

博时特许价值混合型证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 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：二〇一六年八月二十五日

§ 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 2016 年 8 月 24 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 2016 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	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	27
7.1 期末基金资产组合情况	27
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	27
7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合	27
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	28
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	33
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	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所有资产支持证券投资明细	34
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	34
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	34
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	34
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	34
7.12 投资组合报告附注	34
§ 8 基金份额持有人信息	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	35
§ 9 开放式基金份额变动	35
§ 10 重大事件揭示	36

10.1 基金份额持有人大会决议	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变	36
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	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	38
§ 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	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时特许价值混合型证券投资基金		
基金简称	博时特许价值混合		
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	251,014,995.62 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： $80\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+ 20\% \times$ 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 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-62,772,658.11
本期利润	-55,948,409.53
加权平均基金份额本期利润	-0.2200
本期加权平均净值利润率	-15.81%
本期基金份额净值增长率	-13.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	97,265,875.48
期末可供分配基金份额利润	0.3875
期末基金资产净值	352,262,205.91
期末基金份额净值	1.403
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	95.47%

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

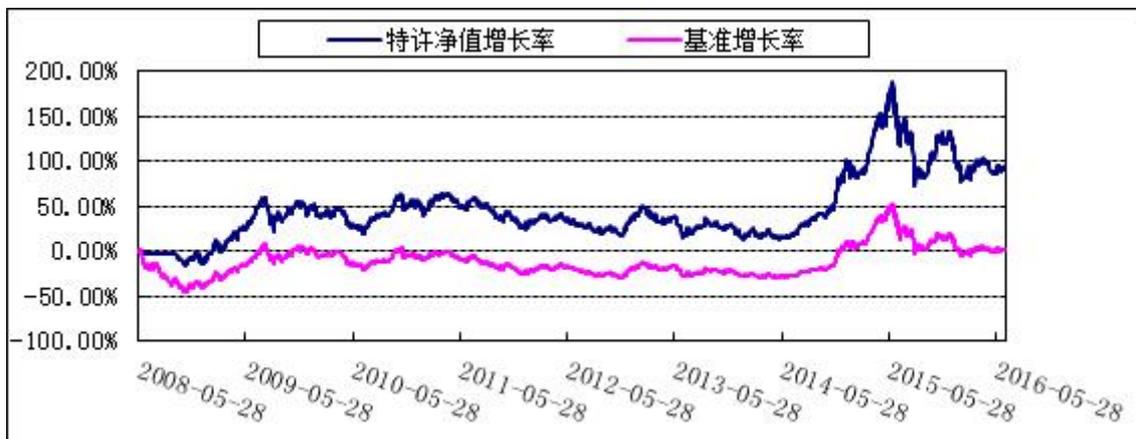
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.30%	1.02%	-0.23%	0.79%	1.53%	0.23%
过去三个月	-1.41%	1.02%	-1.50%	0.81%	0.09%	0.21%
过去六个月	-13.61%	1.82%	-12.05%	1.47%	-1.56%	0.35%
过去一年	-20.91%	2.21%	-22.57%	1.84%	1.66%	0.37%
过去三年	64.44%	1.76%	40.37%	1.47%	24.07%	0.29%
自基金合同生效起至今	95.47%	1.53%	2.81%	1.46%	92.66%	0.07%

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 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 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。资产管理净值总规模达 4,598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 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，2016 年二季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博

时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

固定收益方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债基金今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；指数债券型基金里，博时上证企债 30ETF 今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第四，博时现金收益货币，今年以来净值增长率在同类 194 只基金中排名前 2/5；博时安丰 18 定期开放债券，今年以来净值增长率在同类 45 只中排名第四。

QDII 基金中，博时亚洲票息，今年以来至 6 月 30 日净值增长 7.12%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名第二。

2、其他大事件

- 2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

- 由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

- 2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金凭借在固定收益投资领域的突出表现，荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

- 2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。wind 数据显示，2015 年博时基金旗下 10 只纯债产品平均收益率达 12.65%，其中 6 只定期开放债基平均收益率更高达 15.17%，博时安丰 18 个月定期开放债券和博时双月薪双双夺得同类基金收益榜冠军。

- 2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇”315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。

- 2016 年 1 月 18 日，大众证券报“2015 中国基金风云榜”上，博时创业成长（050014）荣获 2015 “最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰 18 个月定开债（160515）荣获 2015 “最佳固定收益型基金”奖。

