博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:二〇一六年三月二十六日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时亚洲票息收益债券(QDII)
基金主代码	050030
交易代码	050030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月1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
报告期末基金份额总额	1,206,292,035.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,寻找各类债券的投资机会,在谨慎投资的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	主要投资于亚洲市场的各类债券,以买入持有策略为主,配合信用策略、期限结构策略、互换策略等卫星策略。在谨慎投资的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return
风险收益特征	中等风险/收益的开放式基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	BROWN BROTHERS HARRIMAN
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行

注:本基金未聘请境外投资顾问。

2.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年
本期已实现收益	56,778,211.70	30,485,928.99
本期利润	123,575,743.41	23,926,481.81
加权平均基金份额本期利润	0.1389	0.0334
本期基金份额净值增长率	13.37%	6.01%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0917	0.0692
期末基金资产净值	1,414,655,746.15	947,607,533.30
期末基金份额净值	1.1727	1.0765

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 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

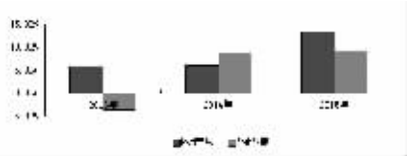
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.33%	0.22%	3.43%	0.21%	1.90%	0.01%
过去六个月	8.54%	0.35%	7.05%	0.32%	1.49%	0.03%
过去一年	13.37%	0.30%	9.10%	0.26%	4.27%	0.04%
自基金合同生效起至今	27.01%	0.24%	14.18%	0.25%	12.83%	-0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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2013年2月1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12条"三、投资范围"、"五、投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金2013年实际运作期间为2013年2月1日(基金合同生效日)至2013年12月31日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.416	34,412,021.42	1,722,968.15	36,134,979.57	-
2014	0.234	26,079,120.38	840,239.42	26,919,359.80	-
2013	0.175	25,710,585.66	459,352.19	26,169,937.85	-
合计	0.825	86,201,727.46	3,022,549.76	89,224,277.22	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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"。

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"。

2015年4月22日,在由上海证券报社主办的第十二届中国"金基金"奖的评选中,博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得金基金·5年期股票型金基金奖。

2015年4月17日,在由证券时报社主办,晨星资讯、上海证券和济安金信提供评奖支持的2014年度"中国基金业明星基金奖"评选中,博时基金旗下博时主题行业与博时信用债分别获得五年持续回报股票型明星基金奖、2014年度积极债券型明星基金奖。

2015年3月28日,在第十二届中国基金业金牛奖评选中,博时基金旗下博时主题行业(LOF)基金、博时信用债券基金分别获得"2014年度开放式股票型金牛基金"奖、"三年期开放式债券型持续优胜金牛基金"奖。

2015年1月21日,在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中,博时转债增强荣获第八届金蝉奖"2014最佳年度债基品牌奖"。

2015年1月18日,博时基金(香港)在和讯财经风云榜海外评选中荣获"最佳中资基金公司"奖。

2015年1月15日,在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中,博时基金获评第十二届中国财经风云榜"年度十大品牌基金公司"奖。

2015年1月11日,在和讯网主办的2013年第十一届财经风云榜基金行业评选中,博时基金荣获"2013年度基金业最佳投资者关系奖"。

2015年1月7日,博时基金在2014年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何凯	基金经理/固定收益总部国际组投资总监	2014-04-02	-	9	2006年起先后在荷兰银行(伦敦),中国投资有限责任公司、南方东英资产管理有限公司从事投资研究工作。2012年加入博时基金管理有限公司,历任国际投资部副总经理、基金经理助理、固定收益总部国际组投资副总监。现任固定收益总部国际组投资总监兼博时亚洲票息收益债券型证券投资基金的基金经理。

注:上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、基金合同和其他相关法律法规的规定,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,在严格控制风险的基础上,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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程,按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.4.2 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《公平交易管理制度》的规定,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,美国国债利率在经历宽幅震荡以及年末美联储加息落地后全年收涨,对亚洲债券市场总体而言形成负面影响;而中国因素则成为驱动市场的主导力量之一:年初佳兆业事件及8月份人民币的贬值都对市场造成了冲击,但中资债券在估值优势、基本面及技术面等多重因素的支撑下,随之又迅速恢复,全年表现突出,与其他新兴市场债券的疲弱表现形成鲜明对比,其中地产债券的表现尤为突出。

