

## 上证企债30交易型开放式指数证券投资基金

### 2013 第三季度 报告

2013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:2013年10月23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法律责任。  
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2013年10月22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7月11日起至9月30日止。

#### §2基金产品概况

基金名称	博时上证企债30ETF
基金代码	511210
交易代码	511210
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013年7月11日
报告期末基金份额总额	20,368.97份
投资目标	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	本基金将采用“一级、日常申购赎回机制、市场流动性等情况主要采取分层复制策略和适当的主动性投资策略实现跟踪标的指数的投资目标。
业绩比较基准	上证企债30指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券基金,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于中低风险收益的开放式基金。
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

#### 3.1主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年7月11日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	7,831,061.70
2.本期利润	-16,741,589.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0206
4.期末基金资产净值	2,049,750,056.10
5.期末基金份额净值	99.625

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。

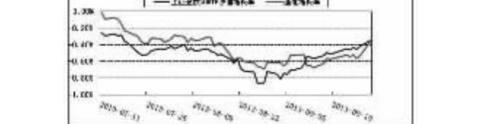
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	-0.35%	0.06%	-0.36%	0.06%	0.01%	0.01%

##### 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7月11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”、(五)“投资限制”的有关规定。本报告期末本基金的各项资产配置符合基金合同规定。

#### §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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨戈光	基金经理	2013-9-11	-	11.5	1990年至2011年先后在特来电科讯、深圳国信证券研究所工作,2011年7月加入博时基金管理有限公司,历任固定收益研究员、高级研究员、基金经理。2013年9月11日起任上证企债30ETF基金经理。
赵蔚阳	基金经理	2013-7-11	-	3	2003年加入博时基金管理有限公司,2010年8月加入博时基金资产管理部,历任固定收益研究员、高级研究员、基金经理。2013年7月11日起任上证企债30ETF基金经理。

##### 4.2报告期内本基金运作遵守信情况

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》及其各项实施准则,《上证企债30交易型开放式指数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,没有损害基金份额持有人的利益。

##### 4.3公平交易专项说明

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  
本基金为交易型开放式指数证券投资基金,为被动跟踪指数的基金,其投资目标是尽量减少和标的指数的跟踪误差,取得标的指数的对市场平均回报。在报告期内我们严格按照基金合同要求,力求组合成份股紧密跟踪指数,利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因,并在最小化交易成本的同时适时调整,尽可能的减少跟踪误差。

本基金于2013年7月11日正式成立,并于2013年8月16日在上海证券交易所上市及打开申购赎回。报告期内,本基金仍在建仓期内,基于信用债市场的偏弱行情,进行缓慢建仓操作。

##### 4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额单位净值为99.625元,累计单位净值为9.965元,报告期内净值增长率为-0.35%,同期业绩基准涨幅为-0.36%。本基金于2013年8月16日在上海证券交易所上市,上市以来的份额净值增长率为0.171%,同期业绩基准增长率为0.025%,相对于投资基准的累计增值率为0.146%,跟踪误差(年化)控制在2%以内。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
2013年3季度,经济数据改善,债券市场承压,PMI连续上升,工业生产受补库存动力带动也有所改善。从流动性方面来看,整体处于紧张偏的状态,央行维持“稳健控、锁放债”的策略,9月底末资金平稳过渡。从海外市场方面来看,美国QE退出预期强烈但最终落空,

**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10月23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法律责任。  
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10月22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7月11日起至9月30日止。

#### §2基金产品概况

基金名称	博时安心收益定期开放债券
基金代码	096028
基金运作方式	定期开放、本基金采用定期开放的方式运作。
基金合同生效日	2012年12月16日
报告期末基金份额总额	3,322,795,590.44份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争取得超越业绩比较基准,追求基金资产的长期、稳健、持续增值。
投资策略	1. 资产配置策略 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补充的方法,确定资产配置比例和资产配置策略,在国家债券、中央银行票据等固定收益类资产中,根据对利率走势的判断,进行资产配置。 2. 债券投资策略 本基金的主要投资策略是买入与中期票据匹配的债券,并持有到期,或者是持有到期并持有中期票据的债券,或者是买入中期票据,到期时,提前将持有中期票据变现,进行必要的动态调整。此外,本基金还将通过买入收益率高于同期限的债券,获得持有到期收益,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。 3. 风险控制策略 报告期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资者安排投资,在遵守本基金有关投资限制的前提下,适度投资于流动性较好的可转债。
业绩比较基准	1年期定期存款利率(税后)×1.05%
风险收益特征	本基金为债券基金,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
下属国际基金的基金简称	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
下属国际基金的基金代码	096028 060128
报告期末下属国际基金的份额总额	1,210,885,428.96份 1,111,826,161.48份

