

# 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

## 2014 年年度报告摘要

2014 年 12 月 31 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

报告送出日期：2015 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 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 2015 年 3 月 27 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 2014 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	博时沪深 300 指数
基金主代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 8 月 26 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	11,836,975,021.49 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用被动式投资的方法，按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为：股票资产为 95%以内，现金和短期债券资产比例不低于 5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95%的沪深 300 指数加 5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

### 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
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## § 3 主要财务指标、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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	900,480,661.34	-579,501,756.00	-1,722,097,767.10
本期利润	4,062,318,408.10	-555,223,473.76	742,710,365.77
加权平均基金份额本期利润	0.3543	-0.0421	0.0540
本期基金份额净值增长率	57.77%	-6.31%	8.25%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1012	-0.3448	-0.3007
期末基金资产净值	12,236,225,676.27	8,480,371,612.03	9,355,915,051.88
期末基金份额净值	1.0337	0.6552	0.6993

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

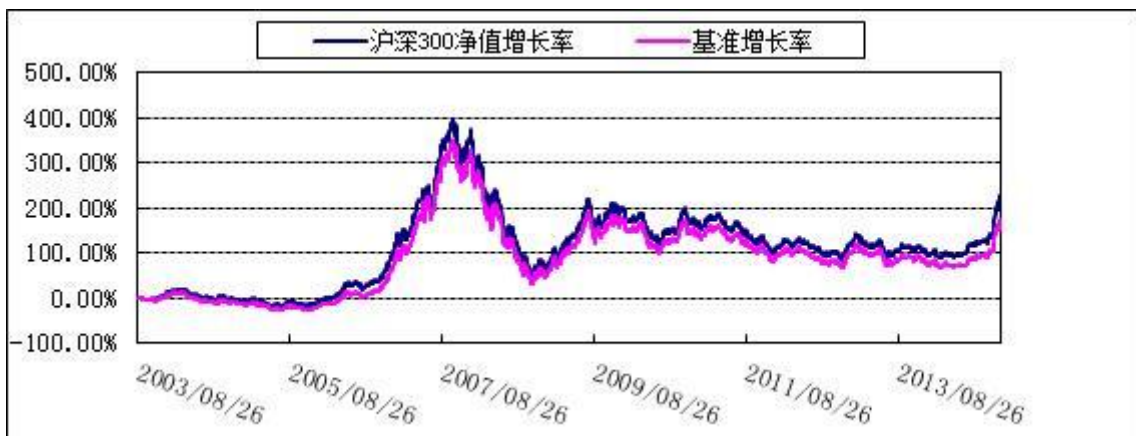
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	43.35%	1.64%	41.64%	1.56%	1.71%	0.08%
过去六个月	65.13%	1.31%	59.38%	1.26%	5.75%	0.05%
过去一年	57.77%	1.18%	48.72%	1.15%	9.05%	0.03%
过去三年	60.02%	1.25%	48.18%	1.23%	11.84%	0.02%
过去五年	7.68%	1.31%	-0.40%	1.29%	8.08%	0.02%
自基金合同生效起至今	226.88%	1.61%	176.66%	1.63%	50.22%	-0.02%

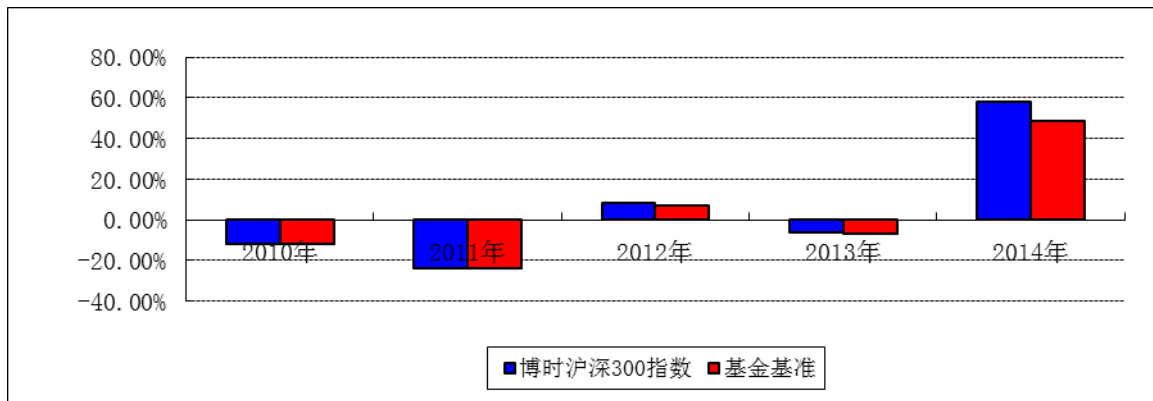
注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×95%+银行同业存款利率×5%。

