安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年 9 月 30 日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25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2012年10月24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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	安信灵活配置混合
基金主代码	750001
交易代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月20日
报告期末基金份额总额	315,536,828.95份
投资目标	灵活运用多种投资策略,深入挖掘和把握市场投资机会,分享中国经济增长和资本市场发展的成果,力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报
投资策略	本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的模式,在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上,以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本,结合金融市场行为分析,根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断,动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略,实现基金资产长期稳定增值
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	4,078,903.99
2.本期利润	2,923,638.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0043
4.期末基金资产净值	316,938,948.88
5.期末基金份额净值	1.004

注:1、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;

2、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	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	0.30%	0.06%	-4.51%	0.71%	4.81%	-0.65%

注:业绩比较基准收益率=60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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、根据基金合同的规定:本基金将基金资产的30%-80%投资于股票,将基金资产的20%-70%投资于债券和其他金融工具(其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的5%)。本基金可以投资于权证,权证的投资比例不高于基金资产净值的3%。本基金的建仓期为2012年6月20日至2012年12月19日,截至本报告期期末(2012年9月30日),本基金仍处于建仓期中。

2、本基金基金合同生效日为2012年6月20日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。图示日期为2012年6月20日至2012年9月30日。

§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		
陈振宇	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2012年6月20日	-	18	陈振宇先生,经济学硕士。历任大鹏证券有限责任公司证券投资部经理、资产管理部总经理,招商证券股份有限公司福民路证券营业部总经理,安信证券股份有限公司资产管理部副总经理(主持工作)、证券投资部副总经理(主持工作)。现任安信基金管理有限责任公司基金投资部总经理。

注:1、此处的任职日期为本基金合同生效日。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、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、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真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

本报告期内,本基金管理人严格执行《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,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本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

2012年3季度,固定投资增速继续回落、消费和出口增长持续低于预期,使得市场对经济见底的预期不断推后,加上财政政策和货币政策放松力度有限,实体经济和资本市场的流动性整体偏紧,A 股市场整体疲软,报告期内全部申万一级行业均呈现负收益。

3季度,本基金在做好资金使用效率管理的同时,逐步买入了具有一定安全边际、业绩增长确定、具有长期投资价值的品种,配置的医药生物、公用事业等行业都有一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2012年9月30日,本基金份额净值为1.004元,本报告期份额净值增长率为0.30%,同期业绩比较基准增长率为-4.51%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时期内,"稳增长"力度加大和经济结构转型可能给市场带来结构性机会,但房地产投资恢复缓慢、政府投资能力受限、欧美经济复苏反复等使得国内经济增长前景仍然不容乐观,而银行借贷情绪不利于资金成本的下降,叠加中小盘股估值回归和大小非解禁压力,市场上涨空间短期可能有限。

本基金将秉承价值投资理念,坚持"持有人利益高于一切",充分利用混合基金的灵活性动态调整大类资产配置比例,勤勉尽责地为基金资产保值增值。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	39,399,630.47	12.15
	其中:股票	39,399,630.47	12.15
2	固定收益投资	53,697,500.00	16.56
	其中:债券	53,697,500.00	16.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	195,000,000.00	60.15
	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	30,347,400.49	9.36
6	其他各项资产	5,762,452.60	1.78
7	合计	324,206,983.56	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	2,848,178.05	0.90
C	制造业	7,061,651.60	2.23
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,547,878.40	1.43
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	17,200.00	0.01
C8	医药、生物制品	2,496,573.20	0.79
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	14,588,914.82	4.60
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	4,924,770.00	1.55
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	9,976,116.00	3.15
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	39,399,630.47	12.43

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	1,552,717	10,030,551.82	3.16
2	600036	招商银行	972,600	9,881,616.00	3.12
3	600009	上海机场	417,000	4,924,770.00	1.55
4	600098	广州发展	724,700	4,558,363.00	1.44
5	000792	盐湖股份	157,040	4,547,878.40	1.43
6	601808	中海油服	175,705	2,848,178.05	0.90
7	002007	华兰生物	96,170	2,496,573.20	0.79
8	601628	中国人寿	5,000	94,500.00	0.03
9	002662	京威股份	2,000	17,200.00	0.01

5.4 报告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	19,334,000.00	6.10
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,313,500.00	1.36
5	企业短期融资券	30,050,000.00	9.48
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	53,697,500.00	16.94

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

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	041255016	12新业国资CP001	200,000	20,016,000.00	6.32
2	1101088	11央行票据88	200,000	19,334,000.00	6.10
3	041260065	12华电能源CP001	100,000	10,034,000.00	3.17
4	126018	08江铜债	50,000	4,313,500.00	1.36

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 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库.本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.8.3 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	5,132,789.69
3	应收股利	-
4	应收利息	618,889.51
5	应收申购款	10,773.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,762,452.60

5.8.4 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。

5.8.5 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。

§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	743,426,623.31
本报告期基金总申购份额	117,947.91
减:本报告期基金总赎回份额	428,007,742.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	315,536,828.95

