博时行业轮动混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:二〇一九年三月二十九日

§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2019年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时行业轮动混合
基金主代码	050018
交易代码	050018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月10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	243,476,928.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入分析经济周期不同阶段的关键驱动因素和不同行业股价波动的关键驱动因子,把握周期性行业与稳定性行业轮动、周期性行业内部轮动的规律,力争实现在经济周期和行业景气波动下的资产稳定增值。
投资策略	本基金具体投资策略分三个层次:首先是大类资产的配置,即根据行业轮动的规律和经济发展的内在逻辑,在经济周期的不同阶段,配置不同的行业,最后是个股选择策略和债券投资策略。行业轮动策略是本基金的核心策略。本基金将根据风险管理的原则,以股票资为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。
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%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险/收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国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	xuqingxl.zhj@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83191540	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-80,878,973.68	64,292,727.33	7,343,753.19
本期利润	-73,176,725.39	65,850,897.51	-670,827.38
加权平均基金份额本期利润	-0.2944	0.2315	-0.0028
本期基金份额净值增长率	-23.37%	27.90%	-1.85%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1742	0.1555	-0.0985
期末基金资产净值	240,344,394.88	381,029,712.65	231,438,209.30
期末基金份额净值	0.987	1.288	1.007

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认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①①	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
过去三个月	-3.52%	1.34%	-9.36%	1.31%	5.84%	0.03%
过去六个月	-18.16%	1.35%	-10.59%	1.19%	-7.57%	0.16%
过去一年	-23.37%	1.57%	-19.05%	1.07%	-4.32%	0.50%
过去三年	-3.80%	1.48%	-13.46%	0.94%	9.66%	0.54%
过去五年	26.21%	1.74%	32.85%	1.23%	-6.64%	0.51%
自基金合同生效起至今	-1.30%	1.54%	7.53%	1.17%	-8.83%	0.37%

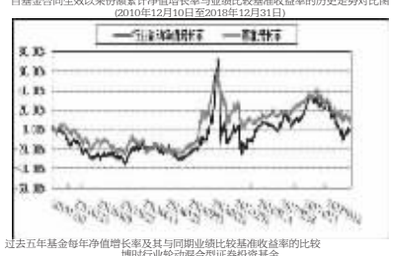
注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

博时行业轮动混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

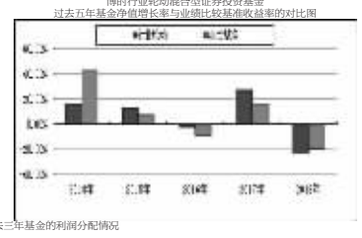
(2010年12月10日至2018年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时行业轮动混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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2018年12月31日,博时基金公司共管理181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9538亿元人民币,剔除货币基金与短期理财债券基金后,博时基金公募资产管理总规模逾2430亿元人民币,累计分红逾916亿元人民币,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2018年4季末:

博时凭论收益类基金业绩表现亮眼。在参与银河排名的107只固收产品(各类份额分开计算)中,有54只产品银河同类排名前1/2。债券型基金中,博时宏观回报债券A/B类、博时宏观回报债券C类2018年全年净值增长率均分别在200只、142只同类基金中排名第1,博时天颐债券A类2018年全年净值增长率在200只同类基金中排名第4,博时天颐债券C类2018年全年净值增长率在142只同类基金中排名第5,博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕瑞纯债债券、博时双月新定期支付债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/10,博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时益裕纯债债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/8;货币型基金中,博时合惠货币B类、博时现金宝货币B类2018年全年净值增长率分别在291只同类基金中排名第8、第29,博时合惠货币A类2018年全年净值增长率在311只同类基金中排名第11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018年A股市场震荡下行,博时旗下参与银河排名的83只权益产品(各类份额分开计算)中,56只银河同类排名在前1/2。其中,股票型基金里,博时工业4.0主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前1/4;混合型基金中,博时乐臻定开混合2018年全年净值增长率在44只同类基金中均排名第4,博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略A类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前1/10,博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰A类等基金业绩排名在银河同类前1/4;指数基金中,博时上证超大盘ETF及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前1/10,博时上证50ETF及其联接基金A类业绩排名在银河同类前1/6,博时沪深300指数业绩排名在银河同类前1/3。

