博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金

【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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	博时互联网主题混合
基金主代码	001125
交易代码	001125
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月28日
报告期末基金份额总额	2,987,054,048.85份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极挖掘成长性行业和企业所蕴含的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	基金管理人基于对经济周期及资产价格发展变化的理解，通过定性和定量的方法分析宏观经济、资本市场、政策导向等各方面因素，建立基金管理人对各大类资产收益的绝对或相对预期，进而作出对各大类资产配置权重的判断。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期收益和预期风险低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，具有中高等风险/收益的特征。
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

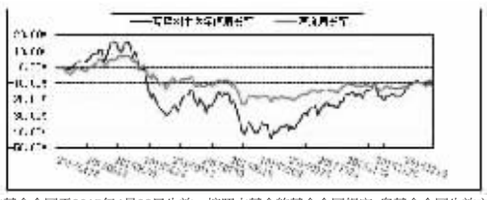
主要财务指标	报告期（2015年10月1日-2015年12月31日）
1.本期已实现收益	273,033,171.25
2.本期利润	855,960,109.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.2806
4.期末基金资产净值	2,687,274,511.87
5.期末基金份额净值	0.900

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	44.69%	2.60%	10.65%	1.01%	34.04%	1.59%

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：本基金合同于2015年4月28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		
招扬	基金经理	2015-04-28	-	8	2004至2007年曾在华为技术有限公司工作。2007年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、资本品研究组主管兼研究员、投资经理、特定资产管理部副总经理。现任股票投资部副总经理兼绝对收益组投资副总监、博时裕益灵活配置混合型证券投资基金、博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
张雪川	基金经理	2015-04-28	-	6	1999年起先后在巨龙公司、华创证券工作。2013年加入博时基金管理有限公司，历任高级研究员、资深研究员、投资经理。现任博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

四季度以来，本基金看好股票市场的机会，从配置上从防御性品种转向弹性品种，同时精选个股，提高了持仓的集中度，重点投向代表中国经济转型方向的新兴产业，大部分仓位集中于云计算、互联网金融、体育、物联网、智能汽车、工业4.0等方向，因此在四季度的市场上涨中获得较好的收益。

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0.900元，累计份额净值为0.900 元，报告期内净值增长率为44.69%，同期业绩基准涨幅为10.65%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从政策层面和外汇层面，IPO重启，注册制加速，人民币加入SDR后开始小幅度贬值等不利因素均已发生并已体现在当前价格中，但股票市场并未出现如前期的连续恐慌下跌，说明市场的内生力量已经初步恢复。从大类资产配置角度看，在股票市场之外难以找到风险收益比较佳的资产，保险公司的频繁举牌也说明某种程度上资产荒是存在的。因此整体来看我们认为16年一季度股票市场机会大于风险，相比仓位，管理人会更加注重于结构。

从微观的公司层面，我们认为两极分化在出现，一批业务成熟，格局稳定，行业天花板明显的传统企业未来将越来越接近债券定价方式，而也存在一大批处于新产业方向的企业因增长的稀缺性持续处于高估值。前者代表了市场的中枢，目前并没有被过分高估，而后者尤其是大量新企业的活跃则是超额收益的主要来源。在近一两个季度我们可以看到诸如云计算/企业级SaaS服务/VR等领域正在开始爆发，而中国企业与全球领先企业处于同一水平，因此我们持续看好新兴产业的投资机会。

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	2,530,333,085.87	93.43
	其中：股票	2,530,333,085.87	93.43
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	170,763,273.24	6.31
7	其他各项资产	7,079,164.49	0.26
8	合计	2,708,175,523.60	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	1,209,113,041.06	44.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	1,162,476,303.11	43.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	158,743,741.70	5.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	2,530,333,085.87	94.16

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	600718	东软集团	8,265,591	256,646,600.55	9.55
2	002413	雷科防务	3,215,770	195,358,027.50	7.27
3	300310	宜通世纪	3,060,652	190,770,439.16	7.10
4	002322	理工监测	7,409,121	187,228,487.67	6.97
5	300059	东方财富	3,359,801	174,810,446.03	6.51
6	000558	莱茵体育	5,730,821	158,743,741.70	5.91
7	001696	宗申动力	11,364,098	157,051,834.36	5.84
8	300348	长亮科技	1,835,819	139,136,722.01	5.18
9	300119	瑞普生物	6,919,018	139,072,261.80	5.18
10	300097	智云股份	2,830,145	131,460,235.25	4.89

