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

## 博时天天增利货币市场基金

### 2014 第四季度 报告

| 报告送出日期:2015年1月21日   |  |   |  |
|---|--|---|--|
| 基金管理人的董事会及董事保证本报<br>50个别及连带责任。  | <b>§ 1重要提示</b><br>告所载资料不存在虚假记载、误导性原          | 朱述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性系                                |  |
| 基金托管人中国银行股份有限公司根<br>等内容、保证复核内容不存在虚假记载、误<br>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽员<br>基金的过往业绩并不代表其未来表现<br>本报告中财务容料未经审计。 | 骨的原则管理和运用基金资产,但不保<br>。投资有风险,投资者在作出投资决策       | 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报信<br>证基金一定盈利。<br>前应仔细阅读本基金的招募说明书。 |  |
| 本报告期自 2014 年 10 月 1 日起至 12  | 月31日止。<br>§2基金产品概况                           |   |  |
| 基金简称  | 博时天天增利货币                                     |   |  |
| 基金主代码   | 000734                                       |   |  |
| 基金运作方式  | 契约型开放式                                       |   |  |
| 基金合同生效日   | 2014年 8 月 25 日                               |   |  |
| 报告期末基金份额总额  | 2,128,069,618.30 份                           | 2,128,069,618.30 份  |  |
| 投资目标  | 在保持相对低风险和相对高流                                | 在保持相对低风险和相对高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。                         |  |
| 投资策略  | 本基金在资产配置时应充分考定<br>益的配比中,力求降低各类风度<br>获取稳定的收益。 | 整各类资产的收益性、流动性及风险性特征。在风险与收益,并争取在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者        |  |
| 业绩比较基准  | 七天通知存款税后利率                                   |   |  |
| 风险收益特征  | 本基金为货币市场基金,是证券<br>收益低于股票型基金、混合型基             | 投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期<br>金、债券型基金。                      |  |
| 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                                   |   |  |
| 下属分级基金的基金简称   | 博时天天增利货币 A                                   | 博时天天增利货币 B  |  |
| 下属分级基金的交易代码   | 000734                                       | 000735  |  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额   | 329,109,180.60 份                             | 1,798,960,437.70 份  |  |
| 3.1 主要财务指标  | § 3 主要财务指标和基金净                               | 值表现   |  |
| 2.4 TWM2010A  |  | 单位:人民币:   |  |
| Account to the Association  | 报告期(2014                                     | 年 10 月 1 日-2014 年 12 月 31 日)                              |  |

| 1. 平州口头现収益   |                     |               | 3,4              | 33,/10.00               |                       | 13,398,384.4       |
|--|---------------------|---------------|------------------|-------------------------|-----------------------|--------------------|
| 2.本期利润   |                     |               | 3,4              | 33,716.60               |                       | 13,598,584.4       |
| 3.期末基金资产净值   |                     |               | 329,1            | 09,180.60               |                       | 1,798,960,437.70   |
| 注:本期已实现收益指<br>实现收益加上本期公允价的金额相等。<br>3.2 基金净值表现<br>3.2.1 本报告期基金份<br>1、博时天天增利货币 | 值变动收益,由于<br>额争值收益率及 | 货币市场基金采用的     | 推余成本法核算,因        | (変动收益) 扣除相<br>此,公允价值变动收 | 关费用后的余额,<br>益为零,本期已实现 | 本期利润为本期<br>现收益和本期利 |
| 阶段   | 净值收益率①              | 净值收益率标准<br>差② | 业绩比较基准收<br>益率(3) | 业绩比较基准收益<br>率标准差④       | ①-③                   | 2-4                |
| 过去三个月  | 1.0939%             | 0.0082%       | 0.3403%          | 0.0000%                 | 0.7536%               | 0.0082%            |
| 2、博时天天增利货币   | B:                  |               |                  |                         |                       |                    |
| 阶段   | 净值收益率①              | 净值收益率标准<br>差② | 业绩比较基准收<br>益率③   | 业绩比较基准收益<br>率标准差④       | ①-③                   | 2-4                |
| 过去三个月  | 1.1550%             | 0.0082%       | 0.3403%          | 0.0000%                 | 0.8147%               | 0.0082%            |

|                     | ———天天 <b>弟</b> 教科                                   | ●信着长率 —                         | -基本提长率     |            |
|---------------------|---|---------------------------------|------------|------------|
| 300                 |   |                                 |            |            |
| . 208<br>. 108      |   | _                               |            |            |
| 1,300               |   |                                 |            |            |
| . 408<br>. 200      |   |                                 |            |            |
| 100                 | 201   | 201                             | 201        | ân.        |
| 2011/01/25          | 30/4/69/25  | $so_{1d,\gamma_{0},\gamma_{0}}$ | 2011/11/25 | 3014/2/205 |
|                     | # ISP on  |                                 |            |            |
| 2 (8) 7             | artificant  |                                 |            |            |
| i. 19 1             |   |                                 | - 基金銀行室    |            |
| 190 I. v.v.         | ——天天排刊10  | 7(II-6)74                       |            | -          |
| 5.70.00.00.00.00.00 | —— <del>, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,</del> | 7124×+                          |            |            |

