

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: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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 博时上证企债30ETF

基金主代码 511210

交易代码 511210

基金运作方式 交易型开放式指数基金

基金合同生效日 2013年7月11日

报告期末基金份额总额 17,206,975.00份

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略 本基金将根据资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性和等情况主要采取一级市场抽样复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪。

业绩比较基准 上证企债30指数收益率

本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于中低风险/收益的开放式基金。

风险收益特征 本基金采用分步抽样复制方法跟踪复制上证企债30指数，其风险收益特征与该指数所表示的市场组合的风险收益特征相似。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 -4,862,974.04

2.本期利润 -16,524,308.44

3.加权平均基金份额本期利润 -0.9002

4.期末基金资产净值 1,699,572,713.52

5.期末基金份额净值 98.7713

注:本基金已实现收益扣减基金管理人本期收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)即期相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

所列基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

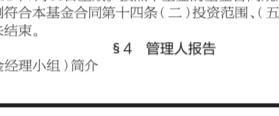
3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金本期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长 率 净值增长 率 业绩比较基 准收益率(%) 业绩比较基 准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.88% 0.14% -1.12% 0.12% 0.33% 0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长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2013年7月11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6个月内本基金的基金组合比例符合本基金合同第十四条(二)投资范围、(五)投资限制的有关规定。本基金合同的建仓期尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.2 报告期内本基金无基金经理。

4.3 报告期内本基金无投资策略。

4.4 报告期内本基金无投资组合分析。

4.5 报告期内本基金无跟踪偏离度与跟踪误差分析。

4.6 报告期内本基金无偏离度分析。

4.7 报告期内本基金无风险收益特征分析。

4.8 报告期内本基金无投资组合报告。

4.9 报告期内本基金无投资组合报告。

4.10 报告期内本基金无投资组合报告。

4.11 报告期内本基金无投资组合报告。

4.12 报告期内本基金无投资组合报告。

4.13 报告期内本基金无投资组合报告。

4.14 报告期内本基金无投资组合报告。

4.15 报告期内本基金无投资组合报告。

4.16 报告期内本基金无投资组合报告。

4.17 报告期内本基金无投资组合报告。

4.18 报告期内本基金无投资组合报告。

4.19 报告期内本基金无投资组合报告。

4.20 报告期内本基金无投资组合报告。

4.21 报告期内本基金无投资组合报告。

4.22 报告期内本基金无投资组合报告。

4.23 报告期内本基金无投资组合报告。

4.24 报告期内本基金无投资组合报告。

4.25 报告期内本基金无投资组合报告。

4.26 报告期内本基金无投资组合报告。

4.27 报告期内本基金无投资组合报告。

4.28 报告期内本基金无投资组合报告。

4.29 报告期内本基金无投资组合报告。

4.30 报告期内本基金无投资组合报告。

4.31 报告期内本基金无投资组合报告。

4.32 报告期内本基金无投资组合报告。

4.33 报告期内本基金无投资组合报告。

4.34 报告期内本基金无投资组合报告。

4.35 报告期内本基金无投资组合报告。

4.36 报告期内本基金无投资组合报告。

4.37 报告期内本基金无投资组合报告。

4.38 报告期内本基金无投资组合报告。

4.39 报告期内本基金无投资组合报告。

4.40 报告期内本基金无投资组合报告。

4.41 报告期内本基金无投资组合报告。

4.42 报告期内本基金无投资组合报告。

4.43 报告期内本基金无投资组合报告。

4.44 报告期内本基金无投资组合报告。

4.45 报告期内本基金无投资组合报告。

4.46 报告期内本基金无投资组合报告。

4.47 报告期内本基金无投资组合报告。

4.48 报告期内本基金无投资组合报告。

4.49 报告期内本基金无投资组合报告。

4.50 报告期内本基金无投资组合报告。

4.51 报告期内本基金无投资组合报告。

4.52 报告期内本基金无投资组合报告。

4.53 报告期内本基金无投资组合报告。

4.54 报告期内本基金无投资组合报告。

4.55 报告期内本基金无投资组合报告。

4.56 报告期内本基金无投资组合报告。

4.57 报告期内本基金无投资组合报告。

4.58 报告期内本基金无投资组合报告。

4.59 报告期内本基金无投资组合报告。

4.60 报告期内本基金无投资组合报告。

4.61 报告期内本基金无投资组合报告。

4.62 报告期内本基金无投资组合报告。

4.63 报告期内本基金无投资组合报告。

4.64 报告期内本基金无投资组合报告。

4.65 报告期内本基金无投资组合报告。

4.66 报告期内本基金无投资组合报告。

4.67 报告期内本基金无投资组合报告。

4.68 报告期内本基金无投资组合报告。

4.69 报告期内本基金无投资组合报告。

4.70 报告期内本基金无投资组合报告。

4.71 报告期内本基金无投资组合报告。

4.72 报告期内本基金无投资组合报告。

4.73 报告期内本基金无投资组合报告。

4.74 报告期内本基金无投资组合报告。

4.75 报告期内本基金无投资组合报告。

4.76 报告期内本基金无投资组合报告。

4.77 报告期内本基金无投资组合报告。

4.78 报告期内本基金无投资组合报告。

4.79 报告期内本基金无投资组合报告。

4.80 报告期内本基金无投资组合报告。

4.81 报告期内本基金无投资组合报告。

4.82 报告期内本基金无投资组合报告。

4.83 报告期内本基金无投资组合报告。

4.84 报告期内本基金无投资组合报告。

4.85 报告期内本基金无投资组合报告。

4.86 报告期内本基金无投资组合报告。

4.87 报告期内本基金无投资组合报告。

4.88 报告期内本基金无投资组合报告。

4.89 报告期内本基金无投资组合报告。

4.90 报告期内本基金无投资组合报告。

4.91 报告期内本基金无投资组合报告。

4.92 报告期内本基金无投资组合报告。

4.93 报告期内本基金无投资组合报告。

4.94 报告期内本基金无投资组合报告。

4.95 报告期内本基金无投资组合报告。

4.96 报告期内本基金无投资组合报告。

4.97 报告期内本基金无投资组合报告。

4.98 报告期内本基金无投资组合报告。

4.99 报告期内本基金无投资组合报告。

4.100 报告期内本基金无投资组合报告。

4.101 报告期内本基金无投资组合报告。

4.102 报告期内本基金无投资组合报告。

4.103 报告期内本基金无投资组合报告。

4.104 报告期内本基金无投资组合报告。

4.105 报告期内本基金无投资组合报告。

4.106 报告期内本基金无投资组合报告。

4.107 报告期内本基金无投资组合报告。

4.108 报告期内本基金无投资组合报告。

4.109 报告期内本基金无投资组合报告。

4.110 报告期内本基金无投资组合报告。

4.111 报告期内本基金无投资组合报告。

4.112 报告期内本基金无投资组合报告。

4.113 报告期内本基金无投资组合报告。

4.114 报告期内本基金无投资组合报告。

4.115 报告期内本基金无投资组合报告。

4.116 报告期内本基金无投资组合报告。

4.117 报告期内本基金