博时理财30天债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月20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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时理财30天债券	
基金主代码	050029	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月28日	
报告期末基金份额总额	44,270,167.18份	
投资目标	本基金在保持资产相对流动性的基础上,努力追求绝对收益,争取为基金份额持有人谋求资产的增值。	
投资策略	本基金通过对宏观经济运行和货币财政政策的分析,预判未来市场利率变化趋势,采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内。采用利率策略、信用策略、个券选择等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,争取提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率（税后）	
风险收益特征	本基金为短期理财债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
下属分级基金的交易代码	050029	050129
报告期末下属分级基金的份额总额	24,165,743.84份	20,104,423.34份

§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（2014年10月1日-2014年12月31日）	
	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
1.本期已实现收益	240,188.06	209,114.56
2.本期利润	240,188.06	209,114.56
3.期末基金资产净值	24,165,743.84	20,104,423.34

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.博时理财30天债券A:

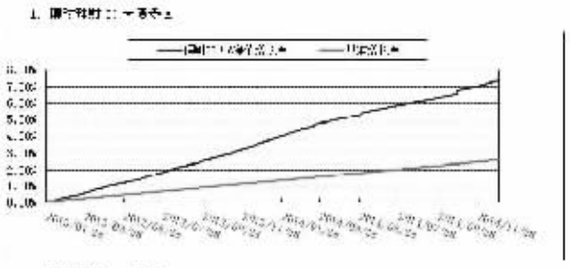
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9479%	0.0225%	0.3403%	0.0000%	0.6076%	0.0225%

2.博时理财30天债券B:

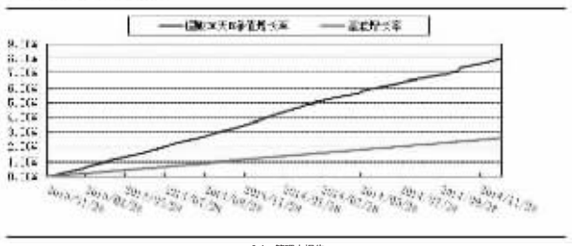
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0217%	0.0225%	0.3403%	0.0000%	0.6814%	0.0225%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时理财30天债券A



2.博时理财30天债券B



§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		
陈凯杨	基金经理/权益管理组投资副总监	2013-1-28	-	9	2003年起先后在深圳发展银行、博时基金、长城基金工作。2009年1月再次加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、特定资产投资经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安心收益定期开放债券基金、博时理财30天债券基金、博时2岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时双月薪定期支付债券基金基金经理。
魏桢	基金经理	2013-1-28	-	6	2004年起在厦门市商业银行任债券交易员主管。2008年7月加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、固定收益研究员。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时安丰18个月定期开放债券（LOF）基金、博时双月薪定期支付债券基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金的基金经理。

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、《博时理财30天债券型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运作分析

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、《博时理财30天债券型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。

4.5 报告期内基金业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.099元,份额累计净值为0.960元,报告期内净值增长率为1.76%,同期业绩基准涨幅为0.34%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行降息进一步确认经济状况以及企业盈利总体偏弱,从上市公司已经公布完毕的三季报情况来看,非金融公司三季度整体盈利当季同比增速5.33%,低于二季度的11.13%,与一季度相当,环比增速在零增长附近。预计全年盈利增速在个位。全球油价暴跌后,经济通缩压力进一步加大,央行降息更多处于对经济下行压力托底的考虑。

经济发展、股市好的格局有望延续。目前股票市场的上行动力主要来自于无风险收益率的下降以及风险溢价的下行。过去几年持续熊市的原因是因为大家担心系统性风险,包括政治、经济等都存在较大不确定性,市场更加偏重“转型”的故事以规避系统性风险,而在目前时点,经过地产行业以及政府投资下滑对经济拖累的压力测试后,很多行业的供需格局有所改变,部分原来被判定为长期存有天花板、难以转型的行业和公司开始出现变化。预计明年市场仍会对这一类机会做出相对正面的反馈,同时,部分盈利增速稳定,估值合理,但目前市场认知度偏低的个股也会有一定的机会。

目前的市场更多表现为估值水平的回升要快于盈利水平的即期改善。在这种情况下,市场轮动加快,波动性提升,实现盈利以及风险控制须提上议事日程。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	固定收益投资	17,005,885.12	34.39
	其中:债券	17,005,885.12	34.39
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	20,200,149.70	40.85
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	10,196,789.82	20.62
4	其他资产	2,044,966.45	4.14
5	合计	49,447,791.09	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.22	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	5,099,872.35	11.52
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	31
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	98
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过150天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过150天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	71.60	11.52
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）-90天	38.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）-397天（含）	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.02	11.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	17,005,885.12	38.41
	其中:政策性金融债	17,005,885.12	38.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	17,005,885.12	38.41
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140317	14进出17	170,000	17,005,885.12	38.41

