博时灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时混合
基金主代码	000178
交易代码	000178
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月8日
报告期末基金份额总额	34,675,007.20份
投资目标	本基金通过灵活运用资产配置策略及多种股票市场、债券市场投资策略,充分挖掘和利用各大类资产潜在的投资机会,追求基金资产长期稳定增值。
投资策略	基于基金管理人对经济周期及资产价格发展变化的深刻理解及前瞻性预见,在把握经济周期性波动的基础上,结合美林时钟及Black-Litterman Model等大类资产配置模型,动态评估不同资产类在不同时期的投资价值,投资时机以及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置及资产的稳健增长。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型基金,预期收益和预期风险低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,具有中等风险/收益的特征。
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

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	13,955,087.25
2.本期利润	8,756,253.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.1240
4.期末基金资产净值	39,713,428.44
5.期末基金份额净值	1.145

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。

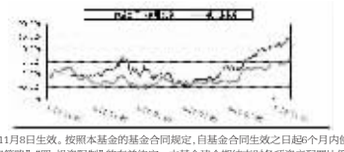
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	12.92%	0.60%	8.49%	0.54%	4.43%	0.06%

3.2.2自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11月8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个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分"三、投资策略""四、投资限制"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。

§4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王雪峰	基金经理	2014-2-18	-	8	2006年起先后在元大京华证券、兴业证券、华夏基金任研究员。2011年加入博时基金管理有限公司,曾任特定资产投资经理,现任博时灵活配置混合型证券投资基金兼博时第三产业成长股票证券投资基金的基金经理。
皮敏	基金经理	2013-11-8	-	9	2005年起在国信证券历任金融工程助理分析师、债券研究员、固定收益分析师。2009年加入博时基金管理有限公司,曾任固定收益研究员、博时宏观回报债券型证券投资基金的基金经理。现任博时平衡配置混合型证券投资基金兼博时信用债纯债债券型证券投资基金、博时灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《博时灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、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,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公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.1 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相关制度。

4.3.2 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报告期内基金的投资策略和运作分析

股票投资部分

2014年三季度,以并购重组为主线,改革政策、新兴产业等各类热点主题轮番表现,特别是小市值品种,在此期间走出很大一波上涨行情。本季度博时灵活配置基金依旧采取了中低仓位、适当捕捉市场热点、提高周转的策略。

债券投资部分

今年3季度债券市场表现良好,利率品种先跌后涨,信用品种几乎无调整,一路上涨。受股票市场持续上涨的带动,可转债在3季度表现出色,上涨幅度比较大。本组合延续此前配置,集中持有城投债,但仓位不高。

利率品种在7月份调整之后又重新上涨,7月份利率产品下跌的原因主要有两个:一个是稳增长政策,如果稳增长政策力度较大,则利率产品的基本面将承受较大压力;另外一个原因是银行资产负债扩张增速被动下行,这在一定程度上制约了银行配置利率产品。但在7月份之后,基本面发生了变化。政府在7月份开始降低了稳增长力度,对经济下行的容忍程度提高,所以金融数据与经济数据持续低于预期。在这些因素的影响下,利率品种重拾升势。信用品种则不同,由于非标扩张受到影响,银行理财资金对信用债的需求上升,所以信用债在3季度基本没有调整,持续上涨。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.145元,累计份额净值为1.145元,报告期内净值增长率为12.92%,同期业绩基准涨幅为8.49%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票投资部分

宏观环境方面,经济增速稳步下台阶仍是大势所趋,但政府在政策方面显得更为积极,一定程度上延缓了经济增速下滑的速度和幅度,流动性也比预期更为宽松,有利于市场追逐各类热点和主题,这不仅包括各类新兴产业题材品种,也包括以蓝筹股为主体的沪港通主题品种;我们认为这一阶段很多小市值股票存在明显的泡沫化特征,四季度这种市场格局或许将发生变化,我们倾向于选择估值更有吸引力的成长股比如消费品和医药股作为四季度和跨年度的底仓品种,在泡沫尚未结束的这段时间也尽可能在规避风险的基础上积极寻找投资机会。

