博时平衡配置混合型证券投资基金

2013 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年3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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	博时平衡配置混合
基金主代码	050007
交易代码	050007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月31日
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
报告期末基金份额总额	1,959,807,720.75份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金力争在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下,获取长期持续稳定的合理回报。
投资策略	本基金遵循经济周期性波动规律,通过定性与定量分析,动态把握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的相对变化,追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置。在严格控制投资风险的前提下,追求基金资产的长期持续稳定增长。
业绩比较基准	45%×富时中国A600指数+50%×中国债券总指数+5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金的预期风险低于股票基金,预期收益高于债券基金。本基金属于证券投资基金中的中等风险、中等收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	赵会军
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	284,624,586.15	-212,081,577.79	-615,645,017.47
本期利润	158,902,112.45	110,983,822.84	-928,621,374.68
加权平均基金份额本期利润	0.0723	0.0456	-0.3098
本期基金份额净值增长率	7.61%	5.43%	-28.55%
3.1.2期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1234	-0.1848	-0.2268
期末基金资产净值	1,718,006,292.15	1,872,771,191.09	2,167,778,081.71
期末基金份额净值	0.877	0.815	0.773

3.2基金净值表现

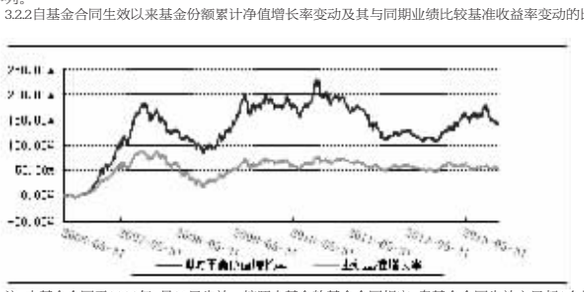
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-13.00%	0.64%	-2.46%	0.53%	-10.54%	0.11%
过去六个月	-2.56%	0.85%	1.69%	0.57%	-4.25%	0.28%
过去一年	7.61%	0.88%	-2.27%	0.62%	9.88%	0.26%
过去三年	-18.94%	0.81%	-8.61%	0.60%	-10.33%	0.21%
过去五年	26.20%	0.94%	22.57%	0.70%	3.63%	0.24%
自基金合同生效起至今	143.55%	1.03%	54.41%	0.87%	89.14%	0.16%

注:本基金的业绩比较基准为:45%×富时中国A600指数+50%×中国债券总指数+5%×同业存款息率。

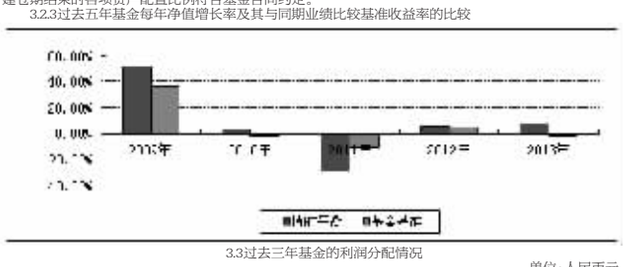
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照45%、50%、5%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



注:本基金合同于2006年5月31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十一条(二)投资范围、(八)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。

3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	-	-	-	-	-
2012年	-	-	-	-	-
2011年	1.360	215,675,620.07	182,229,974.08	397,905,594.15	分配2010年度红利
合计	1.360	215,675,620.07	182,229,974.08	397,905,594.15	-

§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2013年12月31日,博时基金公司共管理四十六只开放式基金和一只封闭式基金,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1052亿元人民币,累计分红超过608亿元人民币,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,股票型基金中,截至12月31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1/4。混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,2013年博时信用债纯债基金收益率在17只长期标准债券型基金中排名前1/3;博时裕祥分级债券A收益率在17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,博时大中华亚太精选2013年收益率在7只QDII亚太股票型基金中排名第2。

2、客户服务

2013年全年,博时基金共举办各类渠道培训活动1534场,参加人数38251人。

3、其他大事件

1)2013年1月30日, 博时亚洲票息债券基金由于达到募集份额目标上限18亿份而提前结束募集,同时启动未日比例配售,配售比例约为63.35%。

2)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”。

3)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”。

4)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”。

5)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”。

6)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”。

7)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。

8)2013年9月24日,由理财周报主办的2013中国基金业领袖峰会暨“寻找中国最受尊敬基金公司”颁奖典礼在上海举行,博时基金共获得三个奖项,分别是:2013中国最佳资产配置基金公司、2013中国最佳价值发现基金公司、2013中国最佳基金公司投资总监(姜文涛先生)。

