博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)

2014 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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时安丰18个月定开债(LOF)
场内简称	安丰18
基金主代码	160515
交易代码	160515
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2013年8月22日
报告期末基金份额总额	248,357,255.56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	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	本基金的业绩比较基准为: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	上海浦东发展银行股份有限公司

§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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	6,331,288.21
2.本期利润	9,400,196.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0379
4.期末基金资产净值	259,991,464.67
5.期末基金份额净值	1.047

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。

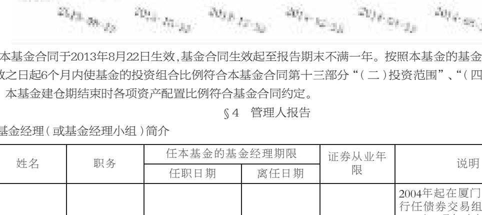
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	3.76%	0.09%	1.12%	0.01%	2.64%	0.08%

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8月22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6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三部分"(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		
魏桢	基金经理	2013-8-22	-	6	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年7月加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、固定收益研究员。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时安丰18个月定期开放债券(LOF)基金、博时双月薪定期支付债券基金基金经理。

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、《博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)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运作分析

2014年第二季度,随着货币政策的逐渐明朗化,资金面状况进一步改善,货币市场利率大幅下滑,银行间R001均值2.53%(-32BP),R007均值3.35%(-70BP)。 现券方面,受"定向降准"和"再贷款"等宽松政策的影响,流动性乐观预期从短端传导到长短,牛市行情延续,长端下行幅度超过短端,曲线平坦化。国债平均下行30BP,国开债平均下行65BP;信用债收益率稳中有降,呈陡峭化下行走势,与金融债信用利差处于历史偏低水平。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.047元,累计份额净值为1.074元,报告期内净值增长率为3.76%,同期业绩基准涨幅为1.12%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第三季度,经济的下滑并没有实质性扭转,地产投资下滑期间,基建投资等稳增长手段客观上要求低利率资金配合。在防控债务和维稳增长中货币政策只能选择定向发力,资金价格有望保持低位平稳运行。由于货币宽松到信用宽松传导不畅,在经济内生动力趋弱、债务偏高的背景下,为避免融资供给过度萎缩,防止经济失速风险,债市下半年资本利得行情寄托于潜在利好的继续释放,政策放松预期有不断强化的空间。另一方面,我们也要警惕市场的风险因素:经济好于预期存在一定的概率,三季度可能成为预期重构的敏感阶段,关注房地产市场融资的实质变化(开发贷和按揭贷的量价放松意味着宏观政策全面宽松);海外货币放水是否会造成物价上涨压力并挤压国内政策空间等。总体上对债市谨慎乐观,细节上修正对流动性的过度乐观和对经济的过度悲观预期。兼顾陡峭化和票息策略,依然偏好低风险资产的表现,精选优质城投。

§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	515,135,040.81	85.43
	其中:债券	515,135,040.81	85.43
	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	76,591,145.38	12.70
7	其他资产	11,246,698.43	1.87
8	合计	602,972,884.62	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	44,974,240.00	17.30
	其中:政策性金融债	44,974,240.00	17.30
4	企业债券	346,999,800.81	133.47
5	企业短期融资券	30,220,000.00	11.62
6	中期票据	92,941,000.00	35.75
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	515,135,040.81	198.14

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	018002	国开1302	428,000	44,974,240.00	17.30
2	122289	13日照港	245,000	24,990,000.00	9.61
3	122266	13中信03	244,000	24,421,960.00	9.39
4	122068	11海螺01	240,000	23,968,800.00	9.22
5	122921	10郴州债	222,980	23,123,026.00	8.89

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	39,643.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,176,807.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.18
8	其他	-
9	合计	11,246,698.43

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	247,885,260.70
报告期期间基金总申购份额	471,994.86
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	248,357,255.56

