博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)

【2016】第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§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4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时主题行业混合(LOF)
场内简称	博时主题
基金主代码	160505
交易代码	160505
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2005年1月6日
报告期末基金份额总额	3,382,679,067.73份
投资目标	分享中国城市化、工业化及消费升级进程中经济与资本市场的高速成长,谋求基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金采取价值策略指导下的行业增强型主动投资策略
业绩比较基准	80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数
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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-116,144,163.16
2.本期利润	-390,524,716.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1244
4.期末基金资产净值	6,305,253,343.47
5.期末基金份额净值	1.864

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。

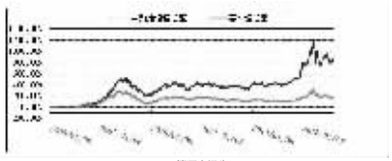
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.67%	2.00%	-12.56%	2.03%	8.89%	-0.03%

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		
王俊	研究部总经理/基金经理	2015-01-22	-	8	2008年从上海交通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、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理。现任研究部总经理兼博时主题行业混合(LOF)基金的基金经理。
蔡滨	基金经理	2014-12-26	-	8.8	2001年起先后在上海振华港机、美国总统轮船(中国)有限公司、美国管理协会、平安证券工作。2009年加入博时基金管理有限公司,历任研究部研究员、研究部副总经理兼资本品组组长。现任博时主题行业混合(LOF)基金兼博时产业新动力混合基金、博时外延增长主题混合基金的基金经理。

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

报告期内本基金在市场下跌期间凭借在低估值/高股息股票上的配置,显著跑赢基准。市场企稳之后,对有色股、钢铁股和部分估值合理的中小市值股票进行了波段操作,取得一定的正收益。报告期末显著提升了对水泥股和养殖股的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金份额净值为1.864元,累计份额净值为4.968元,报告期内净值增长率为-3.67%,同期业绩基准涨幅为-12.56%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1季度宏观经济增速在投资的驱动下明显企稳,我们预计2季度将出现显著的回升,将出现一次典型的库存周期。预计2季度人民币汇率也将处于稳定的状态。

由于3月以来的反弹,使得我们对2季度股票指数的表现变得谨慎,预计市场将维持震荡格局。

2季度我们坚定看好基准投资增速的提升,这将显著提升投资品和必需消费品的需求,因此我们积极配置供给收缩的生猪养殖和部分供给结构较好的投资品。由于估值的原因,对新产品和新商业模式的公司变得谨慎。

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	5,155,866,415.69	81.24
	其中:股票	5,155,866,415.69	81.24
2	固定收益投资	303,658,000.00	4.78
	其中:债券	303,658,000.00	4.78
	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	483,400,881.70	7.62
	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	273,615,981.31	4.31
7	其他各项资产	129,848,338.07	2.05
8	合计	6,346,389,616.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1按市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	797,614,828.60	12.65
B	采矿业	114,020.85	0.00
C	制造业	2,302,055,164.93	36.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	461,789,352.62	7.32
E	建筑业	30,779,170.48	0.49
F	批发和零售业	385,719,858.42	6.12
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	64,625,345.25	1.02
J	金融业	819,736,146.74	13.00
K	房地产业	228,848,495.97	3.63
L	租赁和商务服务业	37,829,490.21	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,501,274.42	0.04
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	24,253,267.20	0.38
S	综合	-	-
	合计	5,155,866,415.69	81.77

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	300498	温氏股份	11,500,704	591,711,220.80	9.38
2	000333	美的集团	15,011,605	463,108,014.25	7.34
3	000651	格力电器	22,233,380	453,338,618.20	7.19
4	601318	中国平安	10,400,054	330,825,717.74	5.25
5	000858	五粮液	10,149,978	285,315,881.58	4.53
6	600585	海螺水泥	15,000,075	253,351,266.75	4.02
7	600036	招商银行	15,000,000	241,350,000.00	3.83
8	600900	长江电力	19,392,205	238,136,277.40	3.78
9	000963	华东医药	3,357,517	234,858,314.15	3.72
10	601139	深圳燃气	22,570,670	188,013,681.10	2.98

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	300,240,000.00	4.76
	其中:政策性金融债	300,240,000.00	4.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,418,000.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	303,658,000.00	4.82

