博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年三月二十七日

§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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月24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2016年4月15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	博时安怡6个月定开债
基金主代码	002625
交易代码	002625
基金运作方式	契约型,定期开放式
基金合同生效日	2016年4月15日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,988,975,202.06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	中债综合指数(总财富)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%。
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,属于中等风险/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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	张建春
	联系电话	0755-83169999	010-63639180
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		95105568	95595
传真		0755-83195140	010-63639132

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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年4月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日
本期已实现收益	52,297,693.49
本期利润	36,185,757.90
加权平均基金份额本期利润	0.0157
本期基金份额净值增长率	3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0261
期末基金资产净值	3,079,363,512.12
期末基金份额净值	1.030

注:本基金合同生效日为2016年4月15日,基金合同生效日起未满一年。

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
过去三个月	-1.72%	0.16%	-1.29%	0.13%	-0.43%	0.03%
过去六个月	1.38%	0.16%	0.32%	0.10%	1.06%	0.06%
自基金合同生效起至今	3.00%	0.15%	1.03%	0.09%	1.97%	0.06%

注:本基金的业绩比较基准:中债综合指数(总财富)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年4月15日至2016年12月31日)

注:本基金合同于2016年4月15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。

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

博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注:本基金合同于2016年4月15日生效,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2016年12月31日,博时基金公司共管理164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,管理资产总规模逾6250亿元人民币,其中公募基金规模逾3760亿元人民币,累计分红逾781亿元人民币,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,截至2016年年末,博时旗下共94只(份额分开计算)成立满一年的基金产品参与分类排名。其中排名在同类前1/2的产品共有60只(主动权益17只,债券16只,指数20只,货币3只,QDII基金4只),约64%;排名在前1/3的产品共有45只,约48%;排名前1/4的产品共有34只,约36%。博时旗下各类产品均有表现突出的产品位居行业前列。

黄金基金类,博时黄金ETF(D类)今年以来净值增长率19.10%,在同类8只排名第1。

固收方面,长期标准债券型基金里,博时双月薪定期支付债券,今年以来净值增长率为6.54%,在同类61只中排名第2;博时信用债纯债(A类),今年以来净值增长率为4.23%,在同类中排名第4;中短期标准债券型基金,博时安盈债券(A类)今年以来净值增长率为2.02%,在同类66只排名第1;普通债券型基金里,博时稳定价值债券(A类)今年以来净值增长率为2.31%,在同类排名前1/3;货币市场基金里,博时外服货币今年以来净值增长率为3.03%,同类194只排名第6。

QDII基金,博时标普500ETF今年以来净值增长率18.34%,同类排名前1/4。博时亚洲票息收益债券(QDII)今年以来净值增长率14.43%,同类排名第3。

2、其他大事件

●2016年12月27日,2016金融新媒体峰会暨金V榜2016颁奖典礼在广州举行,博时基金荣获"最具传播力基金公司"奖项。

●2016年12月13日,由中国经营报主办的"2016第十四届中国企业竞争力年会暨金融高峰论坛"在北京举行,博时基金荣获"2016卓越竞争力品牌建设金融机构"奖项。

●2016年12月9日,在证券日报主办的"第十二届中国证券市场年会"上,博时基金荣膺中国证券市场"2016年度最全能公募基金龙鼎奖"。

●2016年12月8日,金融界网站主办的首届智能金融国际论坛暨第五届金融界"领航中国"年度盛典,博时基金荣获"2016年杰出品牌奖"。

●2016年12月6日,全国社会保障基金理事会发布公告,博时成为基本养老保险基金首批证券投资管理机构之一。

●2016年12月1日,由《经济观察报》主办的"2015-2016年度观察家金融峰会"在沪举办,博时基金再次独家蝉联"卓越固定收益投资团队奖"。

●2016年11月25日,由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的2016年(第二届)CFAC中国金融年会在深召开,博时基金再次蝉联"年度最佳基金公司大奖"。

●2016年11月23日,由新浪财经主办的"2016新浪全球资产管理论坛"在京举行,"2016中国(首届)波特菲勒奖综合评选"结果揭晓。博时基金荣获"2016最具互联网创新基金公司"、基金经理过钧获评"2016最佳债券基金经理"、何凯获"2016最佳QDII基金经理"。本届波特菲勒奖博时基金共斩获三项大奖,成为获奖最多的公募基金公司之一。

●2016年11月17日,全国社保基金境内投资管理人2016年座谈会在上海举行,博时基金副总裁董良泓荣获"五年服务社保奖",该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人,本次仅授予5人,董良泓先生是自2015年之后再次蝉联该奖项。

●2016年9月7日,第二届结构性融资与资产证券化论坛暨2016年度资产证券化?介甫奖颁奖典礼上,"博时资本-平安银行橙鑫橙e资产支持专项计划"荣获"应收账款类最受投资者欢迎产品"和"最佳风控产品"两项大奖。

