博时理财30天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: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1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时理财30天债券	
基金主代码	050029	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月28日	
报告期末基金份额总额	199,470,129.57份	
投资目标	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。	
投资策略	本基金通过对宏观经济运行和货币财政政策的分析,预判未来市场利率变化趋势,采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内。采用利率策略、信用策略、个券选择等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,争取提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率(税后)	
风险收益特征	本基金为短期理财债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
下属两级基金的交易代码	050029	050129
报告期末下属两级基金的份额总额	133,753,023.46份	65,717,106.11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7月1日-2013年9月30日)	
	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
1. 本期已实现收益	1,698,932.11	1,980,237.20
2. 本期利润	1,698,932.11	1,980,237.20
3. 期末基金资产净值	133,753,023.46	65,717,106.11

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.博时理财30天债券A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0043%	0.0023%	0.3403%	0.0000%	0.6640%	0.0023%

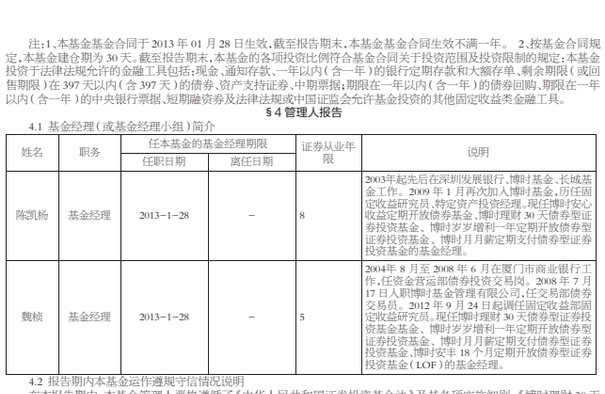
2.博时理财30天债券B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.0786%	0.0023%	0.3403%	0.0000%	0.7383%	0.0023%

注:本基金的收益分配原则是按日分配,每个运作周期期满结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1. 博时理财30天债券A



注:1.本基金基金合同于2013年01月28日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效不满一年。 2.按基金合同规定,本基金建仓期为30天。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券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金融工具。

§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	2013-1-28	-	8	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天债券型证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金的基金经理。
魏楠	基金经理	2013-1-28	-	5	2004年8月至2008年6月在厦门市商业银行工作,任资金营运部债券投资交易岗。2008年7月17日入职博时基金管理有限公司,任交易部债券交易员。2012年9月24日起调任固定收益部固定收益研究员。现任博时理财30天债券型证券投资基金基金、博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)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、《博时理财30天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,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的情况,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

2013年三季度,受资金利率中枢上移、基本面回暖、供给压力及银行配置力度偏弱等因素影响,债券市场收益率一路上行,期间虽有阶段性回落,但熊市特征明显,其中以中长期限品种调整更为显著,收益率曲线形态仍然较为平坦。

三季度,本基金秉承现金管理工具的安全性原则,合理进行流动性安排,滚动投放存款和逆回购,获取资金趋紧的较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类基金份额收益率为1.00%,B类基金份额收益率为1.08%,业绩基准收益率为0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从未来趋势看,央行"锁长放短"的中性基调、市场情绪的缓解、外汇占款的好转以及财政存款释放等因素使得四季度资金面较三季度宽松,流动性或将保持中性环境,资金利率均值水平可能下行至3.5%附近。7-8月基本面的明显回暖可能难以持续,四季度可能逐渐弱化,经济增速或将放缓。因此,中长期收益率脱离基本面持续进一步大幅上扬的概率有限,资金面对中长期利率的影响也逐步减弱;但由于大型商业银行的需求难以调动,收益率下行空间也将有限;中长端收益率可能仍将呈现高位震荡的特征,而短端产品在资金面宽松后或有一定的交易机会。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合较好的流动性和适中的组合期限。未来一段时间,利息收入是主要的收益来源,我们将加大存款与逆回购的投资力度。

§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	固定收益投资	39,974,365.07	20.00
	其中:债券	39,974,365.07	20.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	70,000,345.00	35.02
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	88,965,194.01	44.50
4	其他各项资产	961,292.74	0.48
5	合计	199,901,196.82	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.37
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	23
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

报告期内投资组合平均剩余期限超过150天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过150天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	94.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	15.03	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	5.01	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.73	-

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	摊余成本(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	29,980,372.61	15.03
	其中:政策性金融债	29,980,372.61	15.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,993,992.46	5.01
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	39,974,365.07	20.04
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	29,980,372.61	15.03

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130306	13进出06	300,000	29,980,372.61	15.03
2	041359034	13亨通CP001	100,000	9,993,992.46	5.01

