

博时第三产业混合型证券投资基金
2015 年年度报告摘要
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 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	博时第三产业混合
基金主代码	050008
交易代码	050008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 4 月 12 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	2,647,457,296.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	基于我国第三产业的快速发展壮大及其战略地位，本基金以高速增长的第三产业集群企业为主要投资对象，通过深入研究并积极投资，力争为基金持有人获得超越于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。
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	本基金属于混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，具有中等风险/收益的特征。

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	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

§ 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	1,952,881,985.59	660,317,583.14	411,465,559.24
本期利润	1,343,908,698.23	941,294,293.00	244,111,569.55
加权平均基金份额本期利润	0.3870	0.1628	0.0381
本期基金份额净值增长率	20.72%	22.16%	3.75%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.6086	0.1859	0.1643
期末基金资产净值	2,808,028,555.26	4,893,196,623.66	5,365,552,626.72
期末基金份额净值	1.061	0.991	0.912

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

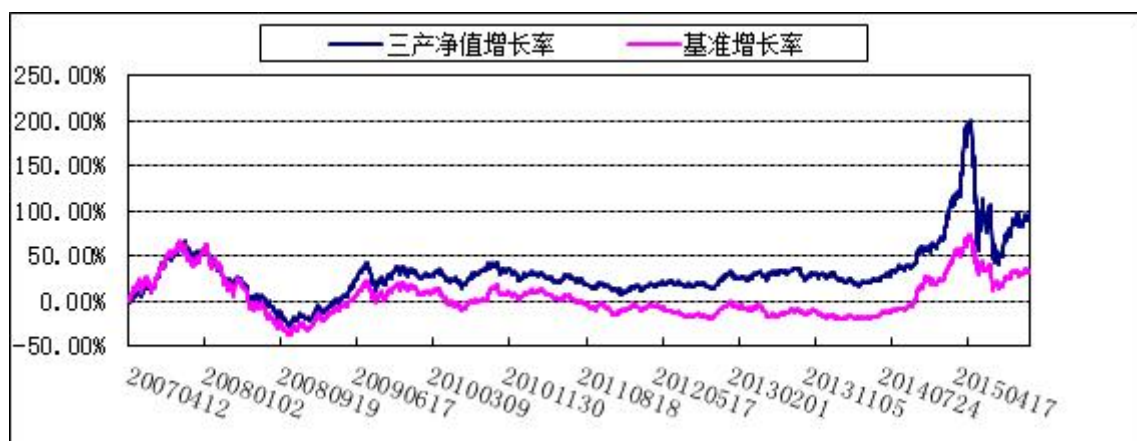
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	26.91%	2.19%	13.84%	1.34%	13.07%	0.85%
过去六个月	-13.60%	3.42%	-11.97%	2.14%	-1.63%	1.28%
过去一年	20.72%	2.99%	7.38%	1.99%	13.34%	1.00%
过去三年	53.00%	1.89%	43.97%	1.43%	9.03%	0.46%
过去五年	45.51%	1.56%	24.00%	1.29%	21.51%	0.27%
自基金合同生效起至今	91.64%	1.59%	32.70%	1.56%	58.94%	0.03%

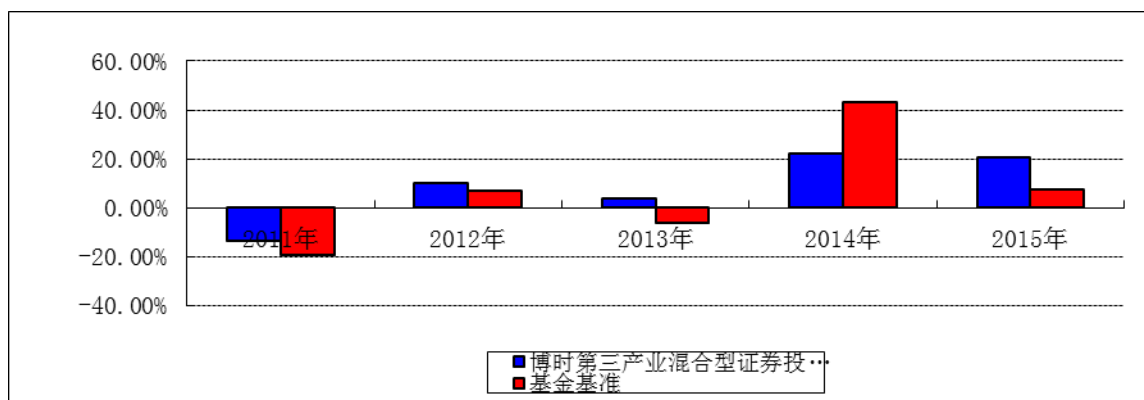
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

