# 博时安盈债券型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015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:中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一六年一月二十日**

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 博时安盈债券 |
| 基金主代码 | 000084 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年4月23日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,905,887,899.13份 |
| 投资目标 | 通过基金管理人对以短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断,选择具有投资价值的债券,严格控制风险,力争实现超过业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,进行前瞻性的决策。一方面,本基金将分析和预测众多的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等),并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面,本基金将对短期债券市场收益率曲线和信用利差的变化进行深入细致分析,从而得出对市场走势和波动特征的判断。在此基础上,确定资产在不同行业、不同品种的债券之间的配置比例。 |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的1年期定期存款利率(税后) |
| 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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 博时安盈债券A / 博时安盈债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000084 / 000085 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 116,660,409.43份 / 1,789,227,489.70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10月1日-2015年12月31日) | |
|---|---|---|
| | 博时安盈债券A | 博时安盈债券C |
| 1.本期已实现收益 | 1,087,488.49 | 8,345,567.05 |
| 2.本期利润 | 1,821,523.11 | 14,345,342.60 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0168 | 0.0150 |
| 4.期末基金资产净值 | 127,264,151.18 | 1,936,050,179.45 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.091 | 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.博时安盈债券A:

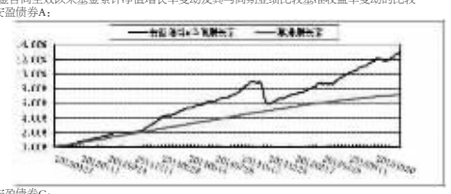
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.58% | 0.06% | 0.39% | 0.01% | 1.19% | 0.05% |

2.博时安盈债券C:

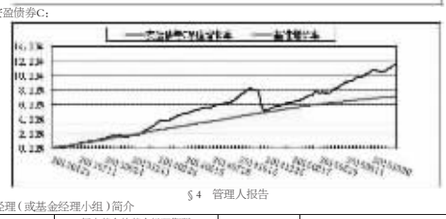
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.41% | 0.06% | 0.39% | 0.01% | 1.02% | 0.05% |

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

1. 博时安盈债券A:



2. 博时安盈债券C:



§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 | | |
| 魏楠 | 基金经理 | 2015-05-22 | - | 7 | 2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年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、博时理财30天债券基金的基金经理。现任博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月新定期支付债券基金、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、博时安盈债券基金、博时保证金货币ETF基金、博时外服货币基金、博时安荣18个月定开债基金的基金经理 |

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,由于证券市场波动等原因,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,对基金份额持有人利益未造成损害。

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

2015年第四季度,随着资产荒的深入和风险偏好的低迷,叠加央行货币政策的持续宽松基调,货币市场流动性维持总体充裕,回购利率总体低位。银行间R001均值1.83%,R007均值2.4%。由于配置需求释放不断填平曲线洼地,推动债券收益率不断向下突破新低。10Y-1Y国债期限利差大幅缩小60BP至50BP。信用风险的逐步暴露,导致投资者加大高等级品种的配置。AA+以上产品信用利差进一步缩窄,高低评级利差明显扩大。1年期短融收益率分别为3.0%(AAA)、3.1%(AA+)、3.3%(AA)。

四季度,本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则,以短期存款和短融为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金A类基金份额净值为1.091元,份额累计净值为1.127元;C类基金份额净值为1.082元,份额累计净值为1.114元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为1.58%,C类基金份额净值增长率为1.41%,同期业绩基准增长率0.39%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

资金大量流入驱动债券市场持续走牛,在此格局下,国债、国开债收益率将迅速下行,而流动性偏差导致形成的利率品位值注地将得以重估。维持对债市乐观态度,短期内货币政策宽松是债牛的重要依托,中长期看融资需求收缩、存量效率提升驱动融资成本下行。接下来有利于行情持续的因素在于新债发行较少与资金利率下降。1)资产供需失衡:1.2月利率债、尤其是国债的供给较少,大约只占到全年月均水平的一半。2)资金/短端利率下降:由于季节性因素消失与财政存款投放,资金利率在1月应该会有下降,打新资金回流也有助于降低短端利率,央行春节前降准降息同样值得期待。3)理财利率向下修复:资产端收益率下降,可能带来理财产品收益率的回落。