全年来看,继2014年之后,亚洲信用市场不同区块的表现基本又是对前一年的反转:按照国家划分,中国表现较好,而印度、印尼等表现较弱;按评级划分,高收益债券表现好于投资级; 按类属划分,公司债表现好于主权债,均是因为前者收益率更高且利率敏感性更低。

在基金的操作上,我们整体维持了高收益、短久期的策略,超配中国,超配地产,并适时捕捉了市场的重要转折点所带来的一些交易性机会。全年基金业绩大幅跑赢基准。

4.5.2 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1.1722元,累计份额净值为1.2547元,报告期内净值上涨13.32%,同期业绩基准上涨幅度为9.10%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为美联储加息进程将是缓慢可控的,且欧洲、日本等发达经济体货币政策总体仍然宽松。在此环境下,资金对于收益的追逐或仍将利好部分基本面有支撑的新兴市场。中国宏观政策的持续放松也会对债券市场形成支持。我们继续维持中资海外债券特别是地产债券在估值优势、基本面以及技术面的改善下未来有较大概率跑赢市场的判断。但对过程中可能存在的个券风险会严格把控,并对外部市场的波动保持密切关注。本基金将在稳定票息和信用质量的基础上积极把握配置机会和寻求交易性机会,力争创造超额收益。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,在完善内部控制制度和流程手册的同时,推动内控体系和制度措施的落实;强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察,通过实时监控、定期检查、专项检查等方式,及时发现情况,提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查,发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告,定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2015年,我公司根据法律、法规的规定,制定、修订和完善了《博时基金融资融券及转融通投资管理制度》、《博时基金管理有限公司产品委员会制度》、《投资决策委员会制度》、《风险管理委员会制度》、《债券型基金股票投资管理流程》、《股票池管理办法》、《债券池管理办法》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》,以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善"博时客户关系管理系统"、"博时投资决策支持系统"等管理平台,加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中,严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料,选择有代销资格的代销机构销售基金,并努力做好投资者教育工作。

4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定, 确保基金资产估值的公平、合理, 有效维护投资人的利益, 设立了博时基金管理有限公司估值委员会 (以下简称 "估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于截至该次收益分配基准日基金可供分配利润的60%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算,期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。选择现金分红方式的外币基金份额获得的现金红利为相应币种的外币,其每份额分配金额根据人民币份额的每份额分配数额按照汇率进行折算,具体见招募说明书;基金合同生效不满三个月,收益可不分配。 基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日;

基金收益分配基准日的人民币份额基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值;对于外币份额,由于汇率因素影响,存在收益分配后外币份额基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能。

本基金管理人已于2015年1月12日发布公告,以2014年12月31日的可分配利润为基准,每10份基金份额派发红利0.416元。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况,报告期末本基金份额可分配收益为110,607,609.64元。

本基金管理人已于2016年1月13日发布公告,以2015年12月31日的可分配利润为基准,每10份基金份额派发红利0.600元。

4.10报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	154,412,788.44	80,968,717.94
结算备付金	-	750,000.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,233,476,567.73	804,192,940.32
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,233,476,567.73	804,192,940.32
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	45,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	23,882,213.50	17,246,959.26
应收股利	-	-
应收申购款	45,383,829.36	5,687,425.96
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,457,155,399.03	953,846,043.48
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	37,439,659.77	-
应付赎回款	3,717,624.60	5,288,384.45
应付管理人报酬	870,010.97	650,242.52
应付托管费	271,878.42	203,200.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	200,479.12	96,682.40
负债合计	42,499,652.88	6,238,510.18
所有者权益:	-	
实收基金	1,206,292,035.11	880,254,016.79
未分配利润	208,363,711.04	67,353,516.51
所有者权益合计	1,414,655,746.15	947,607,533.30
负债和所有者权益总计	1,457,155,399.03	953,846,043.48

