

## 博时平衡配置混合型证券投资基金

[2014] 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

报告期:2014年7月1日至2014年9月30日

5.1 基本提示

基金管理人的董事及监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。2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合

报告期末的资产配置情况，以及本报告摘要的编制和复核情况。

基金经理承诺:本人声明已阅读并理解本基金合同，履行了向投资人揭示风险义务。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

5.2 基金产品概况

	博时平衡配置混合型证券投资基金
交易代码	050007
基金份额发售方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月31日
报告期末基金份额总额	1,632,883,516.37份

基金名称:博时平衡配置混合型证券投资基金

基金类别:混合型

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

报告期末基金份额总额:1,632,883,516.37份

投资目标:本基金将通过资产配置策略，通过定性与定量分析，动态把握不同资产类别的相对变化，追求股票、债券等大类资产的适度平衡配置，从而在控制风险的前提下，力争基金资产长期稳定的增值。

业绩比较基准:45%×富时中国A股指数+50%×中债总指数+5%×同业存款利息率。

风险收益特征:本基金为中等风险、中等收益品种。

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

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

1.本期已实现收益 26,584,360.33

2.本期利润 85,219,460.48

3.加权平均基金份额本期利润 0.0495

4.期末基金资产净值 1,510,807,027.60

5.期末基金份额净值 0.925

注:本基金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利润。

所有赎回费用均不包括认购或交易基金的各项费用，计入费用后投资者的实际收益水平要低于零时数。

3.2基金净值表现

3.2.1报告期末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(①) 净值增长标准差(②) 收益率差(%) 收益差标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.59% 0.25% 7.13% 0.09% -154% -0.15%

3.2.2报告期内本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净值表现

3.3.1报告期末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(①) 净值增长标准差(②) 收益率差(%) 收益差标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 5.59% 0.25% 7.13% 0.09% -154% -0.15%

3.4基金管理人(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

任职日期 离任日期

孙敬文 基金经理 2009-12-8 -

段旗 基金经理 1998年6月在国泰基金公司任研究员，2000年1月在国泰基金公司任研究员，2001年6月任国泰基金管理有限公司任研究员，2003年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2005年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2006年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2007年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2008年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2009年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2010年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2011年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2012年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2013年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2014年1月任国泰基金管理有限公司任研究员。

段旗 1998年6月在国泰基金公司任研究员，2000年1月在国泰基金公司任研究员，2001年6月任国泰基金管理有限公司任研究员，2003年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2005年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2006年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2007年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2008年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2009年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2010年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2011年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2012年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2013年1月任国泰基金管理有限公司任研究员，2014年1月任国泰基金管理有限公司任研究员。

4.4持有人对本基金的公平交易情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规，制定了公平交易制度，对所有投资组合执行公平交易制度，对所有投资组合公平对待，没有利益输送行为。

4.5公平交易制度的执行情况

4.5.1公平交易制度的执行情况

4.5.2公平交易制度的执行情况

4.5.3公平交易制度的执行情况

4.5.4公平交易制度的执行情况

4.5.5公平交易制度的执行情况

4.5.6公平交易制度的执行情况

4.5.7公平交易制度的执行情况

4.5.8公平交易制度的执行情况

4.5.9公平交易制度的执行情况

4.5.10公平交易制度的执行情况

4.5.11公平交易制度的执行情况

4.5.12公平交易制度的执行情况

4.5.13其他各部分构成

4.6持有人对本基金的公平交易情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规，制定了公平交易制度，对所有投资组合执行公平交易制度，对所有投资组合公平对待，没有利益输送行为。

4.7公平交易制度的执行情况

4.7.1公平交易制度的执行情况

4.7.2公平交易制度的执行情况

4.7.3公平交易制度的执行情况

4.7.4公平交易制度的执行情况

4.7.5公平交易制度的执行情况

4.7.6公平交易制度的执行情况

4.7.7公平交易制度的执行情况

4.7.8公平交易制度的执行情况

4.7.9公平交易制度的执行情况

4.7.10公平交易制度的执行情况

4.7.11公平交易制度的执行情况

4.7.12公平交易制度的执行情况

4.7.13其他各部分构成

4.8持有人对本基金的公平交易情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格执行了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规，制定了公平交易制度，对所有投资组合执行公平交易制度，对所有投资组合公平对待，没有利益输送行为。

4.9公平交易制度的执行情况

4.9.1公平交易制度的执行情况

4.9.2公平交易制度的执行情况

4.9.3公平交易制度的执行情况

4.9.4公平交易制度的执行情况

4.9.5公平交易制度的执行情况

4.9.6公平交易制度的执行情况

4.9.7公平交易制度的执行情况

4.9.8公平交易制度的执行情况

4.9.9公平交易制度的执行情况

4.9.10公平交易制度的执行情况

4.9.11公平交易制度的执行情况

4.9.12公平交易制度的执行情况

4.9.13其他各部分构成

4.10报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 471,493,365.87 30.92

2 固定收益投资 748,709,680.44 49.11

3 货币市场工具 49,115.00 0.01

4 金融衍生品投资 164,000,296.00 10.76

5 其他资产 123,657,542.87 8.11

6 银行存款和结算备付金合计 16,782,977.51 1.10

7 其他负债 1,524,638,665.25 100.00

注:本基金的基金合同于2012年10月31日生效，根据本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起2个月内本基金的报告组合比例符合本基金合同第十一“二(一)投资范围”、八(八)投资限制的有关规定。本基金建仓期结束时各项资产占基金总资产的比例符合规定。

5.1 基金产品概况

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:2014年7月1日至2014年9月30日

5.2 报告期内本基金的利润分配情况

截至报告期末本基金未进行利润分配。

5.3 报告期内基金资产净值

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.4 报告期内基金的财务指标

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.5 报告期末基金资产组合情况

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.6 报告期内基金的净值表现

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.7 报告期内基金的偏离度情况

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.8 报告期内基金的估值政策

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.9 报告期内基金的交易价格与份额净值的折溢价情况

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.10 报告期内基金的现金流量表

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.11 报告期内基金的季度报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.12 报告期内基金的半年度报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.13 报告期内基金的年度报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.14 报告期内基金的中期报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.15 报告期内基金的临时公告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.16 报告期内基金的清算报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.17 报告期内基金的年度报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.18 报告期内基金的半年度报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.19 报告期内基金的中期报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.20 报告期内基金的清算报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.21 报告期内基金的年度报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.22 报告期内基金的半年度报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.23 报告期内基金的中期报告

报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)

5.