博时抗通胀增强回报证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时抗通胀增强回报(QDII-FOF)
基金主代码	050020
交易代码	050020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月25日
报告期末基金份额总额	742,449,220.75份
投资目标	本基金通过进行全球大类资产配置,投资于通胀(通缩)相关的各类资产,在有效控制风险的前提下,力争为投资者资产提供通胀(通缩)保护,同时力争获取较高的超额收益。
投资策略	本基金采用将自上而下的资产配置与自下而上的个券选择相结合、构造被动的通胀跟踪组合与适度的主动投资以获取超额收益相结合的策略。
业绩比较基准	标普高盛贵金属类总收益指数(S&P GSCI Precious Metal Total Return Index)×收益率×20%+标普高盛农产品总收益指数(S&P GSCI Agricultural Total Return Index)×收益率×30%+标普高盛能源类总收益指数(S&P GSCI Energy Total Return Index)×收益率×20%+巴克莱美国通胀保护债券指数(Barclays Capital U.S. Treasury Inflation Protected Securities(TIPS) Index(Series-L))×收益率×30%,简称"通胀综合跟踪指标"。其中,前三个指数是标准普尔公司编制发布的标准大宗商品分类指数,巴克莱美国通胀保护债券指数是境外共同基金最常用的抗通胀债券指数。
风险收益特征	本基金为基金中基金,主要投资范围为抗通胀相关主题的资产。本基金所指的抗通胀相关主题的资产包括抗通胀主题相关的基金和其他资产。抗通胀相关主题的其他资产主要指通胀挂钩债券和通胀相关的权益类资产等。本基金的收益和风险低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高风险收益特征的开放式基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China(Hong Kong)Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-12,980,168.70
2.本期利润	-22,151,987.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0291
4.期末基金资产净值	584,911,127.87
5.期末基金份额净值	0.788

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。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-3.43%	0.56%	-5.35%	0.50%	1.92%	0.06%

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:本基金的基金合同于2011年04月25日生效,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第14条"二、投资范围"、"六、投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章强	国际投资部副总经理/基金经理	2011-4-25	-	10.5	2002年起先后在太平洋投资管理公司、花旗集团另类投资部、德意志银行资产管理部工作。2009年6月加入博时公司,现任国际投资部副总经理兼博时抗通胀增强回报证券投资基金(QDII-FOF)基金经理。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《博时抗通胀增强回报证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、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,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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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相关制度。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年四季度以来,欧洲债务问题再度成为市场关注焦点,西班牙、意大利等国的债务问题再度发酵,欧洲国家经济下滑减速。ECB的救市措施有效地避免了欧洲的流动性风险,美联储在12月份宣布QE4。市场在三季度QE利好兑现的情况下,四季度商品类对QE预期已经提前预支的出现了部分调整。

在3季度反弹后,四季度原油和黄金因为价格已经反映了放松货币政策,在WTI原油从九月中近100美元一桶的高点回调到美国大选前的85美元附近,12月份随着利空出尽和股市反弹,原油上涨到94美元。受利好兑现,美元走强和利率上升影响,贵金属是4季度表现较差的品种,黄金在10月份从QE3后的1785美元的高点开始回落,一度下探到1630美元附近,最终在季度末收至1676美元。农产品延续3季度末的跌势,在整个四季度处于下滑区间。操作上我们四季度中期开始增加能源类配置。贵金属类则4季度前期进行了长波段操作,有所减仓,在12月过度悲观时加仓。农产品类上一直低配,12月底开始加仓。 整体开来,四季度下跌-3.4%,损失主要来自贵金属部分和农产品,股票头寸取得正收益,债券上波段操作有些盈利,人民币升值导致损失-0.88%。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.788元,累计份额净值为0.788元,报告期内净值增长率为-3.43%,同期业绩基准涨幅为-5.35%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年1季度,美国财政悬崖虽然暂时缓解,但是2月底再度面临债务天花板。随着经济数据的回暖,周期型的大宗商品或表现相对较好。估计全年联储仍会保持宽松的货币政策,不会过早退出。贵金属如果继续下跌,可以适度加仓。衰产品在经过几个月下跌后,或会出现超跌反弹的机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	475,084,876.20	78.89
3	固定收益投资	9,105,180.00	1.51
	其中:债券	9,105,180.00	1.51
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	11,762,684.70	1.95
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	11,762,684.70	1.95
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	83,069,185.34	13.79
8	其他各项资产	23,189,158.18	3.85
9	合计	602,211,084.42	100.00

