

博时理财 30 天债券型证券投资基金

2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

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 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 债券回购融资情况.....	28
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	29
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	30
7.5 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.....	30
7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	30
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	30
7.8 投资组合报告附注.....	30
§ 8 基金份额持有人信息	31
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	31
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	31
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	31
§ 9 开放式基金份额变动	32
§ 10 重大事件揭示	32
10.1 基金份额持有人大会决议.....	32
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	32
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	32
10.4 基金投资策略的改变.....	32
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	32
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	33

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	33
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	33
10.9 其他重大事件	33
§ 11 备查文件目录	34
11.1 备查文件目录	34
11.2 存放地点	35
11.3 查阅方式	35

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时理财30天债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	44,008,200.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时理财30天债券A	博时理财30天债券B
下属分级基金的交易代码	050029	050129
报告期末下属分级基金的份额总额	33,925,024.93份	10,083,175.40份

2.2 基金产品说明

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
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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道	北京市西城区闹市口大街1号院

	7088 号招商银行大厦 29 层	1 号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	杨鹤	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期 (2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日)	
	博时理财 30 天债券 A	博时理财 30 天债券 B
本期已实现收益	968,732.57	204,441.89
本期利润	968,732.57	204,441.89
本期净值收益率	1.92%	2.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2014 年 6 月 30 日)	
	博时理财 30 天债券 A	博时理财 30 天债券 B
期末基金资产净值	33,925,024.93	10,083,175.40
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2014 年 6 月 30 日)	
	博时理财 30 天债券 A	博时理财 30 天债券 B
累计净值收益率	5.66%	6.10%

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，由于本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。

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

1. 博时理财 30 天债券 A:

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.2246%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.1136%	0.0004%
过去三个月	0.8032%	0.0097%	0.3366%	0.0000%	0.4666%	0.0097%

过去六个月	1.9220%	0.0109%	0.6695%	0.0000%	1.2525%	0.0109%
过去一年	4.0706%	0.0079%	1.3500%	0.0000%	2.7206%	0.0079%
自基金成立 起至今	5.6577%	0.0069%	1.9196%	0.0000%	3.7381%	0.0069%

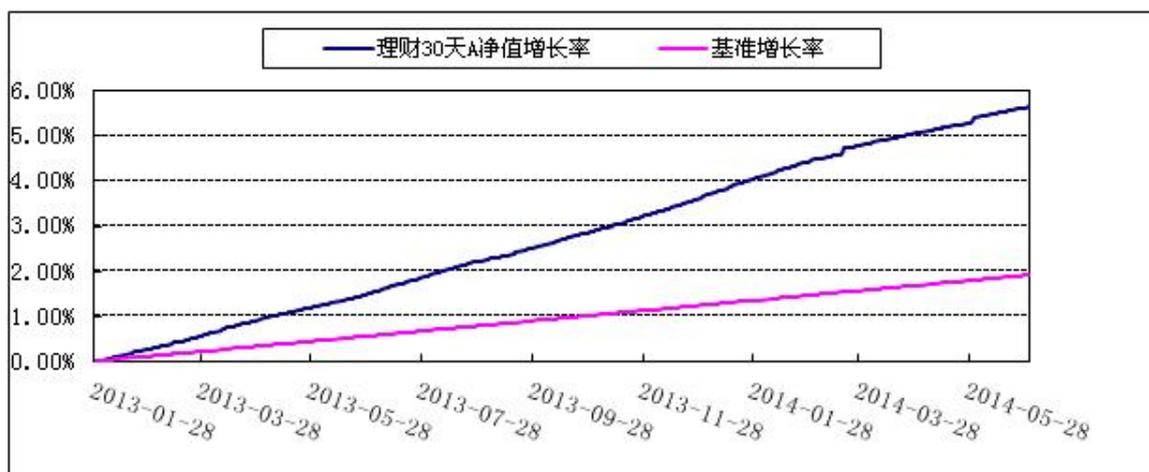
2. 博时理财 30 天债券 B:

阶段	份额净值收 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
过去一个月	0.2485%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.1375%	0.0004%
过去三个月	0.8766%	0.0097%	0.3366%	0.0000%	0.5400%	0.0097%
过去六个月	2.0693%	0.0109%	0.6695%	0.0000%	1.3998%	0.0109%
过去一年	4.3737%	0.0079%	1.3500%	0.0000%	3.0237%	0.0079%
自基金成立 起至今	6.0972%	0.0069%	1.9196%	0.0000%	4.1776%	0.0069%

