博时月月薪定期支付债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时月月薪定期支付债券
基金主代码	000246
交易代码	000246
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月25日
报告期末基金份额总额	381,032,926.23份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争为投资人提供稳定的现金流收入,争取实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,确定资产在非信用类固定收益类证券(国家债券、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例。
业绩比较基准	3年期定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。
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4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	10,283,336.88
2.本期利润	15,626,658.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0410
4.期末基金资产净值	412,031,331.59
5.期末基金份额净值	1.081

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。

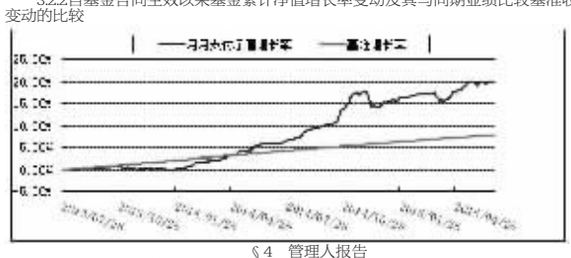
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	3.92%	0.15%	0.90%	0.01%	3.02%	0.14%

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		
陈凯杨	基金经理/现金管理组投资副总监	2013-07-25	-	10	2003年起先后在深圳发展银行、博时基金、长城基金工作。2009年1月再次加入博时基金管理有限公司,历任固定收益研究员、特定资产投资经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安心收益定期开放债券基金、博时理财30天债券基金、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、博时双月薪定期支付债券基金、博时现金收益货币基金、博时证金宝货币基金的基金经理。
魏桢	基金经理	2013-07-25	-	7	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年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、博时现金收益货币基金、博时安盈债券基金、博时保证金货币ETF基金、博时证金宝货币基金的基金经理。

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,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报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第二季度,受央行大幅降准影响,货币市场流动性十分充裕。银行间R001均值1.55%(-154BP),R007均值4.39%(-190BP)。现券市场先涨后跌,收益率曲线呈现出短端下行幅度大于长端的陡峭化走势,期限利差扩大。高评级信用债收益率下行幅度大于中低评级收益率下行幅度，因此信用利差扩大。1年期短融收益率分别为3.49%(AAA)、3.97%(AA+)、4.39%(AA)。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.081元,累计份额净值为1.202元,报告期内净值增长率为3.92%,同期业绩基准涨幅为0.90%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于IPO频率加快和规模放量可能,资金需求向短端逼近,短期限资金价格将维持低位震荡。预计资金面仍将保持宽松的状态,且利率仍有下行空间。广谱利率传导机制不完善,广谱负债利率(理财)对债券收益率下限形成较强约束;传统配置框架的打破需要为配置户的交易化营造环境,长期限的流动性宽松是必要条件,这意味着要么获得疲弱基本面的支持,要么要有长期限的政策承诺。经济仍然是维持弱势,通胀维持在低位,总需求较弱。我们倾向认为于未来货币政策继续宽松的方向依旧明确,未来资金价格仍处在下降的通道之中,供需矛盾方向与经济方向一致,套息和杠杆带来确定性的收益,长债仍然有下行空间。

本组合三季度投资思路维持较高杠杆策略,以中高评级信用债为底仓配置,杠杆部分配置利率债,攫取波段收益。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	750,606,025.60	96.56
	其中:债券	750,606,025.60	96.56
	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	10,182,065.72	1.31
7	其他各项资产	16,568,518.02	2.13
8	合计	777,356,609.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	165,699,000.00	40.22
	其中:政策性金融债	165,699,000.00	40.22
4	企业债券	437,679,025.60	106.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	147,228,000.00	35.73
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	750,606,025.60	182.17

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	150205	15国开05	1,700,000	165,699,000.00	40.22
2	101458007	14闽漳龙MTN001(5年期	300,000	32,415,000.00	7.87
3	101360018	13乌城投MTN001	300,000	31,815,000.00	7.72
4	122362	14上实01	300,000	31,047,000.00	7.54
5	1182343	11柳控MTN1	300,000	31,014,000.00	7.53

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	16,450.12
2	应收证券清算款	85,391.66
3	应收股利	-
4	应收利息	16,466,676.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,568,518.02

