博时安心收益定期开放债券型证券投资基金

2013 第二季度 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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013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2013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2013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	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4月1日-2013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	12,611,095.95	10,420,687.97
2.本期利润	4,427,271.73	2,926,641.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0026
4.期末基金资产净值	1,239,899,026.14	1,135,894,007.30
5.期末基金份额净值	1.024	1.022

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%	0.11%	1.12%	0.01%	-0.73%	0.10%

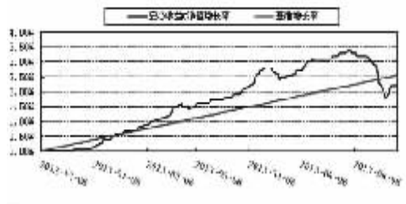
2、博时安心收益定期开放债券C:

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%	0.11%	1.12%	0.01%	-0.83%	0.10%

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

2. 博时安心收益定期开放债券C



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	-	7	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天债券基金和博时岁岁增利一年定期开放债券基金基金经理。

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 报告期内本基金的业绩表现

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

2013年二季度,市场整体的悲观情绪、主板与创业板的两极分化都达到非常极端的水平。中央降低GDP增速和调结构的决心,以及6月下旬回购利率市场短期的大幅上涨引发的恐慌强化了市场的行为。

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金A类基金份额净值为1.024元,份额累计净值为1.024元;C类基金份额净值为1.022元,份额累计净值为1.022元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.39%,C类基金份额净值增长率为0.29%,同期业绩基准增长率1.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6月份以来的资金紧张主要源于结构失衡及预期紊乱。展望三季度,从大的背景看,经济大概率继续下行,政策也并不试图刺激经济,通胀很难超预期,债市投资的基本面仍然较好。其次,市场流动性的状态取决于央行的态度,未来央行的政策操作将中性偏紧,资金成本较上半年大概率上行。再次,从估值来看,在资金面的冲击下,短端收益率超调,中长端和高评级券的价值已有所修复。但资金面紧张导致的去杠杆行为可能会持续一段时间,资金成本制约下的债市反弹也相对有限。总体上我们将保持谨慎乐观的态度。因此,本基金组合策略上维持短久期为主要策略。

§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	3,743,318,485.00	93.26
	其中:债券	3,743,318,485.00	93.26
	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	152,937,202.51	3.81
6	其他各项资产	117,638,422.39	2.93
7	合计	4,013,894,109.90	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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,759,234,485.00	74.05
5	企业短期融资券	1,422,464,000.00	59.87
6	中期票据	561,620,000.00	23.64
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,743,318,485.00	157.56

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	0982052	09中远MTN1	2,000,000	197,680,000.00	8.32
2	122213	12松建化	1,500,000	153,000,000.00	6.44
3	112090	12中兴01	1,325,030	130,886,463.40	5.51
4	041251041	12沙钢CP002	1,300,000	130,286,000.00	5.48
5	122079	11上港02	1,148,150	115,446,482.50	4.86

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

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	193,925.95
2	应收证券清算款	32,099,421.93
3	应收股利	-
4	应收利息	85,345,074.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,638,422.39

5.9.4 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。

5.9.5 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。

5.9.6 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
本报告期期初基金份额总额	1,210,885,428.96	1,111,820,161.48
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,210,885,428.96	1,111,820,161.48

§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

根据银河证券基金研究中心统计,2013年二季度,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。

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)中名列第2。

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年二季度,博时基金共举办各类渠道培训活动逾450场,参加人数近1.2万人。

3、其他大事件

1)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"。

2)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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 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

