

博时安盈债券型证券投资基金  
2014 年第 3 季度报告  
2014 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：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2014 年 10 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 10 月 24 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|             |                                                                                                                                                                                                                                 |          |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| 基金简称        | 博时安盈债券                                                                                                                                                                                                                          |          |
| 基金主代码       | 000084                                                                                                                                                                                                                          |          |
| 基金运作方式      | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                          |          |
| 基金合同生效日     | 2013 年 4 月 23 日                                                                                                                                                                                                                 |          |
| 报告期末基金份额总额  | 552,150,000.21 份                                                                                                                                                                                                                |          |
| 投资目标        | 通过基金管理人以对短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断，选择具有投资价值的债券，严格控制风险，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                 |          |
| 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，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析和预测众多的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面，本基金将对短期债券市场收益率曲线和信用利差的变化进行深入细致分析，从而得出对市场走势和波动特征的判断。在此基础上，确定资产在不同行业、不同品种的债券之间的配置比例。 |          |
| 业绩比较基准      | 中国人民银行公布的 1 年期定期存款利率（税后）                                                                                                                                                                                                        |          |
| 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。                                                                                                                                                                          |          |
| 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                                                                                                                                                                                                                    |          |
| 下属两级基金的基金简称 | 博时安盈债券 A                                                                                                                                                                                                                        | 博时安盈债券 C |

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 下属两级基金的交易代码     | 000084           | 000085           |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 296,530,732.46 份 | 255,619,267.75 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(2014 年 7 月 1 日-2014 年 9 月 30 日) |                |
|-----------------|-------------------------------------|----------------|
|                 | 博时安盈债券 A                            | 博时安盈债券 C       |
| 1. 本期已实现收益      | 4,482,364.60                        | 4,425,244.72   |
| 2. 本期利润         | 3,853,063.69                        | 3,382,134.94   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0147                              | 0.0118         |
| 4. 期末基金资产净值     | 315,285,908.09                      | 270,241,681.03 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.063                               | 1.057          |

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

###### 1、博时安盈债券 A：

| 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 | 1.33%  | 0.05%     | 0.76%      | 0.01%         | 0.57% | 0.04% |

###### 2、博时安盈债券 C：

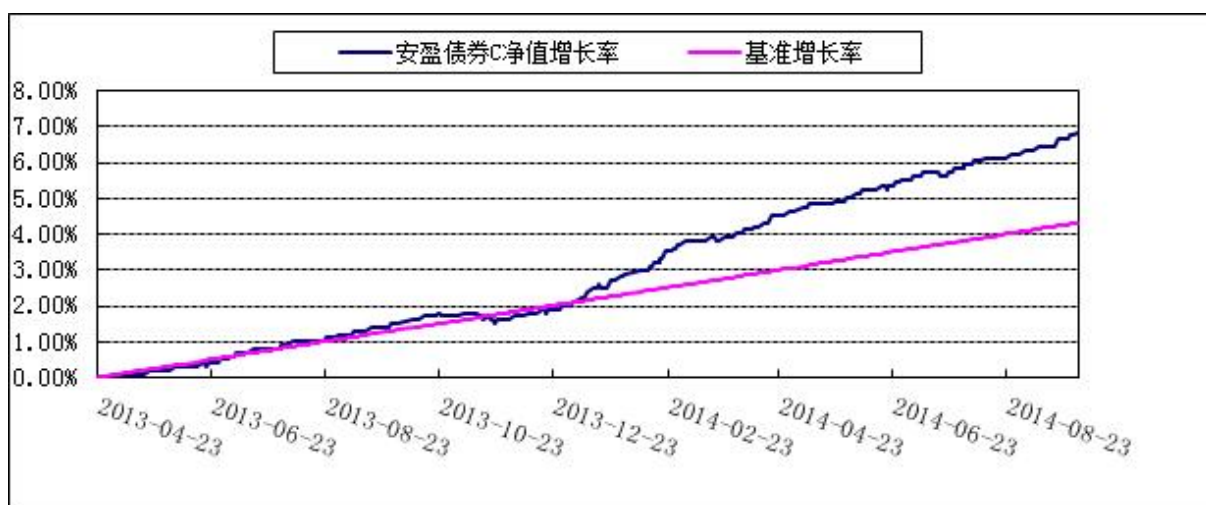
| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.25%  | 0.04%     | 0.76%      | 0.01%         | 0.49% | 0.03% |

##### 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

###### 1. 博时安盈债券 A



## 2. 博时安盈债券 C



注：本基金合同于 2013 年 4 月 23 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“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关约定。

## § 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 |        |                                                                |
| 张勇 | 基金经理/固定收益总部现金管理组投资总监 | 2013-4-23   | -    | 10.5   | 2001 年起先后在南京市商业银行任信贷员、债券交易员。2003 年加入博时基金管理有限公司，历任债券交易员、基金经理助理、 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                              |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 固定收益部副总经理、博时稳定价值债券投资基金的基金经理。现任固定收益总部现金管理组投资总监兼博时现金收益证券投资基金、博时策略灵活配置混合型证券投资基金、博时安盈债券型证券投资基金、博时宏观回报债券型证券投资基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况说明

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、《博时安盈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。

