

# 博时新兴成长混合型证券投资基金

## 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十六日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人交通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。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§ 6 审计报告	13
6.1 管理层对财务报表的责任	13
6.2 注册会计师的责任	14
6.3 审计意见	14
§ 7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§ 8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41

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 .....	42
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	42
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
8.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	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 .....	43
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
11.4 基金投资策略的改变 .....	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
11.8 其他重大事件 .....	46
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时新兴成长混合型证券投资基金
基金简称	博时新兴成长混合
基金主代码	050009
交易代码	050009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 7 月 6 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,146,415,558.37 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	基于中国经济正处于长期稳定增长周期，本基金通过深入研究并积极投资于全市场各类行业中的新兴高速成长企业，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过“自上而下”的宏观分析，以及定性分析与定量分析相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行配置。本基金将分析和预测众多宏观经济变量，包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等，并关注国家财政、税收、货币、汇率以及股权分置改革政策和其它证券市场政策等。本基金将在此基础上决定股票、固定收益证券和现金等大类资产在给定区间内的动态配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险/收益品种

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	汤嵩彦
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		518040	200120
法定代表人		张光华	牛锡明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

## § 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	2014 年	2013 年
本期已实现收益	5,038,390,490.15	776,587,587.20	-201,133,375.47
本期利润	4,114,874,879.43	1,237,483,443.68	1,049,850,054.78
加权平均基金份额本期利润	0.4683	0.0779	0.0571
本期加权平均净值利润率	56.25%	14.20%	10.55%
本期基金份额净值增长率	36.31%	15.76%	10.84%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	3,026,601,674.41	-1,137,051,663.92	-2,309,432,509.07
期末可供分配基金份额利润	0.4924	-0.0820	-0.1339
期末基金资产净值	5,353,300,390.20	8,856,531,043.84	9,528,217,975.66
期末基金份额净值	0.871	0.639	0.552
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	42.07%	4.23%	-9.96%

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交易基金的各项费用，计入费用后持有人的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

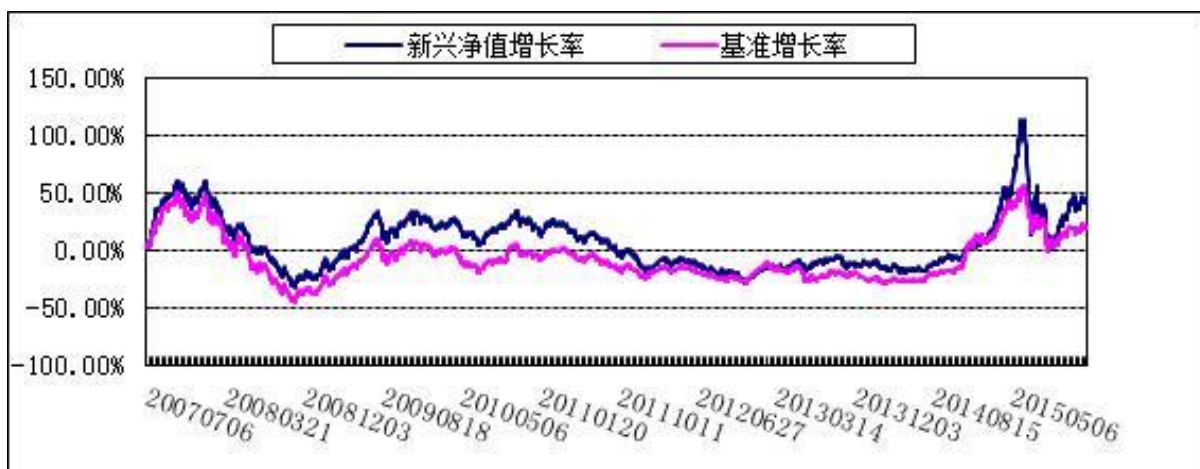
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.97%	2.04%	13.84%	1.34%	13.13%	0.70%
过去六个月	-8.32%	3.23%	-11.97%	2.14%	3.65%	1.09%
过去一年	36.31%	2.93%	7.38%	1.99%	28.93%	0.94%

过去三年	74.90%	1.92%	43.97%	1.43%	30.93%	0.49%
过去五年	15.21%	1.68%	24.00%	1.29%	-8.79%	0.39%
自基金合同生效起至今	42.07%	1.67%	20.20%	1.53%	21.87%	0.14%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

