博时平衡配置混合型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月20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2015年4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时平衡配置混合
基金主代码	050007
交易代码	050007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月31日
报告期末基金份额总额	1,217,985,976.92份
投资目标	本基金力争在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下,获取长期持续稳定的合理回报。
投资策略	本基金遵循经济周期波动规律,通过定性与定量分析,动态把握不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化,追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置。在严格控制投资风险的前提下,追求基金资产的长期持续稳定增长。
业绩比较基准	45%×富时中国A600指数+50%×中国债券总指数+5%×同业存款息率。
风险收益特征	本基金的预期风险低于股票基金,预期收益高于债券基金。本基金属于证券投资基金中的中等风险、中等收益品种。
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 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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	160,150,380.41
2.本期利润	122,649,432.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0913
4.期末基金资产净值	1,345,623,083.50
5.期末基金份额净值	1.105

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。

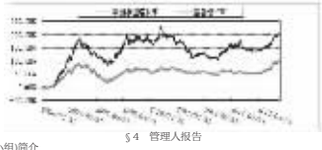
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	9.04%	0.71%	8.31%	0.77%	0.73%	-0.06%

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		
皮敏	基金经理	2013-11-08	-	10	2005年起在国信证券历任金融工程助理分析师、债券研究员、固定收益分析师,2009年加入博时基金管理有限公司,曾任固定收益研究员、博时宏观回报债券型证券投资基金的基金经理。现任博时平衡配置混合型证券投资基金兼博时信用债纯债债券型证券投资基金、博时灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
陈雷	基金经理	2015-02-13		7	2007年起在华信惠悦咨询公司工作。2008年加入博时基金管理有限公司,历任数据分析员、研究员、资深研究员、基金经理助理。现任博时行业轮动股票型证券投资基金兼博时回报灵活配置混合型证券投资基金、博时平衡配置混合型证券投资基金的基金经理。
姜文涛	基金经理	2012-07-17	2015-01-15	15.5	1998年起先后在国泰证券、国泰君安证券、博时基金、长盛基金、南方基金工作。2011年再次加入博时基金管理有限公司,历任基金经理、股票投资部总经理、股票投资部混合组投资总监、博时回报混合基金基金经理、博时裕益混合基金基金经理、股票投资部地对收益组投资总监、博时平衡配置混合基金基金经理。
曾升	基金经理	2013-11-22	2015-02-13	8	2006年5月从在中国人民银行研究生部硕士毕业后加入博时基金管理有限公司,任研究部研究员。2008年6月至2010年4月在工银瑞信基金公司任研究部研究员。2010年4月再次加入博时基金管理有限公司,曾任特定资产管理部投资经理、博时平衡配置混合基金基金经理。

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报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年一季度,中国宏观经济继续处在弱势寻底阶段,但资金面仍处在较宽裕的环境。政府鼓励创新、加大支持力度,同时减政放权,为活跃资本市场起到保驾护航的作用,同时处在信息化及大数据时代,互联网思维及渠道彻底冲击了传统思维和逻辑,为资本市场参与者打开了更广阔的想象空间。海外方面,在美元走强的大背景下,大宗商品及油价持续下跌,降低企业成本及通胀水平,且全球性的量化宽松政策,为市场流动性提供支撑。一季度期间,市场风格继续在互联网劲风下,市场风格继续延续小盘成长风格,沪深300指数上涨14.64%,中证500指数上涨36.27%,创业板指数上涨58.67%,中小板指数上涨46.60%。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金,为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差,取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求,力求组合成份股紧密跟踪指数,利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因,并在最小化交易成本的同时适时调仓,尽可能地减少跟踪误差。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月31日,本基金份额净值为1.2507元,累计份额净值为1.2507元,报告期内净值增长率为18.68%,同期业绩基准涨幅为19.27%。

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2015年二季度,在整体经济疲弱的大背景下,货币、财政政策有望继续偏松来对冲经济风险。利率下行、改革推进整体方向不变。地方债务置换将继续扩容,“一带一路”战略的稳步推进将助力经济转向,稳中求进。大类资产配置方面,权益类配置在居民财产中的比重有望进一步增加。增量资金入市趋势从未改变,当前是第二次加速,源于政策暖调。在牛市预期中,板块有望轮涨。前期涨幅较少的价值股如金融地产等有望有所表现。在地方债务置换望扩容、银行设立理财子公司等信息催化下,风口将偏向前期涨幅不大且基本面支撑的股票。未来可继续关注带路大战略涉及主题、互联网+相关主题。

在投资策略上,深F200ETF作为一只被动的指数基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,紧密跟踪深证基本面200指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过深F200ETF为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

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	740,257,866.83	54.21
	其中:股票	740,257,866.83	54.21
2	固定收益投资	490,840,502.40	35.95
	其中:债券	490,840,502.40	35.95
	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	118,881,932.52	8.71
7	其他各项资产	15,448,383.32	1.13
8	合计	1,365,428,685.07	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	493,305,838.97	36.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,642,187.38	6.51
E	建筑业	29,580,607.75	2.20
F	批发和零售业	97,650,622.73	7.26
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	-	-
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	32,078,610.00	2.38
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	740,257,866.83	55.01