- 2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖盛典在

京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

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	指数与量化投资部总经理 / 基金经理	2015-02-09	-	14	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 EFT 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）、股票投资部量化投资组投资总监。现任指数与量化投资部总经理兼博时价值增长混合基金、博时价值增长贰号混合基金、博时特许价值混合基金的基金经理。
周江	研究员兼基金经理助理	2015-07-27		1.2	2014 年 1 月至 2015 年 4 月在平安磐海资本工作，任策略研究部策略研究员。2015 年 4 月 23 日加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部研究员兼基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，市场整体延续了股灾以来的弱市行情。1 月份，在人民币贬值、美联储加息等利空预期之下，市场经历了一轮快速下跌。3 月初，市场企稳回暖，迎来短暂的反弹行情。整个二季度，市场处于箱型整理阶段，振幅缩小，趋势不明显。从风格而言，一季度价值、技术因子表现突出，二季度成长、质量、分析师因子占优，5 月底以来，小盘因子逐步复苏，总体来说，市场风格切换频繁。1-6 月，上证 50 跌 13%，沪深 300 跌 16%，中证 500 跌 20%，中小板指、创业板指、中证 1000 跌幅接近 18%，各指数表现差距缩小。行业层面，食品饮料率先翻红，煤炭、有色、银行、家电跌幅较小，在 10%以内；传媒、交运、商贸零售、餐饮旅游和计算机跌幅较大，均超过 25%。

本基金在坚持价值投资理念的同时，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.403 元，累计份额净值为 1.843 元，报告期内净值增长率为-13.61%，同期业绩基准涨幅为-12.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年 3 季度，英国退欧影响逐步明朗，美联储加息预期进一步被抑制，各国央行维稳措施加强，宏观政策环境预计更加温和。预期国内三季度通胀压力会有所下降，货币政策很难进一步收紧，人民币贬值压力仍然存在。同时，美国基本面数据企稳，关注美国大选可能带来的黑天鹅事件。经历年初的悲观预期之后，市场风险偏好有所提升，三季度积极关注半年报业绩超预期的企业，同时布局各类主题性机会。

从估值体系看，小盘股风险得到一定的释放，在市场回暖预期下，超跌反弹、外延增长性强的股票有望领先。大盘蓝筹估值相对合理，从大类资产配置的角度，仍有可能获得青睐。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时特许价值混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	69,921,262.85	40,980,454.88
结算备付金		3,823,432.02	4,103,249.12
存出保证金		176,648.91	362,531.50
交易性金融资产	6.4.3.2	282,000,476.85	371,557,308.93
其中：股票投资		281,949,894.35	371,509,268.13
基金投资		-	-
债券投资		50,582.50	48,040.80
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		-	-
应收利息	6.4.3.5	16,309.04	13,801.87
应收股利		-	-
应收申购款		47,519.92	137,232.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		355,985,649.59	417,154,578.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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		-	-
应付赎回款		151,324.76	919,104.32
应付管理人报酬		429,800.29	531,009.41
应付托管费		71,633.38	88,501.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	2,546,137.05	2,447,511.20
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	524,548.20	403,127.66
负债合计		3,723,443.68	4,389,254.15
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	251,014,995.62	254,175,225.49
未分配利润	6.4.3.10	101,247,210.29	158,590,099.12
所有者权益合计		352,262,205.91	412,765,324.61
负债和所有者权益总计		355,985,649.59	417,154,578.76

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.403 元，基金份额总额 251,014,995.62 份。

6.2 利润表

会计主体：博时特许价值混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-49,555,393.37	231,743,988.00
1. 利息收入		228,037.43	332,351.59
其中：存款利息收入	6.4.3.11	227,982.79	274,974.40
债券利息收入		54.64	57,377.19
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）		-56,632,984.10	345,471,451.33
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-59,269,212.35	341,404,869.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-473,309.84
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	2,636,228.25	4,539,891.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	6,824,248.58	-115,734,588.17
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	25,304.72	1,674,773.25

减：二、费用		6,393,016.16	15,724,339.16
1. 管理人报酬		2,640,239.14	5,745,681.11
2. 托管费		440,039.86	957,613.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	3,124,317.75	8,797,444.62
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	188,419.41	200,452.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-55,948,409.53	216,019,648.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-55,948,409.53	216,019,648.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时特许价值混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	254,175,225.49	158,590,099.12	412,765,324.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-55,948,409.53	-55,948,409.53
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）	-3,160,229.87	-1,394,479.30	-4,554,709.17
其中：1. 基金申购款	15,203,381.19	5,878,426.82	21,081,808.01
2. 基金赎回款	-18,363,611.06	-7,272,906.12	-25,636,517.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	251,014,995.62	101,247,210.29	352,262,205.91
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人：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》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.3 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
	2016 年 6 月 30 日
活期存款	69,921,262.85
定期存款	-
其他存款	-
合计	69,921,262.85

