

博时特许价值股票型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	9
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	9
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	11
6.4 报表附注	12
§ 7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	26
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	39
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	39
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	39
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41

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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	44
§ 11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录	49
11.2 存放地点	49
11.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时特许价值股票型证券投资基金	
基金简称	博时特许价值股票	
基金主代码	050010	
交易代码	050010(前端)	051010(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 5 月 28 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	290,746,545.61 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于分享中国经济高速发展过程中那些具有政府壁垒优势、技术壁垒优势、市场与品牌壁垒优势的企业所带来的持续投资收益，为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金实行风险管理下的主动型价值投资策略，即采用以精选个股为核心的多层次复合投资策略。在战略上，强调自上而下的组合管理；在战术上，强调自下而上的精选个股。具体投资策略为：在资产配置和组合管理方面，利用金融工程手段和投资组合管理技术，保持组合流动性；在选股层面，按照价值投资原则，利用研究人员的专业研究能力和金融工程的财务数据处理能力，从品质过滤和价值精选两个阶段来精选个股，选择价值被低估且具有政府壁垒优势、技术壁垒优势、市场壁垒优势或者品牌壁垒优势等持续增长潜力的股票，作为构建股票组合的基础。本基金的投资策略具有三层结构，即自上而下的资产配置、自上而下的行业选择和自下而上的选股或选债策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于预期风险收益较高的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广东省深圳市福田区深南大道	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

	7088号招商银行大厦29层	
邮政编码	518040	100033
法定代表人	张光华	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金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1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	331,754,237.01
本期利润	216,019,648.84
加权平均基金份额本期利润	0.4399
本期加权平均净值利润率	27.94%
本期基金份额净值增长率	26.41%
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	225,002,515.45
期末可供分配基金份额利润	0.7739
期末基金资产净值	515,749,061.06
期末基金份额净值	1.774
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	147.16%

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交易基金的各项费用，计入费用后持有人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.06%	3.13%	-5.88%	2.80%	1.82%	0.33%
过去三个月	13.21%	2.41%	9.11%	2.09%	4.10%	0.32%
过去六个月	26.41%	2.15%	21.98%	1.81%	4.43%	0.34%
过去一年	109.52%	1.75%	82.58%	1.47%	26.94%	0.28%
过去三年	88.74%	1.42%	67.10%	1.19%	21.64%	0.23%

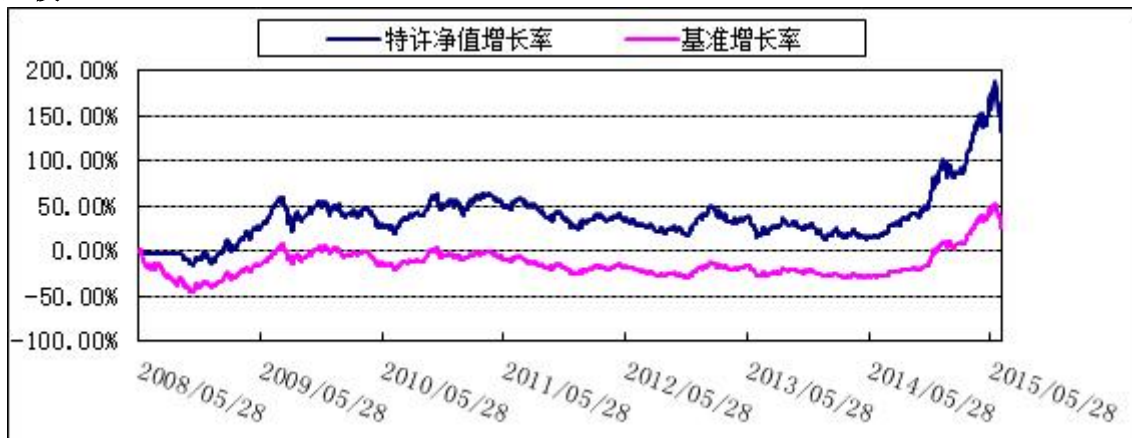
自基金合同生效起至今	147.16%	1.41%	32.78%	1.40%	114.38%	0.01%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率

×80%+中国债券总指数收益率×20%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



§ 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		
黄瑞庆	股票投资部量化投资组投资总监/基金经理	2015-02-09	-	13	2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）。现任股票投资部量化投资组投资总监兼博时价值增长混合基金、博时价值增长贰号混合基金、博时特许价值股票基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2013-09-13	2015-02-09	5	2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金、博时证券保险指数分级基金基金经理

黄瑞庆	量化投资组投资总监兼基金经理	2013-9-1	2015-2-9	4	2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）。现任股票投资部量化投资组投资总监兼博时价值增长混合基金、博时价值增长贰号混合基金、博时特许价值股票基金的基金经理。
冯春远	基金经理助理	2015-3-16		3	2012 年起曾在中山证券工作。2013 年加入博时基金，现任股票投资部基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、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

2015 年上半年 A 股市场波动性显著增加，前 5 个月以创业板为代表的小盘股大幅领先以沪深 300 为代表的大盘股。6 月份开始，市场出现系统性下跌，小盘主题板块回调显著重于大盘蓝筹，市场结构分化从极端的小盘行情向大盘蓝筹风格转变。

本基金始终坚持价值投资理念，并通过量化多策略体系充分挖掘和利用市场规律，努力把握各类风格的变化，力争平稳超越沪深 300 指数。本基金在价值风险上的暴露使得总体表现落后于沪深 300，在五、六月份通过若干动量策略的配置增加，结合期间市场动量-反转特征显著，获取了一定的超额收益。

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 1.774 元，累计份额净值为 2.214 元，报告期内净值增长率为 26.41%，同期业绩基准涨幅为 21.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年上半年宏观经济持续下滑，短期利率也大幅度下降，在货币整体偏向于宽松的背景下，投资者的投资情绪高涨，并在短期内大幅度推升了中高估值股票的价格，6 月份的大跌使得悲观情绪集中释放，部分杠杆资金退出市场，投资者观望情绪渐浓。长期来看，2015 年改革红利将逐步体现到市场上，市场参与者可能对对国企改革信心将逐渐树立，预计股票市场的估值体系将会得以修正。低估值的大盘蓝筹股有望在未来一两个季度乃至两三年内有较好的表现，而目前估值水平较高的多数小盘股在未来相当长的时间框架里维持高位震荡、滞涨或者下跌。

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

本基金管理人已于 2015 年 1 月 16 日发布公告，以 2014 年 12 月 31 日可分配利润为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.950 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 47,905,739.82 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时特许价值股票型证券投资基金

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	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	37,898,350.24	25,176,388.73
结算备付金		3,432,599.84	1,553,308.99
存出保证金		458,679.71	139,439.43
交易性金融资产	6.4.3.2	484,398,973.24	533,914,197.64
其中：股票投资		484,345,208.54	524,066,923.84
基金投资		-	-
债券投资		53,764.70	9,847,273.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		11,497,930.37	-
应收利息	6.4.3.5	10,386.76	56,088.10
应收股利		-	-
应收申购款		8,051,501.12	23,878,849.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		545,748,421.28	584,718,272.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,540,269.86	-
应付赎回款		22,016,698.37	7,533,420.68
应付管理人报酬		740,805.22	640,197.53
应付托管费		123,467.54	106,699.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	1,974,913.05	958,979.30

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	603,206.18	325,574.17
负债合计		29,999,360.22	9,564,871.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	290,746,545.61	382,151,791.32
未分配利润	6.4.3.10	225,002,515.45	193,001,610.26
所有者权益合计		515,749,061.06	575,153,401.58
负债和所有者权益总计		545,748,421.28	584,718,272.87

注：报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.774 元，基金份额总额 290,746,545.61 份。

