

**博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券
投资基金
2017 年半年度报告摘要
2017 年 6 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十四日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时银智大数据 100
基金主代码	002588
交易代码	002588
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 20 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	183,445,757.46 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,050,791.88
本期利润	10,432,735.63
本期加权平均净值利润率	6.43%
本期基金份额净值增长率	7.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.1221
期末基金资产净值	230,825,174.72
期末基金份额净值	1.2583

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	6.71%	0.68%	4.98%	0.66%	1.73%	0.02%
过去三个月	5.75%	0.77%	0.95%	0.81%	4.80%	-0.04%
过去六个月	7.01%	0.76%	3.49%	0.79%	3.52%	-0.03%
过去一年	15.47%	0.83%	13.85%	0.85%	1.62%	-0.02%
自基金合同生效起至今	25.83%	0.90%	26.77%	0.93%	-0.94%	-0.03%

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2017 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理

186 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 6357.79 亿元人民币，其中公募基金规模逾 3763.55 亿元人民币，累计分红逾 814 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2017 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时深证基本面 200ETF 今年以来净值增长率为 16.07%，在同类 104 只基金中排名前 10，博时裕富沪深 300 指数、博时上证 50ETF 等今年以来净值增长率排名前 1/5；股票型分级子基金里，博时中证银行指数分级 B 今年以来净值增长率为 20.90%，在同类 128 只基金中排名前 1/6；混合偏股型基金中，博时主题行业今年以来净值增长率为 12.13%，在同类基金排名位居前 1/4；混合灵活配置型基金中，博时产业新动力、博时互联网主题基金今年以来净值增长率分别为 8.95%、8.40%，在同类基金中排名均位于前 1/4。

保本型基金中，博时保泰保本混合基金今年以来净值增长率在同类 137 只中排名前 1/3；绝对收益目标基金里，博时新起点灵活配置混合今年以来净值增长率在同类基金中排名前 10。

黄金基金类，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率 3.67%，在同类 14 只中排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债 (A 类)、博时裕昂纯债债券基金今年以来净值增长率在同类 797 只排名前 1/10；普通债券型基金中，博时信用债券基金、博时天颐债券基金今年以来净值增长率在 417 只中排名前 1/10；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率在 631 只同类基金中排名前 1/4；转债基金方面，博时转债增强债券 (A 类) 今年以来收益率 3.78%，同类排名第一。

QDII 基金方面，博时大中华亚太精选股票基金 (QDII)、博时大中华亚太精选股票基金 (QDII) (美元)，今年以来净值增长率分别为 13.46%、15.92%，同类排名前 1/2、1/4。

2、其他大事件

2017 年 6 月 23 日，由南方日报社主办的“2017 年南方金融峰会暨第六届金榕奖颁奖典礼”在广州举行，博时基金获得“年度资产管理优秀奖”。

2017 年 6 月 17 日，由中国证券报主办的“全球配置时代海外投资动力与机遇——首届海外基金金牛奖颁奖典礼暨高端论坛”在深召开，博时基金海外全资子公司博时基金 (国际) 有限公司荣获“一年期海外金牛私募管理公司 (固定收益策略)”。

2017 年 5 月 12 日，由中国基金报主办的第四届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在深召开。博时摘得“2016 年度十大明星基金公司奖”和“2016 年度固定收益投资明星团队奖”两项公司类大奖，博时双月薪和博时稳定价值获“三年持续回报普通债券型明星基金奖”、博时新财富获“2016 年度绝对收益明星基金奖”、博时信用债纯债获“2016 年度积极债券型明星基金奖”、博时信用债券获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2017 年 4 月 25 日，博时基金在 2017 中国基金业峰会暨第十四届中国“金基金”奖颁奖典礼上，获得“2016 年度金基金·TOP 公司奖”。

2017 年 4 月 25 日，在由中国基金报主办的第四届中国基金业英华奖颁奖典礼暨高峰论坛上，博时基金过钧获评“三年期二级债最佳基金经理”、“五年期二级债最佳基金经理”，陈凯杨获评“三年期纯

债型最佳基金经理”。

2017 年 4 月 8 日，在第十四届中国基金业金牛奖颁奖典礼上，博时基金被评为“2016 年度固定收益投资金牛基金公司”，旗下博时卓越品牌混合（160512）被评为“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”、博时主题行业（160505）获“2016 年度开放式混合型金牛基金”、博时信用债券（050011）获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”、博时信用债纯债债券（050027）获“2016 年度开放式债券型金牛基金”。

2017 年 3 月 10 日，由中国工商银行私人银行部举办的“第十八届资本市场投资论坛会议”在杭州落下帷幕。工行私行对管理人的过往表现给予充分肯定并对 2016 年表现突出的管理人进行了表彰，博时基金荣获“2016 年度优秀管理人奖”。

2017 年 2 月 22 日，第二届中国基金业营销创新高峰论坛暨“金果奖”颁奖典礼在京举办，博时基金一举斩获最佳品牌形象建设奖、最具创新精神奖、最佳自媒体建设奖三项大奖。

2017 年 1 月 19 日，深交所召开了新一代交易系统上线运行总结会，会上介绍了深交所新一代交易系统运行情况，并表彰了在新一代交易系统上线过程中，积极参与各项准备和测试工作，为系统顺利上线做出突出贡献的单位和个人。博时基金被授予新一代交易系统建设先行者、突出贡献单位殊荣。博时基金信息技术部车宏原、陈小平、祁晓东被授予突出贡献奖殊荣。