| 住: 平点<br>合同第<br>4.1 基: | 5並合同于 2014<br>十二部分 "(二<br>全经理(或基金) | 空理小组)简介   |         | 河规定,日本金<br>为定。本基金建<br><b>理人报告</b> | 合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比<br>仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约  |
|------------------------|------------------------------------|-----------|---------|-----------------------------------|---|
| 姓名                     | 职务                                 | 任本基金的     | 1.金经理期限 | 证券从业年                             | 逆期  |
| X±di                   | 87(95                              | 任职日期      | 离任日期    | 限                                 | 10099   |
| 张勇                     | 基金经理/固定收益原理总数 经现金管息 投资总监           | 2014-8-25 | -       | 10.5                              | 2001年起先后在南京市南州银行任富烷的<br>2003年11 从即村基金营车等从三月,<br>房局,基金经到助理。固定设定部国总签理。<br>经营理和投资。但某种理理会收益止季税受<br>管理和投资。因某种理理会收益止季税受<br>即增率关键资金。 博时至规目时债券犯证<br>使用于其份据金。 博士集观目债务犯<br>技术等。 使用于具有<br>技术等。 使用于具有<br>技术等。 使用于具有<br>技术等。 使用于是一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于其一种。 使用于具有<br>使用于是一种。 使用于具有<br>使用于是一种。 使用于具有<br>使用于是一种。 使用于具有<br>使用于是一种。 使用于具有一种。 使用于具有<br>使用于是一种。 使用于具有<br>使用于是一种。 使用于是一种。 使用于是一种,使用于是一种。 使用于是一种。 使用于是一种。 使用于是一种。 使用于是一种。 使用于是一种。 使用于是一种。 使用于是一种,使 |

19、4金金宝19年八千份雇佣1(中华人民天时国业券投资基金法)及其各项实施组则(拥即大天境和货币市场基金基金台法律法规的规定,并本省域实信用,勤勉尽责,取信于市场,取信于社会的原则管理和互用基金资产,为基金持有人谋求最大约,基金投资管理符合有完选规和基金台间的规定。没有规准基金持有人和益的行为。 公十文·罗(平9009) 《平文·易制度的执行情况 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。

部位基本分别的4.50mm (AMM ) 2.50mm (

|   | 无  | 期末基金资产组合情况        | 5 5 投资组合报告       |              |
|---|----|-------------------|------------------|--------------|
| ſ | 序号 | 项目                | 金額 (元 )          | 占基金总资产的比例 %) |
| Ī | 1  | 固定收益投资            | 904,794,100.54   | 40.43        |
| Ī |    | 其中:债券             | 904,794,100.54   | 40.43        |
| Ī |    | 资产支持证券            | -                | -            |
| Ī | 2  | 买人返售金融资产          | 835,302,092.95   | 37.32        |
| Ī |    | 其中:买断式回购的买人返售金融资产 | -                | -            |
| Ī | 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 480,694,941.95   | 21.48        |
| Ī | 4  | 其他资产              | 17,334,233.51    | 0.77         |
| Ī | 5  | 合计                | 2,238,125,368.95 | 100.00       |

| 序号  | 项目  | 占基金资产净值比例                          | R] (%)            |
|---|---|------------------------------------|-------------------|
|   | 报告期内债券回购融资余额                                      |                                    | 10.36             |
| 1   | 其中:买断式回购融资  |                                    | -                 |
| 序号  | 项目  | 金額                                 | 占基金资产净值的比例<br>(%) |
| 2   | 报告期末债券回购融资余额                                      | 108,999,436.50                     | 5.12              |
| 2   | 其中:买断式回购融资  | =                                  | -                 |
| 注:报告<br>债券正正<br>在本报告<br>5.3 基金<br>5.3.1 投 | 期内債券回與融資余額占基金資产等值的比例为根<br>明购的资金余额超过基金资产等值的 20%的说明 | 告期內每个交易日融資余額占資产净值比例<br>1资产净值的 20%。 | 的简单平均值。           |
|   | 项目  | 天数                                 |                   |

