

博时国企改革主题股票型证券投资基金 2017 年半年度报告 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十四日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

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 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	27
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38
§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	39
§9 开放式基金份额变动	39
§10 重大事件揭示	40

10.1 基金份额持有人大会决议	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2 产品特有风险	43
11.3 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时国企改革主题股票型证券投资基金
基金简称	博时国企改革股票
基金主代码	001277
交易代码	001277
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 20 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,076,927,124.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对国企改革事件催生的各类持续性和阶段性投资机会的深入研究，运用量化手段，结合自下而上的研究，实施多策略的组合管理，投资受益于中国国企改革的标的，以分享中国经济体制改革带来的财富增长，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略分五个方面：首先是资产配置策略，强调通过把握中国国企改革带来的各种投资机遇、结合公司分析和投资价值分析，使用量化的分析模型和策略，进行前瞻性的决策；二是股票投资策略，紧密围绕中国国企改革的基本面分析为基础，运用量化的方法，通过多条投资主线，设计量化策略，实施多策略的组合管理；三是债券投资策略，通过采用积极主动的投资策略，结合宏观经济变化趋势，货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合，在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性；最后是金融衍生品投资策略和资产支持证券的投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×90%+中国债券总指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险/预期收益特征的开放式基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140

法定代表人	张光华	易会满
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

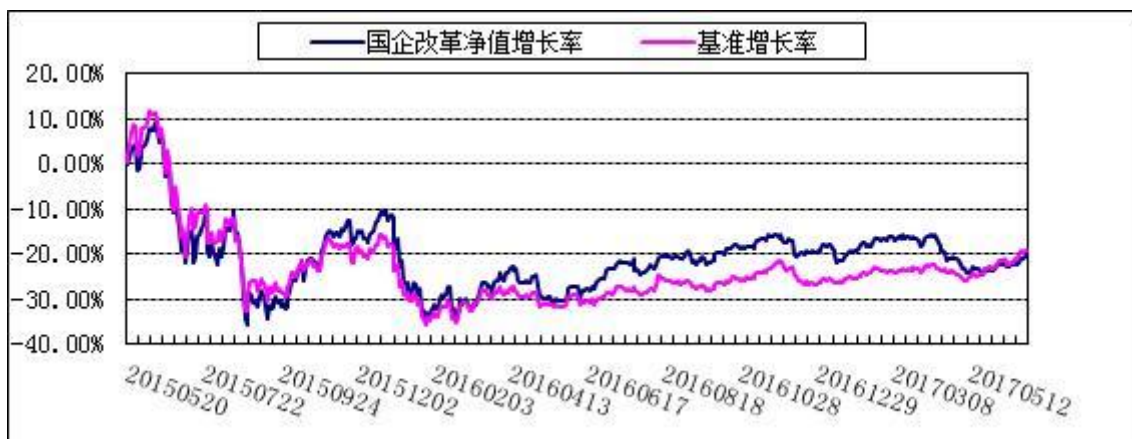
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-81,267,997.56
本期利润	-23,323,604.77
加权平均基金份额本期利润	-0.0108
本期加权平均净值利润率	-1.34%
本期基金份额净值增长率	-1.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-498,002,601.12
期末可供分配基金份额利润	-0.2398
期末基金资产净值	1,649,077,118.34
期末基金份额净值	0.794
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-20.60%

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	3.66%	0.55%	4.59%	0.61%	-0.93%	-0.06%
过去三个月	-3.41%	0.73%	5.47%	0.56%	-8.88%	0.17%
过去六个月	-1.49%	0.71%	9.60%	0.51%	-11.09%	0.20%
过去一年	6.15%	0.77%	14.50%	0.60%	-8.35%	0.17%
自基金合同生效起至今	-20.60%	1.93%	-19.39%	1.64%	-1.21%	0.29%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 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		
林景艺	基金经理	2015-05-20	-	7	2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理,现任博时国企改革股票基金兼博时量化平衡混合基金的基金经理。
周江	研究员兼基金经理助理	2015-07-27	-	2.2	2014 年 1 月至 2015 年 4 月在平安磐海资本工作。2015 年 4 月加入博时基金管理有限公司,曾任研究员,现任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。

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,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年市场波动率持续降低，消费行业龙头公司表现抢眼，体现投资者风险偏好降低环境下对于确定性成长的估值溢价。二季度市场风格差异急剧加大，以上证 50 为代表的大盘蓝筹与以中证 1000 为代表的小盘股收益率平均差异接近 20%，这一方面与金融去杠杆下的投资者风险偏好急剧下降有关，另一方面也有小盘股高估值风险未完全释放的影响。

本基金作为股票型基金今年以来一直保持 80% 以上的股票仓位，在投资策略上我们运用量化方法，围绕兼并重组、治理优化、业绩改善和资产重估四条投资主线，维持相对均衡的风格配置，在关注标的业绩改善和成长潜力的同时也注意控制整体组合的估值风险，行业配置较为分散。因此，在二季度市场只有少部分股票上涨，大部分股票整体下挫的情况下，相对分散的持仓遇到了部分回撤。

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 0.794 元，份额累计净值为 0.794 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-1.49%，同期业绩基准增长率 9.6%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，在一二季度经济增速超预期之后，三季度经济增速将小幅下滑，但总体上市场对于经济的预期仍处在改善过程中。金融防风险、降杠杆的政策依然会持续推进，货币政策维持中性趋紧，市场流动性相对并不充裕但是存在边际改善的可能。国企混合所有制改革特别是重点地区地方国企改革步伐将有所加快，供给侧改革深入推进态势明确，僵尸企业处置提速。市场情绪趋于稳定，预期下半年投资者风险偏好会略有提高，但是部分股票的估值依然在历史中位数以上，低估值且具有业绩稳定性的板块和个股更加值得关注。展望全年，我们认为市场还是会以震荡为主，组合操作上需要进一步加强对市场状况的应对，顺势而为，及时调整基金的策略配置，力求战胜基准，为投资者创造价值。

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、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

本报告期内，本基金托管人在对博时国企改革主题股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，博时国企改革主题股票型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时国企改革主题股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时国企改革主题股票型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时国企改革主题股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	126,567,544.80	143,562,406.26
结算备付金		49,796,964.08	65,713,527.26
存出保证金		4,306,563.29	12,546,019.47
交易性金融资产	6.4.3.2	1,453,997,705.63	1,544,971,705.80
其中：股票投资		1,451,482,167.33	1,544,019,291.00
基金投资		-	-
债券投资		2,515,538.30	952,414.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	30,000,000.00	30,000,000.00
应收证券清算款		217,145.73	17,173,457.45
应收利息	6.4.3.5	69,404.60	92,400.99
应收股利		-	-
应收申购款		204,489.58	359,570.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		1,665,159,817.71	1,814,419,087.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.3.3	-	-
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		3,437,995.34	1,039,448.72
应付管理人报酬		2,008,367.35	2,322,753.77
应付托管费		334,727.88	387,125.60
应付销售服务费	6.4.3.7	-	-
应付交易费用		10,096,528.84	10,077,867.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	205,079.96	203,841.56
负债合计		16,082,699.37	14,031,037.45
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	2,076,927,124.86	2,234,657,875.75
未分配利润	6.4.3.10	-427,850,006.52	-434,269,825.53
所有者权益合计		1,649,077,118.34	1,800,388,050.22
负债和所有者权益总计		1,665,159,817.71	1,814,419,087.67

