博时月月薪定期支付债券型证券投资基金

【2015】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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9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	361,981,282.44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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	14,971,783.05
2.本期利润	22,555,375.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0613
4.期末基金资产净值	406,284,174.82
5.期末基金份额净值	1.122

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。

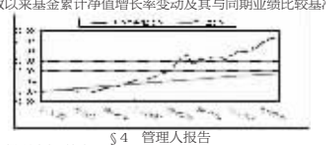
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.71%	0.14%	0.79%	0.01%	4.92%	0.13%

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、博时理财30天债券基金的基金经理。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、博时现金宝货币基金、博时裕瑞纯债债券基金的基金经理。
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、博时理财30天债券基金的基金经理。现任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年第三季度,受汇率波动和央行降准双重影响,货币市场流动性维持总体宽松充裕,回购利率低位稳定。银行间R001均值1.56%,R007均值2.48%。现券市场温和普涨,收益率曲线呈现出短端上行长端下行的平坦化修正走势,10Y-1Y期限利差缩小20BP至110BP。绝对收益追逐下叠加高收益资产缺乏导致中低评级信用债收益率本季下行幅度超过高评级,因此信用利差和评级利差进一步缩窄。1年期短融收益率分别为3.3%(AAA)、3.53%(AA+)、3.84%(AA)。

考虑到信用风险是接下来市场焦点,信用债风险收益可能不对等。三季度,本基金降低适当降低信用债仓位,提高长久期利率债比例。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.122元,累计份额净值为1.271元,报告期内净值增长率为5.71%,同期业绩基准涨幅为0.79%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从大的债务周期的角度来,社会融资成本利率应趋于下行的,这长期利好于债券市场。目前三期叠加的新常态下,潜在经济增长速度下行难以避免。短期因素是积极的财政政策不断加码,政策在打通资金进入实体的渠道上下功夫,简政放权、国企改革等改革措施释放政策红利,一系列稳增长政策短期内可能对经济起到一定托底作用,但难以拉动经济明显反弹。另外,受制于工业领域通缩形式长期存在,当前货币条件不支持,CPI除了猪以外、全是缩。放弃通胀的视角和期待,迎接中国和全球的至少是3-5年的类通缩。故此经济基本面较难为债市带来明显的负面影响。期限利差偏高对长端利率债有较强的保护,尽管中短期内未必能够有效的突破前低,但去杠杆和经济结构调整的周期里,利率下行的方向和趋势很难改变,利率每次上升都提供了买入机会。我们会保持耐心、等待新的逻辑的出现。总体债市仍处于较为有利的环境,但突破前期低点需要更低预期的经济表现或宽松政策的不断触发,票息加杠杆的策略较为传统,但效率打折,久期策略逐渐体现出价值。

本组合投资思路上保持相对乐观,策略上依然保持中等杠杆水平,以控制信用风险和博弈久期价值为主。

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	666,401,036.80	96.07
	其中:债券	666,401,036.80	96.07
	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	9,124,408.21	1.32
7	其他各项资产	18,102,057.65	2.61
8	合计	693,627,502.66	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	170,850,000.00	42.05
	其中:政策性金融债	170,850,000.00	42.05
4	企业债券	442,639,036.80	108.96
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	52,912,000.00	13.02
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	666,401,036.80	164.02

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	170,850,000.00	42.05
2	122362	14上实01	300,000	31,893,000.00	7.85
3	118917	15国商01	300,000	31,197,000.00	7.68
4	1180085	11晨鸣控股债	300,000	31,077,000.00	7.65
5	122334	12大唐02	220,000	22,963,600.00	5.65

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	6,040.38
2	应收证券清算款	59,281.89
3	应收股利	-
4	应收利息	18,036,735.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,102,057.65

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
报告期基金总申购份额	29,300,079.58
减:报告期基金总赎回份额	55,114,143.59
报告期基金拆分变动份额	6,762,420.22
本报告期末基金份额总额	361,981,282.44

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7月1日、2015年8月3日和2015年9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7月3日、2015年8月5日和2015年9月7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》;基金管理人于受限开放期2015年7月27日开放了申购和赎回业务,受限开放期申赎结果可详见博时基金管理有限公司官方网站2015年7月29日刊登的《博时月月薪定期开放债券型证券投资基金受限开放期申赎结果的公告》。

§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9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