9)2013年11月18日,博时基金在《每日经济新闻》举办的基金金鼎奖评选活动中获得“基金投顾业务-2013最具竞争力基金公司”奖项。

10)2013年12月20日,东方财富网在北京中国大饭店举办“东财互联网金融圆桌论坛”和“2013东方财富风云榜颁奖盛典”活动,我司获得“最佳企业年金奖”。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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
皮敏	基金经理	2009-12-8	-	8	2005年-2009年在国信证券经济研究所从事研究分析工作。2009年6月加入博时基金管理有限公司,历任固定收益研究员、基金经理。现担任公司博时平衡配置混合基金、博时宏观回报债券基金、博时信用债纯债债券基金和博时混合基金基金经理。
娄文涛	基金经理/绝对收益组投资总监	2012-7-17	-	14.5	1998年参加工作,先后就职于国泰君安证券股份有限公司、博时基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司、南方基金管理有限公司。2011年加入博时基金管理有限公司,2012年7月起任博时回报混合基金和博时平衡配置混合基金基金经理。现任投资部绝对收益组投资总监,兼任博时回报混合基金和博时平衡配置混合基金、博时裕益混合基金的基金经理。
曾升	基金经理	2013-11-22	-	7	2006年5月从在中国人民银行研究生部硕士毕业后加入博时基金管理有限公司,任研究部研究员。2008年6月至2010年4月在工银瑞信基金公司任研究部研究员。2010年4月再次加入博时基金管理有限公司,曾任转定资产管理部投资经理。现任博时平衡配置混合基金基金经理。

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《博时博时平衡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,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,在严格控制风险的基础上,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公平交易制度和控制方法

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程,按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2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《公平交易管理制度》的规定,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3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的说明

4.4.1报告期内本基金投资策略和运作分析

股票投资部分

2013年,中国经济增速下滑已经成为市场共识,政策从单纯强调经济刺激转向为深化改革、放松管制。新兴产业与传统产业的边界得到市场参与者的有效划分,一边是基于移动互联网的各种创新应用,另一边是传统重工业的产能收缩。反映在A股市场,传统行业估值下滑仍没有结束,新兴行业业绩普遍超预期,且估值得到持续提升。2013年市场的极端走势将引发投资人对“成长”的深深思索。

回顾本组合2013年度操作,主要分为几个阶段:一是从金融地产、制造业、消费品三驾马车的均衡配置转而偏向于新兴行业中寻找成长股、消费医药领域寻找稳定增长的投资标的;二是在科技股中,细化个股选择,年初配置消费电子产业链为主、二、三季度转向传媒;三是在四季度初净值出现较大波动的情况下,重新调整组合配置方向为低仓位下的均衡。从净值表现看,前三季度从配置方向和个股选择均获得了远超越基准的收益率,但是如何控制净值回撤与降低波动率仍然是组合投资过程中的重中之重。

债券投资部分

2013年债券市场收益率完成了一个深V的走势,多个期限与品种的收益率水平创历史新高。回过头来看2013年的债券调整有一定的必然性,但是调整幅度这么大却有一定的偶然性。调整的必然性来自于信用供需的失衡,监管套利与宏观政策不协调是偶然性的主因。具体内容我们已经在四季度策略报告中展开。本组合为了规避信用风险,在去年主要配置了高等级债券利率债。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为0.877元,累计净值为2.292元。报告期内,本基金份额净值增长率为7.61%,同期业绩基准增长率为-2.27%。

4.5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

在成长股普遍较高估值的情况下,业绩是否跟上估值提升的步伐?在经济增速下台阶背景下,传统周期性行业中的优质公司还是否能享受市场给予的相较相关公司明显的估值溢价?经济转型过程中创新的盈利模式能否带来相关公司市值的快速成长以及给部分传统行业转型自新的机会?货币政策变动及收益率曲线变化提醒投资人是否应该从更高层次的角度思考金融资产的配置方向?这几个问题都值得在年初仔细思考。展望世界经济格局,美国退出量化宽松政策或将给新兴市场带来的币值稳定冲击、中国深化改革措施落地带来的短期冲击和阵痛均可能成为今年投资的主要风险点。展望2014年的投资环境,我们认为系统性机会的概率在下降,优质的成长股可能成为市场抱团取暖的主力军,预计市场仍然表现为结构性行情而非全面开花。对组合投资而言,如何控制风险变得尤为重要。为此,我们将强化组合管理过程中的风险控制手段,争取在降低净值回撤和组合波动率的基础上为投资者创造良好的业绩回报。

债券投资部分

受流动性与市场情绪好转,2014年开年以来债券市场反弹明显。虽然我们看好债券市场反弹,但是从目前的背景来看,我们仍然只能归结于流动性与情绪的改变。因为我们并没有看到债务扩张得到遏制迹象,不管是从已经公布的数据上,还是制度上都没有明显改善。而且随着经济数据下滑,政府还面临保底线压力,如果政府真的花力气保住7%的经济增长底线,那么债务再度扩张是必然结果。而债务扩张是利率上升的根本原因。所以从这个角度说,虽然我们看好2014年的债券市场,但是必须保持对政府再度启动债务扩张的警惕。从这个角度看,2014年系统性信用风险发生的概率较低。因为如果出现系统性信用风险,那么政府保底线就将成为几乎不可能完成的任务。不过虽然不会出现系统性风险,但是不排除出现个别的信用事件。

2014年债券部分配置将基本维持目前配置。

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

收益分配原则:在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次最多为四次,年度收益分配比例不低于基金可分配收益的60%,《基金合同》当年生效不满3个月,收益可不分配;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况,报告期末本基金未满足收益分配条件,故不进行收益分配。

