

# 博时中证银联智惠大数据 100 指数型证

## 券投资基金

2017 年年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月三十一日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 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 2017 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69

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 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>71</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>73</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	73
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 .....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	75
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>77</b>
12.1 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 .....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金	
基金简称	博时银智大数据 100	
基金主代码	002588	
交易代码	002588	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 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	44,901,704.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C
下属分级基金的交易代码	002588	004416
报告期末下属分级基金的份额总额	44,873,351.71 份	28,352.72 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%，年跟踪误差不超过 6%，实现对中证银联智惠大数据 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证银联智惠大数据 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。
业绩比较基准	95%×中证银联智惠大数据 100 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的特征。

	风险收益特征。
--	---------

### 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>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	2017 年		2016 年 5 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日	
	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C
本期已实现 收益	15,651,029.30	18.59	6,842,619.66	-
本期利润	18,893,576.95	559.66	6,713,272.52	-
加权平均基 金份额本期 利润	0.1797	0.0414	0.1487	-
本期加权平 均净值利润 率	14.50%	2.99%	13.19%	-
本期基金份 额净值增长 率	18.97%	4.76%	17.59%	-
3.1.2 期末数据 和指标	2017 年末		2016 年末	
	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C
期末可供分 配利润	17,904,740.68	11,256.31	8,932,577.68	-
期末可供分 配基金份额 利润	0.3990	0.3970	0.1740	-
期末基金资	62,778,092.39	39,609.03	60,380,476.30	-

产净值				
期末基金份额净值	1.3990	1.3970	1.1759	-
3.1.3 累计期末指标	2017 年末		2016 年末	
	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C
基金份额累计净值增长率	39.90%	4.76%	17.59%	-

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

##### 1. 博时银智大数据 100A:

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	3.53%	1.00%	4.49%	1.01%	-0.96%	-0.01%
过去六个月	11.18%	0.82%	10.96%	0.81%	0.22%	0.01%
过去一年	18.97%	0.79%	14.83%	0.80%	4.14%	-0.01%
自基金合同生效起至今	39.90%	0.87%	40.66%	0.89%	-0.76%	-0.02%

##### 2. 博时银智大数据 100C:

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	3.40%	1.00%	4.49%	1.01%	-1.09%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.76%	0.94%	5.29%	0.95%	-0.53%	-0.01%



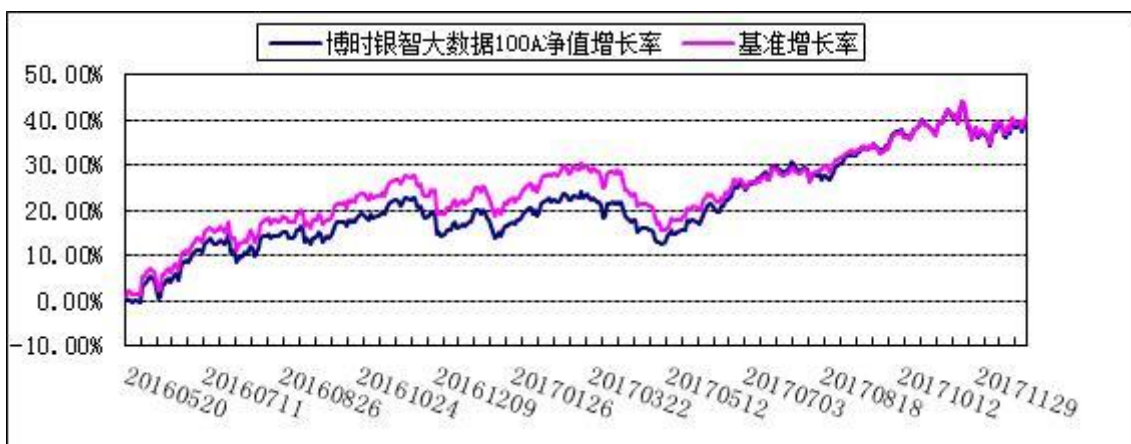
注：本基金合同于 2016 年 5 月 20 日生效，本基金自 2017 年 9 月 15 日起增加 C 类基金份额。

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

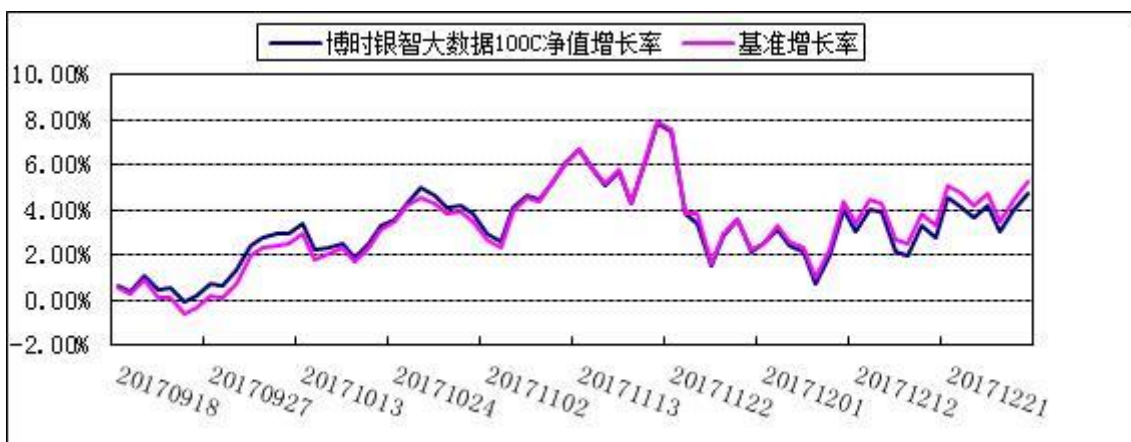
博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016 年 5 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日)

#### 1、博时银智大数据 100A



#### 2、博时银智大数据 100C



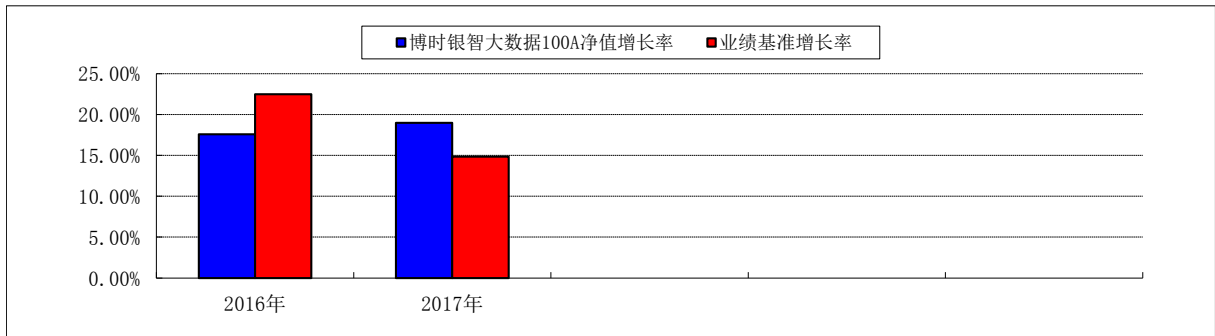
注：本基金合同于 2016 年 5 月 20 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

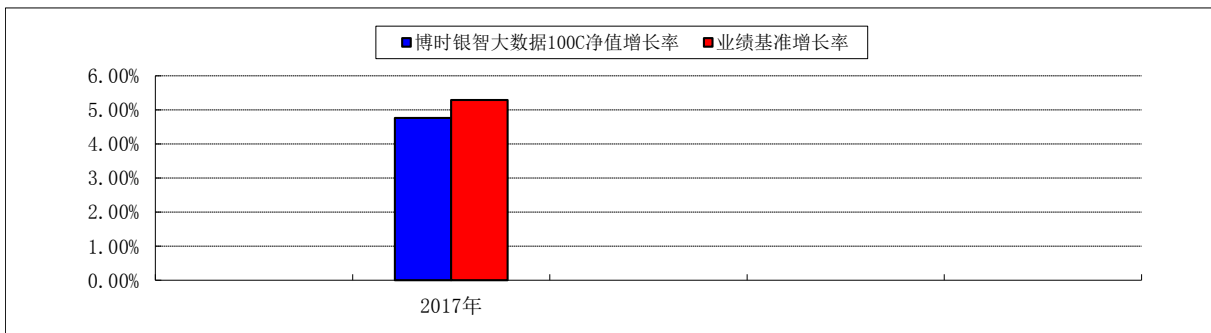
博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

### 1、博时银智大数据 100A



### 2、博时银智大数据 100C



注：本基金合同于 2016 年 5 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。本基金自 2017 年 9 月 15 日起增加 C 类基金份额。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 192 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，管理资产总规模约 7587 亿元人民币，其中非货币公募基金规模约 2254 亿元人民币，累计分红逾 828 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 4 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时上证 50ETF、博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率分别为 30.41%、28.81%，同类排名分别为前 1/8 和前 1/6；博时裕富沪深 300 指数(A 类)今年以来净值增长率排名前 1/6；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 43.97%，同类基金中排名前 1/6；混合偏股型基金中，博时主题行业混合(LOF)今年以来净值增长率为 31.96%，同类基金排名位居前 1/6，博时行业轮动混合今年以来净值增长率为 27.90%，同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时外延增长主题灵活配置混合基金今年以来净值增长率分别为 32.12%，同类基金排名位于前 1/12，博时互联网主题灵活配置混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)基金今年以来净值增长率分别为 23.79%、24.01%，同类基金中排名位于前 1/3。

