博时安心收益定期开放债券型证券投资基金

【2013】第二季度报告

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：２０１３年７月１８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2013年7月17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2013年4月1日起至6月30日止。

§２基金产品概况

基金简称	博时安心收益定期开放债券	
基金主代码	050028	
基金运作方式	契约型基金。本基金以定期开放的方式运作。	
基金合同生效日	2012年12月6日	
报告期末基金份额总额	2,322,705,590.44份	
投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争战胜业绩比较基准，追求基金资产的长期、稳健、持续增值。	
投资策略	1、封闭期投资策略 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。 本基金的主要投资策略是买入与封闭期相匹配的债券，并持有到期，或者是持有回售期与封闭期相匹配的债券，获得本金和票息收入；同时，根据所持债券信用状况变化，进行必要的动态调整；此外，本基金通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益。在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。 2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。	
业绩比较基准	1年期定期存款利率(税后)×150%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和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	中国建设银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	博时安心收益定期开放债券A	博时安心收益定期开放债券C
下属两级基金的交易代码	050028	050128
报告期末下属两级基金的份额总额	1,210,885,428.96份	1,111,820,161.48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(2013年4月1日-2013年6月30日)	
	博时安心收益定期开放债券A	博时安心收益定期开放债券C
1.本期已实现收益	12,611,095.95	10,420,687.97
2.本期利润	4,427,271.73	2,926,641.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0026
4.期末基金资产净值	1,239,899,026.14	1,135,894,007.30
5.期末基金份额净值	1.024	1.022

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

1、博时安心收益定期开放债券A：

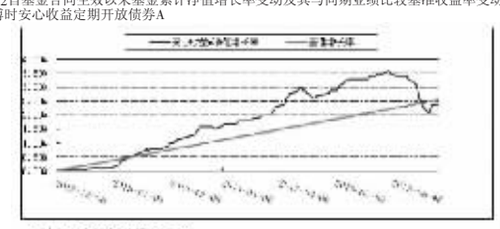
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.11%	1.12%	0.01%	-0.73%	0.10%

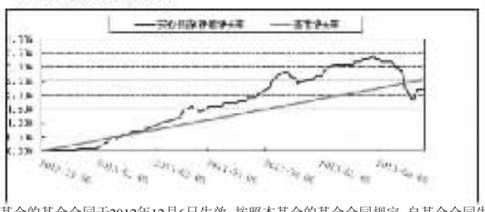
2、博时安心收益定期开放债券C：

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	0.29%	0.11%	1.12%	0.01%	-0.83%	0.10%

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.博时安心收益定期开放债券A





注：本基金的基金合同于2012年12月6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6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十四条“（二）投资范围”、“（六）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	2012-12-6	-	7	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，历任固定收益研究员、特定资产投资经理。现任博时安心收益定期开放债券基金、博时理财30天债券基金和博时岁岁增利一年定期开放债券基金基金经理。

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、《博时安心收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》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

2013年二季度，市场资金面总体维持紧平衡，4月下旬、5月下旬至季末，货币市场利率阶段性高位，隔夜回购利率最高达到30%；现券市场渐趋谨慎，收益率曲线由平坦化演变为倒挂，短端在资金压力下收益率上行幅度大幅超过长端。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金A类基金份额净值为1.024元，份额累计净值为1.024元；C类基金份额净值为1.022元，份额累计净值为1.022元。报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为0.39%，C类基金份额净值增长率为0.29%，同期业绩基准增长率1.12%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6月份以来的资金紧张主要源于结构失衡及预期紊乱。展望三季度，从大的背景看，经济大概率继续下行，政策也并不试图刺激经济，通胀很难超预期，债市投资的基本面仍然较好。其次，市场流动性的状态取决于央行的态度，未来央行的政策操作将中性偏紧，资金成本较上半年大概率上行。再次，从估值来看，在资金面的冲击下，短端收益率超调，中长端和高评级券的价值已有所修复。但资金面紧张导致的去杠杆行为可能会持续一段时间，资金成本制约下的债市反弹也相对有限。总体上我们将保持谨慎乐观的态度。因此，本基金组合策略上维持短久期为主要策略。