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.794 元，基金份额总额 2,076,927,124.86 份。

6.2 利润表

会计主体：博时国企改革主题股票型证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		11,223,070.27	-315,795,088.07
1. 利息收入		1,261,048.47	1,287,078.50
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,149,772.32	1,271,024.04
债券利息收入		2,309.63	498.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		108,966.52	15,555.53
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-48,225,417.89	-312,288,022.56
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-65,922,823.74	-315,780,657.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	151,097.46	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	5,177,100.00	-5,212,520.00
股利收益	6.4.3.15	12,369,208.39	8,705,154.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	57,944,392.79	-5,068,393.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	243,046.90	274,249.70
减：二、费用		34,546,675.04	43,774,217.78
1. 管理人报酬		12,944,375.72	14,452,448.90
2. 托管费		2,157,396.03	2,408,741.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	19,233,246.53	26,702,283.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.19	211,656.76	210,743.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-23,323,604.77	-359,569,305.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,323,604.77	-359,569,305.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时国企改革主题股票型证券投资基金

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）	2,234,657,875.75	-434,269,825.53	1,800,388,050.22
二、本期经营活动产生的	-	-23,323,604.77	-23,323,604.77

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-157,730,750.89	29,743,423.78	-127,987,327.11
其中：1. 基金申购款	45,677,537.25	-8,558,521.18	37,119,016.07
2. 基金赎回款	-203,408,288.14	38,301,944.96	-165,106,343.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,076,927,124.86	-427,850,006.52	1,649,077,118.34
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）	2,704,927,332.22	-323,271,371.16	2,381,655,961.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-359,569,305.85	-359,569,305.85
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）	-81,843,159.59	21,001,327.58	-60,841,832.01
其中：1. 基金申购款	84,335,253.81	-23,158,445.11	61,176,808.70
2. 基金赎回款	-166,178,413.40	44,159,772.69	-122,018,640.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,623,084,172.63	-661,839,349.43	1,961,244,823.20

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[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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	活期存款	126,567,544.80
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	126,567,544.80	

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,409,174,860.31	1,451,482,167.33	42,307,307.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,396,000.00	2,515,538.30
	银行间市场	-	-
	合计	2,396,000.00	2,515,538.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,411,570,860.31	1,453,997,705.63	42,426,845.32

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注 (投资成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
股指期货	19,715,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	19,715,280.00	-	-	-

衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IH1707	26	19,715,280.00	334,920.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	334,920.00
股指期货投资净额	-	-	-

6.4.3.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所市场	30,000,000.00	-
合计	30,000,000.00	-

注：无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	24,749.20
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	30,890.50
应收债券利息	1,306.09
应收买入返售证券利息	12,304.11
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	154.70
合计	69,404.60

6.4.3.6 其他资产

无。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	10,096,528.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,096,528.84

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,725.68
其他应付款	-
预提费用	198,354.28
合计	205,079.96

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,234,657,875.75	2,234,657,875.75
本期申购	45,677,537.25	45,677,537.25
本期赎回（以“-”号填列）	-203,408,288.14	-203,408,288.14
本期末	2,076,927,124.86	2,076,927,124.86

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-449,578,408.26	15,308,582.73	-434,269,825.53
本期利润	-81,267,997.56	57,944,392.79	-23,323,604.77
本期基金份额交易产生的变动数	32,843,804.70	-3,100,380.92	29,743,423.78
其中：基金申购款	-9,277,345.34	718,824.16	-8,558,521.18
基金赎回款	42,121,150.04	-3,819,205.08	38,301,944.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-498,002,601.12	70,152,594.60	-427,850,006.52

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	550,690.88
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	596,633.29
其他	2,448.15
合计	1,149,772.32

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	6,670,693,434.53
减：卖出股票成本总额	6,736,616,258.27
买卖股票差价收入	-65,922,823.74

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	668,479.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	517,000.00
减：应收利息总额	382.44
买卖债券差价收入	151,097.46

6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
远期投资收益	-
期货投资收益	5,177,100.00
期权投资收益	-
合计	5,177,100.00

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,369,208.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,369,208.39

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	59,904,992.79
——股票投资	59,939,869.29
——债券投资	-34,876.50
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,960,600.00
——股指期货投资	-1,960,600.00
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	57,944,392.79

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	227,169.95
转换费收入	15,876.95
合计	243,046.90

注：对持续持有期少于 30 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产；赎回费未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	19,233,246.53
银行间市场交易费用	-
合计	19,233,246.53

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行间汇划费	3,902.48
银行间账户维护费	9,000.00
其他	400.00
合计	211,656.76

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

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	3,362,137,891.03	25.37%	2,588,315,563.38	14.37%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 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	3,131,214.02	27.51%	3,131,214.02	31.01%
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	2,410,481.21	15.02%	2,850,060.93	17.20%

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	12,944,375.72	14,452,448.90

其中：支付销售机构的客户维护费	5,157,807.59	6,623,033.57
-----------------	--------------	--------------

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	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	2,157,396.03	2,408,741.47

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		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
中国工商银行	126,567,544.80	550,690.88	211,743,891.57	831,720.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
002879	长缆科技	2017-6-5	2017-7-7	未上市	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-6-15	2017-7-17	未上市	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-6-28	2017-7-6	未上市	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-6-30	2017-7-10	未上市	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-6-26	2017-7-3	未上市	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-