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 95%、5% 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



### 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



### 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 2014 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理五十三只开放式基金，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。博时基金资产管理净值总规模逾 2363 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1124 亿元人民币，累计分红超过 638 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，标准股票型基金中，截至 12 月 31 日，博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在 355 只标准型股票基金中排名第 6，博时特许价值股票基金今年以来净值增长率在 355 只标准型股票基金中排名第 12；博时精选股票基金在 7 只同类普通股票型基金中排名前 1/2；博时裕富沪深 300 指数基金在同类 150 只标准指数股票型基金中排名前 1/5，博时上证超大盘 ETF 及博时深证基本面 200ETF 在 150 只标准指数股票型基金中均排名前 1/2；博时上证超级大盘 ETF 联接及博时深证基本面 200ETF 联接在同类 45 只产品中排名前 1/2。混合基金中，博时裕益灵活配置混合在 34 只灵活配置型基金中排名前 1/4，博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类 29 只产品中排名前 1/2；博时平衡配置混合在同类 16 只产品中排名前 1/2。

固定收益方面，博时信用债券(A/B 类) 今年以来收益率在 93 只同类普通债券型基金中排名第 1；博时信用债券(C 类) 今年以来收益率在 56 只同类普通债券型基金中排名第 1；博时稳定价值债券(B 类) 今年以来收益率在 41 只同类普通债券型基金中排名第 1；博时稳定价值债券(A 类) 今年以来收益率在 67 只同类普通债券型基金中排名第 2；博时转债增强债券(A 类) 今年以来收益率在 13 只可转换债券基金中排名第 3；博时安丰 18 个月定期开放基金在 100 只同类长期标准债券型基金中排名前 1/3，博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A 类) 及博时月月薪定期支付债券基金在 100 只同类长期标准债券型基金中排名前 1/2；博时宏观回报债券(A/B 类) 及博时天颐债券(A 类) 在 93 只同类普通债券型基金中分别排名第 7、第 8；博时现金收益货币(A 类) 在 78 只同类货币市场基金中排名前 1/2。

海外投资方面业绩方面，截至 12 月 31 日，博时亚洲票息收益债券基金在同类可比 7 只 QDII 债券基金中排名第 1，博时抗通胀在 8 只 QDII 商品基金中排名第 1。

## 2) 客户服务

2014 年，博时基金共举办各类渠道培训及活动 718 场，参加人数 18775 人。

## 3) 其他大事件

2014 年 12 月 18 日，博时国际获得和讯海外财经风云榜“2014 年度最佳中资基金公司奖”；

2014 年 12 月 25 日，博时基金获得金融界评选的“最佳品牌奖”。

2014 年 1 月 9 日，金融界网站在北京举办“第二届领航中国 2013 金融行业年度颁奖典礼”，博时基金荣获“2013 金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖”。

2014 年 1 月 11 日，在和讯网主办的 2013 年第十一届财经风云榜基金行业评选中，博时基金荣获“2013 年度基金业最佳投资者关系奖”。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		

王红欣	指数投资部总经理/基金经理	2013-01-09	-	20	1994 年起先后在 RXR 期货公司、Aeltus 投资公司、Putnam 投资公司、Acadian 资产管理公司、易方达资产管理（香港）公司工作。2012 年 10 月加入博时基金管理有限公司。曾任股票投资部 ETF 及量化组投资总监。现任指数投资部总经理兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
郑宇泉	基金经理助理	2013-01-30	2014-12-11	7	2007 年起先后在美国 PGAM 对冲基金、盛融（上海）信息技术公司工作。2011 年 4 月加入博时基金管理有限公司，曾任股票投资部量化研究员，特定资产投资经理助理、股票投资部基金经理助理。
林景艺	高级研究员兼基金经理助理	2014-01-13		4	2010 年 7 月加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部高级研究员兼基金经理助理。
桂征辉	基金经理助理	2014-10-27		5	2006 年起先后在松下电器北京研究所、美国在线公司工作。2009 年加入博时基金，现任指数投资部基金经理助理

