

博时产业新动力灵活配置混合型  
发起式证券投资基金  
2015 年半年度报告  
2015 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：二〇一五年八月二十七日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2015 年 8 月 26 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 2015 年 1 月 26 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	4
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遵规守信情况的说明	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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
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	9
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	9
§ 5 托管人报告	9
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	9
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	9
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	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	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	29
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	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	30
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	33
7.6 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债券投资明细	33
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	33
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	33
7.9 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权证投资明细	33
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	33
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	33
7.12 投资组合报告附注	34
§ 8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	34
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	34
8.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	35
§ 9 开放式基金份额变动	35
§ 10 重大事件揭示	35

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	35
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 .....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	35
10.4 基金投资策略的改变 .....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	36
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 .....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	36
10.8 其他重大事件 .....	37
§ 11 备查文件目录 .....	40
11.1 备查文件目录 .....	40
11.2 存放地点 .....	40
11.3 查阅方式 .....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	博时产业新动力混合
基金主代码	000936
交易代码	000936
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 26 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	545,129,488.47 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对符合或引领国内产业创新、制造业升级趋势的优质企业的深入研究，在严格控制估值风险及流动性风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值
投资策略	本基金投资策略分三个层次：首先是大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业发展规律和内在逻辑，在不同行业之间进行动态配置；最后是个股选择策略和债券投资策略。
业绩比较基准	中证全指工业指数收益率×70%+中国债券总指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	蒋松云
	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	姜建清

### 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（2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	636,959,162.69
本期利润	640,733,976.54
加权平均基金份额本期利润	0.4563
本期加权平均净值利润率	38.60%
本期基金份额净值增长率	42.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	232,012,301.76
期末可供分配基金份额利润	0.4256
期末基金资产净值	777,141,790.23
期末基金份额净值	1.426
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	42.60%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-12.78%	3.47%	-8.80%	2.68%	-3.98%	0.79%
过去三个月	20.64%	2.83%	16.69%	2.06%	3.95%	0.77%
自基金合同生效起至今	42.60%	2.26%	37.81%	1.69%	4.79%	0.57%

注：本基金的业绩比较基准：中证全指工业指数收益率×70%+中国债券总指数收益率×30%。

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



注：本基金合同于 2015 年 1 月 26 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2015 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理七十只开放式基金，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。博时基金资产管理净值总规模逾 3027.86 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1317.35 亿元人民币，累计分红超过 664.83 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，标准股票型基金中，截至 6 月 30 日，博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在 379 只标准型股票基金中分别排名前 1/3 和前 1/2；博时深证基本面 200ETF 及联接基金今年以来的净值增长率在 175 只指数股票型基金-标准指数股票基金及 46 只 ETF 联接基金中分别排名前 1/2 和前 1/3；混合基金-偏股型基金中，博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型 36 只产品中排名前 1/3；混合基金-灵活配置型基金中，博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在 126 只同类型基金中分别排名前 1/3 和前 1/2。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债券今年以来收益率在 71 只同类长期标准债券型基金中分别排名前 1/10、前 1/2 和前 1/2；博时上证企债 30ETF 今年以来的收益率在 18 只指数债券型基金-指数债券型基金 (A 类) 排名前 1/3。

## 2、其他大事件

2015 年 1 月 7 日，博时基金在 2014 年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

2015 年 1 月 15 日，在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中，博时基金获评第十二届中国财经风云榜“年度十大品牌基金公司”奖。

2015 年 1 月 18 日，博时基金（香港）在和讯财经风云榜海外评选中荣获“最佳中资基金公司”奖。

2015 年 1 月 21 日，在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中，博时转债增强荣获第八届金蝉奖“2014 最佳年度债基品牌奖”。

2015 年 3 月 28 日，在第十二届中国基金业金牛奖评选中，博时主题行业（LOF）基金、博时信用债券基金分别获得“2014 年度开放式股票型金牛基金”奖、“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2015 年 3 月 28 日，在中金在线主办的“2014 年度财经排行榜”评选中，邓欣雨获评“2014 年度中金在线财经排行榜最佳基金经理”。