§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	3,743,318,485.00	93.26
	其中：债券	3,743,318,485.00	93.26
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	152,937,202.51	3.81
6	其他各项资产	117,638,422.39	2.93
7	合计	4,013,894,109.90	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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,759,234,485.00	74.05
5	企业短期融资券	1,422,464,000.00	59.87
6	中期票据	561,620,000.00	23.64
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,743,318,485.00	157.56

5.5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

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	0982052	09中远MTN1	2,000,000	197,680,000.00	8.32
2	122213	12松建化	1,500,000	153,000,000.00	6.44
3	112090	12中兴01	1,325,030	130,886,463.40	5.51
4	041251041	12沙钢CP002	1,300,000	130,286,000.00	5.48
5	122079	11上港02	1,148,150	115,446,482.50	4.86

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	193,925.95
2	应收证券清算款	32,099,421.93
3	应收股利	-
4	应收利息	85,345,074.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,638,422.39

5.9.4 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。

5.9.5 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。

5.9.6 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

项目	博时安心收益定期开放债券A	博时安心收益定期开放债券C
本报告期期初基金份额总额	1,210,885,428.96	1,111,820,161.48
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,210,885,428.96	1,111,820,161.48

§７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2013年6月30日，博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金，并且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，公募基金资产规模逾1065.69亿元人民币，累计分红602.92亿元人民币，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，2013年二季度，股票型基金中，截至6月28日，博时医疗保健今年以来净值增长率在328只标准型股票基金中排名前1/3。混合灵活配置型基金方面，博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名第8。

固定收益方面，博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名第1；博时裕祥分级债券A今年以来收益率在19只封闭式债券型分级子基金《优先份额》中名列第2。

海外投资方面，博时标普500今年以来净值增长率在15只QDII指数股票型基金中排名第2，该基金成立以来的涨幅达到15.94%。

2、客户服务

2013年二季度，博时基金共举办各类渠道培训活动逾450场，参加人数近1.2万人。

3、其他大事件

1）2013年4月，在股市动态分析杂志主办的“2012基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜”评选活动中，博时标普500指数基金获得“2012年基金新产品营销策划案例奖”。

2）2013年4月10日，由上海证券报举办的第十届“金基金奖”颁奖典礼在上海举行，博时基金荣获金“基金十年？卓越公司奖”，博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获“金基金十年？投资回报奖”，博时主题行业基金荣获“金基金？股票型基金奖5年期奖”，博时裕阳封闭荣获“金基金？分红基金奖3年期奖”。

3）2013年4月27日，由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的2013中国网·普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选“年度最佳财富管理基金公司”。

4）2013年6月26日，世界品牌实验室（WBL）在京发布2013年度（第十届）《中国500最具价值品牌》排行榜，博时基金以81.65亿的品牌价值位列第216名，品牌价值一年内提升了近20亿元，排名逐年上升。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

8.1.1中国证券监督管理委员会批准博时安心收益定期开放债券基金设立的文件

8.1.2《博时安心收益定期开放债券基金基金合同》

8.1.3《博时安心收益定期开放债券基金托管协议》

8.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

8.1.5报告期内博时安心收益定期开放债券基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2存放地点：

基金管理人、基金托管人处

8.3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
２０１３年７月１８日

博时安盈债券型证券投资基金

【2013】第二季度报告

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：２０１３年７月１８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2013年7月17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2013年4月23日起至6月30日止。

§２基金产品概况

基金简称	博时安盈债券	
基金主代码	000084	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年4月23日	
报告期末基金份额总额	1,841,524,402.20份	
投资目标	通过基金管理人对以短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断，选择具有投资价值的债券，严格控制风险，力争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，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析和预测众多的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等，另一方面，本基金将对短期债券市场收益率曲线和信用利差的变化进行深入细致分析，从而得出对市场走势和波动特征的判断。在此基础上，确定资产在不同行业、不同品种的债券之间的配置比例。	
业绩比较基准	中国人民银行公布的1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，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	博时安盈债券A	博时安盈债券C
下属两级基金的交易代码	000084	000085
报告期末下属两级基金的份额总额	739,600,469.15份	1,101,923,933.05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(2013年4月23日-2013年6月30日)	
	博时安盈债券A	博时安盈债券C
1.本期已实现收益	6,081,570.83	16,624,170.80
2.本期利润	5,759,082.52	15,203,472.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0048
4.期末基金资产净值	744,146,847.33	1,107,739,801.71
5.期末基金份额净值	1.006	1.005