2017 年 1 月 16 日，博时基金荣登中央国债登记结算有限责任公司评选的“优秀资产管理机构”榜单，成为全国十家获此殊荣的基金公司之一。

2017 年 1 月 12 日，由华夏时报、新浪财经联合主办的“第十届金蝉奖颁奖典礼”上，博时基金荣获“2016 年度市场营销力公司”奖项。

2017 年 1 月 10 日，由信息时报主办的“2016 年度金狮奖金融行业风云榜”颁奖典礼于广州盛大举办，博时基金斩获“年度最佳投研基金公司”大奖。

2017 年 1 月 6 日，由东方财富网、天天基金网主办的“2016 东方财富风云榜”评选活动于广州举行，博时基金荣膺“2016 年度最佳基金公司”大奖，同时，旗下产品博时银智 100 荣获“2016 年度最受欢迎新发基金奖”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桂征辉	基金经理	2016-05-20	-	7.9	2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理。现任博时沪深 300 指数基金兼博时中证淘金大数据 100 指数基金、博时银智大数据 100 指数基金的基金经理。
杨振建	基金经理助理	2016-05-20	-	3.9	2013 年起先后在中证指数有限公司、中国证监会工作。2015 年

					5 月加入博时基金管理有限公司，曾任高级研究员，现任基金经理助理。
--	--	--	--	--	-----------------------------------

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，A 股市场震荡上行，走出 N 型行情。一月到四月份上证综指连续上涨，一度触及 3280 点，之后市场发生反转，调整到 3000 点左右。5 月中旬止跌反弹。风格方面，市场也由小盘成长切换到大盘价值股，形成漂亮 50 行情。行业方面家电、食品饮料、非银金融等行业涨幅居前，国防军工、农林牧渔和机械行业表现落后，行业内以龙头股为上涨主力。本基金在密切跟踪指数的前提下，利用量化手段采取适当的优化操作，在控制跟踪误差的情况下，相对指数获得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2583 元，累计份额净值为 1.2583 元，报告期内净值增长率为 7.01%，同期业绩基准涨幅为 3.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球复苏但新周期尚不明确，随着价格与利率的趋势反转，全球经济的压力将重现。金融工作会议透露出的监管从严信号将进一步加大金融监管压力，企业去杠杆也将继续进行。政治局会议一方面淡化“稳增长”，强调“调结构”和“防风险”。另一方面强调地方政策债务治理和加强金融

监管协调。CPI 方面，预计同比增速在三季度将温和上行，四季度同比可能低于三季度。周期行业有阶段性行情。“一带一路”战略有望改善出口和自然资源贸易，新兴产业的发展成为“中国制造”转型升级的可能方向，信息化进程的推进可以为经济增长带来正外部性。A 股市场“漂亮 50”为首的大盘价值行情走向极致，市场开始关注二线蓝筹，市场由一九行情逐渐向二八行情扩散。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对博时中证银联智慧大数据100指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时中证银联智惠大数据100指数型证券投资基金2017年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	12,571,952.60	4,847,961.55
结算备付金	2,266,442.27	325,053.96
存出保证金	112,192.97	12,117.80
交易性金融资产	217,617,256.08	55,508,029.76
其中：股票投资	217,617,256.08	55,508,029.76
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	3,687.37	1,029.62
应收股利	-	-
应收申购款	98,443.04	78,260.98

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	232,669,974.33	60,772,453.67
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	455,330.17	68,485.39
应付管理人报酬	145,082.23	39,622.06
应付托管费	18,135.27	4,952.76
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,007,335.29	138,826.72
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	218,916.65	140,090.44
负债合计	1,844,799.61	391,977.37
所有者权益:	-	-
实收基金	183,445,757.46	51,349,762.63
未分配利润	47,379,417.26	9,030,713.67
所有者权益合计	230,825,174.72	60,380,476.30
负债和所有者权益总计	232,669,974.33	60,772,453.67

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2583 元，基金份额总额 183,445,757.46 份。

6.2 利润表

会计主体：博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年5月20日（基金合 同生效日）至2016年6月 30日
一、收入	13,444,245.47	3,575,776.54
1. 利息收入	67,492.43	25,588.73
其中：存款利息收入	61,619.37	25,588.73
债券利息收入	30.28	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,842.78	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-5,220,600.91	1,382,126.13
其中：股票投资收益	-7,084,866.66	1,200,271.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,959.72	-

资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,853,306.03	181,854.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	18,483,527.51	2,026,717.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	113,826.44	141,343.86
减：二、费用	3,011,509.84	199,922.06
1. 管理人报酬	630,718.55	51,270.24
2. 托管费	78,839.81	6,408.78
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,022,169.72	96,850.83
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	279,781.76	45,392.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,432,735.63	3,375,854.48
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,432,735.63	3,375,854.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	51,349,762.63	9,030,713.67	60,380,476.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,432,735.63	10,432,735.63
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）	132,095,994.83	27,915,967.96	160,011,962.79
其中：1. 基金申购款	273,995,949.09	51,077,328.48	325,073,277.57
2. 基金赎回款	-141,899,954.26	-23,161,360.52	-165,061,314.78
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）	183,445,757.46	47,379,417.26	230,825,174.72
项目	上年度可比期间		

	2016年5月20日（基金合同生效日）至2016年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）	218,526,964.07	-	218,526,964.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		3,375,854.48	3,375,854.48
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）	-182,081,376.57	-104,965.86	-182,186,342.43
其中：1. 基金申购款	6,015,991.89	256,120.27	6,272,112.16
2. 基金赎回款	-188,097,368.46	-361,086.13	-188,458,454.59
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）	36,445,587.50	3,270,888.62	39,716,476.12

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 主管会计工作的负责人：王德英 会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债