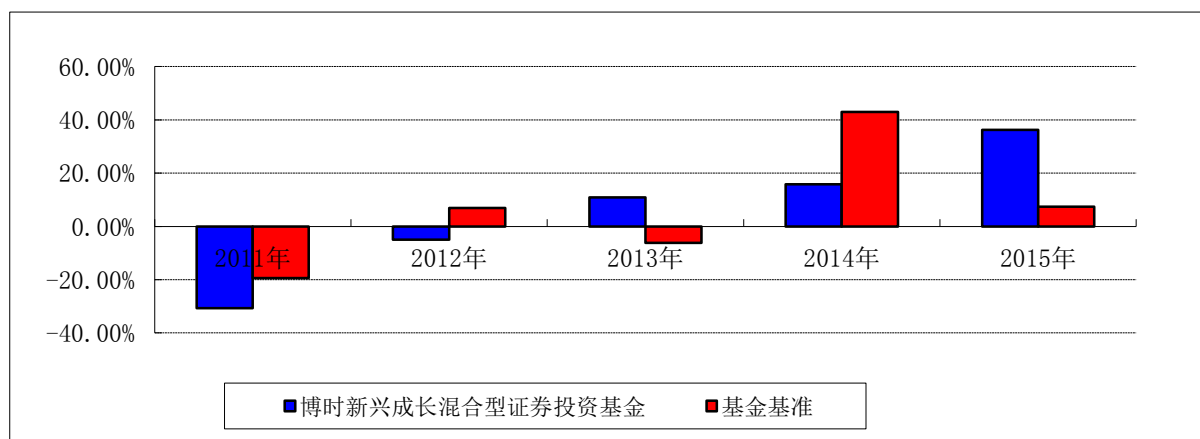
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金由原封闭式基金—裕华证券投资基金转型而来，本基金合同于 2007 年 7 月 6 日生效。

### 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 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，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		
曾鹏	基金经理	2013-01-18	-	10	2005 年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012 年加入博时基金管理有限公司，曾任投资经理，现任博时新兴成长混合基金兼博时混合基金的基金经理。
韩茂华	基金经理	2013-01-09	2015-01-22	9	2006 年从清华大学博士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、原材料组组长、投资经理、博时新兴成长股票型证券投资基金基金经理。现任博时创业成长股票型证券投资基金兼博时价值增长混合基金的基金经理。
肖瑞瑾	基金经理助理	2015-06-15	-	3	2012 年加入博时基金，现任研究部高级研究员兼基金经理助理

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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

### 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

2015 年，中国经济增长中枢持续下移，整个宏观经济呈现鲜明的结构性特点。传统产业由于总需求不足产能过剩，仍处于弱势；而以互联网传媒为代表的新经济产业，受益于人口红利仍处于快速增长阶段。2015 年货币政策趋于宽松，全年共经历 5 次降息和降准。在杠杆资金助推下，市场在年初即步入牛市，但从 7 月份开始去场外配资背景下出现快速下跌，至 10 月份市场风险偏好逐步恢复，反弹至 12 月。

本基金全年总体维持较高仓位，并顺应宏观经济结构的结构性特点，重点配置在 TMT 新兴行业、医药、金融、大众消费品等领域；并参与了军工、国企改革等主题性投资机会。从投资结果看，在 TMT 新兴行业、军工等主题性投资机会中获取了较好投资收益。但由于配置行业波动性较强，基金净值的波动幅度大于同期业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.871 元，累计份额净值为 3.838 元，报告期内净值增长率为 36.31%，同期业绩基准涨幅为 7.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，我们认为宏观经济整体仍在继续寻底。供给侧改革背景下，经济进入阵痛期，市场不确定性加大。美元加息预期下，为维持人民币汇率总体稳定，货币政策边际上放松空间有限。人民币贬值客观上有利于国内企业增强成本竞争力、扩大出口，有利于宏观经济的企稳。以石油、铁矿石为代表的大宗商品价格维持低位运行，有效降低了国内企业生产成本。我们预期 2016 年国内企业的整体生产成本上升趋势将得到有效控制。

我们对 2016 年市场看法谨慎。以 TMT 为代表的新兴板块在经历 2015 年大幅上涨后，部分透支未来 3 年左右的成长空间，我们认为市场将大概率出现分化，其中产业资本减持预期将成为判断个股分化的重要因素。因此在延续行业导向的配置思路的同时，我们将加大至下而上精选个股，在新兴行业中继续发掘估值合理、基本面有重大变化的个股；在汽车、零售、机械、食品饮料为代表的传统行业中，发掘转型及并购预期强烈的低估值二线蓝筹，以通过价值重估获得超额收益。

