

博时天颐债券型证券投资基金

[2013] 第三季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2013年10月23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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和基金管理人报告,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。

报告书中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

在行情的产生,市值或将出现震荡的走势。策略上,继续保持三季度的配置策略,保持短久期组合,择机逢低吸纳长期信用债。

§ 3 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 31,882,275.90 12.98

其中:股票 31,882,275.90 12.98

2 固定收益投资 181,925,616.34 74.04

其中:债券 181,925,616.34 74.04

3 资产支持证券 - -

4 衍生工具投资 - -

5 买入返售金融资产 13,000,000.00 5.29

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

6 银行存款和结算备付金合计 10,920,099.42 4.44

7 其他各项资产 7,978,235.10 3.25

8 合计 245,706,226.76 100.00

在谨慎操作的前提下,本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

投资目标

§ 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 矿采业 - -

C 制造业 14,967,901.04 6.84

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 - -

G 交通运输、仓储和邮政业 - -

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 6,498,264.50 2.97

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究和技术服务业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 10,416,110.36 4.76

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 教育 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 综合 - -

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

博时天颐债券 A类 博时天颐债券 C类

1.本期已实现收益 472,581.62 840,375.52

2.本期利润 2,737,020.31 4,058,055.14

3.加权平均基金份额本期利润 0.0317 0.0315

4.期末基金资产净值 82,342,857.89 136,511,806.88

5.期末基金份额净值 1.051 1.047

注:本报告期内实现收益指基金本期利润减去费用后的余额,不包含公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.2 期末持有的买入返售金融资产的公允价值,计价后用后投资人的实际收益水平要低若干列示。

3.2.3 期末持有的买入返售金融资产的公允价值,计价后用后投资人的实际收益水平要低若干列示。

3.2.4 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.博时天颐债券 A类:

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 净值收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.14% 0.49% 1.32% 0.01% 1.82% 0.48%

2.博时天颐债券 C类:

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 净值收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.05% 0.49% 1.32% 0.01% 1.73% 0.48%

3.2.5 期末持有的买入返售金融资产的公允价值变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1.博时天颐债券 A类:

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 净值收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.14% 0.49% 1.32% 0.01% 1.82% 0.48%

4.2.1 本报告期基金运作遵循监管部门的规定

报告期内,本基金运作遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及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,严格履行基金合同约定的各项职责,基金投资管理人不存在损害基金持有人利益的行为。

4.2.2 本报告期基金运作遵循监管部门的规定

报告期内,本基金运作遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及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,严格履行基金合同约定的各项职责,基金投资管理人不存在损害基金持有人利益的行为。

4.2.3 本报告期基金运作遵循监管部门的规定

报告期内,本基金运作遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及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,严格履行基金合同约定的各项职责,基金投资管理人不存在损害基金持有人利益的行为。

4.2.4 本报告期基金运作遵循监管部门的规定

报告期内,本基金运作遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及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,严格履行基金合同约定的各项职责,基金投资管理人不存在损害基金持有人利益的行为。

4.2.5 本报告期基金运作遵循监管部门的规定

报告期内,本基金运作遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及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,严格履行基金合同约定的各项职责,基金投资管理人不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的估值政策和账面余额

2013年中国经济在结构性调整的背景下出现了超预期的回暖迹象,并在工业增加值、发电量等数据上较一季度有所好转,因此,国内的股市表现出了较大反弹。债市方面,在经济回升与资金面好转的一致的正面影响下,中长期利率债表现了较大反弹,而短期信用债的表现较好。大鹏债券在资金面上表现出了较好的反弹。

4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金A类基金份额净值为1.051元,基金份额净值为1,073.7元,C类基金份额净值为1.047元,份额累计净值为1.047元;C类基金份额净值增长率为-0.14%,C类基金份额净值增长率为-0.13%,C类基金份额净值增长率为-0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.1 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.2 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.3 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.4 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.5 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.6 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.7 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.8 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.9 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.10 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.11 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.12 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.13 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.14 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.15 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.16 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.17 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.18 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.19 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.20 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.21 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.22 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.23 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.24 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.25 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.26 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.27 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.28 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.29 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.30 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.31 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.32 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.33 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.34 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.35 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.36 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.37 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.38 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.39 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.40 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.41 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.42 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.43 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.44 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.45 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.46 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.47 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.48 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.49 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.50 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.51 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.52 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.53 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.54 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.55 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.56 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.57 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.58 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.59 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.60 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.61 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.62 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.63 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.64 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.65 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.66 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.67 对宏观经济、行业走势及行业投资的主要观点

4.5.68 对宏观经济、行业走势