(上接B66版)

(99)国海证券股份有限公司

注册地址：	广西桂林市辅星路13号
办公地址：	深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人：	张雅锋
联系人：	武斌
电话：	0755-83707413
传真：	0755-83700205
客户服务电话：	4008888100(全国)，96100(广西)
网址：	http://www.ghzq.com.cn

(100)财富证券有限责任公司

注册地址：	长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址：	长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：	蔡一兵
联系人：	郭磊
电话：	0731-84403319
传真：	0731-84403439
客户服务电话：	0731-84403360
网址：	http://www.cfzq.com/

(101)东莞证券有限责任公司

注册地址：	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：	张运勇
联系人：	梁建伟
电话：	0769-22119341
传真：	0769-22116999
客户服务电话：	0769-961130
网址：	http://www.dgzq.com.cn

(102)中原证券股份有限公司

注册地址：	郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：	郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：	菅明军
联系人：	程月艳
电话：	0371－65585670
传真：	0371－65585665
客户服务电话：	0371-967218/4008139666
网址：	http://www.ccnew.com/

(103)东海证券股份有限公司

注册地址：	江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：	上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：	刘化军
联系人：	汪汇
电话：	021-20333333
传真：	021-50498825
客户服务电话：	95531；4008888588
网址：	http://www.longone.com.cn

(104)中银国际证券有限责任公司

注册地址：	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：	许俊
联系人：	王炜哲
电话：	021-68604866
传真：	021-50372474
客户服务电话：	4006208888;021-61195566
网址：	http://www.boci-china.com

(105)恒泰证券股份有限公司

注册地址：	内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址：	内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：	刘汝军
联系人：	张荣亮
电话：	0471-4913998
传真：	0471-4930707
客户服务电话：	0471-4961259
网址：	http://www.cnht.com.cn/

(106)国盛证券有限责任公司

注册地址：	江西省南昌市永叔路15号
办公地址：	江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人：	管荣升
联系人：	徐英云
电话：	0791-6285337
传真：	0791-6289395
客户服务电话：	0791-96168
网址：	http://www.gsstock.com/

(107)华西证券有限责任公司

注册地址：	四川省成都市陕西街239号
办公地址：	四川省成都市陕西街239号
法定代表人：	杨炯纲
联系人：	张璧
电话：	010-68716150
传真：	028-86150040
客户服务电话：	4008888818
网址：	http://www.hx168.com.cn

(108)新疆证券股份有限公司

注册地址：	新疆乌鲁木齐文艺路233号
办公地址：	北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：	洪警生
联系人：	李巍
电话：	010-88085338
传真：	010-88085240
客户服务电话：	4008000562
网址：	http://www.hysec.com

(109)齐鲁证券有限公司

注册地址：	山东省济南市经十路20518号
办公地址：	山东省济南市经七路86号23层
法定代表人：	李玮
联系人：	吴阳
电话：	0531-81283938
传真：	0531-81283900
客户服务电话：	95538
网址：	http://www.qlzq.com.cn/

(110)新纪元证券有限责任公司

注册地址：	深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址：	深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人：	卢长才
联系人：	袁媛
电话：	0755-83199511
传真：	0755-83199599
客户服务电话：	0755-83199599
网址：	http://www.oscn.com.cn/

(111)第一创业证券股份有限公司

注册地址：	深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
办公地址：	深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：	刘学民
联系人：	毛severe
电话：	0755-23835754
传真：	0755-23838750
客户服务电话：	0755-23832852
网址：	www.fcsc.com

(112)中航证券有限公司

注册地址：	南昌市抚河北路291号
办公地址：	南昌市抚河北路291号
法定代表人：	王宜四
联系人：	余雅娜
电话：	0791-6768763
传真：	0791-6789414
客户服务电话：	400-8866-567
网址：	http://www.avicsec.com/

(113)华林证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
办公地址：	深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人：	薛荣年
联系人：	杨玲
电话：	0755-82707855
传真：	0755-23613751
客户服务电话：	全国统一客服热线4008183888 全国统一电话委托号码4008802888
网址：	http://www.chinalin.com/

(114)湘财证券有限责任公司

注册地址：	上海市普陀区曹杨路510号南半楼9楼
办公地址：	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人：	方加春
联系人：	罗芳
电话：	021-68761616
传真：	021-68767981
客户服务电话：	4008888128
网址：	http://www.xcsc.com

(115)西部证券股份有限公司

注册地址：	陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址：	西安市西五路海蓝大厦4层422室
法定代表人：	刘建武
联系人：	冯萍
电话：	029-87406488
传真：	029-87406387
客户服务电话：	95582
网址：	http://www.westsecu.com/