#### 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：每一基金份额享有同等分配权；基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；每次基金收益分配比例不得低于可分配收益的 60%；基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配。

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，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

2015 年度，基金托管人在博时新兴成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2015 年度，博时基金管理有限公司在博时新兴成长混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 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

2015 年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时新兴成长混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2016)第 21405 号

博时新兴成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的博时新兴成长混合型证券投资基金(原博时新兴成长股票型证券投资基金，以下简称“博时新兴成长基金”)的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是博时新兴成长基金的基金管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致

的重大错报。

## 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 审计意见

我们认为，上述博时新兴成长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时新兴成长基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

薛 竞

中国 · 上海市

注册会计师

2016 年 3 月 24 日

沈 兆 杰

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时新兴成长混合型证券投资基金



报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,611,946.28	4,907,175.03
结算备付金		482,137,052.24	718,640,604.93
存出保证金		2,890,096.76	1,375,520.93
交易性金融资产	7.4.7.2	4,913,742,865.88	8,257,957,944.69
其中：股票投资		4,913,742,865.88	8,257,957,944.69
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	66,680,489.22
应收利息	7.4.7.5	391,354.37	336,003.11
应收股利		-	-
应收申购款		356,616.03	328,764.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,402,129,931.56	9,050,226,502.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,240,596.98	139,484,781.75
应付赎回款		8,697,238.02	32,013,218.65
应付管理人报酬		6,848,748.35	11,474,992.20
应付托管费		5,209,644.60	1,912,498.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,291,757.81	7,379,094.55
应交税费		47,234.40	47,234.40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,494,321.20	1,383,638.50
负债合计		48,829,541.36	193,695,458.77
<b>所有者权益：</b>		-	

实收基金	7.4.7.9	1,638,391,142.24	3,695,825,873.46
未分配利润	7.4.7.10	3,714,909,247.96	5,160,705,170.38
所有者权益合计		5,353,300,390.20	8,856,531,043.84
负债和所有者权益总计		5,402,129,931.56	9,050,226,502.61

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.871 元，基金份额总额 6,146,415,558.37 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>4,287,723,092.35</b>	<b>1,416,759,769.22</b>
1. 利息收入		15,991,592.76	11,758,651.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,322,542.26	11,206,120.74
债券利息收入		-	423.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		669,050.50	552,107.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,193,946,056.80	944,023,630.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,177,529,159.17	871,766,491.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	139,166.88
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	16,416,897.63	72,117,971.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-923,515,610.72	460,895,856.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,301,053.51	81,630.68
<b>减：二、费用</b>		<b>172,848,212.92</b>	<b>179,276,325.54</b>
1. 管理人报酬		109,718,937.77	130,931,528.21
2. 托管费		18,286,489.62	21,821,921.30
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	44,355,658.16	26,037,516.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	487,127.37	485,359.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,114,874,879.43</b>	<b>1,237,483,443.68</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>4,114,874,879.43</b>	<b>1,237,483,443.68</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	3,695,825,873.46	5,160,705,170.38	8,856,531,043.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,114,874,879.43	4,114,874,879.43
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）	-2,057,434,731.22	-5,560,670,801.85	-7,618,105,533.07
其中：1. 基金申购款	439,935,726.70	1,139,570,607.21	1,579,506,333.91
2. 基金赎回款	-2,497,370,457.92	-6,700,241,409.06	-9,197,611,866.98
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）	1,638,391,142.24	3,714,909,247.96	5,353,300,390.20
项目	上年度可比期间 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）	4,597,764,958.63	4,930,453,017.03	9,528,217,975.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,237,483,443.68	1,237,483,443.68
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）	-901,939,085.17	-1,007,231,290.33	-1,909,170,375.50
其中：1. 基金申购款	38,427,209.22	43,478,253.82	81,905,463.04
2. 基金赎回款	-940,366,294.39	-1,050,709,544.15	-1,991,075,838.54
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）	3,695,825,873.46	5,160,705,170.38	8,856,531,043.84

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 主管会计工作负责人：王德英 会计机构负责人：成江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

博时新兴成长混合型证券投资基金(原名为博时新兴成长股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)是根据原裕华证券投资基金(以下简称“基金裕华”)基金份额持有人大会 2007 年 5 月 28 日审议通过的《关于裕华证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]174 号《关于核准裕华证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,由原基金裕华转型而来。原基金裕华为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至 2007 年 7 月止。根据深交所深证复[2007]38 号《关于终止裕华证券投资基金上市的批复》,原基金裕华于 2007 年 7 月 5 日进行终止上市权利登记。自 2007 年 7 月 6 日起,原基金裕华终止上市,原基金裕华更名为博时新兴成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),《裕华证券投资基金基金合同》失效的同时《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