2015 年 4 月 22 日，由上海证券报社主办的第十二届中国“金基金”奖的评选揭晓，博时主题行业股票证券投资基金 (LOF) 获得 5 年期股票型金基金奖。

### 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		
蔡滨	基金经理	2015-01-26	-	8	2001 年起先后在上海振华职校、美国总统轮船（中国）有限公司、美国管理协会、平安证券工作。2009 年加入博时基金管理有限公司，历任研究部研究员、研究部副总经理兼资本品组组长。现任博时主题行业股票（LOF）基金兼博时产业新动力混合基金的基金经理。



## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基金自 1 月 26 日成立以来，贯彻产业新动力投资理念，持续从产业升级和改革转型方向挖掘优质标的。主要采取行业比较、精选个股的投资策略，积极把握了军工、工业 4.0、计算机、航空、互联网+等行业及主题机会。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.426 元，份额累计净值为 1.426 元，报告期内净值增长率为 42.60%，同期业绩基准涨幅为 37.81%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2015 年“稳增长+调结构” 宏观政策基调不会变化。下半年财政政策仍有望加码，CPI 将企稳回升，但预计对宽松的货币政策影响有限。市场大幅调整之后，估值风险得以一定释放，而资金杠杆带来的流动性风险也接受了压力测试。我们对市场持偏乐观看法，预计 A 股市场短期将震荡企稳，但行业以及个股表现分化有望加大。本基金仍将积极从产业升级和改革转型方向挖掘优质标的，此外随着经济企稳，行业供需改善明显的周期成长行业也具有较好的投资机会。感谢基金持有人的信任，我们将勤勉工作，严控风险并力争实现本

基金长期稳健增值。

#### 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、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对博时产业新动力灵活配置混合型发起式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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时产业新动力灵活配置混合型发起式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的真实、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产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金2015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：博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	54,676,452.85
结算备付金		6,184,167.07
存出保证金		935,007.74
交易性金融资产	6.4.7.2	657,936,773.98
其中：股票投资		657,936,773.98
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	114,500,000.00
应收证券清算款		34,205,506.14
应收利息	6.4.7.5	26,705.36
应收股利		-
应收申购款		2,999,736.53
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>871,464,349.67</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		-
短期借款		-

交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		89,497,074.78
应付管理人报酬		1,371,848.99
应付托管费		228,641.49
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	2,868,960.43
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	356,033.75
<b>负债合计</b>		<b>94,322,559.44</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	6.4.7.9	545,129,488.47
未分配利润	6.4.7.10	232,012,301.76
<b>所有者权益合计</b>		<b>777,141,790.23</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>871,464,349.67</b>

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.426 元，基金份额总额 545,129,488.47 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>661,813,531.46</b>
1. 利息收入		6,399,894.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,309,141.10
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,090,753.20
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		640,571,030.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	637,867,762.75
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	2,703,267.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.16	3,774,813.85

”号填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 17	11, 067, 792. 94
<b>减: 二、费用</b>		<b>21, 079, 554. 92</b>
1. 管理人报酬		10, 637, 250. 14
2. 托管费		1, 772, 875. 04
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	8, 481, 004. 94
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	188, 424. 80
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>640, 733, 976. 54</b>
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>640, 733, 976. 54</b>

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2015 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, 371, 474, 753. 32	-	2, 371, 474, 753. 32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	640, 733, 976. 54	640, 733, 976. 54
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)	-1, 826, 345, 264. 85	-408, 721, 674. 78	-2, 235, 066, 939. 63
其中: 1. 基金申购款	536, 671, 140. 79	168, 387, 066. 73	705, 058, 207. 52
2. 基金赎回款	-2, 363, 016, 405. 64	-577, 108, 741. 51	-2, 940, 125, 147. 15
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)	545, 129, 488. 47	232, 012, 301. 76	777, 141, 790. 23