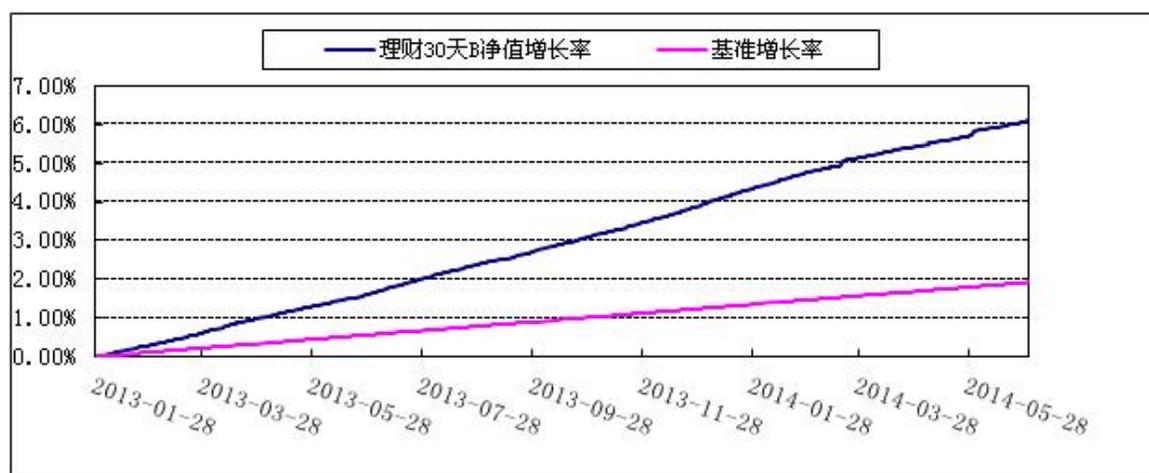
注：本基金的收益分配原则是按日分配，每个运作周期期满结转份额。

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

1、博时理财 30 天债券 A



2、博时理财 30 天债券 B



注：1、本基金基金合同于 2013 年 01 月 28 日生效。 2、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 2014 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理四十七只开放式基金，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 1041 亿元人民币，累计分红超过 628 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 6 月 30 日，博时医疗保健股票基金、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，博时主题行业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 1/3。标准指数股票型基金中，博时沪深 300 指数、博时上证超大盘 ETF、博时深证基本面 200ETF 三只基金今年以来净值增长率在 150 只同类基金中排名前 1/2。混合基金方面，今年以来博时裕益收益率在 35 只灵活配置型同类基金中排名前 1/2，博时平衡配置在 16 只股债平衡型同类基金中排名前 1/2。

固定收益方面，博时信用债纯债今年以来收益率在 101 只长期标准债券型基金中排名前 1/4，博时安丰 18 个月定期开放基金排名前 1/3，博时安盈债券基金（A 类）在 6 只中短期标准债券型基金中排名前 1/2。

海外投资方面业绩方面，截至 6 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，博时大中华亚太精选今年以来收益率在 9 只 QDII 亚太股票型基金中排名第 2，博时抗通胀在 8 只 QDII 商品基金中排名第 2。

2、客户服务

2014 年上半年，博时基金共举办各类渠道培训活动 284 场，参加人数 7355 人。

3、其他大事件

2014 年 1 月 9 日，金融界网站在北京举办“第二届领航中国 2013 金融行业年度颁奖典礼”，博时基金荣获“2013 金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖”。

2014 年 1 月 11 日，在和讯网主办的 2013 年第十一届财经风云榜基金行业评选中，博时基金荣获“2013 年度基金业最佳投资者关系奖”。

2014 年 6 月 16 日，大智慧在上海举办“智慧财经巅峰榜”，博时基金荣获“十佳基金公司”奖项，基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜“最佳基金经理”奖项。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、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 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年，基本面趋于弱化、资金面状况改善，货币市场利率和现券收益率均明显下行，债券收益率曲线呈现“牛陡”到“牛平”的特征。R001 收于 2.93%，R007 收于 4%，10 年国债收益率 4.06%，10 年国开债 4.96%。信用债收益率稳中有降，呈陡峭化下行走势、高收益债则表现偏弱，与金融债信用利差处于历史偏低水平。上半年，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，并进行部分短融的波段获利了结。

4.4.2 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 1.92%，B 类基金份额收益率为 2.07%，业绩基准收益率为 0.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济的下滑并没有实质性扭转，地产投资下滑期间，基建投资等稳增长手段客观上要求低利率资金配合。在防控债务和维稳增长中货币政策只能选择定向发力，资金

价格有望保持低位平稳运行。总体上对债市谨慎乐观，细节上修正对流动性的过度乐观和对经济的过度悲观预期。

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。

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、风险管理部负责人、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