原基金裕华于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为人民币 1,372,645,809.28 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《博时新兴成长股票型证券投资基金招募说明书》和《博时新兴成长股票型证券投资基金集中申购结果的公告》,本基金于 2007 年 8 月 3 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1:3.751596708,并于 2007 年 8 月 6 日进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2007 年 7 月 19 日至 2007 年 8 月 3 日止期间内开放集中申购,包括集中申购资金利息共募集人民币 13,505,780,160.33 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 107 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金(包括集中申购资金利息折份额部分)已按 2007 年 8 月 3 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.000 元折合为 13,505,780,160.33 份基金份额,并于 2007 年 8

月 6 日进行了确认登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，博时新兴成长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为博时新兴成长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《博时新兴成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票和债券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95% (权证投资比例不得超过基金资产的 3% 并计入股票投资比例)；债券投资比例为基金资产的 0%-35%；现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金于 2015 年度未出现连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的情形，故本财务报表以持续经营为编制基础。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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。

##### 7.4.4.4 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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。

#### 7.4.4.8 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。



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)。

#### 7.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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权益再投资日经过除权后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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 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，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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	2,611,946.28	4,907,175.03
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	2,611,946.28	4,907,175.03

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,174,467,278.62	4,913,742,865.88	739,275,587.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,174,467,278.62	4,913,742,865.88	739,275,587.26
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,595,166,746.71	8,257,957,944.69	1,662,791,197.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	6,595,166,746.71	8,257,957,944.69	1,662,791,197.98

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	1,400.61	1,735.40
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	388,523.21	333,586.81
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,430.55	680.90
合计	391,354.37	336,003.11

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日

交易所市场应付交易费用	5,291,757.81	7,379,094.55
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	5,291,757.81	7,379,094.55

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00	1,250,000.00
应付赎回费	14,321.20	3,638.50
预提费用	230,000.00	130,000.00
合计	1,494,321.20	1,383,638.50

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,865,204,788.99	3,695,825,873.46
本期申购	1,650,418,482.82	439,935,726.70
本期赎回(以“-”号填列)	-9,369,207,713.44	-2,497,370,457.92
本期末	6,146,415,558.37	1,638,391,142.24

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,137,051,663.92	6,297,756,834.30	5,160,705,170.38
本期利润	5,038,390,490.15	-923,515,610.72	4,114,874,879.43
本期基金份额交易产生的变动数	-874,737,151.82	-4,685,933,650.03	-5,560,670,801.85
其中：基金申购款	382,851,398.45	756,719,208.76	1,139,570,607.21
基金赎回款	-1,257,588,550.27	-5,442,652,858.79	-6,700,241,409.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,026,601,674.41	688,307,573.55	3,714,909,247.96

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	422,939.63	200,176.83
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	14,840,200.99	10,987,079.82

其他	59,401.64	18,864.09
合计	15,322,542.26	11,206,120.74

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	18,482,473,362.06	9,508,673,013.58
减：卖出股票成本总额	13,304,944,202.89	8,636,906,521.79
买卖股票差价收入	5,177,529,159.17	871,766,491.79

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	430,696.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	290,600.00
减：应收利息总额	-	929.92
买卖债券差价收入	-	139,166.88

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,416,897.63	72,117,971.71
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	16,416,897.63	72,117,971.71

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-923,515,610.72	460,895,856.48
——股票投资	-923,515,610.72	461,013,334.44
——债券投资	-	-117,477.96
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-923,515,610.72	460,895,856.48

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	1,064,115.36	66,914.47
转换费收入	236,938.15	13,599.19
印花税返还		1,117.02
合计	1,301,053.51	81,630.68

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	44,355,658.16	26,037,516.08
银行间市场交易费用	-	-
合计	44,355,658.16	26,037,516.08

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	130,000.00	130,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	33,927.37	36,959.95
债券托管账户维护费	23,200.00	18,000.00
其他	-	400.00
合计	487,127.37	485,359.95

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项



无。

#### 7.4.9 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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、基金销售机构
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
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	1,020,159,398.59	3.58%	305,344,129.61	1.81%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1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	928,746.92	3.99%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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 金总额的比例

