

# 博时安盈债券型证券投资基金

## 2013 年半年度报告

### 2013 年 6 月 30 日

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 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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的法律责任。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 28 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	29
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	30
7.6 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.....	30
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	30
7.8 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.....	30
7.9 期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	30
7.10 投资组合报告附注.....	30
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>31</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	32
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>32</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>32</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	32
10.2 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.....	32
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	32
10.4 基金投资策略的改变.....	32
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	33

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	33
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	33
10.8 其他重大事件 .....	33
<b>§11 备查文件目录 .....</b>	<b>35</b>
11.1 备查文件目录 .....	35
11.2 存放地点 .....	35
11.3 查阅方式 .....	35

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时安盈债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,841,524,402.20份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时安盈债券A	博时安盈债券C
下属分级基金的交易代码	000084	000085
报告期末下属分级基金的份额总额	739,600,469.15份	1,101,923,933.05份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	95588

传真	0755-83195140	010-66105798
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	杨鹤	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2013 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日）	
	博时安盈债券 A	博时安盈债券 C
本期已实现收益	6,081,570.83	16,624,170.80
本期利润	5,759,082.52	15,203,472.13
加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0048
本期加权平均净值利润率	0.59%	0.48%
本期基金份额净值增长率	0.60%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	博时安盈债券 A	博时安盈债券 C
期末可供分配利润	4,546,378.18	5,815,868.66
期末可供分配基金份额利润	0.0061	0.0053
期末基金资产净值	744,146,847.33	1,107,739,801.71
期末基金份额净值	1.006	1.005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	博时安盈债券 A	博时安盈债券 C
基金份额累计净值增长率	0.60%	0.50%

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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.30%	0.04%	0.25%	0.01%	0.05%	0.03%
自基金成立起至今	0.60%	0.03%	0.57%	0.01%	0.03%	0.02%

##### 2. 博时安盈债券 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.30%	0.05%	0.25%	0.01%	0.05%	0.04%
自基金成立起至今	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

##### 1、博时安盈债券 A



##### 2、博时安盈债券 C



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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司成立于 1998 年 7 月 13 日，是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。注册资本 2.5 亿元人民币，总部设在深圳，在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。同时，博时基金公司拥有博时基金（国际）有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。博时基金公司的股东为招商证券股份有限公司、中国长城资产管理公司、天津港（集团）有限公司、璟安股权投资有限公司、上海盛业股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广厦建设集团有限责任公司。博时基金公司的经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务，是一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构。

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

(1) 根据银河证券基金研究中心统计，2013 年上半年，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。

(2) 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）



(3) 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 年上半年, 博时基金共举办各类渠道培训活动逾 841 场, 参加人数超过 2 万人。

## 3、其他大事件

(1) 2013 年 3 月 29 日, 由证券时报社主办的 2012 年度中国基金业明星奖颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业基金荣获“2012 年度股票型明星基金奖”。2013 年 3 月 30 日, 由中国证券报社主办的第十届中国基金业金牛奖颁奖典礼暨 2013 金牛基金论坛在北京举行。博时基金蝉联“金牛基金管理公司”奖, 博时基金价值组投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得“金牛基金十周年特别奖”, 博时现金收益荣获“2012 年度货币市场金牛基金”。

(2) 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”。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。

### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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。

注: 上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013 年上半年，本基金托管人在对博时安盈债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013 年上半年，博时安盈债券型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时安盈债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时安盈债券型证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：博时安盈债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	369,782,985.40
结算备付金		65,272,727.27
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	378,555,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		378,555,000.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,398,501,707.75
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	2,152,581.57
应收股利		-
应收申购款		343,288.59
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		<b>2,214,608,290.58</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		360,000,000.00
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,269,905.97
应付托管费		412,719.43
应付销售服务费		957,920.84
应付交易费用	6.4.7.7	16,659.50
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	64,435.80
负债合计		362,721,641.54
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,841,524,402.20

未分配利润	6.4.7.10	10,362,246.84
所有者权益合计		1,851,886,649.04
负债和所有者权益总计		<b>2,214,608,290.58</b>

注：

1、报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,841,524,402.20 份。其中 A 类基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 739,600,469.15 份；C 类基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 1,101,923,933.05 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2013 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2013 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：博时安盈债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2013 年 4 月 23 日（基金合同生效日） 至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>27,593,203.36</b>
1. 利息收入		29,269,953.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	943,504.01
债券利息收入		816,793.96
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		27,509,655.74
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,743,186.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	66,436.63
<b>减：二、费用</b>		<b>6,630,648.71</b>
1. 管理人报酬		3,131,243.43
2. 托管费		1,017,654.11
3. 销售服务费		2,402,287.68
4. 交易费用	6.4.7.18	950.00
5. 利息支出		3,998.01
其中：卖出回购金融资产支出		3,998.01
6. 其他费用	6.4.7.19	74,515.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>20,962,554.65</b>

