

(上接B61版)

注册地址:	上海市浦东新区陆家嘴世纪大道1589号2402室
办公地址:	北京市西城区金融大街19号中央国际大厦B座402
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	北京市石景山区古城街道特钢小区16号楼2单元204
办公地址:	北京市西城区金融大街19号中央国际大厦B座402
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
办公地址:	深圳市福田区福安社区福安村中城大厦A座1006
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	010-62684668
传真:	010-62684622
客户服务热线:	010-62684629
电子邮箱:	www.bosonfund.com

(上接B62版)

十三、基金的业绩比较标准
本基金业绩比较标准采用:三年期银行定期存款税后收益率。
三年期银行定期存款收益率按照基金合同生效日或前一个保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位,单位为百分数)与当期期末长期国债利率孰高者确定。本基金业绩比较标准采用:三年期银行定期存款税后收益率。本基金是保本型基金,保本周期为三年,保本但不保证收益率。在三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,能够体现本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征,合理地衡量比较本基金业绩的有效性。
本基金在保本周期内,若市场环境变化导致本业绩比较基准不再适用,又或者市场出现更具权威、且更能代表本基金的风险收益特征的业绩比较基准,则本基金管理人将按程序经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩比较基准并报中国证监会备案,但无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征
本基金是一只保本混合型基金,在证券投资基金中属于中低风险品种。
十二、基金投资组合特征
本基金管理人从真实性、准确性和完整性角度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责任。
本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期为2015年7月1日至2015年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	55,892,928.73	31.18
	其中:股票	55,892,928.73	31.18
2	固定收益投资	113,216,000.00	63.16
	其中:债券	113,216,000.00	63.16
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	5,474,359.59	3.05
7	其他资产	4,680,978.48	2.61
8	合计	179,264,266.80	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,068,000.00	1.34
C	制造业	33,189,261.23	21.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,770,400.00	1.13
E	建筑业	1,364,317.50	0.87
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,004,000.00	1.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,948,150.00	6.37
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,168,600.00	2.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	609,000.00	0.39
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	卫生健康业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	751,200.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	55,892,928.73	35.78

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300159	新研股份	300,000	4,443,000.00	2.84
2	600655	迪玛股份	300,000	3,636,000.00	2.33
3	601889	中顺洁柔	300,000	3,003,000.00	1.92
4	000938	紫光股份	39,975	2,789,055.75	1.79
5	600854	广生药业	200,000	2,630,000.00	1.68
6	603993	东阿阿胶	200,000	2,088,000.00	1.34
7	600787	中核股份	200,000	2,004,000.00	1.28
8	300166	东方国信	60,000	1,767,000.00	1.13
9	002280	联众互动	50,000	1,763,000.00	1.13
10	300075	数字政通	70,000	1,641,500.00	1.05

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	113,216,000.00	72.48
4	政策性金融债	113,216,000.00	72.48
5	企业债	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	113,216,000.00	72.48

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140424	14农发24	500,000	51,570,000.00	33.01
2	140407	14农发207	500,000	51,555,000.00	33.01
3	010801	国开1301	100,000	10,091,000.00	6.46

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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权证投资明细

9. 报告期末本基金持有的公允价值低于成本的交易权证,期末公允价值仍高于成本的情况如下:

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

注册地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址:	上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
信息披露负责人:	李博
联系人:	李博
电话:	021-68606666
传真:	021-68606666
客户服务热线:	4008000022-01193500
电子邮箱:	www.bosonfund.com

基金管理人可根据有关法律法规的规定,选择其他符合要求的机构代销本基金,并及时公告。

二、登记机构
名称: 博时基金管理有限公司
住所: 广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
办公地址: 北京市西城区月坛国际大厦18层西中心10层B座
法定代表人: 李光伟
电话: 010-63761166
传真: 010-63761068
联系人: 卢鹏
出具法律意见书的律师事务所
名称: 广东信达律师事务所
住所: 上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
负责人: 李光伟
电话: 021-31358666
传真: 021-31358660
经办律师: 彭明
四、审计基金财产的会计师事务所
机构名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址: 上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1589号2402室
法定代表人: 李光伟
电话: 021-31358666
传真: 021-31358660
联系人: 沈兆杰
经办注册会计师: 薛俊、沈兆杰

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	卖出回购资金	145,216.96	-
2	应收证券清算款	1,149,932.30	-
3	应收利息	-	-
4	应收股利	3,384,883.98	-
5	应收申购款	944.34	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,680,978.48	-

11. 报告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。

12. 报告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	流通受限情况下的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600565	迪玛股份	3,636,000.00	2.33	重大事项
2	000938	紫光股份	2,789,055.75	1.79	重大事项

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于本基金A、B的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩
基金业绩比较基准为:2015年9月30日,所载财务数据未经审计师审计。
基金管理人从真实性、准确性和完整性角度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责任。
本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告期为2015年7月1日至2015年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

1. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

2. 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

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

4. 报告期末本基金持有的公允价值低于成本的交易权证,期末公允价值仍高于成本的情况如下:

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300159	新研股份	300,000	4,443,000.00	2.84
2	600655	迪玛股份	300,000	3,636,000.00	2.33
3	601889	中顺洁柔	300,000	3,003,000.00	1.92
4	000938	紫光股份	39,975	2,789,055.75	1.79
5	600854	广生药业	200,000	2,630,000.00	1.68
6	603993	东阿阿胶	200,000	2,088,000.00	1.34
7	600787	中核股份	200,000	2,004,000.00	1.28
8	600031	三一重工	100,000	1,650,000.00	1.06
9	600036	招商银行	100,000	1,620,000.00	1.04
10	600051	国药股份	100,000	1,560,000.00	1.00
11	600052	浙江广厦	100,000	1,500,000.00	0.96
12	600054	黄山旅游	100,000	1,440,000.00	0.92
13	600056	金矿股份	100,000	1,380,000.00	0.88
14	600058	五矿股份	100,000	1,320,000.00	0.84
15	600060	中金公司	100,000	1,260,000.00	0.80
16	600063	上海医药	100,000	1,200,000.00	0.76
17	600066	兴业银行	100,000	1,140,000.00	0.72
18	600068	格力电器	100,000	1,080,000.00	0.68
19	600070	福建水利	100,000	1,020,000.00	0.64
20	600073	上海证券	100,000	960,000.00	0.60
21	600075	中国国贸	100,000	900,000.00	0.56
22	600078	浙江富润	100,000	840,000.00	0.52
23	600080	浙江广厦	100,000	780,000.00	0.48
24	600083	上海石化	100,000	720,000.00	0.44
25	600086	上海石化	100,000	660,000.00	0.40
26	600089	上海石化	100,000	600,000.00	0.36
27	600093	上海石化	100,000	540,000.00	0.32
28	600096	上海石化	100,000	480,000.00	0.28
29	600099	上海石化	100,000	420,000.00	0.24
30	600101	上海石化	100,000	360,000.00	0.20
31	600104	上海石化	100,000	300,000.00	0.16
32	600107	上海石化	100,000	240,000.00	0.12
33	600110	上海石化	100,000	180,000.00	0.08
34	600113	上海石化	100,000	120,000.00	0.04
35	600116	上海石化	100,000	60,000.00	0.00