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	275,683,904.81	281,949,894.35	6,265,989.54	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	45,000.00	50,582.50	5,582.50
	银行间市场	-	-	-
	合计	45,000.00	50,582.50	5,582.50
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	275,728,904.81	282,000,476.85	6,271,572.04	

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
	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	14,495.38
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	1,720.60

应收债券利息	13.56
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	79.50
合计	16,309.04

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,546,137.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,546,137.05

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	507.06
其他应付款	-
预提费用	274,041.14
合计	524,548.20

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	254,175,225.49	254,175,225.49
本期申购	15,203,381.19	15,203,381.19
本期赎回(以“-”号填列)	-18,363,611.06	-18,363,611.06
本期末	251,014,995.62	251,014,995.62

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	161,155,210.54	-2,565,111.42	158,590,099.12
本期利润	-62,772,658.11	6,824,248.58	-55,948,409.53
本期基金份额交易产生的变动数	-1,116,676.95	-277,802.35	-1,394,479.30
其中：基金申购款	7,847,029.21	-1,968,602.39	5,878,426.82
基金赎回款	-8,963,706.16	1,690,800.04	-7,272,906.12

本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,265,875.48	3,981,334.81	101,247,210.29

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
活期存款利息收入	208,607.49	
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	17,147.40	
其他	2,227.90	
合计	227,982.79	

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
卖出股票成交总额	1,126,731,111.23	
减：卖出股票成本总额	1,186,000,323.58	
买卖股票差价收入	-59,269,212.35	

6.4.3.13 债券投资收益

无余额。

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 2016年1月1日至2016年6月30日	
股票投资产生的股利收益	2,636,228.25	
基金投资产生的股利收益	-	
合计	2,636,228.25	

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
1. 交易性金融资产	6,824,248.58	
——股票投资	6,829,706.88	
——债券投资	-5,458.30	
——资产支持证券投资	-	
——基金投资	-	
——贵金属投资	-	
——其他	-	
2. 衍生工具	-	

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	6,824,248.58

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	18,647.84
转换费收入	6,656.88
合计	25,304.72

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 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	3,124,317.75
银行间市场交易费用	0.00
合计	3,124,317.75

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	149,178.12
银行费用	5,378.27
银行间帐户服务费	9,000.00
合计	188,419.41

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、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 权证交易

无。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比 例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	219,545.44	12.19%	297,295.18	11.68%

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,640,239.14	5,745,681.11
其中：支付销售机构的客户维护费	470,150.90	902,951.99

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	440,039.86	957,613.52

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	5,820,139.70	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,820,139.70	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.32%	-

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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	69,921,262.85	208,607.49	37,898,350.24	206,601.95

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

无。

6.4.8 期末（2016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

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300431	暴风科技	2015-06-11	重大事项	4.90	-	-	254,800	1,369,579.11	1,248,520.00	
600166	福田汽车	2016-06-29	重大事项	5.52	2016-07-01	5.62	240,900	1,350,003.81	1,329,768.00	
600295	鄂尔多斯	2016-06-29	重大事项	7.89	2016-07-14	5.46	170,200	1,310,360.15	1,342,878.00	
600318	新力金融	2016-03-23	重大事项	26.84	-	-	27,500	668,855.90	738,100.00	
600330	天通股份	2016-05-20	重大事项	13.93	-	-	47,000	559,817.75	654,710.00	

