

# 博时行业轮动股票型证券投资基金

## 2012 年年度报告

### 2012 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2013 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 25 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
§ 2 基金简介 .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	7
§ 4 管理人报告 .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
§ 5 托管人报告 .....	12
§ 6 审计报告 .....	13
§ 7 年度财务报表 .....	13
7.1 资产负债表 .....	14
7.2 利润表 .....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
7.4 报表附注 .....	17
§ 8 投资组合报告 .....	36
8.1 期末基金资产组合情况 .....	36
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	36
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	37
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	37
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	42
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	42
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	42
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	42
8.9 投资组合报告附注 .....	42
§ 9 基金份额持有人信息 .....	43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	43
§ 10 开放式基金份额变动 .....	43
§ 11 重大事件揭示 .....	44

11.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
11.4 基金投资策略的改变 .....	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
11.8 其他重大事件 .....	45
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
§ 13 备查文件目录 .....	49
13.1 备查文件目录 .....	49
13.2 存放地点 .....	50
13.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时行业轮动股票型证券投资基金
基金简称	博时行业轮动股票
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	692,265,325.07 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入分析经济周期不同阶段的关键驱动因素和不同行业股价波动的关键驱动因子，把握周期性行业与稳定性行业轮动、周期性行业内部轮动的规律，力争实现在经济周期和行业景气波动下的资产稳定增值。
投资策略	本基金具体投资策略分三个层次：首先是大类资产的配置，即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置，即根据行业轮动的规律和经济发展的内在逻辑，在经济周期的不同阶段，配置不同的行业；最后是个股选择策略和债券投资策略。行业轮动策略是本基金的核心策略。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。
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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	杨鹤	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

## § 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	2012年	2011年	2010年12月10日（基金合同生效日）至2010年12月31日
本期已实现收益	-65,795,926.76	-228,973,965.97	-966,938.49
本期利润	21,511,986.27	-255,941,897.44	499,733.53
加权平均基金份额本期利润	0.0286	-0.2674	0.0004
本期加权平均净值利润率	3.94%	-30.26%	0.04%
本期基金份额净值增长率	4.02%	-27.80%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配利润	-238,407,561.71	-231,072,962.01	-966,938.49
期末可供分配基金份额利润	-0.3444	-0.2781	-0.0007
期末基金资产净值	520,169,506.85	599,957,364.28	1,400,939,025.18
期末基金份额净值	0.751	0.722	1.000
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2011年末	2010年末
基金份额累计净值增长率	-24.90%	-27.80%	0.00%

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交易基金的各项费用，计入费用后持有人的实际收益水平要低于所列数字。

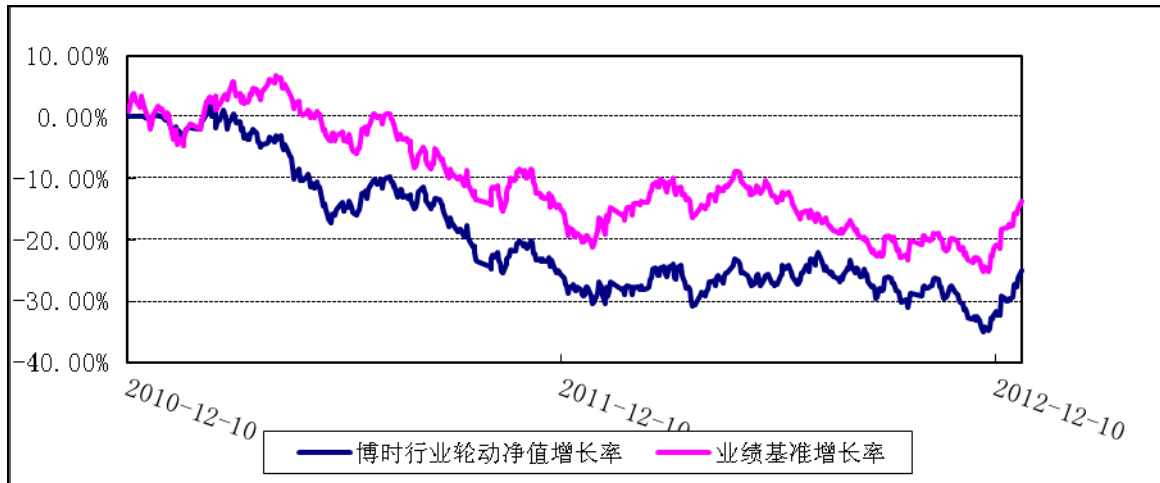
### 3.2 基金净值表现

#### 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	5.33%	1.15%	8.15%	1.02%	-2.82%	0.13%
过去六个月	0.67%	1.12%	2.18%	0.99%	-1.51%	0.13%
过去一年	4.02%	1.18%	6.87%	1.02%	-2.85%	0.16%
自基金合同生效起至今	-24.90%	1.08%	-13.69%	1.04%	-11.21%	0.04%

