

博时产业新动力灵活配置混合型发起式  
证券投资基金摘要  
2015 年年度报告  
2015 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十六日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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 2015 年 1 月 26 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	博时产业新动力混合
基金主代码	000936
交易代码	000936
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 26 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	318,503,039.20 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对符合或引领国内产业创新、制造业升级趋势的优质企业的深入研究，在严格控制估值风险及流动性风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值
投资策略	本基金投资策略分三个层次：首先是大类资产配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业发展规律和内在逻辑，在不同行业之间进行动态配置；最后是个股选择策略和债券投资策略。
业绩比较基准	中证全指工业指数收益率×70%+中国债券总指数收益率×30%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	洪渊
	联系电话	0755-83169999	(010) 66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	(010) 66105798

### 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	2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	519,298,216.78
本期利润	562,486,346.11
加权平均基金份额本期利润	0.6684
本期基金份额净值增长率	37.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3764
期末基金资产净值	438,383,777.16
期末基金份额净值	1.376

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。

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	28.36%	1.86%	13.03%	1.34%	15.33%	0.52%
过去六个月	-3.51%	2.90%	-10.55%	2.26%	7.04%	0.64%
自基金合同生效起至今	37.60%	2.63%	23.28%	2.02%	14.32%	0.61%

注：本基金的业绩比较基准：中证全指工业指数收益率×70%+中国债券总指数收益率×30%。

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 70%、30%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

博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金

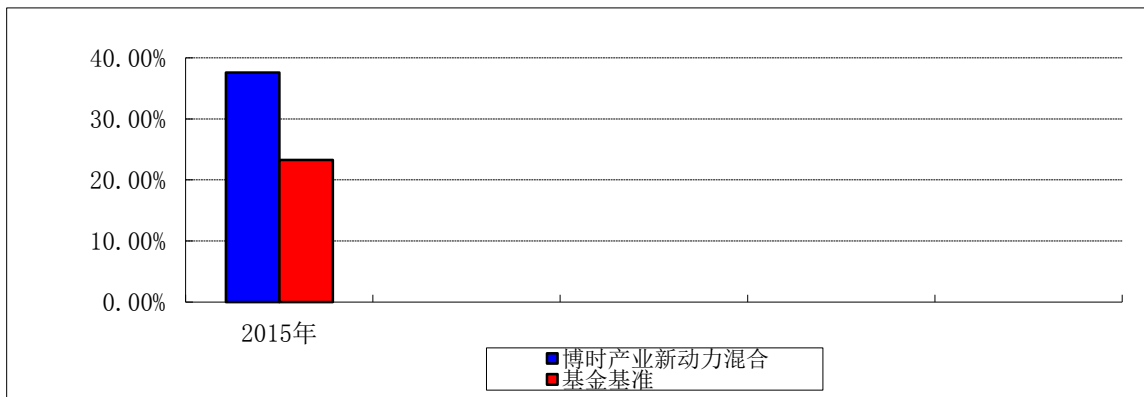
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2015 年 1 月 26 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：本基金合同于 2015 年 1 月 26 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条（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金  
自基金合同生效以来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 2015 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理八十五只开放式基金，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。资产管理净值总规模逾 3980 亿元人民币。

币，其中公募基金资产规模约 2054 亿元人民币，累计分红约 677 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 12 月 31 日，指数股票型基金中，博时深证基本面 200ETF 及深证基本面 200ETF 联接，今年以来净值增长率在同类型分别排名前 1/2 和 1/3；偏股型的混合基金里，博时创业成长混合及博时卓越品牌混合，今年以来净值增长率在同类型基金中分别排名前 1/4 和 1/3；灵活配置型的混合基金里，裕隆灵活配置混合今年以来净值增长率在 101 只同类型中排名前 1/2；灵活策略混合基金里，博时裕益及博时回报，在 39 只同类基金分别排名前 1/5 和 1/3。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券 LOF 今年以来净值增长率在 19 只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一；在长期标准债券型基金中，博时安心收益定期开放债券 C 类今年以来净值增长率在同类排名前 1/7，安心 A 类排名前 1/6，博时信用债纯债 A 及博时优势收益信用债，在 70 只同类中排名前 1/2；中短期标准债券基金 A 类里，博时安盈债券 A 在同类排名第二；普通债券型基金里，博时稳定价值债券 A 类在同类 85 只排名前 1/9，博时稳定价值债券 B 类在 50 只同类排名前 10%；可转换债券型基金 A 类和指数债券型基金 A 类里，博时转债增强债券 A 及博时上证企债 30ETF 在同类基金中排名前 1/2；货币市场基金中，博时现金宝货币 A 在同类 146 只排名前 1/3。