黄金基金类，博时黄金 ETF(D 类)今年以来净值增长率 4.00%，同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时裕盛纯债债券今年以来净值增长率为 3.63%，同类 170 只基金中排名前 10，博时聚润纯债债券今年以来净值增长率分别为 3.45%，同类基金排名位于前 1/10，博时裕昂纯债债券、博时裕创纯债债券等今年以来净值增长率排名前 1/8，博时裕安纯债债券、博时智臻纯债债券等今年以来净值增长率排名前 1/6；货币基金类，博时合利货币、博时外服货币今年以来净值增长率分别为 4.26%、4.23%，在 227 只同类基金排名中位列第 8 位与第 11 位。

QDII 基金方面，博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时亚洲票息收益债券(QDII)(美元)，今年以来净值增长率分别为 0.23%、6.38%，同类排名均位于前 2/4。

## 2、其他大事件

2017 年 12 月 13 日—12 月 15 日，由华尔街见闻主办的“2017 全球投资峰会及颁奖典礼活动”和由时代周报主办的“2017(南翔)年度盛典暨 2017‘金桔奖’颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金分别斩获“年度卓越公募基金”和“最佳财富管理机构”两项颇具份量的公司大奖。

2017 年 12 月 8 日，由经济观察报与上海国际信托有限公司联合主办的“观察家金融峰会”暨“2016-2017 中国卓越金融奖”颁奖典礼在北京召开，博时基金实力荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2017 年 12 月 5 日，北京商报联手北京市品牌协会主办的“2017 北京金融论坛暨年度北京金融业十大品牌评选”在京揭晓。博时基金凭借优秀的品牌建设及卓越的品牌推广力，在本次论坛中荣获“品牌推广卓越奖”。

2017 年 11 月 27 日，由南方都市报和中国金融改革研究院共同主办的 2017 年（第三届）CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金在此次大会上荣获“年度最佳基金公司大奖”，值得一提的是，这是博时基金第三次获得该项殊荣。

2017 年 11 月 24 日，由《新财富》杂志社主办的“第十五届新财富最佳分析师”评选颁奖盛典在深圳举行博时基金捧得新财富十五周年特别大奖——3i 最智慧投资机构。

2017 年 10 月 19 日，外汇交易中心公布 2017 年第三季度银行间本币市场活跃交易商名单。博时基金管理有限公司荣誉入选“债券市场活跃交易商”。

2017 年 9 月 24 日，由南方财经全媒体集团和 21 世纪传媒举办的 21 世纪国际财经峰会在深圳举行，博时基金荣获“2017 年度基金管理公司金帆奖”。

2017 年 8 月 6 日，首届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行，在基金公司综合奖方面，博时基金获得“群星奖”；在基金公司单项奖方面，博时基金获得“纯债型基金管理奖”、“一级债基金管理奖”、“二级债基金管理奖”三大奖项；在基金产品单项奖方面，博时信用债券 A/B（050011）获得“二级债基金”奖，博时裕富沪深 300 指数 A（050002）获“指数型基金”奖；在本次五星基金明星经理奖的颁奖环节，由于博时外服货币、博时双月薪定期支付债券以及博时信用债券 A/B 在 2017 年第二季度持续获得济安金信五星评级，三只基金的基金经理魏桢、过钧及陈凯杨更是因此获得“五星基金明星奖”的荣誉称号。

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，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 20 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 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		
桂征辉	基金经理	2016-05-20	-	8.4	2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理。现任博时沪深 300 指数基金兼博时中证淘金大数据 100 指数基金、博时银智大数据 100 指数基金、博时中证 500 指数增强基金的基金经理。
杨振建	基金经理助理	2015-06-15	-	4.4	2013 年起先后在中证指数有限公司、中国证监会工作。2015 年 5 月加入博时基金管理有限公司，曾任高级研究员，现任基金经理助理。

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

2017 年全年，A 股市场震荡上行，主要经历两波调整。风格方面，市场全年持续大盘蓝筹行情，最后一季度逐渐向中盘转移，但大小盘风格切换尚未完成。本基金作为指数基金，为保证对于业绩基准的紧密跟踪，我们本着勤勉尽责的态度，严格按照基金合同要求，在月度指数成份股变动时，尽量降低交易成本、减少市场冲击，力求组合成份股紧密跟踪指数，并在最小化交易成本的同时适时调仓，取得了较低的跟踪误差。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金博时银智大数据 100A 类基金份额净值为 1.3990 元，份额累计净值为 1.3990 元，本基金博时银智大数据 100C 类基金份额净值为 1.3970 元，份额累计净值为 1.3970 元。报告期内，本基金博时银智大数据 100A 基金份额净值增长率为 18.97%，同期业绩基准增长率为 14.83%，博时银智大数据 100C 基金份额净值增长率为 4.76%，同期业绩基准增长率 5.29%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年一季度，预计我国经济增速平稳略回落，全球经济大概率延续温和复苏。通胀方面，预测 CPI 略有提高，经济进入温和通胀，有助于企业盈利修复；货币政策方面，全面宽松可能性很低，货币政策保持紧平衡概率较大；一季度 A 股市场预计会出现风格上的切换，17 年消费与大盘行情步入尾声，经济转型带来的成长估值修复有望出现；另外，创新是建立现代化经济体系的战略支撑，高技术产业将面临难得的历史发展机遇。行业方面，重点关注高端装备制造、现代服务、电子、计算机以及通信等行业，注意捕捉市场的结构性行情。

#### 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。

2017 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《投资者适当性管理制度》、《非标投资业务投资管理流程手册》、《债券信用风险处置预案》。修订了《黄金租赁业务管理制度》、《债券池管理办法》、《反洗钱工作管理办法》、《风险管理委员会制度》、《博时基金管理有限公司费用开支管理规定》、《博时基金大宗交易制度》、《博时基金关于规范全国银行间债券市场交易对手范围的管理规定》、《博时基金管理有限公司基金资产估值委员会制度》等制度文件。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供



在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后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

本报告期内，本基金托管人在对中证银联智惠大数据 100 指数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，中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在中证银联智惠大数据 100 指数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

本托管人依法对中证银联智惠大数据 100 指数型基金管理有限公司编制和披露的中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年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 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 21491 号

博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(以下简称“博时银智大数据 100 基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附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,公允反映了博时银智大数据 100 基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博时银智大数据 100 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时银智大数据 100 基金的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估博时银智大数据 100 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算博时银智大数据 100 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时银智大数据 100 基金的财务报告过程。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时银智大数据 100 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时银智大数据 100 基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天

注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)

张 振 波

注册会计师

中国 · 上海市

2018 年 3 月 23 日

林佳璐

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	3,638,864.37	4,847,961.55
结算备付金		308,971.38	325,053.96
存出保证金		74,221.33	12,117.80
交易性金融资产	7.4.7.2	59,534,892.00	55,508,029.76
其中：股票投资		59,202,942.00	55,508,029.76
基金投资		-	-
债券投资		331,950.00	-
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		298,817.01	-
应收利息	7.4.7.5	7,149.24	1,029.62
应收股利		-	-
应收申购款		120,679.83	78,260.98

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>63,983,595.16</b>	<b>60,772,453.67</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
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		126,582.12	-
应付赎回款		207,895.79	68,485.39
应付管理人报酬		41,879.66	39,622.06
应付托管费		5,234.95	4,952.76
应付销售服务费		17.16	-
应付交易费用	7.4.7.7	534,147.16	138,826.72
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	250,136.90	140,090.44
<b>负债合计</b>		<b>1,165,893.74</b>	<b>391,977.37</b>
<b>所有者权益:</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	7.4.7.9	44,901,704.43	51,349,762.63
未分配利润	7.4.7.10	17,915,996.99	9,030,713.67
<b>所有者权益合计</b>		<b>62,817,701.42</b>	<b>60,380,476.30</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>63,983,595.16</b>	<b>60,772,453.67</b>

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 44,901,704.43 份。其中 A 类基金份额净值 1.3990 元，基金份额总额 44,873,351.71 份；C 类基金份额净值 1.3970 元，基金份额总额 28,352.72

份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 20 日（基 金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>23,630,609.11</b>	<b>7,851,342.02</b>
1. 利息收入		103,769.26	43,939.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	94,577.48	41,975.06
债券利息收入		160.69	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,031.09	1,964.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,143,358.24	7,778,629.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,496,355.56	7,520,401.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	65,555.21	-
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	3,581,447.47	258,227.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	3,243,088.72	-129,347.14
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	140,392.89	158,120.40
<b>减：二、费用</b>		<b>4,736,472.50</b>	<b>1,138,069.50</b>

1. 管理人报酬		1,031,414.70	247,451.88
2. 托管费		128,926.82	30,931.48
3. 销售服务费		30.88	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,073,907.83	562,609.97
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	502,192.27	297,076.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>18,894,136.61</b>	<b>6,713,272.52</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>18,894,136.61</b>	<b>6,713,272.52</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	51,349,762.63	9,030,713.67	60,380,476.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,894,136.61	18,894,136.61
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）	-6,448,058.20	-10,008,853.29	-16,456,911.49
其中：1. 基金申购款	306,244,838.48	62,030,480.94	368,275,319.42
2. 基金赎回款	-312,692,896.68	-72,039,334.23	-384,732,230.91

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）	44,901,704.43	17,915,996.99	62,817,701.42
项目	上年度可比期间		
	2016年5月20日（基金合同生效日）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）	218,526,964.07	-	218,526,964.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,713,272.52	6,713,272.52
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）	-167,177,201.44	2,317,441.15	-164,859,760.29
其中：1. 基金申购款	48,484,044.14	6,616,864.66	55,100,908.80
2. 基金赎回款	-215,661,245.58	-4,299,423.51	-219,960,669.09
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）	51,349,762.63	9,030,713.67	60,380,476.30

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

博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(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[2015]2251 号《关于准予博时中证银联智惠大数据 100 指数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《博时中证银联智惠大数据 100 指数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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 218,502,305.50 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 409 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 218,526,964.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 24,658.57 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时中证银联智惠大数据 100 指数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,以中证银联智惠大数据 100 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、银行存款、债券(含中小企业私募债)、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可参与转融通证券出借交易业务。本基金投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不低于 90%,其中,投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的标的指数为:中证银联智惠大数据 100 指数。本基金业绩比较基准为:95%×中证银联智惠大数据 100 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

