博时宏观回报债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时宏观回报债券
基金主代码	050016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月27日
报告期末基金份额总额	45,010,980.39份
投资目标	通过一定范围内固定收益类与权益类资产,以及不同久期固定收益类资产的灵活配置,获取不同时期各子类资产的市场收益,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用以自上而下分析为主,自下而上分析为辅,定性分析、定量分析等各种分析手段有效结合的方法进行大类资产配置,在确定基金资产在固定收益类资产(债券、可转债、货币)与权益类资产(股票)之间的配置比例后,再确定不同年期债券的配置比例。 债券方面本基金对不同年期债券的配置,主要采取期限结构策略,通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类不同年期的债券进行久期配置,力争组合收益超过业绩比较基准收益。 权益投资方面,本基金在参与股票一级市场申购时主要考虑一二级市场溢价率、中签率和申购机会成本三个方面,选取合适的环境与个股参与,参与股票二级市场时,坚持择时参与不同股票指数的策略。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。
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	博时宏观回报债券A/B类 / 博时宏观回报债券C类
下属分级基金的交易代码	050016(前端),051016(后端) / 050116
报告期末下属分级基金的份额总额	20,046,123.75份 / 24,964,856.64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(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	博时宏观回报债券A/B类	博时宏观回报债券C类
1.本期已实现收益	-3,920,199.10	-3,921,254.62
2.本期利润	-2,804,712.32	-2,922,375.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1339	-0.1311
4.期末基金资产净值	21,695,029.18	27,021,573.74
5.期末基金份额净值	1.082	1.082

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

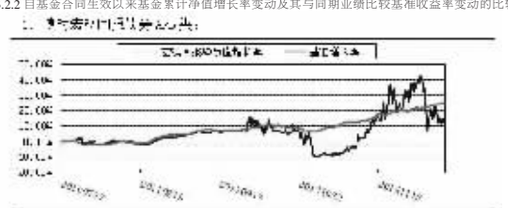
1、博时宏观回报债券A/B类:

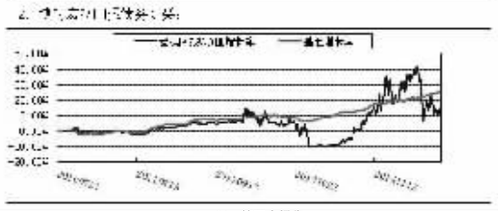
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.13%	1.79%	2.57%	0.06%	-12.70%	1.73%

2、博时宏观回报债券C类:

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	-10.13%	1.80%	2.57%	0.06%	-12.70%	1.74%

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		
王申	基金经理/固定收益总部研究组投资总监	2015-05-22	-	5	2002年起先后在友邦保险、申银万国证券、国金证券工作。2013年加入博时基金管理有限公司,历任固定收益研究主管、固定收益总部研究组副总监,现任固定收益总部研究组总监兼博时宏观回报债券基金、博时新财富混合基金的基金经理

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、本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、本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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金三季度在配置上仍然以计算机、电子、通讯、传媒相关的新兴成长行业为主,在市场下跌过程中逐渐将配置转换至业绩增长更为确定的个股,大幅降低了转型类高估值企业的持仓,但在市场八月底的第二轮下跌中仍遭遇明显回撤。进入九月份,我们观察到已经有部分业绩持续增长的企业股价回到了一年前位置,因此提高了仓位,短期的净值波动幅度会有所加大,但从中期我们还是有一定的信心。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金A/B类基金份额净值为0.622元,累计份额净值为0.622元,报告期内净值增长率为-26.22%,同期业绩基准涨幅为-16.99%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,宏观经济继续探底,央行降息至负利率使得整体流动性仍然充裕,导致大部分资产如债券、一线城市房地产价格被推高,短期从大类资产角度看除了股票外已经没有洼地。尽管短期市场信心并未完全恢复,但中期看资金仍会逐步流回股市这一相对低估的市场。

从市场参与者结构的角度看,场内两融已经降至1万亿以下,回到14年底水平,场外配资也进行了第二轮清理,在众多资金面利空的压力下,市场却逐步企稳,并在自发力量的推动下形成了阶段性底部,我们认为这表明市场的价格发现功能正在逐步修复。指数未来在较长时间内可能难以有行情,但个股开始有明显绝对收益空间,看好超跌过后的泛互联网行业股票的投资机会。