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	-0.05%
报告期内偏离度的最低值	-0.24%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.16%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

5.8.2 报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值20%。

5.8.3 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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	950,934.63
4	应收申购款	10,358.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	961,292.74

5.8.5 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	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
本报告期期初基金份额总额	224,042,932.83	380,592,821.03
本报告期基金总申购份额	82,575,083.26	19,137,467.71
减:本报告期基金总赎回份额	172,864,992.63	334,013,182.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	133,753,023.46	65,717,106.11

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013年9月3日,我司收到中国证监会下发的《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》,责令我司进行为期6个月的整改。我司高度重视,通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理,彻底排查业务中存在的风险隐患,针对性的制定、实施整改措施,进而提升公司内部控制和风险管理的能力,并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准博时理财30天债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时理财30天债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时理财30天债券型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 报告期内博时理财30天债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点:

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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10月23日

博时平衡配置混合型证券投资基金

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: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1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时平衡配置混合
基金主代码	050007
交易代码	050007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月31日
报告期末基金份额总额	2,045,586,863.96份
投资目标	本基金力争在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下,获取长期持续稳定的合理回报。
投资策略	本基金遵循经济周期波动规律,通过定性与定量分析,动态把握不同资产类在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化,追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置。在严格控制投资风险的前提下,追求基金资产的长期持续稳定增长。
业绩比较基准	45%×富时中国A600指数+50%×中国债券总指数+5%×同业存款息率。
风险收益特征	本基金的预期风险低于股票基金,预期收益高于债券基金。本基金属于证券投资基金中的中等风险、中等收益品种。
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 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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	41,205,913.70
2.本期利润	230,700,360.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.1024
4.期末基金资产净值	2,061,941,099.37
5.期末基金份额净值	1.008

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	12.00%	0.98%	4.25%	0.61%	7.75%	0.37%

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2006年5月31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十一条(二)投资范围、(八)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		
皮敏	基金经理	2009-12-8	-	8	2005年至2009年在国信证券经济研究所任分析师。2009年6月加入博时基金管理有限公司,任固定收益部固定收益研究员。现任博时平衡配置混合基金、博时宏观回报债券基金、博时信用债纯债基金的基金经理。
姜文涛	基金经理/混合组投资总监	2012-7-17	-	14.5	1998年参加工作,先后就职于国泰君安证券股份有限公司、博时基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司、南方基金管理有限公司。2011年加入博时基金管理有限公司,2012年7月起任博时回报混合基金和博时平衡配置混合基金基金经理。现任股票投资部混合组投资总监,兼任博时回报混合基金和博时平衡配置混合基金、博时裕益混合基金的基金经理。

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、《博时平衡配置混合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

股票投资部分

三季度宏观经济和股票市场的走向超出我们的预期。我们判断在近年的经济增速持续下调中,政府的刺激是经济回暖的必要条件,这个判断基于对中国经济结构性矛盾的分析,却忽略了市场经济本身的周期性特征。从三季度的经济数据回暖来看,一方面与过去几年货币信贷刺激和市场利率下行带来的经济反弹不同,本轮经济回暖伴随的是市场利率的上升,显示了政府因素之外的经济体系自身的波动规律,另一方面中国的经济回暖与美日德等其他大国经济体系同步,显示了本轮复苏可能具备全球意义。股票市场在这个国内国际背景下,出现了反弹。

三季度内,本基金主要进行了两项投资组合调整。第一,针对股票指数反弹的环境特征,小幅提升了仓位。第二,针对经济的回暖,我们在二季度的消费和TMT行业之外,增加了在其他制造业领域的持仓,在二季度的经济和市场下行过程中,很多制造业公司因为行业属性的关系,估值水平不断下移,随着经济的回暖,我们相信投资者的风险偏好将提升,制造业虽然还未面临全面的投资机会,但制造业中具备独特竞争优势的个别企业,已经进入市场的主流视野。

债券投资部分

今年三季度债券市场出现明显调整,从收益率上升的幅度来看,是近几年少有之大,超出我们预期。市场调整直接的原因是主要商业银行对利率产品的需求微弱,从而推动了整个收益率曲线的上移。本组合的债券配置以中长期高等级和利率产品的配置为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为1.008元,累计份额净值为2.423元,报告期内净值增长率为12.00%,同期业绩基准涨幅为4.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票投资部分

