博时现金收益证券投资基金

【2013】年度报告摘要

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3月29日

§1重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	博时现金收益货币
基金主代码	050003
交易代码	050003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年1月16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
报告期末基金份额总额	25,346,757,687.16份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	在保证低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报。
投资策略	本基金根据短期利率的变动和市场格局的变化,积极主动地在债券资产和回购资产之间进行动态的资产配置。
业绩比较基准	本基金成立于2004年1月16日,业绩比较基准是一年期定期存款利率(税后); 自2009年7月1日起,本基金的业绩比较基准变更为:活期存款利率(税后)。
风险收益特征	现金收益证券投资基金投资于短期资金市场基础工具,由于这些金融工具的特点,因此整个基金的风险处于较低的水平。但是,本基金依然处于各种风险因素的暴露之中,包括利率风险、再投资风险、信用风险、操作风险、政策风险和通货膨胀风险等等。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	裘学敏
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	1,233,970,417.79	1,706,619,459.73	465,722,820.50
本期利润	1,233,970,417.79	1,706,619,459.73	465,722,820.50
本期净值收益率	4.0138%	4.4004%	3.9174%
3.1.2期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末基金资产净值	25,346,757,687.16	46,887,347,991.37	22,492,619,365.25
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
累计净值收益率	34.3782%	29.1927%	23.7500%

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。

本基金利润分配是按月结转份额。

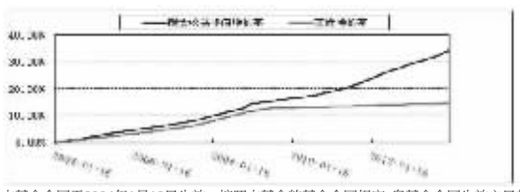
3.2基金净值表现

3.2.1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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	1.2615%	0.0024%	0.0894%	0.0000%	1.1721%	0.0024%
过去六个月	2.2437%	0.0030%	0.1789%	0.0000%	2.0648%	0.0030%
过去一年	4.0138%	0.0028%	0.3549%	0.0000%	3.6589%	0.0028%
过去三年	12.8447%	0.0040%	1.2557%	0.0002%	11.5890%	0.0038%
过去五年	17.1890%	0.0063%	2.9204%	0.0015%	14.2686%	0.0048%
自基金合同生效起至今	34.3782%	0.0062%	14.7038%	0.0032%	19.6744%	0.0030%

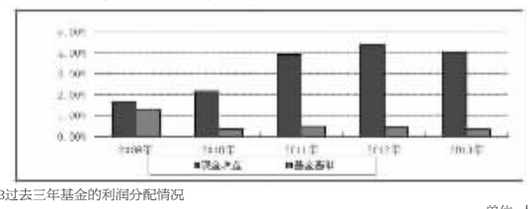
注:本基金成立于2004年1月16日,业绩比较基准是一年期定期存款利率(税后);
自2009年7月1日起,本基金的业绩比较基准变更为:活期存款利率(税后)。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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2004年1月16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3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十六条(三)投资范围、(八)资产配置策略的有关约定。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。

3.2.3过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2013年	1,238,476,909.96	-	-4,506,492.17	1,233,970,417.79	-
2012年	1,701,253,010.68	-	5,366,449.05	1,706,619,459.73	-
2011年	463,760,563.07	-	1,962,257.43	465,722,820.50	-
合计	3,403,490,483.71	-	2,822,214.31	3,406,312,698.02	-

§4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

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,2013年博时信用债纯债基金收益率在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,博时大中华亚太精选2013年收益率在7只QDII亚太股票型基金中排名第2。

2、客户服务

2013年全年,博时基金共举办各类渠道培训活动1534场,参加人数38251人。

3、其他大事件

1)2013年1月30日,博时亚洲票息债券基金由于达到募集份额目标上限18亿份而提前结束募集,同时启动末日比例配售,配售比例约为63.35%。

2)2013年3月29日,由证券时报社主办的2012年度中国基金业明星奖颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业基金荣获“2012 年度股票型明星基金奖”。

