博时亚洲票息收益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1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	博时亚洲票息收益债券(QDII)
基金主代码	050030
交易代码	050030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月1日
报告期末基金份额总额	1,552,150,354.75份
投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,寻找各类债券的投资机会,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。
投资策略	主要投资于亚洲市场的各类债券,以买入持有策略为主,配合信用策略、期限结构策略、互换策略等卫星策略。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。
业绩比较基准	JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return
风险收益特征	中等风险/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	招商银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	BROWN BROTHERS HARRIMAN
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	27,709,774.24
2.本期利润	66,333,554.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0399
4.期末基金资产净值	1,584,278,909.01
5.期末基金份额净值	1.0207

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。

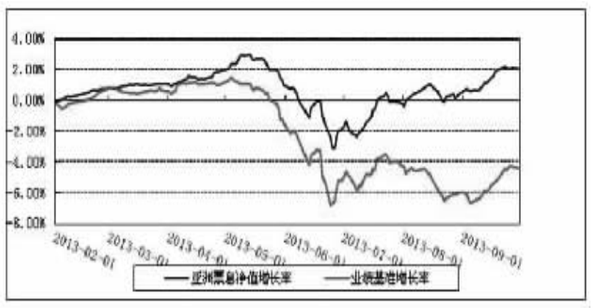
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.07%	0.24%	0.79%	0.32%	3.28%	-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2013年2月1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12条"三、投资范围"、"五、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		
过钧	基金经理/固定收益总部公募基金组投资总监	2013-2-1	-	14	1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德累斯顿银行上海市分行、美国GE资产公司、华夏基金管理有限公司固定收益部工作,2005年加入博时基金管理有限公司,历任基金经理、固定收益部副总经理兼任基金经理职务,2005年8月24日至2010年8月3日期间担任博时稳定价值债券投资基金的基金经理。现任固定收益总部公募基金组投资总监兼博时信用债券基金、博时亚洲票息收益债券(QDII)基金、博时双债增强债券基金的基金经理。

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、《博时亚洲票息收益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。

4.4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

三季度,亚洲信用市场在国内外复杂的宏观因素驱动之下,呈现出较高的波动性:7月初,伴随着国内流动性的恢复正常以及之后经济"保底论"的提出,中国经济基本面企稳回升,在此带领下亚洲信用市场也随之迅速上涨;7月底开始,随着市场对美联储退出QE及其带来的资金外流的担忧加剧,印度和印尼等高经常项目赤字的新兴国家承压,其过度依赖海外资金的经济模式在全球流动性可能开始收紧的大环境下显得格外脆弱,亚洲信用市场也随之下跌;之后市场一度处于底部震荡状态,但9月中,鹰派的萨默斯突然宣布退选美联储主席,加之美联储意外宣布暂时不缩减QE的规模,很大程度提振了市场信心,亚洲信用市场再次上扬。

总体而言,亚洲信用市场三季度在经历宽幅震荡后最终小幅上涨,但市场结构出现明显分化:按地域划分,北亚国家总体表现要好于东南亚国家,其中又以中国的债券表现最强;按照发债主体的类别划分,企业债的表现最好,主权债的表现最差;按照评级划分,高收益债券的表现好于投资级债券。

在基金的操作上,我们坚持了一直以来的短久期、高收益的配置策略,同时超配中国、超配公司债,基本上选中了市场中表现最好的板块,因此基金的表现大幅超越基准。

4.5.2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1.0207元,累计份额净值为1.0207元,报告期内净值增长率为4.07%,同期业绩基准涨幅为0.79%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为主要受到美国政府部分关闭,债务上限僵局以及偏紧的房贷融资状况等因素影响,QE进一步延缓退出的可能性在增加。这对市场的影响可能更偏正面,因为前期市场估值对QE九月退出有非常充分的反应,而今有估值修复的动力;并且客观上讲QE的延缓退出也为那些经常项目面临压力的国家改善自己的经济状况赢得了一些时间。与此同时,我们看到这些国家的基本面也确实开始企稳:经常项目赤字缩窄,货币币值回升等等。综合来看,在外部环境和自身基本面均有改善的情况下,四季度的亚洲信用市场可能交易性机会与配置性机会并存,我们力争在严格控制信用风险的基础上,捕捉相应机会。当然,市场仍然存在一个不确定性因素,即如果美国出现债务违约,将对全球金融市场造成前所未有的冲击,但我们认为出现这种情况的可能性较低,因为美国政府知道其债务违约的严重后果,并且其是否违约最终也是由美国政府自己决定的,而并不取决于其它的外部因素。

§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	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,454,529,852.04	88.73
	其中:债券	1,454,529,852.04	88.73
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	5,193,701.18	0.32
	其中:远期	5,193,701.18	0.32
	期货	-	-
	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	113,708,115.52	6.94
8	其他各项资产	65,818,818.36	4.02
9	合计	1,639,250,487.10	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