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。

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	3,829,753.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,345.40
5	应收申购款	3,206,065.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,079,164.49

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	3,106,669,021.20
报告期基金总申购份额	220,040,561.03
减：报告期基金总赎回份额	339,655,533.38
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,987,054,048.85

§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2054亿元人民币，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基金中分别排名前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ODII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互联网主题灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时互联网主题灵活配置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
二〇一六年一月二十日

深证基本面200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：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	34,229,029.00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10月1日-2015年12月31日）
1.本期已实现收益	-781,515.38
2.本期利润	9,679,054.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.2709
4.期末基金资产净值	44,418,393.24
5.期末基金份额净值	1.2977

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。

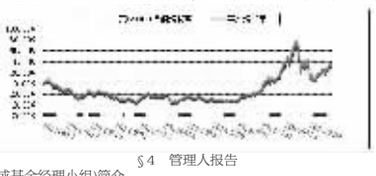
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	25.89%	1.79%	27.68%	1.85%	-1.79%	-0.06%

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		
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、博时黄金ETF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，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，央行进行多次降准降息操作。在经历3季度的大幅深跌之后，在人民币加入SDR、加息预期兑现后，中央经济工作会议决议逐步落实，并把“化解过剩产能、房地产去库存、降低企业成本”作为中长期努力方向。在经济下滑减缓、资金面宽松以及中央稳增长基调等因素的共同作用下，4季度股票市场出现了一波可观的反弹。其中，房地产、电子、计算机、通信等板块涨幅居前，银行、国防军工、交通运输、钢铁行业涨幅靠后。

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。在本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，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期，我们严格按照基金合同要求，在年中指数权重及成份股变动时，尽量降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合与目标指数的结构一致。

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1.2977 元，累计份额净值为1.2977 元，报告期内净值增长率为25.89%，同期业绩基准涨幅为27.68%。

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。尽管前期出现了可观的反弹，但市场投资者的风险偏好仍将偏低，增量资金进入迹象不明显。市场仍处于存量资金博弈阶段，短期市场主题的轮动增多，也导致市场处于震荡格局。总之，当前市场的运行方向较不明朗，总体处于震荡状态，投资者可轻仓参与一些具有催化剂的成长股的投资，待未来市场放量的企稳后加大仓位。

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。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末，本基金已超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元，针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

§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	43,278,377.02	97.02
	其中：股票	43,278,377.02	97.02
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	1,326,303.18	2.97
7	其他各项资产	5,261.23	0.01
8	合计	44,609,941.43	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	48,620.32	0.11
B	采矿业	944,628.78	2.13
C	制造业	25,350,623.33	57.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,243,155.92	2.80
E	建筑业	494,614.86	1.11
F	批发和零售业	1,998,354.89	4.50
G	交通运输、仓储和邮政业	402,482.96	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	400,801.43	0.90
J	金融业	3,346,354.90	7.53
K	房地产业	7,906,635.56	17.80
L	租赁和商务服务业	291,223.70	0.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	597,091.60	1.34
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	254,088.78	0.57
S	综合	-	-
	合计	43,278,377.02	97.43

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	210,782	5,149,404.26	11.59
2	000651	格力电器	92,924	2,076,851.40	4.68
3	000333	美的集团	43,838	1,438,763.16	3.24
4	000858	五粮液	46,027	1,255,616.56	2.83
5	000001	平安银行	93,818	1,124,877.82	2.53
6	001979	招商蛇口	38,626	805,738.36	1.81
7	000568	泸州老窖	28,322	768,092.64	1.73
8	002024	苏宁云商	54,450	732,352.50	1.65
9	000776	广发证券	34,642	673,786.90	1.52
10	000066	长城电脑	31,224	672,564.96	1.51

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本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除广发证券（000776）外，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。

广发证券股份有限公司因存在向不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题，被中国证监会采取责令限期改正的行政监管措施。

广发证券股份有限公司2015年8月26日发布公告称，因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，公司被中国证监会立案调查。

对该股票投资决策程序的说明：

根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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	4,964.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	296.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,261.23

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	000002	万 科A	5,149,404.26	11.59	公告重大事项
2	000066	长城电脑	672,564.96	1.51	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	37,229,029.00
报告期基金总申购份额	1,500,000.00
减：报告期基金总赎回份额	4,500,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	34,229,029.00

§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2054亿元人民币，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基金中分别排名前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ODII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中国证券监督管理委员会批准深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

9.1.2《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《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
二〇一六年一月二十日

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：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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

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	28,932,752.24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，紧密跟踪标的指数国深证基本面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