

博时安心收益定期开放债券型  
证券投资基金  
2014 年年度报告摘要  
2014 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：2015 年 3 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	195,313,789.48份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	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
下属分级基金的交易代码	050028	050128
报告期末下属分级基金的份额总额	136,296,141.40份	59,017,648.08份

### 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	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>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。</p>
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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

博时安心收益定期开放债券 A:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年 12 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	9,031,840.43	26,391,194.37	2,036,352.15
本期利润	18,953,135.35	20,929,988.04	1,295,499.00
加权平均基金份额本期利润	0.1137	0.0183	0.0011
本期基金份额净值增长率	11.49%	1.35%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0610	0.0130	0.0011
期末基金资产净值	136,979,983.10	167,607,043.05	1,212,180,927.96
期末基金份额净值	1.005	0.996	1.001

博时安心收益定期开放债券 C:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年 12 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,951,430.93	20,142,954.44	1,565,670.97
本期利润	13,011,112.62	14,936,724.31	885,462.91
加权平均基金份额本期利润	0.1091	0.0143	0.0008
本期基金份额净值增长率	11.04%	0.94%	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0531	0.0085	0.0008
期末基金资产净值	59,312,993.48	121,192,915.49	1,112,705,624.39
期末基金份额净值	1.005	0.996	1.001

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

博时安心收益定期开放债券 A:

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
过去三个月	4.08%	0.23%	1.09%	0.01%	2.99%	0.22%
过去六个月	6.67%	0.17%	2.23%	0.01%	4.44%	0.16%
过去一年	11.49%	0.15%	4.46%	0.01%	7.03%	0.14%
自基金合同生效起至今	13.11%	0.12%	9.28%	0.01%	3.83%	0.11%

博时安心收益定期开放债券 C:

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
过去三个月	4.04%	0.23%	1.09%	0.01%	2.95%	0.22%
过去六个月	6.45%	0.17%	2.23%	0.01%	4.22%	0.16%
过去一年	11.04%	0.15%	4.46%	0.01%	6.58%	0.14%
自基金合同生效起至今	12.20%	0.12%	9.28%	0.01%	2.92%	0.11%

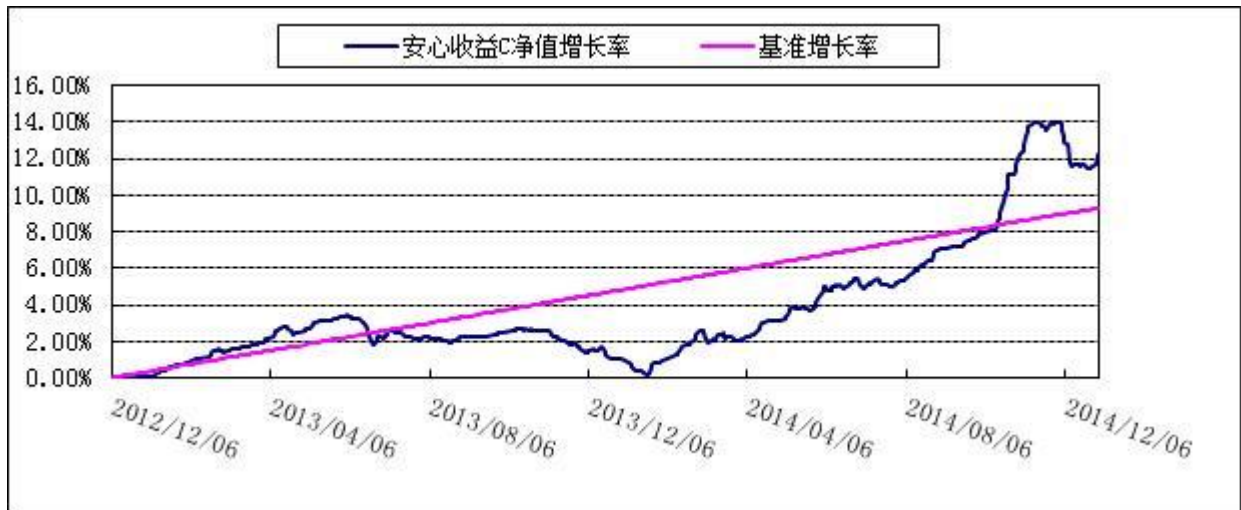
注：本基金的业绩比较基准为1年期定期存款利率（税后）×150%。

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

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较  
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