3)2013年3月30日,由中国证券报社主办的第十届中国基金业金牛奖颁奖典礼暨2013金牛基金论坛在北京举行。博时基金蝉联“金牛基金管理公司”奖,博时基金价值组投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得“金牛基金十周年特别奖”,博时现金收益荣获“2012年度货币市场金牛基金”。

4)2013年4月,在股市动态分析杂志主办的“2012基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜”评选活动中,博时标普500指数基金获得“2012年基金新产品营销策划案例奖”。

5)2013年4月10日,由上海证券报举办的第十届“金基金奖”颁奖典礼在上海举行,博时基金荣获金“基金十年?卓越公司奖”,博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获“金基金十年?投资回报奖”,博时主题行业基金荣获“金基金·股票型基金奖5年期奖”,博时裕阳封闭荣获“金基金·分红基金奖3年期奖”。

6)2013年4月27日,由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的2013中国网?普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选“年度最佳财富管理基金公司”。

7)6月26日,世界品牌实验室(WBL)在京发布2013年度(第十届)《中国500最具价值品牌》排行榜,博时基金以81.65亿的品牌价值位列第216名,品牌价值一年内提升了近20亿元,排名逐年上升。

8)2013年9月24日,由理财周报主办的2013中国基金业领袖峰会暨“寻找中国最受尊敬基金公司”颁奖典礼在上海举行,博时基金共获得三个奖项,分别是:2013中国最佳资产配置基金公司、2013中国最佳价值发现基金公司、2013中国最佳基金公司投资总监(姜文涛先生)。

9)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。

10)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”。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张勇	基金经理/固定收益总部现金管理组投资总监	2006-7-1	-	9.5	2001年起先后在南京市商业银行北清支行、南京市商业银行资金营运中心工作。2003年12月加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、债券交易员兼任博时现金收益货币基金经理助理。现任固定收益总部现金管理组投资总监,兼任博时现金收益货币基金、博时策略混合基金、博时稳定价值债券基金、博时安盈债券基金的基金经理。

注:上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《博时现金收益证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况,基金管理人在规定期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程,按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2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《公平交易管理制度》的规定,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3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管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年国内经济维持“弱复苏”局面,通胀压力不大,资金面宽松。进入下半年,资金面骤然紧张,货币市场利率不断高企,回购利率创近10年新高,市场整体下跌明显。四季度美国启动了QE退出,导致市场预期转变。

回顾2013年债券市场,利率产品收益率先平坦后陡峭;信用债收益率向贷款、非标收益看齐,收益率曲线上行,带动全社会资金成本中枢上行。

全年资金市场前松后紧,货币市场利率与信用债收益率不断上行,同业存款与短融再次成为我们投资的首选。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为4.01%,同期业绩基准增长率为0.35%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年,信用风险需要我们重点关注,流动性相比2013年下半年将有所好转,但资金的绝对价格将在高位波动。信用风险如果得到一定程度暴露,将对信用债券定价重估,这将带来系统性买入机会,但在这之前,需要采取防守的投资策略。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了博时基金管理有限公司估值委员会(以下简称“估值委员会”),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金采用1.00元固定份额净值交易方式,自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人,并按月结转到投资人基金账户,使基金账面份额净值始终保持1.00元。

本基金本报告期内向份额持有人分配利润1,233,970,417.79元。

§5托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2013年度,托管人在博时现金收益证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013年度,博时基金管理有限公司在博时现金收益证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日,托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定,托管人及时通知了基金管理人,基金管理人根据规定进行了调整。本基金本报告期内向份额持有人分配利润:1,233,970,417.79元。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013年度,由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时现金收益证券投资基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	17,973,467,590.59	35,665,606,949.17
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	6,199,288,947.82	13,108,663,803.11
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	6,199,288,947.82	13,108,663,803.11
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	3,066,704,970.95	263,121,908.77
应收证券清算款	-	191,383,575.58
应收利息	220,147,341.30	407,067,215.00
应收股利	-	-
应收申购款	247,453,798.97	3,288,860.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	95,000.00	95,000.00
资产总计	27,707,157,649.63	49,639,227,311.99
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	2,332,396,893.75	2,704,998,350.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	9,461,829.15	16,413,364.11
应付托管费	2,867,220.96	4,973,746.71
应付销售服务费	7,168,052.40	12,434,366.76
应付交易费用	105,802.46	145,075.38
应交税费	4,080,249.01	4,080,249.01
应付利息	281,656.24	289,439.90
应付利润	3,789,187.22	8,295,679.39
递延所得税负债	-	-
其他负债	249,071.28	249,049.36
负债合计	2,360,399,962.47	2,751,879,320.62
所有者权益:		
实收基金	25,346,757,687.16	46,887,347,991.37
未分配利润	-	-
所有者权益合计	25,346,757,687.16	46,887,347,991.37
负债和所有者权益总计	27,707,157,649.63	49,639,227,311.99