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



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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015 年	1.120	260,089,320.82	279,525,091.24	539,614,412.06	2014 年度分红
2014 年	0.990	310,371,577.51	295,816,882.11	606,188,459.62	2013 年度分红
2013 年	1.530	570,213,277.38	459,491,950.73	1,029,705,228.11	2012 年度分红
合计	3.640	1,140,674,175.71	1,034,833,924.08	2,175,508,099.79	-

§ 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

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		
苏永超	基金经理 /成长组投资副总监	2015-02-09	-	12	1999 年起先后在太极集团、北京百慧勤投资有限公司、第一创业证券、中恒集团、财富证券、大成基金工作。2013 年加入博时基金管理有限公司，曾任投资经理，现任股票投资部成长组投资副总监兼博时医疗保健行业混合基金、博时第三产业混合基金的基金经理。

王雪峰	基金经理	2014-02-25	2015-02-09	8	2006 年起先后在元大京华证券、兴业证券、华夏基金任研究员。2011 年加入博时基金管理有限公司，历任特定资产投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金兼博时第三产业成长股票证券投资基金的基金经理。
唐天	基金经理助理	2014-01-01	2015-04-22	4	2010 年 7 月从北京大学经济学专业毕业后，加入博时基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员兼基金经理助理。2015 年 4 月 22 日离职

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

报告期，虽然宏观经济仍旧低迷，但随着上半年场外配资加杠杆及下半年二级市场清理配资等多重因素，2015 年权益二级市场经历了上半年暴涨及下半年暴跌的过山车行情。基于对改革和转型的长期看好，我们全年维持了较高仓位。在配置方面，我们部分仓位配置的国企改革，军工及科研院所改革因为行业性进展低于预期，相关股票表现也差强人意。计算机及信息安全等配置表现相对较好，能够跟上上半年市场大涨及四季度的反弹。但就整个四季度表现而言，我们的配置略显保守，不够激进，最终影响了全年业绩表现。

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 1.061 元，累计份额净值为 3.573 元，报告期内净值增长率为 20.72%，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

展望 2016 年，我们预计经济大概率底部缓慢企稳，虽然一季度有注册制，股灾期间增持股份的可能减持，等短期利空因素存在，但在利率不断下行，人民币汇率逐渐企稳等背景下，我们对全年资本市场不悲观。同时我们也看到，虽然经历了 15 年的股灾行情，但成长股的估值并没有显著下降，而大市值成长股也会进入业绩兑现阶段，逻辑的支撑效用将有所下降。整体而言，我们预计资本市场会有波动但难以出现大幅度的单边走势，选股难度将有所提升，成长股的表现分化也会非常明显。为此，我们将通过深入的自下而上的研究，加大契合改革和转型大方向的中小市值成长股，以及有业绩兑现和支撑的龙头成长股的配置，力争获得超越业绩基准的收益回报。

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：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次分配比例不得低于可分配收益的 60%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。

本基金管理人已于 2015 年 1 月 14 日发布公告，以 2014 年 12 月 31 日的可分配利润为基准，每 10 份基金份额派发红利 1.120 元。

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第三产业混合型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，博时第三产业混合型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时第三产业混合型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。本报告期内，博时第三产业混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为539,614,412.06元。

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第三产业混合型证券投资基金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：博时第三产业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	本期末	上年度末
----	-----	------