本报告期内，本基金 A 类份额向份额持有人分配利润 968,732.57 元，本基金 B 类份额向份额持有人分配利润 204,441.89 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全

尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额，博时理财 30 天债券 A 为 968,732.57 元，博时理财 30 天债券 B 为 204,441.89 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时理财 30 天债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	16,060,346.92	29,088,149.22
结算备付金		88,000.00	528,576.19
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	22,020,155.27	14,969,178.71
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		22,020,155.27	14,969,178.71
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	5,400,000.00	23,200,148.80
应收证券清算款		200,217.58	9,709,609.09

应收利息	6.4.3.5	431,427.95	229,312.33
应收股利		-	-
应收申购款		12,117.38	213,808.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		44,212,265.10	77,938,782.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,012.80	48,012.64
应付托管费		2,966.75	14,225.96
应付销售服务费		8,725.14	20,372.80
应付交易费用	6.4.3.7	1,189.40	7,802.36
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		3,569.18	17,520.37
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	177,601.50	199,000.00
负债合计		204,064.77	306,934.13
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	44,008,200.33	77,631,848.42
未分配利润	6.4.3.10	-	-
所有者权益合计		44,008,200.33	77,631,848.42
负债和所有者权益总计		44,212,265.10	77,938,782.55

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额总额 44,008,200.33 份。其中 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 33,925,024.93 份；B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 10,083,175.40 份。

6.2 利润表

会计主体：博时理财 30 天债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 28 日（基 金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

一、收入		1,551,839.30	19,204,916.25
1. 利息收入		1,450,556.90	17,559,703.63
其中：存款利息收入	6.4.3.11	697,248.90	9,729,301.38
债券利息收入		451,364.44	3,495,091.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		301,943.56	4,335,310.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		101,282.40	1,645,192.67
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	101,282.40	1,645,192.67
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	19.95
减：二、费用		378,664.84	3,050,422.57
1. 管理人报酬		81,044.86	1,224,243.22
2. 托管费		24,013.32	362,738.75
3. 销售服务费		75,686.10	811,570.70
4. 交易费用	6.4.3.18	400.00	-
5. 利息支出		4,493.36	446,026.92
其中：卖出回购金融资产支出		4,493.36	446,026.92
6. 其他费用	6.4.3.19	193,027.20	205,842.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,173,174.46	16,154,493.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,173,174.46	16,154,493.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时理财 30 天债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	77,631,848.42	-	77,631,848.42
二、本期经营活动产生的基	-	1,173,174.46	1,173,174.46

金净值变动数（本期利润）			
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）	-33,623,648.09	-	-33,623,648.09
其中：1. 基金申购款	31,081,255.61	-	31,081,255.61
2. 基金赎回款	-64,704,903.70	-	-64,704,903.70
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）	-	-1,173,174.46	-1,173,174.46
五、期末所有者权益（基金净值）	44,008,200.33	-	44,008,200.33
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 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）	2,576,064,677.81	-	2,576,064,677.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,154,493.68	16,154,493.68
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）	-1,971,428,923.95	-	-1,971,428,923.95
其中：1. 基金申购款	1,094,565,675.73	-	1,094,565,675.73
2. 基金赎回款	-3,065,994,599.68	-	-3,065,994,599.68
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）	-	-16,154,493.68	-16,154,493.68
五、期末所有者权益（基金净值）	604,635,753.86	-	604,635,753.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人：吴姚东 主管会计工作负责人：王德英 会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	1,060,346.92
定期存款	15,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	15,000,000.00
其他存款	-
合计	16,060,346.92

注：定期存款期限指于资产负债表日定期存单剩余到期期限。

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券				
交易所市场	-	-	-	-

银行间市场	22,020,155.27	22,099,100.00	78,944.73	0.1794
合计	22,020,155.27	22,099,100.00	78,944.73	0.1794

注 1: 偏离金额=影子定价-摊余成本;

2: 偏离度=偏离金额/基金资产净值 X100%。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
交易所买入返售证券	5,400,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	5,400,000.00	-

6.4.3.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	251.04
应收定期存款利息	54,178.50
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	39.60
应收债券利息	373,790.41
应收买入返售证券利息	3,168.40
应收申购款利息	-
其他	-
合计	431,427.95

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位: 人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-140.10
银行间市场应付交易费用	1,329.50
合计	1,189.40

6.4.3.8 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末

2014 年 6 月 30 日	
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	177,601.50
合计	177,601.50

6.4.3.9 实收基金

博时理财 30 天债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,754,536.34	67,754,536.34
本期申购	30,159,763.88	30,159,763.88
本期赎回（以“-”号填列）	-63,989,275.29	-63,989,275.29
本期末	33,925,024.93	33,925,024.93