券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日） 至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	312,609,571.97	21.44%	37,961,144.94	47.55%

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 债券交易

无。

6.4.4.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

招商证券	291,140.60	23.51%	291,140.60	28.90%
关联方名称	上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日）至2016年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	35,350.13	53.02%	35,350.13	53.02%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日） 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	630,718.55	51,270.24
其中：支付销售机构的客户维护费	69,219.29	11,429.98

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日） 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	78,839.81	6,408.78

6.4.4.2.3 销售服务费

无。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日） 至2016年6月30日
期初持有的基金份额	9,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总 份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.45%	-

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年5月20日（基金合同生效日）至 2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	12,571,952.60	50,785.32	3,249,634.83	25,119.15

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金在承销期内未买入关联方所承销的证券（2016年可比期间：同）。

6.4.5 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券
6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603933	睿能科技	2017-6-28	2017-7-6	未上市	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
300670	大烨智能	2017-6-26	2017-7-3	未上市	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-6-30	2017-7-12	未上市	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-6-27	2017-7-5	未上市	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-6-27	2017-7-5	未上市	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-6-23	2017-7-3	未上市	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
603305	旭升股份	2017-6-30	2017-7-10	未上市	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000034	神州数码	2017-3-21	重大资产重组	24.45	2017-7-18	22.01	95,000	2,231,322.95	2,322,750.00	
601989	中国重工	2017-5-31	重大资产重组	6.21	-	-	209,900	1,359,666.00	1,303,479.00	
601919	中远海控	2017-5-17	重大资产重组	5.35	2017-7-26	5.89	148,900	797,269.00	796,615.00	
000153	丰原药业	2017-1-16	重大资产重组	12.52	2017-7-12	11.27	5,100	66,809.00	63,852.00	
601717	郑煤机	2017-4-24	重大资产重组	7.79	-	-	193,000	1,665,256.51	1,503,470.00	

本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 211,545,456.44 元，属于第二层次的余额为 6,071,799.64 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 54,008,745.76 元，属于第二层次的余额为 1,499,284.00 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

§ 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	217,617,256.08	93.53
	其中：股票	217,617,256.08	93.53
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	14,838,394.87	6.38
7	其他各项资产	214,323.38	0.09

8	合计	232,669,974.33	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,449,486.00	0.63
B	采矿业	7,440,820.00	3.22
C	制造业	78,443,776.90	33.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,168,371.00	2.67
E	建筑业	9,993,658.00	4.33
F	批发和零售业	8,731,204.07	3.78
G	交通运输、仓储和邮政业	5,590,916.00	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,679,253.62	2.46
J	金融业	75,313,322.49	32.63
K	房地产业	11,291,156.00	4.89
L	租赁和商务服务业	2,296,998.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,176,947.00	1.38
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	2,041,347.00	0.88
S	综合	-	-
	合计	217,617,256.08	94.28

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	264,900	13,141,689.00	5.69
2	601166	兴业银行	389,200	6,561,912.00	2.84
3	600016	民生银行	749,900	6,164,178.00	2.67
4	000651	格力电器	143,800	5,920,246.00	2.56
5	600519	贵州茅台	11,400	5,379,090.00	2.33
6	600036	招商银行	214,100	5,119,131.00	2.22
7	600030	中信证券	294,600	5,014,092.00	2.17
8	601288	农业银行	1,374,500	4,838,240.00	2.10
9	601668	中国建筑	473,800	4,586,384.00	1.99
10	000002	万科 A	176,600	4,409,702.00	1.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	15,433,105.44	25.56
2	601166	兴业银行	12,086,768.51	20.02
3	600016	民生银行	9,938,166.62	16.46
4	601818	光大银行	9,656,336.00	15.99
5	601288	农业银行	8,910,094.00	14.76
6	601939	建设银行	8,151,675.00	13.50
7	600276	恒瑞医药	7,857,273.81	13.01
8	601601	中国太保	7,187,682.13	11.90
9	600519	贵州茅台	7,177,530.98	11.89
10	601668	中国建筑	6,707,875.00	11.11
11	601211	国泰君安	6,660,639.00	11.03
12	000858	五粮液	6,097,280.59	10.10
13	600104	上汽集团	6,069,303.87	10.05
14	600030	中信证券	5,717,082.74	9.47
15	000651	格力电器	5,690,625.73	9.42
16	600019	宝钢股份	5,676,279.53	9.40
17	600741	华域汽车	5,538,349.19	9.17
18	600015	华夏银行	5,282,440.00	8.75
19	601186	中国铁建	4,947,066.57	8.19
20	000895	双汇发展	4,923,766.48	8.15
21	600887	伊利股份	4,923,108.52	8.15
22	600048	保利地产	4,784,841.00	7.92
23	600036	招商银行	4,767,272.74	7.90
24	600028	中国石化	4,754,068.00	7.87
25	601328	交通银行	4,731,996.54	7.84
26	600383	金地集团	4,728,801.78	7.83
27	000415	渤海金控	4,687,118.38	7.76
28	601899	紫金矿业	4,651,798.00	7.70
29	000900	现代投资	4,628,870.62	7.67
30	600900	长江电力	4,480,688.05	7.42
31	000725	京东方 A	4,402,952.00	7.29
32	601009	南京银行	4,325,447.29	7.16
33	600282	南钢股份	4,220,306.94	6.99
34	600291	西水股份	3,956,696.79	6.55
35	002048	宁波华翔	3,952,507.52	6.55
36	002636	金安国纪	3,866,474.00	6.40
37	002463	沪电股份	3,858,596.00	6.39
38	600035	楚天高速	3,819,283.56	6.33
39	600335	国机汽车	3,812,731.96	6.31
40	000066	中国长城	3,656,507.47	6.06
41	600708	光明地产	3,653,104.64	6.05
42	002611	东方精工	3,605,155.22	5.97
43	000036	华联控股	3,571,089.26	5.91