#### 3.1主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年7月11日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	9,399,308.49
2.本期利润	4,791,479.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0029
4.期末基金资产净值	1,244,660,496.09
5.期末基金份额净值	1.028

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

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%	0.07%	1.13%	0.01%	-0.74%	0.06%

##### 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



#### §3主要财务指标和基金净值表现

##### 3.1主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年7月11日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	9,399,308.49
2.本期利润	4,791,479.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0029
4.期末基金资产净值	1,244,660,496.09
5.期末基金份额净值	1.028

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

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%	0.07%	1.13%	0.01%	-0.74%	0.06%

##### 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



#### §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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
薛彤	基金经理	2012-12-16	-	8	2003年起先后在国信证券研究所、博时基金管理有限公司,历任固定收益研究员、博时安心收益定期开放债券基金经理。2012年12月16日起任博时安心收益定期开放债券基金经理。

##### 4.2报告期内本基金运作遵守信情况

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》及其各项实施准则,《博时安心收益定期开放债券基金基金合同》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,为基金份额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,没有损害基金份额持有人的利益。

##### 4.3公平交易专项说明

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  
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报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金A类基金份额净值为1.028元,份额累计净值为1.028元;C类基金份额净值为1.025元,份额累计净值为1.025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为1.13%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望  
展望四季度,基本上,实质性的政策出台的的概率较低,货币政策也并未放松,而且从中央高层的态度来看,基于长远发展的经济转型和结构调整还是主题,经济数据好时坏,目前也看不到政策托底刺激的可能,经济本身上的动力也不足,货币政策方面,我们认为央行可能会延续三季度的节奏,12月份由于财政存款投放流动性或将有所好转,所以,总体上对于四季度的市场,资金成本偏高决定了债市的波段机会有限,大概率上四季度看不到有趋势性机会,组合操作上以减持债券,为定期开放提供流动性为主要操作策略。

#### §5投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	2,379,770,010.76	77.37
3	买入返售金融资产	2,379,770,010.76	77.37
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	722,691,652.17	20.41
6	其他各项资产	78,222,223.43	2.22
7	合计	3,541,188,385.30	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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	1,053,970,010.76	44.21
5	企业短期融资券	1,325,920,000.00	47.43
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,379,770,010.76	100.00

##### 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	098252	09国债(21)71	2,000,000	198,920,000.00	8.34
2	041251004	12国债(1)02	1,300,000	130,910,000.00	5.49
3	122819	11国债(9)	870,000	87,000,000.00	3.68
4	122213	12国债(6)	800,000	80,773,100.00	3.40
5	111214	12国债(6)	800,000	79,280,000.00	3.33

## 博时月月薪定期支付债券型证券投资基金

### 2013 第三季度 报告

2013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:招商银行股份有限公司**  
**报告送出日期:2013年10月23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法律责任。  
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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7月25日起至9月30日止。

#### §2基金产品概况

基金名称	博时月月薪定期支付债券
基金代码	090246
交易代码	090246
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月25日
报告期末基金份额总额	444,415,188.32份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争为投资者提供稳定的现金收入,争取实现超越业绩比较基准的投资目标。
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补充的方法,确定资产在固定收益类资产中的配置比例,在国债、央行票据、中期票据、企业债、短期融资券、中期票据、可转债、资产支持证券等固定收益类资产中,根据对利率走势的判断,进行资产配置。
业绩比较基准	3年期定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为债券基金,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	招商银行股份有限公司

#### 3.1主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年7月25日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	3,213,481.26
2.本期利润	5,258,256.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0067
4.期末基金资产净值	446,953,444.67
5.期末基金份额净值	1.006

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。

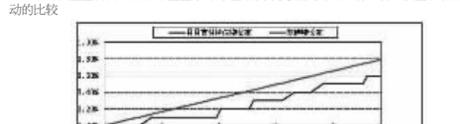
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	0.60%	0.01%	0.79%	0.01%	-0.19%	0.02%

##### 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7月25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4个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(四)投资限制”的有关规定。截至本报告期末本基金的建仓尚未结束。

#### §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	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈皓楠	基金经理	2013-7-25	-	8	2003年起先后在国信证券研究所、博时基金、长城基金工作,2009年1月加入博时基金,历任固定收益研究员、博时安心收益定期支付债券基金经理。2013年7月25日起任博时月月薪定期支付债券基金经理。
魏晓	基金经理	2013-7-25	-	5	2004年8月至2008年6月在招商证券银行工作,任债券自营副经理。2008年7月加入博时基金,任固定收益研究员、博时安心收益定期支付债券基金经理。2013年7月25日起任博时月月薪定期支付债券基金经理。

##### 4.2报告期内本基金运作遵守信情况

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》及其各项实施准则,《博时月月薪定期支付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,为基金份额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,没有损害基金份额持有人的利益。

##### 4.3公平交易专项说明

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  
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。