300672	国科微	2017-6-30	2017-7-12	未上市	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-6-27	2017-7-5	未上市	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-6-27	2017-7-5	未上市	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-6-23	2017-7-3	未上市	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
601088	中国神华	2017-06-05	重要事项未公告	22.29	-	-	1,082,500	22,554,905.67	24,128,925.00	
002600	江粉磁材	2017-02-27	重大资产重组	11.46	-	-	500,700	5,297,682.11	5,738,022.00	
300267	尔康制药	2017-05-10	重大事项	11.46	-	-	407,300	5,360,519.24	4,667,658.00	
300087	荃银高科	2017-05-12	重大资产重组	14.14	-	-	302,200	4,064,709.00	4,273,108.00	
000034	神州数码	2017-03-21	重大资产重组	24.45	2017-7-18	22.01	163,300	4,254,335.71	3,992,685.00	
002675	东诚药业	2017-01-03	重大资产重组	14.26	2017-7-17	12.84	241,600	3,524,067.76	3,445,216.00	
000301	东方市场	2017-03-13	重大资产重组	5.05	-	-	670,200	3,463,069.00	3,384,510.00	
300065	海兰信	2016-12-08	重大资产重组	24.49	2017-7-6	23.07	131,550	3,347,769.22	3,221,659.50	
300209	天泽信息	2017-02-10	重大资产重组	27.72	-	-	113,700	3,145,478.51	3,151,764.00	
600734	实达集团	2017-04-05	重大事项	12.75	2017-7-12	12.00	167,100	2,327,310.10	2,130,525.00	
601989	中国重工	2017-05-26	重大资产重组	6.21	-	-	332,300	2,034,655.00	2,063,583.00	
601919	中远海控	2017-05-17	重大资产重组	5.35	2017-7-26	5.89	382,800	2,088,362.51	2,047,980.00	
601001	大同煤业	2017-06-22	重要事项未公告	5.25	2017-7-21	5.78	366,000	1,922,454.98	1,921,500.00	
300145	中金环境	2017-06-28	重大资产重组	16.92	-	-	111,780	1,782,588.47	1,891,317.60	
002625	龙生股份	2017-04-13	重大资产重组	36.36	-	-	45,900	1,649,147.50	1,668,924.00	
600460	士兰微	2017-05-12	重大资产重组	6.07	-	-	269,800	1,737,825.00	1,637,686.00	
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76	-	-	269,400	1,570,368.00	1,551,744.00	
601717	郑煤机	2017-04-24	重大资产重组	7.79	-	-	198,400	1,566,475.66	1,545,536.00	
601313	江南嘉捷	2017-06-12	重大资产重组	8.79	-	-	171,690	1,605,040.48	1,509,155.10	
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.24	2017-8-2	11.36	130,350	1,540,901.97	1,334,784.00	
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项	12.08	2017-7-6	12.61	80,800	968,059.81	976,064.00	
002509	天广中茂	2017-06-12	重大事项	9.20	-	-	98,280	813,458.25	904,176.00	
002075	沙钢股份	2016-09-15	重大资产重组	16.12	-	-	46,700	775,926.35	752,804.00	
300271	华宇软件	2017-06-22	拟披露重大事项	16.59	2017-7-4	16.8	44,800	753,600.19	743,232.00	
002358	森源电气	2017-05-12	重大资产重组	17.02	2017-7-12	16.68	28,600	554,023.00	486,772.00	
300340	科恒股份	2017-06-05	重大资产重组	43.55	-	-	10,500	539,732.90	457,275.00	
002162	悦心健康	2016-12-22	重大资产重组	6.61	2017-7-5	6.8	45,100	288,513.65	298,111.00	
000935	四川双马	2017-01-17	重大资产重组	23.06	-	-	8,900	266,617.00	205,234.00	
600890	中房股份	2016-08-22	重大事项	11.27	-	-	17,500	186,097.00	197,225.00	
600468	百利电气	2017-05-16	重大资产重组	6.50	-	-	14,550	105,848.72	94,575.00	
600490	鹏欣资源	2017-02-21	重大资产重组	7.91	-	-	9,300	75,026.00	73,563.00	
600057	象屿股份	2017-06-27	重要事项未公告	10.17	2017-7-4	10.07	89,906	958,863.33	914,344.02	

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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种，风险与预期收益都要高于平衡型基金。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“基金资产长期稳定增长”的风险收益目标。

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。

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	126,567,544.80	-	-	-	126,567,544.80
结算备付金	49,796,964.08	-	-	-	49,796,964.08
存出保证金	4,306,563.29	-	-	-	4,306,563.29
交易性金融资产	-	293,307.80	2,287,948.10	1,451,482,167.33	1,454,063,423.23
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	30,000,000.00

应收证券清算款	-	-	-	217,145.73	217,145.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	69,404.60	69,404.60
应收申购款	-	-	-	204,489.58	204,489.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	210,671,072.17	293,307.80	2,287,948.10	1,451,973,207.24	1,665,225,535.31
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	334,920.00	334,920.00
应付赎回款	-	-	-	3,437,995.34	3,437,995.34
应付管理人报酬	-	-	-	2,008,367.35	2,008,367.35
应付托管费	-	-	-	334,727.88	334,727.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,096,528.84	10,096,528.84
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	205,079.96	205,079.96
负债总计				16,417,619.37	16,417,619.37
利率敏感度缺口	210,671,072.17	293,307.80	2,287,948.10	1,435,555,587.87	1,648,807,915.94
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	143,562,406.26	-	-	-	143,562,406.26
结算备付金	65,713,527.26	-	-	-	65,713,527.26
存出保证金	12,546,019.47	-	-	-	12,546,019.47
交易性金融资产	-	468,345.60	484,069.20	1,544,019,291.00	1,544,971,705.80
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	17,173,457.45	17,173,457.45
应收利息	-	-	-	92,400.99	92,400.99
应收申购款	-	-	-	359,570.44	359,570.44
资产总计	251,821,952.99	468,345.60	484,069.20	1,561,644,719.88	1,814,419,087.67
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,039,448.72	1,039,448.72
应付管理人报酬	-	-	-	2,322,753.77	2,322,753.77
应付托管费	-	-	-	387,125.60	387,125.60
应付交易费用	-	-	-	10,077,867.80	10,077,867.80
其他负债	-	-	-	203,841.56	203,841.56
负债总计				14,031,037.45	14,031,037.45
利率敏感度缺口	251,821,952.99	468,345.60	484,069.20	1,547,613,682.43	1,800,388,050.22

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.15%（2016 年 12 月 31 日：0.05%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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 80%-95%，其中投资于国企改革股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	1,451,482,167.33	88.02	1,544,019,291.00	85.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,451,482,167.33	88.02	1,544,019,291.00	85.76

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元)	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 8,139	增加约 10,287
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 8,139	减少约 10,287	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 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 1,372,464,365.31 元，属于第二层级的余额为 81,533,340.32 元，无属于第三层级的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 1,490,256,273.66 元，属于第二层次的余额为 54,715,432.14 元，无属于第三层次的余额）。

(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。

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,451,482,167.33	87.17
	其中：股票	1,451,482,167.33	87.17
2	固定收益投资	2,515,538.30	0.15
	其中：债券	2,515,538.30	0.15
	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	30,000,000.00	1.80
	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	176,364,508.88	10.59
7	其他各项资产	4,797,603.20	0.29