	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
资 产:	-	-
银行存款	377,858,873.22	794,749,392.17
结算备付金	6,062,561.85	10,205,429.79
存出保证金	988,394.75	2,553,984.82
交易性金融资产	2,436,568,644.06	4,122,546,422.42
其中: 股票投资	2,436,568,644.06	4,122,546,422.42
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	-	-
应收证券清算款	9,176,591.84	-
应收利息	81,959.48	146,238.87
应收股利	-	-
应收申购款	762,194.56	447,440.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,831,499,219.76	4,930,648,908.40
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	9,410,414.84	-
应付赎回款	5,126,981.64	21,603,227.97
应付管理人报酬	3,570,558.05	6,280,180.29
应付托管费	595,093.00	1,046,696.71
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,500,783.49	7,348,791.66
应交税费	25,137.60	25,137.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,241,695.88	1,148,250.51
负债合计	23,470,664.50	37,452,284.74
所有者权益:	-	-
实收基金	1,196,746,847.83	2,231,614,507.11
未分配利润	1,611,281,707.43	2,661,582,116.55
所有者权益合计	2,808,028,555.26	4,893,196,623.66
负债和所有者权益总计	2,831,499,219.76	4,930,648,908.40

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.061 元，基金份额总额 2,647,457,296.64 份。

7.2 利润表

会计主体：博时第三产业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	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	1,432,345,583.33	1,056,186,665.27
1. 利息收入	4,666,475.89	14,907,652.32
其中：存款利息收入	3,904,858.93	6,719,577.48
债券利息收入	771.87	681,268.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	760,845.09	7,506,806.78
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,035,471,726.64	759,768,053.30
其中：股票投资收益	2,023,526,022.26	732,884,224.77
基金投资收益	-	-
债券投资收益	209,737.97	-9,121,719.36
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,735,966.41	36,005,547.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-608,973,287.36	280,976,709.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,180,668.16	534,249.79
减：二、费用	88,436,885.10	114,892,372.27
1. 管理人报酬	55,768,758.59	71,018,648.22
2. 托管费	9,294,793.20	11,836,441.41
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	22,877,773.00	31,553,774.64
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	495,560.31	483,508.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,343,908,698.23	941,294,293.00
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,343,908,698.23	941,294,293.00

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时第三产业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

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)	2,231,614,507.11	2,661,582,116.55	4,893,196,623.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,343,908,698.23	1,343,908,698.23
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)	-1,034,867,659.28	-1,854,594,695.29	-2,889,462,354.57
其中：1. 基金申购款	505,469,570.45	696,767,111.70	1,202,236,682.15
2. 基金赎回款	-1,540,337,229.73	-2,551,361,806.99	-4,091,699,036.72
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)	-	-539,614,412.06	-539,614,412.06
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,196,746,847.83	1,611,281,707.43	2,808,028,555.26
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)	2,659,714,334.36	2,705,838,292.36	5,365,552,626.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	941,294,293.00	941,294,293.00
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)	-428,099,827.25	-379,362,009.19	-807,461,836.44
其中：1. 基金申购款	364,977,540.29	312,552,240.07	677,529,780.36
2. 基金赎回款	-793,077,367.54	-691,914,249.26	-1,484,991,616.80
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)	-	-606,188,459.62	-606,188,459.62
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,231,614,507.11	2,661,582,116.55	4,893,196,623.66

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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》、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、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。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。

7.4.3 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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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
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	基金管理人子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人子公司

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。

7.4.4 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 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	1,734,443,338.92	11.82%	1,121,310,183.50	5.45%

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 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	1,592,484.83	12.76%	436,298.05	12.46%
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	1,020,840.53	5.59%	578,873.83	7.88%

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	55,768,758.59	71,018,648.22
其中：支付销售机构的客户维护费	9,785,130.34	12,569,103.14

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。

7.4.4.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	9,294,793.20	11,836,441.41

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	377,858,873.22	3,772,187.05	794,749,392.17	6,165,481.48

