

博时安心收益定期开放债券型证券投资基金

【2014】年度报告摘要

定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值价值和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具
于2014年12月31日,本基金未持有持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差不多。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。

§ 8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元				
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	237,290,747.20	87.83	
其中:债券	237,290,747.20	87.83		
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:买入返售金融资产中的买入返售金融资产		--	--	
6	其他资产和待结算资产合计	14,941,523.85	5.53	
7	银行存款	17,923,949.84	6.63	
8	合计	270,156,220.89	100.00	

8.2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。

8.3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。

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未持有股票。

8.5期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元				
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	34,708,619.60	12.59	
其中:政策性金融债		34,708,619.60	12.59	
4	企业债券	123,262,127.60	62.79	
5	中期票据	89,320,000.00	45.50	
6	可转债	--	--	
7	其他	--	--	
8	合计	237,290,747.20	120.89	

8.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小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	占基金资产净值比例(%)
1	138203	13国债13 MTN1	400,000	39,880,000.00	20.32
2	138283	13国债13 MTN2	300,000	29,541,000.00	15.05
3	018001	国开1301	240,520	24,708,619.60	12.59
4	124907	14农发债	230,000	24,265,000.00	12.36
5	1406262	14农发债	200,000	21,080,000.00	10.74

8.7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明细

本基金未投资资产支持证券	
--------------	--

8.7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。

8.8报告期内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。

8.9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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12投资股指期货附注

8.12.1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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3报告期内其他各项资产构成

单位:人民币元				
序号	名称	金额		
1	存出保证金	42,374.06		
2	应收证券清算款	--		5,682,866.04
3	应收利息	--		--
4	应收股利	8,685,912.37		--
5	应收申购款	3,512,797.37		--
6	其他应收款	--		--
7	其他	--		--
9	合计	17,923,949.84		--

8.12.4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。

8.12.5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。

8.12.6 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。

9 基金份额持有人信息

9.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额级别	持有人户数(户) ⁽²⁾	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
博时安心收益定期 开放债券A	970	140,511.49	67,310,890.50	49.39%	68,985,250.90	50.61%
博时安心收益定期	668	88,349.77	25,815,815.23	43.74%	33,201,832.85	56.26%

9.2期末基金基金管理人的从业员工持有本基金的情况

项目	份额级别	持有基金份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时安心收益定期开放债券A	0.008	0.00%
合计	博时安心收益定期开放债券A	0.008	0.00%

9.3期末基金基金管理人的从业员工持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金	博时安心收益定期开放债券A	--
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时安心收益定期开放债券A	--
合计	博时安心收益定期开放债券A	--

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 10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B		
基金合同生效日(2012年12月6日)基金份额总额	1,210,885,428.96	1,311,820,161.48		
本期基金份额总额变动	168,255,332.66	121,680,630.60		
本期基金份额总额	35,039,339.98	30,973,366.13		
基金份额持有人户数	85,535,108.32	105,762,105.32		
基金份额持有人户数	136,296,141	59,077,648.68		

注:根据《博时安心收益定期开放债券型证券投资基金合同》和《博时安心收益定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,基金管理人于2014年12月12日对本基金进行了份额折算,折算结果公告刊登于博时基金管理有限公司官方网站2014年12月16日刊登的《博时安心收益定期开放债券型证券投资基金的份额折算结果公告》。

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于本报告期发生重大人事变动情况:1)基金管理人于2014年4月19日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变动的公告》,李志惠不再担任博时基金管理有限公司副经理职务;2)基金管理人于2014年11月7日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,将洪小源先生担任博时基金管理有限公司董事长及法定代表人职务,杨楠女士不再担任博时基金管理有限公司董事长职务。

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

本基金托管人2014年11月3日发布公告,聘任赵建明为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4基金投资运作的重大改变

本报告期内本基金投资运作未改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费0.000元。

11.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人涉及及基金业务的代表及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元				
券商名称	交易单元数量	股票交易成交金额	当期股票交易成交金额占当期股票交易成交金额的比例	应付证券清算款
国泰君安	3	--	--	-3,361.59
中金公司	1	--	--	-218.39
中信建投	1	--	--	-300.72

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下:

(1)经营行为规范,内部控制健全,在业内有良好的声誉;
(2)具备基金交易所所需的高效、安全的通讯条件,交易设施能满足进行证券投资的需要;
(3)具有较强大的网上交易金融服务平台,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的有关宏观、行业及市场走势、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司对管理基金的特点要求,提供针对研究报告,具有开发基金投资组合模型的能力;能积极为公司提供专业化的投资建议,提供信息及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定席位所属的证券经营机构。
(2)基金管理人或被选中的证券经营机构签订席位服务协议。
(3)基金租用证券公司交易单元进行其证券投资的情况

金额单位:人民币元				
券商名称	成交金额	占当期股票交易成交金额比例	成交金额	占当期股票交易成交金额比例
国泰君安	1,052,107,217.37	77.69%	16,399,888,000.00	84.86%
中金公司	10,500,243.38	0.78%	2,900,000.00	0.02%
中信建投	29,660,575.36	2.14%	2,911,200,000.00	15.12%

