博时主题行业股票证券投资基金

【2013】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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2013年10月23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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时主题行业股票(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	5,946,584,291.67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	本基金是一只主动型的股票基金，基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下，谋求实现基金资产的长期稳定增长。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	18,787,467.15
2.本期利润	777,691,966.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1275
4.期末基金资产净值	9,964,489,434.67
5.期末基金份额净值	1.676

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。

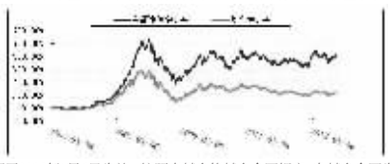
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	8.27%	1.33%	9.04%	1.09%	-0.77%	0.24%

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2005年1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十二条“(五)投资范围”、“(九)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		
邓晓峰	基金经理/权益投资总部董事总经理/股票投资部总经理/价值组投资总监	2007-3-14	-	12	1996年起先后在深圳市银业工贸有限公司、国泰君安证券股份有限公司工作。2005年加入博时公司，历任基金经理助理、社保股票基金经理。现任权益投资总部董事总经理、股票投资部总经理、价值组投资总监，兼任博时主题行业股票(LOF)基金经理、社保股票基金基金经理。

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、《博时主题行业股票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

一、市场回顾

3季度，市场处于回升状态，而创业板大幅上涨。6月钱荒，国内外各位专家纷纷跳出来加入大合唱：神州即将陆沉、危机一触即发！但中国经济7月份开始回升，并连续3个月处上升状态，转变之快甚至政府都还没有来得及采用刺激性措施。市场初期还对经济的走势存有疑虑，但后续的数据强化了市场信心，A股表现良好。

二、三季度基金组合管理回顾

我们增加了汽车、家电业、油田服务等估值明显偏低公司的配置。白酒行业并未见底，但部分公司的股价已充分反映了负面的预期，我们开始逐渐买入部分潜力公司。我们也增加了医药行业中低估值公司的比例。同时，我们降低了大幅上涨的IT行业配置并继续回避高估值的创业板公司。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2013年9月30日，本基金份额净值为1.676元，累计净值为3.514元。报告期内，本基金份额净值增长率为8.27%，同期业绩基准增长率为9.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

难以想象，作为全球第二大经济体，它会1季度复苏、2季度衰退、3季度又复苏、4季度再次收缩。但这却是各位专家对中国经济的描述！从历史上看，经济学家和各类专家对中国经济的预测准确率不高，描述性也并不精确。可能的事实是，中国经济正在按自己的轨迹平稳运行，没有大起大落。

但市场却以中国经济的悲观预期作为缺省选项，直到被证伪。

今年，我们从各方面观察到企业盈利的增长与GDP增速下降的脱钩情况的出现，需要思考这种情况会不会成为新的常态？这背后反映的是总需求稳定扩张与一致性悲观预期导致供给增加速度放缓的背离。我们不必太悲观。

但从监筹股估值水平上看，现有的价格水平说明市场认为经济崩溃就在眼前，我们认为市场会做出修正。

§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	9,299,721,432.80	93.00
	其中：股票	9,299,721,432.80	93.00
2	固定收益投资	4,377,359.70	0.04
	其中：债券	4,377,359.70	0.04
	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	655,426,963.51	6.55
6	其他各项资产	40,411,515.09	0.40
7	合计	9,999,937,271.10	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	-	-
B	采矿业	150,779,391.48	1.51
C	制造业	2,894,615,272.09	29.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,523,055,452.92	15.28
E	建筑业	386,400,000.00	3.88
F	批发和零售业	54,214,304.00	0.54
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	5,001,907.15	0.05
J	金融业	3,469,949,251.61	34.82
K	房地产业	619,516,448.35	6.22
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	196,189,405.20	1.97
	合计	9,299,721,432.80	93.33

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	601318	中国平安	25,199,471	899,621,114.70	9.03
2	600886	国投电力	228,906,904	844,666,475.76	8.48
3	601601	中国太保	43,253,688	759,967,298.16	7.63
4	600104	上汽集团	46,524,783	629,480,313.99	6.32
5	000002	万 科A	60,499,970	552,364,726.10	5.54
6	600036	招商银行	46,000,000	502,320,000.00	5.04
7	000333	美的集团	10,340,762	447,134,548.88	4.49
8	600016	民生银行	42,355,708	404,920,568.48	4.06
9	601668	中国建筑	120,000,000	386,400,000.00	3.88
10	600690	青岛海尔	28,872,975	384,588,027.00	3.86

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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,377,359.70	0.04
8	其他	-	-
9	合计	4,377,359.70	0.04

