富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富日日收益货币
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月24日
报告期末基金份额总额	2,541,826,190.19份
投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上,追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金主要为投资者提供现金管理工具,通过积极的投资组合管理,同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会,在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。 1、剩余期限结构配置 基于对国内外宏观经济形势、国家货币政策和财政政策、短期资金市场利率波动、资金供求、市场结构变化等因素的深入研究,对利率期限结构变动趋势进行研判,预测货币市场利率水平,确定基金投资组合的平均剩余期限及期限分配结构,当预期短期利率上升时,缩短组合的平均剩余期限;当预期短期利率下降时,适度延长组合的平均剩余期限。 2、类属资产配置策略 根据市场环境,结合各债券品种之间的流动性、相对收益水平、信用等级、参与主体资金的供求变化及到期期限等因素,灵活运用哑铃形策略、梯形策略及纺锤形策略等,确定组合中各债券品种的配置比例。 3、个券选择,构建投资组合 构建不同券种的收益率曲线预测模型,对货币市场工具进行估值,确定价格中枢的变动趋势,在综合考虑风险收益匹配水平及流动性的基础上,投资于各类属债券中价值低估的个券。在保证投资组合低风险、高流动性的前提下,构建投资组合,并根据投资环境的变化相机调整,尽可能提升组合的收益。 4、现金流均衡管理策略 对市场资金面的变化及本基金申购/赎回变化的动态预测,通过现金库存管理、回购滚动操作、债券品种的期限结构安排及资产变现等措施,动态调整并有效分配现金流,在保证基金资产充分流动性的基础上,获取稳定的收益。 5、充分把握市场短期失衡带来的套利机会 由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级发生突然变化等情况会造成市场在短期内的非有效性;由于新股、新债发行以及季节效应等因素会使市场资金供求关系发生短期失衡,本基金管理人将积极把握由于市场短期失衡而带来的套利机会,通过跨市场套利、跨品种套利、跨期限套利、正回购放大等策略获取超额收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	国富日日收益货币A	国富日日收益货币B
下属两级基金的交易代码	000203	000204
报告期末下属两级基金的份额总额	390,092,512.07份	2,151,733,678.12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(2013年10月1日-2013年12月31日)	
	国富日日收益货币A	国富日日收益货币B
1.本期已实现收益	2,516,481.51	10,174,163.38
2.本期利润	2,516,481.51	10,174,163.38
3.期末基金资产净值	390,092,512.07	2,151,733,678.12

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 国富日日收益货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1612%	0.0021%	0.3394%	0.0000%	0.8218%	0.0021%

2. 国富日日收益货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2218%	0.0021%	0.3394%	0.0000%	0.8824%	0.0021%

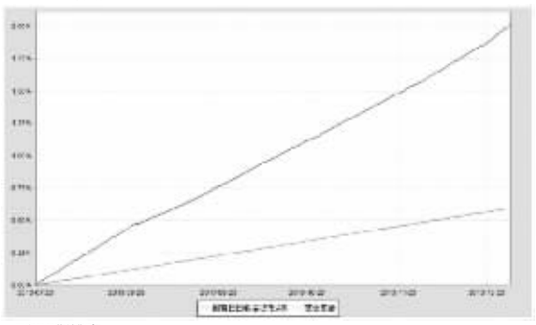
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金

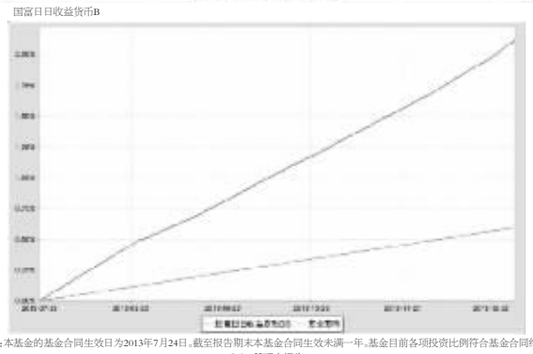
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年7月24日至2013年12月31日)

1、 国富日日收益货币A



2、 国富日日收益货币B



注:本基金的基金合同生效日为2013年7月24日,截至报告期末本基金合同生效未满一年,基金目前各项投资比例符合基金合同约定。

§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		
胡永燕	国富日日收益货币基金、国富恒丰定期债券基金的基金经理	2013-7-24	-	5年	胡永燕女士,中国人民大学金融学硕士,历任华泰资产管理有限公司固定收益组合管理部研究员、投资助理及投资经理,并曾在国海富兰克林基金管理有限公司负责公司投资管理部固定收益小组固定收益类产品的投资与研究工作,现任国海富兰克林基金管理有限公司国富日日收益货币基金、国富恒丰定期债券基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

