

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司(以下简称“博时”)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,保证基金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,基金的实际业绩并不表示其未来表现,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。
本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

基金名称	博时深证基本面200ETF
场内简称	深200
基金代码	159008
交易场所	交易所
交易方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2014年7月10日
报告期末基金份额总额	115,229,029.91
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,按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面200指数(价格净指数)
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,属于高风险收益的投资品种。本基金的风险收益特征与标的指数的风险收益特征相类似。
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

3.1 主要财务指标	
主要财务指标	单位:人民币元
1.本期已实现收益	4,903,829.95
2.本期利润	34,603,065.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.2529
4.期末基金资产净值	119,947,035.80
5.期末基金份额净值	1.009

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,计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数据。

3.2 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	业绩比较基准收益率	①-②
过去三个月	33.24%	1.54%	33.19%
过去六个月	67.79%	2.99%	67.76%
过去一年	105.91%	4.43%	105.87%

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的比较	
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的比较	

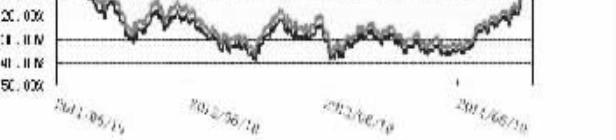


图3:自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

5.4 管理人报告				
4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介				
姓名	职务	任本基金基金经理年限	证券从业年限	说明
赵阳	基金经理	2012-11-13	4	2003年至2010年在嘉实基金任研究员,2010年加入博时基金,在博时基金历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2012年11月13日起任本基金基金经理,现任博时基金权益部基金经理兼博时深证基本面200ETF基金经理。

4.2 管理人对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守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规,《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于持有人,为持有人谋求利益。本基金管理人严格遵守了基金合同的有关规定,没有损害基金份额持有人的利益的行为。
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管理制度,未发现异常交易行为。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,本基金管理人不存在异常交易行为。
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
4.4.1 宏观经济形势分析
2014年四季度,国内经济保持平稳发展,在流动性宽松、稳增长的支持下,A股走出了“一波三折”行情,自降息以来,上证指数、沪深300为代表的蓝筹股表现抢眼,中小股表现则相对逊色。从行业来看,食品饮料、医药、通信、国防军工等行业表现突出,而煤炭、有色、钢铁等行业表现较弱。整体来看,市场情绪有所好转,但仍处于震荡调整阶段。本基金管理人将继续密切关注市场动态,灵活调整投资组合,力争实现基金资产的稳健增值。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和运作分析
4.4.3 公平交易专项说明
4.4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.5 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.5.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.6 管理人报告
4.6.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.7 报告期内基金的投资策略和运作分析
4.7.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.8 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.8.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.9 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.9.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.10 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.10.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.11 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.11.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.12 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.12.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.13 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.13.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.14 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.14.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.15 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.15.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.16 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.16.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.17 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.17.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.18 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.18.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.19 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.19.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.20 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.20.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

4.21 基金业绩(或基金经理小组)简介
4.21.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	250,887.90	0.21
B	采矿业	4,837,870.13	4.03
C	制造业	60,980,308.29	53.85
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	4,204,918.73	3.51
E	建筑业	1,270,554.44	1.06
F	交通运输、仓储和邮政业	513,535.93	0.43
G	信息传输、软件和信息技术服务业	984,627.90	0.80
H	住宿和餐饮业	695,101.08	0.58
I	金融业	15,080,977.12	12.57
J	房地产业	17,084,401.24	14.24
K	批发和零售业	82,626,136.06	0.71
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	1,450,861.50	1.21
N	教育	-	-
O	卫生和社会工作	-	-
P	文化、体育和娱乐业	156,233.80	0.13
Q	合计	118,976,202.12	99.19

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	629,882	8,752,579.80	7.30
2	000651	格力电器	109,962	4,081,708.44	3.40
3	000001	平安银行	238,965	3,785,260.60	3.16
4	000776	广发证券	139,742	3,639,304.90	3.02
5	000157	中联重科	436,345	3,082,007.70	2.57
6	000313	宝硕股份	2,002,802	2,249,200.00	1.88
7	000799	洋河股份	74,829	2,837,503.07	2.37
8	000825	太原钢铁	470,140	2,477,637.80	2.07
9	000402	金 鼎 刚	191,470	2,365,757.10	1.97
10	000783	长江证券	136,412	2,294,449.84	1.91

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。

5.6 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
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投资。

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
5.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。
5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,428.62
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	254.02
5	应收申购款	-
6	预收账款	-
7	其他应收款	-
8	其他	-
9	合计	9,682.64

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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。

5.11.7 其他资产构成

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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	9,550,579.98
6	其他应收款	482,186.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,032,766.47

5.11.8 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。

5.11.9 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。

5.11.10 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。

5.11.11 其他资产构成

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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	9,550,579.98
6	其他应收款	482,186.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,032,766.47

5.11.12 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。

5.11.13 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。

5.11.14 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。

5.11.15 其他资产构成

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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	9,550,579.98
6	其他应收款	482,186.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,032,766.47