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%（含）-0.5%间的次数	8次
报告期内偏离度的最高值	0.32%
报告期内偏离度的最低值	-0.03%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.10%

注:上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.8.2 本报告期内,本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 报告期内本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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,301,314.44
3	应收利息	715,304.64
4	应收申购款	28,347.37
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,044,966.45

5.8.5 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

项目	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
报告期期初基金份额总额	24,129,073.69	10,159,840.91
报告期期间基金总申购份额	8,521,766.34	21,429,728.80
减:报告期期间基金总赎回份额	8,485,096.19	11,485,146.37
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	24,165,743.84	20,104,423.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 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“敬投资价值的发现者”,截至2014年12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,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,博时基金资产管理净值总规模逾2363亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1124亿元人民币,累计分红超过638亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至12月31日,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名第6,博时特许价值股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名第12;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2;博时裕富沪深300指数基金在同类150只标准指数股票型基金中排名前1/5,博时上证超大盘ETF及博时深证基本面200ETF在150只标准指数股票型基金中均排名前1/2;博时上证超级大盘ETF联接及博时深证基本面200ETF联接在同类45只产品中排名前1/2,混合基金中,博时裕益灵活配置混合在34只灵活配置型基金中排名前1/4,博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类29只产品中排名前1/2;博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类)今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类)今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(B类)今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2.客户服务

2014年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动219场,参加人数6102人。

3.其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜“2014年度最佳中资基金公司奖”;

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的“最佳品牌奖”。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准博时理财30天债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时理财30天债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时理财30天债券型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5博时理财30天债券型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时理财30天债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2存放地点:

基金管理人、基金托管人处。

9.3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
2015年1月21日

博时抗通胀增强回报证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014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:2015年1月21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2015年1月20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2014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	290,549,290.10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（2014年10月1日-2014年12月31日）
1.本期已实现收益	-4,534,969.47
2.本期利润	-9,740,972.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0301
4.期末基金资产净值	184,718,618.78
5.期末基金份额净值	0.636

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。

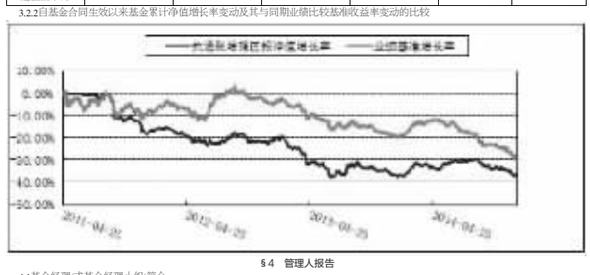
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-4.65%	0.68%	-7.84%	0.69%	3.19%	-0.01%

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



§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		
黄韬	基金经理	2014-3-7	-	9.5	2004年起在民安证券任交易员。2005年加入博时基金管理有限公司,历任交易员、国际股票交易组主管、基金经理助理、投资经理助理、投资经理。现任博时抗通胀增强回报证券投资基金的基金经理。

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、本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

今年以来全球大宗商品市场整体表现疲弱,中国、欧洲及日本经济增速的下滑是其主要原因,虽然这些国家的地区均采用了货币宽松政策但效效甚微。今年第四季度全球大宗商品中以原油表现最差,汽油、柴油、燃料油、天然气均出现不同程度的下跌,究其原因主要有两个方面,一方面,今年全球经济复苏不理想,对于能源的需求较为疲软;另一方面,原油供应却维持于高位,除欧佩克成员国保持此前的高供应量外,美国页岩油开发规模也明显扩大。虽然美联储结束了QE3,但欧洲、日本和中国先后加入了货币宽松行列,然而在全球低通胀率影响下黄金价格维持低位窄幅震荡走势。一直以来中国因素是影响基本金属价格走势的主要原因,而中国经济增速放缓导致基本金属需求下滑,以及人民币兑美元汇率双边波幅增大后融资需求下滑较为明显,这校因素都导致了今年以来基本金属价格表现不佳。农产品方面,在经历了收割季的价格回落后,大豆、小麦、玉米、棉花等主要农产品价格在第四季度有所反弹。

股票资产方面,本基金今年初以来价增加通胀、美股的配置,通过基本面选股和灵活的投资策略取得了较好的投资收益,其中来自医药、非银行金融、电商、新能源汽车板块的股票投资收益贡献了今年的基金净值增长。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为0.636元,份额累计净值为0.636元,报告期内净值增长率为-4.65%,同期业绩基准涨幅为-7.84%。