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 基金基本情况

博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2014]251号《关于核准博时产业新动力灵活配置混合型发起式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《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集包括认购资金利息共募集 2,371,474,753.32 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(2015)第 069 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额(包括认购资金利息折算部分)为 2,371,474,753.32 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《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、权证、股指期货、债券(含中小企业私募债)、货币市场工具、中期票据、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例为基金资产的 0%-95%,其中投资于具备产业创新动力、引领制造业发展趋势的股票(以下简称“产业新动力股票”)比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金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,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中证全指工业指数收益率 $\times$ 70%+中国债券总指数收益率 $\times$ 30%。

### 6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年半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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 26 日至 2015 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 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；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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

除以下会计估计变更外，本报告期所采用的会计未发生变更：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

(3) 自2013年1月1日起，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，暂减按25%计入应纳税所得额。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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	54,676,452.85
定期存款	-
其他存款	-
合计	54,676,452.85

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	654,161,960.13	657,936,773.98	3,774,813.85
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	654,161,960.13	657,936,773.98	3,774,813.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所市场	114,500,000.00	-
合计	114,500,000.00	-

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	23,501.86
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	2,782.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	420.70
合计	26,705.36

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,868,960.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,868,960.43

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	181,680.35
其他应付款	-
预提费用	174,353.40
合计	356,033.75

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,371,474,753.32	2,371,474,753.32
本期申购	536,671,140.79	536,671,140.79
本期赎回（以“-”号填列）	-2,363,016,405.64	-2,363,016,405.64
本期末	545,129,488.47	545,129,488.47

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金自 2015 年 1 月 9 日至 2015 年 1 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,371,474,753.32 元。根据《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 342,894.83 元在本基金成立后，折算为 342,894.83 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 3 月 4 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回和转换业务自 2015 年 3 月 5 日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	636,959,162.69	3,774,813.85	640,733,976.54
本期基金份额交易产生的变动数	-259,648,743.20	-149,072,931.58	-408,721,674.78
其中：基金申购款	95,826,243.88	72,560,822.85	168,387,066.73
基金赎回款	-355,474,987.08	-221,633,754.43	-577,108,741.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	377,310,419.49	-145,298,117.73	232,012,301.76

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
活期存款利息收入	1,074,818.64
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	229,874.12
其他	4,448.34
合计	1,309,141.10

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
卖出股票成交总额	3,112,367,525.14
减：卖出股票成本总额	2,474,499,762.39
买卖股票差价收入	637,867,762.75

**6.4.7.13 债券投资收益**

无。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,703,267.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,703,267.62

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	3,774,813.85
——股票投资	3,774,813.85
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,774,813.85

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金赎回费收入	10,673,555.38
转换费收入	394,237.56
合计	11,067,792.94

注：对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期少于 3 个月的投资人收取的赎回费，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 个月的投资人收取的赎回费，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，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。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
交易所市场交易费用	8,481,004.94
银行间市场交易费用	0.00
合计	8,481,004.94

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
审计费用	36,705.24
信息披露费	137,648.16
银行间汇划费	14,071.40
合计	188,424.80

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,637,250.14
其中：支付销售机构的客户维护费	5,800,904.17

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。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,772,875.04

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。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

##### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

单位：份

项目	本期
	2015年1月26日（基金合同生效日）至 2015年6月30日
基金合同生效日（2015年1月26日）持有的基金份额	9,000,750.08
报告期初持有的基金份额	9,000,750.08
报告期间申购/买入总份额	
报告期间因拆分变动份额	



减：报告期间赎回/卖出总份额	
报告期末持有的基金份额	9,000,750.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%

#### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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 2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	54,676,452.85	1,074,818.64