§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2014年6月30日,博时基金公司共管理四十七只开放式基金,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1041亿元人民币,累计分红超过628亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至6月30日,博时医疗保健股票基金、博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/4,、博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/3。标准指数股票型基金中,博时沪深300指数、博时上证超大盘ETF、博时深证基本面200ETF三只基金今年以来净值增长率在150只同类基金中排名前1/2。混合基金方面,今年以来博时裕益收益率在35只灵活配置型同类基金中排名前1/2,博时平衡配置在16只股债平衡型同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债纯债今年以来收益率在101只长期标准债券型基金中排名前1/4,博时安丰18个月定期开放基金排名前1/3,博时安盈债券基金(A类)在6只中短期标准债券型基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至6月30日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时大中华亚太精选今年以来收益率在9只QDII亚太股票型基金中排名第2,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第2。

2、客户服务

2014年二季度,博时基金共举办各类渠道培训活动213场,参加人数5318人。

3、其他大事件

2014年6月16日,大智慧在上海举办"智慧财经巅峰榜",博时基金荣获"十佳基金公司"奖项,基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜"最佳基金经理"奖项。

§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安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)设立的文件

9.1.2《博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》

9.1.3《博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(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报告期内博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(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
2014年7月18日

博时安心收益定期开放债券型证券投资基金

2014 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:2014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2014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2014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	289,915,963.26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	168,235,332.66份	121,680,630.60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(2014年4月1日-2014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	2,655,926.34	1,793,222.48
2.本期利润	5,634,317.47	3,943,950.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0341	0.0329
4.期末基金资产净值	175,171,571.16	126,411,722.63
5.期末基金份额净值	1.041	1.039

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:

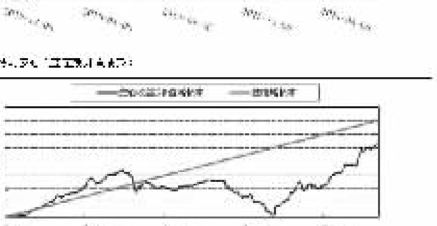
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.27%	0.10%	1.12%	0.01%	2.15%	0.09%

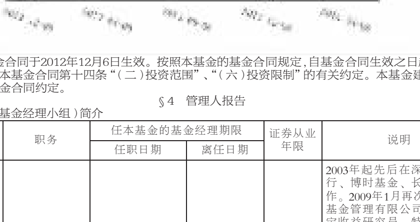
2、博时安心收益定期开放债券C:

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	3.28%	0.10%	1.12%	0.01%	2.16%	0.09%

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-现金管理组投资副总监	2012-12-6	-	9	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管理有限公司。历任固定收益研究员、特定资产投资经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安心收益定期开放债券基金、博时理财30天债券基金、博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时双月薪定期支付债券基金基金经理。

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运作分析

2014年第二季度,随着货币政策的逐渐明朗化,资金面状况进一步改善,货币市场利率大幅下滑,银行间R001均值2.53%(-32BP),R007均值3.35%(-70BP)。 现券方面,受"定向降准"、"再贷款"和PSL等宽松政策的影响,流动性乐观预期从短端传导到长端,债市牛市行情延续,长端下行幅度超过短端,曲线平坦化。国债平均下行30BP,国开债平均下行65BP;信用债收益率稳中有降,呈陡峭化下行走势,与金融债信用利差处于历史偏低水平。

基本对经济偏弱,货币政策宽松的基本判断,组合采取高杠杆和短久期利率+信用债为主要投资策略。组合杠杆维持在较高水平,主配中低评级信用债,择机增配短久期利率债。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金A类基金份额净值为1.041元,份额累计净值为1.060元;C类基金份额净值为1.039元,份额累计净值为1.054元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为3.27%,C类基金份额净值增长率为3.28%,同期业绩基准增长率1.12%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第三季度,经济在定向降准及再贷款和PSL等政策配合及中央代地方投资托底主导下,经济短期企稳回升。而在防控债务和维稳增长中货币政策只能选择定向发力,但总体上,基于偏弱的宏观背景,资金价格有望保持低位平稳运行。债市下半年资本利得行情寄托于潜在利好的继续释放,政策放松预期有不断强化的空间。另一方面,我们也要警惕市场的风险因素:经济好于预期存在一定的概率,三季度可能成为预期重构的敏感阶段,关注房地产市场融资的实质变化(开发贷和按揭贷的量价放松意味着宏观政策全面宽松);海外货币放水是否会造成物价上涨压力并挤压国内政策空间等。总体上对债市谨慎乐观,细节上修正对流动性的过度乐观和对经济的过度悲观预期。兼顾陡峭化和票息策略,依然偏好低风险资产的表现,精选优质城投。

