博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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	博时招财一号保本
基金主代码	001238
交易代码	001238
基金运作方式	契约型定期开放
基金合同生效日	2015年4月29日
报告期末基金份额总额	1,353,010,620.65份
投资目标	在保障保本周期到期时本金安全的前提下,严格控制风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的基本面研究分析与积极主动的投资风格相结合,利用组合保险技术,动态调整固定收益类资产与风险资产的投资比例,以确保基金在保本周期到期时,实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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	5,034,129.87
2.本期利润	13,724,781.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0101
4.期末基金资产净值	1,336,326,870.94
5.期末基金份额净值	0.988

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。

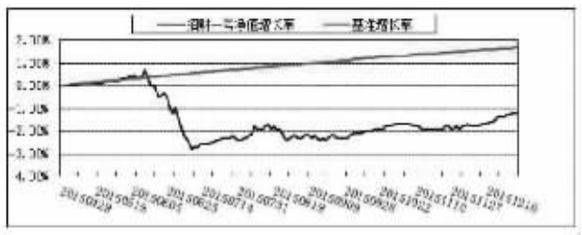
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	1.02%	0.06%	0.55%	0.01%	0.47%	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



注:本基金的基金合同于2015年4月29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六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条"(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		
沙炜	基金经理	2015-08-04	-	7	2008年从中国科学院硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、资深研究员、基金经理助理、研究部副经理。现任博时经路主题股票基金兼博时招财一号保本基金的基金经理。
杨永光	固定收益总部公募基金组投资副总监/基金经理	2015-04-29	-	13.5	1993年至1997年先后在桂林电器科学研究所、深圳迈瑞生物医疗电子股份公司工作。2001年起在国海证券历任债券研究员、债券投资经理助理、高级投资经理、投资主办人。2011年加入博时基金管理有限公司,曾任博时稳定价值债券基金的基金经理。现任固定收益总部公募基金组投资副总监兼博时天颐债券基金、上证企债30ETF基金、博时优势收益信用债债券基金、博时招财一号保本基金、博时新机遇混合基金、博时境源保本基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2015-04-29	-	5	2003年至2010年在曼星中国研究中心工作。2010年加入博时基金管理有限公司,历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金经理。现任博时深证基本面200ETF基金兼博时深证基本面200ETF联接基金、上证企债30ETF基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据100基金、博时沪深300指数基金、博时证券投资指数分级基金、博时黄金ETF基金、博时上证50ETF基金、博时上证50ETF联接基金、博时银行分级基金的基金经理。

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,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,A股市场风险偏好出现上升,市场整体出现上涨。本基金出于严控风险考虑,总体保持低股票仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为0.988元,累计份额净值为0.988元,报告期内净值增长率为1.02%,同期业绩基准涨幅为0.55%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济情况仍然低迷,预计2016年政府将保持积极的财政和货币政策,市场整体风险不大。另一方面,A股市场经过四季度反弹后估值吸引力下降,随着前期政市政策逐步退出,预计一季度市场波动将加大。由于目前基金净值仍在面值以下,近期本基金将保持较低股票仓位以严格控制风险,通过精选个股和积极参与新股申购来积累安全垫。

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	29,154,799.97	1.91
	其中:股票	29,154,799.97	1.91
2	固定收益投资	1,006,786,400.00	66.00
	其中:债券	1,006,786,400.00	66.00
	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	150,000,545.00	9.83
	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	145,009,070.86	9.51
7	其他各项资产	194,535,560.22	12.75
8	合计	1,525,486,376.05	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	21,228,646.34	1.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	807,192.00	0.06
F	批发和零售业	222,304.44	0.02
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	6,787,264.98	0.51
J	金融业	-	-
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	109,392.21	0.01
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	-	-
	合计	29,154,799.97	2.18

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	300363	博腾股份	451,400	12,246,482.00	0.92
2	002643	万润股份	98,400	3,988,152.00	0.30
3	300061	康耐特	157,800	3,943,422.00	0.30
4	002368	太极股份	55,600	3,730,760.00	0.28
5	300150	世纪瑞尔	110,700	1,605,150.00	0.12
6	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.07
7	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.06
8	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.02
9	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.02
10	300497	富祥股份	5,523	237,654.69	0.02