600853	龙建股份	2016-06-27	重大事项	5.15	2016-07-01	5.23	509,000	2,622,435.45	2,621,350.00
000002	万科 A	2015-12-18	重大事项	18.20	2016-07-04	21.99	6,900	102,187.08	125,580.00
000401	冀东水泥	2016-04-05	重大事项	10.60	2016-07-14	11.32	110,900	1,207,878.00	1,175,540.00
000409	山东地矿	2016-03-11	重大事项	10.19	-	-	127,000	1,409,700.00	1,294,130.00
000415	渤海金控	2016-01-29	重大事项	6.82	-	-	17,100	119,529.00	116,622.00
000651	格力电器	2016-02-19	重大事项	22.07	-	-	70,100	1,577,433.29	1,547,107.00
000728	国元证券	2016-06-07	重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	135,700	2,223,079.24	2,268,904.00
000948	南天信息	2016-06-27	重大事项	19.31	2016-07-12	21.00	8,500	162,152.00	164,135.00
002057	中钢天源	2016-06-08	重大事项	15.05	-	-	75,300	1,067,517.59	1,133,265.00
002129	中环股份	2016-04-22	重大事项	8.29	-	-	2,100	28,135.62	17,409.00
002249	大洋电机	2016-06-07	重大事项	11.97	2016-07-28	10.77	30,700	271,706.34	367,479.00
002297	博云新材	2016-06-17	重大事项	13.09	-	-	6,600	69,062.40	86,394.00
300035	中科电气	2016-05-20	重大事项	13.76	-	-	68,000	810,942.00	935,680.00
300345	红宇新材	2016-06-20	重大事项	10.46	2016-07-19	11.46	13,600	134,876.28	142,256.00

注：本基金截至 2016 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 2016 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% (2015 年 12 月 31 日：0.01%)。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流

动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持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 2016 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 2016 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	69,921,262.85	-	-	-	69,921,262.85
结算备付金	3,823,432.02	-	-	-	3,823,432.02
存出保证金	176,648.91	-	-	-	176,648.91
交易性金融资产	-	40,807.30	9,775.20	281,949,894.35	282,000,476.85
应收利息	-	-	-	16,309.04	16,309.04
应收申购款	-	-	-	47,519.92	47,519.92
资产总计	73,921,343.78	40,807.30	9,775.20	282,013,723.31	355,985,649.59

负债					
应付赎回款	-	-	-	151,324.76	151,324.76
应付管理人报酬	-	-	-	429,800.29	429,800.29
应付托管费	-	-	-	71,633.38	71,633.38
应付交易费用	-	-	-	2,546,137.05	2,546,137.05
其他负债	-	-	-	524,548.20	524,548.20
负债总计	-	-	-	3,723,443.68	3,723,443.68
利率敏感度缺口	73,921,343.78	40,807.30	9,775.20	278,290,279.63	352,262,205.91
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	40,980,454.88	-	-	-	40,980,454.88
结算备付金	4,103,249.12	-	-	-	4,103,249.12
存出保证金	362,531.50	-	-	-	362,531.50
交易性金融资产	-	-	48,040.80	371,509,268.13	371,557,308.93
应收利息	-	-	-	13,801.87	13,801.87
应收申购款	-	-	-	137,232.46	137,232.46
资产总计	45,446,235.50		48,040.80	371,660,302.46	417,154,578.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	919,104.32	919,104.32
应付管理人报酬	-	-	-	531,009.41	531,009.41
应付托管费	-	-	-	88,501.56	88,501.56
应付交易费用	-	-	-	2,447,511.20	2,447,511.20
其他负债	-	-	-	403,127.66	403,127.66
负债总计	-	-	-	4,389,254.15	4,389,254.15
利率敏感度缺口	45,446,235.50	-	48,040.80	367,271,048.31	412,765,324.61

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2016 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% (2015 年 12 月 31 日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	281,949,894.35	80.04	371,509,268.13	90.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	281,949,894.35	80.04	371,509,268.13	90.00

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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 1,926	增加约 2,010
2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 1,926	减少约 2,010

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 2016 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 264,640,067.35 元，属于第二层级的余额为 17,309,827.00 元，无属于第三层级的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层级 447,442,293.84 元，第二层级 36,902,914.70 元，无第三层级)。于 2016 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(2015 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	281,949,894.35	79.20
	其中：股票	281,949,894.35	79.20
2	固定收益投资	50,582.50	0.01
	其中：债券	50,582.50	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	73,744,694.87	20.72
7	其他各项资产	240,477.87	0.07
8	合计	355,985,649.59	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,278,682.00	0.93
B	采矿业	7,269,037.00	2.06
C	制造业	96,124,548.00	27.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,951,272.00	0.55
E	建筑业	6,044,372.16	1.72
F	批发和零售业	12,111,601.14	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	5,389,166.72	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,353,265.26	0.67

J	金融业	137,766,460.78	39.11
K	房地产业	9,136,727.29	2.59
L	租赁和商务服务业	301,258.00	0.09
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	112,336.00	0.03
S	综合	111,168.00	0.03
	合计	281,949,894.35	80.04