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001696	宗申动力	2015-06-30	重大事项	17.25	2015-08-24	15.53	759,454.00	15,365,546.22	13,100,581.50	-
300291	华录百纳	2015-06-30	重大事项	37.76	2015-07-13	34.65	478,792.00	23,877,782.44	18,079,185.92	-
601111	中国国航	2015-06-30	非公开发行	15.36	2015-07-29	13.78	1,517,482.00	19,705,122.16	23,308,523.52	-
300195	长荣股份	2015-06-22	重大事项	28.35	2015-08-24	28.76	647,630.00	11,782,905.42	18,360,310.50	
300431	暴风科技	2015-06-11	重大事项	211.45	2015-07-13	276.80	20,205.00	144,263.70	4,272,347.25	
603898	好莱客	2015-06-15	重大事项	109.46	-	-	88,400.00	11,905,780.00	9,676,264.00	
合计								82,781,399.94	86,797,212.69	

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，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，将风险控制可在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 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，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，

违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等，其余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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2015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	54,676,452.85	-	-	-	54,676,452.85
结算备付金	6,184,167.07	-	-	-	6,184,167.07
存出保证金	935,007.74	-	-	-	935,007.74
交易性金融资产	-	-	-	657,936,773.98	657,936,773.98
买入返售金融资产	114,500,000.00	-	-	-	114,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	34,205,506.14	34,205,506.14
应收利息	-	-	-	26,705.36	26,705.36
应收申购款	-	-	-	2,999,736.53	2,999,736.53
<b>资产总计</b>	<b>176,295,627.66</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>695,168,722.01</b>	<b>871,464,349.67</b>
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	89,497,074.78	89,497,074.78
应付管理人报酬	-	-	-	1,371,848.99	1,371,848.99
应付托管费	-	-	-	228,641.49	228,641.49
应付交易费用	-	-	-	2,868,960.43	2,868,960.43
其他负债	-	-	-	356,033.75	356,033.75
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>94,322,559.44</b>	<b>94,322,559.44</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>176,295,627.66</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>600,846,162.57</b>	<b>777,141,790.23</b>

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 0%-35%。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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	657,936,773.98	84.66
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	-	-
<b>合计</b>	<b>657,936,773.98</b>	<b>84.66</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证全指工业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 2015 年 6 月 30 日
	中证全指工业指数下降 5%	减少约 3,147.00
中证全指工业指数上升 5%	增加约 3,147.00	

#### 6.4.14 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 2015 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 571,139,561.29 元，属于第二层级的余额为 86,797,212.69 元，无属于第三层级的余额。

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

(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 2015 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	657,936,773.98	75.50
	其中：股票	657,936,773.98	75.50
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	114,500,000.00	13.14
	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	60,860,619.92	6.98
7	其他各项资产	38,166,955.77	4.38
8	合计	871,464,349.67	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	33,089,214.50	4.26
B	采矿业	24,750.00	0.00
C	制造业	432,823,740.32	55.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	85,726,480.24	11.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,750,867.00	8.59
J	金融业	21,442,536.00	2.76
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	18,079,185.92	2.33
S	综合	-	-
	合计	657,936,773.98	84.66

## 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	000768	中航飞机	1,104,312	48,125,916.96	6.19
2	000910	大亚科技	2,680,930	45,629,428.60	5.87
3	600029	南方航空	3,129,668	45,505,372.72	5.86
4	300145	南方泵业	1,000,000	43,950,000.00	5.66
5	600151	航天机电	2,500,000	40,075,000.00	5.16
6	600570	恒生电子	339,091	37,995,146.55	4.89