44	600502	安徽水利	3,409,004.36	5.65
45	600816	安信信托	3,407,640.80	5.64
46	000921	海信科龙	3,389,262.00	5.61
47	000531	穗恒运 A	3,370,582.64	5.58
48	600230	沧州大化	3,336,637.00	5.53
49	000002	万科 A	3,322,930.00	5.50
50	000863	三湘印象	3,250,276.87	5.38
51	000528	柳工	3,230,298.49	5.35
52	000910	大亚圣象	3,185,943.50	5.28
53	600782	新钢股份	3,167,648.53	5.25
54	000400	许继电气	3,152,531.00	5.22
55	600757	长江传媒	3,125,113.52	5.18
56	000069	华侨城 A	3,103,954.08	5.14
57	600856	中天能源	3,061,229.83	5.07
58	600475	华光股份	3,028,657.40	5.02
59	600309	万华化学	3,024,804.31	5.01
60	600308	华泰股份	2,950,746.98	4.89
61	000333	美的集团	2,935,803.00	4.86
62	000936	华西股份	2,932,586.23	4.86
63	600073	上海梅林	2,886,933.79	4.78
64	600808	马钢股份	2,880,549.00	4.77
65	000166	申万宏源	2,874,780.07	4.76
66	000876	新希望	2,872,287.78	4.76
67	601390	中国中铁	2,858,420.00	4.73
68	601988	中国银行	2,856,244.00	4.73
69	002157	正邦科技	2,853,578.00	4.73
70	600056	中国医药	2,813,225.81	4.66
71	002050	三花智控	2,808,942.00	4.65
72	000338	潍柴动力	2,803,088.78	4.64
73	601636	旗滨集团	2,798,904.00	4.64
74	601006	大秦铁路	2,795,967.66	4.63
75	002309	中利集团	2,766,844.51	4.58
76	600373	中文传媒	2,749,874.08	4.55
77	002078	太阳纸业	2,740,773.00	4.54
78	600637	东方明珠	2,698,254.99	4.47
79	601155	新城控股	2,681,411.12	4.44
80	601607	上海医药	2,648,850.24	4.39
81	002244	滨江集团	2,640,760.00	4.37
82	600029	南方航空	2,635,863.00	4.37
83	002368	太极股份	2,629,194.87	4.35
84	002238	天威视讯	2,625,919.14	4.35
85	600170	上海建工	2,605,148.00	4.31
86	300241	瑞丰光电	2,581,923.26	4.28
87	600031	三一重工	2,571,240.00	4.26
88	000402	金融街	2,562,418.72	4.24
89	000630	铜陵有色	2,550,088.00	4.22
90	000425	徐工机械	2,543,722.00	4.21
91	002440	闰土股份	2,543,356.45	4.21
92	300120	经纬电材	2,520,751.63	4.17
93	300116	坚瑞沃能	2,484,251.54	4.11

94	300184	力源信息	2,470,685.00	4.09
95	000822	山东海化	2,462,283.00	4.08
96	601699	潞安环能	2,426,423.80	4.02
97	600720	祁连山	2,424,278.41	4.02
98	002273	水晶光电	2,396,931.34	3.97
99	600711	盛屯矿业	2,388,535.00	3.96
100	600761	安徽合力	2,379,183.82	3.94
101	002714	牧原股份	2,353,400.43	3.90
102	600694	大商股份	2,348,259.40	3.89
103	000878	云南铜业	2,336,674.59	3.87
104	300227	光韵达	2,334,201.52	3.87
105	300344	太空板业	2,327,592.37	3.85
106	002674	兴业科技	2,315,351.60	3.83
107	600409	三友化工	2,314,322.23	3.83
108	600801	华新水泥	2,311,650.00	3.83
109	300040	九洲电气	2,308,885.53	3.82
110	000023	深天地 A	2,308,648.35	3.82
111	601137	博威合金	2,305,363.12	3.82
112	600697	欧亚集团	2,296,797.88	3.80
113	300303	聚飞光电	2,291,523.48	3.80
114	000685	中山公用	2,289,638.30	3.79
115	000034	神州数码	2,287,693.21	3.79
116	600191	华资实业	2,284,463.99	3.78
117	600166	福田汽车	2,281,782.00	3.78
118	600677	航天通信	2,280,608.74	3.78
119	000568	泸州老窖	2,277,474.77	3.77
120	600121	*ST 郑煤	2,272,218.20	3.76
121	002637	赞宇科技	2,268,693.88	3.76
122	300138	晨光生物	2,263,323.46	3.75
123	600661	新南洋	2,260,801.95	3.74
124	600966	博汇纸业	2,260,240.91	3.74
125	600348	阳泉煤业	2,256,065.00	3.74
126	600235	民丰特纸	2,255,664.45	3.74
127	600675	中华企业	2,253,445.52	3.73
128	002295	精艺股份	2,252,083.44	3.73
129	600522	中天科技	2,246,533.00	3.72
130	600183	生益科技	2,242,396.85	3.71
131	002179	中航光电	2,241,396.84	3.71
132	600051	宁波联合	2,226,969.18	3.69
133	300082	奥克股份	2,225,053.00	3.69
134	600755	厦门国贸	2,224,819.66	3.68
135	000004	国农科技	2,219,414.96	3.68
136	600153	建发股份	2,216,674.72	3.67
137	300046	台基股份	2,212,632.58	3.66
138	000070	特发信息	2,211,613.75	3.66
139	000587	金洲慈航	2,211,538.00	3.66
140	600057	象屿股份	2,204,764.16	3.65
141	002247	帝龙文化	2,193,205.84	3.63
142	000890	法尔胜	2,190,625.00	3.63
143	600466	蓝光发展	2,187,683.01	3.62