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	000001	平安银行	1,068,162	9,293,009.40	2.64
2	601998	中信银行	1,188,400	6,738,228.00	1.91
3	600000	浦发银行	427,862	6,661,811.34	1.89
4	000686	东北证券	461,300	5,955,383.00	1.69
5	002673	西部证券	222,900	5,764,194.00	1.64
6	601198	东兴证券	231,600	5,660,304.00	1.61
7	601788	光大证券	330,700	5,602,058.00	1.59
8	000166	申万宏源	666,100	5,601,901.00	1.59
9	601555	东吴证券	416,200	5,577,080.00	1.58
10	600061	国投安信	312,400	5,566,968.00	1.58
11	000783	长江证券	479,500	5,562,200.00	1.58
12	600109	国金证券	411,900	5,552,412.00	1.58
13	601377	兴业证券	748,600	5,532,154.00	1.57
14	600958	东方证券	327,300	5,501,913.00	1.56
15	000750	国海证券	739,550	5,465,274.50	1.55
16	002736	国信证券	316,600	5,461,350.00	1.55
17	002500	山西证券	326,000	5,398,560.00	1.53
18	601166	兴业银行	343,466	5,234,421.84	1.49
19	601328	交通银行	830,102	4,673,474.26	1.33
20	601318	中国平安	102,785	3,293,231.40	0.93
21	002696	百洋股份	171,300	3,278,682.00	0.93
22	600746	江苏索普	311,500	3,062,045.00	0.87
23	300022	吉峰农机	358,206	2,933,707.14	0.83
24	600215	长春经开	399,400	2,823,758.00	0.80
25	000985	大庆华科	113,011	2,794,762.03	0.79
26	601818	光大银行	738,958	2,778,482.08	0.79
27	600016	民生银行	306,297	2,735,232.21	0.78
28	600099	林海股份	231,700	2,727,109.00	0.77
29	600148	长春一东	123,300	2,716,299.00	0.77

30	600015	华夏银行	273,522	2,705,132.58	0.77
31	300132	青松股份	336,300	2,703,852.00	0.77
32	600128	弘业股份	210,500	2,700,715.00	0.77
33	600137	浪莎股份	92,100	2,697,609.00	0.77
34	000785	武汉中商	241,900	2,697,185.00	0.77
35	600605	汇通能源	139,500	2,690,955.00	0.76
36	000737	南风化工	495,500	2,675,700.00	0.76
37	300321	同大股份	79,902	2,651,947.38	0.75
38	600853	龙建股份	509,000	2,621,350.00	0.74
39	002193	山东如意	157,900	2,591,139.00	0.74
40	000712	锦龙股份	119,600	2,482,896.00	0.70
41	000728	国元证券	135,700	2,268,904.00	0.64
42	601628	中国人寿	97,800	2,036,196.00	0.58
43	600816	安信信托	120,300	2,029,461.00	0.58
44	601601	中国太保	73,500	1,987,440.00	0.56
45	600705	中航资本	336,800	1,980,384.00	0.56
46	600381	ST 春天	124,000	1,697,560.00	0.48
47	000651	格力电器	70,100	1,547,107.00	0.44
48	002329	皇氏集团	93,700	1,404,563.00	0.40
49	600266	北京城建	111,700	1,395,133.00	0.40
50	000926	福星股份	117,700	1,380,621.00	0.39
51	000858	五粮液	42,000	1,366,260.00	0.39
52	600887	伊利股份	81,106	1,352,037.02	0.38
53	000550	江铃汽车	55,200	1,344,672.00	0.38
54	601988	中国银行	418,437	1,343,182.77	0.38
55	600295	鄂尔多斯	170,200	1,342,878.00	0.38
56	000528	柳工	206,600	1,338,768.00	0.38
57	600048	保利地产	154,883	1,336,640.29	0.38
58	000338	潍柴动力	171,000	1,335,510.00	0.38
59	600519	贵州茅台	4,574	1,335,242.08	0.38
60	601668	中国建筑	250,528	1,332,808.96	0.38
61	600166	福田汽车	240,900	1,329,768.00	0.38
62	000157	中联重科	321,100	1,326,143.00	0.38
63	601288	农业银行	413,507	1,323,222.40	0.38
64	600029	南方航空	187,000	1,320,220.00	0.37
65	002304	洋河股份	18,355	1,320,091.60	0.37
66	000333	美的集团	55,450	1,315,274.00	0.37
67	600269	赣粤高速	302,200	1,314,570.00	0.37
68	601633	长城汽车	154,600	1,304,824.00	0.37
69	600104	上汽集团	64,238	1,303,389.02	0.37
70	000830	鲁西化工	288,200	1,302,664.00	0.37
71	000709	河钢股份	470,155	1,302,329.35	0.37
72	601186	中国铁建	130,700	1,301,772.00	0.37
73	000898	鞍钢股份	339,429	1,300,013.07	0.37
74	603589	口子窖	35,900	1,299,939.00	0.37
75	600809	山西汾酒	58,400	1,295,312.00	0.37
76	000409	山东地矿	127,000	1,294,130.00	0.37
77	600690	青岛海尔	144,600	1,284,048.00	0.36
78	600028	中国石化	271,800	1,282,896.00	0.36
79	600050	XD 中国联	333,946	1,272,334.26	0.36

