上证企债30交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十日

§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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时上证企债30ETF
场内简称	企债ETF
基金主代码	511210
交易代码	511210
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013年7月11日
报告期末基金份额总额	828,975.00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	本基金将根据资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况主要采取分层抽样复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪。
业绩比较基准	上证企债30指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于中风险/收益的开放式基金。 本基金采用分层抽样复制方法跟踪复制上证企债30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	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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	1,506,188.35
2.本期利润	753,028.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.9084
4.期末基金资产净值	94,498,331.05
5.期末基金份额净值	113.9942

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。

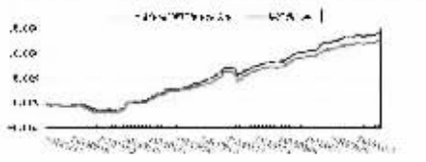
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.80%	0.06%	0.94%	0.06%	-0.14%	0.00%

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		
杨永光	固定收益总部公募基金组投资副总监/基金经理	2013-07-11	-	13.5	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。2001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公募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、博时新机遇混合基金、博时境源保本基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2013-07-11	-	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、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、博时黄金ETF基金、博时上证50ETF基金、博时上证50ETF联接基金、博时银行分级基金的基金经理。

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报告期内基金投资策略和运作分析

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,尽可能的减少跟踪误差。

报告期内,本基金在指数定期调仓阶段采取择优调仓策略,同时组合保持较少的现金头寸,持仓票息在低利率环境下获得较高的票息收益。由于组合部分个券日常交易的不平滑,增加组合收益偏差的控制难度。为了优化跟踪偏离,本季度继续维持组合持有较多成份券的个数,争取在控制跟踪误差的情况下为投资者获得一定的超额收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为113.9942元,累计份额净值为1.1399 元,报告期内净值增长率为0.80%,同期业绩基准涨幅为0.94%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年4季度,宏观经济数据仍在底部震荡,PMI小幅下行,CPI平稳,地产销量延续回暖趋势,但电力等工业品以及大宗商品价格仍在下降通道。从流动性方面来看,2015年全年,货币政策总体仍处于持续宽松的状态。债券收益率下行价格上涨,其中利率债的表现更好,企业债的表现有所逊色。

展望2016年1季度,从宏观经济角度来看,经济继续处在筑底阶段,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。而股票市场的运行方向较不明朗,投资者的风险偏好仍不高,对债券市场有所支撑。大量资金流入债券市场,有利于利率债和企业债,但从空间看,利率债收益率继续下行的空间有限,利率债将整体处于震荡行情,而质优企业债的收益率仍有下行空间。但我们应该警惕经济下滑带来的信用风险,规避资质较差的标的。总之,从债市供需角度来看,企债发行提速,但货币较宽松,叠加债市受短期避险情绪带动,中高评级信用债的投资价值继续可关注。

在投资策略上,上证企债30ETF作为一只被动的信用债指数基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,紧密跟踪上证企债30指数。同时我们仍然看好中国经济转型中直接融资渠道的扩展,希望通过上证企债30ETF为投资人提供分享中国信用债市场成长中的机会与收益。

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	90,649,374.90	92.77
	其中:债券	90,649,374.90	92.77
	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	900,000.00	0.92
	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	4,031,844.46	4.13
7	其他各项资产	2,128,570.85	2.18
8	合计	97,709,790.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	90,649,374.90	95.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,649,374.90	95.93

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	122393	15恒大03	71,000	7,810,000.00	8.26
2	122149	12石化01	56,180	5,747,214.00	6.08
3	122276	13魏桥01	52,140	5,589,408.00	5.91
4	122823	11舟山债	50,000	5,262,500.00	5.57
5	122366	14武钢债	45,000	4,585,500.00	4.85

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本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,887.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,126,682.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,128,570.85

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处于转股期的可转换债券。

5.11.6报告期内投资决策程序的说明

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	828,975.00
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	828,975.00