### 2、其他大事件

2015 年 12 月 18 日，由东方财富网主办的 2015 年东方财富风云榜活动在深举行，博时基金荣获“2015 年度最优 QDII 产品基金公司奖”。

2015 年 12 月 17 日，由华夏日报主办第九届机构投资者年会暨金蝉奖颁奖盛典，博时基金荣获“2015 年度最具互联网创新基金公司”。

2015 年 12 月 16 日，由北京商报主办的 2015 北京金融论坛，博时基金荣获“品牌推广卓越奖”。

2015 年 12 月 11 日，由第一财经日报主办的 2015 金融价值榜典礼在北京金融街威斯汀酒店举行，博时基金荣获“最佳财富管理金融机构”大奖。

2015 年 12 月 11 日，由 21 世纪经济报道主办的 2015 亚洲资本年会在深圳洲际酒店举行，博时基金获评“2015 最受尊敬基金公司”、张光华董事长获评“2015 中国赢基金任务奖”。

2015 年 12 月 4 日，由经济观察报主办的 2014-2015 年度中国卓越金融奖颁奖典礼

在北京举行，博时基金凭借旗下固定收益类的出色表现，独家获评“年度卓越固定收益投资团队奖”。

2015 年 11 月 26 日，由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的 CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金荣获“年度最佳基金公司”大奖。

2015 年 11 月 20 日，第十一届中国证券市场年会，博时基金获评“年度卓越贡献龙鼎奖”。

2015 年 11 月 7 日，由每日经济新闻主办的第四届中国上市公司领袖峰会在成都香格里拉举行，博时资本荣获“最具成长性子公司”。

2015 年 8 月 3 日，博时基金经理过钧和张溪冈，荣获证券时报颁发的“英华奖”；同时，过钧获得证券时报评选的“三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理”，张溪冈获得证券时报评选的“三年期海外投资-最佳基金经理”。

2015 年 4 月 22 日，在由上海证券报社主办的第十二届中国“金基金”奖的评选中，博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得金基金·5 年期股票型金基金奖。

2015 年 4 月 17 日，在由证券时报社主办，晨星资讯、上海证券和济安金信提供评奖支持的 2014 年度“中国基金业明星基金奖”评选中，博时基金旗下博时主题行业与博时信用债分别获得五年持续回报股票型明星基金奖、2014 年度积极债券型明星基金奖。

2015 年 3 月 28 日，在第十二届中国基金业金牛奖评选中，博时基金旗下博时主题行业(LOF)基金、博时信用债券基金分别获得“2014 年度开放式股票型金牛基金”奖、“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2015 年 1 月 21 日，在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中，博时转债增强荣获第八届金蝉奖“2014 最佳年度债基品牌奖”。

2015 年 1 月 18 日，博时基金(香港)在和讯财经风云榜海外评选中荣获“最佳中资基金公司”奖。

2015 年 1 月 15 日，在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中，博时基金获评第十二届中国财经风云榜“年度十大品牌基金公司”奖。

2015 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”。

2015 年 1 月 7 日，博时基金在 2014 年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。



#### 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		
蔡滨	基金经理	2015-01-26	-	8	2001 年起先后在上海振华职校、美国总统轮船（中国）有限公司、美国管理协会、平安证券工作。2009 年加入博时基金管理有限公司，历任研究部研究员、研究部副总经理兼资本品组组长。现任博时主题行业混合（LOF）基金兼博时产业新动力混合基金的基金经理。

