# 博时军工主题股票型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十九日

## §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2018年8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2018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 | 博时军工主题股票 |
| 基金主代码 | 004698 |
| 交易代码 | 004698 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年7月4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 | 92,376,116.52份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

### 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过精选军工主题的优质上市公司进行投资,把握中国军工产业发展带来的投资机会,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法,在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置,强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。 |
| 业绩比较基准 | 中证军工指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。 |

### 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 | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-83195140 | 010-66275853 |

### 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(2018年1月1日至2018年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -9,098,920.96 |
| 本期利润 | -14,923,461.19 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1631 |
| 本期基金份额净值增长率 | -16.26% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1503 |
| 期末基金资产净值 | 78,491,886.02 |
| 期末基金份额净值 | 0.850 |

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。

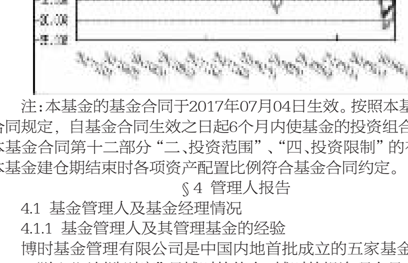
### 3.2 基金净值表现

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 | -3.95% | 1.74% | -6.88% | 1.75% | 2.93% | -0.01% |
| 过去三个月 | -12.82% | 1.49% | -14.74% | 1.42% | 1.92% | 0.07% |
| 过去六个月 | -16.26% | 1.48% | -13.73% | 1.47% | -2.53% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -15.00% | 1.08% | -18.17% | 1.25% | 3.17% | -0.17% |

注:本基金的业绩比较基准为:中证军工指数收益率*80%+上证国债指数收益率*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



注:本基金的基金合同于2017年07月04日生效。按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分"二、投资范围"、"四、投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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06月30日,博时基金公司共管理185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8461亿元人民币,其中非货币公募基金规模逾1947亿元人民币,累计分红逾872亿元人民币,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2季末:

权益基金方面,标准指数股票型基金里,博时中证银联智惠大数据100指数(A类)、博时裕富沪深300指数(A类)等今年以来净值增长率同类排名前1/4;股票型分级子基金里,博时中证银行分级指数(B级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前1/3;混合偏股型基金中,博时创业成长混合(C类)今年以来净值增长率同类基金排名第一,博时创业成长混合(A类) 今年以来净值增长率同类基金排名位居前1/10,博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前1/3;混合灵活配置型基金中,博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为3.14%,在166只同类基金排名第6,博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为4.38% ,同类基金排名位居前1/10,博时新价值灵活配置混合(A类)、博时新策略灵活配置混合(A类)、博时新起点灵活配置混合(A类)、博时新起点灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率分别为2.12%、1.93%、1.65%、1.60%,同类基金排名均位居前1/8,博时新价值灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率为2.07%,同类基金中排名位于前1/6。

黄金基金类,博时黄金ETF联接(A类)、博时黄金ETF联接(C类)今年以来净值增长率同类排名第一。

固收方面,长期标准债券型基金中,博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率为5.11%、4.56%、4.54%,同类219只基金中分别排名第3、第8、第9位,博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)、博时信用债券(C类)、博时宏观回报债券(C类)今年以来净值增长率分别为4.88%、4.56%、4.34%、4.23%,同类153只基金中分别排名第2、第4、第7、第8位,博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%,同类排名前1/10;货币基金类,博时兴荣货币、博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率分别为2.21%、2.18%,在315只同类基金排名中位列第15位与第24位。

QDII基金方面,博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类),今年以来净值增长率同类排名分别位于前1/5、1/4。

2、其他大事件

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泓荣获"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凭借长期稳健的投资业绩荣膺"三年期纯债投资最佳基金经理"称号。值得一提的是,这也是陈凯杨继2016年之后连续两年蝉联该项殊荣,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"致敬公募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"这四项最具份量的公司大奖;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薪定期支付债券基金(000277)获得"最具价值理念基金产品奖-债券型",博时亚洲票息收益债券 (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部董事总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"2017年度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 | | |
| 兰乔 | 基金经理 | 2017-07-04 | - | 8 | 2010年从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、资深研究员、基金经理助理、资本品组组长、博时回报混合基金(2015.11.30-2017.1.10)、博时卓越品牌混合(LOF)基金(2015.12.23-2017.1.10)的基金经理。现任博时工业4.0主题股票基金(2016.7.4-至今) 兼博时军工主题股票基金(2017.7.4-至今)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

本基金重点关注军工主题相关行业的投资机会,包括海陆空天电子等各领域装备、新材料、民参军等各类安全相关领域。本基金重点分析国家投入力度、成长空间、技术附加值、资产整合空间等因素,致力于寻找确定性大、能充分受益于未来10年军工行业黄金发展期的企业进行投资。18年上半年在军工行业配置为主的基础上,增配了部分机械、TMT行业中竞争力强的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年06月30日,本基金基金份额净值为0.850元,份额累计净值为0.850元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-16.26%,同期业绩基准增长率-13.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