| 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  |                       | 97                        |  |  |
| 报告期内投                   | 资组合平均剩余期限最高值   | 125                   |                           |  |  |
|                         | 资组合平均剩余期限最低值   |                       | 52                        |  |  |
| 报告期内<br>本报告期<br>5.3.2 报 | 报资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明<br>时本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120<br>告期末投资组合平均剩余期限分布比例 | 0天。                   |                           |  |  |
| 序号                      | 平均剩余期限   | 各期限资产占基金资产净值<br>比例 %) | 的 各期限负债占基金资产净值的<br>比例 (%) |  |  |
| 1                       | 30天以内  | 50                    | 1.56 5.                   |  |  |
|                         | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债   |                       | -                         |  |  |
| 2                       | 30天(含)—60 天  | 15                    | i.52                      |  |  |
|                         | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债   |                       | -                         |  |  |
| 3                       | 60天(含)—90 天  | 1                     | .88                       |  |  |
|                         | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债   |                       | -                         |  |  |
| 4                       | 90天(含)—180 天   | 8                     | 3.00                      |  |  |
|                         | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债   |                       | -                         |  |  |
| 5                       | 180天(含)—397天 含)  | 28                    | 1.39                      |  |  |
|                         | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债   |                       | -                         |  |  |
|                         | 合计   | 104                   | 1.36 5.                   |  |  |
|                         | 期末按债券品种分类的债券投资组合   |                       |                           |  |  |
| 序号                      | 债券品种   | 推余成本 (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   | 109,802,252.33        | 5.                        |  |  |
|                         | 其中:政策性金融债  | 109,802,252.33        | 5.                        |  |  |
| 4                       | 企业债券   | -                     |                           |  |  |
| 5                       | 企业短期融资券  | 794,991,848.21        | 37.                       |  |  |
| 6                       | 中期票据   | -                     |                           |  |  |
| 7                       | 其他   | -                     |                           |  |  |
| 8                       | 合计<br>剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券   | 904,794,100.54        | 42.5                      |  |  |
| 9                       |  |                       |                           |  |  |

| 注:上表中            | <ul><li>申,债券的成本包括债券面<br/>期末按摊余成本占基金资</li></ul> | ii值和折溢价。<br>:产净值比例大小排名的i | 前十名债券投资明细 |               | <u>,</u>        |
|------------------|--|--------------------------|-----------|---------------|-----------------|
| 序号               | 债券代码   | 债券名称                     | 债券数量(张)   | 推余成本 元 )      | 占基金资产净值比例<br>%) |
| 1                | 011462003                                      | 14葛洲坝 SCP003             | 1,000,000 | 99,941,217.80 | 4.70            |
| 2                | 041461062                                      | 14晋焦煤 CP002              | 700,000   | 70,186,609.58 | 3.30            |
| 3                | 041460111                                      | 14永泰能源 CP002             | 630,000   | 63,001,614.21 | 2.96            |
| 4                | 041462028                                      | 14南山集 CP002              | 500,000   | 50,497,914.41 | 2.37            |
| 5                | 041458048                                      | 14同盛 CP001               | 500,000   | 50,402,314.28 | 2.37            |
| 6                | 011499028                                      | 14豫能源 SCP001             | 500,000   | 50,058,548.39 | 2.35            |
| 7                | 041454063                                      | 14中轻 CP001               | 500,000   | 50,008,707.74 | 2.35            |
| 8                | 041458083                                      | 14宝金属 CP001              | 500,000   | 49,984,454.24 | 2.35            |
| 9                | 041461003                                      | 14金元 CP001               | 400,000   | 40,236,296.78 | 1.89            |
| 10               | 041459068                                      | 14新投 CP001               | 400,000   | 40,154,171.39 | 1.89            |
| 注:上表中<br>5.6 "影子 | Þ,债券的成本包括债券@<br>定价"与"摊余成本法"                    | fi值和折溢价。<br>角定的基金资产净值的偏  | 离         |               |                 |
|                  |  | 项目                       |           | 偏离情           | 165             |

| 注:上表中<br>5.6 "影子                       | p,债券的成本包括债券i<br>定价"与"摊余成本法"                    | 面值和折溢价。<br>确定的基金资产净值的偏              | 离 |    |          |        |
|--|--|-------------------------------------|---|----|----------|--------|
|  |  | 项目                                  |   | 偏离 | 青泥       |        |
| 报告期内偏居                                 | 图度的绝对值在 0.25(含)                                | -0.5%间的次数                           |   |    |          | 7次     |
| 报告期内偏居                                 | 氢度的最高值   |                                     |   |    |          | 0.10%  |
| 报告期内偏居                                 | 氢度的最低值   |                                     |   |    |          | -0.35% |
| 报告期内每个                                 | 个交易日偏离度的绝对值                                    | 的简单平均值                              |   |    |          | 0.11%  |
| 5.7 报告》<br>本基金本<br>5.8 投资约<br>5.8.1 基金 | 期末按公允价值占基金资<br>报告期末未持有资产支<br>组合报告附注<br>会计价方法说明 | 期内各工作日数据计算。<br>资产净值比例大小排名的自<br>特证券。 |   |    | 1公钟四十亩65 | 行口込む   |

