

## 博时现金收益证券投资基金

## 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:交通银行股份有限公司

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监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。

基金托管人交通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。投资人投资于基金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10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

在本报告期内本基金市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

§3 基金投资组合平均剩余期限情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	92
报告期初投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期初投资组合平均剩余期限最低值	50

报告期末投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金的基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

§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	19.97	9.20
2	30天(含)-90天	0.81	-
3	90天(含)-180天	21.44	-
4	180天(含)-397天	39.06	-
5	397天以上	16.49	-
合计		0.20	-
		10.52	-
		-	-
		107.47	9.20

§3.4 报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	企业债券	2,142,361,646.65	8.45
4	金融债	1,702,420,540.85	6.72
5	企业短期融资券	253,740,362.03	1.00
6	中期票据	3,803,186,944.14	15.00
7	其他	-	-
8	合计	6,199,288,947.82	24.46
9	剩余期限小于97天的浮动利率债券	253,740,362.03	1.00

§3.5 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)	占基金资产净值的比例(%)
1	130226	13国开36	7,300,000	727,503,137.68	2.87
2	04158603	13国债C101	5,000,000	499,904,271.54	1.97
3	130243	13国开43	4,000,000	396,136,281.53	1.57
4	0996047	09国债107	2,000,000	204,26,270.72	0.81
5	130227	13国债27	2,000,000	198,549,887.84	0.78
6	110251	11国债51	1,000,000	100,046,467.97	0.39
7	04133508	13国债C100	1,000,000	100,016,600.31	0.39
8	07130011	13国债C101	1,000,000	99,982,657.70	0.39
9	07131805	13国债C105	1,000,000	99,981,013.56	0.39
10	04159001	13国债C100	1,000,000	99,914,432.13	0.39

注:本报告期未持有其他品种的债券投资。

§3.2 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



注:本基金合同于2014年1月16日生效。按本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十六条(三)投资范围、(八)资产配置比例的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理(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
张勇	基金经理/固定收益总监 基金经理/固定收益总监	2006-7-1	9.5	

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守情况说明

在本基金合同中,基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则,《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的原则管理运用基金资产,为基金份额持有人谋取利益。本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的规则,基金管理人在定期报告内进行了调整,对基金份额持有人利益造成损害。

4.3 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 常规交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金在异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的公平交易制度和公平交易情况说明

四季末央行实施了偏紧的货币政策,在季度末时,再度成为了驱动全局的变量,第四季度资金的回流,从而对中国金融市场产生心理层面的紧缩效果。四季末的货币收益也从一个整体上的态势上,中枢在三季末有所抬高。

资金的紧张,带动货币市场的利率上行。我们预计在资金的限制下,引入新资金,增厚组合收益。存款与短期再次投资将超过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业内名列前茅。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率法计算每期利息收入,基金账面价值始终保持1.00元。

5.8.2 本基金在报告期不存在持续剩余期限超过97天剩余货币资金的摊余成本超过基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的资产支持证券情况

5.8.4 报告期内本基金投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于舍弃五人的原因,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



注:本基金合同于2014年1月16日生效。按本基金的基金合同约定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十六条(三)投资范围、(八)资产配置比例的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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	银行存款	6,199,288,947.82	22.37
2	卖出回购金融资产	6,199,288,947.82	22.37
3	应收利息	-	-
4	应收申购款	3,066,404,910.95	11.07
5	银行存款和结算备付金合计	19,735,696,590.59	64.87
6	其他资产	467,696,140.27	1.69
7	合计	27,707,157,694.63	100.00

注:报告期末货币类投资余额占基金资产净值的比例为报告期末内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

5.2 报告期内基金资产净值占基金资产净值的20%的说明

5.3 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	4,468	-
2	卖出回购金融资产	-	-
3	应收利息	-	-
4	应收申购款	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	23,323,996,893.75	9.20
6	其他资产	-	-
7	合计	23,323,996,893.75	9.20

注:报告期末货币类投资余额占基金资产净值的比例为报告期末内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

5.4 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	银行存款	4,468	-
2	卖出回购金融资产	-	-
3	应收利息	-	-
4	应收申购款	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	23,323,996,893.75	9.20
6	其他资产	-	-
7	合计	23,323,996,893.75	9.20

注:本基金合同于2012年9月7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六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“(二)投资范围”、“(五)投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.5 报告期内基金投资组合情况