

# 信息披露 Disclosure

## 博时主题行业股票证券投资基金

### 2014 第三季度报告

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:2014年10月27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2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等信息,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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

基金简称		博时主题行业股票(LOF)
场内简称		博时主题
基金代码		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		5,454,399,651.03份
投资目标		分享中国城市化、工业化及消费升级过程中经济与资本市场的高速增长,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

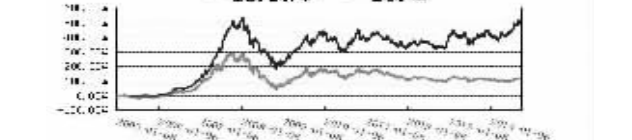
3.1 主要财务指标		§3 主要财务指标和基金净值表现
		单位:人民币元
主要财务指标		报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)
1.本期已实现收益		477,460,703.82
2.本期利润		1,306,688,245.71
3.加权平均基金份额本期利润		0.2388
4.期末基金份额净值		10.784,472,753.93
5.期末基金净值增长率		1.977

注:1.本期已实现收益指基金本期利润减去收入、投资收益、利息收入(不含公允价值变动收益)和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;

2.期末基金份额净值指基金资产净值除以基金总份额的公允价值,计入费用后投资人的实际收益水平可能低于所列数据。

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	13.95%	0.84%	11.59%	0.69%	2.36%	0.15%

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:本基金合同于2005年1月6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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时的资产配置比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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:2014年10月27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2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合信息,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。	
本报告财务资料未经审计。	
本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。	

基金简称		博时转债增强基金
场内简称		博时转债
基金代码		160609
交易代码		160609
基金合同生效日		2009年11月24日
报告期末基金份额总额		823,828,754.53份
投资目标		本基金通过投资于可转债市场,分享可转债市场长期增长带来的收益,谋求基金资产的长期稳定增长。
投资策略		本基金采取自上而下的资产配置策略,在可转债市场内部,本基金采取自下而上的资产配置策略,在可转债市场内部,本基金采取自下而上的资产配置策略。
业绩比较基准		中证转债指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%
风险收益特征		本基金属于债券型基金,其预期收益及风险水平高于货币型基金,债券基金与货币市场基金,属于低风险/低收益特征的开放式基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标

报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)

单位:人民币元

1.本期已实现收益	-7,271,914.66	博时转债增强债券基金	-7,281,426.54
2.本期利润	27,115,883.47		26,418,484.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0374		0.0545
4.期末基金份额净值	10.410,439,871.96		359,811,287.82
5.期末基金净值增长率	0.941		0.929

注:

1.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。

2.期末基金净值增长率与同期比较基准收益率的差额,为基金份额净值增长率偏离同期比较基准收益率的差额。

3.2.期末基金净值增长率与同期比较基准收益率的差额,为基金份额净值增长率偏离同期比较基准收益率的差额。

3.2 基金份额净值增长率及其与同期比较基准收益率的比较

1.博时转债增强债券基金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	6.93%	0.90%	1.50%	0.05%	5.43%	0.85%

2.博时转债增强债券基金C:

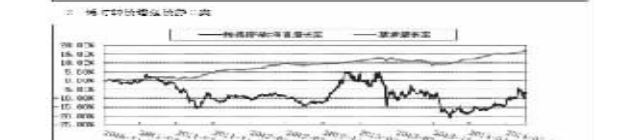
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.78%	0.89%	1.50%	0.05%	5.28%	0.84%

3.2 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	标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.93%	0.90%	1.50%	0.05%	5.43%	0.85%

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:本基金合同于2009年11月24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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时的资产配置比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。

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:2014年10月27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2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合信息,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。	
本报告财务资料未经审计。	
本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。	