8	合计	1,665,159,817.71	100.00
---	----	------------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,078,150.00	0.43
B	采矿业	131,740,355.11	7.99
C	制造业	678,469,855.58	41.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,021,726.00	0.91
E	建筑业	105,781,090.20	6.41
F	批发和零售业	53,783,589.59	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	35,236,241.88	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,844,154.73	1.51
J	金融业	222,897,419.92	13.52
K	房地产业	142,031,552.70	8.61
L	租赁和商务服务业	10,841,689.02	0.66
M	科学研究和技术服务业	668,885.89	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	8,935,471.70	0.54
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	11,580,765.65	0.70
S	综合	2,571,219.36	0.16
	合计	1,451,482,167.33	88.02

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	732,692	36,348,850.12	2.20
2	601668	中国建筑	3,017,700	29,211,336.00	1.77
3	601088	中国神华	1,082,500	24,128,925.00	1.46
4	600016	民生银行	2,931,600	24,097,752.00	1.46
5	600028	中国石化	4,060,260	24,077,341.80	1.46
6	601166	兴业银行	1,321,200	22,275,432.00	1.35
7	601186	中国铁建	1,764,700	21,229,341.00	1.29
8	600104	上汽集团	591,100	18,353,655.00	1.11
9	600015	华夏银行	1,908,056	17,592,276.32	1.07
10	600782	新钢股份	4,717,600	17,219,240.00	1.04
11	601288	农业银行	4,628,775	16,293,288.00	0.99
12	600383	金地集团	1,371,500	15,731,105.00	0.95
13	600823	世茂股份	3,156,420	15,466,458.00	0.94
14	600547	山东黄金	527,200	15,251,896.00	0.92
15	601857	中国石油	1,938,700	14,908,603.00	0.90
16	600708	光明地产	2,235,080	14,840,931.20	0.90

17	601006	大秦铁路	1,761,628	14,780,058.92	0.90
18	601390	中国中铁	1,701,100	14,748,537.00	0.89
19	601800	中国交建	890,100	14,143,689.00	0.86
20	600675	中华企业	2,020,980	13,762,873.80	0.83
21	601328	交通银行	2,176,448	13,406,919.68	0.81
22	600000	浦发银行	1,023,799	12,951,057.35	0.79
23	601988	中国银行	3,498,900	12,945,930.00	0.79
24	601818	光大银行	3,195,937	12,943,544.85	0.78
25	601666	平煤股份	2,419,301	12,749,716.27	0.77
26	600519	贵州茅台	24,600	11,607,510.00	0.70
27	000002	万科 A	420,700	10,504,879.00	0.64
28	600741	华域汽车	428,728	10,392,366.72	0.63
29	601169	北京银行	1,060,200	9,722,034.00	0.59
30	600160	巨化股份	807,600	9,715,428.00	0.59
31	000959	首钢股份	1,384,300	9,676,257.00	0.59
32	000059	华锦股份	927,800	9,287,278.00	0.56
33	000550	江铃汽车	446,973	9,252,341.10	0.56
34	000830	鲁西化工	1,315,000	9,073,500.00	0.55
35	600801	华新水泥	946,800	9,023,004.00	0.55
36	601009	南京银行	778,800	8,730,348.00	0.53
37	600269	赣粤高速	1,647,275	8,582,302.75	0.52
38	000528	柳工	986,800	8,525,952.00	0.52
39	002146	荣盛发展	856,200	8,450,694.00	0.51
40	600183	生益科技	662,218	8,171,770.12	0.50
41	002601	龙鳞佰利	481,400	7,885,332.00	0.48
42	600409	三友化工	763,400	7,687,438.00	0.47
43	600720	祁连山	977,900	7,656,957.00	0.46
44	601225	陕西煤业	1,077,400	7,617,218.00	0.46
45	600875	东方电气	771,000	7,386,180.00	0.45
46	000415	渤海金控	1,095,200	7,370,696.00	0.45
47	002589	瑞康医药	475,416	7,321,406.40	0.44
48	600325	华发股份	874,000	7,297,900.00	0.44
49	600755	厦门国贸	797,500	7,273,200.00	0.44
50	000701	厦门信达	570,800	7,135,000.00	0.43
51	000001	平安银行	759,700	7,133,583.00	0.43
52	601117	中国化学	1,017,400	7,111,626.00	0.43
53	002078	太阳纸业	960,200	7,057,470.00	0.43
54	600266	北京城建	478,100	6,951,574.00	0.42
55	600966	博汇纸业	1,330,600	6,905,814.00	0.42
56	000926	福星股份	564,300	6,884,460.00	0.42
57	002092	中泰化学	541,200	6,873,240.00	0.42
58	600376	首开股份	600,400	6,868,576.00	0.42
59	600166	福田汽车	2,385,100	6,773,684.00	0.41
60	000651	格力电器	158,800	6,537,796.00	0.40
61	000709	河钢股份	1,529,555	6,408,835.45	0.39
62	600808	马钢股份	1,799,341	6,369,667.14	0.39
63	000425	徐工机械	1,686,000	6,322,500.00	0.38
64	600449	宁夏建材	644,200	6,190,762.00	0.38
65	000858	五粮液	110,700	6,161,562.00	0.37
66	600746	江苏索普	568,006	6,123,104.68	0.37