招商证券	277,983.34	1.90%	-	-
------	------------	-------	---	---

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	109,718,937.77	130,931,528.21
其中：支付销售机构的客户维护费	23,620,131.31	28,362,125.67

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	18,286,489.62	21,821,921.30

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

##### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

##### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014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
交通银行	2,611,946.28	422,939.63	4,907,175.03	200,176.83

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于 2015 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2014 年 12 月 31 日：同)。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

无。

**7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**
**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601186	中国铁建	2015-07-16	2016-07-17	非公开发行	8.00	10.55	25,000,000	200,000,000.00	263,750,000.00	-
<b>合计</b>							<b>25,000,000</b>	<b>200,000,000.00</b>	<b>263,750,000.00</b>	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

**7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600565	迪马股份	2015-12-30	公告重大事项	11.68	2016-1-7	11.03	3,500,000	39,771,758.99	40,880,000.00	-
600584	长电科技	2015-11-30	公告重大事项	22.02	-	-	1,500,000	31,091,921.43	33,030,000.00	-
600682	南京新百	2015-7-1	公告重大事项	32.97	2016-1-27	33.78	637,600	19,998,324.00	21,021,672.00	-
600990	四创电子	2015-9-1	公告重大事项	82.63	-	-	2,000,015	98,486,304.94	165,261,239.45	-
002049	同方国芯	2015-12-11	公告重大事项	63.22	2016-3-11	54.14	6,000,081	205,781,947.76	379,325,120.82	-
002065	东华软件	2015-12-22	公告重大事项	25.10	-	-	1,999,993	51,594,459.82	50,199,824.30	-
002544	杰赛科技	2015-8-31	公告重大事项	41.39	-	-	6,000,000	104,652,584.60	248,340,000.00	-
300162	雷曼股份	2015-11-2	公告重大事项	27.06	2016-2-29	21.47	2,499,963	58,178,718.93	67,648,998.78	-

注：本基金截至 2015 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格

因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	2,611,946.28	-	-	-	2,611,946.28
结算备付金	482,137,052.24	-	-	-	482,137,052.24
存出保证金	2,890,096.76	-	-	-	2,890,096.76
交易性金融资产	-	-	-	4,913,742,865.88	4,913,742,865.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	391,354.37	391,354.37
应收申购款	-	-	-	356,616.03	356,616.03
<b>资产总计</b>	<b>487,639,095.28</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,914,490,836.28</b>	<b>5,402,129,931.56</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	21,240,596.98	21,240,596.98
应付赎回款	-	-	-	8,697,238.02	8,697,238.02
应付管理人报酬	-	-	-	6,848,748.35	6,848,748.35
应付托管费	-	-	-	5,209,644.60	5,209,644.60
应付交易费用	-	-	-	5,291,757.81	5,291,757.81
应交税费	-	-	-	47,234.40	47,234.40
其他负债	-	-	-	1,494,321.20	1,494,321.20
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>48,829,541.36</b>	<b>48,829,541.36</b>



利率敏感度缺口	487,639,095.28	-	-	4,865,661,294.92	5,353,300,390.20
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	4,907,175.03	-	-	-	4,907,175.03
结算备付金	718,640,604.93	-	-	-	718,640,604.93
存出保证金	1,375,520.93	-	-	-	1,375,520.93
交易性金融资产	-	-	-	8,257,957,944.69	8,257,957,944.69
应收证券清算款	-	-	-	66,680,489.22	66,680,489.22
应收利息	-	-	-	336,003.11	336,003.11
应收申购款	-	-	-	328,764.70	328,764.70
<b>资产总计</b>	<b>724,923,300.89</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,325,303,201.72</b>	<b>9,050,226,502.61</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	139,484,781.75	139,484,781.75
应付赎回款	-	-	-	32,013,218.65	32,013,218.65
应付管理人报酬	-	-	-	11,474,992.20	11,474,992.20
应付托管费	-	-	-	1,912,498.72	1,912,498.72
应付交易费用	-	-	-	7,379,094.55	7,379,094.55
应交税费	-	-	-	47,234.40	47,234.40
其他负债	-	-	-	1,383,638.50	1,383,638.50
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>193,695,458.77</b>	<b>193,695,458.77</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>724,923,300.89</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,131,607,742.95</b>	<b>8,856,531,043.84</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2014 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95% (权证投资比例不得超过基金资产的 3% 并计入股票投资比例)；债券投资比例为基金资产的 0%-35%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,913,742,865.88	91.79	8,257,957,944.69	93.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	4,913,742,865.88	91.79	8,257,957,944.69	93.24