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

自 2015 年 1 月 26 日成立以来，本基金产品贯彻产业新动力投资理念，持续从产业升级和改革转型方向挖掘优质投资标的。主要采取行业比较、精选个股的投资策略，重点关注军工、环保、新能源、自动化、高端装备、互联网+等行业主题机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.376 元，累计份额净值为 1.376 元，报告期内净值增长率为 37.60%，同期业绩基准涨幅为 23.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于目前市场估值水平以及利率下行、货币偏宽松趋势，整体上，我们认为 2016 年 A 股市场仍有较好的投资环境和投资机会；但影响市场的不确定性因素增多，宏观上，我们需要对美元加息进度、国内财政政策刺激以及各项改革举措的推进力度等保持紧密跟踪观察。在经济改革转型的背景下，我们持续看好受益于产业升级和改革转型的优质企业的中长期投资机会。同时也会积极关注受美元政策及宏观政策影响较大的周期性行业的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2015 年，我公司根据法律、法规的规定，制定、修订和完善了《博时基金融资融券及转融通投资管理制度》、《博时基金管理有限公司产品委员会制度》、《投资决策委员会制度》、《风险管理委员会制度》、《债券型基金股票投资管理流程》、《股票池管理办法》、《债券池管理办法》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关

系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。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，本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末
----	-----

	2015 年 12 月 31 日
资 产:	-
银行存款	45,029,343.67
结算备付金	4,229,532.53
存出保证金	780,986.19
交易性金融资产	346,966,423.45
其中: 股票投资	346,966,423.45
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	66,400,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	16,043.23
应收股利	-
应收申购款	207,529.81
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>463,629,858.88</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>
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	19,189,348.96
应付赎回款	3,934,326.11
应付管理人报酬	562,381.17
应付托管费	93,730.16
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,267,224.13
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	199,071.19
<b>负债合计</b>	<b>25,246,081.72</b>
<b>所有者权益:</b>	-
实收基金	318,503,039.20
未分配利润	119,880,737.96
<b>所有者权益合计</b>	<b>438,383,777.16</b>

负债和所有者权益总计	463,629,858.88
------------	----------------

注：

1. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.376 元，基金份额总额 318,503,039.20 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>591,541,244.47</b>
1. 利息收入	7,241,724.02
其中：存款利息收入	1,698,571.82
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	5,543,152.20
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	528,529,290.80
其中：股票投资收益	525,622,703.46
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	2,906,587.34
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	43,188,129.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	12,582,100.32
<b>减：二、费用</b>	<b>29,054,898.36</b>
1. 管理人报酬	14,062,693.18
2. 托管费	2,343,782.22
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	12,250,027.91
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	398,395.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>562,486,346.11</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>562,486,346.11</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时产业新动力灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 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）	2,371,474,753.32	-	2,371,474,753.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	562,486,346.11	562,486,346.11
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）	-2,052,971,714.12	-442,605,608.15	-2,495,577,322.27
其中：1. 基金申购款	669,988,811.73	199,593,173.04	869,581,984.77
2. 基金赎回款	-2,722,960,525.85	-642,198,781.19	-3,365,159,307.04
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）	318,503,039.20	119,880,737.96	438,383,777.16

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：

基金管理人负责人：江向阳

主管会计工作的负责人：王德英

会计机构负责人：成江

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

##### 7.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.1.3 金融资产和金融负债的分类



#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.1.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.1.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确

认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.1.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.1.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

#### 7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.2.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.3 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》、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》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，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

#### 7.4.4 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东
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
上海汇华实业有限公司	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
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 于 2015 年 7 月 16 日，根据基金管理人发布的《博时基金管理有限公司关于股权变更及修改〈公司章程〉的公告》，并经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2015]812 号)，博时基金原股东璟安股权投资有限公司将所持本公司 12%股权转让给博时基金现股东上海汇华实业有限公司。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	44,983,807.71	0.53%

##### 7.4.5.1.2 交易所债券交易

无。

##### 7.4.5.1.3 交易所回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期交易所回购成交总额的比例
招商证券	304,300,000.00	0.99%

##### 7.4.5.1.4 权证交易

无。



#### 7.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2015 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 总额的比例
招商证券	41,893.95	0.61%	41,893.95	3.31%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人于对方协商确定，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。

#### 7.4.5.2 关联方报酬

##### 7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,062,693.18
其中：支付销售机构的客户维护费	7,415,189.69

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 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,343,782.22

注：支付基金托管人中国工商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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期 2015 年 1 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2015
----	--



	年 12 月 31 日
基金合同生效日（2015 年 1 月 26 日）持有的基金份额	9,000,750.08
报告期初持有的基金份额	9,000,750.08
报告期间申购/买入总份额	
报告期间因拆分变动份额	
减：报告期间赎回/卖出总份额	
报告期末持有的基金份额	9,000,750.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.83%