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值为1.1727元,基金份额总额为1,206,292,035.11 份。

7.2 利润表

会计主体:博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	134,249,959.99	32,422,293.08
1.利息收入	73,617,290.07	59,339,531.62
其中:存款利息收入	84,090.88	253,439.06
债券利息收入	73,463,878.75	58,373,691.72
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	69,320.44	712,400.84
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-18,911,559.98	-28,499,222.00
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-819,081.34	-
债券投资收益	-18,399,018.21	-25,276,721.97
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-3,222,500.03
股利收益	306,539.57	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	66,797,531.71	-6,559,447.18
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	8,676,068.12	880,965.41
5.其他收入(损失以"-"号填列)	4,070,630.07	7,260,465.23
减:二、费用	10,674,216.58	8,495,811.27
1. 管理人报酬	7,750,337.18	6,100,932.12
2. 托管费	2,421,980.33	1,906,541.36
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	37,929.04	-
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	463,970.03	488,337.79
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	123,575,743.41	23,926,481.81
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	123,575,743.41	23,926,481.81

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时亚洲票息收益债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	880,254,016.79	67,353,516.51	947,607,533.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	123,575,743.41	123,575,743.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	326,038,018.32	53,569,430.69	379,607,449.01
其中:1.基金申购款	812,919,512.87	94,449,364.40	907,368,877.27
2.基金赎回款	-486,881,494.55	-40,879,933.71	-527,761,428.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-36,134,979.57	-36,134,979.57
五、期末所有者权益(基金净值)	1,206,292,035.11	208,363,711.04	1,414,655,746.15
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,195,915,301.54	46,520,611.24	1,242,435,912.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,926,481.81	23,926,481.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-315,661,284.75	23,825,783.26	-291,835,501.49
其中:1.基金申购款	706,345,436.05	60,283,128.52	766,628,564.57
2.基金赎回款	-1,022,006,720.80	-36,457,345.26	-1,058,464,066.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-26,919,359.80	-26,919,359.80
五、期末所有者权益(基金净值)	880,254,016.79	67,353,516.51	947,607,533.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:江向阳 主管会计工作的负责人:王德英 会计机构负责人:成江

7.4 报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的债券利息收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司("博时基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
招商证券股份有限公司("招商证券")	基金管理人的股东
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司

注:

1.于2015年7月16日,根据基金管理人发布的《博时基金管理有限公司关于股权变更及修改<公司章程>的公告》,并经中国证券监督管理委员会核准(证监许可[2015]812号),博时基金原股东瑞安股权投资有限公司将所持本公司12%股权转让给博时基金现股东上海汇华实业有限公司。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,750,337.18	6,100,932.12
其中:支付销售机构的客户维护费	3,385,599.75	2,692,130.93

注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.8%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.8% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,421,980.33	1,906,541.36

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值× 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3与关联方进行柜台交易市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	74,136,065.88	79,355.15	22,271,508.21	142,001.87
布朗兄弟哈里曼银行	80,276,722.56	-	58,697,209.73	-

注:本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管,其中由招商银行保管的银行存款按适用利率计息,由布朗兄弟哈里曼银行保管的银行存款不计息。

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.5期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,233,476,567.73元,无属于第一层次和第三层次的余额。(2014年12月31日:属于第二层次的余额为804,192,940.32元,无属于第一层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,233,476,567.73	84.65
	其中:债券	1,233,476,567.73	84.65
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	154,412,788.44	10.60
8	其他各项资产	69,266,042.86	4.75
9	合计	1,457,155,399.03	100.00

8.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布本基金本报告期末未持有权益投资。

8.3期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末进行权益资产的投资。

8.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期末进行权益资产的投资。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期末进行权益资产的投资。

8.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
BBB-	38,826,013.63	2.74
BB+	56,782,733.24	4.01
BB	86,073,213.46	6.08
BB-	126,044,650.08	8.91
B+	254,418,755.79	17.98
B	267,718,224.06	18.92
B-	112,688,959.86	7.97
无评级	290,924,017.61	20.57

注:评级机构为标准普