商品型基金当中,博时黄金ETF联接A类2018年全年净值增长率同类排名第1。

QDII基金方面,博时标普500ETF、博时标普500ETF联接A类2018年全年净值增长率银河同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年12月28日,由新华网主办的第十一届"中国企业社会责任峰会"暨2018中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的响应号召和企业公民义务的切实履行,老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获"2018中国社会责任杰出企业奖"。

2018年12月22日,东方财富在南京举办的"2018东方财富风云榜暨基情20年"颁奖典礼上,博时基金喜获两项大奖,博时基金江向阳总经理获得"基情20周年最受尊敬行业领袖"奖;博时主题行业混合(LOF)荣登"天天基金年度产品热销榜"。

2018年12月21日,由华夏时报社主办的"华夏机构投资者年会暨第十二届金鲤奖颁奖盛典"在北京召开,本次年会的主题是"金融业2019年:突破与回归",博时基金荣获"2018年度基金管理公司"。

2018年12月21日,由北京商报社、北京品牌协会主办的"科技赋能与金融生态再造"——2018年度(第四届)北京金融论坛在京成功举办,博时基金荣获"技术领先价值奖"。

2018年12月15日,第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单,其中博时安盈债券基金(A类:000094,C类:000095)凭借年内出色的业绩表现以及在3年期开户中的超高人气,一举斩获"最受90后用户喜爱的产品奖"。

2018年11月16日,由《每日经济新闻》主办的"2018公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼"在成都举行,凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守,博时基金一举摘得"公募20年特别贡献奖——创造收益"这一重磅奖项,同时,旗下专户板块获"专户业务最具竞争力基金公司"奖。

2018年11月1日,博时基金正式加入联合国责任投资原则组织(简称UN PRI),成为中国较早加入UN PRI国际组织的资产管理机构之一。

2018年10月17日,由南方财经全媒体集团和21世纪传媒举办的21世纪国际财经峰会暨"金帆奖"评选在深圳举行,凭借对价值投资理念的坚守和以色的综合资管能力,博时基金一举斩获"2018年度基金管理公司金帆奖"这一重磅奖项。

2018年9月7日,由证券时报主办的"2018中国A股探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋"榜颁奖典礼在深圳举行,凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维,博时基金副总裁王德英获得了"2018中国金融科技领军人物先锋"的荣誉。

2018年9月6-9日,在阿拉善生态基金会主办、深圳证券信息、全景网协办、深交所、证券协会、基金协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的"2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛"中,由4名博时员工朱墨(信息技术部)、过灼(固定收益总部)、王飞(信息技术部)、王黔(信息技术部)组成的代表队,成功突破内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠,率先全员抵达终点获得冠军,其中王飞更获得个人第一。

2018年8月,全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉,博时基金投研能力获得高度认可,在公司基本面单项考评中获A档,三个社保委托组合获评"综合考评A档",此为社保考评结果的最高档。同时,在社保投资经理的考评中,博时基金共收获3项个人奖项,博时基金副总裁兼高级投资经理董良弘换手社保理事会特别颁发的"10年长期贡献社保表彰",用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合,全心量极高。同时,董良弘本人还被四"10年贡献社保表彰"的殊荣,该奖项授于长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人,本次仅授予2人。此外,博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧凯凡获评"3年贡献社保表彰"。

2018年7月19日,由中国证券投资基金业协会主办的"中国基金业20周年——发展中的思考与启示"主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的投资实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的充分肯定,入选"中国基金业20周年最杰出机构"、"大家"副总经理王德英获"杰出专业人士"的殊荣。同时,博时主题行业混合(LOF)(160505)更是以长期优异的业绩上榜"优秀基金产品"。

2018年6月8日,由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届"中国基金业金牛奖"颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选,博时基金获得"2017年度最受信赖金牛基金公司"荣誉称号。