博时理财 30 天债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,877,312.08	9,877,312.08
本期申购	921,491.73	921,491.73
本期赎回（以“-”号填列）	-715,628.41	-715,628.41
本期末	10,083,175.40	10,083,175.40

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

博时理财 30 天债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	968,732.57	-	968,732.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-968,732.57	-	-968,732.57
本期末	-	-	-

博时理财 30 天债券 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-	-	-
本期利润	204,441.89	-	204,441.89
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-204,441.89	-	-204,441.89
本期末	-	-	-

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2014年1月1日至2014年6月30日	
活期存款利息收入	13,523.55	
定期存款利息收入	681,774.10	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	1,951.25	
其他	-	
合计	697,248.90	

6.4.3.12 股票投资收益

无发生额。

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2014年1月1日至2014年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,461,125.03	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,000,356.60	
减：应收利息总额	359,486.03	
债券投资收益	101,282.40	

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

无发生额。

6.4.3.16 公允价值变动收益

无发生额。

6.4.3.17 其他收入

无发生额。

6.4.3.18 交易费用

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	400.00
合计	400.00

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	6,425.70
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
合计	193,027.20

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

无。

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月28日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	81,044.86	1,224,243.22
其中：支付销售机构的客户维护费	17,572.24	294,939.08

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 0.27% 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 0.27% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月28日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,013.32	362,738.75

注：支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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 0.08% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时理财 30 天债券 A	博时理财 30 天债券 B	合计
博时基金	6,628.21	495.36	7,123.57
建设银行	38,708.39	0.00	38,708.39
招商证券	0.00	0.00	0.00
合计	45,336.60	495.36	45,831.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月28日（基金合同生效日）至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时理财 30 天债券 A	博时理财 30 天债券 B	合计
博时基金	29,916.66	11,979.07	41,895.73

建设银行	693,794.80	5,284.38	699,079.18
招商证券	0.00	0.00	0.00
合计	723,711.46	17,263.45	740,974.91

注：支付基金销售机构的销售服务费 A 类按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，B 类按前一日基金资产净值 0.01% 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：A 类日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数

B 类日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.01% / 当年天数

6.4.6.3 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 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
中国建设银行	60,172,566.58	-	-	-	-	-

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.4.2 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

无。

6.4.7.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 28 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,060,346.92	13,523.55	11,539,254.70	121,795.68

注：本基金的活期银行存款由基金托管人建设银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

博时理财 30 天债券 A

单位：人民币元

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	本期利润 分配合计	备注
956,202.81	-	12,529.76	968,732.57	-

注：本基金在本年度累计分配收益 968,732.57 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 966,043.12 元，计入应付利润科目 2,689.45 元。

博时理财 30 天债券 B

单位：人民币元

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	本期利润 分配合计	备注
203,020.46	-	1,421.43	204,441.89	-

注：本基金在本年度累计分配收益 204,441.89 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 203,562.16 元，计入应付利润科目 879.73 元。

6.4.9 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保持低风险和高流动性的前提下获得高于投资基准的回报的

投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.10.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行建设银行，定期银行存款存放在中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司和上海浦东发展银行股份有限公司等，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券。本基金的基金管理人通过对投资品种信用等级评估来控

制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.10.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年末 2013年12月31日
A-1	5,068,500.00	9,992,500.00
A-1 以下	-	-
未评级	17,030,600.00	4,969,500.00
合计	22,099,100.00	14,962,000.00

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.10.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.10.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债和短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 150 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金投资于同一公司发行的短期企业债券不超过本基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金所承担的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.10.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.10.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	16,060,346.92	-	-	-	16,060,346.92
结算备付金	88,000.00	-	-	-	88,000.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	22,020,155.27	-	-	-	22,020,155.27
买入返售金融资产	5,400,000.00	-	-	-	5,400,000.00
应收证券清算款	-	-	-	200,217.58	200,217.58
应收利息	-	-	-	431,427.95	431,427.95
应收申购款	-	-	-	12,117.38	12,117.38
资产总计	43,568,502.19	-	-	643,762.91	44,212,265.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,012.80	10,012.80
应付托管费	-	-	-	2,966.75	2,966.75
应付销售服务费	-	-	-	8,725.14	8,725.14
应付交易费用	-	-	-	1,189.40	1,189.40
应付利润	-	-	-	3,569.18	3,569.18
其他负债	-	-	-	177,601.50	177,601.50
负债总计	-	-	-	204,064.77	204,064.77
利率敏感度缺口	43,568,502.19	-	-	439,698.14	44,008,200.33
上年度末 2013年12月31日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	29,088,149.22	-	-	-	29,088,149.22