●2016年8月5日,由21世纪经济报道主办的"2016深港通论坛暨'金帆奖'系列颁奖礼上,博时一举斩获2016年综合实力十强基金公司奖、2016年互联网突出表现奖、2016年ABS最具实力管理人奖(博时资本)三项大奖。

●2016年6月24日,由南方日报主办的一年一度"金榕奖"南方金融大奖系列评选正式揭晓,博时基金董事长张光华荣膺"2016南方金融领导力年度大奖",博时基金基金经理魏桢荣获"2016南方金融年度投资理财师"称号。

●由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的"中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛"2016年5月13日在深举行。博时旗下博时信用债券获得"五年持续回报积极债券型明星基金奖"。

●2016年5月10日,由上海证券报主办的2016中国基金业峰会暨第十三届"金基金"奖颁奖典礼在上海举办,博时基金荣获"2015年度金基金·债券投资回报基金管理公司"大奖。

●2016年4月15日,由中国基金报主办的第三届中国基金业英华奖评选揭晓,博时基金经理过钧先生获评三年期二级债基最佳基金经理、五年期二级债基最佳基金经理。

●2016年3月27日,第十三届中国基金业金牛奖揭晓,博时基金摘得了基金业的"奥斯卡"奖——"固定收益投资金牛基金公司"奖。

●2016年3月15日,由腾讯证券主办的《"挑战 机遇"315评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓,博时基金董事长张光华先生获评"投资者最认同的公募基金领军人物",网络票选高居第二位。

●2016年1月18日,大众证券报"2015中国基金风云榜"上,博时创业成长(050014)荣获2015"最受投资者喜爱基金"奖、博时安丰18个月定开债(160515)荣获2015"最佳固定收益型基金"奖。

●2016年1月15日,2016年金融理财创新与发展论坛暨第六届"金貔貅"奖颁奖在京举办,博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖;博时"存金宝"获年度金牌创新力金融产品奖。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
陈凯扬	固定收益总部现金管理组投资总监/基金经理	2016-04-15	-	11.2	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、博时理财30天债券基金基金经理、固定收益总部现金管理组投资副总监、博时外服货币市场基金、博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时裕福纯债债券基金、博时益盈纯债债券基金、博时裕恒纯债债券基金、博时裕荣纯债债券基金、博时裕隆纯债债券基金、博时裕泰纯债债券基金、博时裕丰纯债债券基金、博时裕和纯债债券基金、博时裕坤纯债债券基金、博时裕嘉纯债债券基金、博时裕达纯债债券基金、博时裕福纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券基金的基金经理。现任固定收益总部现金管理组投资总监兼博时月薪定期支付债券基金、博时双月薪定期支付债券基金、博时现金收益货币基金、博时安普19个月定开债基金、博时裕乾纯债债券基金、博时裕腾纯债债券基金、博时安和18个月定开债基金、博时安泰18个月定开债基金、博时裕安纯债债券基金、博时裕新纯债债券基金、博时安瑞18个月定开债基金、博时裕发纯债债券基金、博时安怡6个月定开债基金、博时裕景纯债债券基金、博时裕通纯债债券基金、博时安盛18个月定开债基金、博时裕泓纯债债券基金、博时裕泉纯债债券基金、博时安银一年定开债基金、博时裕信纯债债券基金、博时裕城纯债债券基金、博时安诚18个月定开债基金的基金经理。
陈黎	研究员兼基金经理助理	2016-04-15	-	2.5	2014年7月从上海财经大学硕士研究生毕业后加入博时基金,现任固定收益总部研究员兼基金经理助理

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、本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 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相关制度。

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

2016年全年债券市场经历了较大幅度的波动,年初由于信用风险和资金面收紧的因素,债券市场缓慢上行,进入二季度之后,资金面逐渐宽松,利率债尤其是超长债迎来了一波较大幅度的下行,超长债更是创出了年内的新低。但进入四季度之后,债券市场利率经历了短暂的下行之后大幅上升,从10月下旬以来,受央行货币政策边际收紧、全球债券市场大跌、银行委外赎回传闻和国债期货恐慌下跌影响,债券市场出现剧烈调整。从收益率上行幅度看,2016年全年1-3年债券上行超过30BP,5-10年金融债上行10BP,20-30年全年基本持平。从指数上来看,中债总财富指数上涨1.48%,国债指数上涨2.35%,金融债指数上涨0.71%,企业债指数上涨2.46%。

2016年度,本基金根据债券市场特征顺势而为,灵活调整了组合的仓位和杠杆水平,在二三季度债券市场收益率下行时积极拉长久期并增加杠杆,在四季度则大幅减持了中长久期利率债以及中低评级信用债,降低了组合久期和信用风险。

今年以来各大类资产价格的波动,都体现出流动性驱动的特征,这一点在债市上尤为突出。本轮调整之前,过剩的流动性已将期限利差和信用利差压缩到了极致。而随着央行去金融杠杆政策的推进,市场流动性开始收缩,期限利差和信用利差又开始反弹,本轮债市调整,流动性驱动是主要因素,基本面方面并无趋势性变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.030元,份额累计净值为1.030元。报告期内,本基金份额净值增长率为3.00%,同期业绩基准增长率1.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