144	600510	黑牡丹	2,176,466.84	3.60
145	600961	株冶集团	2,175,832.76	3.60
146	300063	天龙集团	2,168,043.92	3.59
147	002420	毅昌股份	2,163,715.37	3.58
148	300302	同有科技	2,160,636.43	3.58
149	600958	东方证券	2,160,166.00	3.58
150	300080	易成新能	2,154,383.67	3.57
151	600518	康美药业	2,146,073.00	3.55
152	600873	梅花生物	2,143,861.16	3.55
153	000662	天夏智慧	2,135,052.15	3.54
154	000501	鄂武商 A	2,134,618.44	3.54
155	002580	圣阳股份	2,130,755.78	3.53
156	002416	爱施德	2,127,016.40	3.52
157	002645	华宏科技	2,118,591.19	3.51
158	002088	鲁阳节能	2,113,704.42	3.50
159	300112	万讯自控	2,098,326.68	3.48
160	002458	益生股份	2,076,077.47	3.44
161	002182	云海金属	2,060,839.66	3.41
162	002148	北纬通信	2,055,717.32	3.40
163	002106	莱宝高科	2,052,470.00	3.40
164	600487	亨通光电	2,040,220.04	3.38
165	601233	桐昆股份	2,035,879.71	3.37
166	002083	孚日股份	2,019,031.52	3.34
167	000030	富奥股份	2,018,043.82	3.34
168	002511	中顺洁柔	2,012,799.94	3.33
169	600529	山东药玻	2,011,079.00	3.33
170	600565	迪马股份	2,010,878.00	3.33
171	600067	冠城大通	2,005,037.36	3.32
172	002006	精功科技	2,000,608.59	3.31
173	600690	青岛海尔	1,998,687.71	3.31
174	000990	诚志股份	1,997,648.04	3.31
175	000488	晨鸣纸业	1,997,278.00	3.31
176	000768	中航飞机	1,983,755.21	3.29
177	600389	江山股份	1,982,931.05	3.28
178	002462	嘉事堂	1,969,394.64	3.26
179	600327	大东方	1,966,148.29	3.26
180	300293	蓝英装备	1,959,989.26	3.25
181	600499	科达洁能	1,948,841.00	3.23
182	002171	楚江新材	1,943,027.92	3.22
183	002567	唐人神	1,931,943.99	3.20
184	300233	金城医药	1,926,532.34	3.19
185	000938	紫光股份	1,924,748.94	3.19
186	600060	海信电器	1,917,790.40	3.18
187	600452	涪陵电力	1,910,256.40	3.16
188	300338	开元股份	1,890,380.87	3.13
189	000521	美菱电器	1,885,203.00	3.12
190	002491	通鼎互联	1,877,823.54	3.11
191	300310	宜通世纪	1,876,700.20	3.11
192	600325	华发股份	1,874,740.28	3.10
193	300401	花园生物	1,874,155.90	3.10

194	300141	和顺电气	1,864,915.70	3.09
195	600258	首旅酒店	1,863,808.97	3.09
196	300365	恒华科技	1,863,609.10	3.09
197	600585	海螺水泥	1,861,826.52	3.08
198	600216	浙江医药	1,856,890.78	3.08
199	600252	中恒集团	1,851,928.00	3.07
200	000960	锡业股份	1,848,357.20	3.06
201	002597	金禾实业	1,847,881.00	3.06
202	600098	广州发展	1,829,997.41	3.03
203	600285	羚锐制药	1,829,698.70	3.03
204	600765	中航重机	1,823,833.00	3.02
205	002079	苏州固锝	1,822,474.00	3.02
206	600368	五洲交通	1,817,025.57	3.01
207	601677	明泰铝业	1,810,823.11	3.00
208	600617	国新能源	1,803,557.49	2.99
209	300130	新国都	1,801,964.04	2.98
210	000667	美好置业	1,795,243.00	2.97
211	002101	广东鸿图	1,790,951.04	2.97
212	002231	奥维通信	1,790,105.67	2.96
213	002037	久联发展	1,787,628.90	2.96
214	600990	四创电子	1,783,045.54	2.95
215	600744	华银电力	1,780,974.00	2.95
216	600268	国电南自	1,780,932.19	2.95
217	002534	杭锅股份	1,780,795.00	2.95
218	600853	龙建股份	1,778,249.77	2.95
219	600835	上海机电	1,775,943.03	2.94
220	600511	国药股份	1,773,615.03	2.94
221	002232	启明信息	1,772,177.06	2.94
222	000411	英特集团	1,772,067.00	2.93
223	300448	浩云科技	1,769,223.18	2.93
224	000550	江铃汽车	1,767,886.02	2.93
225	002019	亿帆医药	1,766,169.70	2.93
226	300252	金信诺	1,764,160.95	2.92
227	300407	凯发电气	1,757,081.30	2.91
228	002739	万达电影	1,756,636.00	2.91
229	601566	九牧王	1,755,980.22	2.91
230	002139	拓邦股份	1,755,174.72	2.91
231	002003	伟星股份	1,743,199.36	2.89
232	600287	江苏舜天	1,737,247.32	2.88
233	000016	深康佳 A	1,726,297.00	2.86
234	600077	宋都股份	1,725,882.96	2.86
235	300287	飞利信	1,720,113.37	2.85
236	000932	*ST 华菱	1,716,093.36	2.84
237	000783	长江证券	1,711,267.00	2.83
238	600997	开滦股份	1,710,565.51	2.83
239	603026	石大胜华	1,703,772.75	2.82
240	002502	骅威文化	1,703,068.09	2.82
241	601666	平煤股份	1,694,383.00	2.81
242	300121	阳谷华泰	1,680,587.82	2.78
243	000601	韶能股份	1,673,829.00	2.77

