博时月月盈短期理财债券型证券投资基金

【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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21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。

本基金第一期运作期为2014年9月22日至2014年10月20日。根据基金合同约定,基于对下一运作期的投资市场环境的判断,基金管理人决定本基金第一期运作期到期后暂停下一运作期运作、不接受集中申购。截至本报告期末,本基金资产负债均已清算。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时月月盈短期理财债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月22日
报告期末基金份额总额	-份
投资目标	在谨慎投资的前提下,追求稳健的当期收益。
投资策略	本基金坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下,采用期限匹配、持有到期策略构建投资组合,基本保持大类品种配置的比例恒定。在运作期,根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例,主要采取期限匹配、持有到期的投资策略。
业绩比较基准	运作期起始日前的Shibor-1M五日平均值。
风险收益特征	本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、预期收益较为稳定的品种,其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和普通债券基金,高于货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	博时月月盈短期理财债券A / 博时月月盈短期理财债券R
下属分级基金的交易代码	000783 / 000784
报告期末下属分级基金的份额总额	-份 / -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(2014年10月1日-2014年12月31日)	
	博时月月盈短期理财债券A	博时月月盈短期理财债券R
1. 本期已实现收益	114,310.41	526,420.66
2. 本期利润	114,310.41	526,420.66
3. 期末基金资产净值	-	-

注:本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

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

1、博时月月盈短期理财债券A:

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	0.2255%	0.0022%	0.2254%	0.0000%	0.0001%	0.0022%

注:本表统计期间为2014年10月1日至2014年10月20日;第一期运作期(2014年9月22日至2014年10月20日)博时月月盈短期理财债券A净值收益率为0.3203%,净值收益率标准差为0.0026%;业绩比较基准收益率为0.3269%,业绩比较基准收益率标准差为0.0000%。

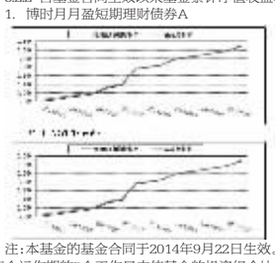
2、博时月月盈短期理财债券R:

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	0.2255%	0.0022%	0.2254%	0.0000%	0.0001%	0.0022%

注:本表统计期间为2014年10月1日至2014年10月20日;第一期运作期(2014年9月22日至2014年10月20日)博时月月盈短期理财债券B净值收益率为0.3203%,净值收益率标准差为0.0026%;业绩比较基准收益率为0.3269%,业绩比较基准收益率标准差为0.0000%。

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

1. 博时月月盈短期理财债券A



注:本基金的基金合同于2014年9月22日生效。按照基金合同规定,本基金已自基金合同生效之日起每个运作期的5个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分投资范围的有关规定。

§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		
张勇	基金经理/固定收益总部现金管理组投资总监	2014-9-22	-	10.5	2001年起先后在南京市商业银行任信贷员、债券交易员。2003年加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理。现任固定收益总部现金管理组投资总监兼博时现金收益证券投资基金、博时策略灵活配置混合型证券投资基金、博时安盈债券型证券投资基金、博时宏观回报债券型证券投资基金、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、博时保证金实时交易型货币市场基金的基金经理。
魏棪	基金经理	2014-9-22	-	6	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年7月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。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、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、《博时月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第四季度,货币市场流动性前松后紧,从11月下旬新股扰动开始,一直延续到年底,资金面总体偏紧。银行间R001均值2.66%(-37BP),R007均值3.46%(-13BP)。 现券市场先扬后抑,收益率曲线扁平化上移, 短端由于年末资金趋紧出现倒挂, 信用利差有所扩大。1年期短融收益率分别为4.86%(AAA)、5.48%(AA+)、5.87%(AA)。

四季度,本基金只运作一期,即2014-9-22至2014-10-20,本基金大类资产配置全为存款类资产,该运作期内本基金回报率0.32%,同期业绩基准回报率0.33%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金第一期运作期为2014年9月22日至2014年10月20日。在第一期运作期内,本基金A类份额的净值收益率为0.3203%, B类份额净值收益率为0.3203%,业绩比较基准收益率为 0.3269%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