基金简称		博时卓越品牌股票(LOF)
场内简称		博时卓越
基金代码		160512
交易代码		160512
基金运作方式		契约型上市开放式
基金合同生效日		2011年4月22日
报告期末基金份额总额		199,947,531.53份
投资目标		本基金主要通过投资于A股市场经过严格筛选的具有投资价值的品牌上市公司的股票,力争通过主动操作,获取长期稳定的资本增值和投资资本利得。
投资策略		在大类资产配置上,本基金强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的行业、公司分析和估值分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准		沪深300指数收益率×80%+中证金融债指数收益率×20%
风险收益特征		本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于高风险/高收益特征的开放式基金。
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

3.1 主要财务指标	单位:人民币元
3.3 主要财务指标和基金净值表现	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2014年7月1日~2014年9月30日)
1.本期已实现收益	15,755,234.30
2.本期利润	34,129,456.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.1859
4.期末基金资产净值	279,054,141.43
5.期末基金份额净值	1.396

注:某项已实现收益指基金本期利息收入、股利收入、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公允价值变动收益。

上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 本基金报告期内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	15.28%	0.72%	10.82%	0.72%	4.46%	0.00%

注:本基金成立于2011年12月23日,自成立之日起,本基金的投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金费率等要素均符合基金合同要求,基金指数自归日基准日(2014年10月20日)起调整为中证500指数,并用日连线的方式对基金净值增长率和业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金自2011年12月23日生效,本基金于2014年5月20日完成了基金份额的集中申购,按照本基金的基金合同规定,自集中申购期间(2014年5月20日至2014年5月23日)起,本基金的投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金费率等要素均符合基金合同要求,基金指数自归日基准日(2014年10月20日)起调整为中证500指数,并用日连线的方式对基金净值增长率和业绩比较基准收益率变动的比较

3.2 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	标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.28%	0.72%	10.82%	0.72%	4.46%	0.00%

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:本基金合同于2011年4月22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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时的资产配置比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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:2014年10月27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2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合信息,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。	
本报告财务资料未经审计。	
本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。	

基金简称		博时主题行业股票(LOF)
场内简称		博时主题
基金代码		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		5,454,399,651.03份
投资目标		分享中国城市化、工业化及消费升级过程中经济与资本市场的高速增长,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

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)	
1.本期已实现收益	477,460,703.82	
2.本期利润	1,306,688,245.71	
3.加权平均基金份额本期利润	0.2386	
4.期末基金份额净值	10.784,472,753.93	
5.期末基金净值增长率	1.977	

3.2 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	标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.95%	0.84%	11.59%	0.69%	2.36%	0.15%

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:本基金合同于2005年1月6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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时的资产配置比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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:2014年10月27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2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合信息,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。	
本报告财务资料未经审计。	
本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。	

基金简称		博时主题行业股票(LOF)
场内简称		博时主题
基金代码		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		5,454,399,651.03份
投资目标		分享中国城市化、工业化及消费升级过程中经济与资本市场的高速增长,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

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)	
1.本期已实现收益	477,460,703.82	
2.本期利润	1,306,688,245.71	
3.加权平均基金份额本期利润	0.2386	
4.期末基金份额净值	10.784,472,753.93	
5.期末基金净值增长率	1.977	

3.2 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	标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.95%	0.84%	11.59%	0.69%	2.36%	0.15%

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:本基金合同于2005年1月6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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时的资产配置比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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:2014年10月27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2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合信息,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。	
本报告财务资料未经审计。	
本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。	

基金简称		博时主题行业股票(LOF)
场内简称		博时主题
基金代码		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		5,454,399,651.03份
投资目标		分享中国城市化、工业化及消费升级过程中经济与资本市场的高速增长,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

3.1 主要财务指标		单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2014年7月1日—2014年9月30日)	
1.本期已实现收益	477,460,703.82	
2.本期利润	1,306,688,245.71	
3.加权平均基金份额本期利润	0.2386	
4.期末基金份额净值	10.784,472,753.93	
5.期末基金净值增长率	1.977	

3.2 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	标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.95%	0.84%	11.59%	0.69%	2.36%	0.15%

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:本基金合同于2005年1月6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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时的资产配置比例符合基金合同第十二条(一)“投资组合范围”、“(九)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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:2014年10月27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2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合信息,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	