

博时理财30天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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23日

基金管理人的董事会及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性负完全责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司对本基金合同规定的内容,保证复核无误,但不对基金合同承担责任。

基金投资人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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。

本报告期内基金财务资料未经审计。

本报告书日期2013年7月1日起至9月30日止。

§ 1 基本产品概况

本基金在追求资产相对稳定性的同时,努力追求对收益,争取为基金份额持有人创造稳定的增值。

本基金通过资产配置和货币市场的分析,预测未来市场利率变化趋势,采用积极管理的投资策略,将组合平均剩余期限控制在150天以内,采取定期和不定期、信用等级、券种选择等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,力争获得超越基准的收益。

本基金将坚持价值投资的原则,继续坚持投资组合较好的流动性及适中的组合期限,使基金的过往业绩不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期内基金财务资料未经审计。

本报告书日期2013年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基本产品概况

本基金在追求资产相对稳定性的同时,努力追求对收益,争取为基金份额持有人创造稳定的增值。

本基金通过资产配置和货币市场的分析,预测未来市场利率变化趋势,采用积极管理的投资策略,将组合平均剩余期限控制在150天以内,采取定期和不定期、信用等级、券种选择等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,力争获得超越基准的收益。

本基金将坚持价值投资的原则,继续坚持投资组合较好的流动性及适中的组合期限,使基金的过往业绩不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期内基金财务资料未经审计。

本报告书日期2013年7月1日起至9月30日止。

§ 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7月1日-2013年9月30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 1,698,932.11 1,980,237.20

2.本期利润 1,698,922.11 1,980,237.20

3.期末基金资产净值 133,753,023.46 65,717,106.11

注:本产品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,扣除本期费用后的收益,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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.博时理财30天债券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	1.0043%	0.0023%	0.3403%	0.0000%	0.6640%	0.0023%

2.本期理财30天债券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	1.0786%	0.0023%	0.3403%	0.0000%	0.7383%	0.0023%

注:本基金的收益计算周期为1个月,每个月定期开放日计算其份额。

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

1.博时理财30天债券A:



2.博时理财30天债券B:



注:1.本基金合同于2013年01月28日生效,截至报告期末,本基金的各项比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定;本基金投资于法律允许的金融工具包括:现金、存款、存贷款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限不超过397天的国债、央行票据、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的短期融资券、企业债、在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券及法律允许或中国证监会准许基金投资的其他固定收益类金融工具。

S 4 基金销售人员

4.1 基金经理(基金经理助理)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

陈凯杨 基金经理 2013-1-28 - 2003年起先后在深圳发展银行、博时基金、长城基金工作,2009年1月加入博时基金,历任固定收益研究员、研究员、投资经理、基金经理助理、基金经理,现任基金经理。博时理财30天债券型基金基金经理,博时岁岁安康一年定期开放式债券型基金基金经理,博时岁岁平安一年定期开放式债券型基金基金经理,博时岁岁平安定期开放型债券型基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作情况说明

在报告期内,本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责,取信于客户的原则谋取最大利益。本报告期内,由于证券交易市场波动等因素,本基金管理人根据基金合同的规定,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原则。

4.3 公平交易制度的说明

4.4 小额定期定额投资业务说明

4.5 公开披露的暂停申购赎回的情况

4.6 公平交易行为的专项说明

4.7 报告期内本基金的业绩表现

本基金报告期内A类基金份额净值收益率为1.00%,B类基金份额净值收益率为1.08%,业绩基准收益率

为0.34%。

4.8 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原则。

4.9 其他需要说明的事项

4.10 报告期内本基金的资产配置情况

4.11 报告期内本基金的估值政策和程序

4.12 报告期内本基金的收益分配情况

4.13 报告期内本基金的费用计提、开支及使用情况

4.14 报告期内本基金的税收情况

4.15 报告期内本基金的代理销售机构情况

4.16 报告期内本基金的承销证券情况

4.17 报告期内本基金的融资融券交易情况

4.18 报告期内本基金的所涉及的暂停申购赎回的情况

4.19 报告期内本基金的赎回费用收取情况

4.20 报告期内本基金的暂停申购赎回的情况

4.21 报告期内本基金的摊余成本法估值情况

4.22 报告期内本基金的侧袋机制的实施情况

4.23 报告期内本基金的临时公告

4.24 报告期内本基金的清算情况

4.25 报告期内本基金的会计政策、会计估计和核算方法变更情况

4.26 报告期内本基金的内部控制制度的修订情况

4.27 报告期内本基金的营业场所、办公设施等设施的重大变化情况

4.28 报告期内本基金的高级管理人员及其他从业人员变动情况

4.29 报告期内本基金的诉讼情况

4.30 报告期内本基金的媒体传播情况

4.31 报告期内本基金的其他重要信息

4.32 报告期内本基金的其他情况说明

4.33 报告期内本基金的其他重要信息

4.34 报告期内本基金的其他重要信息

4.35 报告期内本基金的其他重要信息

4.36 报告期内本基金的其他重要信息

4.37 报告期内本基金的其他重要信息

4.38 报告期内本基金的其他重要信息

4.39 报告期内本基金的其他重要信息

4.40 报告期内本基金的其他重要信息

4.41 报告期内本基金的其他重要信息

4.42 报告期内本基金的其他重要信息

4.43 报告期内本基金的其他重要信息

4.44 报告期内本基金的其他重要信息

4.45 报告期内本基金的其他重要信息

4.46 报告期内本基金的其他重要信息

4.47 报告期内本基金的其他重要信息

4.48 报告期内本基金的其他重要信息

4.49 报告期内本基金的其他重要信息

4.50 报告期内本基金的其他重要信息

4.51 报告期内本基金的其他重要信息

4.52 报告期内本基金的其他重要信息

4.53 报告期内本基金的其他重要信息

4.54 报告期内本基金的其他重要信息

4.55 报告期内本基金的其他重要信息

4.56 报告期内本基金的其他重要信息

4.57 报告期内本基金的其他重要信息

4.58 报告期内本基金的其他重要信息

4.59 报告期内本基金的其他重要信息

4.60 报告期内本基金的其他重要信息

4.61 报告期内本基金的其他重要信息

4.62 报告期内本基金的其他重要信息

4.63 报告期内本基金的其他重要信息

4.64 报告期内本基金的其他重要信息

4.65 报告期内本基金的其他重要信息

4.66 报告期内本基金的其他重要信息

4.67 报告期内本基金的其他重要信息

4.68 报告期内本基金的其他重要信息

4.69 报告期内本基金的其他重要信息

4.70 报告期内本基金的其他重要信息

4.71 报告期内本基金的其他重要信息

4.72 报告期内本基金的其他重要信息

4.73 报告期内本基金的其他重要信息

4.74 报告期内本基金的其他重要信息

4.75 报告期内本基金的其他重要信息

4.76 报告期内本基金的其他重要信息

4.77 报告期内本基金的其他重要信息

4.78 报告期内本基金的其他重要信息

4.79 报告期内本基金的其他重要信息

4.80 报告期内本基金的其他重要信息

4.81 报告期内本基金的其他重要信息