明年,央行控杠杆仍然是一条重要的主线,在央行控杠杆的思路下,信用刚兑和流动性刚兑都在逐步打破,防风险将成为主基调。近一年来,央行将短端利率守在2.25%,导致大量套利资金涌入债市,银行委外和债市杠杆都迅速上升;但随着经济的企稳,央行去杠杆的估计也显著下降。随着央行对金融去杠杆的推动,流动性的刚兑被打破,短端利率开始出现显著上行。但市场之前对央行控杠杆的决心有所低估,从目前的公开市场操作来看,我们不能低估央行去杠杆的决心。

长期来看,经济下行趋势难改,且处于高债务水平的债务周期内,债券市场利率有下行空间的,我们保持债券市场中长期牛市的观点不变,对于后市不应悲观。但短期机会仍需要耐心等待,从中短期的角度看,宏观政策现阶段的重点在于"抑制资产泡沫、防范金融风险",结合汇率条件和金融高杠杆风险的判断,现阶段货币政策的基调立足于"稳健中性"而不是"稳健宽松",流动性边际条件上维持紧平衡,强调"货币闸门"。在当前时点,债市依然具有配置价值,但需要扛过流动性冲击的影响。短期来看,流动性风险尚没有得到充分的释放,期限利差和信用利差依然存在显著的上行空间。唯有等待流动性风险得到充分释放,期限利差和信用利差得到显著修复,债市才会具有较高的安全边际。

本组合遵循定开债的投资理念,投资思路上保持谨慎乐观,继续采用短久期、轻杠杆操作策略,等待市场调整充分,通过左侧博弈增强收益,精选个券严控信用风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,在完善内部控制制度和流程手册的同时,推动内控体系和制度措施的落实;强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察,通过实时监控、定期检查、专项检查等方式,及时发现情况,提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查,发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告,定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2016年,我公司根据法律、法规的规定,制定、修订和完善了《博时货币市场基金投资管理制度》、《博时基金国债期货投资管理流程手册》、《博时基金国债期货风险管理流程手册》、《博时基金流动性风险管理制度》、《关联交易管理办法》、《交易部公平交易管理制度》、《博时ETF基金风险管理制度》、《博时基金反洗钱工作手册》、《开放式基金业务规则》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》,以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善"博时客户关系管理系统"、"博时投资决策支持系统"等管理平台,加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中,严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料,选择有代销资格的代销机构销售基金,并努力做好投资者教育工作。

4.7 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。

4.8 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:本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资(红利再投资不受封闭期限制);若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后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,本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金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

2016年度,中国光大银行股份有限公司在博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,依法安全保管了基金的全部资产,对博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。同时,按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2016年度,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人——博时基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求,各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——博时基金管理有限公司编制的"博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金2016年年度报告"进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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:博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2016年12月31日
资产:	
银行存款	503,068,875.59
结算备付金	20,977,089.09
存出保证金	36,892.70
交易性金融资产	3,309,891,258.10
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	3,309,891,258.10
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	39,615,259.42
应收证券清算款	-
应收利息	36,994,217.02
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,910,583,591.92
负债和所有者权益	**本期末 2016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	829,700,000.00
应付证券清算款	27,516.83
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,046,263.70
应付托管费	261,565.94
应付销售服务费	-
应付交易费用	24,177.15
应交税费	-
应付利息	15,556.18
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	145,000.00
负债合计	831,220,079.80
所有者权益:	-
实收基金	2,988,975,202.06
未分配利润	90,388,310.06
所有者权益合计	3,079,363,512.12
负债和所有者权益总计	3,910,583,591.92

注:1.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.030元,基金份额总额2,988,975,202.06份。

2.本财务报表的实际编制期间为2016年4月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2016年4月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年4月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	64,726,057.12
1.利息收入	75,436,244.92
其中:存款利息收入	10,111,170.11
债券利息收入	64,326,688.64
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	998,386.17
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,401,747.78
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	5,401,747.78
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)	-16,111,935.58
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	28,540,299.22
1. 管理人报酬	6,702,146.06
2. 托管费	1,675,536.48
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	51,610.00
5. 利息支出	19,824,806.68
其中:卖出回购金融资产支出	19,824,806.68
6. 其他费用	286,200.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	36,185,757.90
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	36,185,757.90

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时安怡6个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2016年4月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年4月15日(基金合同生效日)至2016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)	2,004,604,888.66	-	2,004,604,888.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,185,757.90	36,185,757.90
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)	984,370,313.40	54,202,552.16	1,038,572,865.56
其中:1.基金申购款	984,804,913.24	54,227,123.78	1,039,032,037.02
2.基金赎回款	-434,579.84	-24,571.62	-459,151.46
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)	2,988,975,202.06	90,388,310.06	3,079,363,512.12

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:

基金管理公司负责人:江向阳　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 重要会计政策和会计估计

7.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年4月15日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

7.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.1.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.1.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.2.