18年政府工作报告将GDP增长目标定在6.5%左右, 与17年的增长目标相同。而18年1季度、2季度GDP同比增速分别为6.8%、6.7%,2017年GDP同比增速为6.9%。从PMI、规模以上工业企业利润、工业增加值、固定资产投资等经济指标数据表现观察,18年1季度以来经济增速向下趋势不变。18年1月市场风格则延续17年全年以来趋势偏向于大盘蓝筹,2月市场风格总体偏向中小创股票,3月创业板大幅跑赢沪深300,4月市场出现不同程度的调整。5月初市场反弹后在5月下旬再次出现明显调整,6月份市场普跌。外部环境看,美联储16年12月至18年6月连续6次加息,中美贸易战影响逐步发酵,影响市场情绪导致市场波动加大。在国内宏观经济增速面临下行压力,外部环境压力增大的背景下,产业升级仍是我们重点的投资方向,同时也积极关注如行业集中度不断提升等变化带来的投资机会。

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、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:博时军工主题股票型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | - | - |
| 银行存款 | 6,219,780.32 | 7,937,221.71 |
| 结算备付金 | 541,897.43 | 3,937,412.80 |
| 存出保证金 | 39,202.19 | 14,091.91 |
| 交易性金融资产 | 67,633,662.78 | 67,703,013.77 |
| 其中:股票投资 | 67,633,662.78 | 67,703,013.77 |
| 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 | 4,500,000.00 | 13,900,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 6,034.16 | 20,784.74 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 16,756.81 | 685,343.98 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 78,957,333.69 | 94,197,868.91 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017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 | 113,586.27 | 230,340.41 |
| 应付管理人报酬 | 97,716.51 | 123,248.31 |
| 应付托管费 | 16,286.07 | 20,541.40 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 63,932.57 | 70,613.98 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 173,926.25 | 130,557.56 |
| 负债合计 | 465,447.67 | 575,301.66 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 92,376,116.52 | 92,281,737.76 |
| 未分配利润 | -13,884,230.50 | 1,340,829.49 |
| 所有者权益合计 | 78,491,886.02 | 93,622,567.25 |
| 负债和所有者权益总计 | 78,957,333.69 | 94,197,868.91 |

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.850元,基金份额总额 92,376,116.52 份。

6.2 利润表

会计主体:博时军工主题股票型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | -13,593,078.63 |
| 1.利息收入 | 133,331.89 |
| 其中:存款利息收入 | 29,419.68 |
| 债券利息收入 | 3,334.58 |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 100,577.63 |
| 其他利息收入 | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -7,968,002.33 |
| 其中:股票投资收益 | -8,176,901.15 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | 15,792.82 |
| 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 | 193,106.00 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -5,824,540.23 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 66,132.04 |
| 减:二、费用 | 1,330,382.56 |
| 1. 管理人报酬 | 634,183.59 |
| 2. 托管费 | 105,697.27 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 404,009.16 |
| 5. 利息支出 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - |
| 6. 税金及附加 | 0.03 |
| 7. 其他费用 | 186,492.51 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -14,923,461.19 |
| 减:所得税费用 | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -14,923,461.19 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时军工主题股票型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018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) | 92,281,737.76 | 1,340,829.49 | 93,622,567.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -14,923,461.19 | -14,923,461.19 |
| 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) | 94,378.76 | -301,598.80 | -207,220.04 |
| 其中:1.基金申购款 | 25,924,011.66 | -1,466,649.63 | 24,457,362.03 |
| 2.基金赎回款 | -25,829,632.90 | 1,165,050.83 | -24,664,582.07 |
| 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) | 92,376,116.52 | -13,884,230.50 | 78,491,886.02 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

______________ ______________ ______________

基金管理人负责人:江向阳 主管会计工作负责人:王德英 会计机构负责人:成江

6.4 报表附注

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

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[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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号 《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深府办[2011]60号《深圳市地方教育附加征收管理暂行办法》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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。

6.4.4 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 招商证券 | 35,357,172.13 | 11.93% |

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债券回购交易

无。

6.4.4.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018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 | 25,854.70 | 10.93% | 14,505.25 | 22.69% |

注:1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,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 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 634,183.59 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 340,769.78 |

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1.50%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 X 1.50% / 当年天数。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 105,697.27 |

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

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

无。

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 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 6,219,780.32 | 20,722.49 |

本基金的活期银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率/约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2018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

无。

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(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300324 | 旋极信息 | 2018-05-30 | 重大事项停牌 | 8.37 | - | - | 343,207.00 | 4,048,827.17 | 2,872,642.59 | - |