#### 7.4.5.4.2 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。

#### 7.4.5.5 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 2015 年 1 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	45,029,343.67	1,388,385.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.6 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.6.2 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
002340	格林美	2015/12/29	重大事项	15.20	2016/1/6	14.35	722,700.00	11,084,927.80	10,985,040.00	-
600122	宏图高科	2015/12/25	重大事项	19.42	未复牌	未复牌	678,300.00	11,537,727.39	13,172,586.00	-
合计								22,622,655.19	24,157,626.00	

##### 7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.7 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 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 322,808,797.45 元，属于第二层级的余额为 241,57,626.00 元，无属于第三层级的余额。

###### (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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.1)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

###### (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 2015 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。

###### (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	346,966,423.45	74.84
	其中：股票	346,966,423.45	74.84
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	66,400,000.00	14.32
	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	49,258,876.20	10.62
7	其他各项资产	1,004,559.23	0.22
8	合计	463,629,858.88	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	263,477,307.76	60.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,993,005.00	2.51
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,172,586.00	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	37,832,192.49	8.63
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	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,795.00	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	9,231,200.00	2.11
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	12,251,337.20	2.79
S	综合	-	-
	合计	346,966,423.45	79.15

### 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	300230	永利股份	967,494	36,155,250.78	8.25
2	300195	长荣股份	1,438,430	34,364,092.70	7.84
3	002224	三力士	1,207,667	26,230,527.24	5.98
4	600029	南方航空	2,909,000	24,930,130.00	5.69
5	300145	南方泵业	470,984	22,428,258.08	5.12
6	603318	派思股份	356,466	19,573,548.06	4.46
7	603308	应流股份	595,649	18,655,726.68	4.26
8	002322	理工监测	654,600	16,541,742.00	3.77
9	300342	天银机电	295,900	13,611,400.00	3.10
10	600122	宏图高科	678,300	13,172,586.00	3.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	186,830,413.15	42.62
2	600029	南方航空	162,672,846.38	37.11
3	600570	恒生电子	112,793,743.38	25.73
4	600418	江淮汽车	99,195,773.42	22.63
5	600688	上海石化	92,086,942.34	21.01
6	002410	广联达	89,908,283.91	20.51
7	002081	金螳螂	84,537,819.79	19.28
8	000801	四川九洲	74,863,919.44	17.08
9	300145	南方泵业	70,750,794.99	16.14
10	601688	华泰证券	69,462,038.89	15.85
11	002009	天奇股份	69,052,302.82	15.75
12	601006	大秦铁路	68,245,481.61	15.57

13	300159	新研股份	66,564,472.54	15.18
14	000712	锦龙股份	65,750,675.33	15.00
15	000768	中航飞机	62,999,300.88	14.37
16	002573	清新环境	62,453,747.74	14.25
17	603766	隆鑫通用	56,150,606.71	12.81
18	600990	四创电子	54,498,634.82	12.43
19	601318	中国平安	52,875,738.00	12.06
20	600105	永鼎股份	50,880,834.62	11.61
21	002407	多氟多	49,899,291.52	11.38
22	002380	科远股份	49,617,982.41	11.32
23	000523	广州浪奇	48,450,042.44	11.05
24	603308	应流股份	46,066,247.08	10.51
25	000550	江铃汽车	45,986,321.06	10.49
26	600497	驰宏锌锗	43,935,321.36	10.02
27	600566	济川药业	42,933,213.89	9.79
28	600115	东方航空	42,167,265.69	9.62
29	002236	大华股份	41,429,152.06	9.45
30	300059	东方财富	40,810,530.00	9.31
31	300284	苏交科	39,625,855.42	9.04
32	300291	华录百纳	39,574,993.84	9.03
33	300007	汉威电子	38,417,864.13	8.76
34	000078	海王生物	38,001,376.48	8.67
35	300195	长荣股份	37,522,718.94	8.56
36	300230	永利股份	36,324,633.60	8.29
37	002375	亚厦股份	35,602,551.47	8.12
38	000910	大亚科技	35,223,474.79	8.03
39	001696	宗申动力	34,857,672.10	7.95
40	002426	胜利精密	32,769,871.57	7.48
41	600151	航天机电	31,154,329.11	7.11
42	300186	大华农	30,987,686.40	7.07
43	002253	川大智胜	30,395,351.60	6.93
44	002285	世联行	29,886,879.01	6.82
45	002396	星网锐捷	29,367,633.54	6.70
46	002234	民和股份	29,175,971.28	6.66
47	300408	三环集团	28,523,179.20	6.51
48	002675	东诚药业	28,028,118.00	6.39
49	600325	华发股份	28,027,927.26	6.39
50	601288	农业银行	27,325,809.69	6.23
51	002111	威海广泰	26,205,836.70	5.98
52	002224	三力士	26,053,248.72	5.94
53	002364	中恒电气	25,951,894.84	5.92
54	601111	中国国航	24,674,182.16	5.63
55	300097	智云股份	24,524,178.98	5.59

