博时标普500指数型证券投资基金

【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:中国工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。

基金托管人中国工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1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	博时标普500指数(QDII)
基金主代码	050025
交易代码	050025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月14日
报告期末基金份额总额	162,889,786.07份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的85%。其余部分将主要投资于固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具。 本基金的股票资产主要采取完全复制法,即完全按照标的指数成份股的构成及其权重构建基金股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应地调整。
业绩比较基准	标普500净总收益指数(S&P 500 Index(Net TR))收益率
风险收益特征	属于高风险/高收益特征的开放式基金
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
境外资产托管人英文名称	The Bank of New York Mellon
境外资产托管人中文名称	纽约梅隆银行

§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	1,068,706.07
2.本期利润	5,563,645.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0395
4.期末基金资产净值	192,197,600.22
5.期末基金份额净值	1.1799

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。

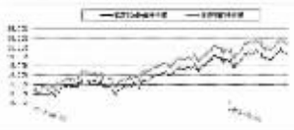
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.38%	0.60%	4.56%	0.60%	-0.18%	-

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:本基金的基金合同于2012年6月14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六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第11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		
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	2012-11-13	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境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3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、《博时标普500指数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。

4.4公平交易专项说明

4.4.1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。

4.4.2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。

4.5报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

本基金主要投资于标普500净总收益指数(S&P 500 Index(Net TR))成份股及备选成份股,以期获得标的指数所表征的市场平均水平的投资收益。截至季末,基金投资于标的指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的85%,投资于现金的比例不低于基金资产净值的5%。

本基金的股票资产主要采取完全复制法,即完全按照标的指数成份股的构成及其权重构建基金股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应地调整。为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差,本基金用少量资产投资标的指数股指期货,以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。

4.5.2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1.1799元,累计份额净值为1.2079元,报告期内净值增长率为4.38%,同期业绩基准涨幅为4.56%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年3季度,美国经济基本面仍然保持稳步复苏的步调,失业率得到逐步的改善,企业盈利加速在增长,通胀在可控范围之内。汽车和房地产仍然是美国经济增长的支撑。在本季度,一方面对经济复苏的信心,让标普500指数屡创历史新高;另一方面,对QE退出的担忧,让股指大幅回调。

展望第4季度,美国市场面临的主要问题是债务上限问题。近期美国政府停摆对经济影响有限,美国政府如何解决债务问题才是关键。由于政治的不确定性,美联储的货币政策也同样具有不确定性,QE或将于更晚的时间退出。

总体而言,第4季度美国政治层面具有不确定性,但经济复苏的支撑仍然来自于基本面及盈利的改善。如若4季度的经济数据持续好转,美国仍然具有长期配置的价值。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	179,860,521.58	89.20
	其中:普通股	176,324,502.02	87.45
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	3,536,019.56	1.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中:远期	-	-
	期货	0.00	0.00
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,823,041.78	9.34
8	其他各项资产	2,942,659.15	1.46
9	合计	201,626,222.51	100.00

注:金融衍生品投资项下的期货投资,在当日无负债结算制度下,结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益,则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款(结算所得的持仓损益)相抵消后的净额为0,具体投资情况详见下表:

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值(人民币元)	公允价值变动(人民币元)
股指期货	ESU3	S&P500 EMINI FUT Dec13	25	12,866,995.50	-59,558.75
总额合计					-59,558.75
减:可抵消期货暂收款					-59,558.75
股指期货投资净额					0.00

5.2报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国纽约证券交易所股票	179,860,521.58	93.58
合计	179,860,521.58	93.58

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息科技	32,202,109.37	16.75
金融	29,253,284.59	15.22
医疗保健	23,400,123.42	12.18
非必需消费品	22,428,534.95	11.67
工业	19,297,477.09	10.04
能源	18,829,483.37	9.80
必需消费品	18,074,048.63	9.40
原材料	6,333,660.01	3.30
公用事业	5,680,452.29	2.96
电信业务	4,361,347.86	2.27
合计	179,860,521.58	93.58

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	-	AAPL US	-	-	1,779	5,214,353.96	2.71
2	EXXON MOBIL CORP	-	XOM US	-	-	8,619	4,559,226.22	2.37
3	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	-	-	14,843	3,039,696.19	1.58
4	GOOGLE INC-CL A	-	GOOG US	-	-	547	2,945,646.79	1.53
5	JOHNSON & JOHNSON	-	JNJ US	-	-	5,518	2,940,929.12	1.53
6	GENERAL ELECTRIC CO	-	GE US	-	-	19,941	2,928,848.73	1.52
7	CHEVRON CORP	-	CVX US	-	-	3,783	2,825,832.91	1.47
8	PROCTER & GAMBLE CO/THE	-	PG US	-	-	5,362	2,491,867.89	1.30
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	-	BRK/B US	-	-	3,524	2,459,256.81	1.28
10	WELLS FARGO & CO	-	WFC US	-	-	9,461	2,403,428.54	1.25

注:所用证券代码采用当地市场代码。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Dec13	-59,558.75	-0.03

注:期货投资采用当日无负债结算制度,其公允价值与相关的期货结算暂收款(结算所得的持仓损益)相抵销后的净额为0。具体投资情况可参见5.1报告期末基金资产组合情况下的备注。