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	262,254,400.00	19.63
5	企业短期融资券	713,275,000.00	53.38
6	中期票据	31,257,000.00	2.34
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,006,786,400.00	75.34

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	041558065	15津铁投CP001	1,100,000	110,638,000.00	8.28
2	041559053	15京机电CP002	800,000	80,400,000.00	6.02
3	122372	14财通债	700,000	72,618,000.00	5.43
4	122375	14苏新债	620,000	62,012,400.00	4.64
5	122394	15中银债	600,000	60,588,000.00	4.53

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,本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券(600030)外,没有出现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、处罚的情形。
中信证券股份有限公司2015年1月18日发布公告称,因存在违规为到期融资融券合约展期问题,公司被中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。
中信证券于2015年11月29日发布公告称,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按照规定与客户签订业务合同"规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。
对该股票投资决策程序的说明:
根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。
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	324,554.51
2	应收证券清算款	180,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	14,211,005.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	194,535,560.22

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

本报告期期初基金份额总额	1,353,010,620.65
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,353,010,620.65

§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"敬投资价值的发现者"。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招财一号大数据保本混合型证券投资基金设立的文件
9.1.2《博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金基金合同》
9.1.3《博时招财一号大数据保本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 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
二〇一六年一月二十日

博时转债增强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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大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	博时转债增强债券
基金主代码	050019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月24日
报告期末基金份额总额	225,290,346.35份
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置,并充分利用可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,实施对大类资产的配置,在控制风险并保持良好流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本产品的类属资产配置策略主要通过自上而下的宏观分析,结合量化的经济指标综合判断经济周期的运行方向,决定类属资产的投资比例,分析的内容包括:影响经济中长期运行的变量,如经济增长模式、中长期经济增长动力;影响宏观经济的周期性变量,如宏观政策、货币供应、CPI等;市场自身的指标,如可转债的转股溢价率和隐含波动率等、股票的估值指标、债券市场的信用利差、期限利差、远期利率等。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,债券型基金的风险高于货币市场基金,低于混合型和股票型基金,属于中低收益风险的品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	博时转债增强债券A类 / 博时转债增强债券C类
下属分级基金的交易代码	050019 / 050119
报告期末下属分级基金的份额总额	97,607,750.37份 / 127,682,595.98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)	
	博时转债增强债券A类	博时转债增强债券C类
1.本期已实现收益	-1,238,857.59	-1,705,059.68
2.本期利润	13,419,930.13	17,325,561.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.1353	0.1325
4.期末基金资产净值	160,066,782.55	207,561,429.20
5.期末基金份额净值	1.640	1.626

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,计入费用后投资人的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、博时转债增强债券A类:

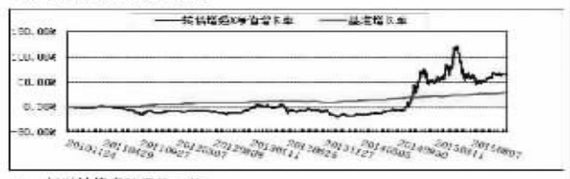
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.04%	0.87%	2.41%	0.06%	6.63%	0.81%

2、博时转债增强债券C类:

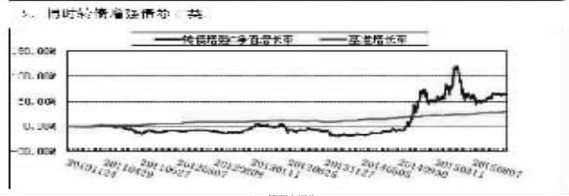
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.98%	0.87%	2.41%	0.06%	6.57%	0.81%

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、博时转债增强债券A类:



2、博时转债增强债券C类:



§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		
邓欣雨	基金经理	2013-09-25	-	7	2008年硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理助理。现任博时转债增强债券基金兼博时双债增强债券基金的基金经理。

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4季度,股市和债市都有不错的收益,中债总财富指数上涨3%左右,沪深300指数也上涨17%左右,创业板指数更是反弹上涨30%多。随着3季度配资清理基本完成和汇率在季度初的企稳等,股市短期负面因素基本消除,市场出现了一波修复行情,但增量资金入市并不明显。债市走势有所超预期,长久期利率债表现突出,而低等级信用债明显较差,不过这与我们所强调的一致,即信用风险值得重视,相对而言长端利率债的性价比更突出,虽然可转债市场估值较高,但考虑到触发性和正股的上涨,可转债指数仍有5%以上的回报,本组合在维持偏慎的情况下适当参与了市场机会,相对重仓投资了估值相对合理的个券。