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	110023	民生转债	41,370	4,377,359.70	0.04

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 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。

5.10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(元)
1	存出保证金	1,268,643.49
2	应收证券清算款	37,174,624.50
3	应收股利	-
4	应收利息	150,390.56
5	应收申购款	1,817,856.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,411,515.09

5.10.4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	110023	民生转债	4,377,359.70	0.04

5.10.5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	600690	青岛海尔	384,588,027.00	3.86	停牌股票

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

本报告期期初基金份额总额	6,229,216,933.09
本报告期基金总申购份额	204,001,969.59
减：本报告期基金总赎回份额	486,634,611.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,946,584,291.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013年9月3日，我司收到中国证监会下发的《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》，责令我司进行为期6个月的整改。我司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升公司内部控制和风险管理的能力，并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

§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股票证券投资基金设立的文件

9.1.2 《博时主题行业股票证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时主题行业股票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 博时主题行业股票证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时主题行业股票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
2013年10月23日

博时裕富沪深300指数证券投资基金

【2013】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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2013年10月23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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时沪深300指数
基金主代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月26日
报告期末基金份额总额	12,922,218,013.58份
投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在95%以上，并保持年跟踪误差在4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用被动式投资的方法，按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为：股票资产为95%以内，现金和短期债券资产比例不低于5%。
业绩比较基准	95%×沪深300指数＋5%×银行同业存款利率
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-284,464,300.24
2.本期利润	807,001,877.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0611
4.期末基金资产净值	8,699,817,480.88
5.期末基金份额净值	0.6732

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。

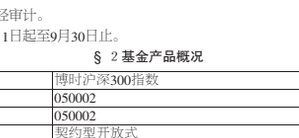
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	9.80%	1.38%	9.02%	1.36%	0.78%	0.02%

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2003年8月26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十六条（五）投资对象、（九）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		
王红欣	基金经理/ETF及量化投资组投资总监	2013-1-9	-	19	1994年起先后在RXR期货管理公司、Aeltus投资管理公司、Putnam投资公司、Acadian资产管理公司、易方达资产管理(香港)有限公司工作。2012年10月加入博时基金管理有限公司，担任股票投资部ETF及量化投资组投资总监、博时标普500指数型证券投资基金、博时裕富沪深300指数证券投资基金基金经理。
胡俊敏	基金经理	2012-11-22	2013-9-13	6	1996年起先后在哈佛大学、惠普安捷伦科技、汤姆森金融公司、贝莱德全球金融公司工作，2011年2月加入博时基金管理有限公司，历任博时特许价值基金、博时上证自然资源ETF基金及其联接基金、博时沪深300指数基金、博时标普500指数基金的基金经理。

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、《博时裕富沪深300指数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年三季度，国内企业对经济底部有了一定共识，企业补库存需求启动，在PMI、工业生产、进口、房地产投资、BDI等一系列宏观经济数据企稳回升利好推动下，指数触底，缓慢回升。在此期间，虽然周期股一定程度上的反弹，自贸区，农地流转等主题板块仍然表现十分抢眼，传媒，TMT，商业贸易等行业涨幅居前。以上现象说明：A股市场对新政府经济政策还处于探索阶段，对未来的经济走向仍未形成共识。与此同时，美国经济数据持续改善，但并未明显超预期，QE退出的步伐有一定放缓，流动性的压力有一定放缓，中国央行在操作上未见大动作，以维稳为主。在投资操作上我们依靠在各行业内精选个股的量化策略，以多方位的估值和基本面逻辑为主，结合个股短期表现，精选估值水平低，公司盈利持续性好、成长性好的个股，进行沪深300指数增强运作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日，本基金份额净值为0.6732元，累计份额净值为2.6532元，报告期内净值增长率为9.80%，同期业绩基准涨幅为9.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，我们认为以结构性行情为主，不确定性因素仍然较多，美国作为全球复苏最为确定的经济体，全球资本向美国流动的趋势不可避免，随着QE政策退出步伐逐渐清晰，大宗商品价格将进一步承压。国内市场建议关注新政府的城镇化政策，和十八届三中全会前后政府对经济政策的表态。从指数上看，有一定的估值修复的机会，不过在预期还未明朗前，市场还是以结构行情为主，多空双方均有机会，看好交运设备，TMT，家电，食品饮料板块。

