

## 博时第三产业成长股票证券投资基金

## 2013 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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2013年10月23日

### § 1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金服务机构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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本报告中所称财务资料未经审计。

本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称:博时第三产业股票  
基金主代码:050008  
交易代码:050008

基金运作方式:契约型开放式  
基金合同生效日:2007年4月12日  
报告期末基金份额总额:6,129,577,271.86份

投资目标:基于我国第三产业的快速发展大及其战略地位,本基金以高速增长的第三产业群体企业为主要投资对象,通过深入研究和积极投资,力争为基金持有人获得超越于业绩比较基准的投资回报。

投资策略:本基金将通过“自上而下”的宏观分析,以及定性分析与定量分析相结合的方法,在股票、债券和货币资金等资产之间进行配置。

业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

风险收益特征:本基金是一只积极主动管理的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

基金管理人:博时基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

### § 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7月1日—2013年9月30日)

1.本期已实现收益:—216,821.52  
2.本期利润:440,967,981.32  
3.加权平均基金份额本期利润:0.0700  
4.期末基金资产净值:5,886,308,770.15  
5.期末基金份额净值:0.960

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 7.74% 0.83% 7.22% 1.15% 0.52% -0.32%

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2007年4月12日生效。本基金于2007年4月24日完成了基金份额的集中申购,并向中国证监会备案。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。

3.3基金净值表现  
3.3.1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 7.74% 0.83% 7.22% 1.15% 0.52% -0.32%

3.3.2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2007年4月12日生效。本基金于2007年4月24日完成了基金份额的集中申购,并向中国证监会备案。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。

3.4基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.5基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.6基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.8基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.9基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.10基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.11基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.12基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.13基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.14基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.15基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.16基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.17基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.18基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.19基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

3.20基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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	16,198,542.00	0.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,117,357,017.32	69.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,759,318.88	0.40
F	批发和零售业	62,408,491.08	1.06
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	18,568,625.82	0.32
J	金融业	592,699,747.02	10.07
K	房地产业	146,080,000.00	2.48
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		4,977,071,742.12	84.55

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	600066	宇通客车	30,600,000	563,040,000.00	9.57
2	000651	格力电器	20,000,000	531,200,000.00	9.02
3	600535	天士力	11,700,000	526,734,000.00	8.95
4	000538	云南白药	3,499,453	409,645,851.12	6.96
5	601633	长城汽车	8,000,000	408,640,000.00	6.94
6	601939	建设银行	80,000,000	344,000,000.00	5.84
7	600276	恒瑞医药	7,150,000	260,045,500.00	4.42
8	000895	双汇发展	3,999,684	185,785,321.80	3.16
9	600887	伊利股份	3,999,865	178,713,968.20	3.04
10	600597	光明乳业	6,999,749	165,124,078.91	2.81

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	417,543.84	0.01
8	其他	-	-
9	合计	417,543.84	0.01

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	128002	东债转债	3,360	417,543.84	0.01

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8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。

5.9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。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,788,505.96
2	应收证券清算款	26,881,212.19
3	应收股利	-
4	应收利息	97,468.70
5	应收申购款	1,218,265.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,985,452.82

5.10.4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。

5.10.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

5.10.6 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
本报告期初基金份额总额
本报告期基金总申购份额
减:本报告期基金总赎回份额
本报告期基金净申购份额
本报告期末基金份额总额

6,438,767,358.52  
35,909,212.77  
345,099,299.43  
6,129,577,271.86

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金管理基金情况

报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金管理基金的情况。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

2013年9月3日,我收到中国证监会下发的《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》,责令我司进行为期6个月的整改。我高度重视,通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理,彻底排查业务中存在的风险隐患,针对性的制定、实施整改措施,进而提升公司内部控制和风险管理的能力,并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

### § 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第三产业成长股票证券投资基金设立的文件

9.1.2 博时第三产业成长股票证券投资基金基金合同

9.1.3 博时第三产业成长股票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 博时第三产业成长股票证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内报告期内第三产业成长股票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内免费查阅,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 (长途话费)

博时基金管理有限公司  
2013年10月23日

## 博时回报灵活配置混合型证券投资基金

## 2013 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:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2013年10月23日

### § 1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金服务机构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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

本报告中所称财务资料未经审计。

本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称:博时宏观回报债券  
基金主代码:050016  
交易代码: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  
报告期末基金份额总额:202,371,312.49份

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。

本基金采用自上而下分析为主,自下而上分析为辅,定性分析、定量分析等多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,再确定不同时期资产的配置比例。

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,通过预期收益率曲线的形状和变化趋势,对各个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数量的策略。

中证全债指数收益率

本基金为债券型基金,预期收益和 risk 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。

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

博时宏观回报债券A/B类 博时宏观回报债券C类  
下属两级基金的交易代码:050016(前缀),051016(后缀) 050116

报告期末下属两级基金的份额总额:199,605,070.23份 102,766,242.26份

### § 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7月1日—2013年9月30日)

1.本期已实现收益:3,342,508.72 3,956,483.70  
2.本期利润:1,256,353.31 1,820,344.98  
3.加权平均基金份额本期利润:0.0148 0.0238

4.期末基金资产净值:103,923,112.16 106,782,772.66  
5.期末基金份额净值:1.043 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。

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 -0.19% 0.61% -1.13% 0.09% 0.94% 0.52%

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

1.博时宏观回报债券A/B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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

3.博时宏观回报债券A/B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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

4.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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

5.博时宏观回报债券A/B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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

6.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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

7.博时宏观回报债券A/B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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

8.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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

9.博时宏观回报债券A/B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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

10.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基金合同“十四部分”四、投资策略”、第二十七部分“五、投资限制”的有关规定。本基金建仓期和持仓比例符合基金合同的规定。

11.博时宏观回报债券A/B类