

博时新兴成长股票型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2014年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2014年1月21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。

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。

§ 2 报告所涉及财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§ 2.1 基金产品概况

基金简称:博时新兴成长股票

基金主代码:050009

交易代码:050009

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2007年7月6日

报告期末基金份额总额:17,248,887,301.32份

投资目标:本基金主要投资于中国经济正在于长期稳定增长周期，本基金通过深入研究并积极地投资于各行业中的新兴高成长企业，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的稳定的投资回报。

投资策略:本基金将通过“自上而下”的宏观分析，以及对行业分析与定量分析相结合的方法，在股票、债券及现金等资产之间进行资产配置。本基金将分析和预测宏观经济变量，包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等，从而判断国家财政、税收、货币、汇率及股市分权改革政策和其他证券市场政策等。本基金将在此基础上，决定股票、固定收益证券和现金等大类资产在给定区间内的动态配置。

业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中国债券指数收益率×20%

风险收益特征:本基金为股票型基金，属于预期风险和预期收益均高于债券型基金的品种。

基金管理人:博时基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 102,368,903.48

2.本期利润 -478,857,471.95

3.加权平均基金份额本期利润 9,528,217,975.66

4.期末基金份额净值 0.552

注:本基金的应收利息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。本期利息收入实现收益加上本期公允价值变动收益后，扣除基金管理费和托管费(不包括持有人交易费用)，计入费用后，投资人的实际收益水平将低于所列示的数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期基金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 准收益基准差④

过去三个月 -4.66% 1.22% -2.04% -1.62% 0.32%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+中债国债指数收益率×20%

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符合基金合同的要

求，本基金每期按90%~20%的比例来取平均数，再以每期的计算方式得到基准收益率的时序排列。

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

3.3 基金净值表现

3.3.1 本基金报告期基金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 准收益基准差④

过去三个月 -4.66% 1.22% -2.04% -1.62% 0.32%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+中债国债指数收益率×20%

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符合基金合同的要

求，本基金每期按90%~20%的比例来取平均数，再以每期的计算方式得到基准收益率的时序排列。

3.3.2 本基金合同生效以来基金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

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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

韩茂华 基金经理 2013-1-9 - 7 2006-7-1加入博时基金管理有限公司，历任研究部助理研究员、行业研究员、基金经理助理、基金经理，现任新兴成长股票型证券投资基金、博时新兴成长股票型证券投资基金基金经理。

曾鹏 基金经理 2013-1-18 - 8 2005-9起先后在上投基金任职，嘉富基金管理部工作。2012-10月加入博时基金管理有限公司，担任新兴成长股票型证券投资基金基金经理，现任新兴成长股票型证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵循信守情况说明

在本基金报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

报告期内，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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.5 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.6 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.7 公平交易制度的执行情况

报告期内，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。

4.8 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.9 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.10 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.11 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.12 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.13 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.14 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.15 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.16 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.17 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.18 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.19 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.20 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.21 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.22 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.23 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.24 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.25 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.26 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.27 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.28 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.29 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.30 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.31 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.32 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品、医药、TMT及能源装备等领域。从投资效果来看，季度内半段受制于市场风格的延续，净值创出年内新高，季度后半段受市场风格切换影响净值出现了明显的回撤。

4.33 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0.562元，累计份额净值为2.641元，报告期内净值增长率为-4.66%，同期净值涨跌幅为-3.04%。

4.34 报告期内基金的估值政策

本基金在报告期内，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、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责、忠实于客户、诚信于社会的职责和管理好基金资产，使基金持有人获得最大利益。本基金报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的有关规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.35 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季报，在经济政策和改革预期背景下，市场经历了宽幅振荡，并在一定程度上完成了风格切换。本基金在季度初降低了仓位，并重点配置在大众消费品