| 元。<br>5.8.2 本記<br>元。<br>5.8.3 报名 | 米用固定份額净值、基金账面份額净值查路學保持 1.00 元。<br>基金在报告期内不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期<br>专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<br>也各项资产构成 | 超过 397 天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值 20%的情<br>案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。 |
|----------------------------------|--|--|
| 序号                               | 名称   | 金額 (元 )  |
| 1                                | 存出保证金  | =  |
| 2                                | 应收证券清算款  | =  |
| 3                                | 应收利息   | 14,519,467.99  |
| 4                                | 应收申购款  | 2,814,765.52   |
| 5                                | 其他应收款  | =  |
| 6                                | 待摊费用   | =  |
| 7                                | 其他   | =  |
| 8                                | 合计   | 17.334.233.51  |

| 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能 | 存在尾差。<br>§6开放式基金份额变动 | 单位:份             |
|------------------------|----------------------|------------------|
| 项目                     | 博时天天增利货币 A           | 博时天天增利货币 B       |
| 设告期期初基金份额总额            | 250,016,424.15       | 634,856,914.04   |
| 设告期期间基金总申购份额           | 925,023,962.57       | 3,782,205,196.17 |
| 或:报告期期间基金总赎回份额         | 845,931,206.12       | 2,618,101,672.51 |
| 设告期期末基金份额总额            | 329,109,180.60       | 1,798,960,437.70 |
| § 7 基金管理               | 人运用固有资金投资本公司管理基金情况   |                  |

8.6 整置雙人與用與特別者於對於不公司豐建整節的。 報告期內基金管理人來发生這用關係資金申職。與認義的理解整理機會。 轉率基金管理有限公司是中国內核管批成立修介家基金管理公司之一,方面民國政營。是轉對於使命。轉對的股份理全是"戰役 值的效果者"或至2014年12月 31 1. 轉率基金公司共管理五十三八并改工基金,其受全国社会保障基金理事会委托管理部分往降基 以及多个企业年金使户。轉列基金符产管理的信息规模值 2943 亿元人民币,其中公募基金的产规模值 1124 亿元人民币,累计分红超过 亿元人任所,是有限规则管理等是使

9.1 备查文件目录 9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时双月薪定期支付债券型证券投资基金设立的文件 9.1.2 【博时天大增和货币市场基金基金台间】

9.1.4 基金管理人业多资格批准、营业执照和公司章程 9.1.5 报告期内博时天天增利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿 2 存放地点: 金管理人、基金托管人处 3 查阅方式 9.3 宣國75. 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;95105588(免长途活费)

# 博时黄金交易型开放式证券投资基金

#### 2014 第四季度 报告

#### 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

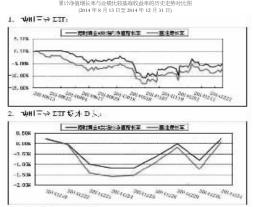
报告逐出日期。2015年1月21日

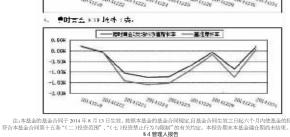
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误号性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、推确性和完整性承基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误号性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、推确性和完整性承基金作品、化工程的,以由国际政策不存在整配记载、误等结然还成了重大遗漏。基金管理人类还以现该省几年加速使用的大量的重要和应用基金资产。但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险、投资者在作出投资决策则应付细阅读本基金的招募谈明书。本报告中报务资料和经知计。本报告的第2014年10月1日起至12月31日止。本报告的第2014年10月1日起至12月31日止。标准后期目2014年10月1日起至12月31日止,从报纸基金管理人2014年12月1日日发布的(特别基金管理有限公司关于博时黄金交易是开放式证券投资基金增设1类场外份额及原场外份额变更仍公告),自2014年12月1日起本市及"特别基金管理有限公司关于博时黄金交易是开放式证券投资基金增设1类场外份额及原场价额变更公全方。是2014年12月1日起本有处理公司本基金增设1类场外份额。即时,本基金原场外份额变更为本基金的 D 类场外份额,具体 P容请应规则还该担任上的各项制度公告。

|                 | 8   | 2基金产品概况         |                 |  |
|-----------------|---|-----------------|-----------------|--|
| 基金简称            | 博时黄金 ETF  |                 |                 |  |
| 场内简称            | 博时黄金  | 柳村黄金            |                 |  |
| 基金主代码           | 159937  | 159937          |                 |  |
| 基金运作方式          | 交易型开放式指数基   | 金               |                 |  |
| 基金合同生效日         | 2014年8月13日  |                 |                 |  |
| 报告期末基金份額总额      | 9,510,504.71 份  | 9,510,504.71 份  |                 |  |
| 投资目标            | 本基金通过投资于黄金交易所的黄金现货合约,在跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下,争取为投资者提供与标的指数表现接近的投资回报。   |                 |                 |  |
| 投资策略            | 本基金主要采取被动式管理策略。基于假跨误差、流动性因素和交易便利程度的考虑,黄金现货实盘合约中,本基金将主要投资于AU99.99。 |                 |                 |  |
| 业绩比较基准          | 黄金现货实盘合约 AI   | U99.99 收益率      |                 |  |
| 风险收益特征          | 本基金主要投资对象为黄金现货合约,预期风险,收益水平与黄金相似,在证券投资基金中属于较高风险和预期收益的基金品种。         |                 |                 |  |
| 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               |                 |  |
| 下属三级基金的基金简称     | 博时黄金 ETF  | 博时黄金 ETF 场外 D 类 | 博时黃金 ETF 场外 I 类 |  |
| 下属三级基金的交易代码     | 159937  | 000929          | 000930          |  |
| 报告期末下属三级基金的份额总额 | 2,221,977.00 份  | 7,855.00 份      | 7,280,672.71 份  |  |