§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12月31日,博时基金公司共管理八十五只开放式基金,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。资产管理净值总规模逾3980亿元人民币,其中公募基金资产规模约2064亿元人民币,累计分红约677亿元人民币,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,截至12月31日,指数股票型基金中,博时深证基本面200ETF及深证基本面200ETF联接,今年以来净值增长率在同类型分别排名前1/2和1/3;偏股型的混合基金里,博时创业成长混合及博时卓越品牌混合,今年以来净值增长率在同类型分别排名前1/4和1/3;灵活配置型的混合基金里,裕隆灵活配置混合今年以来净值增长率在101只同类型中排名前1/2;灵活策略混合基金里,博时裕益及博时回报,在39只同类基金分别排名前1/5和1/3。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来净值增长率在19只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一;在长期标准债券型基金中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来净值增长率在同类排名前1/7,安心A类排名前1/6,博时信用债纯债A及博时优势收益信用债,在70只同类中排名前1/2;中短期标准债券基金A类里,博时安盈债券A在同类排名第二;普通债券型基金里,博时稳定价值债券A类在同类85只排名前1/9,博时稳定价值债券B类在50只同类排名前10%;可转换债券型基金A类和指数债券型基金A类里,博时转债增强债券A及博时上证企债30ETF在同类基金中排名前1/2;货币市场基金中,博时现金宝货币A在同类146只排名前1/3。

2、其他大事件

2015年12月18日,由东方财富网主办的2015年东方财富风云榜活动在深举行,博时基金荣获"2015年度最优QDII产品基金公司奖"。

2015年12月17日,由华夏日报主办第九届机构投资者年会暨金蝉奖颁奖盛典,博时基金荣获"2015年度最具互联网创新基金公司"。

2015年12月16日,由北京商报主办的2015北京金融论坛,博时基金荣获"品牌推广卓越奖"。

2015年12月11日,由第一财经日报主办的2015金融价值榜典礼在北京金融街威斯汀酒店举行,博时基金荣获"最佳财富管理金融机构"大奖。

2015年12月11日,由21世纪经济报道主办的2015亚洲资本年会在深圳洲际酒店举行,博时基金获评"2015最受尊敬基金公司"、张光华董事长获评"2015中国赢基金任务奖"。

2015年12月4日,由经济观察报主办的2014-2015年度中国卓越金融奖颁奖典礼在北京举行,博时基金凭借旗下固定收益类的出色表现,独家获评"年度卓越固定收益投资团队奖"。

2015年11月26日,由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的CFAC中国金融年会在深召开,博时基金荣获"年度最佳基金公司"大奖。

2015年11月20日,第十一届中国证券市场年会,博时基金获评"年度卓越贡献龙鼎奖"。

2015年11月7日,由每日经济新闻主办的第四届中国上市公司领袖峰会在成都香格里拉举行,博时资本荣获"最具成长性子公司"。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会批准上证企债30交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

9.1.2《上证企债30交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

9.1.3《上证企债30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基金托管人业务资格批件、营业执照

9.1.6关于申请募集上证企债30交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书

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
二〇一六年一月二十日

博时卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十日

§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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时卓越品牌混合(LOF)
场内简称	博时卓越
基金主代码	160512
交易代码	160512
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
报告期末基金份额总额	158,786,021.48份
投资目标	本基金主要通过投资于A股市场经过严格筛选的具有投资价值的品牌上市公司的股票,力争通过主动操作,获取较长期限内的资本增值和资本利得。
投资策略	在大类资产配置上,本基金强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的行业、公司分析和估值分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险/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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	29,555,487.05
2.本期利润	86,009,171.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.5396
4.期末基金资产净值	346,701,793.60
5.期末基金份额净值	2.183

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。

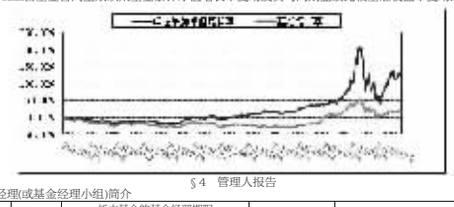
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	35.17%	2.35%	13.76%	1.34%	21.41%	1.01%

