博时抗通胀增强回报证券投资基金

【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:中国银行股份有限公司
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。

基金托管人中国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	博时抗通胀增强回报(QDII-FOF)
基金主代码	050020
交易代码	050020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月25日
报告期末基金份额总额	170,328,892.75份
投资目标	本基金通过进行全球大类资产配置,投资于通胀(通缩)相关的各类资产,在有效控制风险的前提下,力争为投资者资产提供通胀(通缩)保护,同时力争获取较高的超额收益。
投资策略	本基金采用将自上而下的资产配置与自下而上的个券选择相结合、构造被动的通胀跟踪组合与适度的主动投资以获取超额收益相结合的策略。
业绩比较基准	标普高盛贵金属类总收益指数(S&P GSCI Precious Metal Total Return Index)收益率×20%+标普高盛农产品总收益指数(S&P GSCI Agricultural Total Return Index)收益率×30%+标普高盛能源类总收益指数 (S&P GSCI Energy Total Return Index) 收益率×20%+巴克莱美国通胀保护债券指数(Barclays Capital U.S. Treasury Inflation Protected Securities(TIPS) Index(Series-L))收益率×30%,简称"通胀综合指数指标"。其中,前三个指数是标准普尔公司编制发布的标准大宗商品分类指数,巴克莱美国通胀保护债券指数是境外共同基金最常用的抗通胀债券指数。
风险收益特征	本基金为基金中基金,主要投资范围为抗通胀相关主题的资产。本基金所指的抗通胀相关主题的资产包括抗通胀主题相关的基金和其他资产。抗通胀相关主题的其他资产主要指通胀挂钩债券和通胀相关的权益类资产等。本基金的收益和风险低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中高风险/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	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China (Hong Kong) Limited
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)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	-33,976,235.04
2.本期利润	-14,016,895.83
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0820
4.期末基金资产净值	93,407,812.27
5.期末基金份额净值	0.548

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。

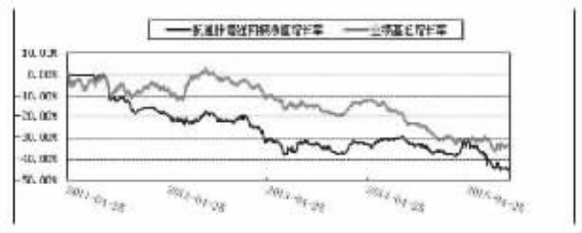
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-13.02%	1.18%	-6.49%	0.78%	-6.53%	0.40%

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



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
魏凤春	基金经理/宏观策略部总经理	2015-08-24	-	8	1993年起先后在山东经济学院、江南信托、通华大学、江南证券、中信建投证券工作。2011年加入博时基金管理有限公司,曾任投资经理。现任宏观策略部总经理兼博时抗通胀增强回报(QDII-FOF)基金的金经理。
黄韬	基金经理	2014-03-07	2015-08-24	10.5	2004年起在民安证券任交易员。2006年加入博时基金管理有限公司,历任交易员、国际股票交易组主管、基金经理助理、投资经理助理、投资经理。曾任博时抗通胀增强回报证券投资基金的基金经理。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

基于因全球经济增长不确定性增加,带来全球风险偏好回落的宏观判断,我们形成了"自上"保持低仓位,"自下"寻找结构性机会的投资策略。

商品方面,虽不改下行趋势,但个别品种仍因事件性冲击形成了可具操作的投资机会。如,黄金的机会来自避险需求,而这也有效对冲了三季度全球风险资产的大调整;"大众丑闻"让汽油车变得流行,带动钯金的投资机会;处于超跌区域的原油,因库存的下降和中国需求提升经历了在8月底大幅上行。糖则在农产品中表现靓丽,主要是受到了印度、巴西恶劣天气影响。