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

代码	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	000100	TCL 集团	17,500,000	103,250,000.00	7.67
2	000910	大亚科技	6,119,101	91,664,132.98	6.81
3	601139	深圳燃气	8,070,183	87,642,187.38	6.51
4	002594	比亚迪	1,299,835	68,111,354.00	5.06
5	600418	江淮汽车	3,699,949	54,907,243.16	4.08
6	600704	物产中大	2,599,987	54,313,728.43	4.04
7	300177	中海达	2,499,925	47,073,587.75	3.50
8	000626	如意集团	819,998	43,336,894.30	3.22
9	600990	四创电子	649,920	42,660,748.80	3.17
10	300225	金力泰	2,456,998	36,535,560.26	2.72

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	190,127,000.00	14.13
	其中:政策性金融债	190,127,000.00	14.13
4	企业债券	300,713,502.40	22.35
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	490,840,502.40	36.48

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	110241	11国开41	600,000	60,828,000.00	4.52
2	0980144	09汾湖债	500,000	51,355,000.00	3.82
3	120222	12国开22	500,000	50,135,000.00	3.73
4	130222	13国开22	500,000	49,390,000.00	3.67
5	1280243	12铁道债05	400,000	39,992,000.00	2.97

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
报告期末本基金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
报告期末本基金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除广发证券(000776)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。
广发证券股份有限公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,被中国证监会采取责令限期改正的行政监管措施。
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报告期内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	431,129.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,761,483.18
5	应收申购款	255,770.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,448,383.32

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

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	300177	中海达	47,073,587.75	3.50	非公开发行股票重大事项
2	000626	如意集团	43,336,894.30	3.22	临时停牌

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	1,420,365,155.29
本报告期基金总申购份额	35,311,216.26
减:本报告期基金总赎回份额	237,690,394.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,217,985,976.92

§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3月31日,博时基金公司共管理五十五只开放式基金,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。博时基金资产管理净值总规模逾2643.38亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1165.18亿元人民币,累计分红超过659.68亿元人民币,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3月31日,博时创业成长股票基金今年以来净值增长率在380只标准型股票基金中排名前1/3;混合基金中,博时裕隆灵活配置混合在127只灵活配置型基金中排名前1/3;医药行业股票基金中,博时医疗保健行业基金在同类10只医药行业股票基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时优势收益信用债券、博时信用债纯债券今年以来收益率在76只同类长期标准债券型基金中分别排名第1和第14;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在90只普通债券基金(一级A类)中排名前1/3。

2、客户服务

2015年1季度,博时基金共举办各类渠道培训及活动489场,参加人数10653人。

3、其他大事件

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。

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3月28日,在第十二届中国基金业金牛奖评选中,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3月28日,在中金在线主办的“2014年度财经排行榜”评选中,邓欣雨获评“2014年度中金在线财经排行榜最佳基金经理”。

2015年3月26日,博时基金发布《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》,为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,经与相关托管银行、会计师事务所协商一致,自2015年3月25日起,本公司对旗下证券投资基金(除上证企债30交易型开放式指数证券投资基金外)持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录
9.1.1中国证券监督管理委员会批准博时平衡配置混合型证券投资基金设立的文件
9.1.2《博时平衡配置混合型证券投资基金基金合同》
9.1.3《博时平衡配置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博时平衡配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本
9.1.6报告期内博时平衡配置混合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
二〇一五年四月二十日

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月20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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月17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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时深证基本面200ETF
场内简称	深F200
基金主代码	159908
交易代码	159908
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2011年6月10日
报告期末基金份额总额	74,729,029.00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	本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪深证基本面200指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
业绩比较基准	深证基本面200指数(价格指数)。
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型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪深证基本面200指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	14,436,555.01
2.本期利润	17,883,494.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1858
4.期末基金资产净值	93,096,642.75
5.期末基金份额净值	1.2458

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。

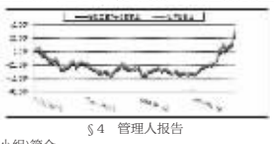
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	19.68%	1.76%	20.31%	1.79%	-0.63%	-0.03%