§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	719,471,436.40	90.63
	其中:债券	719,471,436.40	90.63
	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	20,925,769.93	2.64
7	其他资产	53,480,442.13	6.74
8	合计	793,877,648.46	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	69,614,000.00	23.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	243,228,519.40	80.65
	其中:政策性金融债	243,228,519.40	80.65
4	企业债券	208,499,917.00	69.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	198,129,000.00	65.70
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	719,471,436.40	238.56

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	018001	国开1301	2,005,270	205,139,121.00	68.02
2	1282502	12通综投MTN1	400,000	39,948,000.00	13.25
3	1382003	13西王MTN1	400,000	39,136,000.00	12.98
4	018002	国开1302	362,480	38,089,398.40	12.63
5	140005	14附息国债05	300,000	30,858,000.00	10.23

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仓国债期货。

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 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 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	46,875.40
2	应收证券清算款	35,943,397.74
3	应收股利	-
4	应收利息	17,490,168.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,480,442.13

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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
报告期期初基金份额总额	168,235,332.66	121,680,630.60
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	168,235,332.66	121,680,630.60

§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2014年6月30日,博时基金公司共管理四十七只开放式基金,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1041亿元人民币,累计分红超过628亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至6月30日,博时医疗保健股票基金、博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/4,、博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/3。标准指数股票型基金中,博时沪深300指数、博时上证超大盘ETF、博时深证基本面200ETF三只基金今年以来净值增长率在150只同类基金中排名前1/2。混合基金方面,今年以来博时裕益收益率在35只灵活配置型同类基金中排名前1/2,博时平衡配置在16只股债平衡型同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债纯债今年以来收益率在101只长期标准债券型基金中排名前1/4,博时安丰18个月定期开放基金排名前1/3,博时安盈债券基金(A类)在6只中短期标准债券型基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至6月30日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时大中华亚太精选今年以来收益率在9只QDII亚太股票型基金中排名第2,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第2。

2、客户服务

2014年二季度,博时基金共举办各类渠道培训活动213场,参加人数5318人。

3、其他大事件

2014年6月16日,大智慧在上海举办"智慧财经巅峰榜",博时基金荣获"十佳基金公司"奖项,基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜"最佳基金经理"奖项。

§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安心收益定期开放债券基金设立的文件

9.1.2《博时安心收益定期开放债券基金基金合同》

9.1.3《博时安心收益定期开放债券基金托管协议》

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报告期内博时安心收益定期开放债券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
2014年7月18日

同盛证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同盛封闭(场内简称:基金同盛)
基金主代码	184699
交易代码	184699
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年11月5日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
投资目标	本基金属于成长价值复合型基金,主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好的分散和控制风险,实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金将根据市场发展情况,确定在一段时间内市场发展的总体趋势,并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-121,255,074.04
2.本期利润	35,613,366.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0119
4.期末基金资产净值	3,133,315,268.52
5.期末基金份额净值	1.0444

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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。

2、所列数据截止到2014年6月30日。

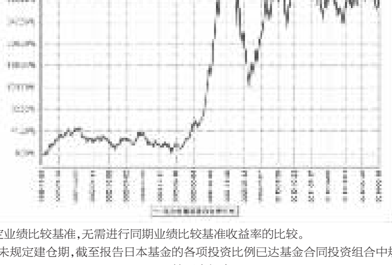
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
过去三个月	1.14%	2.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、本基金未规定业绩比较基准,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

2、本基金基金合同未规定建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同投资组合中规定的各项比例。

§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		
田间	本基金基金经理。	2013年7月9日	-	6年	女,1978年11月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员,基金经理助理等职务。现任同盛证券投资基金(本基金)基金经理。
侯继雄	本基金基金经理,社保组合组合经理,公司总经理助理。长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。	2008年8月11日	2014年4月21日	13年	男,1974年5月出生,中国国籍。清华大学博士。历任国泰君安证券研究所研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司,先后任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,研究部总监等职务。现任公司总经理助理,社保组合组合经理,兼任长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。自2014年4月21日起不再担任同盛证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