56	002657	中金金财	24,303,477.62	5.54
57	601988	中国银行	24,122,035.00	5.50
58	002653	海思科	23,685,183.69	5.40
59	002585	双星新材	23,672,417.87	5.40
60	000858	五粮液	23,408,337.50	5.34
61	600805	悦达投资	22,369,552.01	5.10
62	300011	鼎汉技术	22,321,048.17	5.09
63	002137	麦达数字	21,909,865.33	5.00
64	600391	成发科技	21,685,888.70	4.95
65	600026	中海发展	21,646,399.19	4.94
66	002456	欧菲光	21,255,775.00	4.85
67	601169	北京银行	20,890,152.00	4.77
68	002049	同方国芯	20,392,901.33	4.65
69	002448	中原内配	20,319,471.20	4.64
70	002299	圣农发展	20,019,065.75	4.57
71	000926	福星股份	19,500,705.71	4.45
72	002121	科陆电子	18,528,011.00	4.23
73	000625	长安汽车	18,194,351.23	4.15
74	002174	游族网络	17,554,551.30	4.00
75	002100	天康生物	17,240,605.00	3.93
76	002488	金固股份	17,236,442.00	3.93
77	600138	中青旅	17,123,772.33	3.91
78	000028	国药一致	16,505,977.20	3.77
79	002366	台海核电	16,439,301.74	3.75
80	603318	派思股份	16,276,008.58	3.71
81	600823	世茂股份	16,245,347.74	3.71
82	601998	中信银行	15,971,342.25	3.64
83	603019	中科曙光	15,508,000.90	3.54
84	002244	滨江集团	15,498,354.74	3.54
85	002322	理工监测	15,205,302.51	3.47
86	600594	益佰制药	15,091,454.68	3.44
87	300048	合康变频	14,795,183.80	3.37
88	300285	国瓷材料	14,597,254.28	3.33
89	002241	歌尔声学	14,377,528.55	3.28
90	600428	中远航运	14,227,950.80	3.25
91	002666	德联集团	14,146,220.01	3.23
92	000899	赣能股份	14,126,031.74	3.22
93	300016	北陆药业	13,848,972.96	3.16
94	002362	汉王科技	13,802,047.49	3.15
95	300075	数字政通	13,669,633.19	3.12
96	002074	国轩高科	13,638,678.00	3.11
97	000619	海螺型材	13,268,504.12	3.03
98	002001	新和成	13,229,014.44	3.02



