博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2014年8月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时岁岁增利一年定期开放债券
基金主代码	000200
交易代码	000200
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月26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
报告期末基金份额总额	359,992,288.71份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	银行一年期定期存款利率（税后）×1.1
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高货币市场基金，属于中低风险收益基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	赵会军
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	25,200,400.40
本期利润	38,629,032.54
加权平均基金份额本期利润	0.0334
本期基金份额净值增长率	3.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0416
期末基金资产净值	374,976,885.03
期末基金份额净值	1.042

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.58%	0.07%	0.28%	0.01%	0.30%	0.06%
过去三个月	1.66%	0.05%	0.82%	0.01%	0.84%	0.04%
过去六个月	3.37%	0.06%	1.64%	0.01%	1.73%	0.05%
过去一年	5.13%	0.06%	3.30%	0.01%	1.83%	0.05%
自基金成立起至今	5.13%	0.06%	3.35%	0.01%	1.78%	0.05%

注：本基金的业绩比较基准为银行一年期定期存款利率（税后）×1.1

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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6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六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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，公募基金资产规模逾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年上半年，博时基金共举办各类渠道培训活动284场，参加人数7355人。

3、其他大事件

2014年1月9日，金融界网站在北京举办“第二届领航中国2013金融行业年度颁奖典礼”，博时基金荣获“2013金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖”。

2014年1月11日，在和讯网主办的2013年第十一届财经风云榜基金行业评选中，博时基金荣获“2013年度基金业最佳投资者关系奖”。

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“十佳基金公司”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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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-现金管理组投资副总监	2013-6-26	-	9	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管理有限公司。历任固定收益研究员、特定资产投资经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安心收益定期开放债券基金、博时理财30天债券基金、博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时双月薪定期支付债券基金基金经理。
魏桢	基金经理	2013-6-26	-	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、博时月月薪定期支付债券基金、博时安丰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。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年，基本面趋于弱化、资金面状况改善，货币市场利率和现券收益率均明显下行，债券收益率曲线呈现“牛陡”到“牛平”的特征。R001收于2.93%，R007收于4%，10年国债收益率4.06%，10年国开债4.96%。信用债收益率稳中有降，呈陡峭化下行走势；高收益债则表现偏弱，与金融债信用利差处于历史偏低水平。

由于岁岁增利6月26日开放，组合面临较大比例赎回，组合二级度维持短久期策略，同时保持组合较高流动性。

4.4.2 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1.042元，累计份额净值为1.051元，报告期内净值增长率为3.37%，同期业绩基准涨幅为1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济在定向降准及再贷款和PSL等政策配合及中央代地方投资托底主导下，经济短期企稳回升。而在防控债务和维稳增长中货币政策只能选择定向发力，但总体上，基于偏弱的宏观背景，资金价格有望保持低位平稳运行。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，利率债存在波段机会，但在定向调控的背景下，空间不大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人已于2014年1月10日发布公告，以2013年12月31日可分配利润为基准，每10份基金份额派发红利0.09元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为10,419,058.52元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：		
银行存款	523,502,777.96	533,145,134.96
结算备付金	13,990,578.83	37,234,286.82
存出保证金	42,380.24	102,041.64
交易性金融资产	345,215,414.40	953,071,945.25
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	345,215,414.40	953,071,945.25
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	318,343,112.86	5,000,000.00
应收证券清算款	-	1,794,850.57
应收利息	8,847,086.33	22,690,397.32
应收股利	-	-
应收申购款	2,982.11	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	12,500.00
资产总计	1,209,944,332.73	1,553,051,156.56
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	373,500,000.00
应付证券清算款	-	1,492,002.43
应付赎回款	833,914,222.95	-
应付管理人报酬	658,668.64	698,236.72
应付托管费	188,191.04	199,496.22
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	12,968.38	-1,074.54
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	193,396.69	110,000.00
负债合计	834,967,447.70	375,998,660.83
所有者权益：		
实收基金	359,992,288.71	1,157,673,020.96
未分配利润	14,984,596.32	19,379,474.77
所有者权益合计	374,976,885.03	1,177,052,495.73
负债和所有者权益总计	1,209,944,332.73	1,553,051,156.56