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	150211	15国开11	3,000,000	300,240,000.00	4.76
2	113010	江南转债	34,180	3,418,000.00	0.05

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

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	3,659,160.49
2	应收证券清算款	115,880,818.22
3	应收股利	-
4	应收利息	8,696,276.53
5	应收申购款	1,612,082.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,848,338.07

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	000651	格力电器	453,338,618.20	7.19	公布重大事项

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	2,344,948,978.68
报告期基金总申购份额	1,117,024,798.97
减:报告期基金总赎回份额	79,294,709.92
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,382,679,067.73

§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

在本报告期内,本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2016年3月31日,博时基金公司共管理九十四只开放式基金,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3881亿元人民币,其中公募基金资产规模约1926亿元人民币,累计分红约712亿元人民币,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,2016年一季度,博时旗下基金业绩依然领先。

截至3月31日,标准股票型基金中,博时国企改革主题及丝路主题A类基金,今年以来净值增长率在同类型排名都在前2/5;标准指数股票型基金里,博时上证自然资源ETF和中证银行指数分级基金,今年以来净值增长率在同类排名前1/10,博时裕富沪深300、博时上证超大盘ETF、博时上证50ETF今年以来净值增长率在同类329只基金中排名前1/5;偏股型基金(股票上下限60%-95%),博时主题行业混合LOF今年以来净值增长率在同类375只基金中排名前1/100、博时特许价值混合A、排名前1/5;灵活配置型基金(股票上限95%),博时灵活配置混合A今年以来净值增长率在同类排名前1/10;股债平衡配置混合基金今年以来净值增长率在同类基金排名前3/10。

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71只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一;标准债券型基金里,博时优势收益信用债债券基金,今年以来净值增长率在同类排名前1/10,裕盈纯债债券基金排名前1/5,安盈债券基金A排名前1/4;黄金基金里,博时黄金ETF场外D类排名前1/10;货币市场基金里,现金宝货币A在同类194只排名前1/5,博时外服货币排名前1/10。

ODII基金中,博时标普500ETF联接在今年以来同类型排名前1/7。

2.其他大事件

2016年1月15日,2016年金融理财创新与发展论坛暨第六届"金貔貅"奖颁奖盛典在京举办,博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖;博时"存金宝"获年度金牌创新力金融产品奖。

2016年1月18日,大众证券报"2015中国基金风云榜"上,博时创业成长(050014)荣获2015"最受投资者喜爱基金"奖、博时安丰18个月定开债(160515)荣获2015"最佳固定收益型基金"奖。

2016年3月27日,第十三届中国基金业金牛奖揭晓,博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的"奥斯卡"奖——"固定收益投资金牛基金公司"奖。wind数据显示,2015年博时基金旗下10只纯债产品平均收益率达12.65%,其中6只定期开放债基平均收益率更高达15.17%,博时安丰18个月定期开放债券和博时双月新双双夺得同类基金收益榜冠军。

§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主题行业混合型证券投资基金(LOF)设立的文件

9.1.2《博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

9.1.3《博时主题行业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 博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时主题行业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
二〇一六年四月二十二日

博时转债增强债券型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§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4月21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2016年1月1日起至3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	215,491,249.11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,追求超越业绩比较基准的超额收益。	
投资策略	本产品的类属资产配置策略主要通过自上而下的宏观分析,结合量化的经济指标综合判断经济周期的运行方向,决定类属资产的投资比例。分析的内容包括:影响经济中长期运行的变量,如经济增长模式、中长期经济增长动力;影响宏观经济的周期性变量,如宏观政策、货币供应、CPI等;市场自身的指标,如可转债的转股溢价率和隐含波动率等、股票的估值指标、债券市场的信用利差、期限利差、远期利率等。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,债券型基金的风险高于货币市场基金,低于混合型和股票型基金,属于中低收益/风险的品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时转债增强债券A类	博时转债增强债券C类
下属分级基金的交易代码	050019	050119
报告期末下属分级基金的份额总额	91,752,070.75份	123,739,178.36份