## 4.3 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 年三季度，市场由于 IPO 的原因资金短期趋紧，但整体还是处于一个较为宽松的状态，9 月份央行更是对五大行进行了 5000 亿的 SLF 操作，近似全面降准 0.5 个百分点，使得货币政策结构性宽松更趋常态化。3 季度利率债先上后下，7 月中旬 10Y 国债和国开都上行了 20-30BP，之后一路下行，最终季末 10Y 国债较下行了 9BP 左右，10Y 国开下行了 30BP 左右；信用债方面，高等级调整幅度不大，中长期的中低等级下行了约 25-30BP。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 9 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.063 元，份额累计净值为 1.075 元；C 类基金份额净值为 1.057 元，份额累计净值为 1.068 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.33%，C 类基金份额净值增长率为 1.25%，同期业绩基准增长率 0.76%。

#### 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，因三季度央行降低回购利率、对 5 大国有银行进行 SLF 操作等定向调控货币政策有助于降低流动性波动；房地产政策放松范围扩大、水利、保障房建设、铁路投资加快、支持小微企业发展等稳增长政策和国有企业改革、结构性减税、打破垄断等改革措施互动都将有助于经济回升。而且因同期数据的低基数，四季度经济或短期回稳。四季度，我们仍将继续维持现有策略不变，配置中低等级收益较高的短期融资券。

### § 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            | 592,399,000.00 | 97.74        |
|    | 其中：债券             | 592,399,000.00 | 97.74        |
|    | 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      | 5,037,547.94   | 0.83         |
| 7  | 其他资产              | 8,662,161.06   | 1.43         |
| 8  | 合计                | 606,098,709.00 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未持有股票。

#### 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

报告期末本基金未持有股票。

#### 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      | 40,027,000.00 | 6.84         |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,027,000.00 | 6.84         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |

|   |         |                |        |
|---|---------|----------------|--------|
| 5 | 企业短期融资券 | 552,372,000.00 | 94.34  |
| 6 | 中期票据    | —              | —      |
| 7 | 可转债     | —              | —      |
| 8 | 其他      | —              | —      |
| 9 | 合计      | 592,399,000.00 | 101.17 |

### 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  | 041461041 | 14 潍坊滨投 CP001 | 600,000 | 60,096,000.00 | 10.26        |
| 2  | 041464048 | 14 鲁晨曦 CP001  | 500,000 | 50,420,000.00 | 8.61         |
| 3  | 041458042 | 14 北方水泥 CP001 | 500,000 | 50,300,000.00 | 8.59         |
| 4  | 041460045 | 14 海沧投资 CP001 | 500,000 | 50,265,000.00 | 8.58         |
| 5  | 041472011 | 14 江阴公 CP001  | 500,000 | 50,105,000.00 | 8.56         |

### 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投资。

### 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投资股指期货交易。

### 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投资国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，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 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 7,703,546.84 |
| 5  | 应收申购款   | 958,614.22   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 8,662,161.06 |

#### 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

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

| 项目             | 博时安盈债券 A       | 博时安盈债券 C       |
|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 257,802,121.04 | 280,028,666.35 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 91,363,243.14  | 524,946,119.95 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 52,634,631.72  | 549,355,518.55 |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额    | 296,530,732.46 | 255,619,267.75 |

## § 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“做投资价值的发现者”。截至 2014 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理五十二只开放式基金，并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。博时基金资产管理净值总规模逾 2135 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1098 亿元人民币，累计分红超过 633 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 9 月 30 日，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；博时医疗保健股票基金、博时创业成长股票基金在 355 只标准型股票基金中排名前 1/3；博时主题行业股票基金、博时特许价值股票基金在 355 只标准型股票基金中排名前 1/2；博时精选股票基金在 7 只同类普通股票型基金中排名前 1/2。标准指数股票型基金中，博时深证基本面 200ETF、博时上证自然资源 ETF 在 150 只同类标准指数股票型基金中排名前 1/3；博时裕富沪深 300 指数、博时上证超大盘 ETF 在 150 只同类标准指数股票型基金中排名前 1/2。

固定收益方面，博时宏观回报债券(A/B 类) 今年以来收益率在 93 只同类普通债券型基金中排名第 2；博时信用债纯债、博时安丰 18 个月定期开放基金在 100 只同类长期标准债券型基金中排名前 1/5；博时月月薪定期支付债券基金在 100 只同类长期标准债券型基金中排名前 1/3；博时信用债券(A/B 类)、博时天颐债券(A 类)在 93 只同类普通债券基金中排名前 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；博时现金收益货币(A 类)在 78 只同类货币市场基金中排名前 1/3。

海外投资方面业绩方面，截至 9 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，博时抗通胀在 8 只 QDII 商品基金中排名第 1。

### 2、客户服务

2014 年三季度，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，大智慧在上海发布“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。

2014 年 8 月 27 日，21 世纪网在苏州主办“2014 中国资本市场高峰论坛暨颁奖典礼”，博时亚洲票息收益债券(QDII)基金获评“2014 中国 QDII 基金国民投资热点奖”。

2014 年 9 月 1 日，《投资者报》发布“公募基金投资总监牛人榜”年化收益率排行榜单，博时基金股票投资部价值组投资总监兼博时主题行业股票基金经理邓晓峰登上“公募总监五年以上年化收益率排行榜”。

2014 年 9 月 18 日，中国基金报“首届中国最佳基金经理评选”揭晓，博时大中华亚太精选基金经理张溪冈获评“海外投资最佳基金经理”。

## § 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盈债券型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时安盈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 报告期内博时安盈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

2014 年 10 月 27 日