2018年5月24日,由《中国基金报》、《证券时报》主办的"第五届中国基金业英华奖、中国基金业20年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛"在深圳隆重举行。从业经历逾23年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良弘荣获"中国基金业20年最佳基金经理"殊荣,此荣誉于全行业仅有20人获评;博时基金固收名将陈凯杨则先后荣获"中国基金业20年最佳基金经理"称号。值得一提的是,这也是陈凯杨楼盘2016年之后连续两届荣膺该项殊荣,足见市场对其管理业绩的认可。

2018年5月23日,由新浪财经和济安金信主办的"敬envy公募20年"颁奖典礼在北京举行,公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获"最佳资产管理公司"、"最受投资者欢迎基金公司"、"行业特别贡献奖"和"区域影响力奖-珠三角"这四项最具分量的公司大奖;博时基金总经理江向阳获得"行业领军人物奖"。同时,博时旗下产品博时双月新定期支付债券基金(000227)获得"最具价值理念基金产品奖-债券型"、博时宝洲票息收益债券(QDII)(人民币050030;美元现汇:050202,美元现钞:050203)获得"最具投资价值基金产品奖-QDII"。

2018年5月17日,被誉为"证券期货行业科学技术领域最高荣誉"的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出,一举夺得二等奖(DevOps统一研发平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合业务接入平台)三项大奖,成为获得奖项最多的基金融机构之一。

2018年5月10日,由《上海证券报》主办的"2018中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼"在上海举行,在此次颁奖典礼上,博时基金揽获"金基金TOP基金公司"这一最具份量的公司大奖;博时基金权益投资总监戴春宇经理兼股票投资部总经理李权胜获评"金基金最佳投资回报基金经理奖"。在第15届金基金奖评选中,旗下价值投资典范产品博时主题行业(160505)获得"三年期金基金分红奖"。

2018年3月26日,第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕,公募"老五家"之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的"中国基金业20年卓越贡献公司"大奖。同时,旗下绩优产品博时主题行业混合(LOF)(160505)荣获"三年期开放式混合型金牛基金"奖;博时信用债纯债债券(050027)荣获"三年期开放式债券型持续优胜金牛基金"奖。

2018年3月22日,由中国基金报、香山财富论坛主办的"第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金20周年特别评选,中国基金业明星基金奖颁奖典礼"在北京举办,本次评选中,博时基金一举斩获本届"20周年特别评选"中最具分量的两项公司级大奖——公募基金20年"十大最佳基金管理人"奖和"最佳固定收益基金管理人"奖,同时,旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将"最佳回报混合型基金"奖和"最佳回报债券型基金(二级债)"奖双双收入囊中,博时聚润纯债债券则获得"2017年度普通债券型明星基金"奖。

2018年2月2日,由金融界举办"第二届智能金融国际论坛"暨第六届金融界"领航中国"年度盛典在南京举办,此次论坛以"安全与创新"为主题,邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨,博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获"五年期投资回报基金管理公司奖"和"杰出品牌影响力奖"两项大奖。

2018年1月11日,由中国基金报主办的"中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业20年最佳创新产品奖颁奖典礼"在上海举办,博时基金一举摘得"十大产品创新基金公司奖",旗下产品博时主题行业混合基金(160505)和博时黄金ETF分别获得"最佳主动权益创新产品奖"和"最佳互联网创新产品奖",成为当天最大赢家之一。

2018年1月9日,由信息时报主办的"第六届信息时报金狮奖——2017年度金融行业风云榜颁奖典礼"在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获"年度最具影响力基金公司"大奖。

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		
陈雷	基金经理	2014-08-29	-	10.4	陈雷先生,硕士。2007年在华信建设咨询公司工作。2008年加入博时基金管理有限公司,历任数据分析员、研究员、资深研究员、资深研究员兼基金经理助理,博时回报灵活配置混合型证券投资基金(2014年12月4日-2016年4月20日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015年2月13日-2016年4月20日)、博时鑫裕灵活配置混合型证券投资基金(2017年10月9日-2018年9月27日)的基金经理。现任博时行业轮动混合型证券投资基金(2014年8月29日至今)、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金(2017年10月9日-2018年9月27日)的基金经理。

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,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现部分投资组合指标超标的情况,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 公平交易制度和控制方法

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程,按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 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

经济和市场回顾:

2018年全年经济预期逐步下行,3季度以来地产销售热度和去化率明显降温,消费景气度继续回落,中游制造业需求也逐步放缓,虽然基建投资方向有所回升,但整体来看经济面临继续回落的趋势。从市场来看,随信用环境的收缩和商誉减值的暴露,中小市值股票继续延续2015年以来的估值收缩过程。而和宏观景气度相关性较高的行业则受纲宏观景气度趋弱带来的回报率下行的压力,全年也呈现负收益状态。

2018年是2009年以来指数跌幅最大的年份,报告期内本基金绝对收益情况不佳,相比指数和同类型基金有一定的相对收益。在投资策略上,本基金仍然延续寻找价值处于提升阶段的行业和个股的策略,寻找回报率提升或者有增量成长空间的机会。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金基金份额净值为0.987元,份额累计净值为0.987元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-23.37%,同期业绩基准增长率-19.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济和市场展望:

2018年已经完成了经济预期的修正和中小市值股票风险的释放,我们认为2019年将开始呈现比较明显的结构分化。中小市值股票估值的大幅收缩给尚未充分定价的成长机会以更好的基础,对经济回落预期的定价也逐步充分,本基金将积极把握其中蕴在的投资机会,方向上,将继续布局在和宏观相关性较低,有回报率回升逻辑或者增量成长空间的行业和个股为主。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	28,943,200.27	231,470.67	13,064,852.38	278,190.46

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行间业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.6 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2018年12月31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200,114,219.60元,无属于第二或第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次348,222,906.18元,第二层次15,036,518.06元,无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1 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	209,114,219.60	86.32
	其中:股票	209,114,219.60	86.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,166,288.50	13.28
8	其他各项资产	969,951.05	0.40
9	合计	242,250,459.15	100.00

8.2 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	44,139,173.93	18.36
B	采矿业	-	-
C	制造业	121,743,861.18	50.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,491,189.90	5.61
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,977,563.04	9.56
M	科学研究和技术服务业	6,762,431.55	2.81
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	209,114,219.60	87.01

8.3 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	002127	南极电商	3,055,527	22,977,563.04	9.56
2	002157	正邦科技	4,239,261	22,510,475.91	9.37
3	300498	温氏股份	859,551	22,503,045.18	9.36
4	600528	中铁工业	2,136,100	22,429,050.00	9.33
5	300037	新宙邦	931,473	22,401,925.65	9.32
6	002714	牧原股份	752,561	21,636,128.75	9.00
7	002594	比亚迪	340,274	17,353,974.00	7.22
8	300014	亿纬锂能	748,400	11,764,848.00	4.89
9	300750	宁德时代	156,300	11,534,940.00	4.80
10	601766	中国中车	784,500	7,076,190.00	2.94