结算备付金	528,576.19	-	-	-	528,576.19
交易性金融资产	4,968,530.42	10,000,648.29	-	-	14,969,178.71
买入返售金融资产	23,200,148.80	-	-	-	23,200,148.80
应收证券清算款				9,709,609.09	9,709,609.09
应收利息	-	-	-	229,312.33	229,312.33
应收申购款	-	-	-	213,808.21	213,808.21
资产总计	57,785,404.63	10,000,648.29	-	10,152,729.63	77,938,782.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	48,012.64	48,012.64
应付托管费	-	-	-	14,225.96	14,225.96
应付销售服务费	-	-	-	20,372.80	20,372.80
应付交易费用	-	-	-	7,802.36	7,802.36
应付利润	-	-	-	17,520.37	17,520.37
其他负债	-	-	-	199,000.00	199,000.00
负债总计	-	-	-	306,934.13	306,934.13
利率敏感度缺口	57,785,404.63	10,000,648.29	-	9,845,795.50	77,631,848.42

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 （2014年6月30日）	上年度末 （2013年12月31日）
	市场利率上升25个基点	减少约3	减少约3
	市场利率下降25个基点	增加约3	增加约3

6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.10.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 22,020,155.27 元，无属于第一层级和第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	22,020,155.27	49.81
	其中：债券	22,020,155.27	49.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,400,000.00	12.21
	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	16,148,346.92	36.52
4	其他各项资产	643,762.91	1.46
5	合计	44,212,265.10	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.44	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	121
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	142
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

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。

7.3.2 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	49.42	-
	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	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	11.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	38.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	99.46	-

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,019,912.87	38.67
	其中：政策性金融债	17,019,912.87	38.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,000,242.40	11.36
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	22,020,155.27	50.04
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。

7.5 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

金额单位：人民币元

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	17,019,912.87	38.67
2	041354073	13兵团投资 CP001	50,000	5,000,242.40	11.36

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

7.6 “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	1 次
报告期内偏离度的最高值	0.26%
报告期内偏离度的最低值	0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.16%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

7.8.2 本报告期内，本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率

债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过日基金资产净值 20%。

7.8.3 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。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	200,217.58
3	应收利息	431,427.95
4	应收申购款	12,117.38
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	643,762.91

7.8.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时理财 30 天债券 A 类	1,081	31,383.00	420,095.09	1.24%	33,504,929.84	98.76%
博时理财 30 天债券 B 类	1	10,083,175.40	10,083,175.40	100.00%	-	-
合计	1,082	40,673.01	10,503,270.49	23.87%	33,504,929.84	76.13%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	博时理财 30 天债券 A 类	21,199.46	0.06%
	博时理财 30 天债券 B 类	-	-
	合计	21,199.46	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放 式基金	博时理财 30 天债券 A 类	-
	博时理财 30 天债券 B 类	-
	合计	-

本基金基金经理持有本开放式基金	博时理财 30 天债券 A 类	-
	博时理财 30 天债券 B 类	-
	合计	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	A 类	B 类
基金合同生效日(2013 年 1 月 28 日)基金份额总额	1,707,098,838.61	868,965,839.20
本报告期期初基金份额总额	67,754,536.34	9,877,312.08
本报告期基金总申购份额	30,159,763.88	921,491.73
减：本报告期基金总赎回份额	63,989,275.29	715,628.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,925,024.93	10,083,175.40

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

涉及基金管理人的重大人事变动：基金管理人于 2014 年 4 月 19 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，李志惠不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

涉及基金托管人的重大人事变动：本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金

提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	-	-	-140.10	100.00%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	成交金额
国泰君安证券	-	-	210,300,000.00	100.00%

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在 0.5%（含）以上的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通建行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-5-27
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-5-10
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-4-29
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-4-29
5	博时理财 30 天债券型证券投资基金 2014 年“劳动节”假期前暂停申购、转换转入公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-4-24
6	关于博时理财 30 天债券基金新增东海证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-4-15
7	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-4-11
8	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-3-29
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-3-11
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-2-28
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-2-25
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-2-18
13	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通工行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-2-17
14	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-2-15
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-2-15
16	博时理财 30 天债券型证券投资基金 2014 年“春节”假期前暂停申购、转换转入公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-1-24
17	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-1-23
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014-1-10

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 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
- 11.1.2 《博时理财 30 天债券型证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时理财 30 天债券型证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

11.1.5 博时理财 30 天债券型证券投资基金各年度审计报告正本

11.1.6 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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 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 8 月 28 日