期限利差较为平坦反映的是短期利率不断下降的预期,年后随着财政资金的大幅投放和短期因素的消失,资金面的边际改善可期。我们认为,货币政策基调并未改变,改变的仅仅是市场的预期。利率市场化推进中,货币政策灵活性加大。央行"弹性利率走廊+中期政策利率"的调控方式将延续,货币市场波动性将维持低位。展望2015年一季度,政策宽松预期将有所修复,全面降准的可能性正在显著上升,资金面缓解的格局很可能延续到春节之前。受此影响,利率债收益率将率先下行,而期限利差将会首先修复。受中登事件和地方债务甄别影响,信用利差的修复可能相对滞后。重点关注流动性压力缓解后的估值修复,收益率曲线短端的机会较为明显。

本基金将坚持作为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,将择机开放运作,为投资者提供特色理财服务。

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

本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	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40%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40%。

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基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	-
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	12
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	3

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过180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

本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

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

本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

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	-
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	-

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

本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

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1.00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

本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

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

项目	博时月月盈短期理财债券A	博时月月盈短期理财债券R
报告期期初基金份额总额	50,701,763.77	233,491,005.68
报告期期间基金总申购份额	114,310.41	526,420.66
减:报告期期间基金总赎回份额	50,816,074.18	234,017,426.34
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	-	-

注:根据基金合同约定,基于对下一运作期的投资市场环境的判断,基金管理人决定本基金第一期运作期到期后暂停下一运作期运作、不接受集中申购。本基金管理人在运作期赎回日(2014年10月20日)自动为各类基金份额持有人发起全部赎回申请。

§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2014年12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,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。

1、基金业绩

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只产品中排名前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贰号混合在同类29只产品中排名前1/2;博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类) 今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类) 今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2、客户服务

2014年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动219场,参加人数6102人。

3、其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜"2014年度最佳中资基金公司奖";

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的"最佳品牌奖"。

§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月月盈短期理财债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时月月盈短期理财债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时月月盈短期理财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报告期内博时月月盈短期理财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
2015年1月21日

博时主题行业股票证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时主题行业股票(LOF)
场内简称	博时主题
基金主代码	160505
交易代码	160505
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2005年1月6日
报告期末基金份额总额	4,869,036,966.85份
投资目标	分享中国城市化、工业化及消费升级进程中经济与资本市场的高速成长,谋求基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金采取价值策略指导下的行业增强型主动投资策略
业绩比较基准	80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金是一只主动型的股票基金,基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下,谋求实现基金资产的长期稳定增长。
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(2014年10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	884,540,583.52
2.本期利润	3,982,091,814.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.7595
4.期末基金资产净值	13,388,817,935.37
5.期末基金份额净值	2.750

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)和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。

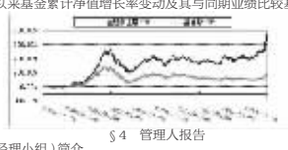
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	39.10%	1.61%	27.20%	1.22%	11.90%	0.39%

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		
邓晓峰	基金经理/权益投资总部董事总经理/股票投资部总经理/价值组投资总监	2007-3-14	2014-12-26	13	1996年起先后在深圳市银业工贸有限公司、国泰君安证券工作。2005年加入博时基金管理有限公司,历任基金经理助理、特定资产管理部副总经理、股票投资部价值组投资副总监、权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理、股票投资部价值组投资总监、博时主题行业股票(LOF)基金基金经理、社保组合投资经理。
蔡滨	研究部副总经理/基金经理	2014-12-26	-	7.5	2001年起先后在上海振华港机、美国总统轮船(中国)有限公司、美国管理协会、平安证券工作。2009年加入博时基金管理有限公司,曾任研究部研究员。现任研究部副总经理兼资本品组组长、博时主题行业股票(LOF)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、《博时主题行业股票证券投资基金基金合同》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,本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的情况,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报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年4季度增量资金入市的力度超过我们此前的预期。低估值蓝筹股得到了增量资金的青睐,这使得组合在4季度取得了较好的收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为2.750元,份额累计净值为4.641元,报告期内净值增长率为39.10%,同期业绩基准涨幅为27.20%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为央行适度宽松的货币政策操作和居民投资资产向权益市场配置的趋势将得以延续;2015年积极财政政策的实施以及大宗商品价格的下降使得企业盈利得到支撑;因此我们看好2015年1季度股票市场的表现。短期资金快速流入股市的势头得以缓和,预计市场将保持震荡。