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。

§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
二〇一五年十月二十六日

博时证金宝货币市场基金

【2015】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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时证金宝货币
基金主代码	001308
交易代码	001308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月15日
报告期末基金份额总额	204,870,628.13份
投资目标	在控制投资组合风险,保持相对流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	1,280,166.26
2.本期利润	1,280,166.26
3.期末基金资产净值	204,870,628.13

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

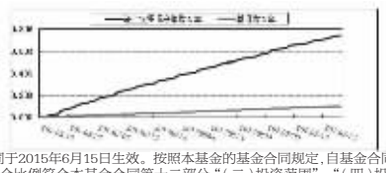
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6256%	0.0009%	0.0894%	0.0000%	0.5362%	0.0009%

注:基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益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2015年6月15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3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分"(二)投资范围"、"(四)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。

§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	2015-06-10	-	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、博时理财30天债券基金的基金经理。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、博时裕瑞纯债债券基金的基金经理。
魏桢	基金经理	2015-06-19	-	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、博时理财30天债券基金的基金经理。现任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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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年第三季度,受汇率波动和央行降准双重影响,货币市场流动性维持总体宽松充裕,回购利率低位稳定。银行间R001均值1.56%,R007均值2.48%。现券市场温和普涨,收益率曲线呈现出短端上行长端下行的平坦化修正走势,10Y-1Y期限利差缩小20BP至110BP。绝对收益追逐下叠加高收益资产缺乏导致中低评级信用债收益率本季下行幅度超过高评级,因此信用利差和评级利差进一步缩窄。1年期短融收益率分别为3.3%(AAA)、3.53%(AA+)、3.84%(AA)。

三季度,本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则,以短期存款和短融为主。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内净值增长率为0.63%,同期业绩基准涨幅为0.09%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行抑制投机加联储加息暂缓,汇率贬值压力下降,缓解资金外流压力,信用需求疲软的情况下,有助于资金面内生性宽松。不过央行在近期开始净回笼资金,显示一旦金融风险下降后,货币政策并没有大水漫灌的倾向。从这个角度而言,当总需求超预期下行和金融风险上升时,央行一定会加大宽松力度以维持流动性稳定,但一旦恐慌情绪过后,货币政策可能还是会以调结构为取向。目前市场的主要驱动力依然是股市财富效应弱化、风险偏好下降带来的资金回流支撑。预计央行依然会"灵活运用多种货币政策工具保持适度流动性",引导货币利率低位稳定,宽松周期仍在持续。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合良好的流动性和适度的组合期限。未来一段时间,继续以存款为主要投资工具,标配短期融资券。

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	固定收益投资	110,032,325.44	46.81
	其中:债券	110,032,325.44	46.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	124,097,673.49	52.79
4	其他各项资产	925,824.76	0.39
5	合计	235,055,823.69	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	11.57	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	29,999,755.00	14.64
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2015-07-27	123	为控制流动性风险,当日存款到期未续做	1个交易日

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	70.33	14.64
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	4.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	39.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		114.28	14.64

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	9,992,036.93	4.88
	其中:政策性金融债	9,992,036.93	4.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,040,288.51	48.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	110,032,325.44	53.71
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071521005	15渤海证券CP005	200,000	19,995,320.97	9.76
2	041552026	15鄂能源CP002	200,000	19,992,198.82	9.76
3	041560059	15京投投CP001	200,000	19,992,198.04	9.76
4	041553013	15广新CP001	100,000	10,081,200.61	4.92
5	041553047	15冀中CP002	100,000	10,000,121.17	4.88
6	011599463	15太不锈SCP002	100,000	9,997,660.99	4.88
7	150419	15农发19	100,000	9,992,036.93	4.88
8	011599545	15国联SCP005	100,000	9,981,587.91	4.87

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.11%
报告期内偏离度的最低值	-0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.06%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.8.2本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.8.3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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	793,230.98
4	应收申购款	132,593.78
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	925,824.76

5.8.5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	204,720,365.92
报告期基金总申购份额	1,816,496.32
报告期基金总赎回份额	1,666,234.11
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	204,870,628.13

§7 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9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

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。

§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证金宝货币市场基金设立的文件

9.1.2《博时证金宝货币市场基金基金合同》

9.1.3《博时证金宝货币市场基金托管协议》

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博时证金宝货币市场基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时证金宝货币市场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、基金托管人住所

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
二〇一五年十月二十六日

博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金

【2015】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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-28,311,278.89
2.本期利润	-16,309,738.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0121
4.期末基金资产净值	1,322,602,089.90
5.期末基金份额净值	0.978

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	-1.21%	0.14%	0.63%	0.01%	-1.84%	0.13%

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