8.1.2《博时安心收益定期开放债券基金基金合同》

8.1.3《博时安心收益定期开放债券基金托管协议》

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

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
2013年7月18日

博时特许价值股票型证券投资基金

2013 第二季度 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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013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2013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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时特许价值股票	
基金主代码	050010	
交易代码	050010(前端)	051010(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年5月28日	
报告期末基金份额总额	746,848,583.39份	
投资目标	本基金的投资目标在于分享中国经济高速发展过程中那些具有政府壁垒优势、技术壁垒优势、市场与品牌壁垒优势的企业所带来的持续投资收益,为基金持有人获取长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金实行风险管理下的主动型价值投资策略,即采用以精选个股为核心的多层次复合投资策略。在战略上,强调自上而下的组合管理;在战术上,强调自下而上的精选个股。具体投资策略为:在资产配置和组合管理方面,利用金融工程手段和投资组合管理技术,保持组合流动性;在选股层面,按照价值投资原则,利用研究人员的专业研究能力和金融工程的财务数据处理能力,从品质过滤和价值精选两个阶段来精选个股,选择价值被低估且具有政府壁垒优势、技术壁垒优势、市场壁垒优势或者品牌壁垒优势等持续增长潜力的股票,作为构建股票组合的基础。本基金的投资策略具有三层结构,即自上而下的资产配置、自上而下的行业选择和自下而上的选股或选债策略。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。	
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于预期风险收益较高的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和混合型基金。	
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	

§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4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	-10,416,053.72
2.本期利润	-93,889,997.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1078
4.期末基金资产净值	683,072,870.93
5.期末基金份额净值	0.915

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。

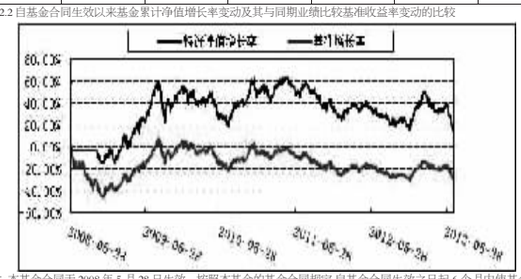
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-11.25%	1.40%	-9.30%	1.16%	-1.95%	0.24%

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2008年5月28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、(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		
胡俊敏	基金经理	2012-6-11	-	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,现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 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、《博时特许价值股票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,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况,基金管理人在规定期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

A股市场在2013年2季度经历了较大的波动,受经济复苏不达预期和突发流动性紧张的影响,投资者情绪悲观,大盘缺乏上涨的动力,沪深300指数2季度下跌11.80%。在经济结构转型驱动下,市场风格极度分化。市值规模层面,中小板、创业板继续跑赢沪深300;成长/价值层面,成长股涨势领先价值股;行业层面,信息服务、信息设备、电子、医药生物、食品饮料等行业优于采掘、有色等周期性行业。我们在各行业相对市场的中性配置及偏价值的投资风格在2季度未能很好表现。但是前期的市场风格的分化导致了这些层面估值水平的分化,在未来有望回归。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.915元,累计净值为1.260元。报告期内,本基金份额净值增长率为-11.25%,同期业绩基准增长率为-9.30%。

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3季度,未来市场的表现在很大程度上依赖于经济复苏预期的变化和政策的调控。同时,海外主要经济体的经济复苏步骤及流动性也影响A股的走势。沪深300估值仍处于底部,低于美国和新兴市场估值。上半年市场风格的极度分化也使得未来更有可能回归。我们看好中国经济的长期发展,力争通过在各行业内精选基本面好、增长性好、低估值的个股为投资者赢得超额收益。

§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	643,276,167.08	84.84
	其中:股票	643,276,167.08	84.84
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	83,959,340.87	11.07
6	其他各项资产	31,012,786.38	4.09
7	合计	758,248,294.33	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	4,722,974.41	0.69
B	采矿业	63,135,626.06	9.24
C	制造业	194,825,959.49	28.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,906,520.12	4.52
E	建筑业	52,231,770.38	7.65
F	批发和零售业	34,030,792.87	4.98
G	交通运输、仓储和邮政业	11,060,717.44	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,636,120.40	0.39
J	金融业	203,448,145.83	29.78
K	房地产业	35,995,205.74	5.27
L	租赁和商务服务业	2,140,320.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,022,274.50	0.88
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	1,658,363.84	0.24
S	综合	461,376.00	0.07
	合计	643,276,167.08	94.17

