

博时逆向投资混合型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	认购数量(股)	认购成本	账面价值	公允价值
003093	中信银行	500	5,000.00	48,460.00	48,460.00
003094	建设银行	13,000	13,000.00	23,103.00	23,103.00
003095	工商银行	13,777	13,777.00	404,060.00	404,060.00

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	数量(股)	期末成本总额	期末公允价值
002031	苏泊尔	2018-08-28	停牌	693,100.00	12,489,100.00	1,542,540.00
300034	科大讯飞	2018-08-30	停牌	412,400.00	4,428,641.00	3,402,380.00

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

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(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开始确定:

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229,441,672.73元,属于第二层次的余额为24,966,666.75元,属于第三层次的余额为2017年12月31日:第一层次42,916,759.40元,第二层次73,261,018.28元,无第三层次。

(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,或属于非公开发行股票等情况,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
上述第三层次资产变动如下:

项目	公允价值	公允价值变动
1. 权益类金融资产	12,313,863.30	3.30
2. 债权类金融资产	12,313,863.30	3.30
3. 其他金融资产	12,313,863.30	3.30
4. 合计	12,313,863.30	3.30

注: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。

7.10 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中,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 本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

序号	名称	金额
1	待摊费用	280,428.00
2	预付款项	18,282,088.00
3	应收利息	64,470.42
4	应收股利	9,600.72
5	其他应收款	1,796,628.00
6	其他	18,782.22
7	合计	15,408,576.82

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
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。

8.1 期末基金份额持有人信息

份额类别	持有人户数(户)	户内持有基金份额比例	持有份额	持有份额比例
博时逆向投资混合A	4,043	390,300.00	-	622,094,796.30
博时逆向投资混合C	1,210	29,141.15	-	30,384,210.07
合计	5,253	419,441.15	-	652,478,006.37

8.2 期末本基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	持有份额(份)	占基金总份额比例
本基金所有从业人员持有本基金	博时逆向投资混合A	1,048.90	0.00%
	博时逆向投资混合C	58,426.63	0.00%
	合计	59,475.53	0.00%

8.3 期末本基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总额总量的情况

1、本公司高级管理人员、基金投资和研究人员均未持有本基金。

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

项目	博时逆向投资混合A	博时逆向投资混合C
基金合同生效日(2017年4月13日)	849,487,390.26	82,540,524.02
本报告期基金份额总额	664,289,493.52	61,609,847.97
本报告期基金份额总额	13,906,028.07	1,796,628.00
本报告期基金份额总额	13,906,028.07	1,796,628.00
本报告期基金份额总额	13,906,028.07	1,796,628.00
本报告期基金份额总额	13,906,028.07	1,796,628.00

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 基金份额持有人大会决议
本报告期内未召开持有人大会。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期内未发生涉及基金管理人、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变
本报告期未改变投资策略。

10.5 报告期内基金投资情况
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、基金托管人涉及稽查或处罚的情况及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情况
10.7.1 基金租用证券公司交易单元选择程序及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期基金成交金额比例	佣金	占当期基金佣金比例	备注
平安证券	1	624,484,313.85	46.01%	603,072.91	46.01%	-
华泰证券	2	603,281,143.01	43.60%	589,608.00	43.60%	-
方正证券	1	168,289,466.22	12.09%	162,782.22	12.09%	-
合计	1	91,758,728.07	6.22%	89,105.32	6.22%	-

注:注:本基金根据中国证监会证券基金业协会《关于完善证券投资基金交易佣金制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定要求,我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,向各家证券经营机构提交了基金专用交易佣金。

1. 基金专用交易佣金的选择标准如下:
(1)经营行为稳健规范,内部控制严格,在业内有良好的声誉;
(2)具备基金业务所需的高效、安全的通讯条件,交易设施能满足基金进行证券交易的需要;
(3)具有较高质量的方向性金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力,能及时、全面地提供基金投资所需的信息;具有较全面的宏观、行业及市场研究能力,能及时、全面地提供基金投资所需的信息;具有较全面的行业研究能力,能及时、全面地提供基金投资所需的信息;具有较全面的行业研究能力,能及时、全面地提供基金投资所需的信息。

2. 基金专用交易佣金的选择程序如下:
(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业务的情况

券商名称	成交金额	占当期基金成交金额比例	佣金	占当期基金佣金比例
平安证券	12,323,323.30	100.00%	7,092,300.00	100.00%
华泰证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
其他券商	-	-	-	-

注:本基金的“买入股票”均按买入成交金额(成交金额以成交数量)乘以买入成交金额(成交数量)计算。

7.4.2 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

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	600028	中国石化	31,129,060.00	5.67
2	603318	华夏银行	21,326,506.62	3.84
3	603288	农业银行	24,439,521.00	4.43
4	300017	钢研高纳	22,262,270.00	4.00
5	603086	吉视传媒	22,003,514.00	3.95
6	600068	葛洲坝	20,006,016.00	3.57
7	603047	上海医药	19,449,728.74	3.47
8	603049	美泰药业	17,186,421.00	3.02
9	603039	爱康医疗	17,008,234.01	3.01
10	603015	东方雨润	13,416,400.00	2.35
11	300456	日创医疗	14,439,343.00	2.53
12	300077	汇金股份	12,369,260.00	2.18
13	002078	太阳纸业	12,369,260.00	2.18
14	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
15	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
16	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
17	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
18	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
19	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
20	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
21	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
22	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
23	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
24	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
25	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
26	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
27	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
28	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
29	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
30	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
31	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
32	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
33	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
34	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
35	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
36	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
37	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
38	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
39	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
40	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
41	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
42	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
43	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
44	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
45	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
46	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
47	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
48	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
49	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
50	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
51	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
52	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
53	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
54	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
55	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
56	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
57	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
58	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
59	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
60	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
61	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
62	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
63	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
64	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
65	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
66	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
67	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
68	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
69	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
70	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
71	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
72	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
73	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
74	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
75	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
76	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
77	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
78	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
79	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
80	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
81	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
82	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
83	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
84	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
85	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
86	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
87	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
88	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
89	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
90	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
91	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
92	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
93	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
94	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
95	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
96	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
97	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
98	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
99	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18
100	002010	三钢闽光	12,369,260.00	2.18

注:本基金在承销期内参与关联方承销的情况

6.4.4.4 其他关联交易事项的说明

6.4.4.5 关联方为保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期	上期
中国工商银行	7,650,144.66	66,778,116.00
建设银行	1,000,000.00	1,000,000.00
农业银行	1,000,000.00	1,000,000.00
交通银行	1,000,000.00	1,000,000.00
招商银行	1,000,000.00	1,000,000.00
浦发银行	1,000,000.00	1,000,000.00
中信银行	1,000,000.00	1,000,000.00
民生银行	1,000,000.00	1,000,000.00
光大		