§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	8,161,302,076.89	93.60
	其中：股票	8,161,302,076.89	93.60
2	固定收益投资	78,167,991.87	0.90
	其中：债券	78,167,991.87	0.90
	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	476,733,304.26	5.47
6	其他各项资产	3,216,099.61	0.04
7	合计	8,719,419,472.63	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	13,842,522.00	0.16
B	采矿业	585,415,209.03	6.73
C	制造业	2,919,431,003.29	33.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	265,758,048.59	3.05
E	建筑业	342,822,835.87	3.94
F	批发和零售业	300,558,350.81	3.45
G	交通运输、仓储和邮政业	161,470,091.99	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,653,268.46	2.67
J	金融业	2,701,320,035.76	31.05
K	房地产业	447,664,787.43	5.15
L	租赁和商务服务业	43,438,691.66	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	112,923,050.68	1.30
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	27,069,191.32	0.31
S	综合	6,934,990.00	0.08
	合计	8,161,302,076.89	93.81

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	600016	民生银行	36,184,943	345,928,055.08	3.98
2	600036	招商银行	26,457,760	288,918,739.20	3.32
3	601166	兴业银行	19,552,519	218,401,637.23	2.51
4	601318	中国平安	5,653,647	201,835,197.90	2.32
5	600837	海通证券	14,466,935	180,981,356.85	2.08
6	601088	中国神华	9,660,939	161,047,853.13	1.85
7	600000	浦发银行	15,806,501	159,487,595.09	1.83
8	600030	中信证券	12,516,584	153,828,817.36	1.77
9	000002	万 科A	16,775,462	153,159,968.06	1.76
10	601328	交通银行	29,276,875	125,890,562.50	1.45

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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	78,167,991.87	0.90
8	其他	-	-
9	合计	78,167,991.87	0.90

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	113002	工行转债	704,720	78,104,117.60	0.90
2	128002	东华转债	514	63,874.27	0.00

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

本基金本报告期末未持仓股指期货。

5.9 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仓国债期货。

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(元)
1	存出保证金	948,641.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	606,418.00
4	应收利息	151,158.87
5	应收申购款	1,509,880.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,216,099.61

5.10.4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	113002	工行转债	78,104,117.60	0.90

5.10.5报告期末前十名股票中在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

本报告期期初基金份额总额	13,933,219,117.93
本报告期基金总申购份额	431,082,655.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,442,083,760.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,922,218,013.58

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013年9月3日，我司收到中国证监会下发的《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》，责令我司进行为期6个月的整改。我司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升公司内部控制和风险管理的能力，并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

§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博时裕富沪深300指数证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时裕富沪深300指数证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时裕富沪深300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博时裕富沪深300指数证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时裕富沪深300指数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
2013年10月23日

博时月月薪定期支付债券型证券投资基金

【2013】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：招商银行股份有限公司
报告送出日期：2013年10月23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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年10月22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7月25日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时月月薪定期支付债券
基金主代码	000246
交易代码	000246
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月25日
报告期末基金份额总额	444,415,188.32份
投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争为投资人提供稳定的现金流收入，争取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，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。
业绩比较基准	3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，预期收益和预期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	招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(2013年7月25日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	3,213,481.26
2.本期利润	2,538,256.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	446,953,444.45
5.期末基金份额净值	1.006

注：本基金合同于2013年7月25日生效。

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。

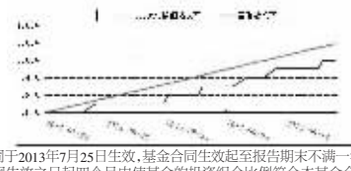
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.60%	0.03%	0.79%	0.01%	-0.19%	0.02%

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2013年7月25日生效，基金合同生效起至报告期末不满一年。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起四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。截至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		
陈凯杨	基金经理	2013-7-25	-	8	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天债券型证券投资基金、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金的基金经理。
魏桢	基金经理	2013-7-25	-	5	2004年8月至2008年6月在厦门市商业银行工作，任资金营运部债券投资交易岗。2008年7月17日入职博时基金管理有限公司，任交易部债券交易员。2012年9月24日起调任固定收益部固定收益研究员。现任博时理财30天债券型证券投资基金基金、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)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、《博时月月薪定期支付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

经济基本面在8、9月份有一个小反弹，但是总体上来看，亮点很少，平稳为主，对债券市场影响中性。三季度以来，货币政策从极度收紧转变为中性或者中性偏紧状态，7天回购利率逐月回落，平均下来大概在4%左右，基本符合市场预期。但是银行在经历了6月底那一波“钱荒”以后，投资行为发生明显改变，逐渐降低了对利率债的配置需求，转而寻求更高收益的资产。总体上，我们按照既定的思路在季度初就降仓位、降杠杆、减低评级信用债，同时在9月份加仓匹配短期定期存款锁定收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日，本基金份额净值为1.006元，累计份额净值为1.006元，报告期内净值增长率为0.60%，同期业绩基准涨幅为0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望