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	601166	兴业银行	1,959,833	28,946,733.41	4.24
2	600016	民生银行	3,096,506	26,537,056.42	3.88
3	600028	中国石化	4,422,859	18,487,550.62	2.71
4	601668	中国建筑	5,203,992	17,017,053.84	2.49
5	601186	中国铁建	3,840,850	16,131,570.00	2.36
6	601318	中国平安	413,399	14,369,749.24	2.10
7	600015	华夏银行	1,545,260	13,938,245.20	2.04
8	600348	阳泉煤业	1,529,921	13,830,485.84	2.02
9	600837	海通证券	1,446,160	13,564,980.80	1.99
10	600000	浦发银行	1,632,513	13,517,207.64	1.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	299,351.15
2	应收证券清算款	28,976,691.31
3	应收股利	1,475,790.96
4	应收利息	13,755.58
5	应收申购款	247,197.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,012,786.38

5.9.4 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。

5.9.5 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。

5.9.6 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	1,033,479,550.16
本报告期基金总申购份额	76,673,813.72
减:本报告期基金总赎回份额	363,304,780.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	746,848,583.39

§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

根据银河证券基金研究中心统计,2013年二季度,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。

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)中名列第2。

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年二季度,博时基金共举办各类渠道培训活动逾450场,参加人数近1.2万人。

3、其他大事件

1)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"。

2)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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时特许价值股票型证券投资基金设立的文件

8.1.2《博时特许价值股票型证券投资基金基金合同》

8.1.3《博时特许价值股票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 博时特许价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本

8.1.6 报告期内博时特许价值股票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
2013年7月18日

博时主题行业股票证券投资基金

2013 第二季度 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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013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2013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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时主题行业股票(LOF)	
场内简称	博时主题	
基金主代码	160505	
交易代码	160505	
基金运作方式	契约型上市开放式	
基金合同生效日	2005年1月6日	
报告期末基金份额总额	6,229,216,933.09份	
投资目标	分享中国城市化、工业化及消费升级进程中经济与资本市场的高速成长,谋求基金资产的长期稳定增长。	
投资策略	本基金采取价值策略指导下的行业增强型主动投资策略	
业绩比较基准	80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数	
风险收益特征	本基金是一只主动型的股票基金,基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下,谋求实现基金资产的长期稳定增长。	
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	

§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4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	257,452,942.94
2.本期利润	-763,996,373.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1199
4.期末基金资产净值	9,644,304,512.88
5.期末基金份额净值	1.548

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。

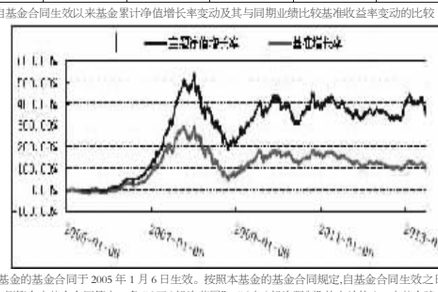
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	-7.47%	1.41%	-8.99%	1.13%	1.52%	0.28%

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2005年1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十二条"(五)投资范围"、"(九)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		
邓晓峰	基金经理/股票投资部总经理/价值组投资总监	2007-3-14	-	11.5	1996年起先后在深圳市银业工贸有限公司、国泰君安证券股份有限公司工作。2005年加入博时公司,历任基金经理助理、社保股票基金经理。现任股票投资部总经理、价值组投资总监,兼任博时主题行业股票(LOF)基金经理、社保股票基金基金经理。

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、《博时主题行业股票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 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基投资策略和运作分析

1、市场回顾

二季度,市场整体的悲观情绪、主板与创业板的两极分化都达到非常极端的水平。中央降低GDP增速和调结构的决心,以及6月下旬回购利率市场短期的大幅上涨引发的恐慌强化了市场的行为。

2、二季度基金组合管理回顾

本季度我们增加了家电和汽车行业的配置。存在这样一些公司:它们的市值中1/3甚至更多是净现金、市盈率7-9倍、1倍的PB对应超过15%的ROE或者2倍的PB对应接近30%的ROE、收入