6.2 利润表

会计主体：博时特许价值股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 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 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		231,743,988.00	-13,118,285.92
1. 利息收入		332,351.59	148,333.05
其中：存款利息收入	6.4.3.11	274,974.40	101,126.70
债券利息收入		57,377.19	47,206.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		345,471,451.33	-18,790,739.55
其中：股票投资收益	6.4.3.12	341,404,869.58	-23,154,765.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-473,309.84	-20,478.44
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	4,539,891.59	4,384,503.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-115,734,588.17	5,403,356.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	1,674,773.25	120,763.78
减：二、费用		15,724,339.16	7,532,836.41
1. 管理人报酬		5,745,681.11	3,226,910.32
2. 托管费		957,613.52	537,818.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	8,797,444.62	3,575,215.22
5. 利息支出		23,147.09	-
其中：卖出回购金融资产支出		23,147.09	-

6. 其他费用	6.4.3.19	200,452.82	192,892.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		216,019,648.84	-20,651,122.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		216,019,648.84	-20,651,122.33

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时特许价值股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	382,151,791.32	193,001,610.26	575,153,401.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	216,019,648.84	216,019,648.84
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）	-91,405,245.71	-136,113,003.83	-227,518,249.54
其中：1. 基金申购款	883,615,964.54	458,920,982.63	1,342,536,947.17
2. 基金赎回款	-975,021,210.25	-595,033,986.46	-1,570,055,196.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-47,905,739.82	-47,905,739.82
五、期末所有者权益（基金净值）	290,746,545.61	225,002,515.45	515,749,061.06
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	576,546,202.29	-30,795,350.17	545,750,852.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,651,122.33	-20,651,122.33
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）	-156,149,555.26	12,627,448.26	-143,522,107.00
其中：1. 基金申购款	22,675,732.73	-2,071,477.04	20,604,255.69
2. 基金赎回款	-178,825,287.99	14,698,925.30	-164,126,362.69
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）	420,396,647.03	-38,819,024.24	381,577,622.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

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

除以下会计估计变更外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致：

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。

6.4.2 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	37,898,350.24
定期存款	-
其他存款	-
合计	37,898,350.24

6.4.3.2 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		486,291,595.12	484,345,208.54	-1,946,386.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	37,000.00	53,764.70	16,764.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	37,000.00	53,764.70	16,764.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		486,328,595.12	484,398,973.24	-1,929,621.88

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 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	8,632.68
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,544.60
应收债券利息	3.08
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	206.40
合计	10,386.76

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 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	1,974,913.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,974,913.05

6.4.3.8 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	250,000.00
应付赎回费	179,645.28

其他应付款	-
预提费用	173,560.90
合计	603,206.18

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	382,151,791.32	382,151,791.32
本期申购	883,615,964.54	883,615,964.54
本期赎回（以“-”号填列）	-975,021,210.25	-975,021,210.25
本期末	290,746,545.61	290,746,545.61

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,956,261.96	133,045,348.30	193,001,610.26
本期利润	331,754,237.01	-115,734,588.17	216,019,648.84
本期基金份额交易产生的变动数	-108,521,586.14	-27,591,417.69	-136,113,003.83
其中：基金申购款	195,955,362.94	262,965,619.69	458,920,982.63
基金赎回款	-304,476,949.08	-290,557,037.38	-595,033,986.46
本期已分配利润	-47,905,739.82	-	-47,905,739.82
本期末	235,283,173.01	-10,280,657.56	225,002,515.45

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	206,601.95
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	42,493.99
其他	25,878.46
合计	274,974.40

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	3,186,105,254.58
减：卖出股票成本总额	2,844,700,385.00
买卖股票差价收入	341,404,869.58

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券、债券到期兑付成交总额	27,872,294.50

减：卖出债券、债券到期兑付成本总额	27,894,414.32
减：应收利息总额	451,190.02
买卖债券差价收入	-473,309.84

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,539,891.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,539,891.59

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-115,734,588.17
——股票投资	-114,418,364.04
——债券投资	-1,316,224.13
——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	-115,734,588.17

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,526,618.31
转换费收入	148,154.94
合计	1,674,773.25

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	8,797,444.62
银行间市场交易费用	0.00
合计	8,797,444.62

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行费用	17,891.92
银行间账户服务费	9,000.00
合计	200,452.82

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

基金管理人于 2015 年 8 月 7 日对外发布了《博时基金管理有限公司关于变更博时主题行业股票证券投资基金等基金基金名称及修改基金合同和托管协议的公告》，博时特许价值股票型证券投资基金更名为博时特许价值混合型证券投资基金，具体内容请详见《博时基金管理有限公司关于变更博时主题行业股票证券投资基金等基金基金名称及修改基金合同和托管协议的公告》。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,745,681.11	3,226,910.32
其中：支付销售机构的客户维护费	902,951.99	539,374.52

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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	957,613.52	537,818.27

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

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	37,898,350.24	206,601.95	19,677,030.96	83,978.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红 数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
1	2015-01-20	2015-01-20	0.950	32,080,284.70	15,825,455.12	47,905,739.82	-
合计	-	-	0.950	32,080,284.70	15,825,455.12	47,905,739.82	-

6.4.8 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 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	停牌原	期末	复牌	复牌开	数量(股)	期末	期末	备
----	----	----	-----	----	----	-----	-------	----	----	---

代码	名称	日期	因	估值 单价	日期	盘单价		成本总额	估值总额	注
000066	长城电脑	2015-6-18	公告重 大事项	16.84	未知	-	100	747.03	1,684.00	-
000429	粤高速	2015-4-08	公告重 大事项	6.42	2015-7-22	7.06	19,600	98,774.59	125,832.00	-
000543	皖能电力	2015-6-15	公告重 大事项	21.36	2015-7-14	19.22	1,000	14,010.00	21,360.00	-
000558	莱茵置业	2015-6-15	公告重 大事项	32.80	2015-7-13 2015-7-13	29.52 29.52	1,053	5,355.12	34,538.40	-
000567	海德股份	2015-6-17	公告重 大事项	33.71	2015-8-06	30.34	14,900	505,390.44	502,279.00	-
000608	阳光股份	2015-5-25	公告重 大事项	8.23	2015-8-21	7.41	47,214	214,908.79	388,571.22	-
000630	铜陵有色	2015-3-09	公告重 大事项	10.32	未知	-	12,600	104,604.00	130,032.00	-
000708	大冶特钢	2015-5-13	公告重 大事项	13.92	未知	-	9,100	96,344.29	126,672.00	-
000709	河北钢铁	2015-6-30	公告重 大事项	7.00	2015-8-24	6.30	144,555	782,107.83	1,011,885.00	-
000732	泰禾集团	2015-6-25	公告重 大事项	34.20	2015-7-02	30.78	6,200	146,725.73	212,040.00	-
000737	南风化工	2015-6-11	公告重 大事项	11.66	2015-7-21	10.49	500	3,234.49	5,830.00	-
000778	新兴铸管	2015-6-15	公告重 大事项	10.16	未知	-	82,400	519,277.92	837,184.00	-
000786	北新建材	2015-4-10	公告重 大事项	19.08	未知	-	54,200	716,849.57	1,034,136.00	-
000793	华闻传媒	2015-5-26	公告重 大事项	20.75	未知	-	77,900	1,220,510.02	1,616,425.00	-
000818	方大化工	2015-6-08	公告重 大事项	14.19	未知	-	1,300	6,763.61	18,447.00	-
000850	华茂股份	2015-5-07	公告重 大事项	10.98	未知	-	100	835.00	1,098.00	-
000862	银星能源	2015-5-21	公告重 大事项	11.81	2015-8-18	11.22	400	4,076.00	4,724.00	-
000878	云南铜业	2015-6-08	公告重 大事项	24.50	未知	-	2,694	38,245.52	66,003.00	-
000887	中鼎股份	2015-6-30	公告重 大事项	24.75	未知	-	4,700	121,704.71	116,325.00	-
000892	*ST 星美	2015-4-17	公告重 大事项	11.32	未知	-	400	3,561.00	4,528.00	-
000932	华菱钢铁	2015-5-14	公告重 大事项	4.71	2015-7-16	4.24	91,500	419,678.34	430,965.00	-
000959	首钢股份	2015-4-23	公告重 大事项	6.15	未知	-	72,532	292,752.69	446,071.80	-
000963	华东医药	2015-6-26	公告重 大事项	62.50	2015-8-05	69.20	25,800	1,662,777.02	1,612,500.00	-
002001	新和成	2015-6-30	公告重	17.09			24,300	655,594.46	415,287.00	-