低估值的优质蓝筹股依然是本基金的首选。保险、银行、汽车、电力和家电等行业的龙头公司的估值依然非常具备吸引力。尤其是保险行业,良好的2014年业绩和值得期待的2015年"开门红"销售将驱动保险股获得良好表现的概率较大。

对于2014年表现落后的医药和新兴行业,我们将加大挖掘力度,寻找那些盈利追上估值的公司,着手布局"被低估的增长"。

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	12,136,578,382.30	86.67
	其中:股票	12,136,578,382.30	86.67
2	固定收益投资	404,516,114.49	2.89
	其中:债券	404,516,114.49	2.89
	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	605,901,228.85	4.33
	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	597,352,495.59	4.27
7	其他资产	258,534,548.97	1.85
8	合计	14,002,882,770.20	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	69,850,952.00	0.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,389,773,657.10	32.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,377,252,579.84	10.29
E	建筑业	69,160,000.00	0.52
F	批发和零售业	59,940,443.85	0.45
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	43,171,571.29	0.32
J	金融业	4,983,732,644.58	37.22
K	房地产业	1,113,669,899.20	8.32
L	租赁和商务服务业	8,933,724.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,921,769.36	0.01
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	19,171,141.08	0.14
S	综合	-	-
	合计	12,136,578,382.30	90.65

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	601318	中国平安	17,000,000	1,270,070,000.00	9.49
2	601601	中国太保	39,000,001	1,259,700,032.30	9.41
3	600886	国投电力	104,000,000	1,189,760,000.00	8.89
4	000002	万 科A	72,000,000	1,000,800,000.00	7.47
5	000333	美的集团	28,000,000	768,320,000.00	5.74
6	600036	招商银行	38,500,000	638,715,000.00	4.77
7	000001	平安银行	38,300,000	606,672,000.00	4.53
8	601633	长城汽车	14,499,910	602,471,260.50	4.50
9	000858	五 粮 液	28,000,000	602,000,000.00	4.50
10	600030	中信证券	15,799,912	535,617,016.80	4.00

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	400,520,000.00	2.99
	其中:政策性金融债	400,520,000.00	2.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,996,114.49	0.03
8	其他	-	-
9	合计	404,516,114.49	3.02

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	140212	14国开12	4,000,000	400,520,000.00	2.99
2	113007	吉视转债	18,700	2,333,199.00	0.02
3	128006	长青转债	12,704	1,662,915.49	0.01

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,297,793.03
2	应收证券清算款	171,566,400.79
3	应收股利	-
4	应收利息	12,043,829.09
5	应收申购款	73,626,526.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,534,548.97

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	128006	长青转债	1,662,915.49	0.01

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

报告期期初基金份额总额	5,454,399,651.03
报告期期间基金总申购份额	905,744,748.59
减:报告期期间基金总赎回份额	1,491,107,432.77
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	4,869,036,966.85

§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2014年12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,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。

1、基金业绩

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只产品中排名前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贰号混合在同类29只产品中排名前1/2;博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类) 今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类) 今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2、客户服务

2014年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动219场,参加人数6102人。

3、其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜"2014年度最佳中资基金公司奖";

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的"最佳品牌奖"。

§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主题行业股票证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时主题行业股票证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时主题行业股票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 博时主题行业股票证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时主题行业股票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
2015年1月21日

博时转债增强债券型证券投资基金

【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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21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2014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	1,298,476,484.21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	435,555,821.89份 / 862,920,662.32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(2014年10月1日-2014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	80,828,273.74	116,101,512.29
2.本期利润	289,449,381.48	376,523,100.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.6561	0.7895
4.期末基金资产净值	708,447,540.82	1,392,409,283.40
5.期末基金份额净值	1.627	1.614

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