富国中证红利指数增强型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：２０１４年０７月１８日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司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2014年7月16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。
富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国中证红利指数增强
基金主代码	100032
交易代码	前端交易代码:100032 后端交易代码:100033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月20日
报告期末基金份额总额（单位:份）	488,160,884.45
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，其在遵循一整套程序化指数投资、有限度个股调整、精细化风险管理"原则的基础上，实现对中证红利指数的有效跟踪并力争实现超越，分享中国经济长期增长所带来的收益。
投资策略	本基金将采用"指数化投资为主、主动性投资为辅"的投资策略，在完全复制目标指数的基础上有限度地调整个股，从而最大限度降低由于交易成本造成的股票投资组合相对于目标指数的偏离，并力求投资收益能够有效跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	90%×中证红利指数收益率+10%×一年期银行储蓄存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
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

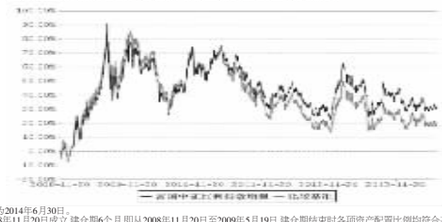
主要财务指标	报告期（2014年04月01日-2014年06月30日）
1.本期已实现收益	-2,720,687.52
2.本期利润	6,265,739.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0127
4.期末基金资产净值	470,771,940.59
5.期末基金份额净值	0.964

注: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(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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。
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	1.26%	0.84%	-0.39%	0.85%	1.65%	-0.01%

注:过去三个月指2014年4月1日-2014年6月30日

3.2.2 自基金转型以来基金累计份额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:截止日期为2014年6月30日。
本基金于2008年11月20日成立,建仓期6个月,即从2008年11月20日至2009年5月19日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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		
徐幼华	本基金基金经理兼任富国中证500指数增强型证券投资基金LOF基金经理	2011-05-13	-	10年	硕士,曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理;2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员,2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司金融部数量研究员、基金经理助理,2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理,2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金LOF基金经理。具有基金从业资格。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
本报告期,富国基金管理有限公司作为富国中证红利指数增强型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证红利指数增强型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长与目标无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人根据相关法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理办法》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、投资执行、业绩评估等投资管理环节,实行集中投资、事中监控、事后评估及预警的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。
事前控制主要包括:1、投向市场通过指标化的办公软件,对关联方密切、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制;2、二级市场,通过交易系统的程序化、交易对手库及投资管理系统的交易对手和操作权限进行控制;3、投资决策。
事中监控主要包括组合间和同组投资标的的交易方向、市场冲击的控制,银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易当限制行为,非指数型控制流程有相同意不跟进行;对于同日同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行监控管理。2、同一基金经理管理的不同组合,对同一投资标的实用相同投资策略的,必须通过交易系统实现同时、同价下达投资指令确保公平对待其所管理的组合。
事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估,以及不同时间窗口下(日、3日、5日)的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统,对违反公平性交易的投向行为进行分析评估,分析结果确认公报,并要求责任人提交书面说明。2、通过公平性交易的事后分析评估系统,对同一基金经理管理不同组合间的交易行为,若发现异常交易行为,监察稽核部稽情况要求相关当事人做出合理性解释,并按法规要求上报稽核监管机构。3、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档坚持以备查员。
本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内未发现异常交易行为。
公司旗下管理的投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,报告期内本组合与其他投资组合之间,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现1次同日反向交易或交易次数少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。
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业绩评分析
回顾2014年二季度,伴随着"经济增速"等多项17项微刺激政策出台,国内经济开始企稳回暖。6月官方制造业PMI指数升至51,连续4月上升,出口、消费、工业等数据也有明显回升。"政府微刺激政策效果开始显现,短期经济仍应也更加明显"。二季度资本市场表现先扬后抑,之后经历了"震荡盘整,并在6月下旬开始趋向回升"。市场情绪仍然以谨慎为主,但已逐渐呈现出看多趋势,中证红利指数二季度整体下跌0.85%。
在投资管理上,我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理,量化增强策略获得了较好的表现,报告期内,本基金的超额收益为1.76%。本基金在报告期内遇到多次申购赎回,在一定程度上增加了本基金的交易成本。
展望2014年三季度,随着微刺激政策的进一步落实,经济将继续企稳回暖。二级市场投资者的情绪将在边际获得较大改善。预计三季度市场整体走势将明显好于上半年,改革的逐条呈现将使得投资者对于经济的信心有系统性的回升,但仍然需要注意市场的系统性信用风险的变化。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
本报告期,本基金份额净值增长率为1.26%,同期业绩比较基准收益率为-0.39%。