注:金融衍生品投资项下的期货投资在当日无负债结算制度下,结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益,期货结算暂收款(结算所得的持仓损益)相抵销后的净额为0。具体投资情况为:

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值(人民币元)	公允价值变动(人民币元)
股指期货	XUF3	FTSE CHINA A50 Jan13	1,300.00	68,065,679.50	1,766,382.64
外汇期货	RXH3	EURO-BUND FUTURE Mar13	-25.00	30,284,381.60	-8,317.60
外汇期货	ECH3	EURO FX CURR FUT Mar13	-30.00	31,132,081.50	-16,735.14
股指期货	ESH3	S&P500 EMINI FUT Mar13	-55.00	24,546,606.01	-150,616.30
总额合计					1,590,713.60
减:可抵消期货暂收款					1,590,713.60
期货投资净额					0.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
BB-	9,105,180.00	1.56

注:评级机构为标准普尔。

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	EVERRE 7 1/2 01/19/14	EVERRE 7 1/2 01/19/14	60,000	6,048,900.00	1.03
2	SHASHU 6 1/2 07/22/14	SHASHU 6 1/2 07/22/14	30,000	3,056,280.00	0.52

5.7 报告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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	期权投资	February 13 Calls on GLD US	6,599,775.00	1.13
2	期权投资	February 13 Calls on GLD US	2,577,055.00	0.44
3	期权投资	February 13 Calls on GLD US	1,891,935.50	0.32
4	期货投资	FTSE CHINA A50 Jan13	1,766,382.64	0.30
5	期权投资	February 13 Calls on GLD US	1,108,762.20	0.19

注:期货投资采用当日无负债结算制度,其公允价值与相关的期货结算暂收款(结算所得的持仓损益)相抵销后的净额为0。具体投资情况可参见5.1报告期末基金资产组合情况下的备注。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR GOLD TRUST	ETF	开放式	World Gold Trust Services LLCUSA	111,769,014.56	19.11
2	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF	开放式	United States Commodities Fund LLC	96,454,768.80	16.49
3	ISHARES BARCLAYS TIPS BOND	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	76,312,255.50	13.05
4	ISHARES BARCLAYS 1-3 YEAR TR	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	63,674,629.20	10.89
5	ISHARES SILVER TRUST	ETF	开放式	BlackRock Fund Advisors	46,119,856.25	7.88
6	POWERSHARES DB AGRICULTURE F	ETF	开放式	Deutsche Bank AG	12,297,580.75	2.10
7	MARKET VECTORS GOLD MINERS	ETF	开放式	Van Eck Associates Corp	11,663,373.80	1.99
8	ETFS PLATINUM TRUST	ETF	开放式	ETF Securities USA LLC	11,416,479.36	1.95
9	ISHARES FTSE A50 CHINA INDEX	ETF	开放式	BlackRock Asset Mgt N Asia Ltd	9,032,869.00	1.54
10	ETFS PALLADIUM TRUST	ETF	开放式	ETF Securities USA LLC	8,845,223.36	1.51

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	16,832,683.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	19,004.96
4	应收利息	290,819.19
5	应收申购款	33,159.67
6	其他应收款	6,013,490.44
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,189,158.18

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	788,459,887.69
本报告期基金总申购份额	888,028.91
减:本报告期基金总赎回份额	46,898,695.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	742,449,220.75

§7 影响投资者决策的其他重要信息

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2012年12月31日,博时基金公司共管理三十三只开放式基金和两只封闭式基金,并且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,公募基金资产规模逼1371.30亿元人民币,累计分红579.49亿元人民币,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,2012年,博时旗下共有8只基金的年度净值增长率位居同类型基金前1/3。

开放式股票型基金中,截至2012年12月31日,博时主题行业基金的年度净值增长率在同类型274只股票型产品中排名第16,此外,博时创业成长基金、博时卓越品牌基金、博时第三产业基金的年度净值增长率均位于同类型274只标准股票型基金的前1/3;债券型基金中,博时信用债券基金的年度净值增长率在同类型55只产品中排名第9;货币基金中,博时现金收益基金的年度净值增长率在同类49只基金中排名第2;