注：本基金 2012 年实际运作期间为 2012 年 12 月 6 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理五十三只开放式基金，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 2363 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1124 亿元人民币，累计分红超过 638 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 12 月 31 日，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第 6，博时特许价值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第 12；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；博时裕富沪深 300 指数基金在同类 150 只标准指数股票型基金中排名前 1/5，博时上证超大盘 ETF 及博时深证基本面 200ETF 在 150 只标准指数股票型基金中均排名前 1/2；博时上证超级大盘 ETF 联接及博时深证基本面 200ETF 联接在同类 45 只产品中排名前 1/2。混合基金中，博时裕益灵活配置混合在 34 只灵活配置型基金中排名前 1/4，博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类 29 只产品中排名前 1/2；博时平衡配置混合在同类 16 只产品中排名前 1/2。

固定收益方面，博时信用债券(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 1；博时信用债券(C 类) 今年以来收益率在 56 只同类普通债券型基金中排名第 1；博时稳定价值债券(B 类) 今年以来收益率在 41 只同类普通债券型基金中排名第 1；博时稳定价值债券(A 类) 今年以来收益率在 67 只同类普通债券型基金中排名第 2；博时转债增强债券(A 类) 今年以来收益率在 13 只可转换债券基金中排名第 3；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 1/3，博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A 类) 及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 1/2；博时宏观回报债券(A/B 类) 及博时天颐债券(A 类) 在 93 只同类普通债券型基金中分别排名第 7、第 8；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 1/2。

海外投资方面业绩方面，截至 12 月 31 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，博时基金共举办各类渠道培训及活动 718 场，参加人数 18775 人。

## 3) 其他大事件

2014 年 12 月 18 日，博时国际获得和讯海外财经风云榜“2014 年度最佳中资基金公司奖”；

2014 年 12 月 25 日，博时基金获得金融界评选的“最佳品牌奖”。

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”。

### 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	2012-12-06	-	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。

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金



运作管理办法》及其各项实施细则、基金合同和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

##### 4.3.2 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《公平交易管理制度》的规定，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

##### 4.3.3 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 年债券市场逐渐回归到基本面驱动模式之中，低增长、低通胀为 2014 年的债券市场塑造了良好的基本面，刺激市场对政策放松的博弈情绪，支撑债市走出长牛格局。各等级，各品种，各行业信用债都跟随着利率债下行，信用利差多数收窄。截至到 2014 年 12 月 31 日，10 年国债收益率 3.62% (-93BP)，10 年国开债收益率 4.09% (-173BP)，5 年 AAA 中票收益率 4.85% (-149BP)，5 年 AA+ 中票收益率 5.41% (-147BP)，AA 中票收益率 5.89% (-156BP)。

在债券大牛市的基本背景下，组合维持高杠杆和长久期为主的策略。组合高配信用债尤其是城投债投资为主，配合利率债的波段交易，这是组合 2014 年操作总体策略，从结果来看组合获取了较高回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.005 元，份额累计净值为 1.131

元；C 类基金份额净值为 1.005 元，份额累计净值为 1.122 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 11.49%，C 类基金份额净值增长率为 11.04%，同期业绩基准增长率 4.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年将是外围和中国经济最为复杂的一年。欧元区基本面持续恶化，全面实施量化宽松政策，美国面临加息。而中国转型调结构最为困难的一年，经济基本面较差，社会融资成本居高不下，而汇率面临贬值压力，货币政策全面放松受制于汇率政策，内外压力下，货币政策虽然全面宽松是大势所趋，但仍然以对冲性及经济托底为主。这为 2015 年资本市场的表现带来较大不确定性，波动性相比 2014 年明显增加，组合管理操作难度加大。

2015 年组合类属资产配置上，债券仍然是慢牛行情。从类属资产配置上以中高评级为主，低评级信用利差会维持在高位，波动性加大；从收益率曲线形态来看牛平可能转变为牛陡行情。因此，组合策略上以中高评级、中等久期为主，配合以中高杠杆策略。利率债经历 2014 年大牛市之后，以反向博弈获取波段行情。

#### 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

收益分配原则：本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 50%；若基金合同生效不满 3 个月或按照当次最低收益分配比例计算的每份基金份额应分配金额低于 0.001 元，可不进行收益分配；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期末本基金 A 类份额可分配收益为 8,313,125.32 元，C 类份额可分配收益为 3,136,430.55 元。

