博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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

2.1基金产品概况

基金简称	博时深证基本面200ETF联接
基金主代码	050021
交易代码	050021
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金
基金合同生效日	2011年6月10日
报告期末基金份额总额	142,231,187.15份
投资目标	通过主要投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即深证基本面200指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金，方便特定的客户群通过本基金投资深证基本面200交易型开放式指数投资基金。本基金不参与深证基本面200交易型开放式指数投资基金的投资管理。
业绩比较基准	深证基本面200指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
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型基金、债券型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，跟踪深证基本面200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	交通银行股份有限公司

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159908
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2011年6月10日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年7月13日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品概况

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	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面200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型基金、债券型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，跟踪深证基本面200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。

§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	-8,210,569.68
2.本期利润	13,072,694.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0853
4.期末基金资产净值	102,519,861.44
5.期末基金份额净值	0.7208

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。

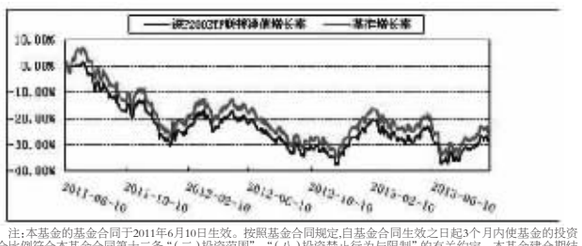
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	13.28%	1.37%	12.84%	1.37%	0.44%	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：本基金的基金合同于2011年6月10日生效。按照基金合同规定，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十二条“（二）投资范围”、“（八）投资禁止行为与限制”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		
赵云阳	基金经理	2012-11-13	-	3	2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年8月加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部量化分析师、博时标普500指数基金基金经理助理和博时深证基本面200ETF基金及其联接基金基金经理助理。现任博时深证基本面200ETF基金及其联接基金、博时上证企债30ETF基金、博时特许价值股票基金的基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

本基金主要投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金，以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的收益。在报告期内，本基金严格按照基金合同，以不低于基金资产净值90%的资产都投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金，保证投资收益紧贴标的指数；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

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0.7208元，累计份额净值为0.7208元，报告期内净值增长率为13.28%，同期业绩基准涨幅为12.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年3季度，宏观经济数据出现明显好转提振了市场情绪，稳增长的政策落地稳定了市场信心，股指缓慢攀升。PMI持续好转，工业生产受益于企业补库存需求启动，进口显著回升，石油和铁矿石等工业原料增长迅速，经济有所企稳回升。从流动性方面来看，整体处于紧平衡的状态，央行维持“控量稳价，锁长放短”的策略。从海外市场方面来看，美国和欧洲经济持续缓慢复苏，9月份美国QE并未缩减。

展望第4季度，市场环境仍然存在诸多的不确定性因素，其主要源于国内外政策变动对经济的调控作用。在国内方面，随着稳增长的压力减缓以及十八届三中全会的临近，各项政策的调整存在不确定性。各项改革的措施也将随着三中全会的召开，逐渐清晰。在国际方面，其主要体现在美国政治的不确定性以及QE退出的节奏。

在投资策略上，深F200ETF联接基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，通过投资于深F200ETF紧密跟踪深证基本面200指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过深F200ETF联接基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

§5投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况（适用于ETF联接基金填写）

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	344,783.56	0.34
	其中：股票	344,783.56	0.34
2	基金投资	96,750,162.18	94.12
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	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	4,847,607.24	4.72
7	其他各项资产	856,456.29	0.83
8	合计	102,799,009.27	100.00

5.2期末投资目标基金明细（适用于ETF联接基金填写）

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金	股票指数型	交易型开放式指数基金	博时基金管理有限公司	96,750,162.18	94.37

5.3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	746.70	0.00
B	采矿业	22,474.29	0.02
C	制造业	202,123.94	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,514.79	0.01
E	建筑业	2,179.08	0.00
F	批发和零售业	30,387.33	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,628.13	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,686.54	0.00
J	金融业	19,771.15	0.02
K	房地产业	52,334.16	0.05
L	租赁和商务服务业	911.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,801.40	0.00
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	565.45	0.00
S	综合	659.20	0.00
	合计	344,783.56	0.34