5.11.16 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。

5.11.17 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。

5.11.18 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。

5.11.19 其他资产构成

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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	9,550,579.98
6	其他应收款	482,186.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,032,766.47

5.11.20 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。

5.11.21 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。

5.11.22 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。

5.11.23 其他资产构成

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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	9,550,579.98
6	其他应收款	482,186.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,032,766.47

5.11.24 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。

5.11.25 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。

5.11.26 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。

5.11.27 其他资产构成

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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	9,550,579.98
6	其他应收款	482,186.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,032,766.47

5.11.28 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。

5.11.29 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。

5.11.30 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。

5.11.31 其他资产构成

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	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	9,550,579.98
6	其他应收款	482,186.49
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,032,766.47

5.11.32 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。

5.11.33 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。

5.11.34 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。

5.11.35 其他资产构成

博时安盈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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司(以下简称“博时”)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,保证基金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,基金的实际业绩并不表示其未来表现,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。
本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

基金名称	博时安盈债券
场内简称 <td>安盈债</td>	安盈债
基金代码 <td>000064</td>	000064
交易场所 <td>交易所</td>	交易所
基金合同生效日 <td>2013年4月23日</td>	2013年4月23日
报告期末基金份额总额 <td>33,001,239,879.72</td>	33,001,239,879.72
投资目标 <td>通过基金管理人以短期债券和中期票据等为主要投资品种,并辅以国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券、银行存款、同业拆借、债券回购、权证、股指期货、权证、股指期货、权证、股指期货等金融工具,力求实现超越业绩比较基准的投资目标。</td>	通过基金管理人以短期债券和中期票据等为主要投资品种,并辅以国债、金融债、企业债、可转债、资产支持证券、银行存款、同业拆借、债券回购、权证、股指期货、权证、股指期货、权证、股指期货等金融工具,力求实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略 <td>本基金采取自上而下和自下而上相结合,定性分析和定量分析相结合的方法,进行国债、中期票据、可转债、资产支持证券、企业债、金融债、短期融资券、中期票据、金融债、企业债、可转债、资产支持证券、银行存款、同业拆借、债券回购、权证、股指期货、权证、股指期货等金融工具的投资。</td>	本基金采取自上而下和自下而上相结合,定性分析和定量分析相结合的方法,进行国债、中期票据、可转债、资产支持证券、企业债、金融债、短期融资券、中期票据、金融债、企业债、可转债、资产支持证券、银行存款、同业拆借、债券回购、权证、股指期货、权证、股指期货等金融工具的投资。
业绩比较基准 <td>中国央行银行公布的半年定期存款利率(税后)</td>	中国央行银行公布的半年定期存款利率(税后)
风险收益特征 <td>本基金为债券型基金,预期风险和收益水平低于股票型基金,但高于混合型基金、股票型基金,属于中低风险收益的投资品种。</td>	本基金为债券型基金,预期风险和收益水平低于股票型基金,但高于混合型基金、股票型基金,属于中低风险收益的投资品种。
基金管理人 <td>博时基金管理有限公司</td>	博时基金管理有限公司
基金托管人 <td>交通银行股份有限公司</td>	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额 <td>33,001,239,879.72</td>	33,001,239,879.72
报告期末基金份额净值 <td>1.0085</td>	1.0085
报告期末基金份额净值 <td>1.0085</td>	1.0085
报告期末基金份额净值 <td>1.0085</td>	1.0085

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,801,028.47	博时安盈债券C: 1,807,222.26
2.本期利润	-1,333,069.64	2,358,764.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0003	0.0081
4.期末基金资产净值	104,072,933.59	100,176,648.58
5.期末基金份额净值	1.008	1.041

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及交易基金的各项费用,计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数据。

3.2 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

过去三个月 -1.41% | 0.15% | 0.73% | 0.00% | -2.14% | 0.12% |

过去六个月 -1.51% | 0.14% | 0.73% | 0.00% | -2.24% | 0.13% |

过去一年 -1.51% | 0.14% | 0.73% | 0.00% | -2.24% | 0.13% |

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的比较

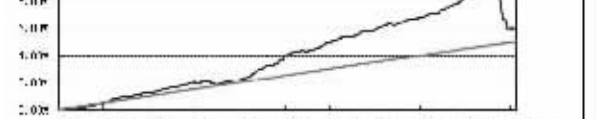


图3:自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

4.1 基金业绩(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理年限	证券从业年限	说明
陈勇	基金经理兼博时安盈债券基金经理	2013-2-3	10.5	2001年起先后在南方基金、嘉实基金、博时基金从事基金研究工作,2009年加入博时基金,历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2013年2月3日起任博时安盈债券基金经理,现任博时基金权益部基金经理兼博时安盈债券基金经理。

4.2 管理人对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守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规,《博时安盈债券型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则,取信于持有人,为持有人谋求利益。本基金管理人严格遵守了基金合同的有关规定,没有损害基金份额持有人的利益的行为。
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管理制度,未发现异常交易行为。
4.3.2