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

#### 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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、基金合同和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，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《公平交易管理制度》的规定，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施 确保了公平对待所管理的投资组合。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 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

2014 年 A 股市场呈现出较为显著的两段式行情。上半年，小盘股大幅上涨，尤其是市值在 20 亿上下的股票因为壳资源稀缺性，一度成为牛股集中营。下半年伴随着经济向下，货币政策由定向宽松逐步演变为直接降息，杠杆资金蜂拥入市，以沪深 300 为代表的低估值蓝筹股完成了逆转，全年指数涨幅接近 50%，为 2009 年以来最佳表现。而同期，以创业板为代表的小盘股票在 12 月大幅下跌。

在这现象的背后，是沪港通、国企改革等政策的指引下，在资金推动下的以沪深 300 为代表的大盘权重股的估值修复。从板块表现来看，以银行保险券商等大金融板块涨幅居前，而传统的防御板块如食品饮料，医疗保健等涨幅靠后。

在投资策略上我们依靠在各行业内精选个股的量化策略，以估值和基本面为主，同时在大小盘，市场情绪等方面进行适当的超配，在较低的跟踪误差下进行沪深 300 指数增强运作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0337 元，累计份额净值为 3.0137 元，报告期内净值上涨 57.77%，同期业绩基准上涨幅度为 48.72%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2015 年中国经济增速将继续下台阶，以基建、房地产为代表的投资进一步放缓。遵循经济下，改革上的逻辑，我们认为改革依然将是资本市场的重要主题。国企改革总体方案，“一带一路”规划有可能正式发布。注册制改革也将稳步推进等等，这些改革措施，都将对资本市场产生深远影响。



伴随货币政策转向，2015年市场流动性可能依然保持较为宽松的态势，仍存降息降准预期。在降息周期下，利率中长期下降将推升市场估值。居民加速资产配置的调整，从房地产、信托和货币市场逐步转向资本市场，尤其是二级市场权益类资产的配置比例将逐步提高。

当前市场估值已经有所恢复，经济仍处于向下寻底的过程中，考虑到目前已经累计了较多涨幅，未来市场加大波动的概率较大。美元中长期升值趋势将使得新兴市场承压，注册制实施和扩容也是市场面临的一大挑战，大量信用交易也可能对市场涨跌起到推波助澜的作用。

#### 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

收益分配原则：基金投资当期亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；基金当期收益应先弥补以前亏损后，才可进行当期收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

#### 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 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

### § 7 年度财务报表

#### 7.1 资产负债表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	582,075,396.78	400,774,200.11
结算备付金	11,393,071.30	11,612,183.54
存出保证金	683,453.99	991,867.17
交易性金融资产	11,710,302,156.59	8,073,770,346.77
其中：股票投资	11,585,767,292.32	7,944,498,295.81
基金投资	-	-
债券投资	124,534,864.27	129,272,050.96
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	12,623,399.14	52,348,122.27
应收利息	1,505,777.61	410,177.76
应收股利	-	-
应收申购款	40,856,467.64	928,955.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,359,439,723.05	8,540,835,853.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2014年12月31日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
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	75,249,807.65	39,618,452.75
应付赎回款	25,719,832.88	4,757,452.17
应付管理人报酬	8,766,021.67	7,194,029.98
应付托管费	1,788,984.01	1,468,169.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,037,113.26	6,692,364.39
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	652,287.31	733,772.56
负债合计	123,214,046.78	60,464,241.24
<b>所有者权益：</b>		

实收基金	11,836,975,021.49	12,942,911,234.67
未分配利润	399,250,654.78	-4,462,539,622.64
所有者权益合计	12,236,225,676.27	8,480,371,612.03
负债和所有者权益总计	12,359,439,723.05	8,540,835,853.27