7	603308	应流股份	1,088,380	31,824,231.20	4.10
8	600105	永鼎股份	1,186,723	27,009,815.48	3.48
9	000858	五粮液	788,700	25,001,790.00	3.22
10	002410	广联达	1,046,298	24,483,373.20	3.15
11	601111	中国国航	1,517,482	23,308,523.52	3.00
12	300159	新研股份	1,214,168	23,069,192.00	2.97
13	601169	北京银行	1,609,800	21,442,536.00	2.76
14	300195	长荣股份	647,630	18,360,310.50	2.36
15	002585	双星新材	1,079,140	18,129,552.00	2.33
16	300291	华录百纳	478,792	18,079,185.92	2.33
17	002456	欧菲光	534,100	18,020,534.00	2.32
18	002675	东诚药业	384,900	17,562,987.00	2.26
19	002299	圣农发展	834,227	16,934,808.10	2.18
20	601006	大秦铁路	1,204,600	16,912,584.00	2.18
21	002234	民和股份	1,017,280	16,154,406.40	2.08
22	002366	丹甫股份	200,000	14,676,000.00	1.89
23	002100	天康生物	1,200,000	14,052,000.00	1.81
24	001696	宗申动力	759,454	13,100,581.50	1.69
25	002174	游族网络	138,202	12,819,617.52	1.65
26	002111	威海广泰	363,034	11,740,519.56	1.51
27	603898	好莱客	88,400	9,676,264.00	1.25
28	300431	暴风科技	20,205	4,272,347.25	0.55
29	603979	金诚信	1,000	24,750.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	186,830,413.15	24.04
2	600029	南方航空	137,771,959.40	17.73
3	600570	恒生电子	112,793,743.38	14.51
4	600418	江淮汽车	99,195,773.42	12.76
5	002410	广联达	89,908,283.91	11.57
6	002081	金螳螂	84,537,819.79	10.88
7	000801	四川九洲	74,863,919.44	9.63
8	600688	上海石化	72,002,670.34	9.27
9	601688	华泰证券	69,462,038.89	8.94
10	601006	大秦铁路	68,245,481.61	8.78
11	000712	锦龙股份	65,750,675.33	8.46
12	002573	清新环境	62,453,747.74	8.04
13	300145	南方泵业	59,014,320.99	7.59
14	002009	天奇股份	58,504,854.16	7.53
15	300159	新研股份	56,038,859.84	7.21
16	600990	四创电子	54,498,634.82	7.01
17	600105	永鼎股份	50,880,834.62	6.55
18	000768	中航飞机	50,876,139.88	6.55
19	002407	多氟多	49,899,291.52	6.42
20	000523	广州浪奇	48,450,042.44	6.23



21	000550	江铃汽车	45,986,321.06	5.92
22	600566	济川药业	42,933,213.89	5.52
23	603766	隆鑫通用	41,429,406.71	5.33
24	002236	大华股份	41,429,152.06	5.33
25	002380	科远股份	40,125,621.77	5.16
26	300284	苏交科	39,625,855.42	5.10
27	300007	汉威电子	38,417,864.13	4.94
28	603308	应流股份	38,051,031.68	4.90
29	000078	海王生物	38,001,376.48	4.89
30	002375	亚厦股份	35,602,551.47	4.58
31	000910	大亚科技	35,223,474.79	4.53
32	601318	中国平安	34,537,317.00	4.44
33	002426	胜利精密	32,769,871.57	4.22
34	600151	航天机电	31,154,329.11	4.01
35	002253	川大智胜	30,395,351.60	3.91
36	002285	世联行	29,886,879.01	3.85
37	002396	星网锐捷	29,367,633.54	3.78
38	002234	民和股份	29,175,971.28	3.75
39	600115	东方航空	29,081,540.39	3.74
40	300408	三环集团	28,523,179.20	3.67
41	002111	威海广泰	26,205,836.70	3.37
42	002657	中科金财	24,303,477.62	3.13
43	601988	中国银行	24,122,035.00	3.10
44	300291	华录百纳	23,877,782.44	3.07
45	002653	海思科	23,685,183.69	3.05
46	002585	双星新材	23,672,417.87	3.05
47	000858	五粮液	23,408,337.50	3.01
48	002675	东诚药业	23,100,022.00	2.97
49	600805	悦达投资	22,369,552.01	2.88
50	300195	长荣股份	21,974,973.97	2.83
51	002456	欧菲光	21,255,775.00	2.74
52	601169	北京银行	20,890,152.00	2.69
53	002448	中原内配	20,319,471.20	2.61
54	002299	圣农发展	20,019,065.75	2.58
55	601111	中国国航	19,705,122.16	2.54
56	001696	宗申动力	19,570,503.49	2.52
57	002121	科陆电子	18,528,011.00	2.38
58	300059	东方财富	18,196,012.00	2.34
59	600497	驰宏锌锗	17,841,723.33	2.30
60	002174	游族网络	17,554,551.30	2.26
61	002100	天康生物	17,240,605.00	2.22
62	600138	中青旅	17,123,772.33	2.20
63	000028	国药一致	16,505,977.20	2.12
64	002366	丹甫股份	16,439,301.74	2.12
65	600823	世茂股份	16,245,347.74	2.09