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,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季度,债券市场整体呈现熊市特征,在资金利率中枢抬升的背景下短端债券的收益率上行幅度高于长端,利率债呈现一级市场发行利率上行推动二级市场利率走高的特点,信用利差持续扩大。从驱动债券市场走向的主要因素分析:资金面上,脆弱格局依然延续,11月和12月中下旬资金价格均出现较大幅度的上行;经济面上,PMI等先行指标显示经济增长的动能有所缓解,但持续高企的资金利率对实体经济的影响或将在未来逐渐显现,需要重点防御发债企业信用资质的分化;政策面上,央行稳中偏紧的货币政策下,市场对2014年春节前的资金面预期难言乐观,未来政策层对同业资产非标业务的政策导向值得密切关注。四季度,本基金维持短久期、滚动投资、谨慎配置的策略,配置较大比例的短期存款,控制组合的整体久期,密切关注持仓债券的信用变化趋势,在根据市场资金面的变化和组合的资金变化作好的流动性管理的前提下,为基金持有人创造稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自2013年9月30日至本报告期末,基金份额A类净值增长1.1612%,同期业绩比较基准增长0.3394%,基金超额收益率0.8200%,基金份额B类净值增长1.2218%,同期业绩比较基准增长0.3394%,基金超额收益率0.8800%。

§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	固定收益投资	299,437,765.74	11.31
	其中:债券	299,437,765.74	11.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,104,811,938.22	41.72
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,161,901,186.18	43.87
4	其他资产	82,178,364.63	3.10
5	合计	2,648,329,254.77	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		4.36
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	99,989,650.01	3.93
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	24
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	88
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	82.57	3.93
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	10.54	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.78	-
4	90天(含)—180天	3.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	1.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.97	3.93

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	摊余成本(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	169,489,022.93	6.67
	其中:政策性金融债	169,489,022.93	6.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	129,948,742.81	5.11
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	299,437,765.74	11.78
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,946,422.07	0.78

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价、贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130218	13国开18	500,000	49,706,045.67	1.96
2	110215	11国开15	300,000	29,887,782.98	1.18
3	041358022	13友阿CP001	200,000	20,004,290.02	0.79
4	041358032	13沪打捞CP001	200,000	20,001,294.83	0.79
5	041361041	13希望六和CP001	200,000	19,998,885.66	0.79
6	110203	11国开03	200,000	19,991,735.17	0.79
7	041356024	13苏交通CP003	200,000	19,989,637.27	0.79
8	130248	13国开48	200,000	19,982,243.94	0.79
9	110403	11农发03	200,000	19,977,668.96	0.79
10	090205	09国开05	200,000	19,946,422.07	0.78

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0157%
报告期内偏离度的最低值	-0.1350%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0435%

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金份额资产净值始终维持在1.00元。

5.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本未超过基金资产净值的20%。

5.8.3 本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受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	11,692,590.89
4	应收申购款	70,485,773.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	82,178,364.63

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国富日日收益货币A	国富日日收益货币B
本报告期期初基金份额总额	190,738,504.48	269,396,075.65
本报告期基金总申购份额	841,935,879.29	3,679,265,629.69
减:本报告期基金总赎回份额	642,581,871.70	1,796,928,027.22
本报告期末基金份额总额	390,092,512.07	2,151,733,678.12

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金设立的文件;

2、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金基金合同》;

3、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金招募说明书》;

4、《富兰克林国海日日收益货币市场证券投资基金托管协议》;

5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站: www.ftsfund.com。

8.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一四年一月二十二日

博时双债增强债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时双债增强债券	
基金主代码	000280	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月13日	
报告期末基金份额总额	109,135,735.41份	
投资目标	在控制投资风险的前提下,通过基金管理人对不同类别债券资产的配置,对债券的精选,力争实现超过业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金的投资策略包括两个层次,第一个层次是不同固定收益类资产的配置,基金管理人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,确定资产在各类固定收益类证券之间的配置比例;第二个层次是精选个券,通过基金管理人对信用债券、私募债券和可转换债券等固定收益资产的长期深入跟踪研究,挖掘投资价值被低估的个券,择机配置和交易。	
业绩比较基准	中债综合指数(总财富)收益率×95% + 一年期定期存款利率(税后)× 5%	
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,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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	博时双债增强债券A类	博时双债增强债券C类
下属两级基金的交易代码	000280	000281
报告期末下属两级基金的份额总额	60,706,523.40份	48,429,212.01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(2013年10月1日-2013年12月31日)	
	博时双债增强债券A类	博时双债增强债券C类
1.本期已实现收益	882,727.89	882,499.90
2.本期利润	430,522.86	501,046.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0051
4.期末基金资产净值	60,920,216.52	48,556,337.32
5.期末基金份额净值	1.004	1.003