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	111,490,235.30	29.26
2	601398	工商银行	98,598,418.27	25.88
3	601288	农业银行	87,430,661.12	22.95
4	002410	广联达	84,841,738.62	22.27
5	601328	交通银行	79,821,078.00	20.95
6	601988	中国银行	79,803,566.37	20.94
7	300059	东方财富	74,001,800.86	19.42
8	300122	智飞生物	69,317,715.33	18.19
9	600585	海螺水泥	68,958,280.79	18.10
10	600048	保利地产	64,328,952.01	16.88
11	002460	赣锋锂业	63,085,232.54	16.55
12	002142	宁波银行	63,035,046.95	16.54
13	002466	天齐锂业	62,282,735.15	16.35
14	603899	山西汾酒	56,101,241.24	14.72
15	000002	万科A	54,412,194.15	14.28
16	300037	新宙邦	50,757,985.29	13.32
17	000858	五粮液	49,781,873.98	13.07
18	003333	美的集团	47,413,712.66	12.44
19	300014	亿纬锂能	46,531,812.91	12.21
20	600547	山东黄金	44,709,216.78	11.73
21	601186	中国铁建	43,943,254.67	11.53
22	002714	牧原股份	43,596,562.28	11.44
23	300124	汇川技术	43,325,581.41	11.37
24	300146	汤臣倍健	43,092,509.00	11.31
25	300498	温氏股份	37,906,486.42	9.95
26	601668	中国建筑	35,796,419.10	9.39
27	600362	江西铜业	33,278,631.50	8.73
28	603799	华友钴业	33,235,808.79	8.72
29	600900	长江电力	32,477,840.61	8.52
30	600030	中信证券	32,409,113.00	8.51
31	002127	南极电商	32,268,292.08	8.47
32	002007	华兰生物	32,149,269.90	8.44
33	300529	健帆生物	32,027,587.07	8.41
34	002709	天赐材料	30,613,017.00	8.03
35	300618	寒锐钴业	30,371,835.00	7.97
36	603993	洛阳钼业	30,208,722.00	7.93
37	600884	杉杉股份	29,785,532.55	7.82
38	300324	旋极信息	29,684,273.42	7.79
39	002310	东方园林	29,587,715.39	7.77
40	600498	烽火通信	29,469,722.97	7.73
41	002126	银轮股份	28,699,076.63	7.53
42	300070	碧水源	28,149,705.89	7.39
43	600801	华新水泥	27,893,750.08	7.32
44	000513	丽珠集团	27,699,623.89	7.27
45	000681	视觉中国	27,590,122.98	7.24
46	601009	南京银行	26,696,697.40	7.01
47	601318	中国平安	26,287,941.00	6.90
48	000651	格力电器	26,262,435.44	6.89
49	002120	韵达股份	25,954,221.43	6.81
50	600028	中国石化	23,652,140.27	6.21
51	600528	中铁工业	23,607,697.87	6.20
52	002157	正邦科技	22,778,185.86	5.98
53	000860	顺鑫农业	21,983,180.93	5.77
54	603338	浙江鼎力	21,921,684.10	5.75
55	603368	伟明环保	21,362,579.72	5.61
56	600068	葛洲坝	20,832,988.00	5.47
57	603589	口子窖	19,565,631.70	5.13
58	600588	用友网络	19,326,968.56	5.07
59	601899	紫金矿业	18,295,543.44	4.80
60	002594	比亚迪	18,203,064.08	4.78
61	601808	中海油服	17,897,238.82	4.70
62	002281	光迅科技	17,697,223.66	4.64
63	002044	美年健康	17,281,488.24	4.54
64	300383	光环新网	17,123,087.48	4.49
65	000616	国际医学	16,610,330.00	4.36
66	601100	恒立液压	16,394,331.80	4.30
67	601012	隆基股份	16,167,630.00	4.24
68	600201	生物股份	15,921,015.14	4.18
69	603986	兆易创新	15,909,926.22	4.18
70	300166	东方国信	15,603,329.05	4.10
71	300296	利亚德	14,615,388.98	3.84
72	600563	法拉电子	14,595,240.15	3.83
73	300017	网宿科技	14,032,008.11	3.68
74	300628	亿联网络	13,797,967.97	3.62
75	601933	永辉超市	13,353,152.11	3.50
76	002867	周大生	13,319,528.20	3.50
77	002901	大博医疗	13,041,898.72	3.42
78	300750	宁德时代	12,262,588.34	3.22
79	601155	新城控股	12,216,220.88	3.21
80	300662	科锐国际	12,095,426.20	3.17
81	600196	复星医药	11,393,564.86	2.99
82	300463	迈克生物	11,111,182.22	2.92
83	600760	中航沈飞	11,063,317.90	2.90
84	601857	中国石油	11,008,394.00	2.89
85	000089	深圳机场	10,796,741.20	2.83
86	000776	广发证券	10,770,163.00	2.83
87	300409	道氏技术	10,739,825.61	2.82
88	600583	海油工程	10,718,190.79	2.81
89	300685	艾德生物	10,686,364.43	2.80
90	000501	鄂武商A	10,665,135.32	2.80
91	300642	透景生命	10,570,103.50	2.77
92	300073	当升科技	10,045,121.00	2.64
93	600256	广汇能源	9,910,889.10	2.60
94	600491	龙元建设	9,603,471.00	2.52
95	002153	石基信息	9,494,659.22	2.49
96	002304	洋河股份	9,473,021.86	2.49
97	002530	金财互联	9,337,758.00	2.45
98	002340	格林美	9,302,275.00	2.44