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	000698	沈阳化工	11,200	44,800.00	0.04
2	000024	招商地产	1,194	28,656.00	0.03
3	000002	万 科A	1,466	13,384.58	0.01
4	002024	苏宁云商	1,026	13,184.10	0.01
5	002155	辰州矿业	800	7,784.00	0.01
6	000538	云南白药	65	7,608.90	0.01
7	000651	格力电器	272	7,224.32	0.01
8	002416	爱施德	272	6,552.48	0.01
9	000001	平安银行	549	6,522.12	0.01
10	000063	中兴通讯	362	6,009.20	0.01

5.5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。

5.6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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	16,733.55
2	应收证券清算款	807,579.57
3	应收股利	-
4	应收利息	2,121.05
5	应收申购款	30,022.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	856,456.29

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000698	沈阳化工	44,800.00	0.04	公告重大事项
2	002155	辰州矿业	7,784.00	0.01	公告重大事项

5.11.6 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	167,272,715.92
本报告期基金总申购份额	3,466,783.12
减：本报告期基金总赎回份额	28,508,311.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	142,231,187.15

§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深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

9.1.2《博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

9.1.3《博时深证基本面200交易型开放式指数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博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.1.6博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金各年度审计报告正本

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

博时特许价值股票型证券投资基金

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	663,294,882.80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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-10,746,629.86
2.本期利润	58,446,111.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0820
4.期末基金资产净值	658,658,966.16
5.期末基金份额净值	0.993

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。

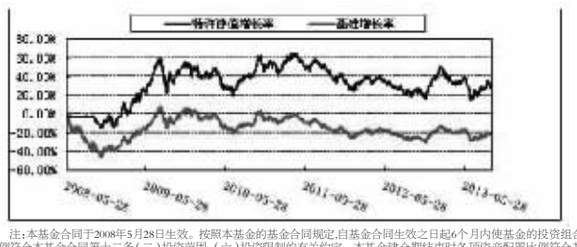
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	8.52%	1.38%	7.22%	1.15%	1.30%	0.23%

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		
赵云阳	基金经理	2013-9-13	-	3	2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年8月加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部量化分析师、博时标普500指数基金基金经理助理和博时深证基本面200ETF基金及其联接基金基金经理助理。现任博时深证基本面200ETF基金及其联接基金、博时上证企债30ETF基金、博时特许价值股票基金的基金经理。
胡俊敏	基金经理	2012-6-11	2013-9-13	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，历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，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

2013年3季度市场分化急速加剧，涨幅第一的信息服务行业上涨超过50%，而金融、地产、食品饮料、采掘等则涨幅低于10%。从市场热点来看，三季度信息服务行业股票的成交金额甚至超过了金融行业；从市场风格来看，小盘股保持了3月份以来对大盘股的领先态势。从归因分析来看，除了信息设备，涨幅居前的热门行业上涨动力全部来自于估值水平的提升，相对中报，这些公司的业绩对于股价上涨甚至还有下拉作用。报告期内，鉴于周期性行业上市公司的盈利能力，部分公司还有较高的进入壁垒，以及周期性行业相对于防御性行业，部分新兴产业等具有估值显著偏低的优势，本基金加仓了地产、有色、采掘、交运等周期性行业。此外，由于金融行业的盈利增长稳定性和增长幅度都相对其它行业有一定优势，而季度内的估值上升幅度较小，本基金还重点加仓了金融行业。

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0.993元，累计份额净值为1.338元，报告期内净值增长率为8.52%，同期业绩基准涨幅为7.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年4季度在宏观层面，预计通胀将温和上行，经济进入周期性的复苏进程。由于8月PPI的回升，未来工业企业的主营利润可能触底回升。股票市场很有可能象往年一样，在4季度将面临全年业绩的第一波检验，高估值公司的表现将趋弱。此外，市场对于三中全会的期待将兑现预期，对于已经稳步推进的市场化改革、以及酝酿已久的房地产调控的长效机制等政策可能会对相关行业基本面和股票价格产生实质性的影响，对于加大开放力度、产业结构调整以及重要体制改革等政策对于基本面和市场面的实质影响估计还需要更长的一段时间。