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2015年虽然美联储结束了QE3,但欧洲、日本仍在推持或加大货币宽松政策的中国则在时隔2年之后首次降息,我们认为金融市场流动性依然充沛,但全球经济增长复苏依旧缓慢。我们认为国际大宗商品中能源价格受低需求及高产能影响将维持弱势,黄金及基本金属将维持低位震荡,农产品价格有望继续向上修正。经历2014年三、四季度的调整之后,我们认为海外中资股整体估值较低已逐渐显现出投资价值,我们希望通过大类资产的灵活配置和个股精选继续为基金贡献收益。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§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	60,426,337.58	32.30
	其中:普通股	60,426,337.58	32.30
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	115,449,532.53	61.71
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	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	11,047,471.05	5.90
8	其他各项资产	171,491.58	0.09
9	合计	187,094,832.74	100.00

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

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
香港	60,426,337.58	32.71
合计	60,426,337.58	32.71

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	38,588,049.37	20.89
医疗保健	11,109,813.98	6.01
工业	5,166,546.29	2.80
信息科技	4,366,789.89	2.36
必需消费品	1,195,138.05	0.65
合计	60,426,337.58	32.71

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	香港证券交易所	中国香港	484,000	14,947,982.08	8.09
2	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	中国银河	6881 HK	香港证券交易所	中国香港	1,900,000	14,583,839.69	7.90
3	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	7,880,811.30	4.27
4	CITIC SECURITIES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	4,607,000.80	2.49
5	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	中国民航信息网络	696 HK	香港证券交易所	中国香港	600,000	3,966,438.36	2.15
6	CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD	中国动物保健品	940 HK	香港证券交易所	中国香港	758,000	3,229,002.68	1.75
7	FIRST SHANGHAI INVESTMENTS	第一上海	227 HK	香港证券交易所	中国香港	2,000,000	2,650,603.20	1.43
8	CAR INC	神州租车	699 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	2,466,007.62	1.34
9	CHINA SMARTPAY GROUP HOLDING	中国支付通	8325 HK	香港证券交易所	中国香港	2,000,000	1,798,623.60	0.97
10	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	中国南方航空股份	1055 HK	香港证券交易所	中国香港	466,000	1,356,493.52	0.73

注:所用证券代码采用当地市场代码。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7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序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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 BARCLAYS HIGH YIELD BD	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	14,175,275.40	7.67
2	POWERSHARES DB BASE METALS F	ETF	交易型开放式	Deutsche Bank AG	13,620,894.00	7.37
3	ETFS PHYSICAL PALLADIUM SHAR	ETF	交易型开放式	ETF Securities USA LLC	12,328,194.06	6.67
4	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	10,939,854.15	5.92
5	IPATH BLOOMBERG AGRICULTURE	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	10,219,757.99	5.53
6	POWERSHARES DB AGRICULTURE F	ETF	交易型开放式	Deutsche Bank AG	9,138,114.60	4.95
7	ETFS PLATINUM TRUST	ETF	交易型开放式	ETF Securities USA LLC	7,878,518.45	4.27
8	MARKET VECTORS EMERGING MARK	ETF	交易型开放式	Van Eck Associates Corp	6,476,961.50	3.51
9	IPATH BLOOMBERG GRAINS SUBIN	ETN	交易型开放式	Barclays Capital Inc	5,076,842.52	2.75
10	SPDR GOLD SHARES	ETF	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC/USA	4,589,251.23	2.48

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	141,787.33
4	应收利息	1,005.50
5	应收申购款	28,698.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	171,491.58

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的情况。

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

项目	
报告期期初基金份额总额	352,863,441.68
报告期期间基金总申购份额	2,263,941.44
减:报告期期间基金总赎回份额	64,578,093.02
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	290,549,290.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 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“敬投资价值的发现者”,截至2014年12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,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,博时基金资产管理净值总规模逾2363亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1124亿元人民币,累计分红超过638亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至12月31日,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名第6,博时特许价值股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名第12;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2;博时裕富沪深300指数基金在同类150只标准指数股票型基金中排名前1/5,博时上证超大盘ETF及博时深证基本面200ETF在150只标准指数股票型基金中均排名前1/2;博时上证超级大盘ETF联接及博时深证基本面200ETF联接在同类45只产品中排名前1/2,混合基金中,博时裕益灵活配置混合在34只灵活配置型基金中排名前1/4,博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类29只产品中排名前1/2;博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类)今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类)今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(B类)今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2.客户服务

2014年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动219场,参加人数6102人。

3.其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜“2014年度最佳中资基金公司奖”;

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的“最佳品牌奖”。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1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

9.1.2《博时抗通胀增强回报证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时抗通胀增强回报证券投资基金托管协议》

9.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5博时抗通胀增强回报证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时抗通胀增强回报证券投资基金在指