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		
赵云阳	基金经理	2012-11-13	-	5	2003年至2010年在晨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基金经理。现任博时深证基本面200ETF基金及其联接基金、博时上证企债30ETF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报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年一季度,中国宏观经济继续处在弱势寻底阶段,但资金面仍处在较宽裕的环境。政府鼓励创新、加大支持力度,同时减政放权,为活跃资本市场起到保驾护航的作用,同时处在信息化及大数据时代,互联网思维及渠道彻底冲击了传统思维和逻辑,为资本市场参与者打开了更广阔的想象空间。海外方面,在美元走强的大背景下,大宗商品及油价持续下跌,降低企业成本及通胀水平,且全球性的量化宽松政策,为市场流动性提供支撑。一季度期间,市场风格继续在互联网劲风下,市场风格继续延续小盘成长风格,沪深300指数上涨14.64%,中证500指数上涨36.27%,创业板指数上涨58.67%,中小板指数上涨46.60%。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金,为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差,取得标的指数所代表的市场平均回报。本报告期内我们严格按照基金合同要求,力求组合成份股紧密跟踪指数,利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因,并在最小化交易成本的同时适时调仓,尽可能地减少跟踪误差。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月31日,本基金份额净值为1.2458元,累计份额净值为1.2458元,报告期内净值增长率为19.68%,同期业绩基准涨幅为20.31%。

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2015年二季度,在整体经济疲弱的大背景下,货币、财政政策有望继续偏松来对冲经济风险。利率下行、改革推进整体方向不变。地方债务置换将继续扩容,“一带一路”战略的稳步推进将助力经济转向,稳中求进。大类资产配置方面,权益类配置在居民财产中的比重有望进一步增加。增量资金入市趋势从未改变,当前是第二次加速,源于政策暖调。在牛市预期中,板块有望轮涨。前期涨幅较少的价值股如金融地产等有望有所表现。在地方债务置换望扩容、银行设立理财子公司等信息催化下,风口将偏向前期涨幅不大且基本面支撑的股票。未来可继续关注带路大战略涉及主题、互联网+相关主题。

在投资策略上,深F200ETF作为一只被动的指数基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,紧密跟踪深证基本面200指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过深F200ETF为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

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	92,155,199.00	98.66
	其中:股票	92,155,199.00	98.66
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,227,090.75	1.31
7	其他各项资产	20,700.99	0.02
8	合计	93,402,990.74	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	215,484.20	0.23
B	采矿业	3,394,382.54	3.65
C	制造业	53,715,004.72	57.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,397,508.80	3.65
E	建筑业	1,244,536.74	1.34
F	批发和零售业	4,598,656.46	4.94
G	交通运输、仓储和邮政业	690,458.58	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	713,214.02	0.77
J	金融业	9,887,463.45	10.62
K	房地产业	12,263,789.05	13.17
L	租赁和商务服务业	822,684.20	0.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,079,468.30	1.16
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	132,547.94	0.14
S	综合	-	-
	合计	92,155,199.00	98.99

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	000002	万 科A	398,282	5,504,257.24	5.91
2	000651	格力电器	69,762	3,054,180.36	3.28
3	000776	广发证券	88,742	2,475,901.80	2.66
4	000100	TCL 集团	417,082	2,460,783.80	2.64
5	000333	美的集团	73,738	2,429,667.10	2.61
6	000001	平安银行	151,565	2,387,148.75	2.56
7	000709	河北钢铁	469,429	2,032,627.57	2.18
8	000157	中联重科	277,345	2,030,165.40	2.18
9	002024	苏宁云商	141,250	1,846,137.50	1.98
10	000825	太钢不锈	298,740	1,669,956.60	1.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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
本基金本报告期末未持有债券。
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。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金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
报告期末本基金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除广发证券(000776)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。
广发证券股份有限公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,被中国证监会采取责令限期改正的行政监管措施。
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报告期内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	20,434.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	266.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,700.99

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
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

本报告期期初基金份额总额	115,229,029.00
本报告期基金总申购份额	1,500,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	42,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	74,729,029.00

§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3月31日,博时基金公司共管理五十五只开放式基金,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。博时基金资产管理净值总规模逾2643.38亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1165.18亿元人民币,累计分红超过659.68亿元人民币,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3月31日,博时创业成长股票基金今年以来净值增长率在380只标准型股票基金中排名前1/3;混合基金中,博时裕隆灵活配置混合在127只灵活配置型基金中排名前1/3;医药行业股票基金中,博时医疗保健行业基金在同类10只医药行业股票基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时优势收益信用债券、博时信用债纯债券今年以来收益率在76只同类长期标准债券型基金中分别排名第1和第14;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在90只普通债券基金(一级A类)中排名前1/3。

2、客户服务

2015年1季度,博时基金共举办各类渠道培训及活动489场,参加人数10653人。

3、其他大事件

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。

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3月28日,在第十二届中国基金业金牛奖评选中,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3月28日,在中金在线主办的“2014年度财经排行榜”评选中,邓欣雨获评“2014年度中金在线财经排行榜最佳基金经理”。

2015年3月26日,博时基金发布《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》,为确保证券投资基金估值的合理性和公允性,根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,经与相关托管银行、会计师事务所协商一致,自2015年3月25日起,本公司对旗下证券投资基金(除上证企债30交易型开放式指数证券投资基金外)持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录
9.1.1中国证券监督管理委员会批准深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
9.1.2《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
9.1.3《深证基本面200交易型开放式指数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报告期内深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿
9.1.6深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
9.2存放地点
基金管理人、基金托管人处
9.3查阅方式