			大事项		2015-7-13	18.49				
002002	鸿达兴业	2015-6-18	公告重 大事项	39.30	未知	-	2,300	33,120.13	90,390.00	-
002003	伟星股份	2015-6-05	公告重 大事项	16.17	未知	-	240	2,403.20	3,880.80	-
002045	国光电器	2015-6-01	公告重 大事项	13.92	2015-7-14	12.53	300	2,562.00	4,176.00	-
002080	中材科技	2015-4-21	公告重 大事项	22.79	未知	-	10,800	175,882.16	246,132.00	-
002110	三钢闽光	2015-4-02	公告重 大事项	9.61	未知	-	169,086	1,420,346.80	1,624,916.46	-
002116	中国海诚	2015-4-23	公告重 大事项	19.21	2015-7-24	21.13	1,169	17,306.35	22,456.49	-
002143	印纪传媒	2015-6-30	公告重 大事项	32.01	2015-7-01	33.50	7,400	259,835.00	236,874.00	-
002191	劲嘉股份	2015-6-18	公告重 大事项	19.22	未知	-	37,874	285,696.11	727,938.28	-
002203	海亮股份	2015-4-27	公告重 大事项	12.71	未知	-	89,100	894,406.91	1,132,461.00	-
002268	卫士通	2015-5-08	公告重 大事项	80.14	2015-8-04	76.32	9,200	551,118.00	737,288.00	-
002292	奥飞动漫	2015-5-18	公告重 大事项	37.29	未知	-	67,200	1,540,631.69	2,505,888.00	-
002310	东方园林	2015-5-27	公告重 大事项	38.30	未知	-	39,700	1,028,121.00	1,520,510.00	-
002367	康利电梯	2015-6-02	公告重 大事项	20.90	未知	-	16,700	257,749.82	349,030.00	-
002416	爱施德	2015-5-05	公告重 大事项	20.67	2015-7-29	18.60	7,700	136,647.80	159,159.00	-
002557	洽洽食品	2015-6-29	公告重 大事项	16.38	2015-8-24	14.74	3,253	43,419.24	53,284.14	-
002639	雪人股份	2015-6-30	公告重 大事项	38.30	2015-8-20	34.47	45,400	1,832,892.09	1,738,820.00	-
002662	京威股份	2015-5-15	公告重 大事项	17.84	2015-8-13	16.06	61,800	1,129,830.35	1,102,512.00	-
002668	奥马电器	2015-6-29	公告重 大事项	29.04	2015-7-21	26.14	12,800	447,986.61	371,712.00	-
300071	华谊嘉信	2015-5-21	公告重 大事项	13.66	未知	-	360	3,427.00	4,917.60	-
300084	海默科技	2015-6-03	公告重 大事项	21.43	2015-7-20	19.29	121,341	2,538,651.52	2,600,337.63	-
300188	美亚柏科	2015-5-14	公告重 大事项	37.15	2015-8-21	33.44	6,200	138,557.13	230,330.00	-
300190	维尔利	2015-5-25	公告重 大事项	34.34	未知	-	9,200	221,926.31	315,928.00	-
300195	长荣股份	2015-6-22	公告重 大事项	28.35	2015-8-24	28.76	12,400	508,229.00	351,540.00	-
300249	依米康	2015-5-29	公告重 大事项	28.78	2015-8-17	31.50	9,100	257,294.00	261,898.00	-

300266	兴源环境	2015-6-03	公告重大事项	55.23	未知	-	9,500	533,900.00	524,685.00	-
300278	华昌达	2015-3-30	公告重大事项	23.43	未知	-	4,000	89,020.41	93,720.00	-
600053	中江地产	2015-3-23	公告重大事项	13.14	未知	-	800	9,512.00	10,512.00	-
600153	建发股份	2015-6-30	公告重大事项	17.51	未知	-	173,281	1,594,253.29	3,034,150.31	-
600167	联美控股	2015-6-27	公告重大事项	25.76	未知	-	55,000	1,420,735.00	1,416,800.00	-
600202	哈空调	2015-6-16	公告重大事项	18.86	未知	-	200	1,726.00	3,772.00	-
600258	首旅酒店	2015-3-17	公告重大事项	18.55	未知	-	100	1,859.00	1,855.00	-
600277	亿利能源	2015-6-01	公告重大事项	14.62	未知	-	102,100	1,146,055.82	1,492,702.00	-
600335	国机汽车	2015-6-15	公告重大事项	27.61	2015-7-21	34.14	12,647	284,388.94	349,183.67	-
600461	洪城水业	2015-2-27	公告重大事项	13.10	未知	-	43,500	517,650.00	569,850.00	-
600531	豫光金铅	2015-6-11	公告重大事项	20.87	2015-7-03	24.78	24,300	610,968.99	507,141.00	-
600561	江西长运	2015-5-04	公告重大事项	19.48	2015-8-20	17.36	200	3,029.28	3,896.00	-
600641	万业企业	2015-6-12	公告重大事项	11.23	未知	-	10,500	84,430.40	117,915.00	-
600900	长江电力	2015-6-15	公告重大事项	14.35	未知	-	46,900	578,998.07	673,015.00	-
601111	中国国航	2015-6-30	公告重大事项	15.36	2015-7-29	13.78	104,200	1,135,389.74	1,600,512.00	-
601633	长城汽车	2015-6-19	公告重大事项	36.69	2015-7-13	38.50	15,200	783,921.11	557,688.00	-
601877	正泰电器	2015-5-19	公告重大事项	30.62	未知	-	12,695	350,848.62	388,720.90	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于较高风险品种，预期风险和预期收益均高于债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性

风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现为基金持有人获取长期持续稳定的投资回报的投资目标。

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。

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 06 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.01% (2014 年 12 月 31 日：1.64%)。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期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，因此除附注 6.4.8.2 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2015 年 06 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。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及债券投资等，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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 06 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	37,898,350.24	-	-	-	37,898,350.24
结算备付金	3,432,599.84	-	-	-	3,432,599.84
存出保证金	458,679.71	-	-	-	458,679.71
交易性金融资产	-	-	53,764.70	484,345,208.54	484,398,973.24
应收证券清算款	-	-	-	11,497,930.37	11,497,930.37
应收利息	-	-	-	10,386.76	10,386.76
应收申购款	-	-	-	8,051,501.12	8,051,501.12
资产总计	41,789,629.79	-	53,764.70	503,905,026.79	545,748,421.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,540,269.86	4,540,269.86
应付赎回款	-	-	-	22,016,698.37	22,016,698.37
应付管理人报酬	-	-	-	740,805.22	740,805.22
应付托管费	-	-	-	123,467.54	123,467.54
应付交易费用	-	-	-	1,974,913.05	1,974,913.05
其他负债	-	-	-	603,206.18	603,206.18
负债总计	-	-	-	29,999,360.22	29,999,360.22

利率敏感度缺口	41,789,629.79	-	53,764.70	473,905,666.57	515,749,061.06
上年度末 2014年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,176,388.73	-	-	-	25,176,388.73
结算备付金	1,553,308.99	-	-	-	1,553,308.99
存出保证金	139,439.43	-	-	-	139,439.43
交易性金融资产	441,063.30	9,226,440.00	179,770.50	524,066,923.84	533,914,197.64
应收利息	-	-	-	56,088.10	56,088.10
应收申购款	-	-	-	23,878,849.98	23,878,849.98
资产总计	27,310,200.45	9,226,440.00	179,770.50	548,001,861.92	584,718,272.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,533,420.68	7,533,420.68
应付管理人报酬	-	-	-	640,197.53	640,197.53
应付托管费	-	-	-	106,699.61	106,699.61
应付交易费用	-	-	-	958,979.30	958,979.30
其他负债	-	-	-	325,574.17	325,574.17
负债总计	-	-	-	9,564,871.29	9,564,871.29
利率敏感度缺口	27,310,200.45	9,226,440.00	179,770.50	538,436,990.63	575,153,401.58