债券投资部分

09年以来政策一直是左右我国经济,资本市场的主导力量。站在这个时点,要判断经济与市场走势只需判断政策什么时候会出手加大刺激力度,如果如最近宣传的那样不会又大刺激政策,则权益市场将承压,债券市场整体机会大于风险。如果在4季度刺激力度加大,则权益市场受益,债券市场承压。我们判断在四季度政策刺激力度有可能加大。

本组合在下一季度的资产配置可能不会做大大的调整。

§5 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	14,247,795.43	28.13
	其中:股票	14,247,795.43	28.13
2	固定收益投资	3,767,755.00	7.44
	其中:债券	3,767,755.00	7.44
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	14,000,000.00	27.64
	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	18,369,056.14	36.27
7	其他资产	263,213.65	0.52
8	合计	50,647,820.22	100.00

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	采矿业	-	-
C	制造业	8,475,748.48	21.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	209,000.00	0.53
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	763,200.00	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,684,356.70	9.28
J	金融业	-	-
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	503,200.00	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	612,290.25	1.54
S	综合	-	-
	合计	14,247,795.43	35.88

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300043	互动娱乐	137,042	2,376,308.28	5.98
2	300267	尔康制药	60,000	2,242,200.00	5.65
3	600850	华东电脑	34,338	1,323,729.90	3.33
4	002421	达实智能	40,000	1,268,000.00	3.19
5	600488	天药股份	200,000	1,144,000.00	2.88
6	600561	江西长运	60,000	763,200.00	1.92
7	000997	新大陆	26,420	701,186.80	1.77
8	600373	中文传媒	38,925	612,290.25	1.54
9	601965	中国汽研	39,498	549,022.20	1.38
10	300284	苏交科	40,000	503,200.00	1.27

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	3,767,755.00	9.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,767,755.00	9.49

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122163	12鄂资债	25,190	2,456,025.00	6.18
2	122893	10丹东债	10,360	1,067,080.00	2.69
3	122560	12淄城运	1,000	103,500.00	0.26
4	122534	12秦开发	1,000	101,750.00	0.26
5	122255	13赣粤01	300	29,400.00	0.07

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11投资组合报告附注
5.11.1报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
5.11.2基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	134,477.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,558.77
5	应收申购款	103,177.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	263,213.65

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300043	互动娱乐	2,376,308.28	5.98	公告重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	113,177,762.45
报告期期间基金总申购份额	3,703,591.57
减:报告期期间基金总赎回份额	82,206,346.82
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	34,675,007.20

注:本报告期内,本基金管出现基金资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况
基金管理人未持有本基金。
7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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2014年9月30日,博时基金公司共管理五十二只开放式基金,并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。博时基金资产管理净值总规模逾2135亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1098亿元人民币,累计分红超过633亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至9月30日,博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/4;博时医疗保健股票基金、博时创业成长股票基金在355只标准型股票基金中排名前1/3;博时主题行业股票基金、博时特许价值股票基金在355只标准型股票基金中排名前1/2;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2。标准指数股票型基金中,博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF在150只同类标准指数股票型基金中排名前1/3;博时裕富沪深300指数、博时上证超大盘ETF在150只同类标准指数股票型基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时宏观回报债券(A/B类)今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第2;博时信用债纯债、博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/5;博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3;博时信用债券(A/B类)、博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券基金中排名前1/2;博时稳盈收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/3。

海外投资方面业绩方面,截至9月30日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2、客户服务

2014年三季度,博时基金共举办各类渠道培训活动213场,参加人数5318人。

3、其他大事件

2014年6月16日,大智慧在上海发布"智慧财经巅峰榜",博时基金荣获"十佳基金公司"奖项,基金经理张溪凤荣获智慧财经巅峰榜"最佳基金经理"奖项。

2014年8月27日,21世纪网在苏州主办"2014中国资本市场高峰论坛暨颁奖典礼",博时亚洲票息收益债券(QDII)基金获评"2014中国QDII基金国民投资热点奖"。