新兴行业仍将是未来的的投资重点,我们认为能源结构的改变,生产方式的变革才是未来经济升级的核心,同时人口老龄化的趋势和代际迁移将带动泛娱乐方向的消费持续高增长,因此我们持续看好新能源、智能硬件、智能制造以及传媒板块的IP/体育/互联网营销等产业方向。

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	权益投资	9,103,421.00	10.55
	其中:股票	9,103,421.00	10.55
2	固定收益投资	58,405,785.30	67.71
	其中:债券	58,405,785.30	67.71
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	12,729,563.06	14.76
7	其他各项资产	6,019,118.32	6.98
8	合计	86,257,887.68	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,300,121.00	10.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	455,200.00	0.93
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	704,000.00	1.45
J	金融业	1,342,100.00	2.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,302,000.00	2.67
S	综合	-	-
	合计	9,103,421.00	18.69

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	300195	长荣股份	78,700	1,348,131.00	2.77
2	600388	龙净环保	99,000	1,307,790.00	2.68
3	300291	华录百纳	60,000	1,302,000.00	2.67
4	300005	探路者	70,000	1,211,000.00	2.49
5	002637	赞宇科技	60,000	908,400.00	1.86
6	300047	天源迪科	55,000	704,000.00	1.45
7	600333	长春燃气	80,000	524,800.00	1.08
8	601198	东兴证券	30,000	471,300.00	0.97
9	601377	兴业证券	60,000	469,800.00	0.96
10	000652	泰达股份	80,000	455,200.00	0.93

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	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	10,938,000.00	22.45
	其中:政策性金融债	10,938,000.00	22.45
4	企业债券	28,857,980.40	59.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	18,609,804.90	38.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,405,785.30	119.89

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

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	132001	14宝钢EB	122,500	14,908,250.00	30.60
2	124161	13隧水泥	136,010	13,824,056.40	28.38
3	140222	14国开22	100,000	10,938,000.00	22.45
4	112138	12苏宁01	63,840	6,613,824.00	13.58
5	122273	13鲁业01	50,000	5,197,500.00	10.67

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。

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。

5.9 报告期末持有的投资品种发生了交易的证券投资品种的交易情况说明

本基金本报告期末未发生投资品种发生了交易的证券投资品种的情况。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	78,324.59
2	应收证券清算款	4,869,513.39
3	应收股利	-
4	应收利息	1,041,081.94
5	应收申购款	30,198.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,019,118.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	3,672,200.00	7.54

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时宏观回报债券A/B类	博时宏观回报债券C类
本报告期期初基金份额总额	22,637,433.88	22,008,952.97
报告期基金总申购份额	4,328,844.31	10,196,847.57
减:报告期基金总赎回份额	6,920,154.44	7,240,943.90
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,046,123.75	24,964,856.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 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"做投资价值的发现者"。截至2015年9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只灵活配置基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

2015年8月3日,博时基金经理过钧和张溪冈,荣获证券时报颁发的英华奖;同时,过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理,张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§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宏观回报债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时宏观回报债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时宏观回报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 博时宏观回报债券型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时宏观回报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
二〇一五年十月二十六日

博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时互联网主题混合
基金主代码	001125
交易代码	001125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月28日
报告期末基金份额总额	3,106,669,021.20份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极挖掘或长性行业和企业所蕴含的投资机会,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	基金管理人基于对经济周期及资产价格发展变化的理解,通过定性和定量的方法分析宏观经济,资本市场,政策导向等各方面因素,建立基金管理人对各大类资产收益的绝对或相对预期,进而作出对各大类资产配置权重的判断。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期收益和预期风险低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,具有中高等风险/收益的特征。
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

§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

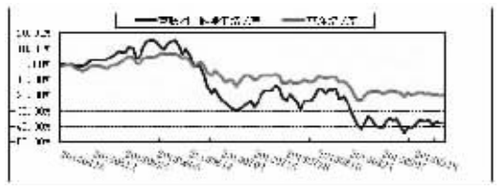
主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-768,069,944.83
2.本期利润	-769,801,449.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2408
4.期末基金资产净值	1,932,098,262.05
5.期末基金份额净值	0.622

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	-26.22%	4.26%	-16.99%	2.01%	-9.23%	2.25%

