博时宏观回报债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年8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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金名称	博时宏观回报债券型证券投资基金	
基金简称	博时宏观回报债券	
基金主代码	050016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年7月27日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	161,289,472.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时宏观回报债券A/B类	博时宏观回报债券C类
下属分级基金的交易代码	050016(前端),051016(后端)	050116
报告期末下属分级基金的份额总额	88,054,392.71份	73,235,079.33份

2.2基金产品说明

投资目标	通过一定范围内固定收益类与权益类资产,以及不同久期固定收益类资产的灵活配置,获取不同时期各子类资产的市场收益,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采用以自上而下分析为主,自下而上分析为辅,定性分析、定量分析等各种分析手段有效结合的方法进行大类资产配置,在确定基金资产在固定收益类资产(债券、可转债、货币)与权益类资产(股票)之间的配置比例后,再确定不同年期债券的配置比例。 债券方面本基金对不同年期债券的配置,主要采取期限结构策略,通过预测收益率曲线的形状和变化趋势,对各类不同年期的债券进行久期配置,力争组合收益超过业绩比较基准收益。 权益投资方面,本基金在参与股票一级市场申购时主要考虑一、二级市场溢价率、中签率和申购机会成本三个方面,选取合适的环境与个股参与。参与股票二级市场时,坚持择时参与不同股票指数的策略。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中低风险/收益的产品。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	唐州徽
	联系电话	0755-83169999	95566
	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594942

2.4信息披露方式

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

§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(2013年1月1日至2013年6月30日)	
	博时宏观回报债券A/B类	博时宏观回报债券C类
本期已实现收益	-2,173,427.36	-1,853,030.68
本期利润	-3,376,715.52	-1,290,610.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0296	-0.0168
本期基金份额净值增长率	-1.05%	-1.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
	博时宏观回报债券A/B类	博时宏观回报债券C类
期末可供分配基金份额利润	0.0429	0.0372
期末基金资产净值	92,031,307.72	76,120,607.18
期末基金份额净值	1.045	1.039

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1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. 博时宏观回报债券A/B类:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-3.15%	0.33%	-0.38%	0.16%	-2.77%	0.17%
过去三个月	-2.70%	0.91%	0.98%	0.10%	-3.68%	0.81%
过去六个月	-1.05%	0.97%	2.42%	0.08%	-3.47%	0.89%
过去一年	0.64%	0.67%	2.84%	0.07%	-2.20%	0.60%
自基金成立起至今	6.70%	0.43%	10.42%	0.11%	-3.72%	0.32%

2. 博时宏观回报债券C类:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-3.17%	0.33%	-0.38%	0.16%	-2.79%	0.17%
过去三个月	-2.81%	0.92%	0.98%	0.10%	-3.79%	0.82%
过去六个月	-1.24%	0.97%	2.42%	0.08%	-3.66%	0.89%
过去一年	0.26%	0.67%	2.84%	0.07%	-2.58%	0.60%
自基金成立起至今	5.38%	0.43%	10.42%	0.11%	-5.04%	0.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、博时宏观回报债券A/B类

2、博时宏观回报债券C类

注:本基金合同于2010年7月27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十四部分"(四)投资策略"、第二十七部分"(五)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成立于1998年7月13日,是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。注册资本2.5亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。同时,博时基金公司拥有博时基金(国际)有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。博时基金公司的股东为招商证券股份有限公司、中国长城资产管理公司、天津港(集团)有限公司、瑞安股权投资有限公司、上海盛业股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广厦建设集团有限责任公司。博时基金公司的经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务,是一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构。

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6月30日,博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金,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1065.69亿元人民币,累计分红602.92亿元人民币,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,2013年上半年,股票型基金中,截至6月28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1/3。混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名第8。

固定收益方面,博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名第1;博时裕祥分级债券A今年以来收益率在19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,博时标普500今年以来净值增长率在15只QDII指数股票型基金中排名第2,该基金成立以来的涨幅达到15.94%。

2、客户服务

2013年上半年,博时基金共举办各类渠道培训活动逾841场,参加人数超过2万人。

3、其他大事件

1)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"。

2)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"。

3)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"。

4)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"。

5)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"。

6)2013年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。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
皮敏	基金经理	2010-7-27	-	7.5	2005年至2009年在国信证券经济研究所任分析师。2009年6月加入博时基金管理有限公司,任固定收益部固定收益研究员。现任博时平衡配置混合基金、博时宏观回报债券基金、博时信用债纯债基金的基金经理。