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 27,323	增加约 30,890
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 27,323	减少约 30,890

#### 7.4.14 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 3,644,286,010.53 元，属于第二层次的余额为 1,269,456,855.35 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 7,271,845,172.73 元，第二层次 986,112,771.96 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 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(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	4,913,742,865.88	90.96
	其中：股票	4,913,742,865.88	90.96
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	-	-
	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	484,748,998.52	8.97
7	其他各项资产	3,638,067.16	0.07
8	合计	5,402,129,931.56	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	2,897,451,200.19	54.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	304,352,420.11	5.69
F	批发和零售业	258,683,026.20	4.83
G	交通运输、仓储和邮政业	49,449,109.90	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	929,404,168.34	17.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	187,328,381.14	3.50
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	287,074,560.00	5.36
S	综合	-	-
	合计	4,913,742,865.88	91.79

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600105	永鼎股份	18,511,812	425,956,794.12	7.96
2	002049	同方国芯	6,000,081	379,325,120.82	7.09
3	002268	卫士通	5,662,198	318,272,149.58	5.95
4	002739	万达院线	2,392,288	287,074,560.00	5.36
5	601186	中国铁建	25,000,000	263,750,000.00	4.93
6	002544	杰赛科技	6,000,000	248,340,000.00	4.64
7	000738	中航动控	5,999,797	189,713,581.14	3.54
8	002389	南洋科技	8,999,759	183,415,088.42	3.43
9	600990	四创电子	2,000,015	165,261,239.45	3.09
10	001696	宗申动力	11,899,840	164,455,788.80	3.07
11	000785	武汉中商	9,526,968	155,289,578.40	2.90
12	002445	中南重工	5,499,902	154,272,251.10	2.88
13	002574	明牌珠宝	6,999,861	148,677,047.64	2.78
14	002222	福晶科技	5,999,887	142,257,320.77	2.66
15	300168	万达信息	4,000,000	132,520,000.00	2.48
16	600850	华东电脑	2,000,000	103,300,000.00	1.93
17	300156	神雾环保	1,999,901	99,975,050.99	1.87
18	600485	信威集团	3,099,933	82,923,207.75	1.55
19	002369	卓翼科技	5,999,909	79,798,789.70	1.49
20	002354	天神娱乐	799,877	76,772,194.46	1.43
21	002076	雪莱特	3,999,860	72,117,475.80	1.35
22	300162	雷曼股份	2,499,963	67,648,998.78	1.26
23	000501	鄂武商 A	2,999,842	64,196,618.80	1.20
24	600198	大唐电信	2,599,970	64,141,259.90	1.20
25	002276	万马股份	2,000,057	60,201,715.70	1.12
26	300450	先导智能	600,000	59,634,000.00	1.11
27	000514	渝开发	4,999,948	57,549,401.48	1.08
28	002162	悦心健康	3,999,994	55,039,917.44	1.03
29	002292	奥飞动漫	999,930	51,706,380.30	0.97
30	603318	派思股份	924,475	50,762,922.25	0.95
31	002065	东华软件	1,999,993	50,199,824.30	0.94
32	600119	长江投资	2,499,955	49,449,109.90	0.92
33	600565	迪马股份	3,500,000	40,880,000.00	0.76
34	002135	东南网架	3,352,801	40,602,420.11	0.76
35	002305	南国置业	5,999,890	38,339,297.10	0.72
36	600666	奥瑞德	799,934	37,788,882.16	0.71
37	000667	美好集团	6,999,936	34,719,682.56	0.65
38	000859	国风塑业	5,000,000	33,400,000.00	0.62
39	600584	长电科技	1,500,000	33,030,000.00	0.62
40	600360	华微电子	2,999,911	29,189,134.03	0.55
41	002388	新亚制程	1,999,959	22,139,546.13	0.41

42	600682	南京新百	637,600	21,021,672.00	0.39
43	603989	艾华集团	530,300	18,926,407.00	0.35
44	603003	龙宇燃油	609,700	18,175,157.00	0.34
45	000656	金科股份	3,000,000	15,840,000.00	0.30
46	300032	金龙机电	495,700	15,069,280.00	0.28
47	002547	春兴精工	800,000	10,624,000.00	0.20