本基金管理人已于 2015 年 1 月 12 日发布公告，以 2014 年 12 月 31 日的可分配利润为基准，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.350 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.300 元。

#### 4.8 基金持有人数或资产净值预警情形的说明

无。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时安心收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	8,899,089.64	5,035,260.37
结算备付金	6,042,434.21	8,722,260.54
存出保证金	42,374.06	139,782.87
交易性金融资产	237,290,747.20	308,888,180.76
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	237,290,747.20	308,888,180.76
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	-	-
应收证券清算款	5,682,866.04	-
应收利息	8,685,912.37	8,881,426.17
应收股利	-	-
应收申购款	3,512,797.37	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	270,156,220.89	331,666,910.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2014 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
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	70,019,754.97	40,000,000.00
应付证券清算款	-	1,019,638.28
应付赎回款	2,742,884.60	-
应付管理人报酬	132,458.54	479,669.95
应付托管费	44,152.84	159,889.97
应付销售服务费	34,336.04	147,002.73
应付交易费用	-120,182.02	-94,915.96
应交税费	955,667.20	955,667.20
应付利息	4,161.33	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,010.81	200,000.00
负债合计	73,863,244.31	42,866,952.17
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	173,969,525.14	285,100,871.08
未分配利润	22,323,451.44	3,699,087.46
所有者权益合计	196,292,976.58	288,799,958.54
负债和所有者权益总计	270,156,220.89	331,666,910.71

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额总额 195,313,789.48 份。其中 A 类基金份额净值 1.0050 元，基金份额总额 136,296,141.40 份；C 类基金份额净值 1.0050 元，基金份额总额 59,017,648.08 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时安心收益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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>42,538,664.68</b>	<b>103,353,622.24</b>
1. 利息收入	29,296,095.82	142,725,377.78
其中：存款利息收入	216,243.01	11,096,811.84
债券利息收入	28,965,954.03	126,965,887.79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	113,898.78	4,662,678.15
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-3,738,597.29	-28,838,781.50
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,738,597.29	-28,838,781.50
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）	16,980,976.61	-10,667,436.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	189.54	134,462.42
<b>减：二、费用</b>	<b>10,574,416.71</b>	<b>67,486,909.89</b>
1. 管理人报酬	1,784,872.04	13,514,064.53
2. 托管费	594,957.38	4,504,688.05
3. 销售服务费	496,119.95	4,301,932.62
4. 交易费用	5,100.00	42,700.00
5. 利息支出	7,289,696.36	44,632,713.61
其中：卖出回购金融资产支出	7,289,696.36	44,632,713.61
6. 其他费用	403,670.98	490,811.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>31,964,247.97</b>	<b>35,866,712.35</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>31,964,247.97</b>	<b>35,866,712.35</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时安心收益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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	285,100,871.08	3,699,087.46	288,799,958.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,964,247.97	31,964,247.97
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）	-111,131,345.94	-13,339,883.99	-124,471,229.93
其中：1. 基金申购款	59,591,706.57	7,187,687.20	66,779,393.77
2. 基金赎回款	-170,723,052.51	-20,527,571.19	-191,250,623.70
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）	173,969,525.14	22,323,451.44	196,292,976.58
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	2,322,705,590.44	2,180,961.91	2,324,886,552.35

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,866,712.35	35,866,712.35
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）	-2,037,604,719.36	-34,348,586.80	-2,071,953,306.16
其中：1. 基金申购款	9,958,570.52	191,658.86	10,150,229.38
2. 基金赎回款	-2,047,563,289.88	-34,540,245.66	-2,082,103,535.54
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）	285,100,871.08	3,699,087.46	288,799,958.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.2 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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。

### 7.4.3 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
璟安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	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。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,784,872.04	13,514,064.53
其中：支付销售机构的客户维护费	440,435.80	6,885,969.51

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 0.60% 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 × 0.60% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	594,957.38	4,504,688.05

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

#### 7.4.4.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A类基金	C类基金	合计
博时基金	-	86,316.87	86,316.87
建设银行	-	233,060.30	233,060.30
招商证券	-	14.44	14.44
合计	-	319,391.61	319,391.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A类基金	C类基金	合计
博时基金	-	90,555.79	90,555.79
建设银行	-	2,199,422.81	2,199,422.81
招商证券	-	104.16	104.16
合计	-	2,290,082.76	2,290,082.76

注：支付基金销售机构的 C 类基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	100,408,083.96	-	-	-	-	-

