

[illegible][illegible][illegible][illegible]

2	固定收益投资	711,313.00000	70.80
	其中：债券	891,879.00000	87.27
	货币支持证券	19,094.00000	2.63
3	债务股权投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买入返售的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,703,697.61	671
7	其他货币资产	17,833.11040	2.20
8	合计	707,266.96210	70.00

2 公允价值计量：按公允价值计量的金融资产列示如下

代码	行业类别	公允价值(元)	公允价值净值比(%)
----	------	---------	------------

B	建筑业	--	--
C	制造业	30,360,134.00	4.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,107,030.00	3.22
J	金融业	--	--
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	教育、文化和体育业	--	--

4	物业服务、修理和其他服务业	-	-	
5	教育	-	-	
6	卫生和计划生育	-	-	
8	文化、体育和娱乐业	-	-	
9	其他	-	-	
	合计	52,287,354.00		750

2) 按行业披露公司前五名客户合计收入金额占公司前五名客户收入总额比例

序号	股票代码	投资单位名称	账龄	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300677	平安银行	324,365	22,307,803.05	323
2	000960	仁东控股	1,517,200	9,649,392.00	1.40
3	002660	金亚科技	250,790	6,477,533.00	
4	300383	永辉超市	441,130	5,326,980.00	0.80
5	300681	奥飞娱乐	82,000	4,366,000.00	0.72

序号	债券信息	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	201,821,000.00	65.46
4	央行-政策性金融债	131,726,000.00	39.95
5	信用债	394,193,500.00	114.44
6	企业短期融资券	--	--
7	中期票据	110,275,000.00	36.04
8	可转债(含分离债)	--	--
9	资产支持证券	--	--
10	其他	4,374,500.00	1.31
合计		691,875,000.00	100.04

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占非金融资产净值比例(%)
1	390202	39020210	500,000	46,156,000.00	6.71
2	360212	36021210	500,000	46,646,000.00	6.62
3	121754302	17鹏丰资管MTN001	300,000	39,122,000.00	4.38
4	143116	17铁投02	300,000	39,120,000.00	4.38
5	161407	17铁投02	300,000	29,079,000.00	4.36

6. 其他金融资产(不含公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产)支持证券投资明细

序号	名称	数量	公允价值	公允价值变动	公允价值变动率	公允价值变动原因
1	149423	宇信0044	200,000.00	19,504,000.00		2350
7	7 报告期内发生公允价值变动较大且对净资产影响较大的前五名贵金属投资明细					
	本报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	1 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	2 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	3 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	4 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	5 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	6 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	7 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	8 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	9 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	10 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	11 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	12 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	13 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	14 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	15 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	16 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	17 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	18 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	19 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	20 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	21 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	22 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	23 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	24 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	25 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	26 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	27 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	28 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	29 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	30 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	31 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	32 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	33 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	34 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	35 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	36 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	37 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	38 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	39 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	40 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	41 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	42 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	43 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	44 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	45 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	46 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	47 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	48 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					
	49 报告期内贵金属投资公允价值变动原因					

序号	名称	金额(元)
1	存在保证金	88,586,027
2	应收证券清算款	1,342,586,001
3	应收股利	-
4	应收利息	16,387,077
5	买入返售资产	-
6	其他应收款	178,544,628
7	应收款项融资	-
8	预付款项	-
9	合计	77,523,130.42

11.4 报告期内发生的前十名应收账款的坏账准备计提比例和未发生坏账损失于账龄的应收账款的坏账准备计提比例和未发生坏账损失于账龄的坏账准备计提比例

11.5 报告期内发生的前十名其他应收款的坏账准备计提比例和未发生坏账损失于账龄的坏账准备计提比例

11.6 报告期内发生的前十名其他应收款的坏账准备计提比例和未发生坏账损失于账龄的坏账准备计提比例

[illegible]

时间段	净利润增长率	净利润增长率环比改善	营业收入增长率	营业收入增长率环比改善	①-③	②-④
2012Q3-2013Q3	401%	5.9%	444%	0.0%	562%	0.0%
2013Q1-2013Q3	-40%	0.0%	5.2%	0.0%	-53%	0.0%
2014Q1-2014Q3	416%	666%	6.2%	0.0%	366%	0.0%
2015Q1-2015Q3	277%	1.4%	4.7%	0.0%	-149%	1.4%
2016Q1-2016Q3	-796%	0.0%	3.9%	0.0%	-1,171%	0.0%
2017Q1-2017Q3	256%	0.0%	3.9%	0.0%	-1,286%	0.0%
2018Q1-2018Q6	438%	0.3%	1.0%	0.0%	320%	0.3%
2019Q1-2019Q6	41.0%	0.7%	20.0%	0.0%	14.2%	0.0%

①、②为报告期内发生的费用

③、④为报告期内发生的

1. 报告期内发生的费用

2. 报告期内发生的费用

3. 报告期内发生的费用

7. 基金资产净值的计算和复核
基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。
7.1 基金资产净值的计算
基金资产净值的计算采用公允价值法。
7.2 基金资产净值的复核
基金资产净值的计算由基金管理人负责，基金托管人复核。基金管理人应当每日计算基金资产净值，并按规定的时间和方式报送中国证监会。基金托管人应当对基金管理人计算的基金资产净值进行复核，并出具复核意见。基金管理人应当将基金资产净值和基金资产净值变动情况，按照中国证监会的规定，及时、准确、完整地予以披露。

[illegible]

A基金投资组合	
余额 (M)	前次申购费率
M < 500万元	0.00%
500万元 ≤ M < 5,000万元	0.07%
5,000万元 ≤ M < 10,000万元	0.10%
M ≥ 10,000万元	100万元以内
C类基金份额	
申购费率	0%
A基金投资组合	
持有年限 (天)	赎回费率
0-6	1.60%

[illegible][illegible]

中国证券投资基金业协会于2015年12月15日出具《关于博时基金管理有限公司私募股权投资基金管理人登记备案公示的公告》(中基协公告〔2015〕2102号),披露了博时基金管理有限公司(以下简称“博时基金”)的私募基金管理人登记备案信息,基金管理人登记编号为A010106,基金管理人名称为博时基金管理有限公司,基金管理人住所为深圳市福田区福强路301号博时基金大厦11楼,基金管理人法定代表人及高级管理人员信息如下:

(1) 2015年03月21日,我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时基金管理有限公司关于博时天颐积极型证券投资基金的基金募集说明的公告》;

博时基金管理有限公司
2015年10月12日