁晓东被授予突出贡献奖殊荣。

2017年1月16日，博时基金荣登中央国债登记结算有限责任公司评选的“优秀资产管理机构”榜单，成为全国十家获此殊荣的基金公司之一。

2017年1月12日，由华夏时报、新浪财经联合主办的“第十届金蝉奖颁奖典礼”上，博时基金荣获“2016年度市场营销力公司”奖项。

2017年1月10日，由信息时报主办的“2016年度金狮奖金融行业风云榜”颁奖典礼于广州盛大举办，博时基金斩获“年度最佳投研基金公司”大奖。

2017年1月6日，由东方财富网、天天基金网主办的“2016东方财富风云榜”评选活动于广州举行，博时基金荣膺“2016年度最佳基金公司”大奖，同时，旗下产品博时银智 100 荣获“2016年度最受欢迎新发基金奖”。

#### 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	2014-08-29	-	9	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、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公平交易相关制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年以来的供给侧改革和需求层面地产、汽车行业的复苏带动了整体经济的复苏和企业盈利能力的回升，这一趋势在 17 年上半年继续持续。政策层面来看，控制金融体系杠杆的过度扩张推动资金“脱虚入实”以支持实体经济的发展成为政策的首要目标。在此背景下央行采取了不松不紧的流动性管理策略，以期支持实体经济的持续复苏。实体经济回报率的提升给人民币汇率提供了较强的支撑，上半年汇率的波动区间相对较小。

受各行业竞争格局改善壁垒提升和监管层鼓励 IPO 限制并购重组政策的共同影响，A 股的估值发生了系统性的重构，从以并购为基础的市值估值法向内生成长为基础的 PE/PB 估值体系转化。在这一趋势下，A 股市场上半年呈现了 13 年以来的最大分化，估值与成长性匹配的个股有较大幅度的上涨，而估值偏高的股票则出现了较大幅度的下跌。上述趋势是反应产业趋势和监管政策的中长期趋势，而 MSCI 纳入 A 股则将进一步加强这一趋势。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.091 元，份额累计净值为 1.091 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 8.34%，同期业绩基准增长率 8.42%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内本基金的回报情况经历了较大的波动，其中一季度的情况较好但二季度有较大的回撤。主要原因在于本基金于 2 季度在左侧参与了一部分高成长行业和个股的投资机会，事后看介入时机偏早，给基金造成了损失。后续本基金将更加注重对净值回撤的控制，争取能够减少净值的回撤幅度。

展望下半年，由于各行业产能在过去的 4-5 年时间内得以逐步消化并带来行业竞争格局的改善和壁垒的提升，因此本次实体经济回报率的提升是一个中期趋势，随着实体经济参与者悲观预期的逐步修复，这将带动制造业投资的温和复苏。而央行和监管层的策略则是提前微调，避免金融体系的过度杠杆也防止良好复苏形势的逆转，因此预计后续政策上仍然延续目前的“平衡”策略。因此综合来看，本次复苏的基础较为坚实，预计持续的时间较长。流动性方面，我们预计央行将继续保持 6 月以来相对温和的态度有助于流动性预期的改善，在 A 股盈利趋势向好的背景下，整体市场机会较好，尤其是估值与成长性匹配的各行业龙头。我们将从中选择长期行业前景较好，竞争格局有利，估值水平合理的公司进行布局和投资。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、



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

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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

无。

---

## § 5 托管人报告

---

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，本基金未实施利润分配。

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

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：博时行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	14,361,705.59	9,333,063.18
结算备付金	4,235,914.33	3,342,222.94
存出保证金	413,003.48	409,115.06
交易性金融资产	301,578,532.98	143,137,556.57
其中：股票投资	301,578,532.98	143,137,556.57
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	8,765,696.53	78,398,273.50
应收利息	6,192.19	7,426.79
应收股利	-	-
应收申购款	189,501.88	27,426.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>329,550,546.98</b>	<b>234,655,084.83</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,140,977.11	681,897.28
应付管理人报酬	409,730.23	303,185.56
应付托管费	68,288.38	50,530.91
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,098,774.90	2,028,785.28
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,241.50	152,476.50
<b>负债合计</b>	<b>4,899,012.12</b>	<b>3,216,875.53</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	297,606,389.61	229,891,306.38
未分配利润	27,045,145.25	1,546,902.92
<b>所有者权益合计</b>	<b>324,651,534.86</b>	<b>231,438,209.30</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>329,550,546.98</b>	<b>234,655,084.83</b>