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交易基金的各项费用,计入费用后投资人的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、博时双债增强债券A类:

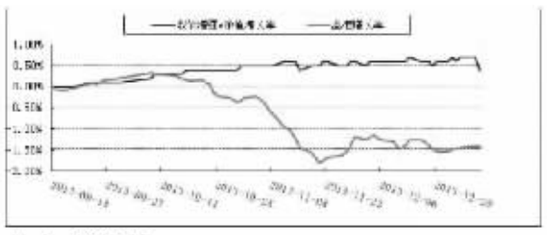
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.30%	0.07%	-1.62%	0.09%	1.92%	-0.02%

2、博时双债增强债券C类:

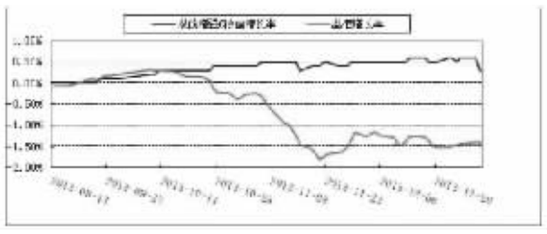
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.20%	0.07%	-1.62%	0.09%	1.82%	-0.02%

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. 博时双债增强债券A类



2. 博时双债增强债券C类



注:本基金合同于2013年9月13日生效,基金合同生效起至报告期末不满一年,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九部分"(二)投资范围"、"(五)投资限制"的有关约定。截至本报告期末本基金的建仓期尚未结束。

§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		
过钧	基金经理/固定收益总部公募基金组投资总监	2013-9-13	-	14	1995年起先后在上海工艺品进出口公司、雄狮斯顿银行上海市分行、美国GE资产公司、华夏基金管理有限公司固定收益部工作,2005年加入博时基金管理有限公司,历任基金经理、固定收益部副总经理兼任基金经理职务,2005年8月24日至2010年8月3日期间担任博时稳定价值债券投资基金的基金经理,2010年11月至2013年9月期间担任转债增强基金基金经理,现任固定收益总部公募基金组投资总监兼博时信用债券基金、博时富洲票息收益债券(QDII)基金、博时双债增强债券基金的基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》及其他有关法律、法规和《博时双月薪定期支付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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

4季度债券市场无其是信用债市场的调整幅度远超市场的预期。直观的原因是以银行等机构为代表的"非标"投资者降杠杆导致的流动性紧张所致。更深层次地,则是中国经济增长的融资模式由债务扩张阶段向债务控制、债务约束阶段转变所导致。这一过程中伴随着无风险利率阶段性的大幅提升,以及信用利差的持续扩大。

更为重要的是,这一过程绝非一朝一夕可以完成,债券市场承受的经济环境约束、政策环境约束仍将在在,控制好组合杠杆仍将是未来债券投资的核心所在。

遵循上述的判断,本基金在成立之初以货币类资产配置为主,保持适当的流动性应对中赎需要,并在本季度中后期将组合的一部分仓位通过一、二级市场配置信用债券,在控制个券信用风险的前提下逐步提高组合的静态收益率水平。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金A类基金份额净值为1.004元,份额累计净值为1.004元;C类基金份额净值为1.003元,份额累计净值为1.003元。报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.30%,C类基金份额净值增长率为0.20%。同期业绩基准增长率-1.62%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

综上所述,展望1季度,我们认为央行依然会维持紧平衡的货币政策,实体经济、金融机构降杠杆的行为仍然会继续,资金成本维持高位、信用品种潜在供给显著增加,都将使得债券市场在1季度维持弱势格局。同时,由于经济中信用环境的持续收缩效应、以及利率重定价的影响,发债主体的偿债压力、利息支出将继续增加,由基本面决定的信用利差继续扩大。