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		
兰乔	基金经理	2015-12-23	-	5	2010年从清华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、高级研究员、资深研究员、基金经理助理。现任博时回报混合基金兼博时卓越品牌混合(LOF)基金的基金经理。
王晓冬	基金经理	2014-12-23	-	6	2008年起先后在上海理成资产管理有限公司、兴业证券从事行业研究工作。2011年加入博时基金管理有限公司,历任研究员、资深研究员、基金经理助理。现任博时行业轮动混合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、博时卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)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报告期内基金投资策略和运作分析

A、大类资产配置:

①股票资产配置——报告期内,本基金坚持"价值投资、精选个股"的投资策略。②债券资产配置——报告期内,本基金未配置债券资产。

B、二级资产配置:

股票资产配置——本报告期,本基金坚持"价值投资、精选个股"的策略。重点持有低估值或者转型预期较为强烈(且估值合理)的个股,持仓以地产、轻工、纺织服装、高端制造和金融等行业为主。

C、报告期股票操作回顾:

4季度股市继续反弹,各大指数在11月26日达到反弹的阶段性高点。27日受几大券商遭证监会调查、证监会祭出场外衍生品融资五项禁令等事件性因素影响,市场暴跌。12月份股市波澜不惊,整体表现平淡,成交量略有萎缩。

个股方面,4季度以创业板和各种主题类公司表现最为亮眼,市场热点纷呈,新能源汽车产业链、VR、智能汽车、保险举牌、她经济等相关主题上涨此起彼伏。此外,4季度大量公司合重组成功,复牌之后表现也非常抢眼。

本基金4季度坚持价值投资的理念,对于市场热点公司的参与较少,因此,4季度基金表现较为一般。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为2.183元,累计份额净值为2.349元,报告期内净值增长率为35.17%,同期业绩基准涨幅为13.76%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面,从几大重要经济数据来看,11月份,规模以上工业增加值同比实际增长6.2%,比10月份加快0.6个百分点,1-11月份规模以上工业增加值同比增长6.1%,与1-10月持平。11月工业增加值同比增速反弹,既有基数原因,也有阶段性补库存生产的影响,1-11月份全国固定资产投资49.71万亿元,同比名义增长10.2%,增速与1-10月份持平,其中房地产投资同比名义增长1.3%,增速比1-10月份回落0.7个百分点。11月份社会消费品零售总额2.79万亿元,同比名义增长11.2%,扣除价格因素实际增长11%,与上月持平。11月我国进出口总值3403.82亿美元,同比下滑7.6%,其中出口1972.42亿美元,同比下滑6.8%,进口1431.39亿美元,同比下降8.7%。总的来说,国内宏观经济依然处于低速增长阶段,未来仍有进一步下行动力。

证券市场方面,首先,经历了13-15年为期三年的超级大牛市之后,当前市值、估值合理的公司已经不多了,这一方面降低了投资的预期回报率,另一方面很多公司的资本运作难度加大;其次,宏观经济的长期低迷,不仅对传统产业造成沉重打击,也有可能对新兴产业带来较大的负面影响,明年上市公司盈利难言乐观。总的来说,资本市场面临的环境是比较恶劣的。而唯一能够支撑股市的因素,就是存在于场外的海量资金缺乏有效投资渠道,也就是所谓的"资产荒"。

个股配置方面,本基金将遵循"价值投资,精选个股"原则,回避高估值、高市值、高涨幅的三高公司,通过深入调研和行业分析,精选估值合理、未来有较大成长空间的个股。此外,我们认为虽然注册制即将推行,但是企业并购和转型的大浪潮(尤其是后面会有最来越多的跨国并购)不会那么快结束,因此,我们也致力于挖掘并投资于那些并购和转型预期强烈、估值和市值相对合理的公司。

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	337,368,910.00	92.98
	其中:股票	337,368,910.00	92.98
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	23,621,752.86	6.51
7	其他各项资产	1,846,639.80	0.51
8	合计	362,837,302.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	230,601,910.00	66.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,760,000.00	3.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,962,000.00	7.78
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	58,965,000.00	17.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,080,000.00	2.91
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	337,368,910.00	97.31