本组合投资思路上保持谨慎乐观,策略上依然保持开放式基金平均杠杆水平,通过短债降低波动性,以控制信用风险和提高票息收入为主。

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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 2,423,044,066.40 | 98.51 |
| | 其中:债券 | 2,423,044,066.40 | 98.51 |
| | 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 | 5,792,445.80 | 0.24 |
| 7 | 其他各项资产 | 30,856,077.21 | 1.25 |
| 8 | 合计 | 2,459,692,589.41 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 100,251,000.00 | 4.86 |
| | 其中:政策性金融债 | 100,251,000.00 | 4.86 |
| 4 | 企业债券 | 648,001,066.40 | 31.41 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,255,615,000.00 | 60.85 |
| 6 | 中期票据 | 419,177,000.00 | 20.32 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,423,044,066.40 | 117.43 |

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 | 112307 | 15投资01 | 1,300,000 | 130,000,000.00 | 6.30 |
| 2 | 041559031 | 15长虹股CP001 | 1,000,000 | 100,750,000.00 | 4.88 |
| 3 | 041573008 | 15丹东港CP002 | 1,000,000 | 100,440,000.00 | 4.87 |
| 4 | 011599758 | 15重产SCP006 | 1,000,000 | 100,390,000.00 | 4.87 |
| 5 | 1382088 | 13丹东港MTN1 | 900,000 | 93,159,000.00 | 4.52 |

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投资。

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

本基金本报告期末未投资股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本报告期内,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的情况。

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 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 30,176,769.73 |
| 5 | 应收申购款 | 679,307.48 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 30,856,077.21 |

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 博时安盈债券A | 博时安盈债券C |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 106,093,458.76 | 655,101,927.67 |
| 报告期基金总申购份额 | 23,972,008.38 | 1,580,595,533.58 |
| 减:报告期基金总赎回份额 | 13,405,057.71 | 446,469,971.55 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 116,660,409.43 | 1,789,227,489.70 |

§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12月31日,博时基金公司共管理八十五只开放式基金,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。资产管理净值总规模逾3980亿元人民币,其中公募基金资产规模约2054亿元人民币,累计分红约677亿元人民币,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,截至12月31日,指数股票型基金中,博时深证基本面200ETF及深证基本面200ETF联接,今年以来净值增长率在同类型分别排名前1/2和1/3;偏股型的混合基金里,博时创业成长混合及博时卓越品牌混合,今年以来净值增长率在同类型基金中分别排名前1/4和1/3;灵活配置型的混合基金里,裕隆灵活配置混合今年以来净值增长率在101只同类型中排名前1/2;灵活策略混合基金里,博时裕益及博时回报,在39只同类基金分别排名前1/5和1/3。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来净值增长率在19只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一;在长期标准债券型基金中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来净值增长率在同类排名前1/7,安心A类排名前1/6,博时信用债纯债A及博时优势收益信用债,在70只同类中排名前1/2;中短期标准债券基金A类里,博时安盈债券A在同类排名第二;普通债券型基金里,博时稳定价值债券A类在同类85只排名前1/9,博时稳定价值债券B类在50只同类排名前10%;可转换债券型基金A类和指数债券型基金A类里,博时转债增强债券A及博时上证企债30ETF在同类基金中排名前1/2;货币市场基金中,博时现金宝货币A在同类146只排名前1/3。

2、其他大事件

2015年12月18日,由东方财富网主办的2015年东方财富风云榜活动在深举行,博时基金荣获"2015年度最优QDII产品基金公司奖"。

2015年12月17日,由华夏日报主办第九届机构投资者年会暨金蝉奖颁奖盛典,博时基金荣获"2015年度最具互联网创新基金公司"。

2015年12月16日,由北京商报主办的2015北京金融论坛,博时基金荣获"品牌推广卓越奖"。

2015年12月11日,由第一财经日报主办的2015金融价值榜典礼在北京金融街威斯汀酒店举行,博时基金荣获"最佳财富管理金融机构"大奖。

2015年12月11日,由21世纪经济报道主办的2015亚洲资本年会在深圳洲际酒店举行,博时基金获评"2015最受尊敬基金公司"、张光华董事长获评"2015中国赢基金任务奖"。

2015年12月4日,由经济观察报主办的2014-2015年度中国卓越金融奖颁奖典礼在北京举行,博时基金凭借旗下固定收益类的出色表现,独家获评"年度卓越固定收益投资团队奖"。

2015年11月26日,由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的CFAC中国金融年会在深召开,博时基金荣获"年度最佳基金公司"大奖。