67	000717	韶钢松山	1,253,223	6,103,196.01	0.37
68	300193	佳士科技	716,318	5,952,602.58	0.36
69	002600	江粉磁材	500,700	5,738,022.00	0.35
70	600487	亨通光电	203,900	5,719,395.00	0.35
71	000725	京东方 A	1,370,100	5,699,616.00	0.35
72	600060	海信电器	370,800	5,625,036.00	0.34
73	601636	旗滨集团	1,220,075	5,502,538.25	0.33
74	600997	开滦股份	883,475	5,389,197.50	0.33
75	600887	伊利股份	246,300	5,317,617.00	0.32
76	000498	山东路桥	722,700	5,167,305.00	0.31
77	601233	桐昆股份	366,800	5,083,848.00	0.31
78	601231	环旭电子	318,712	5,006,965.52	0.30
79	600792	云煤能源	1,085,534	5,004,311.74	0.30
80	603128	华贸物流	583,100	4,991,336.00	0.30
81	002479	富春环保	414,400	4,931,360.00	0.30
82	600757	长江传媒	653,800	4,883,886.00	0.30
83	600309	万华化学	168,200	4,817,248.00	0.29
84	000789	万年青	668,200	4,737,538.00	0.29
85	002315	焦点科技	188,800	4,708,672.00	0.29
86	300267	尔康制药	407,300	4,667,658.00	0.28
87	000417	合肥百货	560,700	4,625,775.00	0.28
88	002683	宏大爆破	509,000	4,591,180.00	0.28
89	002534	杭锅股份	483,860	4,577,315.60	0.28
90	601628	中国人寿	168,400	4,543,432.00	0.28
91	002142	宁波银行	232,700	4,491,110.00	0.27
92	601601	中国太保	131,000	4,436,970.00	0.27
93	000985	大庆华科	186,406	4,417,822.20	0.27
94	300087	荃银高科	302,200	4,273,108.00	0.26
95	600308	华泰股份	742,400	4,216,832.00	0.26
96	600585	海螺水泥	184,500	4,193,685.00	0.25
97	300116	坚瑞沃能	388,000	4,171,000.00	0.25
98	601168	西部矿业	539,200	4,146,448.00	0.25
99	000800	一汽轿车	405,901	4,128,013.17	0.25
100	000568	泸州老窖	81,300	4,112,154.00	0.25
101	002456	欧菲光	225,700	4,100,969.00	0.25
102	600188	兖州煤业	334,600	4,095,504.00	0.25
103	601678	滨化股份	584,600	4,062,970.00	0.25
104	002636	金安国纪	233,700	4,035,999.00	0.24
105	600031	三一重工	491,500	3,995,895.00	0.24
106	000034	神州数码	163,300	3,992,685.00	0.24
107	601211	国泰君安	193,100	3,960,481.00	0.24
108	000685	中山公用	347,800	3,808,410.00	0.23
109	600743	华远地产	896,800	3,784,496.00	0.23
110	300184	力源信息	302,020	3,757,128.80	0.23
111	600231	凌钢股份	1,121,300	3,700,290.00	0.22
112	603568	伟明环保	170,900	3,694,858.00	0.22
113	002530	金财互联	124,000	3,653,040.00	0.22
114	600068	葛洲坝	324,600	3,648,504.00	0.22
115	600397	安源煤业	843,022	3,641,855.04	0.22
116	000807	云铝股份	502,800	3,630,216.00	0.22

117	002463	沪电股份	786,400	3,578,120.00	0.22
118	002675	东诚药业	241,600	3,445,216.00	0.21
119	000423	东阿阿胶	47,400	3,407,586.00	0.21
120	300158	振东制药	209,253	3,394,083.66	0.21
121	300136	信维通信	84,700	3,389,694.00	0.21
122	000301	东方市场	670,200	3,384,510.00	0.21
123	002572	索菲亚	81,800	3,353,800.00	0.20
124	002061	江山化工	353,600	3,352,128.00	0.20
125	002247	帝龙文化	254,163	3,334,618.56	0.20
126	002354	天神娱乐	155,000	3,332,500.00	0.20
127	000756	新华制药	214,935	3,262,713.30	0.20
128	300297	蓝盾股份	294,401	3,223,690.95	0.20
129	300065	海兰信	131,550	3,221,659.50	0.20
130	000426	兴业矿业	352,700	3,181,354.00	0.19
131	300209	天泽信息	113,700	3,151,764.00	0.19
132	000521	美菱电器	488,820	3,128,448.00	0.19
133	600380	健康元	343,700	3,120,796.00	0.19
134	601339	百隆东方	524,135	3,118,603.25	0.19
135	002475	立讯精密	106,400	3,111,136.00	0.19
136	603799	华友钴业	51,000	3,099,780.00	0.19
137	600499	科达洁能	388,800	3,087,072.00	0.19
138	000936	华西股份	437,600	3,071,952.00	0.19
139	600230	沧州大化	103,100	3,064,132.00	0.19
140	600438	通威股份	548,600	3,061,188.00	0.19
141	002277	友阿股份	473,200	3,052,140.00	0.19
142	300040	九洲电气	300,869	3,050,811.66	0.19
143	601101	昊华能源	371,785	3,048,637.00	0.18
144	002101	广东鸿图	126,659	3,025,883.51	0.18
145	002254	泰和新材	225,800	3,003,140.00	0.18
146	600641	万业企业	267,500	2,985,300.00	0.18
147	002615	哈尔斯	263,400	2,976,420.00	0.18
148	600628	新世界	257,500	2,974,125.00	0.18
149	603355	莱克电气	50,580	2,972,586.60	0.18
150	002507	涪陵榨菜	261,000	2,933,640.00	0.18
151	000930	中粮生化	270,700	2,918,146.00	0.18
152	300194	福安药业	417,500	2,901,625.00	0.18
153	601999	出版传媒	317,894	2,899,193.28	0.18
154	601669	中国电建	365,600	2,895,552.00	0.18
155	600751	天海投资	507,600	2,888,244.00	0.18
156	600606	绿地控股	367,500	2,873,850.00	0.17
157	000036	华联控股	314,546	2,862,368.60	0.17
158	300156	神雾环保	87,300	2,859,948.00	0.17
159	002236	大华股份	123,500	2,817,035.00	0.17
160	002205	国统股份	101,700	2,790,648.00	0.17
161	000525	红太阳	147,900	2,752,419.00	0.17
162	000980	众泰汽车	227,800	2,747,268.00	0.17
163	000898	鞍钢股份	484,800	2,743,968.00	0.17
164	002258	利尔化学	216,600	2,737,824.00	0.17
165	300217	东方电热	748,500	2,724,540.00	0.17
166	002002	鸿达兴业	347,490	2,720,846.70	0.16