2014年9月1日,《投资者报》发布"公募基金投资总监牛人榜"年化收益率排行榜单,博时基金股票投资部价值组投资总监兼博时主题行业股票基金经理邓晓峰登上"公募总监五年以上年化收益率排行榜"。

2014年9月18日,中国基金报"首届中国最佳基金经理评选"揭晓,博时大中华亚太精选基金经理张溪凤获评"海外投资最佳基金经理"。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录
9.1.1 中国证监会批准博时灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
9.1.2《博时灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
9.1.3《博时灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
9.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
9.1.5报告期内博时灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿
9.2存放地点:
基金管理人、基金托管人处
9.3查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司
博时一线通:95105568(免长途话费)

博时基金管理有限公司
2014年10月27日

博时理财30天债券型证券投资基金

【2014】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:2014年10月27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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时理财30天债券	
基金主代码	050029	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月28日	
报告期末基金份额总额	34,288,914.60份	
投资目标	本基金在保持资产相对流动性的基础上,努力追求绝对收益,争取为基金份额持有人谋求资产的增值。	
投资策略	本基金通过对宏观经济运行和货币财政政策的分析,预判未来市场利率变化趋势,采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内。采用利率策略、信用策略、个券选择等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,争取提高基金收益。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率(税后)	
风险收益特征	本基金为短期理财债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
下属两级基金的交易代码	050029	050129
报告期末下属两级基金的份额总额	24,129,073.69份	10,159,840.91份

§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(2014年7月1日-2014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	189,630.54	76,529.89
2.本期利润	189,630.54	76,529.89
3.期末基金资产净值	24,129,073.69	10,159,840.91

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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:

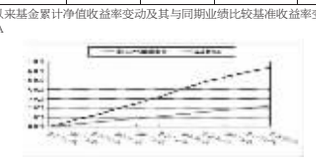
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6850%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.3447%	0.0005%

2、博时理财30天债券B:

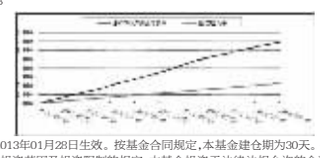
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7589%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.4186%	0.0005%

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:本基金基金合同于2013年01月28日生效。按基金合同规定,本基金建仓期为30天。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈凯杨	基金经理/现金管理组投资副总监	2013-1-28	-	9	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月再次加入博时基金管理有限公司。历任固定收益研究员、特定资产投资经理。现任固定收益总部现金管理组投资副总监兼博时安心收益定期开放债券基金、博时理财30天债券基金、博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时双月薪定期支付债券基金基金经理。
魏桢	基金经理	2013-1-28	-	6	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年7月加入博时基金管理有限公司,历任债券交易员、固定收益研究员。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时安丰18个月定期开放债券(LOF)基金、博时双月薪定期支付债券基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《博时理财30天债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、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,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,本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的情况,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.1 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相关制度。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第三季度,货币市场流动性整体宽松平稳。由于新股扰动,月末资金较为紧张,季度平均利率抬升。银行间R001均值3.03%(+50BP),R007均值3.59%(+24BP)。 现券方面,由于经济金融数据均低于预期,叠加9月份货币政策的量价放松,债券价格在基准利率下调的强烈预期下大幅上涨。三季度,本基金秉承现金管理工具的流动性和安全性原则,以滚动投放存款和逆回购为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类基金份额收益率为0.69%,B类基金份额收益率为0.76%,业绩基准收益率为0.34%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于央行通过5000亿SLF和公开市场操作调降正回购利率的量价放松操作,货币市场流动性短期较为充裕,波动性降低,资金利率的扰动主要来自场内,因IPO的冲击和场外的信用产品融资。季节性原因导致的整体利率的表现将是略有上行,幅度有限。从年内来看,也不能指望资金面一直很宽松。SLF有到期限,3个月后需要继续观察有没有更大的刺激政策跟上,且SLF主要是对冲短期的多因素叠加冲击(外汇占款减少、IPO冲击和冲存款等),等IPO发行和银行冲存款到最激烈状态时,资金面仍不免会有一定冲击。结构性宽松货币政策的常态化,从中期来看,其边际效力则是逐渐加强的,市场利率将在此预期下,产生逐步下调的效应。SLF以及公开市场正回购利率的下调将导致商业银行的中长期SHIBOR报价、NCD招标价格大概率会出现下行,预计短期内商业银行的同业负债成本将逐步走低,短期利率的下行空间被打开是大概率事件。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合良好的流动性和较短的组合期限。未来一段时间,票息收入将有所增加,我们将提高债券占比,相对降低存款与逆回购的投资力度。