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01% (2014 年 12 月 31 日：1.71%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 06 月 30 日		上年度末 2014 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	484,345,208.54	93.91	524,066,923.84	91.12
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	484,345,208.54	93.91	524,066,923.84	91.12

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元)	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	沪深300指数下降5%	减少约2,425	减少约2,902
沪深300指数上升5%	增加约2,425	增加约2,902	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

不以公允价值计量的金融工具

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

(a) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

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

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

(ii) 各层级金融工具公允价值

于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

447,442,293.84元，属于第二层级的余额为36,902,914.70元，无属于第三层级的余额(2014年12月31日：第一层级526,469,350.68元，第二层级7,444,846.96元，无第三层级)。于2015年6月30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负债均属于第一层次(2014年12月31日：同)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级还是第三层级。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，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	484,345,208.54	88.75
	其中：股票	484,345,208.54	88.75
2	固定收益投资	53,764.70	0.01
	其中：债券	53,764.70	0.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	41,330,950.08	7.57
7	其他各项资产	20,018,497.96	3.67
8	合计	545,748,421.28	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	2,589,918.00	0.50
B	采矿业	18,676,866.38	3.62
C	制造业	132,609,801.92	25.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,131,855.00	1.58
E	建筑业	18,872,653.80	3.66
F	批发和零售业	13,783,736.34	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	14,391,046.30	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,980,521.60	2.13
J	金融业	235,379,830.82	45.64
K	房地产业	15,740,345.22	3.05
L	租赁和商务服务业	2,266,048.60	0.44
M	科学研究和技术服务业	88,756.49	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,308,425.20	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	529,999.54	0.10
R	文化、体育和娱乐业	8,576,669.33	1.66
S	综合	418,734.00	0.08
	合计	484,345,208.54	93.91

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	600016	民生银行	2,661,876	26,459,047.44	5.13
2	601166	兴业银行	1,520,853	26,234,714.25	5.09
3	601318	中国平安	312,200	25,581,668.00	4.96
4	601398	工商银行	4,079,900	21,541,872.00	4.18
5	601288	农业银行	4,706,640	17,461,634.40	3.39
6	601998	中信银行	2,110,300	16,270,413.00	3.15
7	002142	宁波银行	670,250	14,175,787.50	2.75
8	600000	浦发银行	621,956	10,548,373.76	2.05
9	600837	海通证券	475,600	10,368,080.00	2.01
10	601601	中国太保	283,493	8,555,818.74	1.66
11	601628	中国人寿	234,800	7,353,936.00	1.43
12	601328	交通银行	878,900	7,242,136.00	1.40

13	601668	中国建筑	829,528	6,893,377.68	1.34
14	600893	中航动力	113,851	6,051,180.65	1.17
15	600048	保利地产	523,383	5,977,033.86	1.16
16	601169	北京银行	445,300	5,931,396.00	1.15
17	601818	光大银行	1,094,431	5,866,150.16	1.14
18	601988	中国银行	1,064,200	5,203,938.00	1.01
19	600519	贵州茅台	19,767	5,092,967.55	0.99
20	601766	中国中车	276,540	5,077,274.40	0.98
21	601688	华泰证券	205,000	4,741,650.00	0.92
22	601006	大秦铁路	303,293	4,258,233.72	0.83
23	600887	伊利股份	211,560	3,998,484.00	0.78
24	600015	华夏银行	244,852	3,724,198.92	0.72
25	601390	中国中铁	256,000	3,504,640.00	0.68
26	600028	中国石化	494,500	3,491,170.00	0.68
27	600637	东方明珠	79,000	3,324,320.00	0.64
28	601788	光大证券	114,700	3,091,165.00	0.60
29	600153	建发股份	173,281	3,034,150.31	0.59
30	601857	中国石油	244,600	2,771,318.00	0.54
31	600104	上汽集团	119,438	2,699,298.80	0.52
32	600518	康美药业	147,800	2,620,494.00	0.51
33	300084	海默科技	121,341	2,600,337.63	0.50
34	600741	华域汽车	121,485	2,593,704.75	0.50
35	002292	奥飞动漫	67,200	2,505,888.00	0.49
36	601901	方正证券	204,500	2,431,505.00	0.47
37	000776	广发证券	103,507	2,344,433.55	0.45
38	600690	青岛海尔	75,500	2,289,915.00	0.44
39	600010	包钢股份	427,800	2,220,282.00	0.43
40	600050	中国联通	300,500	2,202,665.00	0.43
41	600150	中国船舶	41,900	2,157,850.00	0.42
42	600585	海螺水泥	100,353	2,152,571.85	0.42
43	601186	中国铁建	125,300	1,958,439.00	0.38
44	601088	中国神华	93,114	1,941,426.90	0.38
45	600276	恒瑞医药	42,290	1,883,596.60	0.37
46	000001	平安银行	123,768	1,799,586.72	0.35
47	002639	雪人股份	45,400	1,738,820.00	0.34
48	600019	宝钢股份	187,800	1,641,372.00	0.32
49	600739	辽宁成大	66,478	1,625,387.10	0.32
50	002110	三钢闽光	169,086	1,624,916.46	0.32
51	000793	华闻传媒	77,900	1,616,425.00	0.31
52	000963	华东医药	25,800	1,612,500.00	0.31
53	601111	中国国航	104,200	1,600,512.00	0.31
54	600111	北方稀土	85,300	1,547,342.00	0.30
55	002304	洋河股份	22,220	1,541,179.20	0.30
56	002310	东方园林	39,700	1,520,510.00	0.29
57	600029	南方航空	104,200	1,515,068.00	0.29
58	000703	恒逸石化	118,400	1,510,784.00	0.29
59	600277	亿利能源	102,100	1,492,702.00	0.29
60	000728	国元证券	39,100	1,485,018.00	0.29
61	600167	联美控股	55,000	1,416,800.00	0.27
62	600089	特变电工	95,148	1,409,141.88	0.27

63	300032	金龙机电	40,500	1,389,960.00	0.27
64	601800	中国交建	78,826	1,384,184.56	0.27
65	601009	南京银行	59,700	1,361,160.00	0.26
66	600011	华能国际	95,800	1,344,074.00	0.26
67	600115	东方航空	104,300	1,284,976.00	0.25
68	600583	海油工程	75,800	1,262,828.00	0.24
69	300157	恒泰艾普	83,007	1,227,673.53	0.24
70	600823	世茂股份	91,467	1,191,815.01	0.23
71	000060	中金岭南	63,060	1,172,285.40	0.23
72	002203	海亮股份	89,100	1,132,461.00	0.22
73	600256	广汇能源	108,000	1,123,200.00	0.22
74	002039	黔源电力	53,950	1,115,686.00	0.22
75	601677	明泰铝业	67,851	1,110,720.87	0.22
76	002662	京威股份	61,800	1,102,512.00	0.21
77	600406	国电南瑞	52,500	1,086,225.00	0.21
78	600356	恒丰纸业	93,300	1,052,424.00	0.20
79	000869	张裕 A	21,480	1,048,009.20	0.20
80	002321	华英农业	85,000	1,043,800.00	0.20
81	000786	北新建材	54,200	1,034,136.00	0.20
82	601919	中国远洋	82,600	1,030,848.00	0.20
83	000625	长安汽车	48,000	1,015,200.00	0.20
84	000623	吉林敖东	30,200	1,014,720.00	0.20
85	000709	河北钢铁	144,555	1,011,885.00	0.20
86	600018	上港集团	127,002	1,004,585.82	0.19
87	000639	西王食品	42,600	973,410.00	0.19
88	600466	蓝光发展	72,003	958,359.93	0.19
89	600398	海澜之家	52,700	955,451.00	0.19
90	000333	美的集团	25,600	954,368.00	0.19
91	601618	中国中冶	131,079	947,701.17	0.18
92	600697	欧亚集团	30,137	933,644.26	0.18
93	300033	同花顺	10,600	911,494.00	0.18
94	000858	五粮液	28,300	897,110.00	0.17
95	600612	老凤祥	16,600	888,764.00	0.17
96	600005	武钢股份	124,800	877,344.00	0.17
97	002252	上海莱士	13,300	870,352.00	0.17
98	600827	百联股份	41,300	859,453.00	0.17
99	600383	金地集团	67,900	858,935.00	0.17
100	601607	上海医药	38,200	850,714.00	0.16
101	000778	新兴铸管	82,400	837,184.00	0.16
102	002300	太阳电缆	71,600	826,264.00	0.16
103	300283	温州宏丰	59,382	823,628.34	0.16
104	600271	航天信息	12,700	821,817.00	0.16
105	000999	华润三九	27,000	820,530.00	0.16
106	000686	东北证券	41,400	806,058.00	0.16
107	600475	华光股份	39,600	805,860.00	0.16
108	002241	歌尔声学	22,400	804,160.00	0.16
109	600369	西南证券	40,800	801,720.00	0.16
110	601106	中国一重	65,900	798,049.00	0.15
111	600376	首开股份	40,900	788,961.00	0.15
112	002099	海翔药业	30,100	783,202.00	0.15

