

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年8月29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，并对其中的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金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。

基金经理人:陈芳菲 招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月28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。

本基金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

读本基金管理人的招募说明书及其摘要。

本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2013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:博时裕祥分级债券型证券投资基金

场内简称:裕祥

基金代码:160513

契约型基金,本基金《基金合同》生效后,在最初的3年内裕祥A每6个月开放一次申购,赎回业务,裕祥B封闭运作,3年后届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

基金合同生效日:2011年6月10日

基金管理人:博时基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告期初基金份额总额:3,540,005,027.78份

基金份额净值:1.00元

基金合同存续期:不长期

基金份额上市的证券交易所:深圳证券交易所

上市日期:2011年9月21日

下属两级基金的基金简称:博时裕祥分级债券A 博时裕祥分级债券B

下属两级基金的场内简称:裕祥A 裕祥B

下属两级基金的交易代码:160514 150003

报告期下属级别的基金的份额总额:2,740,380,250.86份

799,624,776.92份

2.2基金产品说明

投资目标:在谨慎投资的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

投资策略:通过宏观方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断,把握市场运行趋势,在严格控制风险的前提下,精选具有投资价值的债券品种,并结合宏观经济形势,在微观方面,根据债券市场的状况,主要采用套息、息差利差策略等投资策略,同时积极参与一级市场新股、债券申购,提高组合预期收益率水平。

业绩比较基准:中债全指指数收益率

风险收益特征:从整体运作来看,本基金属于中低风险品种,预期收益和风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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 招商银行股份有限公司

姓名:孙鹏翀 张燕

信息披露负责人:0755-83169999

电子邮箱:service@bofor.com

客户服务电话:95105568 95555

传真:0755-83195140 0755-83195201

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.bofor.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 2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 169,333,635.54

本期利润 111,062,213.60

加权平均基金份额本期利润率 0.0312%

本期基金份额净值增长率 2.91%

3.1.2期末数据和指标 报告期末 2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.1323

期末基金份额净值 3,736,188.0716

期末基金份额净值 1.005

注:本期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)扣减相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价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 标准差② 业绩比较基准收益率③ 标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 -2.08% 0.29% -0.38% 0.16% -1.70% 0.13%

过去三个月 -0.62% 0.23% 0.98% 0.10% -1.60% 0.13%

过去六个月 2.91% 0.21% 2.42% 0.08% 0.49% 0.13%

过去一年 2.92% 0.39% 2.84% 0.07% 0.08% 0.32%

自基金成立以来 15.32% 0.55% 10.45% 0.09% 4.87% 0.46%

注:本基金的业绩比较基准为中债全指指数收益率。

3.2.2基金份额生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变动的比较

金额单位:人民币元

3.3.1期间数据和指标 报告期 2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 111,062,213.60

加权平均基金份额本期利润率 0.0312%

本期基金份额净值增长率 2.91%

3.3.2期末数据和指标 报告期末 2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 0.1323

期末基金份额净值 3,736,188.0716

期末基金份额净值增长率 2.91%

3.4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其他基金管理人员

博时基金管理有限公司成立于1998年7月13日,是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一,注册资本2.5亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。

同时,博时基金管理有限公司拥有博时基金(国际)有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。

博时基金管理公司为股东招银理财有限公司、中国长城资产管理公司、天津港(集团)有限公司、深圳市招银股权投资有限公司、上海盛华股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广发证券投资有限公司、国泰君安证券有限公司、中国平安资产管理公司、国泰君安证券有限公司、国泰君安证券有限公司、国泰君安证券有限公司。

博时基金管理公司是全国社会保障基金理事会委托管理部分基金,以及多个企业年金账户,公募基金总资产规模突破106.69亿元人民币,累计分红60.92亿元人民币,是目前公募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行业中名列第一。

3.4.2基金经理

金额单位:人民币元

3.4.2.1博时裕祥分级债券A与裕祥B份额累计净值

报告期末 1,003

3.4.2.2博时裕祥分级债券A与裕祥B份额净值

1.101

3.4.2.3博时裕祥分级债券A与裕祥B份额累计净值

1.235

3.4.2.4博时裕祥分级债券A与裕祥B份额累计净值

1.235

3.4.2.5博时裕祥分级债券A与裕祥B份额累计净值

4.50%

§ 4 管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其他基金管理人员

博时基金管理有限公司成立于1998年7月13日,是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一,注册资本2.5亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。

同时,博时基金管理有限公司拥有博时基金(国际)有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。

博时基金管理公司为股东招银理财有限公司、中国长城资产管理公司、天津港(集团)有限公司、深圳市招银股权投资有限公司、上海盛华股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广发证券投资有限公司、国泰君安证券有限公司、中国平安资产管理公司、国泰君安证券有限公司、国泰君安证券有限公司。

博时基金管理公司是全国社会保障基金理事会委托管理部分基金,以及多个企业年金账户,公募基金总资产规模突破106.69亿元人民币,累计分红60.92亿元人民币,是目前公募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行业中名列第一。

4.1.2基金经理

基金经理:陈芳菲 招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月28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。

本基金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

读本基金管理人的招募说明书及其摘要。

本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2013年1月1日起至6月30日止。

§ 5 半年度报告摘要

2013年6月30日

博时裕祥分级债券型证券投资基金

2013半年度报告摘要

2013年6月30日

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时裕祥分级债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|-----|----------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 7,168,470,054.39 | 84.69 |
| 3 | 其中:债券 | 7,168,470,054.39 | 84.69 |
| 4 | 资产支持证券 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | 330,001,095.00 | 3.90 |
| 6 | 买入返售金融资产 | 790,100,607.65 | 9.33 |
| 7 | 其他各项资产 | 176,090,918.09 | 2.08 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合 | 8,464,662,675.13 | 100.00 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

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