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。

7.4.4.6 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（2015 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600420	现代制药	2015-10-21	重大资产重组	41.77	2016-03-23	33.44	3,000,004.00	72,937,543.29	125,310,167.08	
000901	航天科技	2015-08-19	重大资产重组	42.12	2016-02-18	47.59	2,000,001.00	76,427,470.81	84,240,042.12	
002020	京新药业	2015-12-29	拟披露重大事项	33.55	2016-01-20	30.20	2,800,000.00	55,578,191.32	93,940,000.00	
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大资产重组	41.39	未复牌	未复牌	1,300,000.00	16,451,051.30	53,807,000.00	
300036	超图软件	2015-10-30	重大资产重组	43.18	2016-01-15	35.11	1,500,017.00	50,320,050.65	64,770,734.06	
合计							10,600,022.00	271,714,307.37	422,067,943.26	

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。

7.4.5.3 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) 各层级金融工具公允价值

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 2,014,500,700.80 元，属于第二层次的余额为

422,067,943.26 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 4,023,107,849.06 元，第二层次 99,438,573.36 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或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；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级还是第三层级。

(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	2,436,568,644.06	86.05
	其中：股票	2,436,568,644.06	86.05
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	383,921,435.07	13.56
7	其他各项资产	11,009,140.63	0.39

8	合计	2,831,499,219.76	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,204,926,421.24	42.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,519,534.25	2.65
E	建筑业	66,603,764.78	2.37
F	批发和零售业	150,288,454.16	5.35
G	交通运输、仓储和邮政业	77,130,617.04	2.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	761,385,555.22	27.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	29,923,364.10	1.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	71,790,933.27	2.56
	合计	2,436,568,644.06	86.77

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	600865	百大集团	6,999,928	150,288,454.16	5.35
2	002253	川大智胜	2,600,024	138,581,279.20	4.94
3	600420	现代制药	3,000,004	125,310,167.08	4.46
4	600718	东软集团	3,800,000	117,990,000.00	4.20
5	000050	深天马 A	5,000,000	106,050,000.00	3.78
6	002322	理工监测	3,999,963	101,079,065.01	3.60
7	600198	大唐电信	3,999,994	98,679,851.98	3.51
8	002020	京新药业	2,800,000	93,940,000.00	3.35
9	000801	四川九洲	2,999,909	92,787,185.37	3.30
10	002172	澳洋科技	5,880,155	87,496,706.40	3.12

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	002253	川大智胜	166,176,570.77	3.40
2	000002	万科 A	146,290,679.86	2.99
3	600571	信雅达	145,825,126.03	2.98
4	300075	数字政通	143,629,172.63	2.94
5	002009	天奇股份	132,268,514.61	2.70
6	600383	金地集团	121,876,403.99	2.49
7	000050	深天马 A	115,384,572.37	2.36
8	600865	百大集团	113,735,005.94	2.32
9	300032	金龙机电	108,497,931.13	2.22
10	600198	大唐电信	104,696,926.48	2.14
11	002482	广田股份	103,965,210.47	2.12
12	002236	大华股份	98,201,325.40	2.01
13	000997	新大陆	98,183,681.90	2.01
14	601166	兴业银行	97,542,676.50	1.99
15	600418	江淮汽车	94,406,675.45	1.93
16	600685	中船防务	91,505,082.68	1.87
17	600305	恒顺醋业	90,739,697.85	1.85
18	000801	四川九洲	88,717,775.50	1.81
19	300130	新国都	87,637,301.55	1.79
20	002522	浙江众成	87,555,255.42	1.79

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	300267	尔康制药	385,726,731.64	7.88
2	600021	上海电力	334,010,132.11	6.83
3	600886	国投电力	269,446,516.08	5.51
4	002185	华天科技	266,570,192.69	5.45
5	600276	恒瑞医药	264,064,140.35	5.40
6	002421	达实智能	260,758,644.78	5.33
7	000002	万科 A	233,807,335.63	4.78
8	000783	长江证券	232,969,152.79	4.76
9	002544	杰赛科技	228,985,862.94	4.68
10	000997	新大陆	197,236,055.25	4.03
11	300032	金龙机电	192,752,901.50	3.94