113	600660	福耀玻璃	54,700	781,116.00	0.15
114	002324	普利特	22,400	777,280.00	0.15
115	600208	新潮中宝	99,400	767,368.00	0.15
116	600663	陆家嘴	15,400	765,996.00	0.15
117	601098	中南传媒	33,243	761,597.13	0.15
118	601555	东吴证券	36,600	749,202.00	0.15
119	600839	四川长虹	76,100	748,824.00	0.15
120	600703	三安光电	23,900	748,070.00	0.15
121	600683	京投银泰	63,500	747,395.00	0.14
122	600705	中航资本	32,200	745,430.00	0.14
123	002268	卫士通	9,200	737,288.00	0.14
124	600316	洪都航空	21,300	736,554.00	0.14
125	600196	复星医药	25,267	731,226.98	0.14
126	000063	中兴通讯	30,600	728,586.00	0.14
127	002191	劲嘉股份	37,874	727,938.28	0.14
128	002465	海格通信	22,600	727,494.00	0.14
129	600009	上海机场	22,718	720,160.60	0.14
130	600221	海南航空	110,300	704,817.00	0.14
131	600633	浙报传媒	35,700	699,720.00	0.14
132	600352	浙江龙盛	48,900	692,913.00	0.13
133	600415	小商品城	45,100	689,128.00	0.13
134	600804	鹏博士	22,700	677,822.00	0.13
135	600785	新华百货	30,900	676,401.00	0.13
136	600900	长江电力	46,900	673,015.00	0.13
137	002065	东华软件	23,200	667,000.00	0.13
138	600863	内蒙华电	79,200	647,856.00	0.13
139	600218	全柴动力	44,997	642,557.16	0.12
140	600873	梅花生物	61,094	637,821.36	0.12
141	600118	中国卫星	11,000	626,560.00	0.12
142	600588	用友网络	13,540	621,215.20	0.12
143	600289	亿阳信通	30,100	599,893.00	0.12
144	600525	长园集团	29,100	598,587.00	0.12
145	600085	同仁堂	16,600	596,106.00	0.12
146	601808	中海油服	21,128	590,316.32	0.11
147	300042	朗科科技	22,200	582,528.00	0.11
148	002470	金正大	26,300	570,973.00	0.11
149	600461	洪城水业	43,500	569,850.00	0.11
150	000883	湖北能源	65,300	569,416.00	0.11
151	000800	一汽轿车	22,700	564,776.00	0.11
152	600252	中恒集团	24,400	561,200.00	0.11
153	601633	长城汽车	15,200	557,688.00	0.11
154	600867	通化东宝	25,330	555,486.90	0.11
155	000836	鑫茂科技	32,600	553,222.00	0.11
156	000983	西山煤电	58,000	549,840.00	0.11
157	000876	新希望	28,300	549,303.00	0.11
158	600030	中信证券	20,400	548,964.00	0.11
159	600332	白云山	15,890	547,569.40	0.11
160	000581	威孚高科	17,500	542,325.00	0.11
161	002399	海普瑞	15,900	540,441.00	0.10
162	000423	东阿阿胶	9,900	539,550.00	0.10

163	000826	桑德环境	13,800	536,682.00	0.10
164	600088	中视传媒	16,600	535,682.00	0.10
165	300003	乐普医疗	13,200	535,524.00	0.10
166	002236	大华股份	16,700	533,064.00	0.10
167	300015	爱尔眼科	16,429	529,999.54	0.10
168	000039	中集集团	16,300	526,490.00	0.10
169	300266	兴源环境	9,500	524,685.00	0.10
170	300124	汇川技术	10,900	523,200.00	0.10
171	002456	欧菲光	15,400	519,596.00	0.10
172	600497	驰宏锌锗	35,200	513,568.00	0.10
173	600108	亚盛集团	49,500	512,820.00	0.10
174	300058	蓝色光标	32,300	510,663.00	0.10
175	600718	东软集团	23,500	510,655.00	0.10
176	002410	广联达	21,800	510,120.00	0.10
177	000413	东旭光电	52,100	509,538.00	0.10
178	600547	山东黄金	20,600	508,820.00	0.10
179	600531	豫光金铅	24,300	507,141.00	0.10
180	000970	中科三环	24,600	507,006.00	0.10
181	000937	冀中能源	63,000	505,260.00	0.10
182	000567	海德股份	14,900	502,279.00	0.10
183	000712	锦龙股份	14,300	501,930.00	0.10
184	600166	福田汽车	56,600	499,778.00	0.10
185	300059	东方财富	7,860	495,887.40	0.10
186	600507	方大特钢	54,800	495,392.00	0.10
187	601333	广深铁路	60,228	495,074.16	0.10
188	601958	金钼股份	42,000	494,760.00	0.10
189	600829	人民同泰	24,500	486,080.00	0.09
190	601118	海南橡胶	49,700	486,066.00	0.09
191	600051	宁波联合	33,400	485,302.00	0.09
192	601989	中国重工	32,600	482,480.00	0.09
193	600458	时代新材	19,200	481,920.00	0.09
194	002554	惠博普	33,500	481,395.00	0.09
195	300146	汤臣倍健	12,200	479,216.00	0.09
196	600516	方大炭素	40,000	476,400.00	0.09
197	000600	建投能源	32,400	475,632.00	0.09
198	300133	华策影视	17,450	471,150.00	0.09
199	002051	中工国际	15,693	467,337.54	0.09
200	600004	白云机场	27,500	464,750.00	0.09
201	000550	江铃汽车	12,600	462,420.00	0.09
202	002590	万安科技	20,300	460,810.00	0.09
203	002344	海宁皮城	23,400	459,342.00	0.09
204	000959	首钢股份	72,532	446,071.80	0.09
205	000069	华侨城 A	34,269	444,811.62	0.09
206	600717	天津港	29,200	437,708.00	0.08
207	600619	海立股份	30,500	437,370.00	0.08
208	002595	豪迈科技	20,000	431,600.00	0.08
209	600529	山东药玻	25,800	431,118.00	0.08
210	000932	华菱钢铁	91,500	430,965.00	0.08
211	601798	蓝科高新	26,000	427,960.00	0.08
212	600548	深高速	49,700	424,935.00	0.08