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)	
	博时转债增强债券A类	博时转债增强债券C类
1.本期已实现收益	-5,929,883.13	-8,030,625.64
2.本期利润	-21,805,043.52	-28,199,666.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2310	-0.2252
4.期末基金资产净值	130,033,400.37	173,678,723.78
5.期末基金份额净值	1.417	1.404

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

1.博时转债增强债券A类:

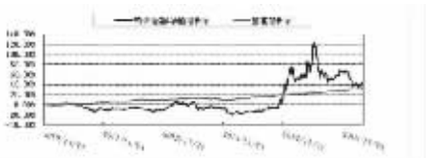
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.60%	1.47%	1.16%	0.05%	-14.76%	1.42%

2.博时转债增强债券C类:

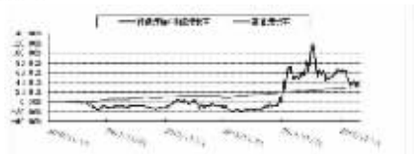
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-13.65%	1.47%	1.16%	0.05%	-14.81%	1.42%

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

1. 博时转债增强债券A类:



2. 博时转债增强债券C类:



§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		
邓欣雨	基金经理	2013-09-25	-	7.7	2008年硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理助理。现任博时转债增强债券基金兼博时双债增强债券基金的基金经理。

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,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

1季度A股市场的表现大跌眼界,1月份指数跌幅达20%,年初多次触发熔断机制,探究原因更多归于人民币贬值及其预期,使人不禁想起去年"811"汇改,可谓是两次不太成功的经历,接下来虽然人民币贬值压力仍在,但短期内决策层在汇率层面应更为谨慎。受股票市场大跌影响,估值本来就偏高的可转债可交换债市场也出现大幅下行,部分个券跌幅也达20%。而回到纯债市场,虽然通胀和社融等数据超出预期,微观层面也显示经济增长短期内有边际改善迹象,但在大量资金配置压力下,特别是银行委外资金,信用债收益率持续下行,绝对收益率已较低,信用利差也处于非常低的位置,这明显不利于未来行情的展开。本基金在估值偏高的可转债市场上的仓位不高,但年初股票仓位偏高,非常遗憾未能规避市场下行风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,本基金A类基金份额净值为1.417元,份额累计净值为1.422元;C类基金份额净值为 1.404元,份额累计净值为1.408元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为-13.60%,C类基金份额净值增长率为-13.65%,同期业绩基准增长率1.16%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到美联储并未在3月份加息,人民币汇率短期内也基本趋于稳定,年初以来国内微观层面确实显示经济有边际上的改善,风险资产的负面因素在减少,在2季度我们应该对权益市场有所期待,但前期经历权益市场的多次下行折磨,市场信心能否恢复仍是问题,另外需关注房地产市场的变化,比如房地产投资是否起来,关于通胀,虽然年初通胀有所超预期,当前市场对后续演化也有分歧,但从核心通胀和易受天气影响的蔬菜价格可持续等方面考虑,倾向于认为2季度通胀仍处于温和可控,当然也可能出现超预期现象而使得通胀成为资本市场的风险点。基于上述综合考虑,2季度在组合操作上倾向于控制纯债市场收益率上行风险,择机加风险资产,重点放在获取风险资产的超额回报上面。

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	39,942,328.44	8.42
	其中:股票	39,942,328.44	8.42
2	固定收益投资	415,083,394.73	87.48
	其中:债券	415,083,394.73	87.48
	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	17,366,280.36	3.66
7	其他各项资产	2,118,895.97	0.45
8	合计	474,510,899.50	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	23,196,621.98	7.64
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	4,515,706.46	1.49
J	金融业	7,032,000.00	2.32
K	房地产业	-	-
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	5,198,000.00	1.71
S	综合	-	-
	合计	39,942,328.44	13.15

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	002273	水晶光电	229,982	8,254,053.98	2.72
2	002049	同方国芯	184,950	8,071,218.00	2.66
3	601377	兴业证券	800,000	7,032,000.00	2.32
4	300291	华录百纳	200,000	5,198,000.00	1.71
5	600654	中安消	199,987	4,515,706.46	1.49
6	603111	康尼机电	150,000	3,802,500.00	1.25
7	000666	经纬纺机	150,000	3,045,000.00	1.00
8	603861	白云电器	1,000	23,850.00	0.01