§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	426,168,731.89	90.24
	其中:股票	426,168,731.89	90.24
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	45,901,876.33	9.72
7	其他资产	208,828.33	0.04
8	合计	472,279,436.55	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	44,544.00	0.01
B	采矿业	4,808,259.00	1.02
C	制造业	41,721,229.09	8.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,733,768.94	0.58
E	建筑业	1,679,607.48	0.36
F	批发和零售业	3,243,872.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	6,300,790.40	1.34
H	住宿和餐饮业	4,392.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,466,015.04	0.31
J	金融业	12,725,830.90	2.70
K	房地产业	3,887,511.00	0.83
L	租赁和商务服务业	457,697.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	859,250.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	115,458.00	0.02
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	90,972.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	80,139,196.85	17.02

5.3 报告期末指数投资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	30,386,988.74	6.45
C	制造业	173,526,692.23	36.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,298,621.30	6.22
E	建筑业	7,176,214.42	1.52
F	批发和零售业	6,571,013.55	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	20,083,510.59	4.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,782,260.97	0.38
J	金融业	59,644,901.64	12.67
K	房地产业	16,325,883.60	3.47
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	-	-
S	综合	1,233,448.00	0.26
	合计	346,029,535.04	73.50

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股票投资明细
5.4.1 报告期末指数投资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	000559	万向钱潮	943,857	9,702,849.96	2.06
2	601515	东风股份	740,478	8,796,878.64	1.87
3	000541	佛山照明	870,100	8,666,196.00	1.84
4	002085	万丰奥威	399,168	8,486,311.68	1.80
5	600660	福耀玻璃	993,060	8,341,704.00	1.77
6	601939	建设银行	1,878,398	7,757,783.74	1.65
7	000631	顺发恒业	1,657,100	7,490,092.00	1.59
8	600036	招商银行	696,934	7,136,604.16	1.52
9	601288	农业银行	2,824,190	7,116,958.80	1.51
10	601988	中国银行	2,710,919	6,912,843.45	1.47

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000562	宏源证券	771,500	6,341,730.00	1.35
2	000559	万向钱潮	205,561	2,113,167.08	0.45
3	002437	誉衡药业	28,028	1,443,442.00	0.31
4	601988	中国银行	472,200	1,204,110.00	0.26
5	601799	星宇股份	69,353	1,187,323.36	0.25

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注: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序的前五名债券投资明细
注:本基金本报告期末未持有债券资产。
5.7 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资产支持证券投资明细
注: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序的前五名贵金属投资明细
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
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五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和摊销明细
注:本基金本报告期末投资股指期货。
5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。
5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11.1 本期国债期货投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。
5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和摊销明细
注:本基金本报告期末投资国债期货。
5.11.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
5.12 投资组合报告附注
5.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形。
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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
5.12.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
本报告期末基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	150,453.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,388.47
5	应收申购款	49,986.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	208,828.33

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末持有可转换债券。
5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
5.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

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	000562	宏源证券	6,341,730.00	1.35	筹划重大事项