213	600007	中国国贸	27,900	424,917.00	0.08
214	600195	中牧股份	15,100	424,310.00	0.08
215	002001	新和成	24,300	415,287.00	0.08
216	600782	新钢股份	54,777	414,661.89	0.08
217	300062	中能电气	19,800	404,910.00	0.08
218	002202	金风科技	20,700	403,029.00	0.08
219	000635	英力特	27,400	402,232.00	0.08
220	600176	中国巨石	14,700	397,782.00	0.08
221	600248	延长化建	29,000	393,240.00	0.08
222	600620	天宸股份	25,000	388,750.00	0.08
223	601877	正泰电器	12,695	388,720.90	0.08
224	000608	阳光股份	47,214	388,571.22	0.08
225	600826	兰生股份	9,900	382,437.00	0.07
226	000501	鄂武商 A	18,500	379,250.00	0.07
227	600027	华电国际	34,000	378,080.00	0.07
228	002668	奥马电器	12,800	371,712.00	0.07
229	000966	长源电力	18,600	368,094.00	0.07
230	002419	天虹商场	21,400	363,800.00	0.07
231	000572	海马汽车	43,200	362,448.00	0.07
232	601377	兴业证券	26,400	361,416.00	0.07
233	002588	史丹利	12,500	359,375.00	0.07
234	300046	台基股份	15,200	357,352.00	0.07
235	600170	上海建工	37,960	356,064.80	0.07
236	002077	大港股份	19,400	353,662.00	0.07
237	000157	中联重科	43,500	352,785.00	0.07
238	300195	长荣股份	12,400	351,540.00	0.07
239	300127	银河磁体	21,000	350,280.00	0.07
240	600335	国机汽车	12,647	349,183.67	0.07
241	002367	康力电梯	16,700	349,030.00	0.07
242	000631	顺发恒业	43,100	348,679.00	0.07
243	000750	国海证券	20,600	346,080.00	0.07
244	000338	潍柴动力	10,800	341,928.00	0.07
245	002281	光迅科技	7,000	336,560.00	0.07
246	600126	杭钢股份	35,400	335,946.00	0.07
247	600850	华东电脑	6,000	332,340.00	0.06
248	600452	涪陵电力	13,000	329,810.00	0.06
249	002134	天津普林	24,900	326,937.00	0.06
250	300092	科新机电	23,400	322,920.00	0.06
251	300379	东方通	4,000	321,480.00	0.06
252	000100	TCL 集团	56,800	320,920.00	0.06
253	000425	徐工机械	24,100	319,807.00	0.06
254	600031	三一重工	33,000	319,770.00	0.06
255	300190	维尔利	9,200	315,928.00	0.06
256	002215	诺普信	18,100	312,225.00	0.06
257	000538	云南白药	3,500	301,945.00	0.06
258	000933	神火股份	31,900	300,498.00	0.06
259	300138	晨光生物	17,800	298,684.00	0.06
260	000418	小天鹅 A	12,483	298,343.70	0.06
261	002555	顺荣三七	6,600	295,680.00	0.06
262	600068	葛洲坝	24,900	291,081.00	0.06

263	300081	恒信移动	6,200	290,160.00	0.06
264	600177	雅戈尔	15,700	286,682.00	0.06
265	000568	泸州老窖	8,700	283,707.00	0.06
266	300104	乐视网	5,400	279,504.00	0.05
267	601669	中国电建	24,200	274,428.00	0.05
268	300148	天舟文化	12,740	273,655.20	0.05
269	002157	正邦科技	15,300	273,105.00	0.05
270	601028	玉龙股份	22,500	270,450.00	0.05
271	600340	华夏幸福	8,704	265,036.80	0.05
272	600203	福日电子	16,600	262,280.00	0.05
273	002179	中航光电	7,940	262,020.00	0.05
274	300249	依米康	9,100	261,898.00	0.05
275	601018	宁波港	29,500	260,780.00	0.05
276	002415	海康威视	5,800	259,840.00	0.05
277	000090	天健集团	10,700	259,475.00	0.05
278	600551	时代出版	11,900	258,349.00	0.05
279	000596	古井贡酒	5,400	252,072.00	0.05
280	000046	泛海控股	17,000	249,050.00	0.05
281	601899	紫金矿业	48,400	247,808.00	0.05
282	002080	中材科技	10,800	246,132.00	0.05
283	601801	皖新传媒	8,300	242,111.00	0.05
284	002056	横店东磁	7,700	240,856.00	0.05
285	603288	海天味业	7,500	239,550.00	0.05
286	000651	格力电器	3,747	239,433.30	0.05
287	600373	中文传媒	9,900	237,204.00	0.05
288	002143	印纪传媒	7,400	236,874.00	0.05
289	002500	山西证券	13,000	235,170.00	0.05
290	600742	一汽富维	7,700	234,696.00	0.05
291	300315	掌趣科技	17,200	233,060.00	0.05
292	002053	云南盐化	8,100	232,551.00	0.05
293	600990	四创电子	2,400	231,168.00	0.04
294	600820	隧道股份	17,200	231,168.00	0.04
295	002032	苏泊尔	9,367	230,521.87	0.04
296	300188	美亚柏科	6,200	230,330.00	0.04
297	601233	桐昆股份	11,538	230,298.48	0.04
298	002475	立讯精密	6,771	228,927.51	0.04
299	601600	中国铝业	23,700	221,121.00	0.04
300	600066	宇通客车	10,650	218,857.50	0.04
301	002537	海立美达	13,900	216,979.00	0.04
302	600371	万向德农	8,000	216,400.00	0.04
303	600060	海信电器	8,800	216,392.00	0.04
304	000540	中天城投	17,100	215,460.00	0.04
305	601933	永辉超市	18,400	213,256.00	0.04
306	000732	泰禾集团	6,200	212,040.00	0.04
307	002047	宝鹰股份	16,500	210,870.00	0.04
308	002024	苏宁云商	13,500	206,550.00	0.04
309	002580	圣阳股份	11,300	200,462.00	0.04
310	000725	京东方 A	38,600	200,334.00	0.04
311	002673	西部证券	6,900	195,753.00	0.04
312	000402	金融街	13,400	189,342.00	0.04

313	600426	华鲁恒升	10,000	185,600.00	0.04
314	300171	东富龙	6,500	182,585.00	0.04
315	600429	三元股份	16,000	180,640.00	0.04
316	600219	南山铝业	17,900	180,611.00	0.04
317	600064	南京高科	9,250	180,375.00	0.03
318	600331	宏达股份	16,700	178,857.00	0.03
319	000563	陕国投 A	12,700	178,689.00	0.03
320	600687	刚泰控股	4,500	176,625.00	0.03
321	002466	天齐锂业	2,800	173,040.00	0.03
322	002437	誉衡药业	5,800	168,490.00	0.03
323	600467	好当家	17,800	166,964.00	0.03
324	000415	渤海租赁	17,600	166,496.00	0.03
325	600188	兖州煤业	12,100	166,375.00	0.03
326	000050	深天马 A	6,900	161,943.00	0.03
327	600282	南钢股份	25,500	160,395.00	0.03
328	002048	宁波华翔	7,700	160,083.00	0.03
329	002681	奋达科技	5,800	159,268.00	0.03
330	002416	爱施德	7,700	159,159.00	0.03
331	002400	省广股份	6,250	157,875.00	0.03
332	600435	北方导航	3,400	154,258.00	0.03
333	300050	世纪鼎利	5,400	154,008.00	0.03
334	601928	凤凰传媒	8,900	152,190.00	0.03
335	600884	杉杉股份	5,300	151,580.00	0.03
336	000685	中山公用	5,000	147,150.00	0.03
337	600651	飞乐音响	7,100	146,047.00	0.03
338	600022	山东钢铁	25,100	145,831.00	0.03
339	600894	广日股份	7,300	145,708.00	0.03
340	002508	老板电器	3,779	144,962.44	0.03
341	600391	成发科技	2,400	140,496.00	0.03
342	300072	三聚环保	4,160	140,192.00	0.03
343	600811	东方集团	11,300	139,329.00	0.03
344	002294	信立泰	4,800	137,280.00	0.03
345	601336	新华保险	2,223	135,736.38	0.03
346	300208	恒顺众昇	1,700	135,133.00	0.03
347	002384	东山精密	6,100	134,871.00	0.03
348	300274	阳光电源	4,400	134,508.00	0.03
349	000002	万科 A	9,200	133,584.00	0.03
350	002152	广电运通	4,100	132,594.00	0.03
351	002426	胜利精密	6,000	132,000.00	0.03
352	002568	百润股份	1,000	131,530.00	0.03
353	000758	中色股份	6,700	131,521.00	0.03
354	002280	联络互动	2,450	130,585.00	0.03
355	000630	铜陵有色	12,600	130,032.00	0.03
356	600536	中国软件	3,600	127,728.00	0.02
357	000708	大冶特钢	9,100	126,672.00	0.02
358	000429	粤高速 A	19,600	125,832.00	0.02
359	000977	浪潮信息	4,200	124,110.00	0.02
360	000587	金叶珠宝	5,300	122,589.00	0.02
361	600601	方正科技	13,441	122,313.10	0.02
362	600143	金发科技	10,200	121,584.00	0.02