(116)华福证券有限责任公司

注册地址：	福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：	福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：	黄金辉
联系人：	张腾
电话：	0591-87383623
传真：	0591-87383610
客户服务电话：	96326(福建省外请加拨0591)
网址：	http://www.hfzq.com.cn

(117)华龙证券有限责任公司

注册地址：	甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人：	李晓安
联系人：	李昕田
电话：	0931-8888088
传真：	0931-4890515
客户服务电话：	0931-4890619 4890618 4890100
网址：	http://www.hlzqgs.com/

(118)财通证券股份有限公司

注册地址：	杭州市解放路111号
办公地址：	杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1602室
法定代表人：	沈继宁
联系人：	葛卿
电话：	0571-87822359
传真：	0571-87925100
客户服务电话：	96336(上海地区962336)
网址：	http://www.ctsec.com

(119)方正证券有限公司

注册地址：	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
办公地址：	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49楼
法定代表人：	张永衡
联系人：	赖君伟
电话：	0755-23902400
传真：	0755-82545500
客户服务电话：	4001840028
网址：	http://www.wkzq.com.cn

(120)中路证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址：	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法定代表人：	洪家新
联系人：	刘敏
电话：	021-64316642
传真：	021-64333051
客户服务电话：	021-32109999 029-68918888
网址：	http://www.cfsc.com.cn

(121)中国中投证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址：	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：	龙增来
联系人：	刘毅
电话：	0755-82023442
传真：	0755-82026539
客户服务电话：	4006008008
网址：	http://www.cjis.cn/

(122)中山证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
办公地址：	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：	吴永良
联系人：	李静
电话：	0755-82943755
传真：	0755-82940511
客户服务电话：	4001022011
网址：	http://www.zszq.com.cn

(123)国信证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区深南中路1012号招商银行大厦三层至六层
办公地址：	北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层
法定代表人：	凡松杰
联系人：	陈雪虹
电话：	010-88086830
传真：	010-66412537
客户服务电话：	010-66413306
网址：	http://www.rzrg.com.cn

(124)联讯证券股份有限公司

注册地址：	广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：	广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：	徐刚
联系人：	陈昱
电话：	021-33606736
传真：	021-33606760
客户服务电话：	95564
网址：	http://www.lxzq.com.cn

(125)江海证券有限公司

注册地址：	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：	孙名扬
联系人：	张智龙
电话：	0451-85863696
传真：	0451-82287211
客户服务电话：	4006662288
网址：	http://www.jhzq.com.cn

(126)天风证券有限公司

注册地址：	青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址：	深圳市民田路新华保险大厦18楼
法定代表人：	宋宏平
联系人：	关键
电话：	0755-33331188
传真：	0755-33329815
客户服务电话：	4006543218
网址：	http://www.tyzq.com.cn

(127)国金证券股份有限公司

注册地址：	四川省成都市东城根上街95号
办公地址：	四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：	冉云
联系人：	刘一荣
电话：	028-86690070
传真：	028-86690126
客户服务电话：	4006-600109
网址：	http://www.gjzq.com.cn

(128)中国民族证券有限责任公司

注册地址：	北京西城区金融大街5号新盛大厦A座
办公地址：	北京西城区金融大街5号新盛大厦A座613
法定代表人：	赵大建
联系人：	李薇
电话：	010-59355941
传真：	010-66553791
客户服务电话：	400-889-5618
网址：	http://www.e5618.com

(129)平安证券有限责任公司

注册地址：	上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
办公地址：	上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人：	陈林
联系人：	过明丽
电话：	021-68777222
传真：	021-68777822
客户服务电话：	4008209898,021-38929908
网址：	http://www.ehlsbstock.com

(130)厦门证券有限公司

注册地址：	厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
办公地址：	厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼
法定代表人：	傅毅群
联系人：	卢金文
电话：	0592-5161816
传真：	0592-5161102
客户服务电话：	0592-5163588
网址：	http://www.xmzq.cn

(131)爱建证券有限责任公司

注册地址：	上海市南京西路758号23楼
办公地址：	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：	宫龙云
联系人：	戴莉丽
电话：	021-32229888
传真：	021-68728703
客户服务电话：	021-63340678
网址：	http://www.ajzq.com

(132)美大证券有限责任公司

注册地址：	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址：	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：	刘汝
联系人：	吴尔柳
电话：	0755-83007159
传真：	0755-83007034
客户服务电话：	4000-188-688
网址：	http://www.ydsc.com.cn