注:本基金截至2018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2018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64,761,020.19元,属于第二层次的余额为2,872,642.59元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次66,595,053.77元,第二层次1,107,960.00元,无第三层次余额)。

(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和债券,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和债券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6月30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。

## §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 | 67,633,662.78 | 85.66 |
| | 其中:股票 | 67,633,662.78 | 85.66 |
| 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 | 4,500,000.00 | 5.70 |
| | 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 | 6,761,677.75 | 8.56 |
| 8 | 其他各项资产 | 61,993.16 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 78,957,333.69 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 64,761,020.19 | 82.51 |
| 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 | 2,872,642.59 | 3.66 |
| 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 | 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 | 67,633,662.78 | 86.17 |

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 | 002013 | 中航机电 | 828,450 | 6,271,366.50 | 7.99 |
| 2 | 600760 | 中航沈飞 | 173,600 | 6,256,544.00 | 7.97 |
| 3 | 600038 | 中直股份 | 129,396 | 5,174,546.04 | 6.59 |
| 4 | 600967 | 内蒙一机 | 350,833 | 4,469,612.42 | 5.69 |
| 5 | 600416 | 湘电股份 | 581,130 | 4,178,324.70 | 5.32 |
| 6 | 600893 | 航发动力 | 142,400 | 3,178,368.00 | 4.05 |
| 7 | 000768 | 中航飞机 | 196,300 | 3,070,132.00 | 3.91 |
| 8 | 000338 | 潍柴动力 | 339,487 | 2,970,511.25 | 3.78 |
| 9 | 300324 | 旋极信息 | 343,207 | 2,872,642.59 | 3.66 |
| 10 | 002383 | 合众思壮 | 171,600 | 2,839,980.00 | 3.62 |

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 | 600416 | 湘电股份 | 7,751,705.51 | 8.28 |
| 2 | 000338 | 潍柴动力 | 5,826,824.10 | 6.22 |
| 3 | 600741 | 华域汽车 | 5,139,242.38 | 5.49 |
| 4 | 600760 | 中航沈飞 | 4,956,127.00 | 5.29 |
| 5 | 002126 | 银轮股份 | 4,773,352.24 | 5.10 |
| 6 | 000768 | 中航飞机 | 4,445,288.00 | 4.75 |
| 7 | 300045 | 华力创通 | 4,390,550.35 | 4.69 |
| 8 | 002008 | 大族激光 | 4,093,408.09 | 4.37 |
| 9 | 601689 | 拓普集团 | 4,063,848.00 | 4.34 |
| 10 | 300324 | 旋极信息 | 4,048,827.17 | 4.32 |
| 11 | 600893 | 航发动力 | 3,861,899.00 | 4.12 |
| 12 | 603986 | 兆易创新 | 3,509,642.00 | 3.75 |
| 13 | 600879 | 航天电子 | 3,436,908.00 | 3.67 |
| 14 | 603337 | 杰克股份 | 3,431,264.00 | 3.66 |
| 15 | 002383 | 合众思壮 | 3,290,857.74 | 3.52 |
| 16 | 600028 | 中国石化 | 3,189,428.00 | 3.41 |
| 17 | 601989 | 中国重工 | 2,813,334.00 | 3.00 |
| 18 | 600990 | 四创电子 | 2,777,758.96 | 2.97 |
| 19 | 300567 | 精测电子 | 2,739,540.00 | 2.93 |
| 20 | 600967 | 内蒙一机 | 2,694,600.78 | 2.88 |
| 21 | 300114 | 中航电测 | 2,581,717.52 | 2.76 |
| 22 | 600230 | 沧州大化 | 2,568,080.00 | 2.74 |
| 23 | 300296 | 利亚德 | 2,492,037.00 | 2.66 |
| 24 | 600340 | 华夏幸福 | 2,481,108.00 | 2.65 |
| 25 | 000651 | 格力电器 | 2,469,907.25 | 2.64 |
| 26 | 600482 | 中国动力 | 2,460,895.82 | 2.63 |
| 27 | 002025 | 航天电器 | 2,425,252.50 | 2.59 |
| 28 | 603993 | 洛阳钼业 | 2,422,174.00 | 2.59 |
| 29 | 601398 | 工商银行 | 2,412,760.00 | 2.58 |
| 30 | 601288 | 农业银行 | 2,407,453.00 | 2.57 |
| 31 | 002466 | 天齐锂业 | 2,405,981.00 | 2.57 |
| 32 | 603799 | 华友钴业 | 2,403,717.00 | 2.57 |
| 33 | 601988 | 中国银行 | 2,391,644.00 | 2.55 |
| 34 | 002714 | 牧原股份 | 2,386,616.00 | 2.55 |
| 35 | 600048 | 保利地产 | 2,345,182.00 | 2.50 |
| 36 | 600519 | 贵州茅台 | 2,226,670.00 | 2.38 |

