

## 博时天颐债券型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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：2014年1月22日

## 5.1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金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、完整性承担责任个别及连带责任。

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、收益分配政策等內容，保証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。

本报告书关于财务资料未经审计。

报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

## 5.2 基金产品概况

基金简称：博时天颐债券

基金主代码：050023

基金运作方式：契约型开放式

报告期初基金份额总额：155,240,627.80份

投资目标：在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

在投资范围的约束下，通过自下而上和自上而下相结合、定性分析和定量分析互补的方法，在固定收益类、权益类和混合类资产之间进行资产配置，追求在控制风险的前提下，最大化的定期收益。权益类资产主要选择股票型基金，债券型基金，同时选择货币市场基金、转债型基金、分级基金、股票型基金、中低风险收益的产品。

投资策略：在控制风险的前提下，具备持续盈利能力的成长型的企业，同时选择具有稳定现金流、并提供抵御下跌时的净值保障的债券。在谨慎投资的前提下，本基金力争获取高于业绩比较基准的投资收益，同时强调稳健的投资风格，争取实现基金资产的长期增值。

本基金的业绩比较基准：业绩比较基准：沪深300指数×30%+中证国债指数×70%

业绩比较基准：三年期定期存款利率(税后)×15%+存续期间内，3个月期定期存款利率与该基准之差值的调整系数×100%。

风险收益特征：本基金为债券型基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险收益的产品。

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

下属两级基金的交易代码：050123

报告期末下属两级基金的份额总额：65,551,867.26份

报告期末基金资产净值：89,688,820.54份

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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)

博时天颐债券 A类

博时天颐债券 C类

1.本期已实现收益 -3,924,574.03

-5,740,613.07

2.本期利润 -4,954,821.11

-7,324,282.26

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0642

-0.0652

4.期末基金资产净值 64,576,623.26

87,918,300.37

5.期末基金份额净值 0.985

0.980

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。

费用的余额，余额为零时，本期利润即为零。

注：本基金未按预期持有或买入或卖出交易基金的各类费用，计算费用后投资人的实际收益水平将低于预期。

3.2基金净值表现

3.2.1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

标准差②

准收益差③

准差④

①-③

②-④

过去三个月 -6.28%

0.63%

1.32%

0.02%

-7.60%

0.61%

2.博时天颐债券 C类：

阶段 净值增长率

① 净值增长率

标准差②

准收益差③

准差④

过去三个月 -6.40%

0.62%

1.32%

0.02%

-7.72%

0.60%

3.2.2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

1.基金总资产：8,456,922.58份

2.基金总负债：0份

3.基金净资产：8,456,922.58份

4.3 管理人报告

4.3.1基金经理(或基金经理小组)简介

1.任本基金的基金经理期限 证券从业年限

姓名 职务 任职日期 离任日期 年限

杨永光 基金经理 2012-2-29 - 11.5

2.任期表现

3.工作年限

4.其他说明

5.1报告期未投资基金资产组合情况

5.1.1报告期未投资债券

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1 国债

13,375,600.00

8.48

2 中票

13,375,600.00

8.48

3 国债期货

126,418,503.49

77.91

4 资产支持证券

126,418,503.49

77.91

5 金融衍生品投资

-

6 银行存款和结算备付金合计

17,061,065.94

10.51

7 其他资产

5,029,107.82

3.10

8 合计

162,264,727.51

100.00

5.1.2报告期未投资基金资产组合情况

5.1.2.1报告期未投资股票

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1 国债

78,332,139.77

100.00

2 衍生工具

490,244.13

0.63

3 国债期货

13,270,576.64

15.59

4 基金投资

-

5 其他投资

65,551,807.26

98.34

6.2.2报告期未投资基金资产组合情况

6.2.2.1报告期未投资股票

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1 国债

7,333,372.40

5.07

2 衍生工具

5,243,850.00

3.44

3 国债期货

4,126,000.00

2.71

4 其他投资

2,248,920.00

1.47

5 合计

17,061,065.94

100.51

6.3.2报告期未投资基金资产组合情况

6.3.2.1报告期未投资股票

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1 国债

18,885,414.59

1.90

2 衍生工具

7,619,697.50

0.77

3 国债期货

992,698,120.49

100.00

6.4报告期未投资基金资产组合情况

6.4.1报告期未投资股票

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1 国债

8,343,600.00

5.47

2 衍生工具

-

3 国债期货

-

4 其他投资

-

5 合计

8,343,600.00

5.47

6.5报告期未投资基金资产组合情况

6.5.1报告期未投资基金资产组合情况

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1 国债

8,343,600.00

5.47

2 衍生工具

-

3 国债期货

-

4 其他投资

-

5 合计