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.091 元，基金份额总额 297,606,389.61 份。

## 6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>18,448,023.97</b>	<b>4,856,164.07</b>
1. 利息收入	378,767.11	174,225.70
其中：存款利息收入	158,667.76	174,225.70
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	220,099.35	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-3,117,398.78	-1,417,055.20
其中：股票投资收益	-6,124,710.33	-1,703,468.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	3,007,311.55	286,413.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	21,024,487.26	5,964,038.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	162,168.38	134,955.55
<b>减：二、费用</b>	<b>6,390,957.46</b>	<b>5,140,603.16</b>
1. 管理人报酬	2,272,753.75	1,489,185.39
2. 托管费	378,792.32	248,197.57
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,560,011.68	3,217,295.47
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	179,399.71	185,924.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>12,057,066.51</b>	<b>-284,439.09</b>

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>12,057,066.51</b>	<b>-284,439.09</b>

### 6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	229,891,306.38	1,546,902.92	231,438,209.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,057,066.51	12,057,066.51
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）	67,715,083.23	13,441,175.82	81,156,259.05
其中：1. 基金申购款	195,588,947.98	25,413,016.03	221,001,964.01
2. 基金赎回款	-127,873,864.75	-11,971,840.21	-139,845,704.96
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）	297,606,389.61	27,045,145.25	324,651,534.86
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-284,439.09	-284,439.09
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）	19,328,370.08	-4,083,895.34	15,244,474.74
其中：1. 基金申购款	147,918,815.54	-21,639,109.08	126,279,706.46
2. 基金赎回款	-128,590,445.46	17,555,213.74	-111,035,231.72
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）	220,755,217.19	791,868.63	221,547,085.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致：

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

### 6.4.3 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	742,452,979.92	30.14%	223,766,478.74	9.58%

#### 6.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	655,176.78	30.05%	655,176.78	31.22%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	182,797.67	9.90%	214,914.43	15.80%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

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

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,272,753.75	1,489,185.39
其中：支付销售机构的客户维护费	746,165.03	490,094.51

注：支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

##### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	378,792.32	248,197.57

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 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。



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

无。

**6.4.4.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	14,361,705.59	130,615.58	13,079,685.59	156,048.86

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。

**6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内，本基金在承销期内未买入关联方所承销的证券（2016年可比期间：同）。

**6.4.5 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**
**6.4.5.1 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

6.4.5.1.1 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
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股未流通	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股未流通	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股未流通	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股未流通	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股未流通	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-

603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股未流通	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股未流通	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股未流通	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股未流通	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-

#### 6.4.5.2 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
002127	南极电商	2017-06-28	重大事项停牌	12.08	2017-07-06	12.61	1,310,200.00	16,616,473.00	15,827,216.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.6 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

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。

##### (a) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 285,627,633.88 元，属于第二层级的余额为 15,950,899.10 元，无属于第三层级的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层级 129,196,214.31 元，第二层级 13,941,342.26 元，无第三层级)。

(iii) 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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.1)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	301,578,532.98	91.51
	其中：股票	301,578,532.98	91.51
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	18,597,619.92	5.64
7	其他各项资产	9,374,394.08	2.84

8	合计	329,550,546.98	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	138,867,810.23	42.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,331,248.75	5.65
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,157,939.62	1.28
J	金融业	124,394,318.38	38.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,827,216.00	4.88
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	301,578,532.98	92.89