| 3.1 土 安州 別 1日 1 |                                     |                 |                 |  |  |  |  |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|-----------------|--|--|--|--|
|                 |                                     |                 | 单位:人民币元         |  |  |  |  |
| 主要财务指标          | 报告期<br>(2014年 10月 1日-2014年 12月 31日) |                 |                 |  |  |  |  |
|                 | 博时黄金 ETF                            | 博时黄金 ETF 场外 D 类 | 博时黄金 ETF 场外 I 类 |  |  |  |  |
| 1.本期已实现收益       | -348,553.98                         | 27.34           | 13,992.85       |  |  |  |  |
| 2.本期利润          | 356,443.32                          | 68.49           | 121,859.24      |  |  |  |  |
| 3.加权平均基金份额本期利润  | 0.0860                              | 0.0102          | 0.0596          |  |  |  |  |
| 4.期末基金资产净值      | 5,359,251.12                        | 18,959.04       | 17,564,068.51   |  |  |  |  |
| 5.期末基金份额净值      | 2.4119                              | 2.4136          | 2.4124          |  |  |  |  |
| 3.2 基金净值表现      |                                     |                 |                 |  |  |  |  |

| e-179271-1889-182-172-184-17-18         | -       |                |               |                  |                   |        |         |
|---|---------|----------------|---------------|------------------|-------------------|--------|---------|
| 3.2 基金净值表现<br>3.2.1 本报告期基<br>1、博时黄金 ETF | 金份额净值   | 増长率)           | 及其与同期业绩比较     | V基准收益率的比较        |                   |        |         |
| 阶段                                      | 净值增长    | <b>(企業</b> (1) | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准收<br>益率(3) | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | 2-4     |
| 过去三个月                                   | -1.31   | %              | 1.16%         | -0.27%           | 1.21%             | -1.04% | -0.05%  |
| 2、博时黄金 ETF                              | 场外 D 类: |                |               |                  |                   |        |         |
| 阶段                                      | 净值增长    | 半①             | 净值增长率标准<br>差② | 业绩比较基准收<br>益率③   | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | (2)-(4) |
| 过去三个月                                   | 0.26    | %              | 0.67%         | 0.10%            | 0.86%             | 0.16%  | -0.19%  |
| 3、博时黄金 ETF                              | 场外 [类:  |                |               |                  |                   |        |         |
|   |         |                |               |                  |                   |        |         |





|         |         |            | 346    | I AE / CIKICI |  |
|---------|---------|------------|--------|---------------|--|
| 4.1 基金经 | 理(或基金经) | 里小组)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   |
| X±41    | 87(95   | 任职日期       | 离任日期   | NE35/ACIE+FPR | 0091   |
| 方维玲     | 基金经理    | 2014-08-13 | =      | 22.5          | 如完后在云南大学、海南省信托投资公司证券<br>新《期价业券和股份任公司证司查班》。让京次<br>方量子软件技术公司任职。2001年3月人期制基<br>全管理有限公司,历任金融工程。组金融工程<br>师、政龄优投资调励总经理。"各规划和总经理。<br>股票投资施工厂基础化设验证规,可是现代的经理。"<br>证据大量 ETF 基金及其联接基金和规划上证目<br>按资源 ETF 基金及其联接基金。"博<br>均上证自然资金。 |

在报告期内,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)及其各项实施細则,基金合同和其他相关法律法规的规本者被实信用,勤修改,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。 - 1 への 4 % 0.65 m 公平交易制度的执行情况 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。

| 5.1 报告期2 | ま基金资产组合情况         | 投资组合报告        |              |
|----------|-------------------|---------------|--------------|
| 序号       | 项目                | 金額(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
| 1        | 权益投资              | -             | -            |
|          | 其中:股票             | =             | -            |
| 2        | 固定收益投资            | =             | -            |
|          | 其中:债券             | =             | -            |
|          | 资产支持证券            | -             |              |
| 3        | 贵金属投资             | 23,563,780.00 | 97.15        |
| 4        | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 5        | 买人返售金融资产          | -             |              |
|          | 其中:买断式回购的买人返售金融资产 | -             |              |
| 6        | 银行存款和结算备付金合计      | 685,194.89    | 2.83         |
| 7        | 其他各项资产            | 4,937.54      | 0.02         |
|          |                   |               |              |