12	603288	海天味业	190,323,028.57	3.89
13	300075	数字政通	175,869,165.99	3.59
14	600850	华东电脑	172,184,734.14	3.52
15	601166	兴业银行	162,256,744.45	3.32
16	600066	宇通客车	160,330,841.99	3.28
17	600855	航天长峰	152,449,393.08	3.12
18	600571	信雅达	144,000,930.44	2.94
19	600030	中信证券	142,594,848.11	2.91
20	002009	天奇股份	135,800,638.94	2.78
21	300144	宋城演艺	133,196,622.78	2.72
22	002236	大华股份	122,184,578.35	2.50
23	002482	广田股份	119,997,737.35	2.45
24	600418	江淮汽车	109,598,308.80	2.24
25	600305	恒顺醋业	109,184,719.68	2.23
26	600690	青岛海尔	108,028,569.40	2.21
27	600597	光明乳业	106,000,574.67	2.17
28	600261	阳光照明	101,170,753.37	2.07
29	600535	天士力	101,138,447.09	2.07
30	600511	国药股份	100,573,545.86	2.06
31	600383	金地集团	100,343,987.06	2.05
32	600685	中船防务	100,177,733.63	2.05

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	5,786,607,896.11
卖出股票的收入（成交）总额	8,887,138,409.37

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	988,394.75
2	应收证券清算款	9,176,591.84
3	应收股利	-
4	应收利息	81,959.48
5	应收申购款	762,194.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,009,140.63

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	600420	现代制药	125,310,167.08	4.46	重大资产重组
2	002020	京新药业	93,940,000.00	3.35	拟披露重大事项

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
153,745.00	17,219.79	35,133,126.75	1.33%	2,612,324,169.89	98.67%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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基金	-	345,684.28	0.01%
	合计	345,684.28	0.01%

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	份额级别	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	-	10-50
	合计	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	-	10-50
	合计	10-50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年4月12日)基金份额总额	1,500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	4,936,819,703.93
本报告期基金总申购份额	1,118,235,968.80
减：本报告期基金总赎回份额	3,407,598,376.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,647,457,296.64

§ 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。

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	
中信建投	2	2,073,122,458.59	14.13%	1,851,847.65	14.84%	—
恒泰证券	1	1,783,648,916.84	12.16%	1,294,699.47	10.38%	—
招商证券	2	1,734,443,338.92	11.82%	1,592,484.83	12.76%	—
广发证券	2	1,240,879,135.37	8.46%	1,129,698.64	9.05%	—
光大证券	3	1,145,163,857.62	7.81%	1,061,975.10	8.51%	—
宏源证券	1	963,724,664.31	6.57%	684,627.49	5.49%	—
国信证券	1	920,120,546.69	6.27%	837,680.34	6.71%	—

宏信证券	1	853,851,365.75	5.82%	624,425.12	5.00%	新增
华泰证券	3	715,871,591.98	4.88%	653,328.04	5.24%	—
山西证券	1	538,887,070.17	3.67%	382,824.75	3.07%	—
兴业证券	1	533,420,138.91	3.64%	485,628.16	3.89%	—
申银万国	2	498,306,569.58	3.40%	464,061.73	3.72%	—
中信证券	3	295,266,380.34	2.01%	209,760.54	1.68%	—
西部证券	1	266,195,249.53	1.81%	189,451.24	1.52%	—
海通证券	2	265,861,305.19	1.81%	242,042.00	1.94%	—
银河证券	1	255,483,506.94	1.74%	237,927.95	1.91%	—
国金证券	1	229,530,767.00	1.56%	208,964.50	1.67%	—
浙商证券	2	204,029,474.12	1.39%	185,749.57	1.49%	—
中金公司	2	154,334,224.35	1.05%	140,506.89	1.13%	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	撤销
首创证券	1	—	—	—	—	新增
国泰君安	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
华林证券	2	—	—	—	—	—
开源证券	1	—	—	—	—	—
英大证券	1	—	—	—	—	新增
安信证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
五矿证券	1	—	—	—	—	—
东莞证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
齐鲁证券	1	—	—	—	—	—
中航证券	0	—	—	—	—	撤销

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	2,400,000,000.00	77.52%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	696,000,000.00	22.48%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	1,886,737.97	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

博时基金管理有限公司
二〇一六年三月二十六日