167	300173	智慧松德	227,800	2,708,542.00	0.16
168	000761	本钢板材	513,224	2,684,161.52	0.16
169	000402	金融街	227,342	2,664,448.24	0.16
170	600056	中国医药	101,800	2,641,710.00	0.16
171	300393	中来股份	47,900	2,634,979.00	0.16
172	600067	冠城大通	383,300	2,633,271.00	0.16
173	002334	英威腾	357,700	2,593,325.00	0.16
174	000609	绵石投资	172,797	2,571,219.36	0.16
175	300042	朗科科技	70,100	2,558,650.00	0.16
176	600022	山东钢铁	1,240,380	2,555,182.80	0.15
177	000509	华塑控股	410,600	2,545,720.00	0.15
178	600958	东方证券	182,800	2,542,748.00	0.15
179	000541	佛山照明	278,500	2,537,135.00	0.15
180	601100	恒立液压	155,747	2,537,118.63	0.15
181	300306	远方光电	145,613	2,523,473.29	0.15
182	000597	东北制药	224,610	2,511,139.80	0.15
183	603869	北部湾旅	91,700	2,495,157.00	0.15
184	000963	华东医药	49,900	2,480,030.00	0.15
185	002048	宁波华翔	118,300	2,467,738.00	0.15
186	300451	创业软件	80,332	2,440,486.16	0.15
187	002466	天齐锂业	44,500	2,418,575.00	0.15
188	600745	中茵股份	127,300	2,381,783.00	0.14
189	002241	歌尔股份	121,800	2,348,304.00	0.14
190	000338	潍柴动力	176,900	2,335,080.00	0.14
191	000400	许继电气	130,000	2,334,800.00	0.14
192	000676	智度股份	155,788	2,332,146.36	0.14
193	002460	赣锋锂业	50,200	2,321,750.00	0.14
194	300115	长盈精密	78,700	2,296,466.00	0.14
195	002035	华帝股份	94,297	2,281,987.40	0.14
196	600567	山鹰纸业	633,500	2,267,930.00	0.14
197	600507	方大特钢	265,530	2,264,970.90	0.14
198	601766	中国中车	220,200	2,228,424.00	0.14
199	000333	美的集团	50,600	2,177,824.00	0.13
200	000978	桂林旅游	233,100	2,158,506.00	0.13
201	600466	蓝光发展	250,100	2,158,363.00	0.13
202	002503	搜于特	303,240	2,131,777.20	0.13
203	600734	实达集团	167,100	2,130,525.00	0.13
204	600665	天地源	416,393	2,077,801.07	0.13
205	601989	中国重工	332,300	2,063,583.00	0.13
206	601919	中远海控	382,800	2,047,980.00	0.12
207	600872	中炬高新	110,330	2,019,039.00	0.12
208	000797	中国武夷	213,600	2,003,568.00	0.12
209	600582	天地科技	434,800	1,995,732.00	0.12
210	601898	中煤能源	339,100	1,993,908.00	0.12
211	002714	牧原股份	73,200	1,992,504.00	0.12
212	300230	永利股份	120,180	1,987,777.20	0.12
213	600123	兰花科创	260,000	1,981,200.00	0.12
214	600723	首商股份	219,600	1,958,832.00	0.12
215	600508	上海能源	167,300	1,952,391.00	0.12
216	002204	大连重工	477,100	1,941,797.00	0.12

217	601001	大同煤业	366,000	1,921,500.00	0.12
218	300324	旋极信息	104,900	1,913,376.00	0.12
219	000910	大亚圣象	76,372	1,897,080.48	0.12
220	002001	新和成	97,500	1,892,475.00	0.11
221	300145	中金环境	111,780	1,891,317.60	0.11
222	600893	航发动力	69,200	1,889,160.00	0.11
223	600565	迪马股份	336,000	1,851,360.00	0.11
224	300197	铁汉生态	139,400	1,851,232.00	0.11
225	600048	保利地产	184,802	1,842,475.94	0.11
226	600703	三安光电	90,500	1,782,850.00	0.11
227	600584	长电科技	108,200	1,736,610.00	0.11
228	000997	新大陆	74,500	1,690,405.00	0.10
229	002625	龙生股份	45,900	1,668,924.00	0.10
230	601336	新华保险	32,100	1,649,940.00	0.10
231	002042	华孚色纺	154,305	1,649,520.45	0.10
232	600867	通化东宝	89,940	1,640,505.60	0.10
233	600460	士兰微	269,800	1,637,686.00	0.10
234	600657	信达地产	269,400	1,551,744.00	0.09
235	300320	海达股份	102,600	1,547,208.00	0.09
236	601717	郑煤机	198,400	1,545,536.00	0.09
237	002050	三花智控	92,558	1,510,546.56	0.09
238	601313	江南嘉捷	171,690	1,509,155.10	0.09
239	601113	华鼎股份	178,300	1,503,069.00	0.09
240	000625	长安汽车	103,700	1,495,354.00	0.09
241	002508	老板电器	34,190	1,486,581.20	0.09
242	300415	伊之密	102,240	1,476,345.60	0.09
243	600079	人福医药	75,200	1,475,424.00	0.09
244	600919	江苏银行	158,800	1,475,252.00	0.09
245	300285	国瓷材料	74,700	1,471,590.00	0.09
246	002635	安洁科技	39,500	1,430,690.00	0.09
247	600340	华夏幸福	42,500	1,427,150.00	0.09
248	000820	神雾节能	37,000	1,405,260.00	0.09
249	002008	大族激光	40,100	1,389,064.00	0.08
250	002310	东方园林	82,700	1,382,744.00	0.08
251	600779	水井坊	55,746	1,370,236.68	0.08
252	000063	中兴通讯	57,400	1,362,676.00	0.08
253	300303	聚飞光电	312,800	1,354,424.00	0.08
254	002013	中航机电	130,350	1,334,784.00	0.08
255	000960	锡业股份	97,800	1,331,058.00	0.08
256	600109	国金证券	112,700	1,320,844.00	0.08
257	601607	上海医药	45,200	1,305,376.00	0.08
258	601998	中信银行	204,600	1,286,934.00	0.08
259	002007	华兰生物	35,000	1,277,500.00	0.08
260	600276	恒瑞医药	25,200	1,274,868.00	0.08
261	300296	利亚德	67,800	1,274,640.00	0.08
262	000028	国药一致	15,400	1,245,860.00	0.08
263	600110	诺德股份	88,300	1,244,147.00	0.08
264	600518	康美药业	56,800	1,234,832.00	0.07
265	000538	云南白药	13,100	1,229,435.00	0.07
266	002450	康得新	53,900	1,213,828.00	0.07