80	601111	XD 中国国	187,400	1,266,824.00	0.36
81	000895	双汇发展	60,450	1,262,196.00	0.36
82	000959	首钢股份	338,900	1,253,930.00	0.36
83	600019	宝钢股份	254,800	1,248,520.00	0.35
84	600741	华域汽车	88,865	1,244,998.65	0.35
85	600027	华电国际	249,000	1,232,550.00	0.35
86	600073	上海梅林	107,000	1,225,150.00	0.35
87	000401	冀东水泥	110,900	1,175,540.00	0.33
88	600549	厦门钨业	39,100	1,161,661.00	0.33
89	002057	中钢天源	75,300	1,133,265.00	0.32
90	600259	广晟有色	19,100	1,093,666.00	0.31
91	000969	安泰科技	77,600	1,088,728.00	0.31
92	600366	宁波韵升	45,300	1,081,311.00	0.31
93	600392	盛和资源	65,600	1,074,528.00	0.31
94	600111	北方稀土	80,100	1,066,131.00	0.30
95	600980	北矿科技	35,900	1,037,510.00	0.29
96	300035	中科电气	68,000	935,680.00	0.27
97	300192	科斯伍德	69,500	884,735.00	0.25
98	002627	宜昌交运	41,292	873,738.72	0.25
99	600093	禾嘉股份	67,300	835,193.00	0.24
100	600302	标准股份	98,900	830,760.00	0.24
101	300346	南大光电	17,700	791,721.00	0.22
102	600239	云南城投	166,100	770,704.00	0.22
103	600318	新力金融	27,500	738,100.00	0.21
104	000020	深华发 A	33,600	729,792.00	0.21
105	300025	华星创业	50,000	717,000.00	0.20
106	600862	中航高科	49,700	704,746.00	0.20
107	002593	日上集团	92,300	703,326.00	0.20
108	300045	华力创通	36,200	693,230.00	0.20
109	002490	山东墨龙	77,800	691,642.00	0.20
110	000059	华锦股份	73,600	684,480.00	0.19
111	002536	西泵股份	43,800	660,942.00	0.19
112	002213	特尔佳	33,400	660,318.00	0.19
113	000572	海马汽车	126,200	654,978.00	0.19
114	600330	天通股份	47,000	654,710.00	0.19
115	600399	抚顺特钢	96,900	626,943.00	0.18
116	002516	旷达科技	103,300	622,899.00	0.18
117	000561	烽火电子	55,900	621,608.00	0.18
118	601390	中国中铁	88,800	618,936.00	0.18
119	002460	赣锋锂业	17,000	568,650.00	0.16
120	603979	金诚信	23,700	568,563.00	0.16
121	002149	西部材料	17,800	567,464.00	0.16
122	000657	中钨高新	36,700	556,005.00	0.16
123	300340	科恒股份	7,000	554,610.00	0.16
124	601958	金钼股份	66,600	542,790.00	0.15
125	000697	炼石有色	23,700	541,545.00	0.15
126	000762	西藏矿业	21,900	541,368.00	0.15
127	603993	洛阳钼业	130,000	539,500.00	0.15
128	600478	科力远	44,300	534,701.00	0.15
129	002428	云南锗业	31,000	532,580.00	0.15