根据基金管理人基金管理有限公司 2017 年 9 月 15 日《关于博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金增加 C 类基金份额以及相应修改基金合同和托管协议的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2017 年 9 月 15 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金根据申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用,在赎回时根据持

有期限收取赎回费用的基金份额，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

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 2018 年 3 月 23 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》、《博时中证银联智惠大数据 100 指数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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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。比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间。

##### 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。本基金暂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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,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卖出回购金融资产款和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或资产支持证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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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[2017]13号《中国证监会关于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。

(2) 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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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) 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,638,864.37	4,847,961.55
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	3,638,864.37	4,847,961.55

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		56,089,140.42	59,202,942.00	3,113,801.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	332,010.00	331,950.00	-60.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	332,010.00	331,950.00	-60.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		56,421,150.42	59,534,892.00	3,113,741.58
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		55,637,376.90	55,508,029.76	-129,347.14
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		55,637,376.90	55,508,029.76	-129,347.14

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。



**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	838.68	862.86
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	153.01	160.82
应收债券利息	6,605.75	-
应收买入返售证券利息	-484.94	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	36.74	5.94
合计	7,149.24	1,029.62

**7.4.7.6 其他资产**

无余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	534,147.16	138,826.72
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	534,147.16	138,826.72

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付赎回费	136.90	90.44
预提费用	200,000.00	90,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00

合计	250,136.90	140,090.44
----	------------	------------

#### 7.4.7.9 实收基金

博时银智大数据 100A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	51,349,762.63	51,349,762.63
本期申购	306,208,964.75	306,208,964.75
本期赎回（以“-”号填列）	-312,685,375.67	-312,685,375.67
本期末	44,873,351.71	44,873,351.71

博时银智大数据 100C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	35,873.73	35,873.73
本期赎回（以“-”号填列）	-7,521.01	-7,521.01
本期末	28,352.72	28,352.72

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

博时银智大数据 100A

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	8,932,577.68	98,135.99	9,030,713.67
本期利润	15,651,029.30	3,242,547.65	18,893,576.95
本期基金份额交易产生的变动数	-6,093,574.74	-3,925,975.20	-10,019,549.94

其中：基金申购款	51,095,549.41	10,921,310.71	62,016,860.12
基金赎回款	-57,189,124.15	-14,847,285.91	-72,036,410.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,490,032.24	-585,291.56	17,904,740.68

博时银智大数据 100C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	18.59	541.07	559.66
本期基金份额交易产生的变动数	11,608.31	-911.66	10,696.65
其中：基金申购款	14,685.14	-1,064.32	13,620.82
基金赎回款	-3,076.83	152.66	-2,924.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,626.90	-370.59	11,256.31

#### 7.4.7.11 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12月 31日	上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同 生效日）至2016年12月31 日
活期存款利息收入	78,667.44	38,979.27
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	14,248.90	2,712.49
其他	1,661.14	283.30
合计	94,577.48	41,975.06

#### 7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	1,062,146,395.78	178,809,502.55
减: 卖出股票成本总额	1,045,650,040.22	171,289,100.65
股票投资收益	16,496,355.56	7,520,401.90

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券成交总额	646,659.19	-
减: 卖出债券成本总额	581,000.00	-
减: 应收利息总额	103.98	-
债券投资收益	65,555.21	-

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,581,447.47	258,227.26
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,581,447.47	258,227.26

#### 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	3,243,088.72	-129,347.14

——股票投资	3,243,148.72	-129,347.14
——债券投资	-60.00	-
——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	3,243,088.72	-129,347.14

#### 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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年5月20日（基金合同生效日）至 2016年12月31日
基金赎回费收入	139,044.92	151,123.04
转换费收入	1,347.97	6,997.36
合计	140,392.89	158,120.40

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补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年5月20日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
交易所市场交易费用	3,073,907.83	562,609.97
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,073,907.83	562,609.97

#### 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
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年5月20日（基金合同生效日）至2016年12月31日
审计费	40,000.00	40,000.00
信息披露费	240,000.00	150,000.00
银行汇划费	3,792.27	1,294.40
中债登账户维护费	18,000.00	4,500.00
指数使用费	200,000.00	101,281.77
开户费	400.00	-
合计	502,192.27	297,076.17

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，每日计算，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 50,000.00 元。

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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、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
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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日） 至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
招商证券	455,049,934.38	21.62%	162,212,644.30	39.99%

##### 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 2017年1月1日至2017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	423,793.83	23.22%	19,823.79	3.71%
关联方名称	上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日）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	151,067.35	43.44%	41,219.34	29.69%

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 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,031,414.70	247,451.88
其中：支付销售机构的客户维护费	132,925.01	71,320.36

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 0.80% 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 × 0.80% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	128,926.82	30,931.48

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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A类	C类	合计
博时基金	-	30.88	30.88



合计	-	30.88	30.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生效日)至 2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A类	C类	合计
博时基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

#### 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

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

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年5月20日(基金合同生效日)至 2016年12月31日	
	博时银智100A	博时银智100C	博时银智100A	博时银智100C
基金合同生效日持有的基金份额	-	-	9,999,000.00	-
期初持有的基金份额	9,999,000.00	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	9,999,000.00	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	9,999,000.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	19.47%	-

注：基金管理人博时基金在本年度赎回本基金的交易委托博时基金直销中心办理，适用费率为

0。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日） 至2016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
中国工商银行	3,638,864.37	78,667.44	4,847,961.55	38,979.27

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

#### 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（2017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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128029	太阳转债	2017-12-27	2018-01-16	新债未上市	100.00	100.00	324	32,400.00	32,400.00	-

##### 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	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备
----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	---

代码	名称	日期	原因	估值 单价	日期	开 盘单 价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	注
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	45.93	未知	未知	18,100	987,425.83	831,333.00	-
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	18,800.00	500,072.26	604,232.00	-

注: 本基金截至 2017 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

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金为指数型基金, 原则上采用完全复制法, 按照成份股在中证银联智惠大数据 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 以中证银联智惠大数据 100 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。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通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段, 力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.50%, 年跟踪误差不超过 6%, 实现对中证银联智惠大数据 100 指数的有效跟踪。

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及绩效分析工作，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工商银行，因而与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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05% (2016 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2017 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求

与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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、存出保证金、债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	3,638,864.37	-	-	-	3,638,864.37
结算备付金	308,971.38	-	-	-	308,971.38
存出保证金	74,221.33	-	-	-	74,221.33
交易性金融资产	299,550.00	32,400.00	-	59,202,942.00	59,534,892.00
应收证券清算款	-	-	-	298,817.01	298,817.01
应收利息	-	-	-	7,149.24	7,149.24
应收申购款	-	-	-	120,679.83	120,679.83
<b>资产总计</b>	<b>4,321,607.08</b>	<b>32,400.00</b>	<b>-</b>	<b>59,629,588.08</b>	<b>63,983,595.16</b>

<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	126,582.12	126,582.12
应付赎回款	-	-	-	207,895.79	207,895.79
应付管理人报酬	-	-	-	41,879.66	41,879.66
应付托管费	-	-	-	5,234.95	5,234.95
应付销售服务费	-	-	-	17.16	17.16
应付交易费用	-	-	-	534,147.16	534,147.16
其他负债	-	-	-	250,136.90	250,136.90
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,165,893.74</b>	<b>1,165,893.74</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>4,321,607.08</b>	<b>32,400.00</b>	-	<b>58,463,694.34</b>	<b>62,817,701.42</b>
<b>上年度末</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>2016 年 12 月 31 日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	4,847,961.55	-	-	-	4,847,961.55
结算备付金	325,053.96	-	-	-	325,053.96
存出保证金	12,117.80	-	-	-	12,117.80
交易性金融资产	-	-	-	55,508,029.76	55,508,029.76
应收利息	-	-	-	1,029.62	1,029.62
应收申购款	-	-	-	78,260.98	78,260.98
<b>资产总计</b>	<b>5,185,133.31</b>	-	-	<b>55,587,320.36</b>	<b>60,772,453.67</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	68,485.39	68,485.39
应付管理人报酬	-	-	-	39,622.06	39,622.06
应付托管费	-	-	-	4,952.76	4,952.76
应付交易费用	-	-	-	138,826.72	138,826.72
其他负债	-	-	-	140,090.44	140,090.44
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>391,977.37</b>	<b>391,977.37</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>5,185,133.31</b>	-	-	<b>55,195,342.99</b>	<b>60,380,476.30</b>

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 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 0.53% (2016 年 12 月 31 日：无)，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)。

#### 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。本基金投资于股票的比例不低于基金资产总值的 90%。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。

##### 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 2017 年 12 月 31 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	59,202,942.00	94.25	55,508,029.76	91.93
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	59,202,942.00	94.25	55,508,029.76	91.93

#### 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 214	增加约 284
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 214	减少约 284

#### 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 2017 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 57,767,377.00 元,属于第二层次的余额为 1,767,515.00 元,无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日:第一层次 54,008,745.76 元,第二层次 1,499,284.00 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。

(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 2017 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（2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	59,202,942.00	92.53
	其中：股票	59,202,942.00	92.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	331,950.00	0.52
	其中：债券	331,950.00	0.52
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,947,835.75	6.17
8	其他各项资产	500,867.41	0.78
9	合计	63,983,595.16	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	1,145,640.00	1.82
B	采矿业	2,932,174.00	4.67
C	制造业	31,395,840.00	49.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	519,147.00	0.83
E	建筑业	2,253,327.00	3.59
F	批发和零售业	2,907,594.00	4.63
G	交通运输、仓储和邮政业	648,448.00	1.03