(133)世纪证券有限责任公司

注册地址：	河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址：	河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
法定代表人：	姜建强
联系人：	刘亚静
电话：	0311-66006393
传真：	0311-66006249
客户服务电话：	4006128888
网址：	http://www.S10000.com

(134)方德证券股份有限公司

注册地址：	辽宁省大连市中山区人民路24号
办公地址：	辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：	于宏民
联系人：	崔立军
电话：	0411-39673202
传真：	0411-39673219
客户服务电话：	4008169169
网址：	http://www.dalton.com.cn

(135)北京冰达证券股份有限公司

注册地址：	云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
办公地址：	北京市西城区北展北街九号华远企业号D座三单元
法定代表人：	李长伟
联系人：	陈斌
电话：	0871-68885858
传真：	0871-68898100
客户服务电话：	400-665-0999
网址：	http://www.bjrsq.com

二、登记机构

名称： 博时基金管理有限公司
住所： 广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
办公地址：北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层
法定代表人：杨佩
电话： 010-65171166
传真： 010-65187068
联系人： 甘勰

三、律师事务所和经办律师

名称： 通力律师事务所
注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
电话： 021- 31358666
传真： 021- 31358600
联系人： 安冬
经办律师：黎明、安冬

四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址：上海市浦东新区延安东路222号外灌渡轮码头1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
电话： 021-23238888
传真： 021-23238800
联系人：沈兆杰
经办注册会计师：薛爽、沈兆杰

第四部分 基金的名称

博时定期回报债券型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资

本基金通过一定范围内固定收益类与权益类资产，以及不同久期固定收益类资产的动态配置，在部不同时期各子类资产的市场收益，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市的股票和债券、以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金主要投资于固定收益类证券，包括国债、央行票据、公司债、金融债、短期融资券、政府机构债、政策性金融机构金融债、商业银行金融债、资产支持证券、次级债、可转换债券及可分离转债、回购及逆回购、银行存款、股指期货、中国证监会认可其金融投资的其他固定收益类金融工具。其中，对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%；对现金或者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%。

本基金还可以参与一级市场新股申购，以及在二级市场上投资股票、权证等权益类证券，本基金投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

第八部分 投资策略

1、本基金资产配置策略

(1)大类资产配置策略

本基金对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%，对股票、权证等权益类资产投资比例不超过基金资产的20%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金采用以自上而下分析为主，自下而上分析为辅，定性分析、定量分析等各种分析手段有效结合的方法进行大类资产配置。分析的内容有：影响经济增长模式、中长期经济增长动力等；影响宏观经济的周期性变量，包括宏观政策、货币供给、CPI等；市场自身的指标，包括供需形势、期限利差、远期利率等。在资产配置方面，采用自上而下的周期资产配置方法，在确定基金资产在固定收益类资产、股票资产、可转换、货币与权益类资产(股票)之间的配置比例后，再确定不同年期债券的配置比例。

债券投资会强依赖于对宏观经济未来运行趋势的判断，而对宏观经济运行趋势的判断也十分有利于判断投资市场的整体走势。本基金将根据主要的经济信号指标对国内外经济形势进行分析，判断经济所处的经济周期阶段、货气循环状况和未来运行趋势。当判断经济处于扩张期，则可提高权益类资产的投资比例。

(2)不同年期债券的配置策略

本基金对不同年期债券的配置，主要采取期限结构策略，通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类不同年期的债券进行久期配置，力争组合收益超过业绩比较基准收益。具体来看，包括期限收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。本基金主要通过以下方法来确定不同年期的债券配置比例：

方法一：博时收益率曲线指标模型

该方法主要通过将影响债券收益率的指标进行定量化处理，结合我国的宏观经济运阐指标体系以及债券市场自身的特性，本基金选取制造业采订单、股票指数、M2等指标作为编制收益率曲线指数的指标库，计算出一个债券收益率的常见指数，从而捉收益率变化趋势，从而对债券收益率的变化趋势进行预测，以期通过调整组合久期，能够捉住利率产品的整体走势。

方法二：定量综合指标评价体系

该评价体系的理念是通过预测宏观经济指标未来的趋势，并与现在进行比较，得出债券收益率在现在基础上的运行趋势。本基金将考察的时间分为短期与中长期，确定每个宏观经济指标的评分范围，依据这些指标与收益率的关系进行评分，计算出收益率在未来短期与中长期的趋势与压力。本基金再根据中长期趋势与短期趋势得分的差异进行不同期限的债券配置。