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

1、博时安盈债券A：

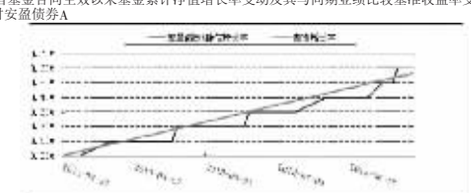
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.60%	0.03%	0.57%	0.01%	0.03%	0.02%

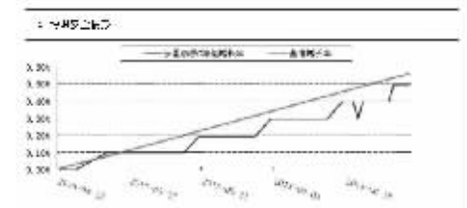
2、博时安盈债券C：

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	0.50%	0.04%	0.57%	0.01%	-0.07%	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

1.博时安盈债券A





注：本基金合同于2013年4月23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6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关约定。本报告期末本基金的建仓期尚未结束。

§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		
张勇	基金经理/固定收益部副总经理	2013-4-23	-	9	2001年起先后在南京市商业银行北清支行、南京市商业银行资金营运中心工作。2003年12月加入博时基金管理有限公司，历任债券交易员、债券交易员兼任博时现金收益货币基金经理助理。现任固定收益部副总经理，兼任博时现金收益货币基金、博时策略混合基金、博时稳定价值债券基金、博时安盈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、《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》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

2季度，国内经济继续维持“弱复苏”局面。社会融资总量创出近年新高，通胀压力不大。资金面在4-5月保持宽松，进入6月，资金面骤然紧张，货币市场利率不断高企，回购利率创出近10年新高。各大类资产价格均出现明显下跌。货币市场利率高企，可以为新增资金带来高额回报，而对存量资产则是不利影响。本基金4月末成立，当时货币市场利率处于较低水平，我们选择了保留现金的策略。该策略在6月的资金紧张之中，获取了大量的超额回报，同时，还避免了6月债券价格下跌带来的基金净值下跌。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，安盈债券A基金份额净值为1.006元，份额累计净值为1.006元；安盈债券C基金份额净值为1.005元，份额累计净值为1.005元。报告期内，安盈债券A基金份额净值增长率为0.60%，安盈债券C基金份额净值增长率为0.50%，业绩比较基准涨幅为0.57%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下个季度，政府对金融行业“降杠杆”态度明确，资金面较上半年会显紧张，货币市场利率中枢有望上升。对于该低风险基金而言，我们仍然会逐步缓慢建仓，把握好下半年货币市场利率波动带来的机遇。

§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	378,555,000.00	17.09
	其中：债券	378,555,000.00	17.09
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,398,501,707.75	63.15
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	435,055,712.67	19.64
6	其他各项资产	2,495,870.16	0.11
7	合计	2,214,608,290.58	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未持有股票。

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

报告期末本基金未持有股票。

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	149,655,000.00	8.08
	其中：政策性金融债	149,655,000.00	8.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	228,900,000.00	12.36
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	378,555,000.00	20.44

5.5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

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	110234	11国开34	1,000,000	99,940,000.00	5.40
2	130218	13国开18	500,000	49,715,000.00	2.68
3	011315002	13中铝业SCP002	500,000	49,610,000.00	2.68
4	071305002	13证金CP002	400,000	39,948,000.00	2.16
5	041361033	13萧国资CP001	400,000	39,848,000.00	2.15

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

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	-
4	应收利息	2,152,581.57
5	应收申购款	343,288.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,495,870.16

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.9.6 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