130	000758	中色股份	67,700	524,675.00	0.15
131	600058	五矿发展	27,900	523,683.00	0.15
132	000795	英洛华	57,200	521,092.00	0.15
133	000970	中科三环	35,800	519,458.00	0.15
134	600206	有研新材	38,600	519,170.00	0.15
135	002466	天齐锂业	12,120	517,402.80	0.15
136	300224	正海磁材	22,700	514,609.00	0.15
137	002600	江粉磁材	42,500	513,400.00	0.15
138	000599	青岛双星	73,800	507,744.00	0.14
139	300127	银河磁体	19,900	507,052.00	0.14
140	002056	横店东磁	29,700	504,900.00	0.14
141	603399	新华龙	42,300	486,027.00	0.14
142	600459	贵研铂业	15,200	454,176.00	0.13
143	000906	物产中拓	38,000	451,060.00	0.13
144	000900	现代投资	66,100	445,514.00	0.13
145	600505	西昌电力	49,700	443,324.00	0.13
146	002249	大洋电机	30,700	367,479.00	0.10
147	002716	金贵银业	19,700	366,420.00	0.10
148	002182	云海金属	18,400	366,160.00	0.10
149	600456	宝钛股份	17,600	354,112.00	0.10
150	000426	兴业矿业	45,200	339,904.00	0.10
151	600529	山东药玻	19,300	339,873.00	0.10
152	300138	晨光生物	20,300	339,010.00	0.10
153	600159	大龙地产	71,100	332,037.00	0.09
154	002378	章源钨业	29,100	304,095.00	0.09
155	300303	聚飞光电	22,900	217,779.00	0.06
156	300063	天龙集团	6,200	184,636.00	0.05
157	000967	盈峰环境	8,100	179,739.00	0.05
158	000892	星美联合	12,400	175,460.00	0.05
159	002602	世纪华通	9,200	170,476.00	0.05
160	002668	奥马电器	2,800	170,436.00	0.05
161	002487	大金重工	19,200	169,920.00	0.05
162	002060	粤水电	24,600	169,002.00	0.05
163	000429	粤高速 A	30,600	168,300.00	0.05
164	002242	九阳股份	9,200	167,256.00	0.05
165	002110	三钢闽光	27,600	166,704.00	0.05
166	000510	金路集团	23,500	165,440.00	0.05
167	002648	卫星石化	18,300	165,432.00	0.05
168	600644	乐山电力	20,200	165,236.00	0.05
169	000948	南天信息	8,500	164,135.00	0.05
170	002015	霞客环保	17,000	162,860.00	0.05
171	000863	三湘股份	17,600	161,920.00	0.05
172	002417	三元达	10,400	158,392.00	0.04
173	300345	红宇新材	13,600	142,256.00	0.04
174	000002	万科 A	6,900	125,580.00	0.04
175	000415	渤海金控	17,100	116,622.00	0.03
176	000419	通程控股	15,700	114,296.00	0.03
177	002300	太阳电缆	11,600	112,868.00	0.03
178	601999	出版传媒	11,800	112,336.00	0.03
179	002233	塔牌集团	13,900	111,617.00	0.03

180	600082	海泰发展	19,200	111,168.00	0.03
181	600187	国中水务	24,700	110,162.00	0.03
182	600162	香江控股	25,200	105,588.00	0.03
183	002297	博云新材	6,600	86,394.00	0.02
184	002065	东华软件	1,300	24,336.00	0.01
185	002129	中环股份	2,100	17,409.00	0.00
186	002062	宏润建设	85	503.20	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	601998	中信银行	23,504,076.92	5.69
2	000001	平安银行	23,250,625.40	5.63
3	601166	兴业银行	19,363,936.29	4.69
4	600000	浦发银行	18,869,692.83	4.57
5	601398	工商银行	16,327,318.00	3.96
6	601328	交通银行	13,413,410.28	3.25
7	600109	国金证券	13,087,856.03	3.17
8	600015	华夏银行	12,813,965.75	3.10
9	000783	长江证券	12,806,011.04	3.10
10	601318	中国平安	10,528,677.73	2.55
11	002128	露天煤业	9,557,583.62	2.32
12	600958	东方证券	9,242,865.00	2.24
13	601918	*ST 新集	9,081,668.80	2.20
14	601288	农业银行	8,723,939.00	2.11
15	601788	光大证券	7,675,174.94	1.86
16	002736	国信证券	7,547,519.06	1.83
17	002142	宁波银行	7,415,837.10	1.80
18	601009	南京银行	7,045,049.02	1.71
19	601186	中国铁建	6,934,341.64	1.68
20	601988	中国银行	6,564,575.00	1.59

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	26,623,106.79	6.45
2	601398	工商银行	23,016,677.32	5.58
3	601601	中国太保	21,478,850.81	5.20
4	601166	兴业银行	19,503,888.10	4.73
5	600015	华夏银行	18,954,634.57	4.59
6	601288	农业银行	18,317,137.00	4.44
7	601998	中信银行	17,129,532.57	4.15
8	601328	交通银行	15,639,670.50	3.79
9	601818	光大银行	15,545,788.77	3.77
10	600109	国金证券	14,764,882.59	3.58