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0337 元，基金份额总额 11,836,975,021.49 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>4,206,650,182.51</b>	<b>-406,183,381.16</b>
1. 利息收入	3,817,050.35	4,042,445.60
其中：存款利息收入	3,169,896.89	3,741,533.81
债券利息收入	643,505.81	300,911.79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,647.65	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,039,330,039.02	-436,606,099.79
其中：股票投资收益	847,709,264.51	-637,166,140.77
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,522,361.22	2,159,536.82
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	183,098,413.29	198,400,504.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,161,837,746.76	24,278,282.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,665,346.38	2,101,990.79
<b>减：二、费用</b>	<b>144,331,774.41</b>	<b>149,040,092.60</b>
1. 管理人报酬	76,724,274.62	87,989,422.46
2. 托管费	15,658,015.21	17,957,024.91
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	51,461,820.15	42,623,797.72
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	487,664.43	469,847.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>4,062,318,408.10</b>	<b>-555,223,473.76</b>
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,062,318,408.10	-555,223,473.76
-------------------	------------------	-----------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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）	12,942,911,234.67	-4,462,539,622.64	8,480,371,612.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,062,318,408.10	4,062,318,408.10
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）	-1,105,936,213.18	799,471,869.32	-306,464,343.86
其中：1. 基金申购款	3,116,329,932.86	-346,423,793.83	2,769,906,139.03
2. 基金赎回款	-4,222,266,146.04	1,145,895,663.15	-3,076,370,482.89
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）	11,836,975,021.49	399,250,654.78	12,236,225,676.27
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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）	13,379,231,495.22	-4,023,316,443.34	9,355,915,051.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-555,223,473.76	-555,223,473.76
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）	-436,320,260.55	116,000,294.46	-320,319,966.09
其中：1. 基金申购款	3,290,463,974.97	-1,080,698,780.14	2,209,765,194.83
2. 基金赎回款	-3,726,784,235.52	1,196,699,074.60	-2,530,085,160.92
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）	12,942,911,234.67	-4,462,539,622.64	8,480,371,612.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：吴姚东      主管会计工作负责人：王德英      会计机构负责人：成江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

### 7.4.3 关联方关系

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、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
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
璟安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东

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。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31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	4,766,584,350.90	13.17%	5,417,983,401.48	18.53%

##### 7.4.4.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31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 总量的比例
招商证券	4,185,884.59	14.58%	566,260.29	5.13%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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 总量的比例
招商证券	4,689,010.62	19.36%	1,866,788.33	27.90%

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。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	76,724,274.62	87,989,422.46
其中：支付销售机构的客户维护费	6,709,090.84	7,598,570.33

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 0.98% 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 × 0.98% / 当年天数。

#### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	15,658,015.21	17,957,024.91

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 0.20% 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 × 0.20% / 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

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	582,075,396.78	2,943,612.93	400,774,200.11	3,504,025.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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(2014 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

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
600129	太极集团	17/12/2014	公告重 大事项	16.98	暂未公示	暂未复 牌	65,000	1,112,523.30	1,103,700.00	



600649	城投控股	01/11/2014	公告重大事项	7.23	暂未公示	暂未复牌	264,900	1,734,446.67	1,915,227.00	
600644	哈药股份	31/12/2014	公告重大事项	8.68	17/02/2015	9.45	862,300	7,014,066.14	7,484,764.00	
600754	锦江股份	08/11/2014	公告重大事项	25.11	19/01/2015	27.00	2,900	57,648.24	72,819.00	
601216	内蒙君正	29/11/2014	公告重大事项	10.44	07/01/2015	11.10	72,700	579,669.77	758,988.00	
601519	大智慧	19/07/2014	公告重大事项	5.98	23/01/2015	6.58	6,471,991	43,633,220.49	38,702,506.18	
000009	中国宝安	27/12/2014	公告重大事项	12.95	07/01/2015	13.88	18,200	234,632.34	235,690.00	
002068	黑猫股份	30/12/2014	公告重大事项	8.71	09/01/2015	7.96	3,001,505	23,359,023.21	26,143,108.55	
002437	誉衡药业	21/11/2014	公告重大事项	23.75	26/01/2015	26.13	588,112	12,776,499.54	13,967,660.00	
002617	露笑科技	29/11/2014	公告重大事项	23.41	暂未公示	暂未复牌	135,500	3,010,207.36	3,172,055.00	
300208	恒顺电气	17/12/2014	公告重大事项	13.36	09/02/2015	14.70	1,405,920	18,528,665.53	18,783,091.20	
300244	迪安诊断	11/10/2014	公告重大事项	43.93	09/01/2015	44.00	72,600	3,023,585.07	3,189,318.00	
300252	金信诺	11/11/2014	公告重大事项	43.40	28/01/2015	46.99	255,359	7,215,293.93	11,082,580.60	
000562	宏源证券	10/12/2014	吸收合并	36.38	26/01/2015	17.77	52,100.00	1,607,522.00	1,895,398.00	

