博时价值增长证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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:2014年1月22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2014年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时价值增长混合	
基金主代码	050001	
交易代码	050001(前端)	051001(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002年10月9日	
报告期末基金份额总额	18,052,132,538.08份	
投资目标	分享中国经济和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	本基金采用兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略。	
业绩比较基准	自本基金成立日至2008年8月31日,本基金的业绩比较基准为价值增长线,自2008年9月1日起本基金业绩比较基准变更为:70%×沪深300指数收益率+30%×中国债券总指数收益率。	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种,以在风险约束下期望收益最大化为核心,在收益结构上追求下跌风险有下界、上涨收益无上界的目标。	
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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-80,603,816.08
2.本期利润	-1,419,431.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0001
4.期末基金资产净值	12,278,314,189.99
5.期末基金份额净值	0.680

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

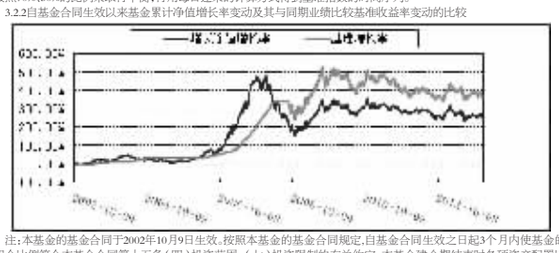
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.00%	0.87%	-2.93%	0.79%	2.93%	0.08%

注:自本基金成立日至2008年8月31日,本基金的业绩比较基准为价值增长线;自2008年9月1日起本基金业绩比较基准变更为:70%×沪深300指数收益率+30%×中国债券总指数收益率。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照70%、30%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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2002年10月9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十五条(四)投资范围、(七)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		
温宇峰	基金经理	2012-7-10	-	12	1994年起先后在中国证监会发行部、中银国际控股公司、博时基金管理有限公司、上投摩根基金管理公司、Prime Capital ,Fidelity International Limited (Hong Kong)从事投资、研究工作。2010年6月加入博时基金管理有限公司,现任博时裕隆封闭基金、博时价值增长混合基金、博时价值增长贰号混合基金基金经理。
聂挺进	研究部总经理兼股票投资部GARP组投资总监、基金经理	2013-11-22	-	7	2004年起在招商局国际有限公司工作。2006年9月加入博时基金管理有限公司,历任研究部研究员、研究部研究员兼基金经理助理、研究部资本品组主管兼基金经理助理、特定资产管理部投资经理、裕泽证券投资基金基金经理。现任研究部总经理兼股票投资部GARP组投资总监、博时卓越品牌股票基金、博时价值增长混合基金基金经理。

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、《博时价值增长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年第4季度,本基金的净值基本持平,整体表现强于基准。在此期间,本基金基于半年度报告的看法,继续逐步增加了在消费、医药和TMT上的配置比重。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为0.680元,累计份额净值为3.182元,报告期内净值增长率为0.00%,同期业绩基准涨幅为-2.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中国的增长动力从投资和工业向消费和服务转换的过程中,中国经济的增速将逐步放缓。在此背景下,能够为股东提供持续的盈利增长、实现高于资本成本的回报并能够合理控制财务杠杆的公司将变得稀缺。因此,本基金将主要从以下角度寻找和投资这种有"品质回报"的上市公司:第一,消费普及和升级;第二,产业升级和整合;第三,绿色发展的机会;第四,中国企业的全球化发展。

在全球经济背景和国内经济结构均处于快速变化的背景下,本基金将坚持自下而上的原则,努力发掘中国经济增长中的结构性投资机会。面对A股市场中不同行业的巨大估值差距,本基金将坚持估值的纪律性,努力寻找未被充分定价的增长。

§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	7,585,434,289.23	61.70
	其中:股票	7,585,434,289.23	61.70
2	固定收益投资	2,845,973,792.50	23.15
	其中:债券	2,845,973,792.50	23.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,140,000,000.00	9.27
	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	613,072,756.06	4.99
6	其他资产	108,763,956.07	0.88
7	合计	12,293,244,793.86	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	16,365,981.28	0.13
B	采矿业	4,689,190.38	0.04
C	制造业	3,662,403,218.62	29.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,876,139.57	0.80
E	建筑业	169,705,605.16	1.38
F	批发和零售业	155,651,836.04	1.27
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	185,428,281.40	1.51
J	金融业	2,246,362,467.86	18.30
K	房地产业	647,191,854.32	5.27
L	租赁和商务服务业	110,350,728.80	0.90
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	289,408,985.80	2.36
S	综合	-	-
	合计	7,585,434,289.23	61.78