363	600885	宏发股份	3,807	119,311.38	0.02
364	600641	万业企业	10,500	117,915.00	0.02
365	002004	华邦颖泰	9,000	116,820.00	0.02
366	000887	中鼎股份	4,700	116,325.00	0.02
367	600096	云天化	7,500	115,800.00	0.02
368	000830	鲁西化工	11,600	115,536.00	0.02
369	601179	中国西电	11,148	114,267.00	0.02
370	600580	卧龙电气	6,254	111,508.82	0.02
371	002594	比亚迪	2,000	110,460.00	0.02
372	601908	京运通	5,217	109,452.66	0.02
373	601012	隆基股份	6,900	108,606.00	0.02
374	600597	光明乳业	4,600	105,800.00	0.02
375	000626	如意集团	1,300	103,610.00	0.02
376	600307	酒钢宏兴	15,200	102,752.00	0.02
377	600655	豫园商城	6,400	102,720.00	0.02
378	601231	环旭电子	6,000	102,060.00	0.02
379	600998	九州通	4,400	98,384.00	0.02
380	601519	大智慧	5,100	95,421.00	0.02
381	600648	外高桥	2,700	94,716.00	0.02
382	300278	华昌达	4,000	93,720.00	0.02
383	600399	抚顺特钢	7,900	93,536.00	0.02
384	002299	圣农发展	4,600	93,380.00	0.02
385	002002	鸿达兴业	2,300	90,390.00	0.02
386	002217	合力泰	4,000	89,680.00	0.02
387	300152	燃控科技	1,900	86,925.00	0.02
388	002501	利源精制	5,400	86,292.00	0.02
389	002135	东南网架	6,900	84,180.00	0.02
390	600550	保变电气	6,600	80,322.00	0.02
391	002721	金一文化	1,100	77,011.00	0.01
392	000048	康达尔	2,900	73,370.00	0.01
393	002013	中航机电	2,600	72,410.00	0.01
394	002008	大族激光	2,500	71,800.00	0.01
395	600320	振华重工	6,800	71,400.00	0.01
396	002714	牧原股份	1,200	70,488.00	0.01
397	600236	桂冠电力	6,300	70,308.00	0.01
398	600535	天士力	1,400	69,664.00	0.01
399	002450	康得新	2,248	68,788.80	0.01
400	600765	中航重机	2,500	68,575.00	0.01
401	600326	西藏天路	4,300	68,542.00	0.01
402	300252	金信诺	1,700	67,439.00	0.01
403	002469	三维工程	3,000	66,300.00	0.01
404	000878	云南铜业	2,694	66,003.00	0.01
405	000507	珠海港	5,800	58,870.00	0.01
406	601588	北辰实业	7,600	58,520.00	0.01
407	002557	洽洽食品	3,253	53,284.14	0.01
408	300226	上海钢联	633	51,273.00	0.01
409	000559	万向钱潮	2,100	45,906.00	0.01
410	600295	鄂尔多斯	3,700	44,400.00	0.01
411	000657	中钨高新	2,100	43,785.00	0.01
412	002311	海大集团	3,170	43,714.30	0.01

413	600711	盛屯矿业	3,500	39,585.00	0.01
414	300230	永利带业	2,000	37,360.00	0.01
415	600584	长电科技	1,900	36,309.00	0.01
416	000558	莱茵置业	1,053	34,538.40	0.01
417	600723	首商股份	2,800	34,524.00	0.01
418	600122	宏图高科	2,100	34,482.00	0.01
419	002271	东方雨虹	1,300	33,410.00	0.01
420	000902	新洋丰	1,200	32,580.00	0.01
421	002372	伟星新材	1,750	31,097.50	0.01
422	000055	方大集团	2,400	30,240.00	0.01
423	600783	鲁信创投	800	29,984.00	0.01
424	002128	露天煤业	1,800	29,664.00	0.01
425	000928	中钢国际	1,105	27,415.05	0.01
426	000911	南宁糖业	1,500	25,710.00	0.00
427	002335	科华恒盛	700	25,326.00	0.00
428	600298	安琪酵母	700	24,346.00	0.00
429	300292	吴通通讯	700	23,681.00	0.00
430	002597	金禾实业	1,900	23,237.00	0.00
431	002116	中国海诚	1,169	22,456.49	0.00
432	000543	皖能电力	1,000	21,360.00	0.00
433	601888	中国国旅	300	19,890.00	0.00
434	600138	中青旅	900	19,008.00	0.00
435	000818	方大化工	1,300	18,447.00	0.00
436	600523	贵航股份	500	15,415.00	0.00
437	000802	北京文化	378	11,003.58	0.00
438	600053	中江地产	800	10,512.00	0.00
439	600828	成商集团	600	6,264.00	0.00
440	002452	长高集团	600	6,234.00	0.00
441	000737	南风化工	500	5,830.00	0.00
442	000801	四川九洲	200	5,500.00	0.00
443	300071	华谊嘉信	360	4,917.60	0.00
444	000862	银星能源	400	4,724.00	0.00
445	000892	*ST 星美	400	4,528.00	0.00
446	601999	出版传媒	300	4,266.00	0.00
447	002045	国光电器	300	4,176.00	0.00
448	600561	江西长运	200	3,896.00	0.00
449	002003	伟星股份	240	3,880.80	0.00
450	600202	哈空调	200	3,772.00	0.00
451	002028	思源电气	200	3,680.00	0.00
452	000988	华工科技	200	3,562.00	0.00
453	600258	首旅酒店	100	1,855.00	0.00
454	000066	长城电脑	100	1,684.00	0.00
455	000850	华茂股份	100	1,098.00	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	600016	民生银行	69,629,881.72	12.11

2	601318	中国平安	60,364,400.90	10.50
3	601166	兴业银行	58,060,511.92	10.09
4	600000	浦发银行	55,724,331.12	9.69
5	601398	工商银行	52,282,781.63	9.09
6	601288	农业银行	45,591,915.00	7.93
7	600837	海通证券	39,878,955.38	6.93
8	601818	光大银行	34,269,856.69	5.96
9	601169	北京银行	33,380,431.09	5.80
10	601668	中国建筑	32,885,183.76	5.72
11	601328	交通银行	31,883,725.59	5.54
12	600376	首开股份	27,535,843.80	4.79
13	600030	中信证券	27,295,376.73	4.75
14	600015	华夏银行	26,715,548.80	4.64
15	600048	保利地产	25,621,937.36	4.45
16	601998	中信银行	25,601,156.61	4.45
17	000776	广发证券	23,673,079.31	4.12
18	601601	中国太保	23,633,605.30	4.11
19	601988	中国银行	22,406,282.33	3.90
20	601688	华泰证券	20,643,566.18	3.59
21	600150	中国船舶	20,427,338.42	3.55
22	002142	宁波银行	18,438,363.23	3.21
23	600028	中国石化	17,672,453.90	3.07
24	601233	桐昆股份	17,607,829.56	3.06
25	000002	万科 A	17,134,873.00	2.98
26	601628	中国人寿	16,954,038.37	2.95
27	600104	上汽集团	15,882,933.44	2.76
28	000001	平安银行	14,808,869.85	2.57
29	601677	明泰铝业	14,628,386.39	2.54
30	600741	华域汽车	14,592,853.98	2.54
31	600823	世茂股份	14,495,470.43	2.52
32	600887	伊利股份	14,476,347.26	2.52
33	601766	中国中车	13,912,080.65	2.42
33	601618	中国中冶	12,760,303.90	2.22
34	600153	建发股份	12,643,779.97	2.20
35	000671	阳光城	12,493,222.75	2.17
36	600739	辽宁成大	12,389,504.77	2.15
37	600519	贵州茅台	12,377,930.90	2.15
38	601390	中国中铁	12,340,174.00	2.15
39	600816	安信信托	12,215,545.12	2.12
40	601377	兴业证券	12,215,384.50	2.12
41	000869	张裕 A	12,203,351.10	2.12
42	600694	大商股份	11,626,245.22	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	71,081,963.36	12.36
2	601318	中国平安	66,899,097.71	11.63