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	501,104,731.19
报告期期间基金总申购份额	5,263,408.98
减:报告期期间基金总赎回份额	18,207,255.72
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期末基金份额总额	488,160,884.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准设立汉鼎证券投资基金的文件
2、汉鼎证券投资基金基金合同
3、汉鼎证券投资基金托管协议
4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
5、汉鼎证券投资基金财务报表及报表附注
6、中国证监会《关于核准汉鼎证券投资基金分额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》
7、富国中证红利指数增强型证券投资基金基金合同
8、富国中证红利指数增强型证券投资基金托管协议
9、富国中证红利指数增强型证券投资基金财务报表及报表附注
10、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
8.2 存放地点
上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
8.3 查阅方式
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话:95105686、4008880686(全国统一免长途话费)
公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2014年07月18日

博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。
基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月17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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时安丰18个月定开债（LOF）
场内简称	安丰18
基金主代码	160515
交易代码	160515
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2013年8月22日
报告期末基金份额总额	248,357,255.56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	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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:1年期定期存款利率（税后）x150%
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期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	上海浦东发展银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

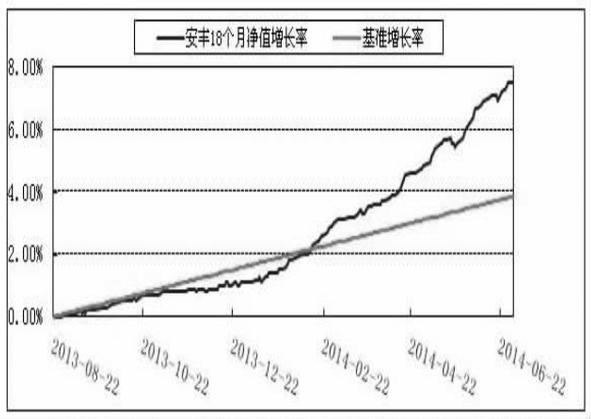
单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2014年4月1日-2014年6月30日）
1.本期已实现收益	6,331,288.21
2.本期利润	9,400,196.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0379
4.期末基金资产净值	259,991,464.67
5.期末基金份额净值	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。
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	3.76%	0.09%	1.12%	0.01%	2.64%	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:本基金合同于2013年8月22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6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三部分（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		
魏楠	基金经理	2013-8-22	-	6	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管，2008年7月加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、固定收益研究员。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月新定期支付债券基金、博时十安丰18个月定期开放债券（LOF)基金、博时双月薪定期支付债券基金基金经理。

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、《博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)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运作分析
2014年第二季度,随着货币政策的逐渐明朗化,资金面状况进一步改善,货币市场利率大幅下滑,银行间R001均值2.53%(-32BP),R007均值3.35%(-70BP)。现券方面,受"定向降准"和"再贷款"等宽松政策的影响,流动性乐观预期从短端传导到长短,牛市行情延续,长端下行幅度超过短端,曲线平坦化。国债平均下行30BP,国开债平均下行65BP;信用债收益率稳中有降,信用利差处于历史偏低水平。
4.5报告期内基金的业绩表现
截至2014年6月30日,本基金份额净值为1.047元,累计份额净值为1.074元,报告期内净值增长率为3.76%,同期业绩基准涨幅为1.12%。
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望第三季度,经济的下滑并没有实质性扭转,地产投资下滑期间,基建投资等稳增长手段客观上要求低利率资金配合。在防控债务和维稳增长中货币政策只能选择定向发力,资金价格有望保持低位平稳运行。由于货币宽松到信用宽松传导不畅,在经济内生动力趋弱、债务偏高的背景下,为避免融资供给过度萎缩,防止经济失速风险,债市下半年资本利得行情寄托于潜在利好的继续释放,政策放松预期有不断强化的空间。另一方面,我们也要警惕市场的风险因素:经济好于预期存在一定的概率,三季度可能成为预期重构的敏感阶段,关注房地产市场融资的实质变化(开发贷和按揭贷的量价放松意味着宏观政策全面宽松);海外货币放水是否会造成物价上涨压力并挤压国内政策空间等。总体上对债市谨慎乐观,细节上修正对流动性的过度乐观和对经济的过度悲观预期。兼顾陡峭化和票息策略,依然偏好低风险资产的表现,精选优质城投。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	515,135,040.81	85.43
	其中:债券	515,135,040.81	85.43
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	76,591,145.38	12.70
7	其他资产	11,246,698.43	1.87
8	合计	602,972,884.62	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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	44,974,240.00	17.30
	其中:政策性金融债	44,974,240.00	17.30
4	企业债券	346,999,800.81	133.47
5	企业短期融资券	30,220,000.00	11.62
6	中期票据	92,941,000.00	35.75
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	515,135,040.81	198.14

