

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

报告书日期:2014年3月28日

§ 1重要提示

基金管理人的声明:本基金所披露资料不存虚假记载、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。本基金报告书经公司二分之一以上董事签字,并由董事长签发。

基金托管人对本基金报告书有限公司根据本基金合同,于2014年3月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配政策、费用计提、报告内容等信息,保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺诚实守信、勤勉尽责地管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金过往经营业绩不构成未来表现的保证,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。

本报告书将报告自年度报告之日,投资者了解了该报告内容,应阅读年度报告正文。

本基金报告期自2013年1月1日起至2012年12月31日。

§ 2基金简介

基金名称:博时行业轮动股票型证券投资基金

基金代码:050018

交易代码:050018

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年12月10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

报告期末基金总资产:500,611,072.399

报告期末基金份额净值:不定期

22基金产品说明

本基金通过深入分析周期内行业的健康度因素和不同行业股价波动对投资者的影响,力争实现超额收益和行业轮动的收益。

本基金投资股票占基金资产的30-70%。首次是大盘蓝筹的配置,根据经济周期决定股票类资产配置比例,在经济周期的上升阶段,本基金将配置于周期性行业,在经济周期的下降阶段,本基金将配置于周期性行业内部的轮动,力争实现超额收益和行业轮动的收益。

本基金投资于股票资产的比例,在经济周期的上升阶段,配置不同的行业,后将选择涨幅较高的行业和投资品种。

行业轮动策略是本基金的最主要策略,以基本面分析为前提,以行业轮动为手段,通过行业轮动,把握行业轮动的名次和风格,获取行业的收益和风险。

业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证债券指数收益率×40%

风险收益特征:本基金为股票型基金,股票型基金的风险高于混合型基金,债券型基金和货币市场基金,属于高风险、高收益的品种。

23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

姓名:孙洁清

联系电话:0755-83169999

电子邮箱:service@bofa.com

客户服务电话:95105568

传真:0755-83195140

24偿债能力指标

基金管理人声明并正视的管理人互联网网址: http://www.bofa.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

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标:2013年:2012年:2011年

本期末实现收益:73,658,451.90,-65,975,926.76,-228,973,965.97

本期利润:27,153,877.87,21,511,986.27,-255,941,897.44

加权平均基金份额本期利润:0.0437,0.0286,-0.2674

本期平均净值增长率为:5.42%,3.94%,30.26%

本期基金净值增长率为:4.13%,4.02%,27.80%

3.1.2期末数据和指标:2013年末:2012年末:2011年末

期末可供分配利润:-110,406,816.68,-238,075,561.71,-231,072,962.01

期末可供分配基金份额利润:-0.3588,-0.3781,-0.2781

期末基金资产净值:391,462,107.56,520,169,506.85,599,997,364.28

期末基金份额净值:0.782,0.751,0.722

3.1.3期末指标:2013年末:2012年末:2011年末

期末可供分配利润:-21.80%,-20.80%,-27.80%

期末可供分配利润增长率为:-21.80%,-20.80%,-27.80%

注:本期末可供分配的金额包括持有人交易基金的管理费、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的金额扣除本公司的管理费。

上述主要财务指标不包括持有人交易基金的管理费。

3.2基金的净值

3.2.1基金的净值增长情况及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中债国债总指数收益率×20%。由于基金资产配比比例处于动态变化的过程中,将通过再平衡来使基金的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日调整80%,20%的比例取平均,再平衡时连带的计算方式为重新计算的基准指数。

3.2.2本基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.3本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.4本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.5本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.6本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.7本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.8本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.9本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.10本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.11本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.12本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.13本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.14本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.15本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.16本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.17本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.18本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.19本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.20本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.21本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.22本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.23本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.24本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.25本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.26本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.27本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.28本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.29本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.30本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.31本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较

注:本基金合同于2010年12月10日生效,按照本基金管理人声明,自基金合同生效之日起的12个月内基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、(八)投资限制的有关规定,本基金在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同的约定。

3.2.32本基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较