11	000001	平安银行	14,542,397.78	3.52
12	600000	浦发银行	14,491,568.77	3.51
13	600016	民生银行	13,244,564.72	3.21
14	601988	中国银行	12,847,787.99	3.11
15	002736	国信证券	12,334,066.41	2.99
16	600518	康美药业	12,140,106.72	2.94
17	601788	光大证券	11,818,676.40	2.86
18	601668	中国建筑	11,324,186.84	2.74
19	601985	中国核电	9,938,987.94	2.41
20	601211	国泰君安	9,937,091.58	2.41
21	002128	露天煤业	9,712,049.00	2.35
22	601669	中国电建	8,322,771.04	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	1,089,611,242.92
卖出股票的收入（成交）总额	1,126,731,111.23

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	50,582.50	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,582.50	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	40,807.30	0.01
2	110034	九州转债	80	9,775.20	0.00

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申万宏源（000166）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。申万宏源股份有限公司 2015 年 11 月 7 日发布公告称，因未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，公司下属子公司申万宏源证券有限公司被中国证监会采取行政监管措施。

对该股票投资决策程序的说明：

7.12.2 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。

7.12.3 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	176,648.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,309.04
5	应收申购款	47,519.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	240,477.87

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	40,807.30	0.01

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
16,530.00	15,185.42	43,215,401.29	17.22%	207,799,594.33	82.78%

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	167,401.36	0.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	10-50

注：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；

§ 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
本报告期期初基金份额总额	254,175,225.49
本报告期基金总申购份额	15,203,381.19
减：本报告期基金总赎回份额	18,363,611.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	251,014,995.62

§ 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

本报告期内，基金管理人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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银证券	1	323,583,737.47	14.60%	301,359.14	16.73%	-
招商证券	3	258,960,231.04	11.69%	219,545.44	12.19%	-
华创证券	2	234,983,510.71	10.60%	171,843.44	9.54%	-
第一创业	1	232,085,080.85	10.47%	169,724.17	9.42%	-
民生证券	1	168,004,545.36	7.58%	122,861.07	6.82%	-
安信证券	2	152,523,727.91	6.88%	111,538.88	6.19%	-
华信证券	1	147,634,526.82	6.66%	107,965.71	5.99%	-
川财证券	1	145,203,220.77	6.55%	106,187.03	5.90%	-
中信建投	2	143,193,854.60	6.46%	133,355.90	7.40%	-
国泰君安	4	139,323,545.25	6.29%	129,752.88	7.20%	-
东北证券	1	125,017,724.76	5.64%	91,425.86	5.08%	-
中金公司	2	49,468,196.92	2.23%	46,070.04	2.56%	-
兴业证券	1	48,973,553.63	2.21%	45,607.92	2.53%	新增 1 个
长江证券	2	46,974,777.71	2.12%	43,747.65	2.43%	-
中信证券	4	-	-	-	-	-

万联证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
新时代	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

高华证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	博时特许价值混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-20
2	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中信期货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	2016-03-09
3	关于博时旗下部分开放式基金增加海银基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-25
4	博时特许价值混合型证券投资基金 2015 年年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
5	博时特许价值混合型证券投资基金 2015 年年度报告(正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
6	关于博时旗下部分开放式基金增加北京葱次	中国证券报、上海证券	2016-03-29

	方资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	报、证券时报	
7	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	2016-04-01
8	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	2016-04-11
9	关于博时旗下部分开放式基金增加北京懒猫金融信息服务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	2016-04-20
10	博时特许价值混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-22
11	关于博时旗下部分开放式基金增加北京植信基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-26
12	关于博时旗下部分开放式基金增加德州银行股份有限公司为代销机构并参加其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	2016-04-27
13	关于博时旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行基金通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	2016-05-05
14	关于博时旗下部分开放式基金增加大连网金金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-06
15	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-25
16	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-26
17	关于博时旗下部分开放式基金增加新增乾道金融信息服务(北京)有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-27
18	关于博时旗下部分开放式基金增加星展银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-27
19	关于博时旗下部分开放式基金增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为代销机构公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-01
20	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海凯恩斯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	2016-06-06
21	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金的申购、定投、最低持有数量限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-08
22	关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-16
23	关于博时旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-24
24	关于博时旗下部分基金继续参加交通银行网上及手机银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-30

§ 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
二〇一六年八月二十五日