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	601318	中国平安	24,886,306	1,038,505,549.38	8.46
2	600030	中信证券	51,039,056	650,747,964.00	5.30
3	000002	万科A	80,596,744	647,191,854.32	5.27
4	000625	长安汽车	41,218,263	471,949,111.35	3.84
5	000338	潍柴动力	20,095,545	381,815,355.00	3.11
6	600276	恒瑞医药	9,296,487	353,080,576.26	2.88
7	601988	中国银行	116,999,333	306,538,252.46	2.50
8	000538	云南白药	2,999,531	305,922,166.69	2.49
9	300133	华策影视	9,072,382	289,408,985.80	2.36
10	601601	中国太保	13,522,434	250,570,702.02	2.04

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	2,580,337,000.00	21.02
	其中:政策性金融债	2,580,337,000.00	21.02
4	企业债券	29,550,000.00	0.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	236,086,792.50	1.92
8	其他	-	-
9	合计	2,845,973,792.50	23.18

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	130409	13农发09	3,900,000	372,450,000.00	3.03
2	110417	11农发17	2,700,000	259,821,000.00	2.12
3	120239	12国开39	2,600,000	251,940,000.00	2.05
4	130228	13国开28	2,500,000	239,450,000.00	1.95
5	130219	13国开19	2,000,000	191,160,000.00	1.56

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 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有国债期货。
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	871,118.76
2	应收证券清算款	56,978,469.78
3	应收股利	-
4	应收利息	50,549,126.43
5	应收申购款	365,241.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	108,763,956.07

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	113001	中行转债	91,104,097.50	0.74

5.10.5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	000625	长安汽车	471,949,111.35	3.84	停牌股票

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	18,727,053,352.45
本报告期基金总申购份额	23,785,080
减:本报告期基金总赎回份额	698,705,894.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,052,132,538.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 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12月31日,博时基金公司共管理四十六只开放式基金和一只封闭式基金,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1052亿元人民币,累计分红超过608亿元人民币,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,股票型基金中,截至12月31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1/4,混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名前1/2。

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前1/3;博时裕祥分级债券A今年以来收益率在17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自2012年6月14日成立以来至2013年12月30日的累计净值增长率已达到31.75%;博时大中华亚太精选今年以来收益率在7只QDII亚太股票型基金中排名第2。

2、客户服务

2013年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动136场,参加人数3400人。

3、其他大事件

2013年11月18日,博时基金在《每日经济新闻》举办的基金金鼎奖评选活动中获得"基金投顾业务-2013最具竞争力基金公司"奖项。

2013年12月20日,东方财富网在北京中国大饭店举办"东财互联网金融圆桌论坛"和"2013东方财富风云榜颁奖盛典"活动,我司获得"最佳企业年金奖"。

§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价值增长证券投资基金设立的文件
9.1.2《博时价值增长证券投资基金基金合同》
9.1.3《博时价值增长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 博时价值增长证券投资基金各年度审计报告正本
9.1.6 报告期内博时价值增长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
2014年1月22日

博时价值增长贰号证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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:2014年1月22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2014年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时价值增长贰号混合	
基金主代码	050201	
交易代码	050201(前端)	051201(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年9月27日	
报告期末基金份额总额	6,596,719,963.04份	
投资目标	在力争使基金份额净值高于价值增长线水平的前提下,本基金在多层次复合投资策略的投资结构基础上,采取低风险适度收益配比原则,以长期投资为主,保持基金资产良好的流动性,谋求基金资产的长期稳定增长。	
投资策略	本基金采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略。	
业绩比较基准	自本基金成立日至2008年8月31日,本基金的业绩比较基准为价值增长线,自2008年9月1日起本基金业绩比较基准变更为:70%×沪深300指数收益率+30%×中国债券总指数收益率。	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种,以在风险约束下期望收益最大化为核心,在收益结构上追求下跌风险有下界、上涨收益无上界的目标。	
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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-41,218,842.01
2.本期利润	-7,765,250.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0012
4.期末基金资产净值	3,986,060,221.52
5.期末基金份额净值	0.604

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	-0.17%	0.90%	-2.93%	0.79%	2.76%	0.11%

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2006年9月27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(三)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		
温宇峰	基金经理	2012-7-10	-	12	1994年起先后在中国证监会发行部、中银国际控股公司、博时基金管理有限公司、上投摩根基金管理公司、Prime Capital ,Fidelity International Limited (Hong Kong)从事投资、研究工作。2010年6月加入博时基金管理有限公司,现任博时裕隆封闭基金、博时价值增长混合基金、博时价值增长贰号混合基金基金经理。
唐桦	基金经理	2013-11-22	-	7	2006年2月从上海财经大学硕士毕业后加入博时基金管理有限公司,历任研究部研究员、研究部原材料组主管兼研究员、股票投资部基金经理助理、特定资产管理部投资经理。现任博时价值增长贰号混合基金基金经理。