减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>20,962,554.65</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时安盈债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,464,554,948.85	-	4,464,554,948.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,962,554.65	20,962,554.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,623,030,546.65	-10,600,307.81	-2,633,630,854.46
其中：1. 基金申购款	6,743,945.69	28,320.22	6,772,265.91
2. 基金赎回款	-2,629,774,492.34	-10,628,628.03	-2,640,403,120.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,841,524,402.20	10,362,246.84	1,851,886,649.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴姚东，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时安盈债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于核准博时安盈债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]244号）和 2013 年 3 月 25 日《关于博时安盈债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2013]207号）的核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金。基金存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,463,559,723.06 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 223 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,464,554,948.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 995,225.79 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是本基金在保持资产相对流动性的基础上，努力追求绝对收益，争取为基金份额持有人谋求资产的增值；本基金主要投资于短期融资券和超级短期融资券。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的短期融资券、超级短期融资券、国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、可分离交易可转债的纯债、资产支持证券、回购和银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实



现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定

公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	369,782,985.40
定期存款	-
其他存款	-
合计	369,782,985.40

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	380,298,186.98	378,555,000.00	-1,743,186.98
	合计	380,298,186.98	378,555,000.00	-1,743,186.98
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		380,298,186.98	378,555,000.00	-1,743,186.98

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	660,000,000.00	-
银行间买入返售证券	738,501,707.75	-
合计	1,398,501,707.75	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	50,616.95
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	29,372.70
应收债券利息	1,080,273.42
应收买入返售证券利息	992,318.50
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,152,581.57

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	16,659.50
合计	16,659.50

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	64,435.80
合计	64,435.80

#### 6.4.7.9 实收基金

博时安盈债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	999,977,258.87	999,977,258.87
本期申购	4,135,334.48	4,135,334.48
本期赎回（以“-”号填列）	-264,512,124.20	-264,512,124.20
本期末	739,600,469.15	739,600,469.15

博时安盈债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	3,464,577,689.98	3,464,577,689.98
本期申购	2,608,611.21	2,608,611.21
本期赎回（以“-”号填列）	-2,365,262,368.14	-2,365,262,368.14
本期末	1,101,923,933.05	1,101,923,933.05

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,081,570.83	-322,488.31	5,759,082.52
本期基金份额交易产生的变动数	-1,357,142.01	144,437.67	-1,212,704.34
其中：基金申购款	20,319.40	-1,884.31	18,435.09
基金赎回款	-1,377,461.41	146,321.98	-1,231,139.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,724,428.82	-178,050.64	4,546,378.18

**博时安盈债券 C**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	16,624,170.80	-1,420,698.67	15,203,472.13
本期基金份额交易产生的变动数	-10,543,134.52	1,155,531.05	-9,387,603.47
其中：基金申购款	11,182.09	-1,296.96	9,885.13
基金赎回款	-10,554,316.61	1,156,828.01	-9,397,488.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,081,036.28	-265,167.62	5,815,868.66

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	821,797.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	121,706.34
其他	-
合计	943,504.01

**6.4.7.12 股票投资收益**

无。

**6.4.7.13 债券投资收益**

无。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

无。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,743,186.98
——股票投资	-
——债券投资	-1,743,186.98
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,743,186.98

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
基金赎回费收入	66,424.25
印花税返还	-
转换费收入	12.38
其他	-
合计	66,436.63

注：本基金基金份额赎回费率最高不超过 5%。本基金 A 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，持有期限在 0.5 年以内的基金份额，赎回费率为 0.10%，持有期限超过 0.5 年（含 0.5 年）而又不满 1 年的基金份额，赎回费率为 0.05%，持有期限超过 1 年（含 1 年）的基金份额，不收取赎回费用；本基金 C 类基金份额的赎回费率为 0。本基金所收取的赎回费，基金管理人将不低于其总额的 25% 计入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	950.00
合计	950.00

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
审计费用	23,012.55

信息披露费	41,423.25
银行汇划费	10,079.68
合计	74,515.48

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,131,243.43
其中：支付销售机构的客户维护费	2,099,175.04