H	住宿和餐饮业	663,954.00	1.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,926,593.00	6.25
J	金融业	4,618,899.00	7.35
K	房地产业	4,501,536.00	7.17
L	租赁和商务服务业	633,600.00	1.01
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	591,360.00	0.94
R	文化、体育和娱乐业	2,464,830.00	3.92
S	综合	-	-
	合计	59,202,942.00	94.25

### 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	002739	万达电影	18,100	831,333.00	1.32
2	600741	华域汽车	24,100	715,529.00	1.14
3	600362	江西铜业	35,300	712,001.00	1.13
4	000671	阳光城	90,000	708,300.00	1.13
5	000425	徐工机械	152,600	706,538.00	1.12
6	600388	龙净环保	40,200	695,460.00	1.11
7	600048	保利地产	48,500	686,275.00	1.09
8	601939	建设银行	88,000	675,840.00	1.08
9	600176	中国巨石	41,300	672,777.00	1.07
10	000703	恒逸石化	30,800	664,356.00	1.06
11	600258	首旅酒店	24,600	663,954.00	1.06
12	000338	潍柴动力	79,100	659,694.00	1.05
13	002304	洋河股份	5,700	655,500.00	1.04
14	000938	紫光股份	9,100	655,473.00	1.04
15	600031	三一重工	72,100	653,947.00	1.04
16	600196	复星医药	14,600	649,700.00	1.03
17	600029	南方航空	54,400	648,448.00	1.03
18	601155	新城控股	22,000	644,600.00	1.03

19	002078	太阳纸业	69,100	641,248.00	1.02
20	300274	阳光电源	34,100	640,057.00	1.02
21	000039	中集集团	27,900	637,515.00	1.01
22	001979	招商蛇口	32,500	635,700.00	1.01
23	002027	分众传媒	45,000	633,600.00	1.01
24	000002	万科 A	20,300	630,518.00	1.00
25	600729	重庆百货	24,900	623,994.00	0.99
26	601225	陕西煤业	76,400	623,424.00	0.99
27	002601	龙鳞佰利	38,800	621,576.00	0.99
28	600019	宝钢股份	71,500	617,760.00	0.98
29	600426	华鲁恒升	38,400	611,328.00	0.97
30	601288	农业银行	159,000	608,970.00	0.97
31	600887	伊利股份	18,900	608,391.00	0.97
32	002714	牧原股份	11,500	607,890.00	0.97
33	600585	海螺水泥	20,700	607,131.00	0.97
34	601607	上海医药	25,000	604,750.00	0.96
35	600332	白云山	18,800	604,232.00	0.96
36	600028	中国石化	98,200	601,966.00	0.96
37	002415	海康威视	15,400	600,600.00	0.96
38	600588	用友网络	28,300	598,545.00	0.95
39	002001	新和成	15,600	593,736.00	0.95
40	002146	荣盛发展	62,300	593,719.00	0.95
41	002244	滨江集团	74,400	591,480.00	0.94
42	300015	爱尔眼科	19,200	591,360.00	0.94
43	000651	格力电器	13,500	589,950.00	0.94
44	601233	桐昆股份	26,200	589,238.00	0.94
45	002310	东方园林	29,200	588,964.00	0.94
46	601318	中国平安	8,400	587,832.00	0.94
47	000513	丽珠集团	8,800	584,760.00	0.93
48	002373	千方科技	39,700	581,605.00	0.93
49	300017	网宿科技	54,600	580,944.00	0.92
50	601186	中国铁建	52,100	580,394.00	0.92
51	600486	扬农化工	11,600	576,404.00	0.92
52	600859	王府井	28,200	575,280.00	0.92
53	601088	中国神华	24,800	574,616.00	0.91
54	603816	顾家家居	9,700	572,009.00	0.91
55	002179	中航光电	14,500	571,010.00	0.91
56	600497	驰宏锌锗	80,400	570,840.00	0.91
57	600566	济川药业	14,900	568,435.00	0.90
58	300133	华策影视	52,200	565,848.00	0.90
59	600809	山西汾酒	9,900	564,201.00	0.90
60	600036	招商银行	19,300	560,086.00	0.89
61	601988	中国银行	140,800	558,976.00	0.89

62	603708	家家悦	27,900	558,558.00	0.89
63	002475	立讯精密	23,800	557,872.00	0.89
64	002081	金螳螂	36,300	556,116.00	0.89
65	000568	泸州老窖	8,400	554,400.00	0.88
66	000333	美的集团	10,000	554,300.00	0.88
67	600104	上汽集团	17,300	554,292.00	0.88
68	600690	青岛海尔	29,400	553,896.00	0.88
69	002383	合众思壮	27,500	550,825.00	0.88
70	000661	长春高新	3,000	549,000.00	0.87
71	002508	老板电器	11,400	548,340.00	0.87
72	603899	晨光文具	22,200	547,452.00	0.87
73	600352	浙江龙盛	46,700	546,857.00	0.87
74	601601	中国太保	13,200	546,744.00	0.87
75	002833	弘亚数控	8,800	546,040.00	0.87
76	600782	新钢股份	82,900	545,482.00	0.87
77	002624	完美世界	16,300	545,398.00	0.87
78	603900	莱绅通灵	18,800	545,012.00	0.87
79	600276	恒瑞医药	7,900	544,942.00	0.87
80	601098	中南传媒	39,100	543,099.00	0.86
81	002241	歌尔股份	31,200	541,320.00	0.86
82	300003	乐普医疗	22,400	541,184.00	0.86
83	601628	中国人寿	17,700	538,965.00	0.86
84	300498	温氏股份	22,500	537,750.00	0.86
85	600702	沱牌舍得	11,500	536,590.00	0.85
86	603337	杰克股份	10,400	536,016.00	0.85
87	002439	启明星辰	22,900	534,715.00	0.85
88	600507	方大特钢	42,100	534,249.00	0.85
89	600406	国电南瑞	29,200	533,776.00	0.85
90	300136	信维通信	10,500	532,350.00	0.85
91	300055	万邦达	25,100	527,853.00	0.84
92	000681	视觉中国	26,900	524,550.00	0.84
93	601100	恒立液压	19,100	524,104.00	0.83
94	002555	三七互娱	25,500	523,770.00	0.83
95	600900	长江电力	33,300	519,147.00	0.83
96	601688	华泰证券	29,600	510,896.00	0.81
97	002008	大族激光	10,300	508,820.00	0.81
98	600703	三安光电	19,800	502,722.00	0.80
99	600338	西藏珠峰	12,000	499,800.00	0.80
100	603160	汇顶科技	5,100	494,394.00	0.79
101	600188	兖州煤业	2,200	31,944.00	0.05
102	601678	滨化股份	3,900	31,668.00	0.05
103	000990	诚志股份	1,800	31,068.00	0.05
104	002456	欧菲科技	1,500	30,885.00	0.05

105	000001	平安银行	2,300	30,590.00	0.05
106	603993	洛阳钼业	4,300	29,584.00	0.05
107	601012	隆基股份	800	29,152.00	0.05
108	600570	恒生电子	600	27,840.00	0.04
109	000830	鲁西化工	1,700	27,064.00	0.04
110	002285	世联行	700	7,805.00	0.01
111	600340	华夏幸福	100	3,139.00	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	601318	中国平安	16,558,701.44	27.42
2	601166	兴业银行	12,529,052.51	20.75
3	600016	民生银行	10,363,219.62	17.16
4	600276	恒瑞医药	10,342,145.91	17.13
5	601818	光大银行	9,853,069.00	16.32
6	601939	建设银行	9,667,227.00	16.01
7	601288	农业银行	9,479,793.00	15.70
8	600519	贵州茅台	7,984,055.98	13.22
9	601601	中国太保	7,495,951.13	12.41
10	601668	中国建筑	7,463,937.00	12.36
11	600104	上汽集团	7,207,675.87	11.94
12	600741	华域汽车	7,048,694.09	11.67
13	601211	国泰君安	6,832,315.00	11.32
14	000858	五粮液	6,704,250.59	11.10
15	600028	中国石化	6,556,529.00	10.86
16	600019	宝钢股份	6,475,555.53	10.72
17	600887	伊利股份	6,172,221.24	10.22
18	000651	格力电器	6,135,436.73	10.16
19	601009	南京银行	5,982,947.29	9.91
20	600030	中信证券	5,938,661.74	9.84
21	601186	中国铁建	5,908,238.57	9.79
22	600900	长江电力	5,874,854.05	9.73
23	601328	交通银行	5,716,365.54	9.47
24	600048	保利地产	5,517,930.00	9.14
25	000895	双汇发展	5,429,645.48	8.99
26	600015	华夏银行	5,429,360.00	8.99
27	601899	紫金矿业	5,303,350.00	8.78
28	000415	渤海金控	5,299,405.89	8.78
29	600036	招商银行	5,168,559.74	8.56