项目	博时安盈债券A	博时安盈债券C
基金合同生效日(2013年4月23日)基金份额总额	999,977,258.87	3,464,577,689.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,135,334.48	2,608,611.21
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	264,512,124.20	2,365,262,368.14
本报告期期末基金份额总额	739,600,469.15	1,101,923,933.05

§７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2013年6月30日，博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金，并且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，公募基金资产规模逾1065.69亿元人民币，累计分红602.92亿元人民币，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，2013年二季度，股票型基金中，截至6月28日，博时医疗保健今年以来净值增长率在328只标准型股票基金中排名前1/3。混合灵活配置型基金方面，博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名第8。

固定收益方面，博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名第1；博时裕祥分级债券A今年以来收益率在19只封闭式债券型分级子基金《优先份额》中名列第2。

海外投资方面，博时标普500今年以来净值增长率在15只QDII指数股票型基金中排名第2，该基金成立以来的涨幅达到15.94%。

2、客户服务

2013年二季度，博时基金共举办各类渠道培训活动逾450场，参加人数近1.2万人。

3、其他大事件

1）2013年4月，在股市动态分析杂志主办的“2012基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜”评选活动中，博时标普500指数基金获得“2012年基金新产品营销策划案例奖”。

2）2013年4月10日，由上海证券报举办的第十届“金基金奖”颁奖典礼在上海举行，博时基金荣获金“基金十年？卓越公司奖”，博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获“金基金十年？投资回报奖”，博时主题行业基金荣获“金基金？股票型基金奖5年期奖”，博时裕阳封闭荣获“金基金？分红基金奖3年期奖”。

3）2013年4月27日，由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的2013中国网·普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选“年度最佳财富管理基金公司”。

4）2013年6月26日，世界品牌实验室（WBL）在京发布2013年度（第十届）《中国500最具价值品牌》排行榜，博时基金以81.65亿的品牌价值位列第216名，品牌价值一年内提升了近20亿元，排名逐年上升。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

8.1.1中国证监会批准博时安盈债券型证券投资基金设立的文件

8.1.2《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》

8.1.3《博时安盈债券型证券投资基金托管协议》

8.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

8.1.5报告期内博时安盈债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.2存放地点：

基金管理人、基金托管人处

8.3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
２０１３年７月１８日

国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2013】第二季度报告

基金管理人：国金通用基金管理有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
报告送出日期：２０１３年７月１８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2013年7月17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，投资者在做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2013年4月1日起至6月30日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	国金通用国鑫发起
交易代码	762001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月28日
报告期末基金份额总额	57,815,798.22份
投资目标	本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择，追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。
投资策略	本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面，本基金将综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在固定收益类资产投资方面，本基金会深入研究分析宏观经济和利率趋势，选择流动性好，到期收益率与信用质量相对较高的债券品种进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	国金通用基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

注：本基金为发起式基金。

§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（2013年4月1日 - 2013年6月30日）
1.本期已实现收益	3,154,573.40
2.本期利润	-2,193,972.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0334
4.期末基金资产净值	56,094,867.98
5.期末基金份额净值	0.9702

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

2、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	-4.42%	1.32%	-6.81%	0.87%	2.39%	0.45%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

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：1、本基金基金合同生效日为2012年8月28日，至本报告期期末，本基金运作时间未满一年。

3.3 其他指标

§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		
吴强	本基金基金经理、投资研究部总经理	2012年8月28日	-	13	吴强先生，江西财经大学学士，上海财经大学硕士。历任上海创达投资管理公司研究员、上海高维化学公司总经理助理、嘉新水泥（中国）控股股份有限公司证券部经理、国金通用基金管理有限公司行业分析师、投资研究部总经理。
徐艳芳	本基金基金经理	2013年2月27日	-	4	徐艳芳女士，中国青年政治学院学士、清华大学硕士，历任香港昊天财经公关公司咨询师，英大泰和财产保险股份有限公司投资经理、国金通用基金管理有限公司固定收益投资分析师。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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《国金通用基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，对持仓和交易等重大非公开投资信息采取保密措施。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，基金交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

在本报告期，本基金管理人仅管理有一只基金产品，不存在非公平交易情况。