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	002394	联发股份	1,850,000	34,465,500.00	9.94
2	600093	禾嘉股份	2,000,000	32,740,000.00	9.44
3	000926	福星股份	1,800,000	30,312,000.00	8.74
4	600382	广东明珠	1,700,000	26,962,000.00	7.78
5	000488	晨鸣纸业	3,000,000	26,760,000.00	7.72
6	000910	大亚科技	1,500,000	24,810,000.00	7.16
7	002133	广宇集团	1,900,000	18,335,000.00	5.29
8	002009	天奇股份	600,000	12,450,000.00	3.59
9	002026	山东威达	700,000	12,334,000.00	3.56
10	300162	雷曼股份	435,500	11,784,630.00	3.40

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投资。

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投资。

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投资。

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没有被监管部门立案调查的情况。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	451,657.35
2	应收证券清算款	761,494.93
3	应收股利	-
4	应收利息	6,361.37
5	应收申购款	627,126.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,846,639.80

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	300162	雷曼股份	11,784,630.00	3.40	筹划重大事项

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	146,889,987.65
报告期基金总申购份额	64,558,254.13
减:报告期基金总赎回份额	52,662,220.30
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	158,786,021.48

§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12月31日,博时基金公司共管理八十五只开放式基金,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。资产管理净值总规模逾3980亿元人民币,其中公募基金资产规模约2064亿元人民币,累计分红约677亿元人民币,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,截至12月31日,指数股票型基金中,博时深证基本面200ETF及深证基本面200ETF联接,今年以来净值增长率在同类型分别排名前1/2和1/3;偏股型的混合基金里,博时创业成长混合及博时卓越品牌混合,今年以来净值增长率在同类型分别排名前1/4和1/3;灵活配置型的混合基金里,裕隆灵活配置混合今年以来净值增长率在101只同类型中排名前1/2;灵活策略混合基金里,博时裕益及博时回报,在39只同类基金分别排名前1/5和1/3。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来净值增长率在19只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一;在长期标准债券型基金中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来净值增长率在同类排名前1/7,安心A类排名前1/6,博时信用债纯债A及博时优势收益信用债,在70只同类中排名前1/2;中短期标准债券基金A类里,博时安盈债券A在同类排名第二;普通债券型基金里,博时稳定价值债券A类在同类85只排名前1/9,博时稳定价值债券B类在50只同类排名前10%;可转换债券型基金A类和指数债券型基金A类里,博时转债增强债券A及博时上证企债30ETF在同类基金中排名前1/2;货币市场基金中,博时现金宝货币A在同类146只排名前1/3。

2、其他大事件

2015年12月18日,由东方财富网主办的2015年东方财富风云榜活动在深举行,博时基金荣获"2015年度最优QDII产品基金公司奖"。

2015年12月17日,由华夏日报主办第九届机构投资者年会暨金蝉奖颁奖盛典,博时基金荣获"2015年度最具互联网创新基金公司"。

2015年12月16日,由北京商报主办的2015北京金融论坛,博时基金荣获"品牌推广卓越奖"。

2015年12月11日,由第一财经日报主办的2015金融价值榜典礼在北京金融街威斯汀酒店举行,博时基金荣获"最佳财富管理金融机构"大奖。

2015年12月11日,由21世纪经济报道主办的2015亚洲资本年会在深圳洲际酒店举行,博时基金获评"2015最受尊敬基金公司"、张光华董事长获评"2015中国赢基金任务奖"。

2015年12月4日,由经济观察报主办的2014-2015年度中国卓越金融奖颁奖典礼在北京举行,博时基金凭借旗下固定收益类的出色表现,独家获评"年度卓越固定收益投资团队奖"。

2015年11月26日,由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的CFAC中国金融年会在深召开,博时基金荣获"年度最佳基金公司"大奖。

2015年11月20日,第十一届中国证券市场年会,博时基金获评"年度卓越贡献龙鼎奖"。

2015年11月7日,由每日经济新闻主办的第四届中国上市公司领袖峰会在成都香格里拉举行,博时资本荣获"最具成长性子公司"。

§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卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)设立的文件

9.1.2《博时卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

9.1.3《博时卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)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博时卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)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
二〇一六年一月二十日

博时转债增强债券型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时转债增强债券	
基金主代码	050019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年11月24日	
报告期末基金份额总额	225,290,346.35份	
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置,并充分利用可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,实施对大类资产的配置,在控制风险并保持良好流动性的基础上