267	002093	国脉科技	137,700	1,211,760.00	0.07
268	002088	鲁阳节能	100,400	1,201,788.00	0.07
269	600105	永鼎股份	148,200	1,195,974.00	0.07
270	000928	中钢国际	125,000	1,182,500.00	0.07
271	600019	宝钢股份	174,800	1,172,908.00	0.07
272	600035	楚天高速	210,971	1,162,450.21	0.07
273	002043	兔宝宝	83,349	1,153,550.16	0.07
274	601567	三星医疗	110,143	1,147,690.06	0.07
275	600229	城市传媒	122,201	1,145,023.37	0.07
276	601788	光大证券	76,300	1,139,159.00	0.07
277	002079	苏州固锔	154,200	1,136,454.00	0.07
278	600479	千金药业	78,400	1,134,448.00	0.07
279	300204	舒泰神	72,646	1,132,551.14	0.07
280	000951	中国重汽	73,685	1,126,643.65	0.07
281	600052	浙江广厦	220,901	1,115,550.05	0.07
282	000065	北方国际	46,700	1,110,526.00	0.07
283	000822	山东海化	136,500	1,108,380.00	0.07
284	601933	永辉超市	147,000	1,040,760.00	0.06
285	300144	宋城演艺	49,800	1,039,326.00	0.06
286	002366	台海核电	22,100	1,036,711.00	0.06
287	002640	跨境通	48,100	1,022,125.00	0.06
288	002217	合力泰	103,400	1,021,592.00	0.06
289	002068	黑猫股份	121,400	1,020,974.00	0.06
290	002583	海能达	63,200	1,016,888.00	0.06
291	002120	韵达股份	19,600	1,011,360.00	0.06
292	002271	东方雨虹	27,200	1,009,120.00	0.06
293	600332	白云山	34,300	996,072.00	0.06
294	002597	金禾实业	45,500	994,630.00	0.06
295	000661	长春高新	7,700	994,147.00	0.06
296	000049	德赛电池	19,105	989,830.05	0.06
297	002434	万里扬	62,100	988,632.00	0.06
298	002127	南极电商	80,800	976,064.00	0.06
299	600298	安琪酵母	37,200	962,364.00	0.06
300	600711	盛屯矿业	144,400	958,816.00	0.06
301	600566	济川药业	25,200	958,356.00	0.06
302	002202	金风科技	61,900	957,593.00	0.06
303	603369	今世缘	72,300	954,360.00	0.06
304	300097	智云股份	35,321	953,667.00	0.06
305	600885	宏发股份	23,900	953,371.00	0.06
306	002185	华天科技	131,200	949,888.00	0.06
307	603198	迎驾贡酒	49,800	947,694.00	0.06
308	601985	中国核电	120,100	937,981.00	0.06
309	603005	晶方科技	33,260	930,947.40	0.06
310	002648	卫星石化	56,402	930,633.00	0.06
311	300072	三聚环保	25,000	926,250.00	0.06
312	600995	文山电力	94,500	919,485.00	0.06
313	600089	特变电工	88,996	919,328.68	0.06
314	600057	象屿股份	89,906	914,344.02	0.06
315	600622	嘉宝集团	55,900	910,052.00	0.06
316	002343	慈文传媒	23,900	904,854.00	0.05

317	002509	天广中茂	98,280	904,176.00	0.05
318	600688	上海石化	136,700	903,587.00	0.05
319	002400	省广股份	110,300	885,709.00	0.05
320	002415	海康威视	27,200	878,560.00	0.05
321	600816	安信信托	64,140	871,662.60	0.05
322	000921	海信科龙	50,567	870,258.07	0.05
323	600282	南钢股份	233,208	865,201.68	0.05
324	300003	乐普医疗	38,500	851,235.00	0.05
325	600750	江中药业	23,600	820,100.00	0.05
326	000998	隆平高科	36,900	812,538.00	0.05
327	603108	润达医疗	50,800	809,244.00	0.05
328	300130	新国都	42,700	806,603.00	0.05
329	002430	杭氧股份	90,700	797,253.00	0.05
330	002117	东港股份	30,700	794,516.00	0.05
331	600029	南方航空	90,100	783,870.00	0.05
332	603993	洛阳钼业	153,600	777,216.00	0.05
333	300203	聚光科技	27,400	770,488.00	0.05
334	300349	金卡智能	27,453	766,487.76	0.05
335	002051	中工国际	36,840	763,693.20	0.05
336	000581	威孚高科	29,400	761,460.00	0.05
337	002075	沙钢股份	46,700	752,804.00	0.05
338	600637	东方明珠	34,700	751,949.00	0.05
339	300271	华宇软件	44,800	743,232.00	0.05
340	601198	东兴证券	42,800	737,872.00	0.04
341	002582	好想你	61,300	736,826.00	0.04
342	600998	九州通	34,100	735,196.00	0.04
343	002614	奥佳华	40,400	734,472.00	0.04
344	002273	水晶光电	35,500	732,365.00	0.04
345	600196	复星医药	23,600	731,364.00	0.04
346	600362	江西铜业	43,300	730,038.00	0.04
347	600348	阳泉煤业	105,700	716,646.00	0.04
348	603338	浙江鼎力	10,860	715,999.80	0.04
349	600677	航天通信	52,100	715,333.00	0.04
350	000938	紫光股份	11,600	708,992.00	0.04
351	002739	万达电影	13,900	708,483.00	0.04
352	300327	中颖电子	22,100	700,570.00	0.04
353	000823	超声电子	48,400	697,928.00	0.04
354	002712	思美传媒	32,200	694,876.00	0.04
355	300494	盛天网络	29,700	688,743.00	0.04
356	600502	安徽水利	89,400	687,486.00	0.04
357	002564	天沃科技	75,100	685,663.00	0.04
358	300316	晶盛机电	54,700	683,203.00	0.04
359	000911	南宁糖业	59,200	674,288.00	0.04
360	601179	中国西电	120,800	671,648.00	0.04
361	603018	中设集团	20,651	668,885.89	0.04
362	002203	海亮股份	81,169	660,715.66	0.04
363	600111	北方稀土	57,600	652,608.00	0.04
364	000026	飞亚达 A	52,400	651,856.00	0.04
365	300400	劲拓股份	43,490	648,870.80	0.04
366	600491	龙元建设	60,300	647,019.00	0.04

367	603766	隆鑫通用	88,700	645,736.00	0.04
368	000703	恒逸石化	44,595	635,032.80	0.04
369	600278	东方创业	48,100	632,996.00	0.04
370	002018	华信国际	92,400	632,940.00	0.04
371	002433	太安堂	68,200	630,850.00	0.04
372	600461	洪城水业	87,200	628,712.00	0.04
373	000570	苏常柴 A	88,900	622,300.00	0.04
374	002493	荣盛石化	62,535	610,341.60	0.04
375	300339	润和软件	48,400	609,840.00	0.04
376	601155	新城控股	32,300	598,842.00	0.04
377	000517	荣安地产	126,992	590,512.80	0.04
378	000564	供销大集	90,389	588,432.39	0.04
379	000069	华侨城 A	58,345	586,950.70	0.04
380	000739	普洛药业	78,600	576,924.00	0.03
381	600393	粤泰股份	79,300	574,132.00	0.03
382	000718	苏宁环球	97,200	569,592.00	0.03
383	002358	森源电气	28,600	486,772.00	0.03
384	600713	南京医药	66,300	466,089.00	0.03
385	300340	科恒股份	10,500	457,275.00	0.03
386	600979	广安爱众	71,900	411,268.00	0.02
387	600197	伊力特	20,400	398,412.00	0.02
388	000030	富奥股份	44,200	395,148.00	0.02
389	300468	四方精创	8,300	370,097.00	0.02
390	600702	沱牌舍得	13,900	369,879.00	0.02
391	600862	中航高科	37,900	367,251.00	0.02
392	000596	古井贡酒	7,200	366,840.00	0.02
393	000860	顺鑫农业	18,300	366,183.00	0.02
394	603919	金徽酒	18,850	359,658.00	0.02
395	603589	口子窖	9,200	356,868.00	0.02
396	002646	青青稞酒	19,900	347,454.00	0.02
397	600199	金种子酒	43,200	342,576.00	0.02
398	600809	山西汾酒	9,600	333,024.00	0.02
399	002304	洋河股份	3,800	329,878.00	0.02
400	000799	酒鬼酒	17,400	319,812.00	0.02
401	000572	海马汽车	57,800	298,826.00	0.02
402	002162	悦心健康	45,100	298,111.00	0.02
403	000935	四川双马	8,900	205,234.00	0.01
404	600890	中房股份	17,500	197,225.00	0.01
405	600468	百利电气	14,550	94,575.00	0.01
406	600490	鹏欣资源	9,300	73,563.00	0.00
407	002082	栋梁新材	3,800	61,902.00	0.00
408	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
409	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
410	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
411	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
412	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
413	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
414	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
415	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
416	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00