§5 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	固定收益投资	22,013,043.21	60.52
	其中:债券	22,013,043.21	60.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,800,000.00	4.95
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	11,892,877.31	32.70
4	其他资产	664,909.80	1.83
5	合计	36,370,830.32	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.11	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的40%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	133
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	98

报告期内投资组合平均剩余期限超过150天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过150天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	39.93	-5.25
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	14.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	49.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.13	-5.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,012,937.74	49.62
	其中:政策性金融债	17,012,937.74	49.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,000,105.47	14.58
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	22,013,043.21	64.20
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140317	14进出17	170,000	17,012,937.74	49.62
2	041354073	13兵团投资CP001	50,000	5,000,105.47	14.58

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.22%
报告期内偏离度的最低值	0.11%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.19%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.8.2 本报告期内,本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	664,909.80
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	664,909.80

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
报告期期初基金份额总额	33,925,024.93	10,083,175.40
报告期期间基金总申购份额	993,107.09	168,750.33
减:报告期期间基金总赎回份额	10,789,058.33	92,084.82
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	24,129,073.69	10,159,840.91

注:本报告期内,本基金管出现基金资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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2014年9月30日,博时基金公司共管理五十二只开放式基金,并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。博时基金资产管理净值总规模逾2135亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1098亿元人民币,累计分红超过633亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至9月30日,博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名前1/4;博时医疗保健股票基金、博时创业成长股票基金在355只标准型股票基金中排名前1/3;博时主题行业股票基金、博时特许价值股票基金在355只标准型股票基金中排名前1/2;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2。标准指数股票型基金中,博时深证基本面200ETF、博时上证自然资源ETF在150只同类标准指数股票型基金中排名前1/3;博时裕富沪深300指数、博时上证超大盘ETF在150只同类标准指数股票型基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时宏观回报债券(A/B类)今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第2;博时信用债纯债、博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/5;博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3;博时信用债券(A/B类)、博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券基金中排名前1/2;博时稳盈收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/3。

海外投资方面业绩方面,截至9月30日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2、客户服务

2014年三季度,博时基金共举办各类渠道培训活动213场,参加人数5318人。

3、其他大事件

2014年6月16日,大智慧在上海发布"智慧财经巅峰榜",博时基金荣获"十佳基金公司"奖项,基金经理张溪凤荣获智慧财经巅峰榜"最佳基金经理"奖项。

2014年8月27日,21世纪网在苏州主办"2014中国资本市场高峰论坛暨颁奖典礼",博时亚洲票息收益债券(QDII)基金获评"2014中国QDII基金国民投资热点奖"。

2014年9月1日,《投资者报》发布"公募基金投资总监牛人榜"年化收益率排行榜单,博时基金股票投资部价值组投资总监兼博时主题行业股票基金经理邓晓峰登上"公募总监五年以上年化收益率排行榜"。

2014年9月18日,中国基金报"首届中国最佳基金经理评选"揭晓,博时大中华亚太精选基金经理张溪凤获评"海外投资最佳基金经理"。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录
9.1.1 中国证监会批准博时理财30天债券型证券投资基金设立的文件
9.1.2《博时理财30天债券型证券投资基金基金合同》
9.1.3《博时理财30天债券型证券投资基金托管协议》
9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
9.1.5博时理财30天债券型证券投资基金各年度审计报告正本
9.1.6报告期内博时理财30天债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿
9.2存放地点:
基金管理人、基金托管人处