

# 上证企债30交易型开放式指数证券投资基金

## 2015 年度 报告 摘要

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遵规守信情况的说明  
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》及其他各项实施细则、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,为基金份额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指标超标情况,基金管理人按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,分别对一级市场和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口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情况。  
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  
本基金为交易型开放式指数证券投资基金,为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减小跟踪标的指数的跟踪误差,取得标的指数所代表的市场平均回报。在报告期内我们严格按照基金合同要求,力求组合成份股紧密跟踪指数,利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因,并在最小化交易成本的同时适时调仓,尽可能的减少跟踪误差。  
报告期内,本基金在指数定期调仓阶段采取择时建仓策略,同时组合保持较少的现金头寸,持仓票息在低利率环境下获得较高的票息收益。由于组合部分个券日常交易的平滑,增加组合收益偏差的控制难度。为了优化跟踪偏离,本季度继续维持组合持有较多公司债券的个数,争取在控制跟踪误差的情况下为投资者获得一定的超额收益。  
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11.39942元,累计份额净值为1.1399元,报告期内净值上涨7.06%,同期业绩比较基准上涨幅度为6.72%。  
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
2015年,宏观经济数据仍在底部震荡,PMI低位徘徊,CPI低迷,电力等工业品以及大宗商品价格仍在下降通道。从流动性方面来看,货币政策整体仍处于持续宽松的状态,央行进行多次降准降息操作。在宽松环境下,债券收益率下行,价格上涨,其中,利率敏感性债券持续上行,信用债的信用利差也不断缩小。  
展望2016年,从宏观经济角度来看,经济继续处在筑底阶段,但预期企稳的时间继续后延。经济的低迷,市场对于流动性继续宽松的预期仍在,货币政策和财政政策给予宽松支持,而股票市场的运行方向仍不明确,投资者的风险偏好仍不高,对股票市场有所支撑。大量资金流入债券市场,有利于利率债和企业债,但从空间看,利率债收益率继续下行的空间有限,利率债将整体处于震荡行情,而优质企业债的收益率仍有下行空间。但我们应该警惕经济下滑和财政赤字带来的信用风险,规避资质较差的标的。总之,从债市供需角度来看,企业债发行提速,但债市较宽松,叠加债市受超预期情绪带动,中高评级信用债的投资价值继续可关注。

在投资策略上,上证企债30ETF作为一只被动的信用债指数基金,我们会以最小跟踪误差为目标,紧密跟踪上证企债30指数。同时我们仍然看好中国经济转型中直接融资渠道的扩展,未来通过上证企债30ETF为投资者提供分享中国信用债市场成长中的机会与收益。  
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,推动内部控制体系和制度规范的落实;强化对基金投资运作和公司经营管理合规性监督,通过实时监督、定期检查、专项检查等方式,及时发现违规,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律法规和管理制度及旗下各基金履行合约义务的情况进行检查,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细则》、《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》、《基金估值委员会制度》、《债券型基金股票投资流程管理》、《股票池管理制度》、《债券池管理制度》等制度和流程手册等制度,定期更新各公募基金基金的《投资管理细则》,以制度化明确了投资管理相关的内部流程和内部要求。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,严格规范基金销售行为,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  
本基金管理人为了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,有效维护投资者的利益,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、运作部负责人等组成,基金治理原则上不参与估值委员会的工作,其估值以经估值委员会成员讨论后审慎采用。估值委员会成员均具有6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致性;定期对估值政策和程序进行评价等。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明  
本基金管理人为了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,有效维护投资者的利益,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、运作部负责人等组成,基金治理原则上不参与估值委员会的工作,其估值以经估值委员会成员讨论后审慎采用。估值委员会成员均具有6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致性;定期对估值政策和程序进行评价等。

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 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明  
本报告期内,本基金托管人在对上证企债30交易型开放式指数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 投资人对报告期内基金资产运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  
本报告期内,上证企债30交易型开放式指数证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在上证企债30交易型开放式指数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,在各项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,上证企债30交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。  
5.3 托管人对本年度报告中财务信息真实、准确和完整发表意见  
本托管人依法对基金管理人编制的博时企债30交易型开放式指数证券投资基金2015年年度报告中财务信息、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资综合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

5.4 审计报告发表  
本托管人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有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。  
7.1 资产负债表  
会计主体:上证企债30交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元  
资产  
货币资金 4,031,844.46 2,176,736.03  
结算备付金 - 679,023.36  
银行存款 1,897.97 26,711.26  
应收利息 90,649,374.90 172,051,076.20  
其中:应收股利 - -  
基金投资 - -  
债券投资 90,649,374.90 172,051,076.20  
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 - 900,000.00  
应收股利 - 7,500,000.00  
应收利息 1,292,557.13  
其他资产 2,126,692.88 3,812,188.60  
负债  
应付赎回款 - -  
应付管理费 - -  
应付托管费 - -  
应付销售服务费 - -  
应付交易费用 -130.39 -73.77  
应交税费 - -  
其他负债 - -  
递延所得税负债 - -  
负债合计 2,996,564.07 13,502.77  
所有者权益  
实收资本 94,408,310.00 94,408,310.00  
未分配利润 9,941,390.57 8,674,719.52  
所有者权益合计 94,408,310.00 107,303,630.60  
负债和所有者权益总计 97,709,790.21 107,303,630.60