博时基金管理有限公司
2015年3月28日

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:2015年3月28日

§ 1重要提示

基金管理人的董事会、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法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。投资者有风险,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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告自2014年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 2基金简介				
2.1基金基本情况				
基金名称	博时安心收益定期开放债券			
基金代码	050028			
基金运作方式	契约型基金,本基金以定期开放方式运作。			
基金合同生效日	2012年12月6日			
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			
报告期末基金份额总额	195,313,789.48份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	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		
下属分级基金的基金代码	050028	050128		
报告期末下属分级基金的份额总额	136,296,141.40份	59,017,648.08份		

2.2基金产品说明				
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争长期资本增值,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,确定资产在中信用等级固定收益证券(国债、央行票据等)和信用固定收益证券之间的配置比例。 本基金的主要投资策略为买入并持有到期策略,并持有到期,或持有到期前于封闭期或流动性需求,将本基金和现金收入,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,本基金通过主动管理,调整资产在债券市场内部构成,获得较高收益,在谨慎投资的前提下,力争取得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,本基金为保持资产的流动性,方便投资人赎回投资,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)+1.50%			
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型基金,低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险收益的产品。			

2.3基金管理人				
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	
名称	博时基金管理有限公司	名称	中国建设银行股份有限公司	
地址	广东省深圳市福田区	地址	广东省深圳市福田区	
信息披露负责人	魏秀英	电话	0755-83169999	010-67595066
电子邮箱	service@bosera.com	传真	010-67595066	010-67595066
客户服务电话	95105588			
网址	0755-83169999			

2.4信息披露方式				
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com			
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处			

§ 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标
博时安心收益定期开放债券A:

金额单位:人民币元				
3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年12月6日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
本期已实现收益	9,031,840.43	26,391,194.37	2,036,352.15	
本期利润	18,953,135.35	20,299,084.04	1,295,499.01	
加权平均基金份额本期利润	0.1317	0.0183	0.0011	
本期基金份额净值增长率	11.49%	1.35%	0.10%	
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0010	0.0010	0.0011	
期末基金资产净值	136,379,983.10	167,607,043.05	1,212,180,027.86	
期末基金份额净值	1.005	0.996	1.001	

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
博时安心收益定期开放债券A:

阶段	份额净值增长率(%)	业绩比较基准(%)	份额净值增长率-业绩比较基准(%)	①-③	②-④
过去三个月	4.08%	0.28%	1.09%	0.03%	2.99%
过去六个月	6.67%	0.17%	2.23%	0.03%	4.44%
过去一年	11.49%	0.15%	4.46%	0.03%	7.03%
自基金合同生效起至今	13.11%	0.12%	9.28%	0.03%	3.83%

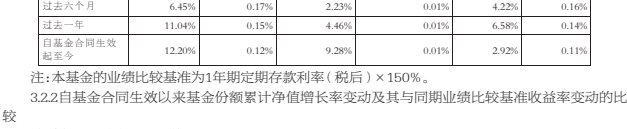
注:本基金业绩比较基准为1年期定期存款利率(税后)+150%。

3.2.2基金合同生效以来基金业绩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

博时安心收益定期开放债券A

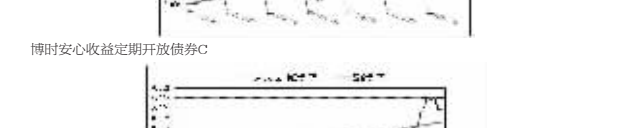


博时安心收益定期开放债券C

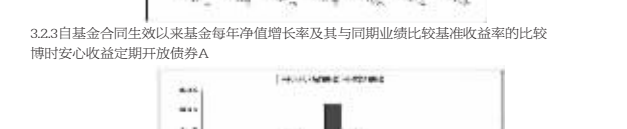


3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



注:本基金2012年实际运作期间为2012年12月6日(基金合同生效日)至2012年12月31日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

无。

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其基金经理的经验

基金管理人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12月31日,博时基金公司共管理五十二只开放式基金,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。博时基金资产管理总规模逾2362亿元人民币,其中公募基金资产管理规模1124亿元人民币,累计分红超638亿元人民币。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行业中名列前茅。

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12月31日,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率为365只标准股票型基金中排名第6,博时转债价值股票基金今年以来净值增长率为365只标准股票型基金中排名第12;博时精选股票基金在只同类股票型基金中排名第1;博时裕富沪深300指数基金在同类150只标准指数股票型基金中排名第1/5,博时上证大盘ETF及博时深证基本面200ETF在150只标准指数股票型基金中均排名第1/2,博时上证超大盘ETF联接及博时深证基本面200ETF联接在同类45只产品中排名第1/2。混合基金中,博时裕富灵活配置混合在34只灵活配置型基金中排名第1/4,博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类灵活配置型基金中排名第1/2,博时平衡配置混合在同类16只产品中排名第1/2。

2) 固定收益方面,博时信用债券(A类)今年以来收益率为93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类)今年以来收益率为56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率为41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率为67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率为13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在只同类长期纯债债券型基金中排名第1/3,博时信用纯债债券型基金、