7 年限6年90页 8 台计
5 2 报告期末按于11分类的股票投资组合
本基金本招告期末按有股票。
5 3 报告期末按公允价值上基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资鲜细
本基金本招告期末来持有股票。
5 4 报告期末按6 报告中分配价值券投资组合
本基金本招告期末收制有股票。
5 5 报告期末按公允价值上基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资鲜细
本基金本活用到末来持有债券。

贵金属代码 贵金属名称 数量 (分)

§ 6 开放式基金份额变动

博时黄金 ETF 注。根據基金管理人 2014年 12月 15日发布的 (轉)基金管理和於乙司关于轉計黃金总學开放乙這等投资基金增收 逐次的分類 外份额变更的公告),自 2014年 12月 18日起对本基金增设 1 炙场外份额。同时,本基金原场外份额变更为本基金的 D 聚场外份额。 京董嘉與指述實用上的各海網技会的

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 基金管理人持有本基金份额变动情况 基金管理人共将有本基金份额变动情况

7.2 基金管理人运用指有资金投资本基金交易制制,联回或者买卖本基金的情况 报告期内基金管理人类处生运用有资金时期,联回或者买卖本基金的情况 18.8 期间投资表决策的其他重要信息 博申基金管理有限公司是中国内地省推改立的互求基金管理公司一、"方面民创造财富"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2014年12月31日,博申基金公司共管理五十三以开放式金。并受全国社会保障基金理事会实任管理部分社保基 金、以及多个企业年金健平,博士基金资产管理单位规模。216亿亿人民币,其中公表金资产规模是 1124亿元人民币,累计分红超过 6.36亿元人民币,是目前我国资产管理规模是大场基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前李。 1.基金业绩

9.2 存放地点 基金管理人、基金托管人处

| **第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 个别及差带责任。 基全杯管、久通銀行股份有限公司根据本基金合同顺定,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 基金管理人承诺以诚实信用,勤勉完再的原则管理和企用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金管理人承诺以诚实信用,勤勉完再的原则管理和企用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过生业级并不仅表其未来表现。投资有知愿,投资者任作出投资决策前应行卿阅读本基金的招募谈明书。 本报告中财务贷料木经申げ。 本报告期自 2014 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

| 基金简称           | 博村深证基本面 200ETF 联接   |
|----------------|---|
| 基金主代码          | 050021  |
| 交易代码           | 050021  |
| 基金运作方式         | 交易型开放式指数基金的联接基金   |
| 基金合同生效日        | 2011年6月10日  |
| 报告期末基金份额总额     | 91,686,463.16 份   |
| 投资目标           | 通过主要投资于深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数即证基本面 200 指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。   |
| 投资策略           | 本基金主要投资干深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金。方便特定的客户群<br>过本基金投资评证基本面 200 交易型开放式指数投资基金。本基金不参与深证基本面 2<br>交易型开放式指数投资基金的投资管理。                     |
| 业绩比较基准         | 深证基本面 200 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%   |
| 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基金。属于高风险高收益的开放式基金。本基金为被动式设价的废源的指数基金跟踪证基本而 200 指线 法风险收益转距与标价指数所奏证的市场组合的风险收益转径相似              |
| 基金管理人          | 博时基金管理有限公司  |
| 基金托管人          | 交通銀行股份有限公司  |
| 2.1.1 目标基金基本情况 |   |
| 基金名称           | 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金  |
| 基金主代码          | 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  |
| 基金份额上市的证券交易所   | 深圳证券交易所   |
| 上市日期           | 2011年7月13日  |
| 基金管理人名称        | 博时基金管理有限公司  |
| 基金托管人名称        | 交通銀行股份有限公司  |
| 2.1.2 目标基金产品概况 |   |
| 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 (介格指数 )。   |
| 风险收益特征         | 本基金属于股票整基金,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基金。属于高风险/腐收益的开放大基金。本基金分核动式投资的废聚型指数基金,主要用完全复制策略,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合的风险收益特征相似。 |

| 风险收益特征  | 用完全复制 | 馬风险/高权益的开放式基金。本基金为极动式投资的股票型指数基金,主要来<br>順築路、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<br>运转证相似 |
|---|-------|--|
| 3.1 主要财务指标  | § 3   | 上要财务指标和基金净值表现  |
|   |       | 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   |       | -1,258,729.43  |
| 2.本期利润  |       | 25,367,489.03  |
| 3.加权平均基金份额本期利润                                    |       | 0.2401   |
| 4.期末基金资产净值  |       | 94,312,875.41  |
| 5.期末基金份額净值  |       | 1.0286   |
| 注:本期已实现收益指基金本<br>现收益加上本期公允价值变动收益<br>上述基金业绩指标不包括持有 | É.    | 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<br>,计人费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。                      |