2015年11月20日,第十一届中国证券市场年会,博时基金获评"年度卓越贡献龙鼎奖"。

2015年11月7日,由每日经济新闻主办的第四届中国上市公司领袖峰会在成都香格里拉举行,博时资本荣获"最具成长性子公司"。

§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安盈债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时安盈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博时安盈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**
**二〇一六年一月二十日**

# 博时保证金实时交易型货币市场基金

## 2015 第四季度 报告

2015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:二〇一六年一月二十日**

§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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 博时保证金货币ETF |
| 场内简称 | 博时货币 |
| 基金主代码 | 511860 |
| 交易代码 | 511860 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年11月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 77,771,308.47份 |
| 投资目标 | 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虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征。在风险与收益的配比中,力求降低各类风险,并争取在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。 |
| 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,是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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10月1日-2015年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 15,729,410.73 |
| 2.本期利润 | 15,729,410.73 |
| 3.期末基金资产净值 | 7,777,130,840.64 |

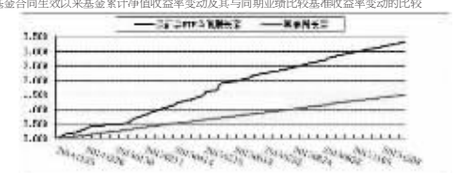
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

| 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 | 0.5932% | 0.0009% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2529% | 0.0009% |

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



注:本基金的基金合同于2014年11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三个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十四条"(二)投资范围"、"(四)投资限制"的有关约定。

§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 | | |
| 魏楠 | 基金经理 | 2015-06-09 | - | 7 | 2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年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、博时理财30天债券基金的基金经理。现任博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月新定期支付债券基金、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、博时安盈债券基金、博时保证金货币ETF基金、博时外服货币基金、博时安荣18个月定开债基金的基金经理 |

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

2015年第四季度,随着资产荒的深入和风险偏好的低迷,叠加央行货币政策的持续宽松基调,货币市场流动性维持总体充裕,回购利率总体低位。银行间R001均值1.83%,R007均值2.4%。由于配置需求释放不断填平曲线洼地,推动债券收益率不断向下突破新低。10Y-1Y国债期限利差大幅缩小60BP至50BP。信用风险的逐步暴露,导致投资者加大高等级品种的配置。AA+以上产品信用利差进一步缩窄,高低评级利差明显扩大。1年期短融收益率分别为3.0%(AAA)、3.1%(AA+)、3.3%(AA)。

四季度,本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则,以短期存款和短融为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内净值增长率为0.59%,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

在利率市场化逐步完成后,央行引入利率走廊和基准利率管理流动性模式,过去半年来货币市场资金利率波动性大幅下降,R007始终在2.5%以下小幅波动。随着未来去产能和去杠杆深化,守住货币市场利率是守住流动性风险的底线。人民币兑美元汇率贬值有限,资本流出压力可控。货币市场利率有望保持低位稳定。

本基金将坚持作为交易所资金流动性管理工具的定位,继续保持投资组合良好的流动性和较短的组合期限。未来一段时间,继续以存款为主要投资工具,低配短期融资券。

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 | 2,977,330,603.42 | 38.27 |
| | 其中:债券 | 2,977,330,603.42 | 38.27 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,872,104,128.15 | 24.06 |
| | 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 | 2,905,362,314.54 | 37.34 |
| 4 | 其他各项资产 | 25,148,481.09 | 0.32 |
| 5 | 合计 | 7,779,945,527.20 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 7.03 |
| | 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 | - | - |
| | 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20%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20%。

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本报告期

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 58 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 119 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 50 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120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 | 61.81 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 13.72 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 4.48 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 6.31 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 13.39 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.71 | - |

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 | 390,509,919.59 | 5.02 |
| | 其中:政策性金融债 | 390,509,919.59 | 5.02 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,151,665,537.78 | 14.81 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,435,155,146.05 | 18.45 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,977,330,603.42 | 38.28 |
| 10 | 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 | 111513085 | 15浙商CD085 | 3,000,000 | 298,584,867.88 | 3.84 |
| 2 | 111593456 | 15包商银行CD037 | 2,000,000 | 199,470,093.49 | 2.56 |
| 3 | 111592681 | 15福建海峡银行CD025 | 1,600,000 | 159,221,033.88 | 2.05 |
| 4 | 111590044 | 15杭州银行CD012 | 1,500,000 | 149,754,349.36 | 1.93 |
| 5 | 150413 | 15农发13 | 1,200,000 | 120,092,886.45 | 1.54 |
| 6 | 111591133 | 15南京银行CD075 | 1,100,000 | 109,892,154.66 | 1.41 |
| 7 | 111519030 | 15恒丰银行CD030 | 1,000,000 | 99,925,730.91 | 1.28 |
| 8 | 111590073 | 15杭州银行CD018 | 1,000,000 | 99,766,744.78 | 1.28 |
| 9 | 111510312 | 15兴业CD312 | 1,000,000 | 99,388,310.87 | 1.28 |
| 10 | 111519049 | 15恒丰银行CD049 | 1,000,000 | 99,341,599.81 | 1.28 |