展望2013年四季度,我们认为,投资者需要在本季度内定性本轮经济复苏的性质,股票市场的投资机会和风险都显著与该项进程相关。

不管周期性的复苏是否持续,中国经济的结构性演变都会继续进行,我们在投资上仍会保持对消费和TMT行业的重点配置。同时我们也抱着开放的心态看待后续投资机会,如果复苏力度和持续性显著,那么我们将更多地增加对宏观经济强周期性行业的配置,在个股选择上,即使是对周期性行业进行投资,我们也倾向于选择行业内的成长性个股。

债券投资方面

市场上有很多解释市场调整的理由,比如很流行的观点认为利率市场化将抬升利率中枢,这个理由与2011年市场以刘易斯拐点将抬升通胀中枢而不看好债券市场有点类似。也有观点认为QE退出导致全球利率上行是这次国内调整的原因,但在2010年的市场同样以QE2而不看好债券,理由是输入性通胀。也还有观点认为是经济已经触底,所以收益率要上行等等。在我看来判断当前利率水平高低,未来趋势怎样可能不需要那么复杂而高深的理论,只需分析在当前的利率水平下,企业盈利、债务水平和经济增长是否具有中长期的持续性。如果有,而且这些指标还会越来越好,那就表明当前的利率水平偏低,否则就是偏高。从目前的情况是对这些指标都不具有持续性,因此从中长期来看当前的利率水平偏高,短期而言债券已经调整充分,我们认为4季度债券市场的表现可能不错。本组合将在未来一段市场继续维持当前配置。

§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	1,168,797,417.96	55.12
	其中:股票	1,168,797,417.96	55.12
2	固定收益投资	917,927,500.00	43.29
	其中:债券	917,927,500.00	43.29
	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	11,267,799.78	0.53
6	其他各项资产	22,424,635.69	1.06
7	合计	2,120,417,353.43	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	764,860,319.97	37.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,110,703.30	7.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	246,826,394.69	11.97
S	综合	-	-
	合计	1,168,797,417.96	56.68

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	300251	光线传媒	2,099,349	135,911,854.26	6.59
2	000538	云南白药	1,000,000	117,060,000.00	5.68
3	300133	华策影视	2,739,307	110,914,540.43	5.38
4	002415	海康威视	4,199,452	110,865,532.80	5.38
5	600887	伊利股份	2,399,929	107,228,827.72	5.20
6	600332	白云山	3,000,000	106,740,000.00	5.18
7	601633	长城汽车	2,000,000	102,160,000.00	4.95
8	002353	杰瑞股份	1,420,190	99,526,915.20	4.83
9	300113	顺网科技	1,132,847	79,922,355.85	3.88
10	600637	百视通	1,474,467	77,188,347.45	3.74

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	379,134,000.00	18.39
	其中:政策性金融债	379,134,000.00	18.39
4	企业债券	490,358,500.00	23.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	48,435,000.00	2.35
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	917,927,500.00	44.52

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	130222	13国开22	1,000,000	94,710,000.00	4.59
2	098069	09海投债	600,000	60,012,000.00	2.91
3	120245	12国开45	600,000	59,916,000.00	2.91
4	110241	11国开41	600,000	59,076,000.00	2.87
5	0980144	09汾湖债	500,000	51,170,000.00	2.48

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仓股指期货。

5.9 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。

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 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,108,095.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,171,422.68
5	应收申购款	1,145,117.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,424,635.69

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	2,220,795,405.54
本报告期基金总申购份额	303,517,065.77
减:本报告期基金总赎回份额	478,725,607.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,045,586,863.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013年9月3日,我司收到中国证监会下发的《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》,责令我司进行为期6个月的整改。我司高度重视,通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理,彻底排查业务中存在的风险隐患,针对性的制定、实施整改措施,进而提升公司内部控制和风险管理的能力,并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时平衡配置混合型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时平衡配置混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时平衡配置混合型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 博时平衡配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时平衡配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点:

基金管理人、基金托管人处

9.3 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10月23日

上证超级大盘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1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时上证超大盘ETF
基金主代码	510020
交易代码	510020
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2009年12月29日
报告期末基金份额总额	493,248,002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	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。
业绩比较基准	上证超级大盘指数(价格指数)。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,属于高风险高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪上证超级大盘指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-40,932,375.59
2.本期利润	37,267,542.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0737
4.期末基金资产净值	795,626,126.53
5.期末基金份额净值	1.6130

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	4.65%	1.68%	3.40%	1.68%	1.25%	0.00%

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2009年12月29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3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十一条"(三)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		
方维玲	基金经理	2012-11-13	-	21.5	曾先后在云南大学、海南省信托投资公司证券部、湘财证券有限责任公司海口营业部、北京玖方量子软件技术公司任职。2001年3月入博时基金管理有限公司,历任金融工程小组金融