244	601717	郑煤机	1,665,256.51	2.76
245	000703	恒逸石化	1,655,562.60	2.74
246	002582	好想你	1,639,602.31	2.72
247	601678	滨化股份	1,638,150.52	2.71
248	601336	新华保险	1,638,033.01	2.71
249	002615	哈尔斯	1,618,788.67	2.68
250	000686	东北证券	1,611,163.92	2.67
251	601099	太平洋	1,599,168.00	2.65
252	002626	金达威	1,552,492.50	2.57
253	000001	平安银行	1,551,024.00	2.57
254	000063	中兴通讯	1,523,333.17	2.52
255	600000	浦发银行	1,516,324.00	2.51
256	000541	佛山照明	1,495,528.98	2.48
257	000830	鲁西化工	1,495,441.00	2.48
258	002736	国信证券	1,467,398.74	2.43
259	002574	明牌珠宝	1,461,089.47	2.42
260	600203	福日电子	1,426,321.66	2.36
261	601169	北京银行	1,423,969.28	2.36
262	002027	分众传媒	1,394,670.68	2.31
263	601989	中国重工	1,359,666.00	2.25
264	600644	乐山电力	1,298,787.60	2.15
265	002456	欧菲光	1,287,135.71	2.13
266	002507	涪陵榨菜	1,263,431.00	2.09
267	601600	中国铝业	1,248,741.00	2.07

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	601939	建设银行	8,403,071.00	13.92
2	600276	恒瑞医药	7,560,920.80	12.52
3	601818	光大银行	6,888,486.00	11.41
4	601166	兴业银行	6,701,757.43	11.10
5	601318	中国平安	6,040,123.95	10.00
6	000900	现代投资	5,229,172.55	8.66
7	601601	中国太保	5,112,802.00	8.47
8	600291	西水股份	4,750,759.09	7.87
9	000921	海信科龙	4,554,766.60	7.54
10	600741	华域汽车	4,550,850.18	7.54
11	000895	双汇发展	4,507,718.96	7.47
12	601009	南京银行	4,446,715.00	7.36
13	600335	国机汽车	4,271,089.27	7.07
14	601288	农业银行	4,231,540.00	7.01
15	000858	五粮液	4,228,680.49	7.00
16	600282	南钢股份	4,168,546.30	6.90
17	600016	民生银行	4,085,459.54	6.77
18	600104	上汽集团	3,969,801.72	6.57
19	002048	宁波华翔	3,940,455.82	6.53
20	000036	华联控股	3,919,198.13	6.49
21	000415	渤海金控	3,918,460.50	6.49

22	002463	沪电股份	3,852,338.82	6.38
23	002636	金安国纪	3,815,520.26	6.32
24	600035	楚天高速	3,706,598.67	6.14
25	600816	安信信托	3,488,728.91	5.78
26	600019	宝钢股份	3,412,691.24	5.65
27	000066	中国长城	3,357,325.58	5.56
28	601636	旗滨集团	3,349,580.04	5.55
29	600230	沧州大化	3,333,674.18	5.52
30	600708	光明地产	3,247,433.18	5.38
31	600028	中国石化	3,174,713.84	5.26
32	000531	穗恒运 A	3,077,428.20	5.10
33	000910	大亚圣象	3,040,631.78	5.04
34	601211	国泰君安	2,979,529.23	4.93
35	600502	安徽水利	2,968,436.82	4.92
36	000863	三湘印象	2,960,894.43	4.90
37	600475	华光股份	2,943,505.30	4.87
38	002611	东方精工	2,930,523.30	4.85
39	300344	太空板业	2,922,120.81	4.84
40	300184	力源信息	2,887,540.00	4.78
41	000876	新希望	2,858,683.02	4.73
42	002148	北纬通信	2,854,155.72	4.73
43	300138	晨光生物	2,817,071.64	4.67
44	300116	坚瑞沃能	2,811,628.99	4.66
45	601155	新城控股	2,810,141.93	4.65
46	002157	正邦科技	2,802,991.77	4.64
47	600755	厦门国贸	2,791,552.94	4.62
48	601390	中国中铁	2,787,808.12	4.62
49	600056	中国医药	2,751,460.71	4.56
50	600073	上海梅林	2,750,500.20	4.56
51	000004	国农科技	2,722,022.23	4.51
52	600782	新钢股份	2,719,540.36	4.50
53	600308	华泰股份	2,693,993.89	4.46
54	600183	生益科技	2,688,999.00	4.45
55	600887	伊利股份	2,655,408.00	4.40
56	600694	大商股份	2,649,142.96	4.39
57	601233	桐昆股份	2,640,145.91	4.37
58	600258	首旅酒店	2,639,580.80	4.37
59	300046	台基股份	2,622,719.46	4.34
60	600873	梅花生物	2,620,432.95	4.34
61	600373	中文传媒	2,594,560.15	4.30
62	600522	中天科技	2,593,106.00	4.29
63	000070	特发信息	2,582,033.00	4.28
64	002244	滨江集团	2,580,267.27	4.27
65	600744	华银电力	2,563,516.53	4.25
66	300310	宜通世纪	2,551,760.62	4.23
67	000528	柳工	2,546,756.31	4.22
68	300120	经纬电材	2,528,023.07	4.19
69	600166	福田汽车	2,527,849.00	4.19
70	002309	中利集团	2,524,863.41	4.18
71	600170	上海建工	2,495,950.60	4.13