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1.640元,份额累计净值为1.645元;C类基金份额净值为1.626元,份额累计净值为1.630元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为9.04%,C类基金份额净值增长率为8.98%,同期业绩基准增长率2.41%。

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2016年1季度,认为经济基本面下行压力仍存,企业盈利情况仍不乐观,维持低利率环境显得较为重要,考虑到美国加息的开启,从预期看人民币汇率仍有贬值压力,这对国内资产有一定的负面压力,不过从政府的管控能力看,特别是经历2015年8月份后的情况看,预期汇率会相对平稳,不必因汇率而产生恐慌。从前期债市走势情况看,当前市场的资金配置压力仍在,映射市场仍缺乏合适的低风险较高回报的资产,一季度债券利率可能将维持低位,这也一定程度上有利于股市,特别是基本面好且估值不高的公司。整体来看,1季度股市有一定期待,但存量可转债估值仍不低,前期赚钱性逻辑也不再成立,价值有所缺乏,接下来需要从新上市个券和调整合适后的存量个券中寻找机会。

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	69,491,679.04	12.21
	其中:股票	69,491,679.04	12.21
2	固定收益投资	405,384,392.90	71.24
	其中:债券	405,384,392.90	71.24
	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	18,105,499.43	3.18
7	其他各项资产	76,047,409.57	13.36
8	合计	569,028,980.94	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

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	31,936,466.96	8.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,685.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
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	5,767,625.08	1.57
J	金融业	12,313,800.00	3.35
K	房地产业	11,181,502.00	3.04
L	租赁和商务服务业	4,713,600.00	1.28
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	3,560,000.00	0.97
S	综合	-	-
	合计	69,491,679.04	18.90

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	603308	应流股份	399,953	12,526,527.96	3.41
2	601989	中国重工	880,000	8,272,000.00	2.25
3	002049	同方国芯	104,950	6,634,939.00	1.80
4	601318	中国平安	180,800	6,508,800.00	1.77
5	000040	宝安地产	421,400	6,291,502.00	1.71
6	600030	中信证券	300,000	5,805,000.00	1.58
7	600654	中安消	199,987	5,767,625.08	1.57
8	600325	华发股份	300,000	4,890,000.00	1.33
9	300058	蓝色光标	320,000	4,713,600.00	1.28
10	600893	中航动力	100,000	4,503,000.00	1.22

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,093,000.00	8.19
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	375,291,392.90	102.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	405,384,392.90	110.27

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	126018	08江铜债	1,537,990	151,999,551.70	41.35
2	132001	14宝钢EB	651,930	100,892,686.80	27.44
3	113008	电气转债	520,450	71,650,351.50	19.49
4	011517012	15华电SCP012	300,000	30,093,000.00	8.19
5	128009	歌尔转债	131,490	18,470,400.30	5.02

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本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券(600030)外,没有出现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、处罚的情形。
中信证券股份有限公司2015年1月18日发布公告称,因存在违规为到期融资融券合约展期问题,公司被中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。
中信证券于2015年11月29日发布公告称,因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条"未按照规定与客户签订业务合同"规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。
对该股票投资决策程序的说明:
根据我司的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。
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	196,552.92
2	应收证券清算款	74,976,158.10
3	应收股利	-
4	应收利息	805,891.10
5	应收申购款	68,807.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,047,409.57

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	132001	14宝钢EB	100,892,686.80	27.44
2	113008	电气转债	71,650,351.50	19.49
3	128009	歌尔转债	18,470,400.30	5.02
4	110030	格力转债	8,942,483.80	2.43

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	002049	同方国芯	6,634,939.00	1.80	公告重大事项
2	600654	中安消	5,767,625.08	1.57	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	99,207,377.71
报告期基金总申购份额	9,510,048.29
减:报告期基金总赎回份额	11,109,675.63
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	97,607,750.37

§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"敬投资价值的发现者"。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