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.4.5 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12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	8,899,089.64	70,786.76	5,035,260.37	384,464.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
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	
				数量 (单位：股/张)	总金额
中国建设银行	018002	国开 1302	簿记建档 集中配售	300,000	31,701,000.00
招商证券	GK1405	14 国开 05 (增 6)	新债 场外分销	1,000,000	103,070,000.00
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
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	
				数量 (单位：股/张)	总金额
中国建设银行	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.5 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 30,019,754.97 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1480262	14 太仓港债	05/01/2015	105.40	200,000	21,080,000.00

1380308	13 寿光城投债	05/01/2015	103.08	100,000	10,308,000.00
1382083	13 西王 MTN2	05/01/2015	98.47	16,000	1,575,520.00
<b>合计</b>				316,000	32,963,520.00

#### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 40,000,000.00 元，于 2015 年 1 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 116,582,747.20 元，属于第二层次的余额为 120,708,000.00 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 94,946,180.76 元，属于第二层次的余额为 213,942,000.00 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（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	237,290,747.20	87.83
	其中：债券	237,290,747.20	87.83
	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	14,941,523.85	5.53
7	其他资产	17,923,949.84	6.63
8	合计	270,156,220.89	100.00

### 8.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.5 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（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	24,708,619.60	12.59
	其中：政策性金融债	24,708,619.60	12.59

4	企业债券	123,262,127.60	62.79
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	89,320,000.00	45.50
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	237,290,747.20	120.89

### 8.6 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

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	1382003	13 西王 MTN1	400,000	39,880,000.00	20.32
2	1382083	13 西王 MTN2	300,000	29,541,000.00	15.05
3	018001	国开 1301	240,520	24,708,619.60	12.59
4	124907	14 莞宜居	230,000	24,265,000.00	12.36
5	1480262	14 太仓港债	200,000	21,080,000.00	10.74

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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仓国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	42,374.06
2	应收证券清算款	5,682,866.04
3	应收股利	-
4	应收利息	8,685,912.37
5	应收申购款	3,512,797.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,923,949.84

#### 8.12.4 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可转换债券。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
博时安心收益定期 开放债券 A	970	140,511.49	67,310,890.50	49.39%	68,985,250.90	50.61%
博时安心收益定期 开放债券 C	668	88,349.77	25,815,815.23	43.74%	33,201,832.85	56.26%
合计	1,638.00	119,239.19	93,126,706.73	47.68%	102,187,083.75	52.32%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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 持有本开放式基金	博时安心收益债券 A 类	0.00	0.00%
	博时安心收益债券 C 类	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

### 9.3 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情况

项目	份额级别	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	博时安心收益债券 A 类	-
	博时安心收益债券 C 类	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时安心收益债券 A 类	-
	博时安心收益债券 C 类	-
	合计	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
基金合同生效日(2012 年 12 月 6 日)基金份额总额	1,210,885,428.96	1,111,820,161.48
本报告期期初基金份额总额	168,235,332.66	121,680,630.60
本报告期基金总申购份额	35,939,339.98	30,873,386.13
减：本报告期基金总赎回份额	85,535,980.12	105,762,105.32
本报告期基金拆分变动份额	17,657,448.88	12,225,736.67
本报告期末基金份额总额	136,296,141.40	59,017,648.08

注：根据《博时安心收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《博时安心收益定期开放债券基金基金招募说明书》的有关规定，基金管理人于 2014 年 12 月 12 日对本基金进行了份额折算，折算结果公告可详见博时基金管理有限公司官方网站 2014 年 12 月 16 日刊登的《博时安心收益定期开放债券型证券投资基金份额折算结果的公告》。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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：1) 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；2) 基金管理人于 2014 年 11 月 7 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》，聘任洪小源先生担任博时基金管理有限公司董事长及法定代表人职务，杨鹁女士不再担任博时基金管理有限公司董事长职务。

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人 2014 年 11 月 03 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 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有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 50,000 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
国泰君安	2	-	-	-3,361.59	86.62%	
中金公司	1	-	-	-218.39	5.63%	新增
中信建投	1	-	-	-300.72	7.75%	新增

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，本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。

### 11.7.2 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	
	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
国泰君安	1,052,107,217.37	77.69%	16,339,888,000.00	84.86%
中金公司	10,500,243.38	0.78%	2,900,000.00	0.02%
中信建投	291,660,575.56	21.54%	2,911,200,000.00	15.12%

博时基金管理有限公司

2015年3月28日