## 7.3 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	601601	中国太保	939,800	31,831,026.00	9.80
2	601166	兴业银行	1,873,800	31,592,268.00	9.73
3	601318	中国平安	614,900	30,505,189.00	9.40
4	600566	济川药业	571,600	21,737,948.00	6.70
5	002640	跨境通	862,647	18,331,248.75	5.65
6	002466	天齐锂业	325,600	17,696,360.00	5.45
7	002127	南极电商	1,310,200	15,827,216.00	4.88
8	002185	华天科技	1,999,200	14,474,208.00	4.46
9	601211	国泰君安	526,128	10,790,885.28	3.32
10	600062	华润双鹤	384,217	10,539,072.31	3.25

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半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300567	精测电子	59,599,268.13	25.75
2	600566	济川药业	39,242,928.48	16.96
3	601328	交通银行	35,000,448.00	15.12
4	601166	兴业银行	34,718,798.00	15.00
5	601601	中国太保	29,048,528.70	12.55
6	300577	开润股份	28,347,534.84	12.25
7	300603	立昂技术	28,287,393.59	12.22
8	300588	熙菱信息	28,128,618.93	12.15
9	601318	中国平安	27,019,721.08	11.67
10	002142	宁波银行	26,913,046.98	11.63
11	300628	亿联网络	26,158,130.00	11.30
12	300061	康耐特	25,591,956.45	11.06
13	002640	跨境通	24,921,841.46	10.77
14	300566	激智科技	24,802,633.04	10.72
15	000513	丽珠集团	23,998,350.13	10.37
16	002537	海立美达	23,902,580.22	10.33
17	601988	中国银行	23,655,090.00	10.22
18	300342	天银机电	21,380,716.34	9.24
19	603338	浙江鼎力	20,004,413.50	8.64
20	300463	迈克生物	19,484,580.02	8.42
21	300568	星源材质	19,413,804.61	8.39
22	603686	龙马环卫	17,934,227.20	7.75
23	002127	南极电商	16,616,473.00	7.18
24	002466	天齐锂业	16,556,956.00	7.15
25	002195	二三四五	16,307,754.69	7.05
26	002368	太极股份	15,273,939.75	6.60
27	002185	华天科技	14,333,036.12	6.19
28	300197	铁汉生态	13,951,491.56	6.03
29	300284	苏交科	13,595,894.98	5.87
30	603939	益丰药房	13,322,971.25	5.76
31	300571	平治信息	12,435,477.00	5.37
32	002310	东方园林	12,254,133.00	5.29
33	300206	理邦仪器	11,743,047.08	5.07
34	000068	华控赛格	11,677,836.66	5.05
35	603903	中持股份	11,543,675.40	4.99
36	300262	巴安水务	11,488,764.88	4.96
37	002850	科达利	11,488,518.98	4.96
38	002658	雪迪龙	11,484,929.00	4.96
39	600340	华夏幸福	11,482,465.00	4.96