股市方面,股权资产风险溢价出现系统性上升而引致了较大幅度调整。

债市方面,美国利率债表现显著好于高收益垃圾债,与避险、风险偏好回落的大逻辑一致。

本产品三季度业绩不佳,主要是受到了全球系统性风险的影响。自8月份以来,开始践行上述投资逻辑,清空了股票,高收益债以低仓位,同时深挖对个别投资机会,这其中黄金、钯金、原油、糖、美国债都是组合中着重配置的品种,有效地对冲了全球系统性冲击。

4.4.2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0.548元,累计份额净值为0.548元,报告期内净值增长率为-13.02%,同期业绩基准涨幅为-6.49%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球金融市场的震荡加剧在一定程度上也增加了经济复苏的难度,预计四季度全球经济仍难有起色。全球竞相放水之后,政策边际效果减弱,是否宽松将成为老问题,市场对此亦愈发不关心,而去真正考量放水后的成色,对于因之获得的"一点可怜的增长"恐怕满足不了投资者。

新的核心矛盾,已在全球资本市场三季度后期隐现出来,即全球经济增长不确定性增加,引发风险偏好回落。预计这仍会是盘旋在四季度的上空的幽灵,甚至因事件冲击而强化,中国的需求刺激政策能缓和这一矛盾,但无法逆转。

基于上述分析,我们认为大类资产配置之中,债券或好于其他风险资产的表现,但商品与股票亦不乏结构性、波段机会。具体而言,商品的机会存在于个别供给受到冲击的品种之中;中国刺激需求的政策无论给商品(资源类)还是股市带来的都将是脉冲式机会。

落实到未来一个季度的操作上,组合拟保持债券的基础配置地位,以风险资产来博取阿尔法、与波段性收益。

4.6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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,505,524.59	4.64
	其中:普通股	4,505,524.59	4.64
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	61,352,413.69	63.18
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,229,387.16	32.16
8	其他各项资产	26,275.98	0.03
9	合计	97,113,601.42	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
香港	4,505,524.59	4.82
合计	4,505,524.59	4.82

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
医疗保健	4,505,524.59	4.82
合计	4,505,524.59	4.82

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	CHINA ANIMAL HEALTH-CARE LTD	中国动物保健品	940 HK	Hongkong Ex-change	香港	1,508,000.00	4,505,524.59	4.82

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES GOLD TRUST	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	9,367,319.59	10.03
2	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF基金	开放式	United States Commodities Fund LLC	9,338,388.40	10.00
3	IPATH BLOOMBERG AGRICULTURE	ETF基金	开放式	Barclays Capital Inc	8,978,687.42	9.61
4	ETFS PHYSICAL PALLADIUM SHAR	ETF基金	开放式	ETF Securities USA LLC	6,368,068.42	6.82
5	POWERSHARES DB AGRICULTURE F	ETF基金	开放式	Deutsche Bank AG	5,711,429.59	6.11
6	IPATH BLOOMBERG SUGAR SUBIND	ETF基金	开放式	Barclays Capital Inc	5,136,876.98	5.50
7	SPDR GOLD SHARES	ETF基金	开放式	World Gold Trust Services LLC/USA	3,765,055.47	4.03
8	PROSHARES ULTRASHORT FTSE EU	ETF基金	开放式	ProShare Advisors LLC	3,638,434.59	3.90
9	PROSHARES ULTRA 7-10 YEAR TR	ETF基金	开放式	ProShare Advisors LLC	2,921,783.26	3.13
10	VANGUARD LONG-TERM GOV BOND	ETF基金	开放式	Vanguard Group Inc/The	2,919,455.02	3.13

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	20,707.94
4	应收利息	1,311.90
5	应收申购款	4,256.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,275.98

5.10.4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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6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

报告期期初基金份额总额	172,007,461.13
报告期基金总申购份额	6,718,407.22
减:报告期基金总赎回份额	8,396,975.60
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	170,328,892.75

§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闵,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,张溪闵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抗通胀增强回报证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时抗通胀增强回报证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时抗通胀增强回报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博时抗通胀增强回报证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时抗通胀增强回报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

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

【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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	37,229,029.00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。
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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,393,543.32
2.本期利润	-19,253,044.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4903
4.期末基金资产净值	38,376,070.74
5.期末基金份额净值	1.0308