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。

**7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	200,222,186.49	25.76
2	600029	南方航空	176,244,990.92	22.68
3	600688	上海石化	128,876,010.04	16.58
4	000801	四川九洲	117,262,987.23	15.09
5	600418	江淮汽车	115,319,634.61	14.84
6	002081	金螳螂	104,146,803.84	13.40
7	002009	天奇股份	89,872,118.75	11.56
8	600990	四创电子	89,135,431.39	11.47
9	002380	科远股份	88,011,407.98	11.33
10	000712	锦龙股份	82,489,816.51	10.61
11	600570	恒生电子	82,441,253.25	10.61
12	002573	清新环境	70,253,375.00	9.04
13	002410	广联达	64,986,445.81	8.36
14	000523	广州浪奇	64,381,509.74	8.28
15	601688	华泰证券	62,538,039.73	8.05
16	002236	大华股份	61,433,376.83	7.91
17	300284	苏交科	61,374,350.86	7.90
18	300007	汉威电子	59,989,566.78	7.72
19	000078	海王生物	56,919,652.21	7.32
20	600566	济川药业	56,406,874.86	7.26
21	601006	大秦铁路	55,150,095.17	7.10
22	603766	隆鑫通用	52,762,405.32	6.79
23	002285	世联行	48,987,941.93	6.30
24	002396	星网锐捷	46,529,888.78	5.99
25	000550	江铃汽车	46,520,754.90	5.99
26	002375	亚厦股份	45,976,144.72	5.92
27	002407	多氟多	45,141,420.25	5.81
28	300159	新研股份	41,486,080.78	5.34
29	300145	南方泵业	39,115,823.70	5.03
30	600115	东方航空	38,009,503.29	4.89
31	601318	中国平安	37,908,858.06	4.88
32	002426	胜利精密	37,714,585.66	4.85
33	300408	三环集团	37,050,404.40	4.77
34	002253	川大智胜	30,073,846.36	3.87
35	603019	中科曙光	27,434,162.20	3.53
36	002657	中科金财	24,741,086.60	3.18
37	300075	数字政通	22,649,549.70	2.91
38	600805	悦达投资	22,424,224.18	2.89
39	601988	中国银行	21,721,136.00	2.80
40	600823	世茂股份	20,495,482.54	2.64
41	002448	中原内配	19,119,451.00	2.46
42	300059	东方财富	18,835,430.28	2.42
43	002653	海思科	18,499,750.10	2.38
44	300195	长荣股份	18,484,771.41	2.38
45	002666	德联集团	16,796,671.70	2.16

46	300230	永利带业	16,625,994.60	2.14
47	600497	驰宏锌锗	16,467,052.30	2.12
48	000028	国药一致	16,077,139.00	2.07
49	002244	滨江集团	15,945,267.73	2.05
50	002121	科陆电子	15,746,838.79	2.03

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

#### 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	3,128,661,722.52
卖出股票的收入（成交）总额	3,112,367,525.14

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 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 报告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 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 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	935,007.74
2	应收证券清算款	34,205,506.14
3	应收股利	-
4	应收利息	26,705.36

5	应收申购款	2,999,736.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,166,955.77

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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
12,859	42,392.84	23,471,723.34	4.31%	521,657,765.13	95.69%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,375,496.85	0.25%