72	002440	闰土股份	2,489,196.00	4.12
73	601668	中国建筑	2,486,029.00	4.12
74	600757	长江传媒	2,467,241.57	4.09
75	002238	天威视讯	2,445,481.91	4.05
76	000521	美菱电器	2,443,333.12	4.05
77	600048	保利地产	2,415,589.00	4.00
78	002273	水晶光电	2,402,391.81	3.98
79	300241	瑞丰光电	2,394,010.90	3.96
80	600285	羚锐制药	2,392,808.98	3.96
81	000630	铜陵有色	2,379,066.04	3.94
82	002491	通鼎互联	2,378,811.31	3.94
83	600711	盛屯矿业	2,368,150.50	3.92
84	600383	金地集团	2,358,865.59	3.91
85	600510	黑牡丹	2,349,958.83	3.89
86	300112	万讯自控	2,348,688.97	3.89
87	600519	贵州茅台	2,338,776.97	3.87
88	600327	大东方	2,328,175.34	3.86
89	000936	华西股份	2,322,405.00	3.85
90	600966	博汇纸业	2,310,019.00	3.83
91	000822	山东海化	2,304,518.08	3.82
92	002645	华宏科技	2,300,762.08	3.81
93	002050	三花智控	2,296,677.46	3.80
94	600808	马钢股份	2,285,366.00	3.78
95	000938	紫光股份	2,271,175.01	3.76
96	000890	法尔胜	2,261,712.51	3.75
97	002458	益生股份	2,227,672.90	3.69
98	000685	中山公用	2,222,234.90	3.68
99	600153	建发股份	2,220,560.00	3.68
100	000402	金融街	2,216,867.44	3.67
101	300303	聚飞光电	2,212,372.02	3.66
102	600661	新南洋	2,203,915.09	3.65
103	300227	光韵达	2,200,823.64	3.64
104	002674	兴业科技	2,194,285.57	3.63
105	002179	中航光电	2,193,481.55	3.63
106	600487	亨通光电	2,192,287.39	3.63
107	600720	XD 祁连山	2,185,657.00	3.62
108	000601	韶能股份	2,179,879.95	3.61
109	000587	金洲慈航	2,177,125.34	3.61
110	600057	象屿股份	2,169,590.97	3.59
111	002511	中顺洁柔	2,156,473.71	3.57
112	300287	飞利信	2,156,087.69	3.57
113	601137	博威合金	2,154,510.76	3.57
114	600325	华发股份	2,143,677.82	3.55
115	000550	江铃汽车	2,141,417.62	3.55
116	002247	帝龙文化	2,140,421.90	3.54
117	002580	圣阳股份	2,140,184.00	3.54
118	601699	潞安环能	2,138,381.02	3.54
119	002182	云海金属	2,136,892.00	3.54
120	600697	欧亚集团	2,127,272.32	3.52
121	600675	中华企业	2,123,988.35	3.52

122	000023	深天地 A	2,123,481.40	3.52
123	000662	天夏智慧	2,122,978.46	3.52
124	300040	九洲电气	2,122,119.00	3.51
125	600060	XD 海信电	2,116,202.37	3.50
126	600121	*ST 郑煤	2,102,172.29	3.48
127	600961	株冶集团	2,089,023.65	3.46
128	600761	安徽合力	2,079,642.87	3.44
129	600677	航天通信	2,076,197.95	3.44
130	002295	精艺股份	2,074,948.51	3.44
131	600801	华新水泥	2,074,425.74	3.44
132	600235	民丰特纸	2,063,770.48	3.42
133	600466	蓝光发展	2,052,986.22	3.40
134	300338	开元股份	2,046,650.52	3.39
135	600765	中航重机	2,045,731.78	3.39
136	002615	哈尔斯	2,036,474.78	3.37
137	000878	云南铜业	2,034,555.13	3.37
138	600051	宁波联合	2,030,926.25	3.36
139	002567	唐人神	2,017,939.98	3.34
140	300302	同有科技	2,011,493.02	3.33
141	002006	精功科技	2,008,822.00	3.33
142	002637	赞宇科技	2,006,047.64	3.32
143	600067	冠城大通	2,000,138.63	3.31
144	600368	五洲交通	1,996,774.41	3.31
145	300080	易成新能	1,996,438.86	3.31
146	002088	鲁阳节能	1,988,907.41	3.29
147	300082	奥克股份	1,986,853.32	3.29
148	002462	嘉事堂	1,984,483.85	3.29
149	600348	阳泉煤业	1,982,080.00	3.28
150	002626	金达威	1,974,039.53	3.27
151	600389	江山股份	1,967,984.26	3.26
152	600015	华夏银行	1,967,467.00	3.26
153	002171	楚江新材	1,957,733.25	3.24
154	002083	孚日股份	1,955,808.05	3.24
155	000488	晨鸣纸业	1,941,305.25	3.22
156	002420	毅昌股份	1,938,113.38	3.21
157	600565	迪马股份	1,935,069.00	3.20
158	600529	山东药玻	1,925,039.00	3.19
159	600499	科达洁能	1,922,396.96	3.18
160	002078	太阳纸业	1,921,652.00	3.18
161	300141	和顺电气	1,918,940.94	3.18
162	600644	乐山电力	1,910,729.01	3.16
163	600511	国药股份	1,909,041.08	3.16
164	600452	涪陵电力	1,907,274.87	3.16
165	300063	天龙集团	1,906,656.00	3.16
166	601899	紫金矿业	1,902,285.00	3.15
167	002597	金禾实业	1,897,933.98	3.14
168	300233	金城医药	1,895,474.76	3.14
169	600191	华资实业	1,887,201.99	3.13
170	600216	浙江医药	1,885,274.71	3.12
171	002574	明牌珠宝	1,875,430.61	3.11