同时,2014年信用违约事件出现的概率会增加,影响也会更广泛,类属、行业风险的差异化会更加显著,信用资产的投资机会也会逐步出现。但在此之前,我们需要保持组合的安全资产比例,控制好组合流动性、规避有信用风险的债券,并通过自下而上的公司研究,发掘优质低估品种,并在合理风险溢价的基础上择优配置。

§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	68,376,387.73	61.17
	其中:债券	68,376,387.73	61.17
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	32,500,000.00	29.08
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	7,252,461.04	6.49
6	其他资产	3,646,042.78	3.26
7	合计	111,774,891.55	100.00

5.2报告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。

5.3报告期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。

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	68,376,387.73	62.46
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	68,376,387.73	62.46

5.5报告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

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	122276	13魏桥01	108,000	10,760,040.00	9.83
2	124374	13塔国资	100,000	10,000,000.00	9.13
3	124029	12玉城投	100,500	9,849,000.00	9.00
4	122620	12乌城投	100,100	9,709,700.00	8.87
5	112013	09亿城债	80,000	8,114,797.81	7.41

5.6报告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。

5.7报告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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,779.47
2	应收证券清算款	2,453,862.74
3	应收股利	-
4	应收利息	1,158,200.84
5	应收申购款	26,199.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,646,042.78

5.10.4 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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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	博时双债增强债券A类	博时双债增强债券C类
本报告期期初基金份额总额	177,234,230.01	229,249,041.22
本报告期基金总申购份额	631,200.76	875,251.70
减:本报告期基金总赎回份额	117,158,907.37	181,695,080.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	60,706,523.40	48,429,212.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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2013年12月31日,博时基金公司共管理四十六只开放式基金和一只封闭式基金,并且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,公募基金资产规模逾1052亿元人民币,累计分红超过608亿元人民币,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,股票型基金中,截至12月31日,博时医疗保健今年以来净值增长率在328只标准型股票基金中排名前1/4,混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名前1/3;博时裕祥分级债券A今年以来收益率在17只封闭式债券型分级子基金(优先份额)中名列第2。

海外投资方面,博时标普500自2012年6月14日成立以来至2013年12月30日的累计净值增长率已达到31.75%;博时大中华亚太精选今年以来收益率在7只QDII亚太股票型基金中排名第2。

2、客户服务

2013年四季度,博时基金共举办各类渠道培训活动136场,参加人数3400人。

3、其他大事件

2013年11月18日,博时基金在《每日经济新闻》举办的基金金鼎奖评选活动中获得"基金投顾业务-2013最具竞争力基金公司"奖项。

2013年12月20日,东方财富网在北京中国大饭店举办"东财互联网金融圆桌论坛"和"2013东方财富风云榜颁奖盛典"活动,我司获得"最佳企业年金奖"。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证券监督管理委员会批准博时双债增强债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时双债增强债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时双债增强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

9.1.6报告期内博时双债增强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1月22日

博时双月薪定期支付债券型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013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:2014年1月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21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2013年10月22日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时双月薪定期支付债券
基金主代码	000277
交易代码	000277
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月22日
报告期末基金份额总额	238,257,705.59份
投资目标	在谨慎投资的前提下,本基金力争为投资人提供稳定的现金流收入,争取实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、运作周期的投资策略 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。 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;本基金通过正回购,融资买入债券,通过杠杆作用,力争为投资者实现更高的投资收益和现金流收入。 2、自由开放期投资策略 自由开放期内,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。
业绩比较基准	3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	中国建设银行股份有限公司

§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(2013年10月22日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	2,061,098.51
2.本期利润	1,516,509.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064
4.期末基金资产净值	239,774,215.28
5.期末基金份额净值	1.006

注: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。

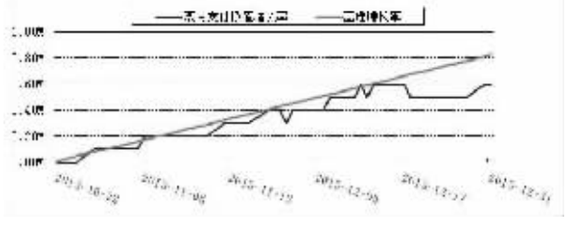
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	0.60%	0.05%	0.83%	0.01%	-0.23%	0.04%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同于2013年10月22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十三条"(二)投资范围"、"(四)投资限制"的有关约定。截止本报告期末本基金建仓期尚未结束。

§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		
陈凯杨