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.042元，基金份额总额359,992,288.71份。

6.2 利润表

会计主体：博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年6月26日（基金合同生效日）至2013年6月30日
一、收入	49,368,373.40	509,867.55
1.利息收入	40,513,881.26	1,057,973.48
其中：存款利息收入	13,350,780.70	914,143.21
债券利息收入	26,442,918.95	22,796.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	720,181.61	121,033.70
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-4,561,640.00	-13,994.61
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,561,640.00	-13,994.61
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	13,428,632.14	-534,111.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-12,500.00	-
减：二、费用	10,739,340.86	120,781.49
1.管理人报酬	4,097,242.74	88,809.74
2.托管费	1,170,640.75	25,374.20
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,507.50	-
5.利息支出	5,242,245.10	-
其中：卖出回购金融资产支出	5,242,245.10	-
6.其他费用	219,704.77	6,597.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	38,629,032.54	389,086.06
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	38,629,032.54	389,086.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时岁岁增利一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,157,673,020.96	19,379,474.77	1,177,052,495.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,629,032.54	38,629,032.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-797,680,732.25	-32,604,852.47	-830,285,584.72
其中：1.基金申购款	3,590,127.28	38,510.95	3,628,638.23
2.基金赎回款	-801,270,859.53	-32,643,363.42	-833,914,222.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-10,419,058.52	-10,419,058.52
五、期末所有者权益（基金净值）	359,992,288.71	14,984,596.32	374,976,885.03
项目	上年度可比期间 2013年6月26日（基金合同生效日）至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,157,673,020.96	-	1,157,673,020.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	389,086.06	389,086.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,157,673,020.96	389,086.06	1,158,062,107.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴姚东　主管会计工作负责人：王德英　会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

无。

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	-	-	-1,674.13	16.43%
关联方名称	上年度可比期间 2013年6月26日（基金合同生效日）至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年6月26日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,097,242.74	88,809.74
其中：支付销售机构的客户维护费	2,296,637.40	50,059.92

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.7% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年6月26日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,170,640.75	25,374.20

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年6月26日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,502,777.96	42,808.87	13,642,613.01	28,725.45

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
				数量（单位：张）	总金额
招商证券	071402005	14国泰君安CP005	新债场外分销	800,000.00	79,980,000.00
招商证券	071407002	14中信建投CP002	新债场外分销	500,000.00	49,987,500.00
上年度可比期间 2013年6月26日（基金合同生效日）至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量（单位：张）	总金额
招商证券	-	-	-	-	-

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	345,215,414.40	28.53
	其中：债券	345,215,414.40	28.53
	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	318,343,112.86	26.31
	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	537,493,356.79	44.42
7	其他各项资产	8,892,448.68	0.73
8	合计	1,209,944,332.73	100.00

7.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	174,439,350.00	46.52
	其中：政策性金融债	174,439,350.00	46.52
4	企业债券	110,704,064.40	29.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	60,072,000.00	16.02
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	345,215,414.40	92.06

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140210	14国开10	800,000	83,000,000.00	22.13
2	018002	国开1302	746,250	78,415,950.00	20.91
3	101461015	14清控MTN001	300,000	30,393,000.00	8.11
4	101361001	13清控MTN001	300,000	29,679,000.00	7.91
5	122921	10郴州债	226,350	23,472,495.00	6.26

7.7 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。

7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	42,380.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,847,086.33
5	应收申购款	2,982.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,892,448.68

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,320	108,431.41	-	-	359,992,288.71	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	49,730.96	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年6月26日）基金份额总额	1,157,673,020.96
本报告期期初基金份额总额	1,157,673,020.96
本报告期基金总申购份额	3,590,127.28
减：本报告期基金总赎回份额	801,270,859.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	359,992,288.71

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于2014年4月19日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，李志惠不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	-	-	-758.40	16.36%	-
中信建投	1	-	-	-3,877.59	83.64%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	717,446,436.48	89.40%	21,230,800,000.00	95.54%	-	-
中信建投	85,103,227.67	10.60%	991,399,000.00	4.46%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

博时基金管理有限公司

2014年8月28日