

## 博时理财30天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

基金管理人和基金托管人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。

基金托管人根据银行结算原则为本基金办理了基金资金账户。2013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，复核结果表明该报告的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。

本报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时理财30天债券
基金代码	05029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月6日
报告期末基金份额总额	77,514,848.42份

投资目标 本基金将保持资产相对流动性的基础上，努力追求对收益，争取为基金份额持有人谋取利益。

投资策略 本基金通过对宏观经济和货币市场的分析，结合未来的市场变化趋势，运用积极型的债券型投资策略，将投资组合的平均剩余期限锁定在50天以内，利用利率策略、信用策略、个券选择等投资策略，在严格控制风险的前提下，争取获取高收益。

业绩比较基准 本基金业绩基准为同期银行定期存款利率(税后)+0.4%的固定收益。

风险收益特征 本基金是一只低风险、低收益的债券型基金，属于稳健收益类基金。

风险收益特征 本基金是一只低风险、低收益的债券型基金，属于稳健收益类基金。

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

下属分级基金的基金简称

博时理财30天债券A

博时理财30天债券B

报告期末分级基金的份额总额

67,514,848.42份 9,877,312.08份

## §3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

博时理财30天债券A 博时理财30天债券B

1.本期已实现收益 996,024.61 2,009,506.37

2.本期利润 996,024.61 2,009,506.37

3.期末基金资产净值 67,514,848.34 9,877,312.08

(注:本基金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,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润相同。)

3.2.2 本期每万份基金收益 分红次数 1 次

3.2.3 期末可供分配基金份额收益及其与同期业绩比较基准收益的比较

1.本期每万份基金收益 0.025% 0.340% 0.0000% 0.7525% 0.0025%

2.同期同类理财产品 1.0928% 0.025% 0.340% 0.0000% 0.7525% 0.0025%

3.同期同类理财产品 1.0928% 0.025% 0.340% 0.0000% 0.7525% 0.0025%

3.2.4 本期可供分配基金份额净值及分红前、后基金份额净值的排名前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 持有数量(份) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 041384073 13国债001 50,000 5,000,506.39 6.44

2 041361059 13锐银CPO02 50,000 5,000,141.90 6.44

3 110234 50,000 4,988,530.42 6.40

4 041361059 13锐银CPO02 50,000 4,988,530.42 6.40

5 041384073 13国债001 50,000 4,988,530.42 6.40

注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码。

5.6.4 报告期内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 货币市场基金 - -

3 金融债 4,988,530.42 6.40

4 企业债 - -

5 短期融资券 10,000,648.29 12.88

6 其他债券 - -

7 资产支持证券 - -

8 其他 - -

9 合计 14,969,178.71 19.29

(注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码)

5.8.1 报告期内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 50,000 5,000,506.39 6.44

2 货币市场基金 50,000 5,000,141.90 6.44

3 金融债 50,000 4,988,530.42 6.40

4 企业债 - -

5 短期融资券 10,000,648.29 12.88

6 其他债券 - -

7 资产支持证券 - -

8 其他 - -

9 合计 14,969,178.71 19.29

(注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码)

5.8.2 报告期内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 50,000 5,000,506.39 6.44

2 货币市场基金 50,000 5,000,141.90 6.44

3 金融债 50,000 4,988,530.42 6.40

4 企业债 - -

5 短期融资券 10,000,648.29 12.88

6 其他债券 - -

7 资产支持证券 - -

8 其他 - -

9 合计 14,969,178.71 19.29

(注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码)

5.8.3 报告期内债券投资的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 摆余成本(元) 占基金资产净值比例 (%)

1 041384073 13国债001 50,000 5,000,506.39 6.44

2 041361059 13锐银CPO02 50,000 5,000,141.90 6.44

3 110234 50,000 4,988,530.42 6.40

4 041361059 13锐银CPO02 50,000 4,988,530.42 6.40

5 041384073 13国债001 50,000 4,988,530.42 6.40

注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码)

5.8.4 报告期内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 50,000 5,000,506.39 6.44

2 货币市场基金 50,000 5,000,141.90 6.44

3 金融债 50,000 4,988,530.42 6.40

4 企业债 - -

5 短期融资券 10,000,648.29 12.88

6 其他债券 - -

7 资产支持证券 - -

8 其他 - -

9 合计 14,969,178.71 19.29

(注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码)

5.8.5 报告期内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 50,000 5,000,506.39 6.44

2 货币市场基金 50,000 5,000,141.90 6.44

3 金融债 50,000 4,988,530.42 6.40

4 企业债 - -

5 短期融资券 10,000,648.29 12.88

6 其他债券 - -

7 资产支持证券 - -

8 其他 - -

9 合计 14,969,178.71 19.29

(注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码)

5.8.6 报告期内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 50,000 5,000,506.39 6.44

2 货币市场基金 50,000 5,000,141.90 6.44

3 金融债 50,000 4,988,530.42 6.40

4 企业债 - -

5 短期融资券 10,000,648.29 12.88

6 其他债券 - -

7 资产支持证券 - -

8 其他 - -

9 合计 14,969,178.71 19.29

(注:表中,债券的名称包含债券简称和债券代码)

5.8.7 报告期内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 50,000 5,000,506.39 6.44

2 货币市场基金 50,000 5,000,141.90 6.44

3 金融债 50,000 4,988,530.42 6.40