172	000501	鄂武商 A	1,867,231.00	3.09
173	300401	花园生物	1,863,574.35	3.09
174	300293	蓝英装备	1,853,179.89	3.07
175	002139	拓邦股份	1,851,505.00	3.07
176	600835	上海机电	1,846,031.82	3.06
177	600617	国新能源	1,840,645.15	3.05
178	601566	九牧王	1,823,488.34	3.02
179	300407	凯发电气	1,822,562.06	3.02
180	300365	恒华科技	1,818,839.00	3.01
181	600203	福日电子	1,814,857.80	3.01
182	600029	南方航空	1,806,902.00	2.99
183	600853	龙建股份	1,806,225.81	2.99
184	000411	英特集团	1,805,883.71	2.99
185	002714	牧原股份	1,800,382.75	2.98
186	002232	启明信息	1,796,905.15	2.98
187	002534	杭锅股份	1,796,578.00	2.98
188	002003	伟星股份	1,796,318.28	2.97
189	000030	富奥股份	1,796,157.24	2.97
190	603026	石大胜华	1,794,197.22	2.97
191	300252	金信诺	1,789,387.24	2.96
192	002502	骅威文化	1,766,424.99	2.93
193	002231	奥维通信	1,761,491.44	2.92
194	000667	美好置业	1,738,434.00	2.88
195	600268	国电南自	1,734,702.14	2.87
196	601677	明泰铝业	1,731,248.83	2.87
197	000400	许继电气	1,729,632.96	2.86
198	000425	徐工机械	1,722,949.00	2.85
199	002106	莱宝高科	1,720,421.35	2.85
200	600287	江苏舜天	1,707,040.37	2.83
201	000016	深康佳 A	1,704,032.00	2.82
202	600990	四创电子	1,695,235.00	2.81
203	002101	广东鸿图	1,690,343.35	2.80
204	002037	久联发展	1,687,491.15	2.79
205	601666	平煤股份	1,682,047.00	2.79
206	600252	中恒集团	1,676,622.00	2.78
207	000990	诚志股份	1,668,919.98	2.76
208	002019	亿帆医药	1,664,047.95	2.76
209	002416	爱施德	1,649,625.57	2.73
210	600409	三友化工	1,646,263.00	2.73
211	601336	新华保险	1,645,790.48	2.73
212	000703	恒逸石化	1,644,695.00	2.72
213	000932	*ST 华菱	1,644,251.30	2.72
214	002079	苏州固锝	1,643,963.00	2.72
215	600077	宋都股份	1,641,066.73	2.72
216	002582	好想你	1,640,235.58	2.72
217	300121	阳谷华泰	1,635,069.12	2.71
218	000960	锡业股份	1,631,399.59	2.70
219	600997	开滦股份	1,629,845.00	2.70
220	300130	新国都	1,609,965.52	2.67
221	600098	广州发展	1,575,098.99	2.61

222	601678	滨化股份	1,564,225.36	2.59
223	000686	东北证券	1,558,599.00	2.58
224	000568	泸州老窖	1,533,936.68	2.54
225	300448	浩云科技	1,511,043.94	2.50
226	601328	交通银行	1,480,293.00	2.45
227	000541	佛山照明	1,453,360.98	2.41
228	601186	中国铁建	1,407,892.00	2.33
229	002507	涪陵榨菜	1,320,252.91	2.19
230	600690	青岛海尔	1,293,606.00	2.14
231	600637	东方明珠	1,269,264.11	2.10
232	000830	鲁西化工	1,248,076.08	2.07
233	000338	潍柴动力	1,247,866.54	2.07
234	600309	万华化学	1,229,800.35	2.04
235	000001	平安银行	1,208,108.00	2.00

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	805,093,720.77
卖出股票的收入（成交）总额	654,493,745.38

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

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有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	112,192.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,687.37
5	应收申购款	98,443.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	214,323.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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
2,756	66,562.32	145,794,019.84	79.48%	37,651,737.62	20.52%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	219,654.45	0.12%

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开放式基金

2、本基金基金经理未持有本开放式基金

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 5 月 20 日）基金份额总额	218,526,964.07
本报告期期初基金份额总额	51,349,762.63
本报告期基金总申购份额	273,995,949.09
减：本报告期基金总赎回份额	141,899,954.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	183,445,757.46

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西部证券	1	597,534,058.22	40.99%	436,994.78	35.29%	-
招商证券	2	312,609,571.97	21.44%	291,140.60	23.51%	-
方正证券	1	210,325,848.64	14.43%	195,876.77	15.82%	-
广发证券	2	173,371,747.67	11.89%	161,446.23	13.04%	-
兴业证券	1	127,848,146.95	8.77%	119,067.54	9.62%	-
中金公司	1	36,242,591.24	2.49%	33,752.74	2.73%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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		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
广发证券	324,990.00	100.00%	2,300,000.00	5.84%	-	-

西部证券	-	-	37,100,000.00	94.16%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-05-03~2017-06-30	-	51,803,660.85	-	51,803,660.85	28.24%
机构	2	2017-03-02~2017-05-04	-	122,368,249.31	122,368,249.31	-	-

11.2 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

11.3 影响投资者决策的其他重要信息

无。

博时基金管理有限公司
二〇一七年八月二十四日