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,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4 个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有4次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2014年二季度以来,在政府定向宽松式稳增长政策的密集出台下,国内经济有一定企稳迹象和回暖趋势,以PMI为代表的多项经济指标连续回升,消费小幅回升。流动性延续了今年以来的宽松局面,人民币贷款增速和M2增速保持平稳。海外经济中,美国经济持续复苏,日本复苏有反复,欧洲国家温和复苏,新兴经济体加快结构调整。

二季度的资本市场表现为大盘指数的窄幅箱体震荡和中小盘指数先抑后扬的反弹行情, 市场体现为整体下跌后来自新兴高成长行业的结构性机会。按主题来看,信息安全、去IOE、基因测序、新能源汽车、传媒等细分领域在二季度上涨中表现突出。表现较好的是去年滞涨、概念新、市值小的个股。

回顾基金同盛二季度的投资运作,在市场下跌中曾一度参与铁路、银行、券商等周期属性行业,在三四月份成长股大幅下调、上证指数窄幅震荡的风格切换过程中,一定程度上起到防御作用。随后调整结构加仓了电子、新能源汽车、互联网、传媒、通信等新兴成长行业,以及家用电器、汽车、公用事业等传统低估值行业,一定程度上做到了攻守兼备,分享了来自中小板和创业板的结构性上涨。未来在投资策略和风格上,坚持自下而上精选个股,兼顾中长周期市场风格选择与判断。在操作上会在成长股和蓝筹股较为均衡配置,以避免短期新因素造成风格切换带来的净值波动。对于长期看好的领域以及个股,会忽略短期因素的干扰。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.0444元,本报告期份额净值增长率为1.14%。

§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	2,458,557,711.91	77.13
	其中:股票	2,458,557,711.91	77.13
2	固定收益投资	633,301,816.00	19.87
	其中:债券	633,301,816.00	19.87
	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	34,302,143.75	1.08
7	其他资产	61,474,279.64	1.93
8	合计	3,187,635,951.30	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	47,467,839.50	1.51
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,055,568,426.38	33.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	157,079,977.52	5.01
E	建筑业	71,129,816.82	2.27
F	批发和零售业	59,591,944.72	1.90
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	759,970,621.16	24.25
J	金融业	60,658,230.75	1.94
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	89,044,314.84	2.84
M	科学研究和技术服务业	2,780,550.00	0.09
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	155,265,990.22	4.96
S	综合	-	-
	合计	2,458,557,711.91	78.47

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	000333	美的集团	15,736,952	304,037,912.64	9.70
2	300296	利亚德	9,773,800	162,049,604.00	5.17
3	600104	上汽集团	8,999,730	137,695,869.00	4.39
4	300291	华录百纳	3,792,113	133,065,245.17	4.25
5	300010	立思辰	4,500,019	112,140,473.48	3.58
6	002373	联信永益	4,195,349	99,010,236.40	3.16
7	600886	国投电力	19,090,824	97,363,202.40	3.11
8	600037	歌华有线	8,479,688	89,206,317.76	2.85
9	300150	世纪瑞尔	4,559,808	72,227,358.72	2.31
10	002713	东易日盛	2,005,917	71,129,816.82	2.27

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	7,662,816.00	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	625,639,000.00	19.97
	其中:政策性金融债	625,639,000.00	19.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	633,301,816.00	20.21

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	100209	10国开09	1,500,000	150,765,000.00	4.81
2	110251	11国开51	1,000,000	100,090,000.00	3.19
3	130227	13国开27	1,000,000	100,000,000.00	3.19
4	130243	13国开43	800,000	80,088,000.00	2.56
5	100230	10国开30	500,000	50,250,000.00	1.60

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

注: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

注: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

注: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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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无被监管部门立案调查,无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,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,234,916.48
2	应收证券清算款	45,912,182.07
3	应收股利	-
4	应收利息	14,296,934.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.07
8	其他	-
9	合计	61,474,279.64

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,000,000
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,000,000
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.20

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《同盛证券投资基金基金合同》;

3、《同盛证券投资基金托管协议》;

4、《同盛证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2014年7月18日