99	600162	香江控股	13,113,318.14	2.99
100	002117	东港股份	13,098,968.76	2.99
101	300224	正海磁材	12,989,796.85	2.96
102	600703	三安光电	12,959,007.23	2.96
103	601198	东兴证券	12,952,354.00	2.95
104	600782	新钢股份	12,862,578.19	2.93
105	600058	五矿发展	12,847,303.00	2.93
106	000860	顺鑫农业	12,492,858.80	2.85
107	000848	承德露露	12,488,287.90	2.85
108	300425	环能科技	12,358,059.50	2.82
109	002312	三泰控股	12,204,047.60	2.78
110	002504	弘高创意	11,980,525.81	2.73
111	603898	好莱客	11,905,780.00	2.72
112	002644	佛慈制药	11,755,581.25	2.68
113	000046	泛海控股	11,740,000.00	2.68
114	600585	海螺水泥	11,734,812.00	2.68
115	300342	天银机电	11,708,290.00	2.67
116	600759	洲际油气	11,661,862.00	2.66
117	002086	东方海洋	11,560,066.99	2.64
118	600122	宏图高科	11,537,727.39	2.63
119	000878	云南铜业	11,284,296.00	2.57
120	002004	华邦健康	11,271,530.32	2.57
121	600483	福能股份	11,203,114.55	2.56
122	002547	春兴精工	11,090,628.12	2.53
123	002340	格林美	11,084,927.80	2.53
124	000423	东阿阿胶	10,983,130.75	2.51
125	002538	司尔特	10,949,868.40	2.50
126	600433	冠豪高新	10,935,620.91	2.49
127	002284	亚太股份	10,919,558.38	2.49
128	300303	聚飞光电	10,633,695.72	2.43
129	002350	北京科锐	10,443,962.20	2.38
130	600829	人民同泰	10,042,408.40	2.29
131	603030	全筑股份	9,812,203.00	2.24
132	601199	江南水务	9,798,984.80	2.24
133	300047	天源迪科	9,788,400.00	2.23
134	300218	安利股份	9,739,504.23	2.22
135	601888	中国国旅	9,630,384.74	2.20
136	600270	外运发展	9,614,346.50	2.19
137	002124	天邦股份	9,392,459.20	2.14
138	002033	丽江旅游	9,116,384.00	2.08
139	002450	康得新	8,807,738.50	2.01
140	600081	东风科技	8,791,949.47	2.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600029	南方航空	214,179,027.54	48.86
2	601166	兴业银行	200,222,186.49	45.67
3	600688	上海石化	150,778,473.71	34.39
4	000801	四川九洲	117,262,987.23	26.75
5	600418	江淮汽车	115,319,634.61	26.31
6	600570	恒生电子	109,726,966.01	25.03
7	002081	金螳螂	104,146,803.84	23.76
8	002009	天奇股份	100,864,705.12	23.01
9	002380	科远股份	96,497,851.78	22.01
10	600990	四创电子	89,135,431.39	20.33
11	002410	广联达	86,442,427.21	19.72
12	000712	锦龙股份	82,489,816.51	18.82
13	300145	南方泵业	71,817,266.93	16.38
14	002573	清新环境	70,253,375.00	16.03
15	601006	大秦铁路	68,009,652.81	15.51
16	603766	隆鑫通用	66,562,137.12	15.18
17	000523	广州浪奇	64,381,509.74	14.69
18	300159	新研股份	63,240,173.06	14.43
19	601688	华泰证券	62,538,039.73	14.27
20	002236	大华股份	61,433,376.83	14.01
21	300284	苏交科	61,374,350.86	14.00
22	300007	汉威电子	59,989,566.78	13.68
23	000078	海王生物	56,919,652.21	12.98
24	600566	济川药业	56,406,874.86	12.87
25	601318	中国平安	55,542,786.28	12.67
26	002285	世联行	48,987,941.93	11.17
27	002396	星网锐捷	46,529,888.78	10.61
28	000550	江铃汽车	46,520,754.90	10.61
29	002375	亚厦股份	45,976,144.72	10.49
30	000768	中航飞机	45,268,325.14	10.33
31	002407	多氟多	45,141,420.25	10.30
32	600497	驰宏锌锗	42,291,012.49	9.65
33	600105	永鼎股份	41,779,914.29	9.53
34	000910	大亚科技	39,391,086.61	8.99
35	600115	东方航空	38,009,503.29	8.67
36	002426	胜利精密	37,714,585.66	8.60
37	300408	三环集团	37,050,404.40	8.45
38	300230	永利股份	35,596,516.39	8.12
39	002049	同方国芯	35,386,235.60	8.07