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.0000 元,基金份额总额25,346,757,687.16份。

7.2利润表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	1,508,506,377.20	2,038,326,056.11
1.利息收入	1,425,833,584.99	1,843,382,238.60
其中:存款利息收入	1,014,713,018.91	1,221,694,470.32
债券利息收入	363,089,978.79	565,042,893.17
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	48,030,587.29	56,644,875.11
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	82,672,792.21	194,943,817.51
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	82,672,792.21	194,943,817.51
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	274,535,959.41	331,706,596.38
1.管理人报酬	106,750,537.12	135,170,602.41
2.托管费	32,348,647.61	40,960,788.58
3.销售服务费	80,871,618.98	102,401,971.68
4.交易费用	-150.00	1,100.00
5.利息支出	54,014,490.68	52,566,310.20
其中:卖出回购金融资产支出	54,014,490.68	52,566,310.20
6.其他费用	550,815.02	605,823.51
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,233,970,417.79	1,706,619,459.73
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,233,970,417.79	1,706,619,459.73

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时现金收益证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	46,887,347,991.37	-	46,887,347,991.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,233,970,417.79	1,233,970,417.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-21,540,590,304.21	-	-21,540,590,304.21
其中:1.基金申购款	143,086,402,741.03	-	143,086,402,741.03
2.基金赎回款	-164,626,993,045.24	-	-164,626,993,045.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,233,970,417.79	-1,233,970,417.79
五、期末所有者权益(基金净值)	25,346,757,687.16	-	25,346,757,687.16
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	22,492,619,365.25	-	22,492,619,365.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,706,619,459.73	1,706,619,459.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	24,394,728,626.12	-	24,394,728,626.12
其中:1.基金申购款	230,401,131,411.37	-	230,401,131,411.37
2.基金赎回款	-206,006,402,785.25	-	-206,006,402,785.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,706,619,459.73	-1,706,619,459.73
五、期末所有者权益(基金净值)	46,887,347,991.37	-	46,887,347,991.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:吴姚东　　主管会计工作的负责人:王德英　　会计机构负责人:成江

7.4报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.3关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司(“博时基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
璇安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
上海丰益股权投资基金有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	106,750,537.12	135,170,602.41
其中:支付销售机构的客户维护费	18,895,381.60	26,732,050.05

注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

7.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	32,348,647.61	40,960,788.58

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

7.4.4.2.3销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
博时基金	20,256,770.90
交通银行	2,730,034.51
招商证券	594,871.99
合计	23,581,677.40
获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
博时基金	10,789,162.37
交通银行	4,090,209.02
招商证券	681,680.77
合计	15,561,052.16

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给博时基金,再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日							
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购		
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	
交通银行	514,580,404.11	514,256,164.38	2,503,000,000.00	16,032,614.11	25,856,500,000.00	3,744,249.18	
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日							
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购		
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	
交通银行	1,492,051,228.31	955,933,726.03	123,500,000.00	1,158,703.55	57,889,000,000.00	10,999,320.37	

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	130,025,231.21	0.51%	100,055,582.15	0.21%

7.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	13,467,590.59	476,437.96	165,606,949.17	590,865.87
交通银行定期存款	6,450,000,000.00	166,165,558.35	5,500,000,000.00	435,534,434.18