§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	617,884,465.50	93.25
	其中：股票	617,884,465.50	93.25
2	固定收益投资	4,433,200.00	0.67
	其中：债券	4,433,200.00	0.67
	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	34,213,756.69	5.16
6	其他各项资产	6,082,743.99	0.92
7	合计	662,614,166.18	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	58,421,374.62	8.87
C	制造业	178,793,221.72	27.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,880,263.22	0.44
E	建筑业	22,670,549.78	3.44
F	批发和零售业	63,792,603.95	9.69
G	交通运输、仓储和邮政业	29,229,554.84	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,993,395.92	0.91
J	金融业	197,936,560.28	30.05
K	房地产业	42,299,591.17	6.42
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	15,867,350.00	2.41
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	617,884,465.50	93.81

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	600016	民生银行	4,277,313	40,891,112.28	6.21
2	600739	辽宁成大	2,492,798	38,738,080.92	5.88
3	601166	兴业银行	2,744,449	30,655,495.33	4.65
4	600362	江西铜业	1,453,388	23,530,351.72	3.57
5	601088	中国神华	1,341,108	22,356,270.36	3.39
6	601318	中国平安	613,399	21,898,344.30	3.32
7	601818	光大银行	6,822,400	19,443,840.00	2.95
8	600153	建发股份	2,572,636	18,265,715.60	2.77
9	000002	万 科A	1,917,709	17,508,683.17	2.66
10	600000	浦发银行	1,632,513	16,472,056.17	2.50

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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,433,200.00	0.67
8	其他	-	-
9	合计	4,433,200.00	0.67

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	113002	工行转债	40,000	4,433,200.00	0.67

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	217,524.23
2	应收证券清算款	5,213,689.11
3	应收股利	-
4	应收利息	10,732.70
5	应收申购款	640,797.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,082,743.99

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	4,433,200.00	0.67

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	746,848,583.39
本报告期基金总申购份额	17,966,048.99
减：本报告期基金总赎回份额	101,519,749.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	663,294,882.80

§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特许价值股票型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时特许价值股票型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时特许价值股票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

9.1.6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

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

博时天颐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	博时天颐债券	
基金主代码	050023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年2月29日	
报告期末基金份额总额	208,699,884.14份	
投资目标	在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	在投资范围的约束下，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，在固定收益类、权益类和流动性资产之间进行动态调整。固定收益类资产主要运用期限结构策略、信用策略、立息策略、息差策略、期权策略等，在控制组合风险的前提下，最大化预期收益。权益类资产投资主要选择带有政府壁垒优势、技术壁垒优势、市场与品牌壁垒优势特征，具备持续竞争力和成长力的企业作为投资标的。同时，持有部分流动性资产，应对流动性需求，并提供市场下跌时的净值保护。在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益，同时强调稳健的投资风格，争取实现基金资产长期保值增值的目标，从而在一定程度上满足投资者未来养老费用的支出需求。	
业绩比较基准	三年期定期存款利率（税后）+1%。存续期间内，3年期定期存款利率随中国人民银行公布的利率水平的调整而调整。	
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。	
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	
下属两级基金的基金简称	博时天颐债券 A类	博时天颐债券 C类
下属两级基金的交易代码	050023	050123
报告期末下属两级基金的份额总额	78,332,139.77份	130,367,744.37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)	
	博时天颐债券 A类	博时天颐债券 C类
1.本期已实现收益	472,581.62	840,375.52
2.本期利润	2,737,020.31	4,058,055.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0317	0.0315
4.期末基金资产净值	82,342,857.89	136,511,806.88
5.期末基金份额净值	1.051	1.047

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

1、博时天颐债券 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	3.14%	0.49%	1.32%	0.01%	1.82%	0.48%

2、博时天颐债券 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