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

本基金本报告期末持有股票。

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	381,032,926.23
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	7,182,195.94
本报告期基金拆分变动份额	7,182,195.94
本报告期期末基金份额总额	381,032,926.23

注:根据《博时月月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》和《博时月月薪定期支付债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，基金管理人分别于2015年4月1日、2015年5月4日和2015年6月1日对本基金进行了份额折算,折算结果公告可详见博时基金管理有限公司官方网站2015年4月3日、2015年5月6日和2015年6月3日刊登的《博时月月薪定期支付债券型证券投资基金份额折算结果的公告》

§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2015年6月30日,博时基金公司共管理七十只开放式基金,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3027.86亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1317.35亿元人民币,累计分红超过664.83亿元人民币,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6月30日,博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在379只标准型股票基金中分别排名前1/3和前1/2；博时深证基本面200ETF及联接基金今年以来的净值增长率在175只指数股票型基金-标准指数股票基金及46只ETF联接基金中分别排名前1/2和前1/3;混合基金-偏股型基金中,博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型36只产品中排名前1/3;混合基金-灵活配置型基金中,博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在126只同类型基金中分别排名前1/3和前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债基金今年以来收益率在71只同类长期标准债券型基金中分别排名前1/10、前1/2和前1/2;博时上证企债30ETF今年以来的收益率在18只指数债券型基金-指数债券型基金(A类)排名前1/3。

2、其他大事件

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

§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薪定期支付债券型证券投资基金募集的文件

9.1.2《博时月月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时月月薪定期支付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博时月月薪定期支付债券型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时月月薪定期支付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
二〇一五年七月十八日

博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7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4月29日起至6月30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4月29日(基金合同生效日)-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,933,552.13
2.本期利润	-14,098,792.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0104
4.期末基金资产净值	1,338,911,828.49
5.期末基金份额净值	0.990

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	-1.00%	0.15%	0.50%	0.01%	-1.50%	0.14%

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		
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	-	-	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。1997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基金经理的基金经理。
赵云阳	基金经理	2015-04-29	-	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联接基金、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、博时证券保险指数分级基金基金经理。

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,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报告期内基金投资策略和运作分析

招财一号基金成立于2015年4月29日,该基金属于保本基金,保本基金采用的投资思路是将大部分资产投入固定收益证券,以保证保本周期到期时能收回本金;同时将剩余的小部分资金做安全垫,乘以一个放大倍数投入股票市场,以博取股票市场的高收益。

招财一号成立以来近2个月的运作期间,股票市场遇到了历史少见的市场大幅跌宕的行情表现,给该基金的建仓和初始的安全垫的积累带来极大的挑战。期间经历并穿越“火”与“冰”的市场气象,即大家熟知的“5.19”和“5.30”市场标志,也迎合今年的厄尔尼诺气候现象。招财一号作为保本基金,该基金稳步运作,基金安全垫收益初始逐步放大,股票仓位也在稳步增加,但经历6月下旬的市场快速调整,基金风险仓位也在逐步降低,而受市场下跌,前期的安全垫有所下降。目前维持极低仓位。另外,招财一号基金也积极参与新股申购。债券投资操作,基于利率持续处于低位,操作上主要参与交易所高评级信用债,同时兼做协议存款等。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为0.990元,份额累计净值为0.990元,报告期内净值增长率为-1.00%,同期业绩基准涨幅为0.50%。

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3季度,从宏观经济角度来看,尽管几大重要指标数据显示经济仍在底部,但是有望逐步实现企稳。预计财政政策将作为更重要的调控工具,改革推进整体方向不变。海外方面,美联储仍有预期在9月启动加息,届时国内资金或将面临外流压力,因而3季度货币政策仍然可能进一步放松。股票市场将呈现震荡调整的格局,但是下行风险有限。部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值。

未来的股票投资操作方面,未来在市场调整充分之后,市场呈现明朗震荡上升通道的情形下,招财一号基于低风险产品特征,在基于安全垫收益的逐步增大前提下,逐步放大股票的仓位,以期在市场上升通道下获取更多的收益,但仍以控制下跌回撤风险为准绳。随着IPO个券的陆续推出,积极进行新股申购投资策略的应用,争取为组合锦上添花获得稳定收益。