封闭式基金中,截至2012年12月31日,博时裕隆封闭的年度净值增长率在同类的25只基金中排名第2;

QDII基金中,截至2012年12月28日,博时大中华亚太精选股票基金的年度净值增长率在全部66只QDII基金产品中排名第2;

2.客户服务

1) 2012年12月,博时客服中心电话交易代客操作功能正式上线,满足认购、申购、赎回、转换、赎回转购买、变更分红方式及撤单需求,只需致电博时一线通95105568按0转人工,告知交易需求,博时客服会代为下单并完成一系列的交易操作;

2) 四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动共计386场,参与人数超过1.2万人;

3.其他大事件

博时安心收益定期开放债券型证券投资基金首募顺利结束并于12月6日正式成立。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准博时抗通胀增强回报证券投资基金设立的文件

8.1.2《博时抗通胀增强回报证券投资基金基金合同》

8.1.3《博时抗通胀增强回报证券投资基金托管协议》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

8.1.5 博时抗通胀增强回报证券投资基金各年度审计报告正本

8.1.6 报告期内博时抗通胀增强回报证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 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
2013年1月18日

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:2013年1月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2013年1月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时深证基本面200ETF
场内简称	深F200
基金主代码	159908
交易代码	159908
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2011年6月10日
报告期末基金份额总额	260,729,029份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面200指数(价格指数)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪深证基本面200指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-5,155,855.11
2.本期利润	11,338,997.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0425
4.期末基金资产净值	187,065,068.36
5.期末基金份额净值	0.7175

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,计入费用后投资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 本报告期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	净值增长率①	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	6.50%	1.34%	6.81%	1.34%	-0.31%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的基金合同于2011年6月10日生效。按照基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条"二、投资范围"、"六、投资禁止行为与限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王政	股票投资部总经理/基金经理/ETF及量化投资组投资总监	2011-6-10	2012-11-13	13	1995年至1997年在哈佛大学从事地球物理博士后研究工作。1997年8月起先后在美国新泽西州道琼斯投资公司、美国新泽西州彭博资讯研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009年5月加入博时基金管理有限公司,历任股票投资部总经理、ETF及量化投资组投资总监、博时上证超大盘ETF及联接基金基金经理、博时深证基本面200ETF及联接基金经理、博时标准普尔指数基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2012-11-13	-	2	赵云阳先生,硕士。2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年8月加入博时基金管理有限公司,历任股票投资部量化分析师、博时标普500指数基金基金经理助理和博时深证基本面200ETF基金及其联接基金基金经理助理。现任博时深证基本面200ETF基金及其联接基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、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,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 公平交易专项说明

4.3.1 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相关制度。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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少和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。在本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。同时,在本报告期,我们严格按照基金合同要求,在年末指数权重变动时,尽量降低成本,减少市场冲击,逐步调整组合与目标指数的结构一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.7175元,累计份额净值为0.7175元,报告期内净值增长率为6.50%,同期业绩基准涨幅为6.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年四季度,A股市场跌至近4年以来的新低点后迅地反弹。从9月份经济数据逐步转暖以来,市场信心一直不足,在食品饮料板块深度调整带动下,市场持续下跌至最低点。12月初,受经济转弥企稳以及改革红利预期的推动,在银行发地产股的带领下,水泥、基建、煤炭等大盘蓝筹股轮番强盛,A股市场单月涨幅超过10%。

展望2013年一季度,A股市场对国内经济改革充满期待。同时,欧债危机处于阶段性缓和阶段,全球流动性层面也依然形成支撑;美国财政悬崖得以暂时解决,使短期最大风险消除,海外市场情绪也得到较大提振。随着新一轮改革预期的逐步推进及落实,上游周期性行业、中游行业、大盘蓝筹股等将率先受益。