注:申购含红利再投份额。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在指定媒体和管理人网站进行了如下信息披露:

1.2012年7月5日披露了《安信基金管理有限责任公司北京分公司成立的公告》;

2.2012年7月21日披露了《安信基金管理有限责任公司上海分公司成立的公告》;

3.2012年8月16日披露了《关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金新增代销机构的公告》;

4.2012年9月10日披露了《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回业务公告》;

5.2012年9月10日披露了《安信基金管理有限责任公司关于开展基金网上直销相关费率优惠活动的公告》;

6.本报告期内,公司按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

8.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话:4008-088-088

网址:http:/www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司
二〇一二年十月二十五日

博时标普500指数型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年 9 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:2012年10月25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2012年10月24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2012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	41,576,946.10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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	2,244,572.47
2.本期利润	4,523,967.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0434
4.期末基金资产净值	42,953,097.71
5.期末基金份额净值	1.0331

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。

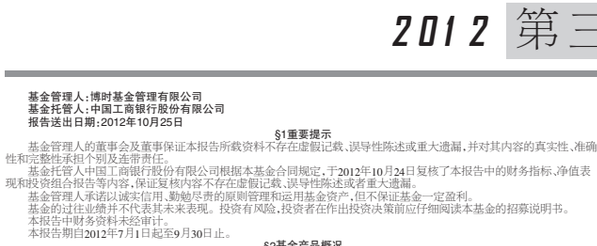
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.11%	0.64%	6.45%	0.72%	-0.34%	-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"、"七、投资限制"的有关约定。截至报告期末本基金建仓期尚未结束。

§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		
王政	ETF及量化投资组投资总监基金经理	2012-6-14	-	13	1995年至1997年在哈佛大学从事地球物理博士后研究工作。1997年8月起先后在美国新泽西州道琼斯投资公司、美国新泽西州彭博资讯研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009年5月加入博时基金管理有限公司。现任ETF及量化投资组投资总监、博时上证超大盘ETF及联接基金基金经理、博时深证基本面200ETF及联接基金经理、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。在报告期内,本基金仍处于建仓期。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%。其余部分主要投资于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。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2012年9月30日,本基金份额净值为1.0331元,累计份额净值为1.0611元,报告期内净值增长率为6.11%,同期业绩基准涨幅为6.45%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期美国经济数据继续支持复苏的观点。9月失业率降到7.8%,是2009年1月来的最低,远好于预期的8.2%。9月制造业PMI指数升到50以上,也好于预期。8月消费信贷增幅远超预期,个人消费支出(PCE)月率上升0.5%,显示消费者信心的提高。房地产在回暖之中,8月新屋销量同比增长27.7%,预售屋房价同比上涨17.0%。从海外市场,QE3和OMT带来的"蛋月效应"比预期消退的要快,QE3相对QE2对投票市场刺激的边际效应减弱,市场之前已早有预期;投资者对美国国会将会在11月6日的选举和2013年1月1日5760亿美元财政紧缩开始之时之间的六周内就税务与支出分歧是否达成共识存在不确定性,使得标普500短期走势有一定不确定性。另外,近期还将迎来美国第三季度企业财报,这也会在很大程度上决定美国市场的未来走向。

展望未来,基于对财政政策不确定性的依赖,美国市场短期内有一定波动风险。但是经过2008-09年的金融危机调整,企业的资产质量处于良好状态。随着美国经济的复苏,企业的估值和盈利都有一定提升空间。我们对美国市场中长期保持乐观。

§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	36,899,652.71	79.91
	其中:普通股	36,135,908.57	78.26
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	763,744.14	1.65
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	-	-
	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	7,955,394.02	17.23
8	其他各项资产	1,319,586.48	2.86
9	合计	46,174,633.22	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	ES|Z2	S&P500 EMINI FUT Dec12	13	5,991,270.43	-81,925.72
总额合计					-81,925.72
减:可抵消期货暂收款					-81,925.72
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	36,899,652.71	85.91
合计	36,899,652.71	85.91

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	7,446,460.08	17.34
金融	5,318,217.92	12.38
医疗保健	4,438,703.64	10.33
能源	4,179,993.42	9.73
非必需消费品	4,077,422.05	9.49
必需消费品	4,017,177.39	9.35
工业	3,616,723.74	8.42
公用事业	1,296,780.91	3.02
原材料	1,294,449.91	3.01
电信业务	1,213,723.65	2.83
合计	36,899,652.71	85.91