在投资策略上,招财一号基金作为一只保本基金,继续按照灵活的CPPI策略,逐步积累安全垫,争取保本周期内在保本的基础上获得额外的收益。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过招财一号基金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	44,749,936.23	3.13
	其中:股票	44,749,936.23	3.13
2	固定收益投资	143,878,399.00	10.06
	其中:债券	143,878,399.00	10.06
	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	589,541,749.31	41.21
	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	648,538,914.33	45.34
7	其他各项资产	3,836,047.29	0.27
8	合计	1,430,545,046.16	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	1,360,184.00	0.10
B	采矿业	525,974.20	0.04
C	制造业	24,733,093.79	1.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,302,406.81	0.17
E	建筑业	1,878,025.62	0.14
F	批发和零售业	3,278,139.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	855,522.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,919,105.00	0.29
J	金融业	2,440,000.00	0.18
K	房地产业	1,333,271.71	0.10
L	租赁和商务服务业	758,555.10	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	843,516.00	0.06
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	522,143.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	44,749,936.23	3.34

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	600109	国金证券	100,000	2,440,000.00	0.18
2	300310	宜通世纪	51,800	1,760,682.00	0.13
3	002714	牧原股份	15,400	904,596.00	0.07
4	002618	丹邦科技	17,500	742,525.00	0.06
5	600829	人民同泰	32,100	636,864.00	0.05
6	601233	桐昆股份	31,300	624,748.00	0.05
7	000966	长源电力	31,439	622,177.81	0.05
8	002039	黔源电力	29,800	616,264.00	0.05
9	600236	桂冠电力	55,100	614,916.00	0.05
10	000933	神火股份	61,300	577,446.00	0.04

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	142,336,000.00	10.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,542,399.00	0.12
8	其他	-	-
9	合计	143,878,399.00	10.75

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	122372	14财通债	700,000	70,336,000.00	5.25
2	122375	14苏新债	620,000	62,000,000.00	4.63
3	122378	13楚天02	100,000	10,000,000.00	0.75
4	132002	15天集EB	11,210	1,121,000.00	0.08
5	110031	航信转债	2,900	421,399.00	0.03

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	33,024.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,803,022.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,836,047.29

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

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	300310	宜通世纪	1,760,682.00	0.13	重大事项停牌

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

序号	1,353,010,620.65
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
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“做投资价值的发现者”。截至2015年6月30日,博时基金公司共管理七十只开放式基金,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3027.86亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1317.35亿元人民币,累计分红超过664.83亿元人民币,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6月30日,博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在379只标准型股票基金中分别排名前1/3和前1/2；博时深证基本面200ETF及联接基金今年以来的净值增长率在175只指数股票型基金-标准指数股票基金及46只ETF联接基金中分别排名前1/2和前1/3;混合基金-偏股型基金中,博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型36只产品中排名前1/3;混合基金-灵活配置型基金中,博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在126只同类型基金中分别排名前1/3和前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债基金今年以来收益率在71只同类长期标准债券型基金中分别排名前1/10、前1/2和前1/2;博时上证企债30ETF今年以来的收益率在18只指数债券型基金-指数债券型基金(A类)排名前1/3。

2、其他大事件

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

§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
二〇一五年七月十八日

博时主题行业股票证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月18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7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4月1日起至6月30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	2,759,146,576.19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 (2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	2,524,561,178.55
2.本期利润	1,934,609,686.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.5563
4.期末基金资产净值	9,316,723,070.53
5.期末基金份额净值	3.377

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。

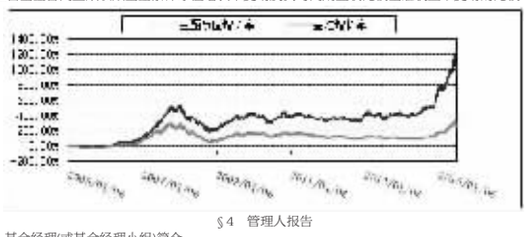
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	15.33%	2.34%	10.45%	2.10%	4.88%	0.24%

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		
王俊	研究部总经理/基金经理	2015-01-22	-	7	2008年从上海交通大学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、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理。现任研究部总经理兼博时主题行业股票(LOF)基金的基金经理。
蔡滨	基金经理	2014-12-26	-	8	2001年起先后在上海振华职校、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,历任研究部研究员、研究部副总经理兼资本品组组长。现任博时