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。

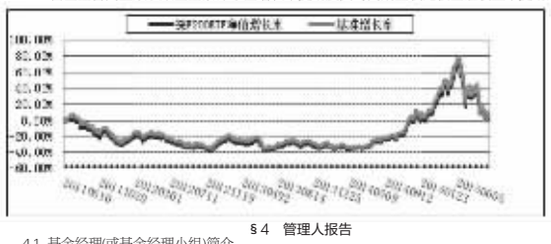
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	-31.26%	3.18%	-32.32%	3.46%	1.06%	-0.28%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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基金兼博时深证基本面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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年3季度,从宏观经济角度来看,经济继续处在寻底阶段,但预期企稳的时间继续后延。经济的低迷,市场给予流动性继续宽松的预期仍在,货币政策和财政政策继续给予宽松支持。但受到前期市场下跌给予投资者心理的冲击,从赚钱效应到亏钱套牢的快速转变,市场投资者的风险偏好在降低,股市资产的流出,债券的热捧及场内货币规模的暴涨等现象给予验证。市场投资者空仓观望的氛围较浓,参与短期市场主题的行为会增多,导致市场的波动会逐步加剧。总之,当前市场的运行方向较不明朗,投资者应该多看少动,等待未来市场放量的企稳。

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。

4.6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	37,395,225.16	96.55
	其中:股票	37,395,225.16	96.55
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	1,295,923.99	3.35
7	其他各项资产	41,319.21	0.11
8	合计	38,732,468.36	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	44,612.52	0.12
B	采矿业	880,378.12	2.29
C	制造业	22,556,066.14	58.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,057,505.72	2.76
E	建筑业	389,687.28	1.02
F	批发和零售业	1,624,807.64	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	350,705.01	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	431,768.39	1.13
J	金融业	2,687,702.96	7.00
K	房地产业	5,812,796.17	15.15
L	租赁和商务服务业	856,612.01	2.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	511,473.82	1.33
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	191,109.38	0.50
S	综合	-	-
	合计	37,395,225.16	97.44

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	289,282	3,682,559.86	9.60
2	000651	格力电器	98,624	1,596,736.32	4.16
3	000858	五粮液	51,627	1,328,362.71	3.46
4	000333	美的集团	46,138	1,164,061.74	3.03
5	000630	铜陵有色	334,250	1,119,737.50	2.92
6	000001	平安银行	99,918	1,048,139.82	2.73
7	002024	苏宁云商	57,950	702,354.00	1.83
8	002183	怡亚通	9,348	683,806.20	1.78
9	000066	长城电脑	31,224	672,564.96	1.75
10	000157	中联重科	133,545	666,389.55	1.74

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	13,133.52
2	应收证券清算款	27,919.57
3	应收股利	-
4	应收利息	266.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,319.21

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	000858	五粮液	1,328,362.71	3.46	公告重大事项
2	000630	铜陵有色	1,119,737.50	2.92	公告重大事项
3	002183	怡亚通	683,806.20	1.78	公告重大事项
4	000066	长城电脑	672,564.96	1.75	公告重大事项

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	43,229,029.00
报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减:报告期基金总赎回份额	12,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	37,229,029.00

§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闵,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,张溪闵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深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

9.1.2《博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时深证基本面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报告期内博时深证基本面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

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

博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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

2.1基金产品概况

基金简称	博时深证基本面200ETF联接
基金主代码	050021
交易代码	050021
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金
基金合同生效日	2011年6月10日
报告期末基金份额总额	31,260,129.35份
投资目标	通过主要投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数即深证基本面200指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金,方便特定的客户群通过本基金投资深证基本面200交易型开放式指数投资基金。本基金不参与深证基本面200交易型开放式指数投资基金的投资管理。
业绩比较基准	深证基本面200指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
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,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

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年7月13日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

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。
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,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。

§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	2,212,659.87
2.本期利润	-14,848,423.63
3.