30	600383	金地集团	5,055,876.78	8.37
31	000725	京东方 A	5,035,950.00	8.34
32	600282	南钢股份	4,962,703.94	8.22
33	600708	光明地产	4,669,958.64	7.73
34	601988	中国银行	4,667,015.00	7.73
35	000900	现代投资	4,628,870.62	7.67
36	002048	宁波华翔	4,547,038.52	7.53
37	000400	许继电气	4,438,874.00	7.35
38	002636	金安国纪	4,363,441.00	7.23
39	600782	新钢股份	4,359,141.53	7.22
40	000002	万科 A	4,275,193.00	7.08
41	601155	新城控股	4,166,352.87	6.90
42	000036	华联控股	4,110,074.26	6.81
43	000333	美的集团	4,095,139.50	6.78
44	600029	南方航空	3,999,837.00	6.62
45	000425	徐工机械	3,996,396.00	6.62
46	000921	海信科龙	3,995,388.00	6.62
47	600291	西水股份	3,956,696.79	6.55
48	000528	柳工	3,953,788.49	6.55
49	002050	三花智控	3,869,871.84	6.41
50	000069	华侨城 A	3,862,051.08	6.40
51	002463	沪电股份	3,858,596.00	6.39
52	601390	中国中铁	3,847,060.00	6.37
53	601233	桐昆股份	3,837,649.71	6.36
54	600035	楚天高速	3,819,283.56	6.33
55	600335	国机汽车	3,812,731.96	6.31
56	000402	金融街	3,782,824.61	6.26
57	002244	滨江集团	3,717,329.73	6.16
58	002027	分众传媒	3,679,604.37	6.09
59	000066	中国长城	3,656,507.47	6.06
60	600309	万华化学	3,632,315.11	6.02
61	002416	爱施德	3,628,185.69	6.01
62	002611	东方精工	3,605,155.22	5.97
63	600637	东方明珠	3,587,437.15	5.94
64	601336	新华保险	3,575,239.19	5.92
65	600056	中国医药	3,563,944.83	5.90
66	000338	潍柴动力	3,459,656.78	5.73
67	601607	上海医药	3,458,117.29	5.73
68	600801	华新水泥	3,457,953.04	5.73
69	002078	太阳纸业	3,443,427.00	5.70
70	000936	华西股份	3,439,275.23	5.70
71	601636	旗滨集团	3,424,071.00	5.67
72	600031	三一重工	3,410,234.00	5.65



73	600502	安徽水利	3,409,004.36	5.65
74	600816	安信信托	3,407,640.80	5.64
75	000531	穗恒运 A	3,370,582.64	5.58
76	000568	泸州老窖	3,355,536.77	5.56
77	000001	平安银行	3,350,664.60	5.55
78	600230	沧州大化	3,336,637.00	5.53
79	601006	大秦铁路	3,329,036.66	5.51
80	000910	大亚圣象	3,301,893.50	5.47
81	002309	中利集团	3,261,494.07	5.40
82	000863	三湘印象	3,250,276.87	5.38
83	600703	三安光电	3,249,630.25	5.38
84	002456	欧菲科技	3,213,823.54	5.32
85	000034	神州数码	3,212,910.52	5.32
86	601600	中国铝业	3,170,142.00	5.25
87	600757	长江传媒	3,167,637.52	5.25
88	002310	东方园林	3,110,552.15	5.15
89	600856	中天能源	3,074,392.83	5.09
90	600694	大商股份	3,055,028.33	5.06
91	600475	华光股份	3,028,657.40	5.02
92	002714	牧原股份	3,004,065.43	4.98
93	000166	申万宏源	2,998,107.07	4.97
94	000938	紫光股份	2,974,287.94	4.93
95	600690	青岛海尔	2,972,845.50	4.92
96	600308	华泰股份	2,965,371.98	4.91
97	600720	祁连山	2,964,397.41	4.91
98	600958	东方证券	2,948,220.00	4.88
99	600711	盛屯矿业	2,923,007.00	4.84
100	600487	亨通光电	2,909,861.04	4.82
101	002241	歌尔股份	2,907,987.29	4.82
102	600808	马钢股份	2,898,758.00	4.80
103	600073	上海梅林	2,886,933.79	4.78
104	002368	太极股份	2,879,988.87	4.77
105	000876	新希望	2,872,287.78	4.76
106	600183	生益科技	2,858,889.85	4.73
107	000768	中航飞机	2,855,716.21	4.73
108	002157	正邦科技	2,853,578.00	4.73
109	002415	海康威视	2,838,958.78	4.70
110	002304	洋河股份	2,836,593.67	4.70
111	600522	中天科技	2,828,529.00	4.68
112	002179	中航光电	2,812,891.84	4.66
113	601888	中国国旅	2,800,203.32	4.64
114	000501	鄂武商 A	2,780,546.44	4.61
115	600755	厦门国贸	2,775,729.66	4.60

116	600373	中文传媒	2,749,874.08	4.55
117	600258	首旅酒店	2,673,190.57	4.43
118	300120	经纬电材	2,667,170.63	4.42
119	002065	东华软件	2,661,630.27	4.41
120	600018	上港集团	2,632,236.00	4.36
121	002238	天威视讯	2,625,919.14	4.35
122	600170	上海建工	2,605,148.00	4.31
123	300241	瑞丰光电	2,581,923.26	4.28
124	000063	中兴通讯	2,578,664.17	4.27
125	000630	铜陵有色	2,550,088.00	4.22
126	002440	闰土股份	2,543,356.45	4.21
127	600518	康美药业	2,498,985.37	4.14
128	000822	山东海化	2,491,998.00	4.13
129	300116	坚瑞沃能	2,484,251.54	4.11
130	300184	力源信息	2,470,685.00	4.09
131	002597	金禾实业	2,466,420.00	4.08
132	600325	华发股份	2,463,113.28	4.08
133	300233	金城医药	2,452,019.32	4.06
134	600153	建发股份	2,440,017.72	4.04
135	002567	唐人神	2,431,605.99	4.03
136	601699	潞安环能	2,426,423.80	4.02
137	002273	水晶光电	2,396,931.34	3.97
138	600271	航天信息	2,381,407.39	3.94
139	600761	安徽合力	2,379,183.82	3.94
140	002247	帝龙文化	2,362,980.44	3.91
141	600409	三友化工	2,362,040.23	3.91
142	000783	长江证券	2,349,239.00	3.89
143	000878	云南铜业	2,336,674.59	3.87
144	300227	光韵达	2,334,201.52	3.87
145	300344	太空板业	2,327,592.37	3.85
146	601766	中国中车	2,327,287.30	3.85
147	002674	兴业科技	2,315,351.60	3.83
148	002008	大族激光	2,311,262.00	3.83
149	300040	九洲电气	2,308,885.53	3.82
150	000023	深天地 A	2,308,648.35	3.82
151	601137	博威合金	2,305,363.12	3.82
152	600697	欧亚集团	2,296,797.88	3.80
153	002230	科大讯飞	2,293,091.80	3.80
154	300303	聚飞光电	2,291,523.48	3.80
155	000685	中山公用	2,289,638.30	3.79
156	601677	明泰铝业	2,289,060.38	3.79
157	600191	华资实业	2,284,463.99	3.78
158	600166	福田汽车	2,281,782.00	3.78

159	600677	航天通信	2,280,608.74	3.78
160	600121	*ST 郑煤	2,272,218.20	3.76
161	000830	鲁西化工	2,271,202.00	3.76
162	000703	恒逸石化	2,269,732.41	3.76
163	002637	赞宇科技	2,268,693.88	3.76
164	300138	晨光生物	2,263,323.46	3.75
165	600661	新南洋	2,260,801.95	3.74
166	600966	博汇纸业	2,260,240.91	3.74
167	600348	阳泉煤业	2,256,065.00	3.74
168	600235	民丰特纸	2,255,664.45	3.74
169	600675	中华企业	2,253,445.52	3.73
170	002295	精艺股份	2,252,083.44	3.73
171	601998	中信银行	2,233,181.00	3.70
172	600051	宁波联合	2,226,969.18	3.69
173	300082	奥克股份	2,225,053.00	3.69
174	000004	国农科技	2,219,414.96	3.68
175	300046	台基股份	2,212,632.58	3.66
176	000070	特发信息	2,211,613.75	3.66
177	000587	金洲慈航	2,211,538.00	3.66
178	600057	象屿股份	2,204,764.16	3.65
179	000890	法尔胜	2,190,625.00	3.63
180	600466	蓝光发展	2,187,683.01	3.62
181	600510	黑牡丹	2,176,466.84	3.60
182	600961	株冶集团	2,175,832.76	3.60
183	601099	太平洋	2,170,511.00	3.59
184	300063	天龙集团	2,168,043.92	3.59
185	002420	毅昌股份	2,163,715.37	3.58
186	300302	同有科技	2,160,636.43	3.58
187	300080	易成新能	2,154,383.67	3.57
188	600873	梅花生物	2,143,861.16	3.55
189	000662	天夏智慧	2,135,052.15	3.54
190	002580	圣阳股份	2,130,755.78	3.53
191	002645	华宏科技	2,118,591.19	3.51
192	002088	鲁阳节能	2,113,704.42	3.50
193	601169	北京银行	2,101,676.28	3.48
194	601857	中国石油	2,101,390.00	3.48
195	300112	万讯自控	2,098,326.68	3.48
196	600585	海螺水泥	2,090,654.52	3.46
197	002458	益生股份	2,076,077.47	3.44
198	002182	云海金属	2,060,839.66	3.41
199	300072	三聚环保	2,060,181.89	3.41
200	002148	北纬科技	2,055,717.32	3.40
201	002106	莱宝高科	2,052,470.00	3.40