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、《博时价值增长贰号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年第4季度,本基金的净值基本持平,整体表现强于基准。在此期间,本基金基于半年度报告的看法,继续逐步增加了在消费、医药和TMT上的配置比重。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为0.604元,累计份额净值为2.059元,报告期内净值增长率为-0.17%,同期业绩基准涨幅为-2.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中国的增长动力从投资和工业向消费和服务转换的过程中,中国经济的增速将逐步放缓。在此背景下,能够为股东提供持续的盈利增长、实现高于资本成本的回报并能够合理控制财务杠杆的公司将变得稀缺。因此,本基金将主要从以下角度寻找和投资这种有"品质回报"的上市公司:第一,消费普及和升级;第二,产业升级和整合;第三,绿色发展的机会;第四,中国企业的全球化发展。

在全球经济背景和国内经济结构均处于快速变化的背景下,本基金将坚持自下而上的原则,努力发掘中国经济增长中的结构性投资机会。面对A股市场中不同行业的巨大估值差距,本基金将坚持估值的纪律性,努力寻找未被充分定价的增长。

§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	2,530,002,415.70	63.29
	其中:股票	2,530,002,415.70	63.29
2	固定收益投资	990,715,164.60	24.78
	其中:债券	990,715,164.60	24.78
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	318,000,000.00	7.96
	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	131,849,700.91	3.30
6	其他资产	26,811,798.13	0.67
7	合计	3,997,379,079.34	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	5,454,063.12	0.14
B	采矿业	1,507,582.72	0.04
C	制造业	1,215,728,729.11	30.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,625,319.54	0.82
E	建筑业	60,934,112.12	1.53
F	批发和零售业	49,501,411.47	1.24
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	61,149,290.60	1.53
J	金融业	751,723,504.03	18.86
K	房地产业	219,241,588.39	5.50
L	租赁和商务服务业	35,865,613.20	0.90
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	96,271,201.40	2.42
S	综合	-	-
	合计	2,530,002,415.70	63.47

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	601318	中国平安	8,411,470	351,010,643.10	8.81
2	000002	万科A	27,302,813	219,241,588.39	5.50
3	600030	中信证券	17,033,518	217,177,354.50	5.45
4	000625	长安汽车	13,539,502	155,027,297.90	3.89
5	000338	潍柴动力	6,698,207	127,265,933.00	3.19
6	600276	恒瑞医药	3,006,730	114,195,605.40	2.86
7	601988	中国银行	38,999,535	102,178,781.70	2.56
8	000538	云南白药	999,562	101,945,328.38	2.56
9	300133	华策影视	3,017,906	96,271,201.40	2.42
10	601601	中国太保	4,390,541	81,356,724.73	2.04

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	886,310,000.00	22.24
	其中:政策性金融债	886,310,000.00	22.24
4	企业债券	9,850,000.00	0.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	94,555,164.60	2.37
8	其他	-	-
9	合计	990,715,164.60	24.85

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	070408	07农发08	2,500,000	247,875,000.00	6.22
2	110416	11农发16	2,000,000	198,800,000.00	4.99
3	120239	12国开39	1,000,000	96,900,000.00	2.43
4	080205	08国开05	1,000,000	96,800,000.00	2.43
5	130218	13国开18	800,000	79,496,000.00	1.99

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 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有国债期货。
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	290,421.12
2	应收证券清算款	8,296,666.78
3	应收股利	-
4	应收利息	18,105,810.69
5	应收申购款	118,899.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,811,798.13

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	113001	中行转债	45,551,567.10	1.14

5.10.5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	000625	长安汽车	155,027,297.90	3.89	公告重大事项

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	6,846,972,879.84
本报告期基金总申购份额	7,063,058.26
减:本报告期基金总赎回份额	257,315,975.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,596,719,963.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 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12月31日,博时基金公司共管理四十六只开放式基金和一只封闭式基金,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1052亿元人民币,累计分红超过608亿元人民币,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,股票型基金中,截至12月31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1/4,混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名前1/2。

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前1/3;博时裕祥分级债券A今年以来收益率在17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自2012年6月14日成立以来至2013年12月30日的累计净值增长率已达到31.75%;博时大中华亚太精选今年以来收益率在7只QDII亚太股票型基金中排名第2。

2、客户服务

2013年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动136场,参加人数3400人。

3、其他大事件

2013年11月18日,博时基金在《每日经济新闻》举办的基金金鼎奖评选活动中获得"基金投顾业务-2013最具竞争力基金公司"奖项。

2013年12月20日,东方财富网在北京中国大饭店举办"东财互联网金融圆桌论坛"和"2013东方财富风云榜颁奖盛典"活动,我司获得"最佳企业年金奖"。

§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价值增长贰号证券投资基金设立的文件
9.1.2《博时价值增长贰号证券投资基金基金合同》
9.1.3《博时价值增长贰号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博时价值增长贰号证券投资基金各年度审计报告正本
9.1.6报告期内博时价值增长贰号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
2014年1月22日

博时安心收益定期开放债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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:2014年1月22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2014年1月21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10月1日起至12月31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	289,915,963.26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	168,235,332.66份	121,680,630.60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10月1日-2013年12月31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	-7,765,589.22	-7,776,692.98
2.本期利润	-11,549,580.69	-11,464