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 | 0次 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.09% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.01% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.04% |

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100.00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 | - |
| 3 | 应收利息 | 25,148,481.09 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 25,148,481.09 |

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

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 14,767,211.23 |
| 报告期基金总申购份额 | 86,644,007.37 |
| 报告期基金总赎回份额 | 23,639,910.13 |
| 报告期基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 77,771,308.47 |

§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"做投资价值的发现者"。截至2015年12月31日,博时基金公司共管理八十五只开放式基金,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。资产管理净值总规模逾3980亿元人民币,其中公募基金资产规模约2054亿元人民币,累计分红约677亿元人民币,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,截至12月31日,指数股票型基金中,博时深证基本面200ETF及深证基本面200ETF联接,今年以来净值增长率在同类型分别排名前1/2和1/3;偏股型的混合基金里,博时创业成长混合及博时卓越品牌混合,今年以来净值增长率在同类型基金中分别排名前1/4和1/3;灵活配置型的混合基金里,裕隆灵活配置混合今年以来净值增长率在101只同类型中排名前1/2;灵活策略混合基金里,博时裕益及博时回报,在39只同类基金分别排名前1/5和1/3。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来净值增长率在19只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一;在长期标准债券型基金中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来净值增长率在同类排名前1/7,安心A类排名前1/6,博时信用债纯债A及博时优势收益信用债,在70只同类中排名前1/2;中短期标准债券基金A类里,博时安盈债券A在同类排名第二;普通债券型基金里,博时稳定价值债券A类在同类85只排名前1/9,博时稳定价值债券B类在50只同类排名前10%;可转换债券型基金A类和指数债券型基金A类里,博时转债增强债券A及博时上证企债30ETF在同类基金中排名前1/2;货币市场基金中,博时现金宝货币A在同类146只排名前1/3。

2、其他大事件

2015年12月18日,由东方财富网主办的2015年东方财富风云榜活动在深举行,博时基金荣获"2015年度最优QDII产品基金公司奖"。

2015年12月17日,由华夏日报主办第九届机构投资者年会暨金蝉奖颁奖盛典,博时基金荣获"2015年度最具互联网创新基金公司"。

2015年12月16日,由北京商报主办的2015北京金融论坛,博时基金荣获"品牌推广卓越奖"。

2015年12月11日,由第一财经日报主办的2015金融价值榜典礼在北京金融街威斯汀酒店举行,博时基金荣获"最佳财富管理金融机构"大奖。

2015年12月11日,由21世纪经济报道主办的2015亚洲资本年会在深圳洲际酒店举行,博时基金获评"2015最受尊敬基金公司"、张光华董事长获评"2015中国赢基金任务奖"。

2015年12月4日,由经济观察报主办的2014-2015年度中国卓越金融奖颁奖典礼在北京举行,博时基金凭借旗下固定收益类的出色表现,独家获评"年度卓越固定收益投资团队奖"。

2015年11月26日,由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的CFAC中国金融年会在深召开,博时基金荣获"年度最佳基金公司"大奖。

2015年11月20日,第十一届中国证券市场年会,博时基金获评"年度卓越贡献龙鼎奖"。

2015年11月7日,由每日经济新闻主办的第四届中国上市公司领袖峰会在成都香格里拉举行,博时资本荣获"最具成长性子公司"。

§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保证金实时交易型货币市场基金设立的文件

9.1.2《博时保证金实时交易型货币市场基金基金合同》

9.1.3《博时保证金实时交易型货币市场基金托管协议》

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报告期内博时保证金实时交易型货币市场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**
**二〇一六年一月二十日**

# 博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015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:中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一六年一月二十日**

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 博时标普500ETF |
| 场内简称 | 标普500 |
| 基金主代码 | 513500 |
| 交易代码 | 513500 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式指数基金 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 167,819,285.00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 | 本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。<br>同时,为了更好地实现本基金的投资目标,本基金可适当借出证券。<br>为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差,本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货,以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。 |
| 业绩比较基准