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	证券代码	公司名称(英文)	公司名称(中文)	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	AAPL US	APPLE INC	-	美国证券交易所	美国	425	1,798,215.66	4.19
2	XOM US	EXXON MOBIL CORP	-	美国证券交易所	美国	2,093	1,213,698.15	2.83
3	GE US	GENERAL ELECTRIC CO	-	美国证券交易所	美国	4,788	689,491.68	1.61
4	CVX US	CHEVRON CORP	-	美国证券交易所	美国	889	657,066.09	1.53
5	MSFT US	MICROSOFT CORP	-	美国证券交易所	美国	3,421	646,004.47	1.50
6	IBM US	INTL BUSINESS MACHINES CORP	-	美国证券交易所	美国	488	641,934.94	1.49
7	T US	AT&T INC	-	美国证券交易所	美国	2,616	625,369.71	1.46
8	GOOG US	GOOGLE INC-CL A	-	美国证券交易所	美国	120	574,114.14	1.34
9	PG US	PROCTER & GAMBLE CO/THE	-	美国证券交易所	美国	1,249	549,324.89	1.28
10	JNJ US	JOHNSON & JOHNSON	-	美国证券交易所	美国	1,250	546,197.89	1.27

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 Dec12	0.00	0.00

注:期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算备付金中。

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	288,515.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	42,918.68
4	应收利息	776.99
5	应收申购款	987,375.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,319,586.48

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	310,182,625.61
本报告期基金总申购份额	11,623,670.57
减:本报告期基金总赎回份额	280,229,350.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,576,946.10

§7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2012年9月30日,博时基金公司共管理三十二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1230亿元人民币,累计分红574.23亿元人民币,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,截至2012年9月28日,开放式基金,股票型基金中,博时创业成长基金、博时第三产业基金分列同类型274只基金的第38 和第63名;指数型基金中,博时超大盘ETF及超大盘ETF联接基金在同类型162只基金中分列第3和第4;封闭式基金中,基金裕隆在同类的25只基金中排名第6;货币基金中,博时现金收益基金在同类49只基金中排名第5。

2、客户服务

2012年三季度,博时基金共举办各类渠道培训活动共计逾194场;"博时e视界"共举办视频直播活动4场,在线人数累计417人次。

3、其他大事件

1)博时医疗保健行业基金首募顺利结束并于8月28日正式成立。

2)博时信用债纯债基金首募顺利结束并于9月7日正式成立。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

8.1.1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

8.1.2《博时标普500指数型证券投资基金基金合同》

8.1.3《博时标普500指数型证券投资基金托管协议》

8.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

8.1.5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

8.2存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3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
2012年10月25日

博时转债增强债券型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012年 9 月 30 日

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月24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2012年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	博时转债增强债券
基金主代码	050019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月24日
报告期末基金份额总额	2,432,128,888.03份
投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置,并充分利用可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,实施对大类资产的配置,在控制风险并保持良好流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资策略	本产品的类属资产配置策略主要通过自上而下的宏观分析,结合量化的经济指标综合判断经济周期的运行方向,决定类属资产的投资比例。分析的内容包括:影响经济中长期运行的变量,如经济增长模式、中长期经济增长动力;影响宏观经济的周期性变量,如宏观政策、货币供应、CPI等;市场自身的指标,如可转债的转股溢价率和隐含波动率等、股票的估值指标、债券市场的信用利差、期限利差、远期利率等。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,债券型基金的风险高于货币市场基金,低于混合型和股票型基金,属于中低收益/风险的品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	博时转债增强债券A类 博时转债增强债券C类
下属两级基金的交易代码	050019 050119
报告期末下属两级基金的份额总额	1,480,395,996.02份 951,732,892.01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(2012年7月1日-2012年9月30日)	
	博时转债增强债券A类	博时转债增强债券C类
1.本期已实现收益	3,932,452.40	1,351,533.84
2.本期利润	-76,606,604.51	-49,064,062.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0498	-0.0502
4.期末基金资产净值	1,293,877,120.14	826,148,558.68
5.期末基金份额净值	0.874	0.868

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

1、博时转债增强债券A类:

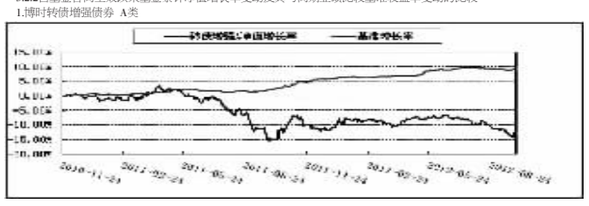
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.41%	0.38%	-0.04%	0.06%	-5.37%	0.32%

2、博时转债增强债券C类:

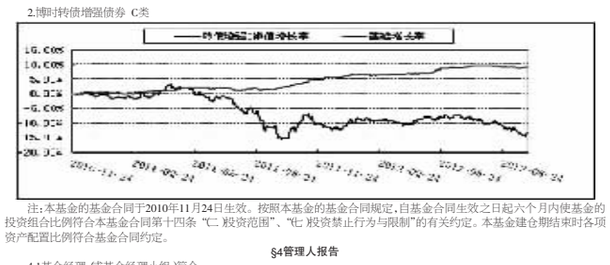
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.45%	0.38%	-0.04%	0.06%	-5.41%	0.32%

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.博时转债增强债券A类



2.博时转债增强债券C类



注:本基金的基金合同于2010年11月24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十四条"二、投资范围"、"七