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、《博时宏观回报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,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

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

今年上半年债券市场整体表现较好,信用债在6月份"钱荒"之前都处于上涨趋势之中,但由于信用债已经不便宜,且信用风险在逐步暴露的过程中,三季度信用债可能缺乏趋势性机会。转债主要在1月和5月出现较大行情,2月随着"国五条"政策收紧而下跌,6月份由于资金面极度紧张,债券市场出现很大回撤,流动性较好的转债首当其冲,跌幅较大。本组合权益与转债配置较多,在5月底开始减仓,尽力减轻了组合所受的损失。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金A/B类基金份额净值为1.045元,份额累计净值为1.067元;C类基金份额净值为1.039元,份额累计净值为1.054元。报告期内,本基金A/B类基金份额净值增长率为-1.05%,C类基金份额净值增长率为-1.24%,同期业绩基准增长率2.42%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济自身规律上,2013年唯一一个支撑经济上行的力量:房地产,在经历了2-4月份销量暴增之后,5月出现超预期的回落。下半年房地产是推动经济下行的力量。政策上,政府去杠杆的决心很大,下半年可以预期政府会在不造成系统性风险的前提下逐步消除经济中的泡沫。三季度信用债和转债可能缺乏趋势性机会,转债由于6月份下跌过多,已经接近债底,我们会适当关注转债中的优质品种。

如果IPO在下半年重启,打新股很可能提供一定的收益,本基金由于规模较小,打新对组合收益的影响较大,未来在深入研究的基础上积极参与打新。

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

本基金管理人已于2013年1月14日发布公告,以2012年12月31日已实现的可分配利润为基准,A/B类基金份额每10份基金份额派发红利0.15元、C类基金份额每10份基金份额派发红利0.13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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对博时宏观回报债券型证券投资基金(以下简称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:博时宏观回报债券型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	11,527,881.29	3,625,437.35
结算备付金	6,149,663.81	2,805,962.93
存出保证金	53,705.88	250,000.00
交易性金融资产	148,643,481.90	300,971,722.60
其中:股票投资	11,340.00	14,734,500.00
基金投资	-	-
债券投资	148,632,141.90	286,237,222.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	7,000,000.00	-
应收证券清算款	-	5,374,142.76
应收利息	2,845,440.50	5,261,964.32
应收股利	-	-
应收申购款	29,347.19	124,745.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	176,249,520.57	318,413,975.70
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30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	-	114,499,695.00
应付证券清算款	7,000,000.00	-
应付赎回款	574,048.21	1,007,498.46
应付管理人报酬	102,877.99	129,023.71
应付托管费	29,393.70	36,863.92
应付销售服务费	22,934.14	27,897.95
应付交易费用	92,180.80	28,614.37
应交税费	97,228.60	97,228.60
应付利息	-	11,740.95
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	178,942.23	410,357.37
负债合计	8,097,605.67	116,248,920.33
所有者权益:		
实收基金	161,289,472.04	189,232,551.57
未分配利润	6,862,442.86	12,932,503.80
所有者权益合计	168,151,914.90	202,165,055.37
负债和所有者权益总计	176,249,520.57	318,413,975.70

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额总额161,289,472.04份。其中A类及B类基金份额净值1.045,基金份额总额88,054,392.71份;C类基金份额净值1.039,基金份额总额73,235,079.33份。

6.2利润表

会计主体:博时宏观回报债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-431,983.97	18,207,010.43
1.利息收入	4,377,477.13	11,152,261.17
其中:存款利息收入	103,473.61	200,273.58
债券利息收入	4,272,009.84	10,924,468.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,993.68	27,518.91
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-4,263,032.46	9,962,111.50
其中:股票投资收益	2,029,727.08	7,605.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6,435,635.13	9,763,875.89
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	142,875.59	190,630.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-640,868.42	-3,758,904.66
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	94,439.78	851,542.42
减:二、费用	4,235,342.49	4,929,241.26
1.管理人报酬	708,819.85	1,566,397.09
2.托管费	202,519.89	447,542.01
3.销售服务费	142,905.82	375,378.48
4.交易费用	356,155.88	360,171.27
5.利息支出	2,617,286.95	1,968,959.18
其中:卖出回购金融资产支出	2,617,286.95	1,968,959.18
6.其他费用	207,654.10	210,793.23
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-4,667,326.46	13,277,769.17
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-4,667,326.46	13,277,769.17