40	300059	东方财富	35,337,856.28	8.06
41	001696	宗申动力	32,906,350.51	7.51
42	002253	川大智胜	30,073,846.36	6.86
43	002364	中恒电气	29,428,166.90	6.71
44	600325	华发股份	27,717,980.80	6.32
45	603019	中科曙光	27,434,162.20	6.26
46	601288	农业银行	27,388,510.00	6.25
47	600151	航天机电	26,445,726.00	6.03
48	002137	麦达数字	25,753,941.37	5.87
49	002234	民和股份	25,246,850.80	5.76
50	002657	中科金财	24,741,086.60	5.64
51	600391	成发科技	23,784,320.38	5.43
52	000926	福星股份	22,926,613.66	5.23
53	300011	鼎汉技术	22,653,724.57	5.17
54	300075	数字政通	22,649,549.70	5.17
55	600805	悦达投资	22,424,224.18	5.12
56	601111	中国国航	21,959,683.10	5.01
57	601988	中国银行	21,721,136.00	4.95
58	000625	长安汽车	21,091,615.64	4.81
59	600026	中海发展	20,950,053.58	4.78
60	300498	温氏股份	20,525,053.74	4.68
61	600823	世茂股份	20,495,482.54	4.68
62	601169	北京银行	19,578,897.95	4.47
63	002111	威海广泰	19,303,022.45	4.40
64	002488	金固股份	19,149,440.47	4.37
65	002448	中原内配	19,119,451.00	4.36
66	002675	东诚药业	19,025,290.94	4.34
67	002653	海思科	18,499,750.10	4.22
68	300195	长荣股份	18,484,771.41	4.22
69	603308	应流股份	18,175,064.63	4.15
70	000858	五粮液	17,288,304.00	3.94
71	002100	天康生物	17,094,313.00	3.90
72	002174	游族网络	16,892,288.00	3.85
73	600058	五矿发展	16,837,104.85	3.84
74	002666	德联集团	16,796,671.70	3.83
75	300097	智云股份	16,706,980.00	3.81
76	300291	华录百纳	16,563,461.45	3.78
77	002074	国轩高科	16,204,725.04	3.70
78	000028	国药一致	16,077,139.00	3.67
79	002244	滨江集团	15,945,267.73	3.64
80	601998	中信银行	15,821,775.55	3.61
81	002121	科陆电子	15,746,838.79	3.59
82	002456	欧菲光	15,723,813.28	3.59

83	300048	合康变频	15,352,439.70	3.50
84	300016	北陆药业	15,326,892.00	3.50
85	002001	新和成	15,069,436.86	3.44
86	002299	圣农发展	14,746,175.98	3.36
87	300425	环能科技	14,709,065.22	3.36
88	000619	海螺型材	14,700,020.30	3.35
89	603686	龙马环卫	14,599,458.00	3.33
90	002504	弘高创意	14,203,280.10	3.24
91	600782	新钢股份	14,143,876.99	3.23
92	000848	承德露露	14,030,217.32	3.20
93	002241	歌尔声学	13,963,616.03	3.19
94	000046	泛海控股	13,913,306.00	3.17
95	600594	益佰制药	13,842,187.98	3.16
96	300303	聚飞光电	13,812,584.87	3.15
97	300186	大华农	13,797,938.00	3.15
98	600162	香江控股	13,372,791.33	3.05
99	002538	司尔特	13,342,336.40	3.04
100	002117	东港股份	13,174,261.43	3.01
101	300224	正海磁材	13,153,617.93	3.00
102	002362	汉王科技	12,677,271.06	2.89
103	002366	台海核电	12,541,008.00	2.86
104	002124	天邦股份	12,471,376.98	2.84
105	600138	中青旅	12,173,111.56	2.78
106	600703	三安光电	12,131,811.72	2.77
107	600585	海螺水泥	11,983,793.00	2.73
108	002086	东方海洋	11,708,847.50	2.67
109	600428	中远航运	11,707,632.00	2.67
110	002004	华邦健康	11,576,622.80	2.64
111	000860	顺鑫农业	11,474,565.15	2.62
112	601199	江南水务	11,276,390.73	2.57
113	601198	东兴证券	11,270,714.50	2.57
114	000423	东阿阿胶	10,957,391.72	2.50
115	300285	国瓷材料	10,822,393.00	2.47
116	002312	三泰控股	10,561,794.55	2.41
117	002644	佛慈制药	10,378,170.90	2.37
118	002350	北京科锐	10,303,770.00	2.35
119	002585	双星新材	10,289,414.70	2.35
120	600292	中电远达	9,921,564.01	2.26
121	000899	赣能股份	9,899,018.73	2.26
122	600759	洲际油气	9,790,855.36	2.23
123	600829	人民同泰	9,515,833.75	2.17
124	002284	亚太股份	9,488,367.00	2.16
125	603030	全筑股份	9,408,206.00	2.15