在投资策略上,深F200ETF作为一只被动的指数基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,紧密跟踪深证基本面200指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过深F200ETF基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	186,306,060.79	99.32
	其中:股票	186,306,060.79	99.32
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,020,798.64	0.54
6	其他各项资产	260,568.25	0.14
7	合计	187,587,427.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	933,288.96	0.50
B	采掘业	8,392,591.72	4.49
C	制造业	110,668,128.62	59.16
C0	食品、饮料	11,369,982.46	6.08
C1	纺织、服装、皮毛	1,336,206.20	0.71
C2	木材、家具	147,772.35	0.08
C3	造纸、印刷	2,440,918.65	1.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,047,059.22	5.37
C5	电子	7,837,337.72	4.19
C6	金属、非金属	34,270,811.27	18.32
C7	机械、设备、仪表	35,889,122.30	19.19
C8	医药、生物制品	6,783,206.56	3.63
C99	其他制造业	545,711.89	0.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,080,080.77	2.18
E	建筑业	1,147,161.47	0.61
F	交通运输、仓储业	2,233,831.57	1.19
G	信息技术业	5,229,167.01	2.80
H	批发和零售贸易	9,031,507.32	4.83
I	金融、保险业	14,749,870.60	7.88
J	房地产业	23,473,574.02	12.55
K	社会服务业	2,933,852.49	1.57
L	传播与文化产业	947,936.22	0.51
M	综合类	2,485,070.02	1.33
	合计	186,306,060.79	99.59

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000002	万科A	1,335,948	13,519,793.76	7.23
2	000651	格力电器	227,178	5,793,039.00	3.10
3	000001	平安银行	275,510	4,413,670.20	2.36
4	000709	河北钢铁	1,575,033	4,221,088.44	2.26
5	000157	中联重科	421,982	3,886,454.22	2.08
6	002024	苏宁电器	574,092	3,817,711.80	2.04
7	000100	TCL集团	1,707,156	3,738,671.64	2.00
8	000402	金融街	516,680	3,487,590.00	1.86
9	000825	太钢不锈	960,542	3,467,556.62	1.85
10	000898	鞍钢股份	891,077	3,457,378.76	1.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 报告期内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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	10,055.88
3	应收股利	-
4	应收利息	512.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	260,568.25

5.8.4 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。

5.8.5 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	000002	万科A	13,519,793.76	7.23	公告重大事项

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	269,729,029
本报告期基金总申购份额	1,500,000
减:本报告期基金总赎回份额	10,500,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	260,729,029

§7 影响投资者决策的其他重要信息

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2012年12月31日,博时基金公司共管理三十三只开放式基金和两只封闭式基金,并且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,公募基金资产规模逼1371.30亿元人民币,累计分红579.49亿元人民币,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,2012年,博时旗下共有8只基金的年度净值增长率位居同类型基金前1/3。

开放式股票型基金中,截至2012年12月31日,博时主题行业基金的年度净值增长率在同类型274只股票型产品中排名第16,此外,博时创业成长基金、博时卓越品牌基金、博时第三产业基金的年度净值增长率均位于同类型274只标准股票型基金的前1/3;债券型基金中,博时信用债券基金的年度净值增长率在同类型55只产品中排名第9;货币基金中,博时现金收益基金的年度净值增长率在同类49只基金中排名第2;

封闭式基金中,截至2012年12月31日,博时裕隆封闭的年度净值增长率在同类的25只基金中排名第2;

QDII基金中,截至2012年12月28日,博时大中华亚太精选股票基金的年度净值增长率在全部66只QDII基金产品中排名第2;

2.客户服务

1) 2012年12月,博时客服中心电话交易代客操作功能正式上线,满足认购、申购、赎回、转换、赎回转购买、变更分红方式及撤单需求,只需致电博时一线通95105568按0转人工,告知交易需求,博时客服会代为下单并完成一系列的交易操作;

2) 四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动共计386场,参与人数超过1.2万人;

3.其他大事件

博时安心收益定期开放债券型证券投资基金首募顺利结束并于12月6日正式成立。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

8.1.2《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

8.1.3《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

8.1.5 报告期内深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.1.6 深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

8.2 存放地点:

基金管理人、基金托管人处

8.3 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
2013年1月18日

博时转债增强债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年1月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时转债增强债券	
基金主代码	050019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年11月24日	
报告期末基金份额总额	2,111,619,305.22份	
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置,并充分利用可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,实施对大类资产的配置,在控制风险并保持良好流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的超额收益。	
投资策略	本产品的类属资产配置策略主要通过自上而下的宏观分析,结合量化的经济指标综合判断经济