注:1、本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人交通银行保管,按适用利率或约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按约定利率计息。于2013年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2012年12月31日:同)。

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券	041361032	13沪临港CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,150.00
招商证券	041358077	13文传媒CP001	簿记建档集中配售	100,000	10,000,150.00
招商证券	071333001	13华融证券CP001	簿记建档集中配售	500,000	49,987,500.00
招商证券	041354051	13红狮CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
招商证券、交通银行	041358071	13龙盛CP001	簿记建档集中配售	200,000	20,000,150.00
交通银行	041373003	13豫煤化CP001	簿记建档集中配售	600,000	60,000,150.00
交通银行	071303011	13中信CP011	簿记建档集中配售	1,000,000	99,975,000.00
交通银行	041360075	13前海CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
交通银行	041354050	13中建五局CP002	簿记建档集中配售	300,000	30,000,150.00
交通银行	071318006	13西南证券CP006	簿记建档集中配售	400,000	39,990,000.00
交通银行	071318005	13西南证券CP005	簿记建档集中配售	1,000,000	99,975,000.00
交通银行	041359045	13京热力CP001	簿记建档集中配售	200,000	20,000,150.00
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券、交通银行	041251015	12铁道CP001	簿记建档集中配售	20,000,000	1,998,000,000.00
招商证券	120228	12国开28	簿记建档集中配售	5,000,000	499,650,000.00
交通银行	011207001	12南电SCP001	簿记建档集中配售	2,000,000	200,000,000.00
交通银行	041251032	12中冶CP002	簿记建档集中配售	1,100,000	110,000,000.00
招商证券、交通银行	041252034	12国电集CP002	簿记建档集中配售	500,000	50,000,000.00
招商证券	041254068	12亿利集CP001	簿记建档集中配售	500,000	50,000,000.00
交通银行	041262036	12淮南矿CP002	簿记建档集中配售	500,000	49,950,000.00
交通银行	041273005	12丹东港CP001	簿记建档集中配售	400,000	40,000,000.00
交通银行	041259005	12厦钨CP001	簿记建档集中配售	300,000	30,000,000.00
招商证券、交通银行	041264038	12兵国资CP001	簿记建档集中配售	200,000	20,000,000.00
交通银行	041253069	12攀钢CP001	簿记建档集中配售	200,000	20,000,000.00
交通银行	041251038	12协鑫发电CP001	簿记建档集中配售	200,000	20,000,000.00
交通银行	041254005	12长电CP001	簿记建档集中配售	100,000	10,000,000.00

7.4.5期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,332,396,893.75元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
130243	13国开43	2014/01/02	99.30	4,000,000	397,200,000.00
110251	11国开51	2014/01/02	99.44	500,000	49,720,000.00
110251	11国开51	2014/01/02	99.44	400,000	39,776,000.00
110418	11农发18	2014/01/02	98.45	1,000,000	98,450,000.00
130218	13国开18	2014/01/02	99.37	500,000	49,685,000.00
110257	11国开57	2014/01/02	99.07	500,000	49,535,000.00
0980147	09中航工债浮	2014/01/02	101.23	2,000,000	202,460,000.00
041372007	13锡产业CP002	2014/01/02	99.83	300,000	29,949,000.00
041352001	13南方水泥CP001	2014/01/02	100.75	200,000	20,150,000.00
041353017	13昆钢CP001	2014/01/02	100.00	200,000	20,000,000.00
041354019	13北部湾CP001	2014/01/02	100.05	200,000	20,010,000.00
041354020	13新希望CP001	2014/01/02	99.99	200,000	19,998,000.00
041354076	13巨化CP003	2014/01/02	99.83	200,000	19,966,000.00
041356015	13豫投资CP002	2014/01/02	99.45	100,000	9,945,000.00
071318006	13西南证券CP006	2014/01/02	99.97	400,000	39,988,000.00
041354050	13中建五局CP002	2014/01/02	99.36	300,000	29,808,000.00
041355015	13中冶CP002	2014/01/02	99.66	300,000	29,898,000.00
041359075	13巨石CP002	2014/01/02	99.61	300,000	29,883,000.00
041360021