3	601166	兴业银行	64,113,462.02	11.15
4	600016	民生银行	64,046,126.43	11.14
5	601668	中国建筑	49,273,199.09	8.57
6	601398	工商银行	42,097,306.35	7.32
7	600739	辽宁成大	41,661,553.10	7.24
8	601818	光大银行	37,257,846.80	6.48
9	600030	中信证券	37,135,062.00	6.46
10	600153	建发股份	36,160,099.67	6.29
11	601288	农业银行	35,989,684.00	6.26
12	600015	华夏银行	35,854,322.00	6.23
13	000001	平安银行	34,262,576.30	5.96
14	600048	保利地产	34,043,816.26	5.92
15	600837	海通证券	33,926,758.13	5.90
16	601328	交通银行	32,206,123.23	5.60
17	601169	北京银行	32,134,608.48	5.59
18	601988	中国银行	30,987,328.00	5.39
19	600376	首开股份	27,708,676.83	4.82
20	000776	广发证券	23,964,081.08	4.17
21	601299	中国北车	21,902,631.90	3.81
22	000002	万科 A	21,450,698.67	3.73
23	600150	中国船舶	21,317,694.27	3.71
24	601688	华泰证券	21,306,071.50	3.70
25	601233	桐昆股份	19,551,709.14	3.40
26	601601	中国太保	19,034,594.45	3.31
27	601088	中国神华	18,445,945.81	3.21
28	600104	上汽集团	17,997,251.97	3.13
29	601998	中信银行	17,104,356.06	2.97
30	601333	广深铁路	16,047,168.71	2.79
31	600823	世茂股份	15,941,931.71	2.77
32	000671	阳光城	14,909,213.71	2.59
33	601989	中国重工	14,607,931.56	2.54
34	601618	中国中冶	14,489,643.68	2.52
35	600028	中国石化	14,279,432.06	2.48
36	601677	明泰铝业	13,929,880.34	2.42
37	601766	中国中车	13,781,264.93	2.40
38	600019	宝钢股份	13,746,176.38	2.39
39	600887	伊利股份	13,421,370.83	2.33
40	600741	华域汽车	12,828,723.22	2.23
41	601377	兴业证券	12,542,647.46	2.18
42	600816	安信信托	12,433,247.70	2.16
43	601669	中国电建	11,907,549.06	2.07
44	000869	张裕 A	11,876,192.52	2.06
45	601390	中国中铁	11,642,646.00	2.02
46	600519	贵州茅台	11,604,990.52	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。

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	2,919,397,033.74
卖出股票的收入（成交）总额	3,186,105,254.58

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	53,764.70	0.01
8	其他	-	-
9	合计	53,764.70	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	370	53,764.70	0.01

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 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仓股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券（600030）、海通证券（600837）外，没有出现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、

处罚的情形。

中信证券股份有限公司 2015 年 1 月 18 日发布公告称，因存在违规为到期融资融券合约展期问题，公司被中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

海通证券股份有限公司 2015 年 1 月 18 日发布公告称，因存在违规为到期融资融券合约展期问题，公司被中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

对以上股票投资决策程序的说明：

根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	458,679.71
2	应收证券清算款	11,497,930.37
3	应收股利	-
4	应收利息	10,386.76
5	应收申购款	8,051,501.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,018,497.96

7.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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
18,650	15,589.63	45,846,190.70	15.77%	244,900,354.91	84.23%

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	69,022.28	0.024%

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	-

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年5月28日）基金份额总额	477,303,148.76
本报告期初基金份额总额	382,151,791.32
本报告期基金总申购份额	883,615,964.54
减：本报告期基金总赎回份额	975,021,210.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	290,746,545.61

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 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。

10.2.2 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。

10.2.3 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。

10.2.4 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。

10.2.5 本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
银河证券	1	1,291,958,454.67	21.20%	1,176,193.04	23.95%	-
华信证券	1	1,217,381,963.14	19.97%	864,831.63	17.61%	新增
民生证券	1	1,216,070,332.04	19.95%	863,895.34	17.59%	-
中信建投	1	654,898,354.56	10.75%	596,217.34	12.14%	-
华泰证券	2	640,984,295.19	10.52%	583,521.07	11.88%	-
东方证券	3	342,355,300.31	5.62%	243,209.62	4.95%	-
第一创业	1	274,458,042.96	4.50%	194,975.70	3.97%	-
高华证券	1	188,298,638.24	3.09%	171,427.54	3.49%	-
中投证券	2	114,632,340.76	1.88%	104,360.66	2.12%	-
海通证券	1	80,598,136.31	1.32%	57,257.03	1.17%	-
信达证券	1	54,473,513.65	0.89%	38,696.73	0.79%	-
长江证券	2	18,611,860.49	0.31%	16,944.27	0.34%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
新时代	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	4	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据本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	
	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
银河证券	5,001,784.60	13.32%	-	-
华信证券	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-
华泰证券	32,538,619.20	86.68%	21,600,000.00	100.00%
东方证券	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-

高华证券	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-
华宝证券				
华龙证券				
湘财证券				
齐鲁证券				
长城证券				
大通证券	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-
中银国际				

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	中国证券报、上海证	2015/4/3

	停牌股票调整估值方法的公告	券报、证券时报	
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	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并参加其网上交易申购业务及定期定额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	2015/4/2
41	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
42	关于博时旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行网上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
43	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
44	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
45	关于博时旗下部分开放式基金增加苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其网上银行、手机银行和柜面申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/27
46	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
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	2015/3/26
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	2015/3/24
49	关于博时旗下部分开放式基金增加泉州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	2015/3/20
50	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
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	2015/3/18
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	2015/3/17
53	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
54	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期	中国证券报、上海证	2015/3/11

	停牌股票调整估值方法的公告	券报、证券时报	
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	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
57	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
58	关于博时旗下部分开放式基金增加江苏吴江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	2015/2/27
59	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	2015/2/26
60	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
61	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
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	2015/2/12
63	关于博时旗下部分开放式基金增加一路财富（北京）信息科技有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/11
64	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	2015/2/10
65	博时基金管理有限公司关于博时特许价值股票型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/10
66	关于博时旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司定期定额交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/9
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	关于博时旗下部分基金参加东莞银行股份有限公司网上银行、手机银行申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/31
69	关于博时旗下部分开放式基金参加江苏张家港农村商业银行股份有限公司柜面、网上银行、手机银行申购和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	2015/1/31

70	关于博时特许价值股票型证券投资基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司网上交易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	2015/1/28
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	2015/1/23
72	博时特许价值股票型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/21
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	2015/1/20
74	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/19
75	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
76	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
77	博时特许价值股票型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/16
78	关于博时旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行网上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	2015/1/6

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时特许价值股票型证券投资基金设立的文件
- 11.1.2 《博时特许价值股票型证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时特许价值股票型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 博时特许价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 11.1.6 报告期内博时特许价值股票型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

客户服务中心电话：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