#### 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	600105	永鼎股份	519,780,528.48	5.87
2	600993	马应龙	362,602,415.36	4.09
3	000166	申万宏源	335,502,633.60	3.79
4	601908	京运通	304,512,085.91	3.44
5	002189	利达光电	269,597,492.95	3.04
6	300039	上海凯宝	269,462,748.36	3.04
7	000738	中航动控	264,551,061.58	2.99
8	002410	广联达	238,548,129.29	2.69
9	002049	同方国芯	229,170,210.45	2.59
10	000848	承德露露	218,807,378.81	2.47
11	600518	康美药业	218,053,244.01	2.46
12	600060	海信电器	212,787,642.22	2.40
13	002739	万达院线	208,089,663.12	2.35
14	601186	中国铁建	200,000,000.00	2.26
15	002389	南洋科技	195,214,499.58	2.20
16	600418	江淮汽车	193,229,892.61	2.18
17	600198	大唐电信	193,014,819.50	2.18
18	001696	宗申动力	190,115,504.67	2.15
19	300126	锐奇股份	190,114,462.25	2.15
20	300226	上海钢联	186,263,596.72	2.10
21	002445	中南重工	183,885,575.58	2.08

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	600570	恒生电子	1,116,467,674.92	12.61
2	300168	万达信息	882,201,323.28	9.96
3	600315	上海家化	802,200,703.14	9.06



4	000998	隆平高科	674,448,625.86	7.62
5	600276	恒瑞医药	584,299,013.84	6.60
6	600085	同仁堂	423,326,184.49	4.78
7	000166	申万宏源	422,004,900.83	4.76
8	000513	丽珠集团	419,835,259.13	4.74
9	002189	利达光电	371,394,537.45	4.19
10	601318	中国平安	354,376,923.05	4.00
11	600518	康美药业	347,805,981.21	3.93
12	000562	宏源证券	335,502,633.60	3.79
13	002063	远光软件	330,046,408.10	3.73
14	600993	马应龙	308,173,438.42	3.48
15	000963	华东医药	284,852,579.59	3.22
16	600990	四创电子	280,727,686.10	3.17
17	002170	芭田股份	272,682,836.01	3.08
18	601988	中国银行	260,927,528.33	2.95
19	002544	杰赛科技	260,163,969.41	2.94
20	600887	伊利股份	250,552,900.72	2.83
21	300022	吉峰农机	244,423,969.42	2.76
22	601908	京运通	243,259,468.58	2.75
23	000901	航天科技	234,944,965.53	2.65
24	300088	长信科技	231,806,316.98	2.62
25	600418	江淮汽车	231,358,213.39	2.61
26	600060	海信电器	225,054,915.60	2.54
27	300039	上海凯宝	219,521,964.33	2.48
28	000538	云南白药	209,431,512.50	2.36
29	000848	承德露露	200,987,379.66	2.27
30	601633	长城汽车	198,681,026.87	2.24
31	600151	航天机电	195,585,843.69	2.21
32	002410	广联达	189,697,167.13	2.14
33	300159	新研股份	180,523,418.40	2.04
34	002223	鱼跃医疗	178,297,196.11	2.01

注：本项的“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	10,884,244,734.80
卖出股票的收入（成交）总额	18,482,473,362.06

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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
1	存出保证金	2,890,096.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	391,354.37
5	应收申购款	356,616.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,638,067.16

#### 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

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	002049	同方国芯	379,325,120.82	7.09	公告重大事项
2	601186	中国铁建	263,750,000.00	4.93	非公开发行认购
3	002544	杰赛科技	248,340,000.00	4.64	公告重大事项
4	600990	四创电子	165,261,239.45	3.09	公告重大事项

### 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
329,978	18,626.74	42,751,676.54	0.70%	6,103,663,881.90	99.30%

### 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	25,470.28	0.00%

### 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	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研发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(2007年7月6日)基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	13,865,204,788.99
本报告期基金总申购份额	1,650,418,482.82
减：本报告期基金总赎回份额	9,369,207,713.44
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额

6,146,415,558.37

## § 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。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 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