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	-	-
5	企业短期融资券	30,117,000.00	9.92
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	384,966,394.73	126.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	415,083,394.73	136.67

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	126018	08江铜债	1,537,990	152,660,887.40	50.26
2	132001	14宝钢EB	551,930	68,240,625.20	22.47
3	113008	电气转债	520,450	61,839,869.00	20.36
4	128009	歌尔转债	263,700	33,416,064.00	11.00
5	011517012	15华电SCP012	300,000	30,117,000.00	9.92

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

本基金本报告期末持仓股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末持仓国债期货。

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除兴业证券(601377)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。

兴业证券于2月20日发布公告称,因公司违反了《证券公司融资融券业务内部控制指引》(证监会公告(2011)32号)第十八条第一项和《关于加强证券经纪业务管理的规定》(证监会公告(2010)11号)第四条第二项的相关规定,中国证券监督管理委员会福建监管局对公司采取了行政监管措施。

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	82,968.52
2	应收证券清算款	479,789.04
3	应收股利	-
4	应收利息	1,517,743.37
5	应收申购款	38,395.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,118,895.97

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132001	14宝钢EB	68,240,625.20	22.47
2	113008	电气转债	61,839,869.00	20.36
3	128009	歌尔转债	33,416,064.00	11.00
4	110030	格力转债	12,803,128.00	4.22

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	600654	中安消	4,515,706.46	1.49	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	158,786,021.48
报告期基金总申购份额	108,737,950.00
减:报告期基金总赎回份额	44,926,697.49
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	222,597,273.99

§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2016年3月31日,博时基金公司共管理九十四只开放式基金,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3881亿元人民币,其中公募基金资产规模约1926亿元人民币,累计分红约712亿元人民币,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,2016年一季度,博时旗下基金业绩依然领先。

截至3月31日,标准股票型基金中,博时国企改革主题及丝路主题A类基金,今年以来净值增长率在同类型排名都在前2/5;标准指数股票型基金里,博时上证自然资源ETF和中证银行指数分级基金,今年以来净值增长率在同类排名前1/10,博时裕富沪深300、博时上证超大盘ETF、博时上证50ETF今年以来净值增长率在同类329只基金中排名前1/5;偏股型基金(股票上下限60%-95%),博时主题行业混合LOF今年以来净值增长率在同类375只基金中排名前1/100、博时特许价值混合A、排名前1/5;灵活配置型基金(股票上限95%),博时灵活配置混合A今年以来净值增长率在同类排名前1/10;股债平衡配置混合基金今年以来净值增长率在同类基金排名前3/10。

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71只同类封闭式长期标准债券型基金中排名第一;标准债券型基金里,博时优势收益信用债债券基金,今年以来净值增长率在同类排名前1/10,裕盈纯债债券基金排名前1/5,安盈债券基金A排名前1/4;黄金基金里,博时黄金ETF场外D类排名前1/10;货币市场基金里,现金宝货币A在同类194只排名前1/5,博时外服货币排名前1/10。

ODII基金中,博时标普500ETF联接在今年以来同类型排名前1/7。

2.其他大事件

2016年1月15日,2016年金融理财创新与发展论坛暨第六届"金貔貅"奖颁奖盛典在京举办,博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖;博时"存金宝"获年度金牌创新力金融产品奖。

2016年1月18日,大众证券报"2015中国基金风云榜"上,博时创业成长(050014)荣获2015"最受投资者喜爱基金"奖、博时安丰18个月定开债(160515)荣获2015"最佳固定收益型基金"奖。

2016年3月27日,第十三届中国基金业金牛奖揭晓,博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的"奥斯卡"奖——"固定收益投资金牛基金公司"奖。wind数据显示,2015年博时基金旗下10只纯债产品平均收益率达12.65%,其中6只定期开放债基平均收益率更高达15.17%,博时安丰18个月定期开放债券和博时双月新双双夺得同类基金收益榜冠军。

§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转债增强债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时转债增强债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时转债增强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报告期内博时转债增强债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.1.6博时转债增强债券型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
二〇一六年四月二十二日

博时卓越品牌混合型证券投资基金(LOF)

【2016】第一季度报告

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