### 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

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；

### 8.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,000,750.08	1.65%	9,000,750.08	0.38%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	1,009,977.13	0.19%	1,009,977.13	0.04%	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,010,727.21	1.84%	10,010,727.21	0.42%	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 1 月 26 日）基金份额总额	2,371,474,753.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	536,671,140.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,363,016,405.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	545,129,488.47

## § 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

基金管理人重大人事变动：（1）基金管理人于 2015 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴姚东不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英代任总经理职务。（2）基金管理人于 2015 年 6 月 20 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫担任博时基金管理有限公司副总经理职务。（3）基金管理人于 2015 年 7 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳担任博时基金管理有限公司总经理职务。（4）基金管理人于 2015 年 8 月 8 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人，洪小源不再任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

基金托管人的基金托管部门的未发生重大人事变动。

### 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

2015 年 2 月，我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求公司对后台权限设置等问题进行改正，我司立即进行了改正并已经完成了验

收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 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	
中信建投	1	2,848,900,058.60	45.66%	2,023,864.98	43.42%	新增 1 个
华泰证券	2	2,013,954,513.05	32.28%	1,430,716.84	30.70%	新增 2 个
国信证券	1	593,024,936.53	9.50%	539,891.70	11.58%	新增 1 个
广发证券	2	227,846,705.74	3.65%	207,432.80	4.45%	新增 2 个
中信证券	1	221,962,022.43	3.56%	202,074.97	4.34%	新增 1 个
齐鲁证券	1	168,255,375.62	2.70%	119,530.85	2.56%	新增 1 个
平安证券	1	99,416,836.63	1.59%	90,508.21	1.94%	新增 1 个
宏源证券	1	65,937,949.06	1.06%	46,842.72	1.01%	新增 1 个
西部证券	1					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

中信建设	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	23,186,500,000.00	94.19%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	1,000,200,000.00	4.06%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	349,800,000.00	1.42%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	80,000,000.00	0.32%	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

### 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	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/30
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/27
3	博时基金管理有限公司关于参加数米基金销售有限公司认申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/27
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/26
5	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/25
6	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
7	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加上海好买基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/19
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/17
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/16
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/12
13	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/11
14	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/6
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/4
16	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/3
17	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/2
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/1

19	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/28
20	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/27
21	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/22
22	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/21
23	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/20
24	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/15
25	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/14
26	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/13
27	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/12
28	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/11
29	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/7
30	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/30
31	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/30
32	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司认、申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/25
33	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/23
34	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/14
35	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/13
36	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/11
37	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/9
38	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/3
39	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/2
40	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
41	关于博时旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
42	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/31
43	关于博时旗下部分开放式基金增加中国国际金融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	2015/3/26



44	博时基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/26
45	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/26
46	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/24
47	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/19
48	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/18
49	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/17
50	关于博时旗下部分开放式基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/14
51	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/14
52	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/11
53	关于博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构并参加其网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/10
54	关于博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金新增江苏张家港农村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	2015/3/6
55	关于中国工商银行股份有限公司开通办理博时旗下部分开放式基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/6
56	关于博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金开通直销网上交易定期投资业务和对直销网上投资者交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/5
57	博时基金管理有限公司关于博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金参加部分银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/5
58	博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的补充公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/4
59	博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常转换、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	2015/3/3
60	博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/3
61	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/3
62	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/27
63	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/17
64	博时基金管理有限公司关于暂停货币基金快速赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/14
65	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/12
66	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股	中国证券报、上海证	2015/2/10

	票调整估值方法的公告	券报、证券时报	
67	关于厦门市鑫鼎盛控股有限公司暂停代理博时旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/7
68	博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/27
69	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/23
70	关于博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金新增恒泰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	2015/1/20
71	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/20
72	公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17
73	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17
74	关于博时产业新动力混合基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/16
75	关于博时产业新动力混合基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/15

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证监会批准博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件

11.1.2 《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

11.1.3 《博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

11.1.5 报告期内博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 11.3 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  
二〇一五年八月二十七日