40	300020	银江股份	11,479,245.00	4.96
41	000598	兴蓉环境	11,476,334.00	4.96
42	300287	飞利信	11,474,814.43	4.96
43	300203	聚光科技	11,455,145.10	4.95
44	300145	中金环境	11,390,764.84	4.92
45	002019	亿帆医药	11,268,799.45	4.87
46	600516	方大炭素	11,198,376.00	4.84
47	300137	先河环保	11,049,541.00	4.77
48	603727	博迈科	11,028,432.00	4.77
49	300144	宋城演艺	10,934,571.12	4.72
50	300075	数字政通	10,847,265.00	4.69
51	002494	华斯股份	10,770,592.00	4.65
52	300604	长川科技	10,762,487.36	4.65
53	300545	联得装备	10,675,614.11	4.61
54	300327	中颖电子	10,630,568.91	4.59
55	002643	万润股份	10,517,774.26	4.54
56	600887	伊利股份	10,459,666.00	4.52
57	300232	洲明科技	10,368,102.90	4.48
58	601021	春秋航空	10,139,503.10	4.38
59	600809	山西汾酒	10,119,904.25	4.37
60	601336	新华保险	10,014,580.50	4.33
61	601211	国泰君安	9,998,558.00	4.32
62	601799	星宇股份	9,957,486.27	4.30
63	600563	法拉电子	9,880,362.50	4.27
64	600062	华润双鹤	9,786,865.04	4.23
65	600066	宇通客车	9,761,234.30	4.22
66	002262	恩华药业	9,748,636.27	4.21
67	002614	奥佳华	9,646,624.00	4.17
68	600000	浦发银行	9,613,749.50	4.15
69	603186	华正新材	9,041,701.21	3.91
70	002624	完美世界	8,429,856.17	3.64
71	002139	拓邦股份	7,648,424.02	3.30
72	603444	吉比特	7,364,957.00	3.18
73	000958	东方能源	7,184,178.00	3.10
74	300355	蒙草生态	6,842,857.55	2.96
75	002045	国光电器	6,813,812.49	2.94
76	601009	南京银行	6,770,380.65	2.93
77	600015	华夏银行	6,767,933.00	2.92
78	601998	中信银行	6,760,454.08	2.92
79	603868	飞科电器	6,742,228.86	2.91
80	000937	冀中能源	6,709,659.00	2.90
81	600362	江西铜业	6,709,532.00	2.90
82	000060	中金岭南	6,705,525.30	2.90
83	601699	潞安环能	6,699,261.98	2.89
84	002813	路畅科技	6,690,365.00	2.89
85	300562	乐心医疗	6,632,016.00	2.87
86	002821	凯莱英	6,597,751.00	2.85
87	603579	荣泰健康	6,364,431.00	2.75
88	300432	富临精工	5,107,815.00	2.21

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



**7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300567	精测电子	61,379,883.66	26.52
2	601328	交通银行	41,634,745.00	17.99
3	300577	开润股份	30,824,779.17	13.32
4	002310	东方园林	26,766,241.42	11.57
5	002142	宁波银行	26,719,565.56	11.55
6	601988	中国银行	25,696,343.97	11.10
7	300197	铁汉生态	25,190,768.70	10.88
8	300628	亿联网络	24,937,681.43	10.78
9	300588	熙菱信息	23,801,703.14	10.28
10	000513	丽珠集团	23,473,205.17	10.14
11	002537	海立美达	21,969,091.97	9.49
12	300463	迈克生物	21,845,222.86	9.44
13	300603	立昂技术	21,589,481.90	9.33
14	300568	星源材质	21,386,127.45	9.24
15	300061	康耐特	21,273,768.89	9.19
16	300566	激智科技	21,099,134.00	9.12
17	600000	浦发银行	19,728,590.05	8.52
18	300342	天银机电	19,467,742.02	8.41
19	600566	济川药业	18,574,491.21	8.03
20	603686	龙马环卫	16,971,272.54	7.33
21	300203	聚光科技	16,544,572.09	7.15
22	002195	二三四五	16,057,769.68	6.94
23	601166	兴业银行	15,648,757.35	6.76
24	002368	太极股份	14,209,162.62	6.14
25	603939	益丰药房	14,088,619.14	6.09
26	300284	苏交科	13,839,716.19	5.98
27	300145	中金环境	13,360,572.47	5.77
28	600516	方大炭素	12,081,835.00	5.22
29	603727	博迈科	12,078,728.14	5.22
30	300571	平治信息	12,012,891.26	5.19
31	000068	华控赛格	11,516,664.48	4.98
32	300206	理邦仪器	11,387,962.80	4.92
33	002658	雪迪龙	11,250,238.63	4.86
34	300262	巴安水务	11,145,053.60	4.82
35	300137	先河环保	11,115,417.30	4.80
36	300287	飞利信	11,052,838.34	4.78
37	000598	兴蓉环境	11,043,651.64	4.77
38	300232	洲明科技	10,997,948.92	4.75
39	603338	浙江鼎力	10,964,971.92	4.74
40	300144	宋城演艺	10,928,971.03	4.72
41	300020	银江股份	10,856,486.63	4.69
42	603903	中持股份	10,753,223.06	4.65
43	002007	华兰生物	10,734,135.86	4.64
44	000001	平安银行	10,687,152.76	4.62
45	603186	华正新材	10,549,861.74	4.56