202	000538	云南白药	2,047,282.95	3.39
203	300070	碧水源	2,040,708.03	3.38
204	002601	龙麟佰利	2,031,364.66	3.36
205	000990	诚志股份	2,030,902.04	3.36
206	000030	富奥股份	2,026,335.82	3.36
207	002083	孚日股份	2,019,031.52	3.34
208	002511	中顺洁柔	2,012,799.94	3.33
209	600529	山东药玻	2,011,079.00	3.33
210	600565	迪马股份	2,010,878.00	3.33
211	600067	冠城大通	2,005,037.36	3.32
212	002006	精功科技	2,000,608.59	3.31
213	000488	晨鸣纸业	1,997,278.00	3.31
214	002024	苏宁云商	1,992,646.55	3.30
215	300059	东方财富	1,988,146.36	3.29
216	600389	江山股份	1,982,931.05	3.28
217	001979	招商蛇口	1,981,663.39	3.28
218	601688	华泰证券	1,974,778.53	3.27
219	601231	环旭电子	1,970,741.55	3.26
220	002462	嘉事堂	1,969,394.64	3.26
221	600327	大东方	1,966,148.29	3.26
222	002466	天齐锂业	1,960,174.73	3.25
223	300293	蓝英装备	1,959,989.26	3.25
224	600000	浦发银行	1,957,105.48	3.24
225	600499	科达洁能	1,948,841.00	3.23
226	002171	楚江新材	1,943,027.92	3.22
227	600216	浙江医药	1,942,510.78	3.22
228	600060	海信电器	1,917,790.40	3.18
229	600452	涪陵电力	1,910,256.40	3.16
230	300338	开元股份	1,890,380.87	3.13
231	000521	美菱电器	1,885,203.00	3.12
232	002491	通鼎互联	1,877,823.54	3.11
233	300310	宜通世纪	1,876,700.20	3.11
234	300401	花园生物	1,874,155.90	3.10
235	300141	和顺电气	1,864,915.70	3.09
236	300365	恒华科技	1,863,609.10	3.09
237	600535	天士力	1,852,872.65	3.07
238	600252	中恒集团	1,851,928.00	3.07
239	000960	锡业股份	1,848,357.20	3.06
240	600098	广州发展	1,829,997.41	3.03
241	600285	羚锐制药	1,829,698.70	3.03
242	600765	中航重机	1,823,833.00	3.02
243	000932	*ST 华菱	1,822,683.36	3.02
244	002079	苏州固锝	1,822,474.00	3.02

245	000776	广发证券	1,817,770.00	3.01
246	600368	五洲交通	1,817,025.57	3.01
247	600617	国新能源	1,803,557.49	2.99
248	300130	新国都	1,801,964.04	2.98
249	601669	中国电建	1,797,075.00	2.98
250	000667	美好置业	1,795,243.00	2.97
251	601225	陕西煤业	1,792,639.00	2.97
252	002101	广东鸿图	1,790,951.04	2.97
253	002231	奥维通信	1,790,105.67	2.96
254	600511	国药股份	1,789,372.03	2.96
255	002037	久联发展	1,787,628.90	2.96
256	600990	四创电子	1,783,045.54	2.95
257	600744	华银电力	1,780,974.00	2.95
258	600268	国电南自	1,780,932.19	2.95
259	002534	杭锅股份	1,780,795.00	2.95
260	600438	通威股份	1,779,449.16	2.95
261	300498	温氏股份	1,778,492.72	2.95
262	600853	龙建股份	1,778,249.77	2.95
263	600835	上海机电	1,775,943.03	2.94
264	002232	启明信息	1,772,177.06	2.94
265	000411	英特集团	1,772,067.00	2.93
266	300448	浩云科技	1,769,223.18	2.93
267	000550	江铃汽车	1,767,886.02	2.93
268	002019	亿帆医药	1,766,169.70	2.93
269	300252	金信诺	1,764,160.95	2.92
270	300407	凯发电气	1,757,081.30	2.91
271	002739	万达电影	1,756,636.00	2.91
272	601566	九牧王	1,755,980.22	2.91
273	002139	拓邦股份	1,755,174.72	2.91
274	002003	伟星股份	1,743,199.36	2.89
275	601198	东兴证券	1,737,949.66	2.88
276	600287	江苏舜天	1,737,247.32	2.88
277	000016	深康佳 A	1,726,297.00	2.86
278	600077	宋都股份	1,725,882.96	2.86
279	300287	飞利信	1,720,113.37	2.85
280	000728	国元证券	1,713,678.31	2.84
281	600997	开滦股份	1,710,565.51	2.83
282	000625	长安汽车	1,706,119.00	2.83
283	603026	石大胜华	1,703,772.75	2.82
284	002502	骅威文化	1,703,068.09	2.82
285	601666	平煤股份	1,694,383.00	2.81
286	300121	阳谷华泰	1,680,587.82	2.78
287	000601	韶能股份	1,673,829.00	2.77

288	600340	华夏幸福	1,673,518.00	2.77
289	000060	中金岭南	1,669,733.00	2.77
290	601678	滨化股份	1,667,923.52	2.76
291	601717	郑煤机	1,665,256.51	2.76
292	300115	长盈精密	1,656,748.18	2.74
293	002582	好想你	1,639,602.31	2.72
294	002615	哈尔斯	1,618,788.67	2.68
295	000686	东北证券	1,611,163.92	2.67
296	600566	济川药业	1,563,345.00	2.59
297	601018	宁波港	1,557,327.00	2.58
298	002626	金达威	1,552,492.50	2.57
299	002146	荣盛发展	1,544,184.00	2.56
300	603993	洛阳钼业	1,539,904.00	2.55
301	002736	国信证券	1,535,741.74	2.54
302	600978	宜华生活	1,499,540.00	2.48
303	000541	佛山照明	1,495,528.98	2.48
304	601933	永辉超市	1,488,285.49	2.46
305	002555	三七互娱	1,479,721.70	2.45
306	002574	明牌珠宝	1,461,089.47	2.42
307	600089	特变电工	1,437,898.00	2.38
308	600203	福日电子	1,426,321.66	2.36
309	601919	中远海控	1,422,137.00	2.36
310	601989	中国重工	1,410,024.00	2.34
311	002624	完美世界	1,321,905.55	2.19
312	300124	汇川技术	1,321,672.02	2.19
313	000681	视觉中国	1,310,150.00	2.17
314	600642	申能股份	1,309,727.00	2.17
315	000423	东阿阿胶	1,300,421.00	2.15
316	600644	乐山电力	1,298,787.60	2.15
317	600109	国金证券	1,288,034.00	2.13
318	002507	涪陵榨菜	1,263,431.00	2.09
319	601788	光大证券	1,259,530.00	2.09
320	002142	宁波银行	1,247,615.19	2.07
321	002365	永安药业	1,239,742.55	2.05
322	600723	首商股份	1,238,169.00	2.05
323	600588	用友网络	1,227,389.60	2.03
324	002396	星网锐捷	1,220,817.44	2.02
325	002589	瑞康医药	1,216,150.00	2.01

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	20,270,687.42	33.57
2	601166	兴业银行	13,779,768.44	22.82
3	600016	民生银行	10,645,210.04	17.63
4	601818	光大银行	10,582,856.00	17.53
5	600276	恒瑞医药	10,360,620.39	17.16
6	601939	建设银行	9,845,009.00	16.30
7	601288	农业银行	9,205,696.00	15.25
8	600519	贵州茅台	8,855,389.48	14.67
9	601601	中国太保	8,258,034.00	13.68
10	601668	中国建筑	7,889,201.00	13.07
11	600104	上汽集团	7,765,517.94	12.86
12	000858	五粮液	7,743,938.61	12.83
13	600741	华域汽车	7,424,097.31	12.30
14	601211	国泰君安	7,212,814.23	11.95
15	600028	中国石化	6,724,161.84	11.14
16	000651	格力电器	6,488,227.64	10.75
17	600887	伊利股份	6,379,542.67	10.57
18	600030	中信证券	6,346,340.00	10.51
19	600019	宝钢股份	6,257,735.24	10.36
20	601009	南京银行	6,103,035.00	10.11
21	601328	交通银行	5,883,746.00	9.74
22	600048	保利地产	5,860,244.00	9.71
23	600900	长江电力	5,643,380.50	9.35
24	600015	华夏银行	5,553,678.00	9.20
25	601899	紫金矿业	5,466,337.00	9.05
26	600036	招商银行	5,394,069.34	8.93
27	000895	双汇发展	5,382,925.96	8.92
28	000415	渤海金控	5,374,010.50	8.90
29	000725	京东方 A	5,333,776.18	8.83
30	000921	海信科龙	5,250,608.60	8.70
31	000900	现代投资	5,229,172.55	8.66
32	601186	中国铁建	5,071,479.99	8.40
33	600383	金地集团	5,044,872.92	8.36
34	600282	南钢股份	4,952,284.30	8.20
35	000036	华联控股	4,880,964.13	8.08
36	600291	西水股份	4,750,759.09	7.87
37	002048	宁波华翔	4,637,538.82	7.68

38	600708	光明地产	4,603,713.38	7.62
39	601390	中国中铁	4,587,215.12	7.60
40	002636	金安国纪	4,540,770.26	7.52
41	600309	万华化学	4,490,200.34	7.44
42	601988	中国银行	4,441,097.00	7.36
43	000002	万科 A	4,362,231.40	7.22
44	000400	许继电气	4,338,665.96	7.19
45	600335	国机汽车	4,271,089.27	7.07
46	000069	华侨城 A	4,159,728.79	6.89
47	601233	桐昆股份	4,059,923.91	6.72
48	002050	三花智控	4,048,258.94	6.70
49	601636	旗滨集团	4,031,716.04	6.68
50	000333	美的集团	3,893,630.00	6.45
51	600029	南方航空	3,864,761.96	6.40
52	002463	沪电股份	3,852,338.82	6.38
53	600056	中国医药	3,790,832.27	6.28
54	601155	新城控股	3,788,399.88	6.27
55	000528	柳工	3,715,228.31	6.15
56	600035	楚天高速	3,706,598.67	6.14
57	000402	金融街	3,671,184.52	6.08
58	601336	新华保险	3,624,830.98	6.00
59	600487	亨通光电	3,616,899.39	5.99
60	601006	大秦铁路	3,595,722.13	5.96
61	600637	东方明珠	3,570,208.53	5.91
62	601600	中国铝业	3,547,362.00	5.88
63	002416	爱施德	3,541,503.01	5.87
64	002611	东方精工	3,537,057.87	5.86
65	600757	长江传媒	3,491,306.99	5.78
66	600816	安信信托	3,488,728.91	5.78
67	600782	新钢股份	3,454,111.36	5.72
68	000910	大亚圣象	3,373,961.78	5.59
69	000066	中国长城	3,357,325.58	5.56
70	600694	大商股份	3,352,182.18	5.55
71	600755	厦门国贸	3,337,105.94	5.53
72	600230	沧州大化	3,333,674.18	5.52
73	000001	平安银行	3,332,092.00	5.52
74	600183	生益科技	3,322,521.00	5.50
75	002456	欧菲科技	3,306,955.04	5.48
76	600522	中天科技	3,300,115.44	5.47
77	000568	泸州老窖	3,286,896.68	5.44
78	601607	上海医药	3,272,756.46	5.42
79	000936	华西股份	3,272,158.00	5.42
80	000338	潍柴动力	3,271,096.54	5.42