§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,本基金托管人在对博时平衡配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全履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

本报告期内,博时平衡配置混合型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时平衡配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,博时平衡配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时平衡配置混合型证券投资基金2013年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:博时平衡配置混合型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	61,165,887.19	30,233,175.38
结算备付金	12,236,530.43	1,297,148.29
存出保证金	920,709.62	1,991,409.69
交易性金融资产	1,465,884,853.98	1,831,245,707.77
其中:股票投资	595,978,313.98	1,117,922,279.54
基金投资	-	-
债券投资	869,906,540.00	713,323,428.23
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	130,000,000.00	-
应收证券清算款	60,110,767.54	12,704,833.96
应收利息	24,993,192.42	15,773,490.45
应收股利	-	-
应收申购款	250,225.44	268,667.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,755,562,166.62	1,893,514,432.68
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31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	-	15,000,000.00
应付证券清算款	31,156,057.57	-
应付赎回款	1,934,277.78	1,633,022.45
应付管理人报酬	2,219,933.93	2,265,619.90
应付托管费	369,988.97	377,603.32
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,423,672.82	755,232.13
应交税费	-	-
应付利息	-	8,610.00
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	451,943.40	703,153.79
负债合计	37,555,874.47	20,743,241.59
所有者权益:		
实收基金	1,959,807,720.75	2,297,370,189.38
未分配利润	-241,801,428.60	-424,598,998.29
所有者权益合计	1,718,006,292.15	1,872,771,191.09
负债和所有者权益总计	1,755,562,166.62	1,893,514,432.68

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.877元,基金份额总额1,959,807,720.75份。

7.2利润表

会计主体:博时平衡配置混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	204,025,161.89	156,973,830.46
1.利息收入	43,316,512.28	36,187,213.47
其中:存款利息收入	734,910.74	1,308,889.02
债券利息收入	41,048,279.99	34,530,115.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,533,321.55	348,209.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	285,561,805.24	-202,807,792.15
其中:股票投资收益	276,418,000.64	-217,514,344.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,671,335.55	2,385,633.13
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,472,469.05	12,320,919.44
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-125,722,473.70	323,065,400.63
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	869,318.07	529,008.51
减:二、费用	45,123,049.44	45,990,007.62
1.管理人报酬	29,692,427.87	28,972,445.87
2.托管费	4,948,737.97	4,828,740.97
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,760,827.95	11,617,351.65
5.利息支出	267,679.76	135,693.21
其中:卖出回购金融资产支出	267,679.76	135,693.21
6.其他费用	453,375.89	435,775.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	158,902,112.45	110,983,822.84
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	158,902,112.45	110,983,822.84

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时平衡配置混合型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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)	2,297,370,189.38	-424,598,998.29	1,872,771,191.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	158,902,112.45	158,902,112.45
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)	-337,562,468.63	23,895,457.24	-313,667,011.39
其中:1.基金申购款	610,859,540.97	-58,525,633.75	552,333,907.22
2.基金赎回款	-948,422,009.60	82,421,090.99	-866,000,918.61
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,959,807,720.75	-241,801,428.60	1,718,006,292.15
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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)	2,803,505,648.29	-635,727,566.58	2,167,778,081.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	110,983,822.84	110,983,822.84
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)	-506,135,458.91	100,144,745.45	-405,990,713.46
其中:1.基金申购款	145,158,540.89	-30,186,432.24	114,972,108.65
2.基金赎回款	-651,293,999.80	130,331,177.69	-520,962,822.11
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,297,370,189.38	-424,598,998.29	1,872,771,191.09

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4报表附注

7.4.1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。

7.4.2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。

7.4.3关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
烟安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
上海丰益股权投资基金有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	293,540,044.03	4.72%	416,038,842.17	5.45%

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	267,239.93	4.80%	17,231.49	1.21%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	351,723.56	5.45%	-	-

注:1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人于对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.4.2关联方报酬

7.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	29,692,427.87	28,972,445.87
其中:支付销售机构的客户维护费	3,326,300.75	3,332,168.13

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1.5%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 1.5%/当年天数。

7.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,948,737.97	4,828,740.97

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 0.25%/当年天数。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2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。

7.4.4.5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12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	61,165,887.19	654,808.67	30,233,175.38	1,224,489.42

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券	120245	12国开45	簿记建档集中配售	600,000	59,958,000.00

7.4.5期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1银行间市场债券正回购

无。

7.4.5.3.2交易所市场债券正回购

无。

7.4.6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2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为749,377,853.98元,属于第二层级的余额为716,507,000.00元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级1,374,869,707.77元,第二层级456,376,000.00元,无第三层级)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(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。

§8投资组合报告

8.1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	595,978,313.98	33.95
	其中:股票	595,978,313.98	33.95
2	固定收益投资	869,906,540.00	49.55
	其中:债券	869,906,540.00	49.55
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	130,000,000.00	7.41
	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	73,402,417.62	4.18
6	其他各项资产	86,274,895.02	4.91
7	合计	1,755,562,166.62	100.00

8.2报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位