46	002640	跨境通	10,536,285.31	4.55
47	300075	数字政通	10,449,656.97	4.52
48	002643	万润股份	10,373,209.44	4.48
49	002494	华斯股份	10,242,394.00	4.43
50	600809	山西汾酒	9,970,199.24	4.31
51	002019	亿帆医药	9,778,968.75	4.23
52	300327	中颖电子	9,514,135.23	4.11
53	600340	华夏幸福	9,466,368.00	4.09
54	603444	吉比特	9,441,594.00	4.08
55	601021	春秋航空	9,416,248.00	4.07
56	300562	乐心医疗	9,347,161.76	4.04
57	002850	科达利	9,293,789.10	4.02
58	300545	联得装备	9,289,000.00	4.01
59	600887	伊利股份	9,230,845.35	3.99
60	300355	蒙草生态	9,032,076.00	3.90
61	002045	国光电器	8,846,059.25	3.82
62	002588	史丹利	8,684,295.00	3.75
63	300604	长川科技	8,443,061.00	3.65
64	603579	荣泰健康	8,122,546.00	3.51
65	603868	飞科电器	7,641,475.15	3.30
66	002139	拓邦股份	7,584,785.50	3.28
67	000958	东方能源	7,510,960.27	3.25
68	601398	工商银行	7,216,016.86	3.12
69	601288	农业银行	7,000,610.00	3.02
70	600015	华夏银行	6,838,416.00	2.95
71	601009	南京银行	6,795,040.15	2.94
72	601998	中信银行	6,744,650.00	2.91
73	601699	潞安环能	6,691,022.68	2.89
74	002813	路畅科技	6,658,409.41	2.88
75	002470	金正大	6,583,658.40	2.84
76	002659	中泰桥梁	6,550,483.12	2.83
77	000060	中金岭南	6,528,393.55	2.82
78	002821	凯莱英	6,419,120.62	2.77
79	600362	江西铜业	6,417,357.52	2.77
80	000937	冀中能源	6,381,810.00	2.76
81	300432	富临精工	5,891,542.00	2.55
82	002624	完美世界	4,887,723.58	2.11
83	300034	钢研高纳	4,853,366.01	2.10

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,304,814,753.65
卖出股票的收入（成交）总额	1,161,273,554.17

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 华润双鹤药业股份有限公司 2017 年 8 月 2 日发布公告称, 因其控股孙公司浙江新赛科药业有限公司滥用市场支配地位, 控股孙公司被国家发改委采取行政处罚措施。

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中, 没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	413,003.48
2	应收证券清算款	8,765,696.53
3	应收股利	-
4	应收利息	6,192.19
5	应收申购款	189,501.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	9,374,394.08
---	----	--------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002127	南极电商	15,827,216.00	4.88	重大事项停牌

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
15,597	19,081.00	9,145,785.73	3.07%	288,460,603.88	96.93%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	309,460.70	0.10%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 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、本基金基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 12 月 10 日) 基金份额总额	1,400,439,291.65
本报告期初基金份额总额	229,891,306.38
本报告期基金总申购份额	195,588,947.98

减：本报告期基金总赎回份额	127,873,864.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	297,606,389.61

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

国泰君安	3	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	742,452,979.92	30.14%	655,176.78	30.05%	-
中信建投	2	612,819,046.79	24.87%	570,726.47	26.18%	-
长江证券	2	588,845,445.33	23.90%	548,393.00	25.15%	-
海通证券	1	207,457,272.91	8.42%	151,713.56	6.96%	-
中金公司	1	130,120,503.96	5.28%	121,180.98	5.56%	-
国信证券	1	93,347,626.89	3.79%	68,263.17	3.13%	-
天风证券	2	58,954,860.31	2.39%	43,115.22	1.98%	-
东北证券	1	22,483,379.55	0.91%	16,442.38	0.75%	-
安信证券	1	7,114,473.21	0.29%	5,202.82	0.24%	-

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；



(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
上海华信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	64,100,000.00	7.97%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	740,400,000.00	92.03%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

---

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

博时基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十四日