——李REDORD展示等省指制等。——基建增为基 10, .08 ...0.0. 1.... 3". "N

# 博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

### 2014 第四季度 报告

2014年12月31日

|   |                 |                  | 3 4 E    | 1年人取口   |   |
|---|-----------------|------------------|----------|---------|---|
| 4.1 基金经理                                  | 里(或基金经理/        | 组)简介             |          |         |   |
| 姓名  | 职务              | 任本基金的基金经理期限      |          | 证券从业年   | 说明  |
| X1:41                                     | R7(9f           | 任职日期             | 离任日期     | 限       | 0099  |
| 赵云阳                                       | 基金经理            | 2012-11-13       | -        | 4       | 2003年至 2010 年在晨星中国新安中心工作。2010 年<br>8 月加入椰油法金管查看例公司,历任显明经济部量<br>化分析师、椰油标谱 500 指数基金基金经理助理和博<br>明添证基本面 2002年 基金及其專務基金基金经理助<br>理。現日椰叶添证基本面 2002年 基金及其學接基金、<br>博鄉上江沚企情 30ETF 基金、椰油特许价值股票基金的<br>基金经理。 |
|   |                 | <b>企运作遵规守信情况</b> |          |         |   |
| 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、《博时深证基本面 200 交易型开放式  |
| 指数证券投资基                                   | 金联接基金基金         | 合同》和其他相关法        | 去律法规的规定, | 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                                  | <b>注</b> 持有人谋求最 | 大利益。本报告期内        | 1,由于证券市场 | 皮动等原因,本 | 基金曾出现个别投资监控指标超标的情况,基金管理人在   |
| 规定期限内进行                                   | 了调整,对基金(        | 分额持有人利益未进        | 成损害。     |         |   |
| 4.2 /\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\\ | L#TREETH        |                  |          |         |   |

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。

期内,本基金严格按照基金台同,以不低于基金资产净值 90%的资产都投资于深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金,保证投资收益紧贴标的指数;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。投资于深证基本面 200ETF基金的资产主要 截至 2014年12月31日,本基金份额争值为 1.0286元,份额累计净值为 1.0286元,报告期内净值增长率为 31.23%,同期业绩基准涨幅为

截至 2014年12月31日,未基金份鄉學值为 1.0286元,份额累计學值为 1.0286元,报告期內中但增长平匀 31.29%,同期並納為信息經過 / 20.23%。
2.03%。
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 / 2014年 4 季度、随着放牧策形式为度,从 2015年 / 201

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

§ 5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况(适用于 ETF 联接基金填 中:买断式回购的买人返售金融资 基金名称 基金类型 管理人

| A      | 农、林、牧、渔业    |             |           | 5,477.45     | 0.01             |  |
|--------|-------------|-------------|-----------|--------------|------------------|--|
| В      | 采矿业         |             |           | 49,746.71    | 0.05             |  |
| С      | 制造业         |             |           | 0.72         |                  |  |
| D      | 电力、热力、燃气及水生 | 产和供应业       |           | 24,617.81    |                  |  |
| E      | 建筑业         |             |           | 22,098.79    | 0.02             |  |
| F      | 批发和零售业      |             |           | 80,770.90    | 0.09             |  |
| G      | 交通运输、仓储和邮政业 | Ł.          |           | 1,895.40     | 0.00             |  |
| Н      | 住宿和餐饮业      |             |           | -            | -                |  |
| I      | 信息传输、软件和信息技 | 技术服务业       |           | 6,616.96     | 0.01             |  |
| J      | 金融业         |             |           | 81,946.92    | 0.09             |  |
| K      | 房地产业        |             |           | 149,863.16   | 0.16             |  |
| L      | 租赁和商务服务业    |             |           | 11,925.96    | 0.01             |  |
| M      | 科学研究和技术服务业  |             |           | -            | -                |  |
| N      | 水利、环境和公共设施管 | 理业          |           | 0.01         |                  |  |
| 0      | 居民服务、修理和其他服 | 3条业         |           | -            |                  |  |
| P      | 教育          |             |           | -            |                  |  |
| 0      | 卫生和社会工作     |             |           | -            |                  |  |
| R      | 文化、体育和娱乐业   |             |           | 4,339.20     |                  |  |
| S      | 综合          |             |           | -            |                  |  |
|        | 合计          |             |           | 1,130,001.03 | 1.20             |  |
| 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 | 1十名股票投资明细 |              |                  |  |
| 序号     | 股票代码        | 股票名称        | 数量 般)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例<br>%。) |  |
| 1      | 000002      | 万 科 A       | 4,045     | 56,225.50    | 0.06             |  |
| 2      | 000616      | 亿城投资        | 9,712     | 46,326.24    | 0.05             |  |
| 3      | 000680      | 山推股份        | 5,256     | 39,682.80    | 0.04             |  |
| 4      | 000906      | 物产中拓        | 2,279     | 36,464.00    | 0.04             |  |
| 5      | 002304      | 洋河股份        | 441       | 34,861.05    | 0.04             |  |
| 6      | 002050      | 三花股份        | 2,459     | 33,368.63    | 0.04             |  |
| 7      | 000651      | 格力电器        | 695       | 25,798.40    | 0.03             |  |
| 8      | 000157      | 中联重科        | 3,019     | 21,314.14    | 0.02             |  |
| 9      | 000501      | 鄂武商 A       | 1,200     | 18,984.00    | 0.02             |  |
| 10     | 000059      | 华锦股份        | 1,916     | 18.872.60    | 0.02             |  |