126	300328	宜安科技	9,399,062.02	2.14
127	601678	滨化股份	9,206,125.76	2.10
128	600522	中天科技	8,931,133.60	2.04
129	002138	顺络电子	8,911,017.28	2.03

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	4,247,497,919.55
卖出股票的收入（成交）总额	4,491,650,404.43

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 报告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。

#### 8.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 报告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。

#### 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 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有股指期货。

#### 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有国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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(元)
1	存出保证金	780,986.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,043.23
5	应收申购款	207,529.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,004,559.23

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600122	宏图高科	13,172,586.00	3.00	重大资产重组

### 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
9,699	32838.75	14,825,259.07	4.65%	303,677,780.13	95.35%

### 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,366,519.68	0.43%

### 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、基金投资和研发部	-



门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：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；

#### 9.4 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,000,750.08	2.83%	9,000,750.08	2.83%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	1,009,977.13	0.32%	1,009,977.13	0.32%	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,010,727.21	3.14%	10,010,727.21	3.14%	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年1月26日)基金份额总额	2,371,474,753.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	669,988,811.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,722,960,525.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	318,503,039.20

## § 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 2015 年 4 月 13 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》，吴姚东先生不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英先生代任博时基金管理有限公司总经理职务；2) 基金管理人于 2015 年 6 月 20 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》，聘任徐卫先生担任博时基金管理有限公司副总经理职务；3) 基金管理人于 2015 年 7 月 10 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》，聘任江向阳先生担任博时基金管理有限公司总经理职务；4) 基金管理人于 2015 年 8 月 8 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》，聘任张光华先生担

任博时基金管理有限公司董事长及法定代表人职务，洪小源先生不再担任博时基金管理有限公司董事长职务。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 100000 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

2015 年 2 月，我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求公司对后台权限设置等问题进行改正，我司立即进行了改正并已经完成了验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
中信建设	1	2,937,243,736.14	33.70%	2,088,471.31	30.57%	-
华泰证券	3	2,273,461,745.21	26.09%	1,670,423.03	24.45%	新增 1 个
国信证券	1	899,495,158.64	10.32%	818,903.52	11.99%	-
广发证券	2	486,115,807.70	5.58%	447,957.49	6.56%	-
平安证券	1	326,347,986.73	3.74%	297,107.09	4.35%	-
恒泰证券	1	236,145,928.30	2.71%	172,693.05	2.53%	新增 1 个
华西证券	1	234,605,628.26	2.69%	218,488.98	3.20%	新增 1 个
光大证券	1	222,658,543.23	2.55%	207,362.18	3.04%	新增 1 个
中信证券	1	221,962,022.43	2.55%	202,074.97	2.96%	-
齐鲁证券	1	192,998,719.15	2.21%	137,625.73	2.01%	-
西部证券	1	162,363,276.27	1.86%	115,342.05	1.69%	-
中金公司	1	155,771,204.87	1.79%	145,071.74	2.12%	新增 1 个

银河证券	1	86,538,294.28	0.99%	80,590.76	1.18%	新增 1 个
宏信证券	1	82,570,904.50	0.95%	60,384.22	0.88%	新增 1 个
国金证券	1	66,089,078.63	0.76%	61,547.41	0.90%	新增 1 个
宏源证券	1	65,937,949.06	0.76%	46,842.72	0.69%	-
招商证券	1	44,983,807.71	0.53%	41,893.95	0.61%	新增 1 个
申银万国	1	19,806,387.33	0.23%	18,445.96	0.27%	新增 1 个
英大证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
首创证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

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；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

### 11.7.2 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	
	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
华泰证券	-	-	23,186,500,000.00	74.39%
中金公司	-	-	2,948,300,000.00	9.46%
广发证券	-	-	2,484,200,000.00	7.97%
齐鲁证券	-	-	716,500,000.00	2.30%
西部证券	-	-	560,400,000.00	1.80%
银河证券	-	-	490,800,000.00	1.57%
招商证券	-	-	304,300,000.00	0.98%
申银万国	-	-	240,000,000.00	0.77%
国金证券	-	-	156,100,000.00	0.50%

宏源证券	-	-	80,000,000.00	0.26%
中信建设	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-

博时基金管理有限公司  
二〇一六年三月二十六日