单位:人民币元  
负债  
货币资金 4,031,844.46 2,176,736.03  
结算备付金 - 679,023.36  
银行存款 1,897.97 26,711.26  
应收利息 90,649,374.90 172,051,076.20  
其中:应收股利 - -  
基金投资 - -  
债券投资 90,649,374.90 172,051,076.20  
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 - 900,000.00  
应收股利 - 7,500,000.00  
应收利息 1,292,557.13  
其他资产 2,126,692.88 3,812,188.60  
负债  
应付赎回款 - -  
应付管理费 - -  
应付托管费 - -  
应付销售服务费 - -  
应付交易费用 -130.39 -73.77  
应交税费 - -  
其他负债 - -  
递延所得税负债 - -  
负债合计 2,996,564.07 13,502.77  
所有者权益  
实收资本 94,408,310.00 94,408,310.00  
未分配利润 9,941,390.57 8,674,719.52  
所有者权益合计 94,408,310.00 107,303,630.60  
负债和所有者权益总计 97,709,790.21 107,303,630.60

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值11.39942元,基金份额总额829,975.00份。  
7.2 利润表  
会计主体:上证企债30交易型开放式指数证券投资基金  
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 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  
一、期间所有者权益(基金净值) 176,728,916.08 8,674,719.52 187,303,630.60  
二、本期损益变动产生的基金净值变动(基金净值变动) - 9,650,124.20 9,650,124.20  
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动(净值减少) -94,171,876.60 -8,283,453.15 -102,456,428.76  
其中:1.基金申购款 - - -  
2.基金赎回款 -94,171,876.60 -8,283,453.15 -102,456,428.76  
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动(净值减少) -94,171,876.60 -8,283,453.15 -102,456,428.76  
其中:1.基金申购款 - - -  
2.基金赎回款 -94,171,876.60 -8,283,453.15 -102,456,428.76  
四、本期基金净值变动产生的基金净值变动(净值减少) -94,171,876.60 -8,283,453.15 -102,456,428.76  
其中:1.基金申购款 - - -  
2.基金赎回款 -94,171,876.60 -8,283,453.15 -102,456,428.76  
五、本期所有者权益(基金净值) 84,556,940.48 9,941,390.57 94,408,310.06

单位:人民币元  
项目 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  
一、期间所有者权益(基金净值) 1,727,617,696.96 -27,064,883.34 1,699,752,713.52  
二、本期损益变动产生的基金净值变动(基金净值变动) - 68,796,593.30 68,796,593.30  
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动(净值减少) -1,548,888,680.78 -32,366,960.44 -1,581,245,671.22  
其中:1.基金申购款 -32,994,361.00 -44,912.68 32,949,448.52  
2.基金赎回款 -1,518,883,041.78 -32,312,077.06 -1,614,165,119.74  
三、本期基金净值变动产生的基金净值变动(净值减少) -1,548,888,680.78 -32,366,960.44 -1,581,245,671.22  
其中:1.基金申购款 -32,994,361.00 -44,912.68 32,949,448.52  
2.基金赎回款 -1,518,883,041.78 -32,312,077.06 -1,614,165,119.74  
四、本期基金净值变动产生的基金净值变动(净值减少) -1,548,888,680.78 -32,366,960.44 -1,581,245,671.22  
其中:1.基金申购款 -32,994,361.00 -44,912.68 32,949,448.52  
2.基金赎回款 -1,518,883,041.78 -32,312,077.06 -1,614,165,119.74  
五、本期所有者权益(基金净值) 176,728,916.08 8,674,719.52 187,303,630.60

本报告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:王德英 主管会计工作负责人:王德英 会计机构负责人:成江  
7.1 报表附注  
7.1.1 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估计与最近一期年度报告相一致。  
7.1.2 报表附注  
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]3号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。  
(2)对基金从事证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。  
(3)对非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%的企业所得税。  
7.1.3 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、基金销售机构  
招商证券股份有限公司(“招商证券”) 基金管理人、基金销售机构  
中国长城资产管理公司 基金管理人、基金销售机构  
广发证券股份有限公司 基金管理人、基金销售机构  
天津海泰投资集团有限公司 基金管理人、基金销售机构  
上海浦东发展银行股份有限公司 基金管理人、基金销售机构  
上海浦东发展银行股份有限公司 基金管理人、基金销售机构  
博时基金管理集团有限公司 基金管理人、基金销售机构  
博时基金(中国)有限公司 基金管理人、基金销售机构  
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》,并经中国证监会资产管理业务核准(证监许可[2015]812号),博时基金原股东现时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时股东上海汇华投资有限公司。  
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。  
7.1.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易  
7.1.4.1 通过关联方交易单元进行的交易  
无。  
7.1.4.2 关联方报酬  
7.1.4.2.1 基金管理费  
单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.2.2 基金托管费  
单位:人民币元  
项目 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 136,385.79 903,571.96  
注:支付基金管理人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例  
招商证券 4,000.00 0.04% 72,548.00 4.12%

单位:人民币元  
项目 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 643,36.36 3,614,287.79  
其中:支付销售机构的客户维护费 643,36.36 3,614,287.79  
注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.40%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。  
其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。  
7.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
无。  
7.1.4.4 各关联方投资本基金的情况  
7.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
无。  
7.1.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
单位:人民币元  
关联方名称 2015年12月31日 2014年12月31日  
持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例 持有的基金份额