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	018002	国开1302	428,000	44,974,240.00	17.30
2	122289	13日照港	245,000	24,990,000.00	9.61
3	122266	13中信03	244,000	24,421,960.00	9.39
4	122068	11海螺01	240,000	23,968,800.00	9.22
5	122921	10郴州债	222,980	23,123,026.00	8.89

5.6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序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8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。
5.10 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。
5.11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、处罚的情况。
5.11.2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。
5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	39,643.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,176,807.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.18
8	其他	-
9	合计	11,246,698.43

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处于转股期的可转换债券。
5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
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

报告期期初基金份额总额	247,885,260.70
报告期期间基金总申购份额	471,994.86
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	248,357,255.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况
基金管理人未持有本基金份额。
7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
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"敬投资价值的发现者"。截至2014年6月30日,博时基金公司共管理四十七只开放式基金,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,公募基金资产规模逼1041亿元人民币,累计分红超过628亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至6月30日,博时医疗保健股票基金、博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/4,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/3。标准指数股票型基金中,博时沪深300指数、博时上证超大盘ETF、博时深证基本面200ETF三只基金今年以来净值增长率在150只同类基金中排名前1/2。混合基金方面,今年以来博时裕益收益率在35只灵活配置型同类基金中排名前1/2,博时平衡配置在16只股债平衡型同类基金中排名前1/2。
固定收益方面,博时信用债纯债今年以来收益率在101只长期标准债券型基金中排名前1/4,博时安丰18个月定期开放基金排名前1/3,博时安盈债券基金(A类)在6只中短期标准债券型基金中排名前1/2。
海外投资方面业绩方面,截至6月30日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时大中华亚太精选今年以来收益率在9只QDII亚太股票型基金中排名第2,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第2。
2、客户服务
2014年二季度,博时基金共举办各类渠道培训活动213场,参加人数5318人。
3、其他大事件
2014年6月16日,大智慧在上海举办"智慧财经巅峰榜",博时基金荣获"牛佳基金公司"奖项,基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜"最佳基金经理"奖项。

§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安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)设立的文件
9.1.2《博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)基金合同》
9.1.3《博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)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报告期内博时安丰18个月定期开放债券型证券投资基金(LOF)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7月18日

博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月18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2014年7月17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。
自2014年6月10日博时裕祥分级债券型证券投资基金之裕祥B(150043)终止上市之日起,原博时裕祥分级债券型证券投资基金名称变更为博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF),原博时裕祥分级债券型证券投资基金本报告期自2014年4月1日至2014年6月9日止,博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)本报告期自2014年6月10日至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)

基金简称	博时稳健回报债券（LOF）
基金主代码	160513
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2011年6月10日
报告期末基金份额总额	1,134,332,087.35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	通过宏观层面自上而下的分析及债券市场方向自下而上的判断,把握市场利率水平的运行态势,根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期选择。在微观方面,基于债券市场的状况,主要采用骑乘、息差策略等投资策略。博时积极参与一级市场新股、债券申购,提高组合预期收益水平。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	从基金整体运作来看,本基金属于中低风险品种,预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属两级基金的基金简称	博时稳健回报债券（LOF）A / 博时稳健回报债券（LOF）C
下属两级基金的场内简称	稳健债A / 稳健债C
下属两级基金的交易代码	160513 / 160514
报告期末下属两级基金的份额总额	799,624,776.92份 / 334,707,310.43份

2.2 博时稳健回报债券型证券投资基金