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(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 | 002179 | 中航光电 | 7,011,031.83 | 7.49 |
| 2 | 000768 | 中航飞机 | 6,648,914.28 | 7.10 |
| 3 | 600990 | 四创电子 | 6,472,794.30 | 6.91 |
| 4 | 600562 | 国睿科技 | 6,131,080.25 | 6.55 |
| 5 | 000903 | 云内动力 | 5,847,203.50 | 6.25 |
| 6 | 600482 | 中国动力 | 5,612,054.06 | 5.99 |
| 7 | 002008 | 大族激光 | 4,744,656.16 | 5.07 |
| 8 | 600741 | 华域汽车 | 4,581,837.02 | 4.89 |
| 9 | 600760 | 中航沈飞 | 4,401,813.33 | 4.70 |
| 10 | 601689 | 拓普集团 | 4,276,241.74 | 4.57 |
| 11 | 600416 | 湘电股份 | 3,857,369.18 | 4.12 |
| 12 | 603986 | 兆易创新 | 3,674,290.36 | 3.92 |
| 13 | 600967 | 内蒙一机 | 3,337,547.26 | 3.56 |
| 14 | 600028 | 中国石化 | 2,963,185.00 | 3.17 |
| 15 | 002126 | 银轮股份 | 2,714,485.60 | 2.90 |
| 16 | 000338 | 潍柴动力 | 2,685,545.20 | 2.87 |
| 17 | 600072 | 中船科技 | 2,685,405.29 | 2.87 |
| 18 | 600230 | 沧州大化 | 2,631,106.00 | 2.81 |
| 19 | 300296 | 利亚德 | 2,556,457.42 | 2.73 |
| 20 | 601398 | 工商银行 | 2,489,236.00 | 2.66 |
| 21 | 600340 | 华夏幸福 | 2,460,316.86 | 2.63 |
| 22 | 002013 | 中航机电 | 2,451,362.24 | 2.62 |
| 23 | 601988 | 中国银行 | 2,369,736.00 | 2.53 |
| 24 | 603367 | 辰欣药业 | 2,363,839.44 | 2.52 |
| 25 | 002714 | 牧原股份 | 2,354,822.20 | 2.52 |
| 26 | 601288 | 农业银行 | 2,291,367.00 | 2.45 |
| 27 | 600519 | 贵州茅台 | 2,281,872.80 | 2.44 |
| 28 | 603799 | 华友钴业 | 2,252,303.00 | 2.41 |
| 29 | 000651 | 格力电器 | 2,032,784.05 | 2.17 |
| 30 | 002258 | 利尔化学 | 2,031,095.54 | 2.17 |
| 31 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,991,794.00 | 2.13 |
| 32 | 600048 | 保利地产 | 1,987,897.00 | 2.12 |
| 33 | 300045 | 华力创通 | 1,932,649.00 | 2.06 |

注:本项的"卖出金额"均按成交金额(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 | 155,184,016.59 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 141,251,926.20 |

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

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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 | 39,202.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,034.16 |
| 5 | 应收申购款 | 16,756.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 61,993.16 |

7.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300324 | 旋极信息 | 2,872,642.59 | 3.66 | 重大事项停牌 |

## §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 |
| 2,576 | 35,860.29 | - | - | 92,376,116.52 | 100.00% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司所有从业人员未持有本基金。

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

1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;

2、本基金的基金经理未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2017年7月4日)基金份额总额 | 537,499,475.81 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 92,281,737.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 25,924,011.66 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 25,829,632.90 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 92,376,116.52 |

## §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、基金托管人的专门基金托管部门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 | |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | 86,659,205.13 | 29.24% | 80,702.34 | 34.13% | - |
| 华信证券 | 1 | 77,368,734.78 | 26.10% | 56,573.08 | 23.93% | - |
| 平安证券 | 1 | 42,989,991.88 | 14.50% | 31,444.15 | 13.30% | 新增1个 |
| 天风证券 | 2 | 42,192,157.32 | 14.23% | 30,859.12 | 13.05% | 新增1个 |
| 招商证券 | 1 | 35,357,172.13 | 11.93% | 25,854.70 | 10.93% | 新增1个 |
| 中信建投 | 1 | 11,836,411.55 | 3.99% | 11,021.97 | 4.66% | 新增1个 |
| 华创证券 | 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,我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服务;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 |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 9,122,894.20 | 98.63% | 132,400,000.00 | 24.68% | - | - |
| 华信证券 | 126,403.20 | 1.37% | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | 303,900,000.00 | 56.66% | - | - |
| 天风证券 | - | - | 64,900,000.00 | 12.10% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | 35,200,000.00 | 6.56% | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |

## §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

无。

11.2 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
二〇一八年八月二十九日