5.9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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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(人民币元)
1	存出保证金	537,950.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	185,356.30
4	应收利息	2,169.36
5	应收申购款	2,217,183.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,942,659.15

5.10.4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。

5.10.5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。

5.10.6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	105,843,065.05
本报告期基金总申购份额	84,362,222.30
减:本报告期基金总赎回份额	27,315,501.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	162,889,786.07

§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标普500指数型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时标普500指数型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时标普500指数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博时标普500指数型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时标普500指数型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

博时安盈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:中国工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。

基金托管人中国工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1日起至9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	1,154,273,407.07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	486,114,016.45份	668,159,390.62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7月1日-2013年9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	6,462,375.22	8,203,255.29
2.本期利润	6,651,038.95	8,423,015.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.0109	0.0097
4.期末基金资产净值	494,459,691.78	678,291,035.06
5.期末基金份额净值	1.017	1.015

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:

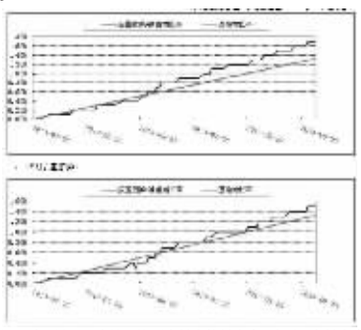
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	0.04%	0.76%	0.01%	0.33%	0.03%

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	1.00%	0.04%	0.76%	0.01%	0.24%	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。

§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/固定收益总部现金管理组投资总监	2013-4-23	-	9.5	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、现任固定收益总部现金管理组投资总监,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

三季度美国经济延续今年以来复苏的良好势头,尽管联储最终未如市场预期开始减少国债购买,但这QE退出只是时间的问题;新兴经济体尤其是东南亚国家资产价格完全重估,从汇率、股票到债券价格都经历了剧烈的调整;国内经济在补库存和投资的支撑下季节性企稳,复苏力度和可持续性都难言乐观,调结构的压力愈发明显;三季度国内债券市场处在钱荒的余震中,商业银行配置力量转移和利率债供给高峰的冲击下利率产品收益率大幅上升,信用债继续分化,部分信用资质恶化的信用债逐步形成垃圾债券市场雏形,可转债估值便宜,但整体上属于震荡行情。

6月的钱荒虽然得以缓解,但央行"惩长放短"的操作,使得货币市场利率始终在高位徘徊。本基金以短融为主要投资标的,但前期我们坚持谨慎投资,债券的比例并不高,在本季度,随着收益的上行,我们逐步加大了对中等评级短融的投资。

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A类基金份额净值为1.017元,份额累计净值为1.017元;C类基金份额净值为1.015元,份额累计净值为1.015元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为1.09%,C类基金份额净值增长率为1.00%,同期业绩基准增长率0.76%。

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,资金价格的上行是利率市场化的长期趋势。本基金的主要投资标的是货币市场工具,在此背景下,将始终受益。我们将在下一个季度,继续加大对短融的投资,置换出前期大量的银行存款。

§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	718,570,000.00	52.30
	其中:债券	718,570,000.00	52.30
	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	621,123,483.59	45.21
6	其他各项资产	34,158,505.42	2.49
7	合计	1,373,851,989.01	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	149,355,000.00	12.74
	其中:政策性金融债	149,355,000.00	12.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	569,215,000.00	48.54
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	718,570,000.00	61.27

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	99,690,000.00	8.50
2	011315002	13中铝业SCP002	500,000	49,835,000.00	4.25
3	041354039	13华能集CP002	500,000	49,820,000.00	4.25
4	130218	13国开18	500,000	49,665,000.00	4.23
5	041361033	13萧国资CP001	400,000	39,928,000.00	3.40

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投资股指期货交易。

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投资国债期货交易。

5.10投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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	10,112,427.85
5	应收申购款	24,046,077.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,158,505.42

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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

项目	博时安盈债券A	博时安盈债券C
本报告期期初基金份额总额	739,600,469.15	1,101,923,933.05
本报告期基金总申购份额	53,055,434.28	531,060,057.39
减:本报告期基金总赎回份额	306,541,886.98	964,824,599.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	486,114,016.45	668,159,390.62

§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安盈债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时安盈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报告期内博时安盈债券型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

博时安心收益定期开放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: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7月1日-2013年9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	7,939,305.49	6,123,934.39
2.本期利润	4,761,470.55	3,213,062.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0039	0.0029
4.期末基金资产净值	1,244,660,496.69	1,139,107,069.62
5.期末基金份额净值	1.028	1.025

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:

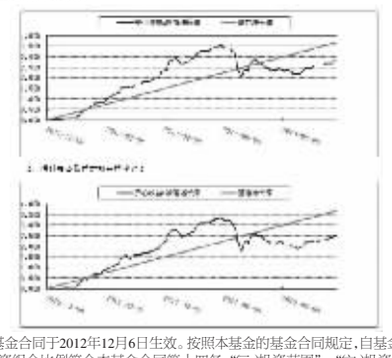
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.07%	1.13%	0.01%	-0.74%	0.06%

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%	0.06%	1.13%	0.01%	-0.84%	0.05%

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	-	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。

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A类基金份额净值为1.028元,份额累计净值为1.028元;C类基金份额净值为1.025元,份额累计净值为1.025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