方法三：收益率曲线预测模型

该模型由两部分组成，第一部分为远期的即期利率预测，第二部分为未来考察期限内的即期利率进行趋势预测，将这两部分结合就能构建考察期限内，相应时点的收益率曲线，本基金将这些预测的收益率曲线与当前收益率曲线进行比较，为当前投资不同期限的债券指数提供支持。

2、本基金投资收益类资产的主要投资策略

本基金固定收益类资产(由于投资对象和投资方法的特殊性，不含可转债)的主要投资策略如下：

在以上大类资产以及不同年期固定收益类资产的比例确定的基础上，本基金主要采取通过操作复制技术模拟中证分年期债券系列指数的走势；同时，灵活应用期限结构策略、信用策略、息差策略等，在合理管理投资组合风险的前提下，最大化组合收益。

(1)通过操作复制模拟分年期债券指数走势

债券市场的交易习惯与股票市场有很大差异，在复制债券市场指数时，本基金将采用抽样复制的方法，综合考虑指数和组合的流动性、交易成本、组合久期、凸度、现金流、行业配置、个券选择、个券久期、个券凸度、个券现金流、个券行业配置、个券个券选择等因素，在一定的组合跟踪误差下，以期获得较高的中证全债指数收益率作为业绩比较基准。

分层抽样法将相关的指数所有成分证券按某种标准分为若干层，每一层为总体中的一个子集，各子集所包含的个体互不重叠，且至少拥有一种共同的特性，然后，再按一定的抽样方式在各层中抽出若干样本，各层抽出的样本，统一组成一个足够多的总样本。

能否找到合适的标准对相关的指数分层成功至关重要，在分层，使得各层的样本至少有一个与其他各层不同的属性，是分层抽样法的一个关键。分层抽样的标准或方法可以有多种，对于固内债券市场，本基金将以指数样本券的剩余年限和信用级别作为一个二维分类标准，即将剩余年限与信用级别作为两个坐标轴，根据坐标轴的数值，将指数成份证券划分到坐标系的不同区域中，按每个区域中证券总市值比例分配各区域抽样比例，在每一个区域内，本基金将通过评分的方法对样本证券进行抽样，评分指标体系包括：债券久期、债券收益率、债券发行规模、债券流动性、债券发行人属性等因素。

(2)适当的主动投资

本基金在指数复制的基础上，在不要求取分层抽样的方法模拟和应用不期的债券指数，在个券投资上，主要运用信用策略、互换策略和息差策略，进行适当的主动投资，以增强收益。

1)信用策略

信用利差收益率主要受两个方面的影响，一是债券对应信用水平的市场信用利差曲线变化；二是债券本身的信用变化。本基金依靠内部评级系统分析债券的相对信用水平，选约风险及理论信用利差，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定各类债券投资比例。

2)互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上的券种，赚取收益差率。

3)息差策略

通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

3、可转换投资策略

本基金采取参考天相可转债指数的方法进行可转债投资，由于可转债债券兼具债性和股性特征，本基金将在参考天相可转债指数的基础上，采用自上而下的宏观、行业分析和自下而上的转债特性分析相结合的方法投资可转债。

4、权证类品种投资策略

(1)一级市场申购策略

本基金权证类品种申购决策主要考虑一二级市场报价率、中签率和申购机会成本三个方面。一级市场申购策略的关键是选取合适的定价模型和参数，在定价过程中充分考虑对应市场的平均信息水平和动态期权行的证券的估值水平，以期合当期的投资环境。

(2)二级市场投资投资策略

本基金的投资管理人在当期基金投资组合管理的辅助工具，为投资者提供适度参与投资的机会。

本基金的投资决策主要遵循三个步骤：一是重点关注我们研究团队长期跟踪并且在投资领域证券公司，并将此类公司作为本基金的基本股票池，同时关注不同时期的主题二是对股票的基本面要进行筛选，应用基本面分析方法，确定标的投资水平，确定标的投资水平，确选出投资潜力的方法，在市场相对低估时机以买入的方式，在市场相对高估时机以卖出的价格，对个股予以动态配置，动态在可投风险前提下的稳健回报。

5、投资决策流程

投资决策委员会是本基金的最高决策机构，定期或遇重大事件时就投资管理业务的重大问题进行讨论，对对本基金投资权方向性指导、基金经理、研究员、交易员等各司其责，相互制衡，共性和投资权力。

(1)投资决策委员会定期召开会议，确定本基金的总投资思路和投资原则。

(2)研究部定期撰写分析报告于自上而下的研究为本基金提供总的资产配置建议；研究部门业研究员为信用债的信用分析提供研究支持；固定收益部数量及信用分析员为固定收益类投资决策提供依据。