注：1. 根据宏源证券公告，申银万国将向宏源证券全体股东发行 A 股股票，以换股比例 2.049: 1 取得宏源证券股东持有的宏源证券全部股票，吸收合并宏源证券，2014 年 12 月 9 日为宏源证券最后一个交易日，合并后的申万宏源于 2015 年 1 月 26 日复牌。

2. 本基金截至 2014 年 12 月 31 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。

#### 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 2014 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 11,581,795,251.06 元, 属于第二层次的余额为 128,506,905.53 元, 无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日: 第一层次 7,924,265,951.51 元, 第二层次 149,504,395.26 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 2014 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(2013 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,585,767,292.32	93.74
	其中: 股票	11,585,767,292.32	93.74
2	固定收益投资	124,534,864.27	1.01
	其中: 债券	124,534,864.27	1.01
	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	593,468,468.08	4.80
7	其他各项资产	55,669,098.38	0.45
8	合计	12,359,439,723.05	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	45,472.00	-
B	采矿业	566,202,588.40	4.63
C	制造业	3,573,197,514.33	29.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	366,895,248.80	3.00
E	建筑业	415,416,925.71	3.39
F	批发和零售业	632,789,339.84	5.17
G	交通运输、仓储和邮政业	230,056,516.92	1.88
H	住宿和餐饮业	72,819.00	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	341,420,534.59	2.79
J	金融业	4,775,803,573.60	39.03
K	房地产业	510,267,525.64	4.17
L	租赁和商务服务业	14,959,429.43	0.12
M	科学研究和技术服务业	7,482,634.34	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	31,946,872.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,189,318.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	115,785,289.72	0.95
S	综合	235,690.00	0.00
	合计	11,585,767,292.32	94.68

### 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	601318	中国平安	7,821,439	584,339,707.69	4.78
2	601166	兴业银行	34,543,467	569,967,205.50	4.66
3	600000	浦发银行	26,099,624	409,503,100.56	3.35
4	600030	中信证券	10,731,435	363,795,646.50	2.97
5	000002	万科A	24,494,825	340,478,067.50	2.78
6	601607	上海医药	18,605,403	306,989,149.50	2.51
7	600036	招商银行	17,850,000	296,131,500.00	2.42

8	601169	北京银行	25,036,196	273,645,622.28	2.24
9	600028	中国石化	41,897,694	271,916,034.06	2.22
10	600104	上汽集团	11,559,344	248,179,115.68	2.03

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	601607	上海医药	332,573,340.53	3.92
2	601166	兴业银行	274,292,536.93	3.23
3	600028	中国石化	269,482,820.62	3.18
4	601169	北京银行	240,898,726.77	2.84
5	600000	浦发银行	232,939,924.15	2.75
6	002202	金风科技	223,886,321.00	2.64
7	000001	平安银行	196,876,206.21	2.32
8	601009	南京银行	186,161,987.34	2.20
9	600150	中国船舶	185,553,514.30	2.19
10	601318	中国平安	178,690,080.00	2.11
11	600886	国投电力	158,042,956.92	1.86
12	601555	东吴证券	154,747,875.60	1.82
13	601818	光大银行	154,065,292.26	1.82
14	600104	上汽集团	153,268,816.89	1.81
15	600109	国金证券	149,052,437.33	1.76
16	000876	新希望	141,381,301.49	1.67
17	000728	国元证券	138,237,197.72	1.63
18	000002	万科 A	137,395,755.45	1.62
19	600741	华域汽车	135,081,711.77	1.59
20	600050	中国联通	123,891,163.17	1.46

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。

##### 8.4.2 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	000001	平安银行	295,450,934.55	3.48
2	600016	民生银行	280,388,505.64	3.31
3	600000	浦发银行	171,458,882.18	2.02
4	601288	农业银行	151,576,249.04	1.79
5	600252	中恒集团	149,376,503.41	1.76
6	601669	中国电建	144,448,348.29	1.70
7	002500	山西证券	140,919,057.84	1.66