81	600801	华新水泥	3,269,930.74	5.42
82	600031	三一重工	3,224,295.07	5.34
83	000425	徐工机械	3,201,280.00	5.30
84	000166	申万宏源	3,109,350.90	5.15
85	600808	马钢股份	3,104,238.00	5.14
86	600856	中天能源	3,091,392.00	5.12
87	000531	穗恒运 A	3,077,428.20	5.10
88	002244	滨江集团	3,072,941.27	5.09
89	002027	分众传媒	3,068,779.80	5.08
90	002230	科大讯飞	3,019,503.81	5.00
91	002309	中利集团	2,994,529.11	4.96
92	300116	坚瑞沃能	2,972,957.99	4.92
93	600502	安徽水利	2,968,436.82	4.92
94	000768	中航飞机	2,967,885.00	4.92
95	000863	三湘印象	2,960,894.43	4.90
96	601888	中国国旅	2,947,637.00	4.88
97	600475	华光股份	2,943,505.30	4.87
98	300344	太空板业	2,922,120.81	4.84
99	600711	盛屯矿业	2,909,507.50	4.82
100	600958	东方证券	2,899,340.00	4.80
101	600325	华发股份	2,888,085.57	4.78
102	300184	力源信息	2,887,540.00	4.78
103	002078	太阳纸业	2,876,986.86	4.76
104	000876	新希望	2,858,683.02	4.73
105	002148	北纬科技	2,854,155.72	4.73
106	000063	中兴通讯	2,850,961.20	4.72
107	000501	鄂武商 A	2,819,239.70	4.67
108	300138	晨光生物	2,817,071.64	4.67
109	002065	东华软件	2,809,948.14	4.65
110	002157	正邦科技	2,802,991.77	4.64
111	000938	紫光股份	2,796,323.01	4.63
112	600703	三安光电	2,774,696.12	4.60
113	600073	上海梅林	2,750,500.20	4.56
114	600720	祁连山	2,734,343.00	4.53
115	600258	首旅酒店	2,733,719.80	4.53
116	000004	国农科技	2,722,022.23	4.51
117	000034	神州数码	2,712,283.00	4.49
118	600308	华泰股份	2,708,506.89	4.49
119	600018	上港集团	2,707,110.00	4.48
120	002310	东方园林	2,695,519.00	4.46
121	300120	经纬电材	2,678,980.07	4.44
122	600690	青岛海尔	2,651,828.68	4.39
123	000830	鲁西化工	2,650,618.08	4.39

124	300046	台基股份	2,622,719.46	4.34
125	600873	梅花生物	2,620,432.95	4.34
126	002368	太极股份	2,619,333.43	4.34
127	600373	中文传媒	2,594,560.15	4.30
128	000070	特发信息	2,582,033.00	4.28
129	600744	华银电力	2,563,516.53	4.25
130	300310	宜通世纪	2,551,760.62	4.23
131	002567	唐人神	2,531,586.98	4.19
132	600166	福田汽车	2,527,849.00	4.19
133	002597	金禾实业	2,517,944.98	4.17
134	002415	海康威视	2,516,839.50	4.17
135	300233	金城医药	2,508,172.76	4.15
136	600518	康美药业	2,506,038.00	4.15
137	600170	上海建工	2,495,950.60	4.13
138	600409	三友化工	2,491,878.15	4.13
139	002440	闰土股份	2,489,196.00	4.12
140	600585	海螺水泥	2,486,818.00	4.12
141	000521	美菱电器	2,445,874.12	4.05
142	002238	天威视讯	2,445,481.91	4.05
143	600153	建发股份	2,440,118.00	4.04
144	002714	牧原股份	2,435,607.46	4.03
145	600271	航天信息	2,403,984.00	3.98
146	002273	水晶光电	2,402,391.81	3.98
147	000783	长江证券	2,394,409.82	3.97
148	300241	瑞丰光电	2,394,010.90	3.96
149	600285	羚锐制药	2,392,808.98	3.96
150	000630	铜陵有色	2,379,066.04	3.94
151	002491	通鼎互联	2,378,811.31	3.94
152	002241	歌尔股份	2,356,929.17	3.90
153	600510	黑牡丹	2,349,958.83	3.89
154	300112	万讯自控	2,348,688.97	3.89
155	000822	山东海化	2,333,446.08	3.86
156	600327	大东方	2,328,175.34	3.86
157	601766	中国中车	2,312,717.00	3.83
158	002247	帝龙文化	2,310,054.90	3.83
159	600966	博汇纸业	2,310,019.00	3.83
160	002645	华宏科技	2,300,762.08	3.81
161	000890	法尔胜	2,261,712.51	3.75
162	002024	苏宁云商	2,260,456.00	3.74
163	002304	洋河股份	2,254,154.00	3.73
164	000685	中山公用	2,236,460.90	3.70
165	002458	益生股份	2,227,672.90	3.69
166	601099	太平洋	2,227,296.00	3.69

167	002179	中航光电	2,216,416.55	3.67
168	601998	中信银行	2,214,556.29	3.67
169	300303	聚飞光电	2,212,372.02	3.66
170	600661	新南洋	2,203,915.09	3.65
171	601677	明泰铝业	2,202,238.83	3.65
172	300227	光韵达	2,200,823.64	3.64
173	002674	兴业科技	2,194,285.57	3.63
174	000601	韶能股份	2,179,879.95	3.61
175	000587	金洲慈航	2,177,125.34	3.61
176	600057	象屿股份	2,169,590.97	3.59
177	002511	中顺洁柔	2,156,473.71	3.57
178	300287	飞利信	2,156,087.69	3.57
179	601137	博威合金	2,154,510.76	3.57
180	601169	北京银行	2,152,925.00	3.57
181	000550	江铃汽车	2,141,417.62	3.55
182	002580	圣阳股份	2,140,184.00	3.54
183	601699	潞安环能	2,138,381.02	3.54
184	002182	云海金属	2,136,892.00	3.54
185	601857	中国石油	2,129,345.33	3.53
186	600697	欧亚集团	2,127,272.32	3.52
187	600675	中华企业	2,123,988.35	3.52
188	000023	深天地 A	2,123,481.40	3.52
189	000662	天夏智慧	2,122,978.46	3.52
190	300040	九洲电气	2,122,119.00	3.51
191	600060	海信电器	2,116,202.37	3.50
192	600121	*ST 郑煤	2,102,172.29	3.48
193	600961	株冶集团	2,089,023.65	3.46
194	600761	安徽合力	2,079,642.87	3.44
195	000030	富奥股份	2,079,371.24	3.44
196	600677	航天通信	2,076,197.95	3.44
197	002295	精艺股份	2,074,948.51	3.44
198	300070	碧水源	2,070,311.10	3.43
199	600235	民丰特纸	2,063,770.48	3.42
200	002462	嘉事堂	2,058,083.85	3.41
201	600466	蓝光发展	2,052,986.22	3.40
202	601231	环旭电子	2,050,881.00	3.40
203	300338	开元股份	2,046,650.52	3.39
204	600765	中航重机	2,045,731.78	3.39
205	002615	哈尔斯	2,036,474.78	3.37
206	000878	云南铜业	2,034,555.13	3.37
207	600051	宁波联合	2,030,926.25	3.36
208	300059	东方财富	2,023,128.00	3.35
209	600000	浦发银行	2,022,656.84	3.35

210	000538	云南白药	2,022,341.00	3.35
211	300302	同有科技	2,011,493.02	3.33
212	002006	精功科技	2,008,822.00	3.33
213	002637	赞宇科技	2,006,047.64	3.32
214	600067	冠城大通	2,000,138.63	3.31
215	600368	五洲交通	1,996,774.41	3.31
216	300080	易成新能	1,996,438.86	3.31
217	300115	长盈精密	1,989,029.00	3.29
218	002088	鲁阳节能	1,988,907.41	3.29
219	300082	奥克股份	1,986,853.32	3.29
220	002466	天齐锂业	1,983,622.64	3.29
221	600348	阳泉煤业	1,982,080.00	3.28
222	002626	金达威	1,974,039.53	3.27
223	002008	大族激光	1,972,461.07	3.27
224	600389	江山股份	1,967,984.26	3.26
225	000990	诚志股份	1,966,384.98	3.26
226	600216	浙江医药	1,962,614.71	3.25
227	002171	楚江新材	1,957,733.25	3.24
228	002083	孚日股份	1,955,808.05	3.24
229	000488	晨鸣纸业	1,941,305.25	3.22
230	002420	毅昌股份	1,938,113.38	3.21
231	300072	三聚环保	1,937,069.82	3.21
232	600565	迪马股份	1,935,069.00	3.20
233	600529	山东药玻	1,925,039.00	3.19
234	600511	国药股份	1,924,689.08	3.19
235	600499	科达洁能	1,922,396.96	3.18
236	300141	和顺电气	1,918,940.94	3.18
237	600644	乐山电力	1,910,729.01	3.16
238	600452	涪陵电力	1,907,274.87	3.16
239	300063	天龙集团	1,906,656.00	3.16
240	600191	华资实业	1,887,201.99	3.13
241	600438	通威股份	1,878,374.14	3.11
242	002574	明牌珠宝	1,875,430.61	3.11
243	300401	花园生物	1,863,574.35	3.09
244	300293	蓝英装备	1,853,179.89	3.07
245	002139	拓邦股份	1,851,505.00	3.07
246	600535	天士力	1,850,074.13	3.06
247	600835	上海机电	1,846,031.82	3.06
248	601669	中国电建	1,845,240.00	3.06
249	600617	国新能源	1,840,645.15	3.05
250	601566	九牧王	1,823,488.34	3.02
251	300407	凯发电气	1,822,562.06	3.02
252	300365	恒华科技	1,818,839.00	3.01