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		
招扬	基金经理	2015-04-28	-	8	2004至2007年曾在华为技术有限公司工作。2007年加入博时基金管理有限公司,历任研究员、资本品研究组主管兼研究员、投资经理。现任特定资产管理部副总经理兼博时标益灵活配置混合型证券投资基金、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
张雪川	基金经理	2015-04-28	-	6	1999年起先后在巨龙公司、华创证券工作。2013年加入博时基金管理有限公司,历任高级研究员、资深研究员、投资经理。现任博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金三季度在配置上仍然以计算机、电子、通讯、传媒相关的新兴成长行业为主,在市场下跌过程中逐渐将配置转换至业绩增长更为确定的个股,大幅降低了转型类高估值企业的持仓,但在市场八月底的第二轮下跌中仍遭遇明显回撤。进入九月份,我们观察到已经有部分业绩持续增长的企业股价回到了一年前位置,因此提高了仓位,短期的净值波动幅度会有所加大,但从中期我们还是有一定的信心。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金A份额净值为0.622元,累计份额净值为0.622元,报告期内净值增长率为-26.22%,同期业绩基准涨幅为-16.99%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,宏观经济继续探底,央行降息至负利率使得整体流动性仍然充裕,导致大部分资产如债券、一线城市房地产价格被推高,短期从大类资产角度看除了股票外已经没有洼地。尽管短期市场信心并未完全恢复,但中期看资金仍会逐步流回股市这一相对低估的市场。

从市场参与者结构的角度看,场内两融已经降至1万亿以下,回到14年底水平,场外配资也进行了第二轮清理,在众多资金面利空的压力下,市场却逐步企稳,并在自发力量的推动下形成了阶段性底部,我们认为这表明市场的价格发现功能正在逐步修复。指数未来在较长时间内可能难以有行情,但个股开始有明显绝对收益空间,看好超跌过后的泛互联网行业股票的投资机会。

新兴行业仍将是未来的的投资重点,我们认为能源结构的改变,生产方式的变革才是未来经济升级的核心,同时人口老龄化的趋势和代际迁移将带动泛娱乐方向的消费持续高增长,因此我们持续看好新能源、智能硬件、智能制造以及传媒板块的IP/体育/互联网营销等产业方向。

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	权益投资	1,814,070,367.92	91.35
	其中:股票	1,814,070,367.92	91.35
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	128,643,161.28	6.48
7	其他各项资产	43,216,372.09	2.18
8	合计	1,985,929,901.29	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	58,203,891.18	3.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	984,137,065.96	50.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,083,018.44	2.54
F	批发和零售业	58,722,735.72	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	413,994,810.51	21.43
J	金融业	97,245,304.20	5.03
K	房地产业	106,687,639.98	5.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	45,995,901.93	2.38
	合计	1,814,070,367.92	93.89

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	000063	中兴通讯	10,347,275	161,417,490.00	8.35
2	002008	大族激光	7,815,365	152,243,310.20	7.88
3	600718	东软集团	10,946,613	152,048,454.57	7.87
4	600109	国金证券	8,036,802	97,245,304.20	5.03
5	600571	信雅达	1,824,253	81,817,747.05	4.23
6	300097	智云股份	2,262,445	79,751,186.25	4.13
7	300136	信维通信	2,636,526	73,216,327.02	3.79
8	002174	游族网络	1,099,837	65,572,281.94	3.39
9	000066	长城电脑	5,699,882	63,154,692.56	3.27
10	002013	中航机电	3,173,641	61,092,589.25	3.16

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。

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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,045,125.17
2	应收证券清算款	38,697,387.69
3	应收股利	-
4	应收利息	30,850.94
5	应收申购款	443,008.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,216,372.09

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

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	002174	游族网络	65,572,281.94	3.39	公告重大事项
2	000066	长城电脑	63,154,692.56	3.27	公告重大事项

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。

§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	3,721,044,872.15
报告期基金总申购份额	362,126,633.69
减:报告期基金总赎回份额	976,502,484.64
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,106,669,021.20

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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"做投资价值的发现者"。截至2015年9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只灵活配置基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

2015年8月3日,博时基金经理过钧和张溪冈,荣获证券时报颁发的英华奖;同时,过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理,张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§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互联网主题灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时互联网主题灵活配置混合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 博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内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
二〇一五年十月二十六日

博时黄金交易型开放式证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	博时黄金ETF		
场内简称	博时黄金		
基金主代码	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		
报告期末基金份额总额	440,925,144.49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,基于跟踪误差、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