8	000540	中天城投	134,940,507.14	1.59
9	601390	中国中铁	132,464,090.59	1.56
10	601998	中信银行	128,591,694.11	1.52
11	600109	国金证券	124,900,314.67	1.47
12	601166	兴业银行	121,874,082.25	1.44
13	000858	五粮液	118,933,160.36	1.40
14	600030	中信证券	108,959,334.48	1.28
15	600827	百联股份	106,143,468.86	1.25
16	601328	交通银行	104,966,694.49	1.24
17	601009	南京银行	103,891,021.52	1.23
18	600216	浙江医药	95,989,985.21	1.13
19	601318	中国平安	95,074,681.03	1.12
20	600519	贵州茅台	93,708,068.11	1.10

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	17,957,539,075.15
卖出股票的收入（成交）总额	18,309,868,445.55

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	75,867,289.00	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	48,667,575.27	0.40
8	其他	-	-
9	合计	124,534,864.27	1.02

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019414	14 国债 14	510,000	51,300,900.00	0.42
2	113001	中行转债	217,000	33,980,030.00	0.28
3	019418	14 国债 18	100,000	10,040,000.00	0.08
4	113007	吉视转债	78,670	9,815,655.90	0.08

5	019028	10 国债 28	65,370	6,517,389.00	0.05
---	--------	----------	--------	--------------	------

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 8.8 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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 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仓股指期货。

### 8.11 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仓国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除中国石油化工股份有限公司（中国石化）外，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。

中国石油化工股份有限公司于 2014 年 1 月 12 日发布公告称，国务院对山东省青岛市“1122”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查报告作出批复，同意国务院事故调查组的调查处理结果，认定是一起特别重大责任事故；同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议，对中国石化及当地政府的 48 名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯罪的 15 名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

对该证券投资决策程序的说明：

根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 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	683,453.99
2	应收证券清算款	12,623,399.14
3	应收股利	-
4	应收利息	1,505,777.61
5	应收申购款	40,856,467.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	55,669,098.38

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113001	中行转债	33,980,030.00	0.28
2	128002	东华转债	83,145.67	0.00

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
514,353	23,013.33	2,417,953,797.39	20.43%	9,419,021,224.10	79.57%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,579,816.53	0.02%

### 9.3 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	0.00
本基金基金经理持有本开放式基金	0.00

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基金；  
 2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003年8月26日)基金份额总额	5,126,401,391.87
本报告期期初基金份额总额	12,942,911,234.67
本报告期基金总申购份额	3,116,329,932.86
减:本报告期基金总赎回份额	4,222,266,146.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,836,975,021.49

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况: 1) 基金管理人于2014年4月19日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,李志惠不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务; 2) 基金管理人于2014年11月7日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,聘任洪小源先生担任博时基金管理有限公司董事长及法定代表人职务,杨鹁女士不再担任博时基金管理有限公司董事长职务。

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人 2014 年 11 月 03 日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 130,000 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
新时代	2	5,781,830,357.62	15.97%	4,107,436.88	14.31%	新增 2 个
招商证券	3	4,766,584,350.90	13.17%	4,185,884.59	14.58%	-
中信建投	3	4,134,912,651.15	11.42%	3,764,357.32	13.11%	-
广州证券	1	3,455,410,153.17	9.54%	2,454,579.56	8.55%	-
财富里昂	1	3,433,788,359.26	9.48%	2,439,386.31	8.50%	-
中信证券	5	3,353,964,665.45	9.26%	2,707,775.33	9.43%	新增 2 个
中金公司	1	2,249,150,145.39	6.21%	2,047,658.74	7.13%	-
国泰君安	4	1,996,705,075.95	5.52%	1,817,781.51	6.33%	-
华创证券	1	1,822,603,199.26	5.03%	1,294,803.94	4.51%	新增
民生证券	1	1,744,499,220.59	4.82%	1,239,270.93	4.32%	-
东方证券	3	1,438,515,561.91	3.97%	1,021,919.78	3.56%	-
中投证券	2	780,963,806.64	2.16%	711,004.15	2.48%	-
国信证券	1	696,272,445.70	1.92%	494,628.65	1.72%	新增
国开证券	1	384,855,786.65	1.06%	273,412.86	0.95%	-
平安证券	1	148,343,716.98	0.41%	135,052.54	0.47%	-
高华证券	1	12,670,895.24	0.03%	11,535.82	0.04%	-
瑞银证券	1	1,790,492.00	0.00%	1,552.83	0.01%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

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。

博时基金管理有限公司

2015 年 3 月 28 日