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

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
BBB-	46,328,376.96	2.92
BB+	54,046,576.16	3.41
BB	179,125,055.06	11.31
BB-	260,155,541.22	16.42
B+	433,161,844.16	27.34
B	86,450,993.46	5.46
B-	82,845,033.08	5.23
CCC+	22,597,342.88	1.43
未评级	289,819,089.06	18.29

注:评级机构为标准普尔。

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

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	XS0622491701	RESOPW 7 1/4 05/09/49	100,000	63,325,014.80	4.00
2	XS0860154805	LONGYU 5 1/4 12/07/49	100,000	62,187,020.00	3.93
3	XS0836493642	SUNAC 12 1/2 10/16/17	70,000	47,914,560.96	3.02
4	XS0758793342	CITPAC 6 7/8 01/21/18	65,000	41,051,763.74	2.59
5	XS0620341064	GZRFPR 10 7/8 04/29/16	60,000	40,168,818.72	2.54

注:债券代码为ISIN码。

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	远期投资	USD/CNY N 10/29/13	3,086,187.20	0.19
2	远期投资	USD/CNH 12/30/13	1,194,945.31	0.08
3	远期投资	USD/CNH 12/27/13	912,568.67	0.06

注:远期投资的成本为零,此表中的"公允价值"即指"公允价值变动"。

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	-
2	应收证券清算款	9,586,255.32
3	应收股利	-
4	应收利息	33,625,232.66
5	应收申购款	11,864.54
6	其他应收款	22,595,465.84
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,818,818.36

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	1,729,177,273.40
本报告期基金总申购份额	1,461,015.42
减:本报告期基金总赎回份额	178,487,934.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,552,150,354.75

§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亚洲票息收益债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时亚洲票息收益债券型证券投资基金合同》

9.1.3《博时亚洲票息收益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报告期内博时亚洲票息收益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

博时裕富沪深300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	博时沪深300指数
基金主代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月26日
报告期末基金份额总额	12,922,218,013.58份
投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在95%以上,并保持年跟踪误差在4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用被动式投资的方法,按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为:股票资产为95%以内,现金和短期债券资产比例不低于5%。
业绩比较基准	95%×沪深300指数 + 5%×银行同业存款利率
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法,基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出,本基金将严格执行风险管理程序,最大程度地运用数量化风险管理手段,以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。
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	-284,464,300.24
2.本期利润	807,001,877.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0611
4.期末基金资产净值	8,699,817,480.88
5.期末基金份额净值	0.6732

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。

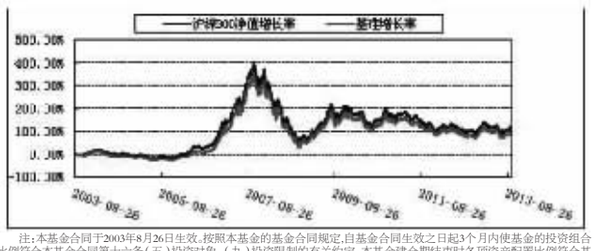
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	9.80%	1.38%	9.02%	1.36%	0.78%	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2003年8月26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十六条(五)投资对象、(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		
王红欣	基金经理/ETF及量化投资组投资总监	2013-1-9	-	19	1994年起先后在RXR期货管理公司、Aeltus投资管理公司、Putnam投资公司、Acadian资产管理公司、易方达资产管理(香港)有限公司工作。2012年10月加入博时基金管理有限公司,担任股票投资部ETF及量化投资组投资总监、博时标普500指数型证券投资基金、博时裕富沪深300指数证券投资基金基金经理。
胡俊敏	基金经理	2012-11-22	2013-9-13	6	1996年起先后在哈佛大学、惠普安捷伦科技、洛姆森金融公司、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、《博时裕富沪深300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,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年三季度,国内企业对经济能部有了一定共识,企业补库存需求启动,在PMI、工业生产、进口、房地产投资、BDI等一系列宏观经济数据企稳回升和政府推动下,指数触底,缓慢回升。在此期间,虽然周期股一定程度上的反弹,自贸区、农地流转等主题板块仍然表现十分抢眼,传媒、TMT、商业贸易等行业涨幅居前。以上现象说明:A股市场对新政府经济政策还处于探索阶段,对未来的经济走向仍未形成共识。与此同时,美国经济数据持续改善,但并未明显超预期,QE退出的步伐有一定放缓、流动性的压力有一定放缓,中国央行在操作上未见大动作,以维稳为主。在投资操作上我们依靠在各行业内精选个股的量化策略,以多方位的估值和基本面逻辑为主,结合个股短期表现,精选估值水平低、公司盈利持续性好、成长性好的个股,进行沪深300指数增强运作。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为0.6732元,累计份额净值为2.6532元,报告期内净值增长率为9.80%,同期业绩基准涨幅为9.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,我们认为以结构性行情为主,不确定性因素仍然较多,美国作为全球复苏最为确定的经济体,全球资本向美国流动的趋势不可避免,随着QE政策退出步伐逐渐清晰,大宗商品价格将进一步承压。国内市场建议关注新政府的城镇化政策,和十八届三中全会前后政府对经济政策的表态。从指数上看,有一定的估值修复的机会,不过在预期还未明朗前,市场还是以结构行情为主,多空双方均有机会,看好交运设备、TMT、家电、食品饮料板块。