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量 段) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例<br>%) |
|----|--------|-------|-------|-----------|-----------------|
| 1  | 000002 | 万 科 A | 4,045 | 56,225.50 | 0.0             |
| 2  | 000616 | 亿城投资  | 9,712 | 46,326.24 | 0.0             |
| 3  | 000680 | 山推股份  | 5,256 | 39,682.80 | 0.0             |
| 4  | 000906 | 物产中拓  | 2,279 | 36,464.00 | 0.0             |
| 5  | 002304 | 洋河股份  | 441   | 34,861.05 | 0.0             |
| 6  | 002050 | 三花股份  | 2,459 | 33,368.63 | 0.0             |
| 7  | 000651 | 格力电器  | 695   | 25,798.40 | 0.0             |
| 8  | 000157 | 中联重科  | 3,019 | 21,314.14 | 0.0             |
| 9  | 000501 | 鄂武商 A | 1,200 | 18,984.00 | 0.0             |
| 10 | 000059 | 华锦股份  | 1,916 | 18,872.60 | 0.0             |

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贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属投资。 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五名权证投资明细 5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未投资股指期货交易

报告期末本基金未投资国债期货交易。 5.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的灾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。 5.12.2 报告期内基金投资的前十名投票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

| 序号 | 名称      | 金額 (元)       |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 10,877.09    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,250,016.13 |
| 3  | 应收股利    | =            |
| 4  | 应收利息    | 2,184.26     |
| 5  | 应收申购款   | 291,508.70   |
| 6  | 其他应收款   | =            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,554,586.18 |

| 3 | 应收股利  | =            |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | 2,184.26     |
| 5 | 应收申购款 | 291,508.70   |
| 6 | 其他应收款 | =            |
| 7 | 待摊费用  | =            |
| 8 | 其他    | =            |
| 9 | 合计    | 1,554,586.18 |

| 序号       | 股票代码      | 股票名称    | 流通受限部分的公允价<br>值(元) | 占基金资产净值比例<br>(%) | 流通受限情况说明 |
|----------|-----------|---------|--------------------|------------------|----------|
| 1        | 000616    | 亿城投资    | 46,326.24          | 0.05             | 公告重大事项   |
| 2        | 000906    | 物产中拓    | 36,464.00          | 0.04             | 公告重大事项   |
| 3        | 002050    | 三花股份    | 33,368.63          | 0.04             | 公告重大事项   |
| 4        | 000501    | 鄂武商 A   | 18,984.00          | 0.02             | 公告重大事项   |
| 5 12 6 担 | 密组合报告附注的其 | 他文字描述部分 | •                  |                  | •        |

由于四舍五人的原因,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           |
|---|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                                     | 112,634,013.33 |
| 报告期期间基金总申购份额                                    | 14,053,424.11  |
| 咸:报告期期间基金总赎回份额                                  | 35,000,974.28  |
| 报告期期间基金拆分变动份额                                   | =              |
| 报告期期末基金份额总额                                     | 91,686,463.16  |
| § 7 基金管理人运用固有资金投资本                              | 基金情况           |
| a the Address I block-to-the Advantage Children |                |

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。

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: 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武号混合在同类

排名館 1/2、混合基金中, 胸畔怀益更无配置配合在 34 只见远配置型基金中排名前 1/4、博时价值增长混合及博叶价值增长或与混合在同类 29 只产品中排名前 1/2、博叶平确配置混合在由或 16 只下品中排名前 1/2。 29 只产品中排名前 1/2;博叶平确配置混合在由或 16 只下油中岩布 1/2。 超定收益方面、博叶信用债券(AB 35) 今年以来收益单在 94 只同类普通债券型基金中排名第 1.博叶信用债券(C 35) 今年以来收益单在 64 只同类普通债券型基金中排名第 1.博叶稳定价值债券的 35) 今年以来收益单在 64 只同类普通债券型基金中排名第 1.博叶稳定价值债券 56 实际,10 使多4 35 实际,10 实际,10

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的"最佳品牌 § 9 备查文件目录

3.1.中国证券监督管理委员会批准博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件 9.1.2《博明/深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》 9.1.3《博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》 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 报告期内博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.1.6 博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金各年度审计报告正本 基金管理人、基金托管人处 9.3 查阅方式

9.3 查阅万式 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