417	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
418	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
419	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
420	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
421	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
422	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
423	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
424	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
425	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	601318	中国平安	95,662,347.68	5.31
2	600028	中国石化	69,955,771.77	3.89
3	601390	中国中铁	54,099,867.19	3.00
4	600104	上汽集团	53,721,686.91	2.98
5	601668	中国建筑	50,819,194.19	2.82
6	601006	大秦铁路	49,785,128.36	2.77
7	601186	中国铁建	49,316,753.78	2.74
8	601857	中国石油	38,637,743.98	2.15
9	600547	山东黄金	36,910,223.74	2.05
10	600383	金地集团	34,250,783.33	1.90
11	601166	兴业银行	33,805,936.67	1.88
12	601088	中国神华	30,261,415.40	1.68
13	600782	新钢股份	28,659,340.39	1.59
14	600808	马钢股份	28,477,436.13	1.58
15	601601	中国太保	25,034,681.20	1.39
16	600057	象屿股份	24,285,507.26	1.35
17	601898	中煤能源	23,146,294.78	1.29
18	601328	交通银行	22,853,657.11	1.27
19	600019	宝钢股份	22,604,069.66	1.26
20	600016	民生银行	21,775,747.25	1.21

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	601318	中国平安	73,402,786.45	4.08
2	600028	中国石化	58,021,473.81	3.22
3	600104	上汽集团	52,180,066.36	2.90
4	601390	中国中铁	51,306,094.28	2.85
5	601186	中国铁建	42,000,122.08	2.33
6	601668	中国建筑	40,043,066.22	2.22
7	601006	大秦铁路	36,819,726.28	2.05

8	600048	保利地产	32,501,139.18	1.81
9	002615	哈尔斯	28,109,667.77	1.56
10	600019	宝钢股份	26,798,037.74	1.49
11	000921	海信科龙	26,642,633.51	1.48
12	600510	黑牡丹	26,334,493.88	1.46
13	600029	南方航空	25,846,681.53	1.44
14	600057	象屿股份	23,403,074.88	1.30
15	601857	中国石油	23,392,683.18	1.30
16	600808	马钢股份	23,295,439.99	1.29
17	601601	中国太保	23,206,777.36	1.29
18	600547	山东黄金	22,171,470.72	1.23
19	600068	葛洲坝	21,908,874.21	1.22
20	000521	美菱电器	21,753,896.55	1.21

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	6,584,139,265.31
卖出股票的收入（成交）总额	6,670,693,434.53

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	2,515,538.30	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,515,538.30	0.15

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	21,150	2,222,230.50	0.13
2	113010	江南转债	2,810	293,307.80	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IH1707	IH1707	26.00	19,715,280.00	334,920.00	-
公允价值变动总额合计					334,920.00
股指期货投资本期收益					5,177,100.00
股指期货投资本期公允价值变动					-1,960,600.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,306,563.29
2	应收证券清算款	217,145.73
3	应收股利	-
4	应收利息	69,404.60

5	应收申购款	204,489.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,797,603.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113010	江南转债	293,307.80	0.02

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	601088	中国神华	24,128,925.00	1.46	停牌股票

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
36,176	57,411.74	3,540,577.84	0.17%	2,073,386,547.02	99.83%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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开放式基金	1,269,548.66	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 20 日）基金份额总额	3,218,168,319.04
本报告期期初基金份额总额	2,234,657,875.75
本报告期基金总申购份额	45,677,537.25
减：本报告期基金总赎回份额	203,408,288.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,076,927,124.86

§ 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	

招商证券	2	3,362,137,891.03	25.37%	3,131,214.02	27.51%	-
华西证券	1	2,175,377,690.80	16.42%	2,025,958.85	17.80%	-
西部证券	1	1,380,704,209.54	10.42%	1,009,729.48	8.87%	-
方正证券	1	1,305,953,309.78	9.86%	955,054.28	8.39%	-
中泰证券	1	1,076,633,337.38	8.13%	787,351.40	6.92%	-
广发证券	2	902,136,857.63	6.81%	840,151.35	7.38%	-
东方证券	1	747,991,027.58	5.65%	547,014.26	4.81%	-
东吴证券	1	616,555,162.12	4.65%	574,204.98	5.05%	-
海通证券	1	569,744,599.57	4.30%	530,613.51	4.66%	-
光大证券	3	466,605,378.27	3.52%	434,559.69	3.82%	-
中信建设	1	282,118,106.39	2.13%	206,315.67	1.81%	-
中金公司	2	215,090,921.54	1.62%	200,316.55	1.76%	-
长江证券	1	149,310,608.15	1.13%	139,056.04	1.22%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	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
招商证券	668,479.90	100.00%	-	-	-	-
西部证券	-	-	135,000,000.00	56.72%	-	-

中泰证券	-	-	53,000,000.00	22.27%	-	-
中金公司	-	-	50,000,000.00	21.01%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建设	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时旗下部分开放式基金增加中证金牛（北京）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	2017-06-15
2	关于博时旗下部分开放式基金增加重庆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	2017-06-02
3	关于博时旗下部分开放式基金增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-15
4	关于博时旗下部分开放式基金增加南京苏宁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	2017-05-10
5	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-04-22
6	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	2017-04-22
7	关于博时国企改革混合型证券投资基金新增中航证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-04-12
8	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2016	中国证券报、上海证券	2017-03-27

	年年度报告（摘要）	报、证券时报	
9	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2016 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-27
10	关于博时旗下部分开放式基金增加大有期货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	2017-03-17
11	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	2017-02-23
12	博时国企改革主题股票型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-01-21
13	博时国企改革主题股票型证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 1 号（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-01-04
14	博时国企改革主题股票型证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 1 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-01-04

§ 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。

11.2 产品特有风险

无。

11.3 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准博时产业新动力混合型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《博时国企改革主题股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时国企改革主题股票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 博时国企改革主题股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 告期内博时国企改革主题股票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

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一七年八月二十四日