§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	8,161,302,076.89	93.60
	其中:股票	8,161,302,076.89	93.60
2	固定收益投资	78,167,991.87	0.90
	其中:债券	78,167,991.87	0.90
	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	476,733,304.26	5.47
6	其他各项资产	3,216,099.61	0.04
7	合计	8,719,419,472.63	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	13,842,522.00	0.16
B	采矿业	585,415,209.03	6.73
C	制造业	2,919,431,003.29	33.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	265,758,048.59	3.05
E	建筑业	342,822,835.87	3.94
F	批发和零售业	300,558,350.81	3.45
G	交通运输、仓储和邮政业	161,470,091.99	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,653,268.46	2.67
J	金融业	2,701,320,035.76	31.05
K	房地产业	447,664,787.43	5.15
L	租赁和商务服务业	43,438,691.66	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	112,923,050.68	1.30
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	27,069,191.32	0.31
S	综合	6,934,990.00	0.08
	合计	8,161,302,076.89	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	36,184,943	345,928,055.08	3.98
2	600036	招商银行	26,457,760	288,918,739.20	3.32
3	601166	兴业银行	19,552,519	218,401,637.23	2.51
4	601318	中国平安	5,653,647	201,835,197.90	2.32
5	600837	海通证券	14,466,935	180,981,356.85	2.08
6	601088	中国神华	9,660,939	161,047,853.13	1.85
7	600000	浦发银行	15,806,501	159,487,595.09	1.83
8	600030	中信证券	12,516,584	153,828,817.36	1.77
9	000002	万 科A	16,775,462	153,159,968.06	1.76
10	601328	交通银行	29,276,875	125,890,562.50	1.45

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	78,167,991.87	0.90
8	其他	-	-
9	合计	78,167,991.87	0.90

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	704,720	78,104,117.60	0.90
2	128002	东华转债	514	63,874.27	0.00

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	948,641.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	606,418.00
4	应收利息	151,158.87
5	应收申购款	1,509,880.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,216,099.61

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	78,104,117.60	0.90

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	13,933,219,117.93
本报告期基金总申购份额	431,082,655.66
减:本报告期基金总赎回份额	1,442,083,760.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,922,218,013.58

§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裕富沪深300指数证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时裕富沪深300指数证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时裕富沪深300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博时裕富沪深300指数证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时裕富沪深300指数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

博时医疗保健行业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	博时医疗保健行业股票
基金主代码	050026
交易代码	050026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月28日
报告期末基金份额总额	194,365,177.60份
投资目标	本基金精选医疗保健行业的优质上市公司,在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,投资策略主要包括资产配置策略和个股选择策略两部分。其中,资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究,动态调整大类资产配置比例,以争取规避系统性风险。个股选择策略采用定性与定量相结合的方式,对医疗保健行业上市公司的投资价值进行综合评估,精选具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。
业绩比较基准	申银万国医药生物行业指数收益率×95%+中国债券总指数收益率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券市场中的高风险高预期收益的基金品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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	19,425,268.14
2.本期利润	51,946,305.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.2258
4.期末基金资产净值	255,049,415.39
5.期末基金份额净值	1.312

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。

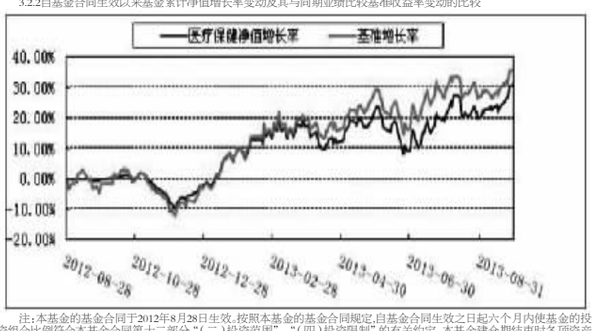
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	20.15%	1.40%	17.05%	1.41%	3.10%	-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:本基金的基金合同于2012年8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六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		
李权胜	基金经理	2012-8-28	-	12	2001年起先后在招商证券研发中心、银华基金工作,2006年3月加入博时基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,投资经理,现任博时医疗保健行业股票基金的基金经理。

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、《博时医疗保健行业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

报告期内A股市场呈现震荡上行趋势,沪深300指数整体上涨近10%,传媒、计算机等多个行业及个股呈现活跃状态,自贸区等主题投资更是表现突出;医药板块整体表现仍然强于市场,7月份医药板块上涨较为突出,在经历8月份的调整之后,9月中下旬开始随着大盘的活跃,医药板块继续出现一波上涨;最终在报告期内申万生物医药指数上涨幅度达到18%。我们认为报告期体现医药板块