(3)固定收益部、投资投资部定期召开投资例会，根据投资决策委员会的决定，结合市场、个股和个券的变化，制定具体的投资策略。

(4)基金经理依据投资会的决定，作等研究员的投资建议，结合风险控制标准做评估的反馈意见，根据市场情况，制定并实施具体的投资组合方案。

(5)基金经理向交易员下达指令，交易员执行后将基金经理反馈。

(6)监察法律部对投资的合法程序行使风险监控。

(7)风险管理部通过行使风险管理职能，测算、分析和监控投资风险，根据风险限额管理政策防范超额损风险。

第九部分 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，对异常价格和无价格成下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。由于本基金为债券型基金，在综合考虑了指数的权威性和代表性，指数的编制方法以及指数与本基金投资范围、投资理念的吻合度后，为本基金选择市场认同度较高的中证全债指数收益率作为业绩比较基准。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，或者指数编制单位终止编制该指数，或有更具权威、更科学的复合指数权重比例，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 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。

第十一部分 基金投资组合报告

博时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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2014年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	6,821,242.43	4.37
	其中：股票	6,821,242.43	4.37
2	固定收益投资	134,835,357.10	86.40
	其中：债券	134,835,357.10	86.40
	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	2,300,000.00	1.47
	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	7,342,570.91	4.71
7	其他资产	4,757,148.22	3.05
8	合计	156,056,318.66	100.00

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	-	-
C	制造业	5,618,377.43	7.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,174,000.00	1.51
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	28,865.00	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
	合计	6,821,242.43	8.78

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	600038	哈飞股份	146,000	4,063,180.00	5.23
2	002318	久立特材	87,333	1,546,667.43	1.99
3	600674	川投能源	100,000	1,174,000.00	1.51
4	300386	飞天诚信	500	28,865.00	0.04
5	002726	龙大肉食	500	8,530.00	0.01

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	70,640,651.50	90.95
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	64,194,705.60	82.65
8	其他	-	-
9	合计	134,835,357.10	173.61

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	110023	民生转债	169,450	15,724,960.00	20.25
2	113003	重工转债	121,740	13,824,794.40	17.80
3	110024	隧道转债	107,090	11,555,011.00	14.88
4	122009	08新湖债	87,060	8,788,707.00	11.32
5	124161	13瑞水泥	84,610	8,257,936.00	10.63

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。

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。

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。

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。

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。

11.投资组合报告附注

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。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	47,314.14
2	应收证券清算款	2,191,793.04
3	应收股利	-
4	应收利息	2,504,158.04
5	应收申购款	13,883.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,757,148.22

11.4 报告期末持有的处于股权期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	110023	民生转债	15,724,960.00	20.25
2	113003	重工转债	13,824,794.40	17.80
3	110024	隧道转债	11,555,011.00	14.88
4	113005	平安转债	7,735,904.40	9.96
5	110016	川投转债	6,567,551.80	8.46
6	110018	国电转债	5,155,384.00	6.64
7	110015	石化转债	3,239,100.00	4.17

11.5 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。

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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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.博时定期回报债券A/B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
2010年7月27日-2014年6月30日	-3.81%	0.54%	12.72%	0.10%	-16.53%	0.44%
2014年1月1日-2014年6月30日	5.37%	0.35%	5.68%	0.07%	-0.31%	0.28%
2013年1月1日-2013年12月31日	-15.35%	0.99%	-1.07%	0.10%	-14.28%	0.89%
2012年1月1日-2012年12月31日	5.10%	0.12%	3.52%	0.07%	1.58%	0.05%
2011年1月1日-2011年12月31日	3.22%	0.22%	5.88%	0.14%	-2.66%	0.08%
2010年7月27日-2010年12月31日	-0.6%	0.31%	-1.64%	0.11%	1.04%	0.20%

2.博时定期回报债券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
2010年7月27日-2014年6月30日	-5.06%	0.53%	12.72%	0.10%	-17.78%	0.43%
2014年1月1日-2014年6月30日	5.17%	0.34%	5.68%	0.07%	-0.51%	0.27%
2013年1月1日-2013年12月31日	-15.40%	0.98%	-1.07%	0.10%	-14.33%	0.88%
2012年1月1日-2012年12月31日	4.62%	0.12%	3.52%	0.07%	1.10%	0.05%
2011年1月1日-2011年12月31日	2.82%	0.22%	5.88%	0.14%	-3.06%	0.08%
2010年7月27日-2010年12月31日	-0.8%	0.32%	-1.64%	0.11%	0.84%	0.21%

第十三部分 基金费用与税收

一、与基金运作有关的费用

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费；

2.基