

博时亚洲票息收益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。

基金托管人招行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。

本报告期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:博时亚洲票息收益债券(ODII)

基金代码:050400

交易代码:050400

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年1月1日

报告期末基金份额总额:901,891,950.02份

本基金通过分析亚洲区域各国和地区的宏观经济状况以及各行业发展特征基本面，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。

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、行业策略等卫星策略，在谨慎投资的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

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

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

境外资产托管人:Brown Brothers Harriman Co.

境外资产托管人中文名称:布朗兄弟哈里曼银行

§ 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 14,106,270.07

2.本期利润 27,769,791.08

3.期初现金及现金等价物余额 6,035,88

4.期末现金及现金等价物余额 8,096,384,039.08

5.期末现金及现金等价物净值 10,094.04

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，本期利润为期末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认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内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 净值增长率为① 净值增长率为② 业绩比较基准收益率为③ 业绩比较基准收益率为④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.20% 0.15% -0.74% 0.19% 3.94% -0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

5.1.10 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1.10.3 本基金各项资产构成

序号 基金名称 基金类型 运作方式 管理人 公寓价值(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 SPDR BANCAIRE HIGH YIELD BD ETF基金 开放式 iShares Fund Management Inc 23,494,564.80 2.71

5.1.10.4 投资组合报告的备注

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本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。

5.1