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数

单位：人民币元

项目	本期
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,017,654.11

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.13% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时安盈债券 A	博时安盈债券 C	合计
博时基金	-	1,582.63	1,582.63
中国工商银行	-	2,320,328.42	2,320,328.42
招商证券	-	0.06	0.06
合计	-	2,321,911.11	2,321,911.11

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。

其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2013年4月23日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	369,782,985.40	821,797.67

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。



#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金主要投资于短期融资券和超级短期融资券。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保持低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在

交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券。本基金的基金管理人通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013年6月30日
A-1	179,290,000.00
A-1 以下	-
未评级	99,325,000.00
合计	278,615,000.00

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013年6月30日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	99,940,000.00
合计	99,940,000.00

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，但主要为流动性较强的国家政策性金融债和央行票据，因此均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	369,782,985.40	-	-	-	369,782,985.40
结算备付金	65,272,727.27	-	-	-	65,272,727.27
交易性金融 资产	378,555,000.00		-	-	378,555,000.00
买入返售金 融资产	1,398,501,707.75	-	-	-	1,398,501,707.75
应收利息	-	-	-	2,152,581.57	2,152,581.57
应收申购款	-	-	-	343,288.59	343,288.59
<b>资产总计</b>	<b>2,212,112,420.42</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,495,870.16</b>	<b>2,214,608,290.58</b>
负债					
应付证券清 算款	-	-	-	360,000,000.00	360,000,000.00
应付管理人 报酬	-	-	-	1,269,905.97	1,269,905.97
应付托管费	-	-	-	412,719.43	412,719.43
应付销售服 务费	-	-	-	957,920.84	957,920.84
应付交易费	-	-	-	16,659.50	16,659.50

用					
其他负债	-	-	-	64,435.80	64,435.80
负债总计	-	-	-	362,721,641.54	362,721,641.54
利率敏感度缺口	2,212,112,420.42	-	-	-360,225,771.38	1,851,886,649.04

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 (2013年6月30日)
	市场利率上升 25 个基点	减少约 73
	市场利率下降 25 个基点	增加约 73

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

## (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 378,555,000.00 元，无属于第一层级和第三层级的余额。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

## (iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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

### 7.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

报告期末本基金未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

无。

**7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

无。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

无。

**7.5 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	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

**7.6 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**

金额单位：人民币元

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	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

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 投资组合报告附注**

7.10.1 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的情况。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
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

7.10.4 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处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.10.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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
博时安盈债券 A	4,621	160,052.04	54,995,671.67	7.44%	684,604,797.48	92.56%
博时安盈债券 C	7,553	145,892.22	4,000,102.78	0.36%	1,097,923,830.27	99.64%
合计	12,174	151,267.00	58,995,774.45	3.20%	1,782,528,627.75	96.80%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	博时安盈债券 A	20,649.47	0.00%
	博时安盈债券 C	89,732.23	0.01%
	合计	110,381.70	0.01%

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。

## § 9 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
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	739,600,469.15	1,101,923,933.05

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 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

1) 基金管理人于2013年6月1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》，何宝不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由杨鵬代任公司总经理。

2) 基金管理人于 2013 年 7 月 26 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》，经博时基金管理有限公司第五届董事会 2013 年第三次会议审议并通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】962 号文核准批复，博时基金管理有限公司聘任吴姚东担任博时基金管理有限公司总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变



本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	成交金额
华泰证券	-	-	28,517,000,000.00	100%
中信建投	-	-	-	-

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) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，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关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以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选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-22

2	关于博时安盈债券型证券投资基金开通直销网上交易定期定额申购、定期定额转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-17
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-14
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-8
5	关于博时安盈债券型证券投资基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-7
6	博时安盈债券型证券投资基金基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-7
7	博时安盈债券型证券投资基金基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-7
8	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的上海家化估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-5-15
9	博时安盈债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-24
10	关于博时安盈债券基金新增民生银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-17
11	关于博时安盈债券型证券投资基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-17
12	关于博时安盈债券型证券投资基金新增上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-16
13	博时基金管理有限公司关于开通基金直销网上交易和查询系统移动版的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-15
14	关于博时安盈债券基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-1
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-3-23
16	博时基金管理有限公司关于股东名称变更、增加注册资本及修改《公司章程》的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-3-13
17	博时基金管理有限公司关于成立博时资本管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-2-28
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-2-27

19	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2013-2-8
20	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2013-1-4

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 11.1.1 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
- 11.1.2 《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时安盈债券型证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 11.1.5 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

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 11.3 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 8 月 29 日