253	600203	福日电子	1,814,857.80	3.01
254	600853	龙建股份	1,806,225.81	2.99
255	000411	英特集团	1,805,883.71	2.99
256	002232	启明信息	1,796,905.15	2.98
257	002534	杭锅股份	1,796,578.00	2.98
258	002003	伟星股份	1,796,318.28	2.97
259	601198	东兴证券	1,795,984.31	2.97
260	603026	石大胜华	1,794,197.22	2.97
261	300252	金信诺	1,789,387.24	2.96
262	600642	申能股份	1,771,544.60	2.93
263	000776	广发证券	1,767,831.30	2.93
264	002502	骅威文化	1,766,424.99	2.93
265	002231	奥维通信	1,761,491.44	2.92
266	000703	恒逸石化	1,760,009.00	2.91
267	000728	国元证券	1,742,166.00	2.89
268	000667	美好置业	1,738,434.00	2.88
269	000932	*ST 华菱	1,736,415.30	2.88
270	002142	宁波银行	1,736,354.20	2.88
271	600268	国电南自	1,734,702.14	2.87
272	002106	莱宝高科	1,720,421.35	2.85
273	000625	长安汽车	1,718,639.00	2.85
274	600287	江苏舜天	1,707,040.37	2.83
275	000016	深康佳 A	1,704,032.00	2.82
276	600990	四创电子	1,695,235.00	2.81
277	603993	洛阳钼业	1,690,904.00	2.80
278	002101	广东鸿图	1,690,343.35	2.80
279	002037	久联发展	1,687,491.15	2.79
280	601666	平煤股份	1,682,047.00	2.79
281	002019	亿帆医药	1,680,028.95	2.78
282	600340	华夏幸福	1,677,228.43	2.78
283	600252	中恒集团	1,676,622.00	2.78
284	601919	中远海控	1,663,871.32	2.76
285	000060	中金岭南	1,648,800.00	2.73
286	002079	苏州固锴	1,643,963.00	2.72
287	600077	宋都股份	1,641,066.73	2.72
288	002582	好想你	1,640,235.58	2.72
289	300121	阳谷华泰	1,635,069.12	2.71
290	000960	锡业股份	1,631,399.59	2.70
291	600997	开滦股份	1,629,845.00	2.70
292	300130	新国都	1,609,965.52	2.67
293	002736	国信证券	1,588,369.00	2.63
294	600098	广州发展	1,575,098.99	2.61
295	601018	宁波港	1,566,612.00	2.59

296	601678	滨化股份	1,564,225.36	2.59
297	000686	东北证券	1,558,599.00	2.58
298	600978	宜华生活	1,512,774.00	2.51
299	300448	浩云科技	1,511,043.94	2.50
300	601933	永辉超市	1,509,783.00	2.50
301	601717	郑煤机	1,458,034.57	2.41
302	601225	陕西煤业	1,456,056.90	2.41
303	000541	佛山照明	1,453,360.98	2.41
304	002601	龙麟佰利	1,444,063.50	2.39
305	600089	特变电工	1,441,140.96	2.39
306	601989	中国重工	1,408,803.00	2.33
307	600350	山东高速	1,405,843.10	2.33
308	001979	招商蛇口	1,391,271.18	2.30
309	002365	永安药业	1,354,845.00	2.24
310	300124	汇川技术	1,329,996.00	2.20
311	002507	涪陵榨菜	1,320,252.91	2.19
312	601688	华泰证券	1,314,653.00	2.18
313	002624	完美世界	1,314,430.50	2.18
314	600723	首商股份	1,300,737.70	2.15
315	600109	国金证券	1,269,403.00	2.10
316	000597	东北制药	1,264,794.00	2.09
317	601788	光大证券	1,260,276.00	2.09
318	002396	星网锐捷	1,228,354.00	2.03
319	000423	东阿阿胶	1,222,153.00	2.02

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	1,045,493,127.26
卖出股票的收入（成交）总额	1,062,146,395.78

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	299,550.00	0.48

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）	32,400.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	331,950.00	0.53

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019563	17 国债 09	3,000	299,550.00	0.48
2	128029	太阳转债	324	32,400.00	0.05

#### 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名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 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。

### 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	74,221.33
2	应收证券清算款	298,817.01
3	应收股利	-
4	应收利息	7,149.24
5	应收申购款	120,679.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	500,867.41

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002739	万达电影	831,333.00	1.32	停牌股票

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者



			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
博时银智大数 据 100A	3,313	13,544.63	3,771,121.02	8.40%	41,102,230.69	91.60%
博时银智大数 据 100C	6	4,725.45	-	-	28,352.72	100.00%
合计	3,319	13,528.68	3,771,121.02	8.40%	41,130,583.41	91.60%

### 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
基金管理人所有从业 人员持有本基金	博时银智大数据 100A	310,733.05	0.69%
	博时银智大数据 100C	2,209.19	7.79%
	合计	312,942.24	0.70%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	博时银智大数据 100A	-
	博时银智大数据 100C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开 放式基金	博时银智大数据 100A	-
	博时银智大数据 100C	-
	合计	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时银智大数据 100A	博时银智大数据 100C
基金合同生效日（2016 年 5 月 20 日）基金份额总额	218,526,964.07	-
本报告期期初基金份额总额	51,349,762.63	-
本报告期基金总申购份额	306,208,964.75	35,873.73
减：本报告期基金总赎回份额	312,685,375.67	7,521.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	44,873,351.71	28,352.72

## § 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和基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 40000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	654,937,604.28	31.12%	478,977.59	26.24%	-
招商证券	2	455,049,934.38	21.62%	423,793.83	23.22%	-
广发证券	2	226,874,159.67	10.78%	211,281.59	11.57%	新增 1 个
方正证券	1	210,325,848.64	9.99%	195,876.77	10.73%	新增 1 个
兴业证券	1	209,625,413.03	9.96%	195,227.11	10.69%	-

长江证券	1	175,014,302.08	8.32%	162,968.23	8.93%	新增 1 个
海通证券	1	63,702,292.99	3.03%	59,324.66	3.25%	新增 1 个
中信证券	1	55,151,879.29	2.62%	51,364.14	2.81%	-
中金公司	1	36,242,591.24	1.72%	33,752.74	1.85%	-
东方证券	1	17,389,475.20	0.83%	12,718.70	0.70%	-
国金证券	1	166,157.31	0.01%	154.74	0.01%	新增 1 个

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。

### 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	59,181.66	6.25%	37,100,000.00	75.41%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	543,626.70	57.45%	4,300,000.00	8.74%	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	343,415.00	36.29%	4,700,000.00	9.55%	-	-
国金证券	-	-	3,100,000.00	6.30%	-	-

## 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	20171229 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	2017-12-29
2	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海汇联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	2017-12-29
3	20171229 关于博时旗下部分基金参加工行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	2017-12-29
4	关于博时旗下部分开放式基金增加龙江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	2017-12-06
5	关于博时旗下部分开放式基金增加上海联泰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	2017-11-20
6	关于博时旗下部分开放式基金增加湖北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	2017-11-01
7	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-10-27
8	关于博时旗下部分开放式基金增加广发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	2017-10-13
9	关于博时旗下部分开放式基金增加中民财富管理(上海)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	2017-09-27
10	关于博时旗下部分基金参加平安银行申购业务与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	2017-09-26
11	博时基金管理有限公司关于博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-09-15
12	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投	中国证券报、上海证券	2017-09-07

	资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	报、证券时报	
13	关于博时旗下部分开放式基金增加天津万家财富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	2017-09-01
14	关于博时旗下部分开放式基金增加联储证券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	2017-09-01
15	关于博时旗下部分开放式基金增加弘业期货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	2017-08-31
16	关于博时旗下部分开放式基金增加乾道金融信息服务(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	2017-08-30
17	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年半年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-08-24
18	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年半年度报告(正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-08-24
19	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-07-19
20	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 2 号(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-07-04
21	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金更新招募说明书 2017 年第 2 号(正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-07-04
22	关于博时旗下部分开放式基金增加泰诚财富基金销售(大连)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	2017-07-03
23	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	2017-07-01
24	关于博时旗下部分基金继续参加交通银行网上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	2017-07-01
25	关于博时旗下部分开放式基金增加首创证券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	2017-06-19
26	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
27	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
28	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
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	2017-05-05

30	博时基金管理有限公司关于博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金开展直销柜台赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-05-03
31	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
32	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 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
33	关于博时旗下部分开放式基金增加大河财富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	2017-04-07
34	关于博时旗下部分开放式基金增加华夏财富为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-04-06
35	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-27
36	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 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
37	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
38	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-03-03
39	关于博时旗下部分开放式基金新增江苏银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017-02-28
40	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
41	关于博时旗下部分开放式基金增加威海市商业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	2017-02-16
42	博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 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
43	博时中证银联智惠大数据 100 指数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
44	博时中证银联智惠大数据 100 指数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

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

投资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-05-03~2017-08-17	-	51,803,660.85	51,803,660.85	-	-
	2	2017-03-02~2017-05-04	-	122,368,249.31	122,368,249.31	-	-
<b>产品特有风险</b>							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金设立的文件

13.1.2 《博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金基金合同》

13.1.3 《博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金各年度审计报告正本

13.1.6 报告期内博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 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  
二〇一八年三月三十一日