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	
中泰证券	1	5,752,257,127.61	20.19%	4,152,850.60	17.86%	撤销1个
兴业证券	2	4,733,673,431.05	16.61%	3,382,460.78	14.54%	-
申银万国	2	3,685,009,029.27	12.93%	3,377,088.11	14.52%	-
民族证券	1	1,896,294,054.78	6.66%	1,347,126.78	5.79%	-
华安证券	1	1,500,658,717.67	5.27%	1,366,880.61	5.88%	-
国信证券	1	1,465,673,694.50	5.14%	1,334,352.41	5.74%	-
德邦证券	1	1,255,477,433.36	4.41%	1,149,310.98	4.94%	-
方正证券	2	1,043,742,907.16	3.66%	959,255.60	4.12%	-
招商证券	1	1,020,159,398.59	3.58%	928,746.92	3.99%	-
国海证券	1	913,095,177.98	3.20%	831,283.42	3.57%	-
中金公司	1	888,001,740.53	3.12%	808,437.84	3.48%	-
东莞证券	1	808,393,995.67	2.84%	580,314.95	2.50%	-
银河证券	1	790,941,033.78	2.78%	724,168.33	3.11%	-
华宝证券	1	773,458,601.75	2.71%	704,154.91	3.03%	-
国泰君安	2	626,666,640.76	2.20%	445,186.29	1.91%	-
海通证券	2	591,969,665.30	2.08%	538,926.84	2.32%	-
渤海证券	1	440,763,943.62	1.55%	401,273.11	1.73%	-
长城证券	1	306,335,121.21	1.08%	224,021.33	0.96%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中富证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

华林证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	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，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。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时旗下部分开放式基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
2	关于博时旗下部分开放式基金继续参加青岛银行申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
3	关于博时旗下部分开放式基金继续参加哈尔滨银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
4	关于博时旗下部分开放式基金参加浙商银行股份有限公司申购业务与定期定额申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
5	关于博时旗下部分基金参加农业银行定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
6	关于博时旗下部分基金参加工商银行定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
7	关于博时旗下部分基金参加东莞银行申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
8	博时基金旗下部分基金参加邮储银行网银申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金在指数熔断期间调整开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/31
10	关于博时旗下部分开放式基金增加邮储银行为代销机构并参加其定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/22
11	关于博时旗下部分开放式基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/12/10



	告		
12	关于博时旗下部分开放式基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构并参加其申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/11/18
13	关于博时旗下部分开放式基金增加北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构并参加其申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/11/3
14	关于博时旗下部分开放式基金增加徽商期货有限责任公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/10/30
15	关于博时旗下部分开放式基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/10/28
16	关于博时旗下部分开放式基金增加北京坤元投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/10/26
17	关于博时旗下部分开放式基金增加嘉实财富管理有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/10/22
18	关于博时旗下部分开放式基金增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/9/22
19	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳富济财富管理有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/9/18
20	博时基金管理有限公司关于调整与通联支付网络服务股份有限公司合作开通的交通银行借记卡直销网上交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/9/15
21	关于博时旗下部分开放式基金增加上海陆金所资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/9/1
22	关于博时旗下部分基金参加河北银行股份有限公司电子渠道申购和定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/9/1
23	博时基金关于在京东开通官方旗舰店基金直销业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/8/25
24	关于博时旗下部分开放式基金增加北京君德汇富投资咨询有限公司为代销机构并参加其网上交易及柜台申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/8/19
25	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/8/8
26	博时基金管理有限公司关于变更博时新兴成长股票型证券投资基金名称及相关内容的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/8/7
27	关于博时旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/8/1
28	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通招商银行借记卡直销网上交易和费	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/7/31

	率优惠的公告		
29	关于博时新兴成长股票型证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/7/20
30	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/7/10
31	博时基金管理有限公司关于公司、高级管理人员以及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/7/7
32	博时基金管理有限公司关于参加数米基金销售有限公司认申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/27
33	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加上海好买基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
34	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
35	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司认、申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/25
36	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/13
37	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并参加其网上交易申购业务及定期定额申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/2
38	关于博时旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
39	关于博时旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
40	关于博时旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参加其网上交易和手机交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/30
41	关于博时旗下部分开放式基金增加苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其网上银行、手机银行和柜面申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/27
42	关于博时旗下部分开放式基金增加泉州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/20
43	关于中国工商银行股份有限公司开通办理博时旗下部分开放式基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/6
44	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/26
45	博时基金管理有限公司关于暂停货币基金快速赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/14
46	关于厦门市鑫鼎盛控股有限公司暂停代理博时旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/7
47	关于博时旗下部分开放式基金参加江苏张家港农村商业银行股份有限公司柜面、网上银行、手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/31

48	关于博时旗下部分基金参加东莞银行股份有限公司网上银行、手机银行申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/31
49	关于博时基金管理有限公司直销网上交易货币市场基金转换为其他开放式基金申购费补差优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/23
50	博时基金管理有限公司关于博时新兴成长股票型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/23
51	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/19
52	公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17
53	关于博时旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/6

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准博时新兴成长混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时新兴成长混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时新兴成长混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时新兴成长混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时新兴成长混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇一六年三月二十六日