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时宏观回报债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1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)	189,232,551.57	12,932,503.80	202,165,055.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,667,326.46	-4,667,326.46
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)	-27,943,079.53	2,186,687.34	-25,756,392.19
其中:1.基金申购款	192,150,270.36	16,894,498.44	209,044,768.80
2.基金赎回款	-220,093,349.89	-14,707,811.10	-234,801,160.99
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)	-	-3,589,421.82	-3,589,421.82
五、期末所有者权益(基金净值)	161,289,472.04	6,862,442.86	168,151,914.90
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	583,606,585.73	12,959,816.40	596,566,402.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,277,769.17	13,277,769.17
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)	-330,900,111.81	-10,651,777.20	-341,551,889.01
其中:1.基金申购款	2,761,076,143.67	98,821,880.01	2,859,898,023.68
2.基金赎回款	-3,091,976,255.48	-109,473,657.21	-3,201,449,912.69
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)	-	-2,836,303.52	-2,836,303.52
五、期末所有者权益(基金净值)	252,706,473.92	12,749,504.85	265,455,978.77

报表附注为本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:

基金管理公司负责人: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 关联方关系

6.4.3.1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。

6.4.3.2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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	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。

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	708,819.85	1,566,397.09
其中:支付销售机构的客户维护费	184,073.18	332,768.75

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0.7%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 0.7% / 当年天数。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	202,519.89	447,542.01

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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 0.2% / 当年天数。

6.4.4.2.3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 2013年1月1日至2013年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时宏观回报债券A/B类	博时宏观回报债券C类	合计
博时基金	-	14,558.52	14,558.52
中国银行	-	63,218.25	63,218.25
招商证券	-	16.09	16.09
合计	-	77,792.86	77,792.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时宏观回报债券A/B类	博时宏观回报债券C类	合计
博时基金	-	120,075.40	120,075.40
中国银行	-	154,353.12	154,353.12
招商证券	-	232.81	232.81
合计	-	274,661.33	274,661.33

注:支付基金销售机构的C类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值0.35%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。A类和B类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.35 % / 当年天数。

6.4.4.3 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
中国银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国银行股份有限公司	-	127,843,802.95	-	-	39,975,283.42	25,283.42

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5 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6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国银行股份有限公司	11,527,881.29	55,353.48	3,275,626.53	163,281.48

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§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	权益投资	11,340.00	0.01
	其中:股票	11,340.00	0.01
2	固定收益投资	148,632,141.90	84.33
	其中:债券	148,632,141.90	84.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	7,000,000.00	3.97
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	17,677,545.10	10.03
6	其他各项资产	2,928,493.57	1.66
7	合计	176,249,520.57	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,340.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,340.00	0.01

7.3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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000887	中鼎股份	1,800	11,340.00	0.01

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600795	国电电力	22,990,233.77	11.37
2	002031	巨轮股份	21,745,458.43	10.76
3	600886	国投电力	21,655,251.12	10.71
4	000887	中鼎股份	16,644,295.97	8.23
5	000731	四川美丰	15,596,414.25	7.71
6	600887	伊利股份	10,476,432.91	5.18
7	002250	联化科技	9,679,674.74	4.79
8	002391	长青股份	4,998,615.82	2.47
9	600583	海油工程	861,600.00	0.43

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600795	国电电力	24,738,406.45	12.24
2	002031	巨轮股份	23,743,152.67	11.74
3	600886	国投电力	22,674,194.19	11.22
4	000731	四川美丰	16,374,865.32	8.10
5	000887	中鼎股份	14,017,466.04	6.93
6	600887	伊利股份	10,404,495.66	5.15
7	002250	联化科技	8,646,119.32	4.28
8	002391	长青股份	4,248,593.04	2.10
9	601006	大秦铁路	1,383,712.56	0.68
10	600316	洪都航空	1,187,866.00	0.59
11	000539	粤电力A	1,181,102.91	0.58
12	600195	中牧股份	1,118,504.00	0.55
13	601628	中国人寿	1,080,047.25	0.53
14	002065	东华软件	1,059,502.01	0.52
15	000848	承德露露	1,046,450.00	0.52
16	600125	铁龙物流	1,039,312.69	0.51
17	600031	三一重工	1,013,000.00	0.50
18	600415	小商品城	1,009,274.48	0.50
19	601339	百隆东方	999,100.00	0.49
20	601111	中国国航	978,378.02	0.48

注:本项"卖出金额"均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	124,647,977.01
卖出股票的收入(成交)总额	140,775,430.39

注:本项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,822,793.20	5.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,945,000.00	5.91