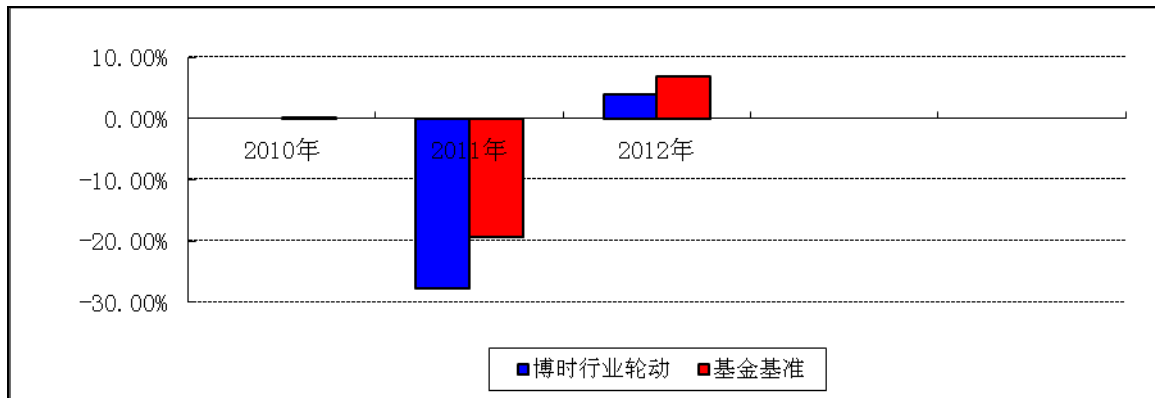
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80% + 中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 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 2010 年 12 月 10 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十二条（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合同约定。

### 3.2.3 合同生效日以来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



注：本基金合同于 2010 年 12 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无

## § 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（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。总部设在深圳，在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司，此外，还设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；璟安股权投资有限公司，持有股份 6%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；上海丰益股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。

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 2012 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理三十三只开放式基金和二只封闭式基金，并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分全国社保基金，以及多个企业年金账户、特定资产管理账户。截至 2012 年 12 月 31 日，博时管理的公募基金资产规模逾 1371 亿元人民币，累计分红超过 579 亿元人民币。博时基金公司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，2012 年，博时旗下共有 8 只基金的年度收益位居同类型基金前 1/3。

开放式股票型基金中，截至 2012 年 12 月 31 日，博时主题行业基金的年度收益在同类型 274 只股票型产品中排名第 16，此外，博时创业成长基金、博时卓越品牌基金、博时第三产业基金的年度收益均位于同类型 274 只标准股票型基金的前 1/3；债券型基金中，博时信用债券基金的年度收益在同类型 55 只产品中排名第 9；货币基金中，博时现金收益基金的年度收益在同类 49 只基金中排名第 2；

封闭式基金中，截至 2012 年 12 月 31 日，博时裕隆封闭的年度收益在同类的 25 只基金中排名第 2；



QDII 基金中，截至 2012 年 12 月 28 日，博时大中华亚太精选股票基金的年度收益在全部 6 只 QDII 亚太型股票基金产品中排名第 1。

## 2、客户服务

1) 2012 年全年，博时基金共举办各类渠道培训活动共计 663 场；“博时 e 视界”共举办视频直播活动 27 场，在线人数累计 2581 人次；

2) 2012 年 1 月 5 日举办“2012 博时基金投资策略媒体交流会”，到会 50 多家媒体。1 月 6 日在中华世纪坛举办“博时基金投资论坛暨 2012 投资策略交流会”，到会约 220 名机构和零售高端客户，通过这些活动，博时与投资者充分沟通了当前市场的热点问题，受到了投资者的广泛欢迎。

## 3、品牌获奖

1) 2012 年 3 月 26 日，在“证券时报 2011 年度中国基金业明星奖”中，我司共获得七项大奖：博时基金管理有限公司获得“2011 年度十大明星基金公司奖”、博时特许价值股票基金获得“三年持续回报股票型明星基金奖”、博时主题行业股票基金和博时特许价值股票基金获得“2011 年度股票型明星基金奖”、博时价值增长基金和博时价值增长贰号基金获得“2011 年度平衡混合型明星基金奖”、博时裕隆封闭获得“2011 年度封闭式明星基金奖”。

2) 2012 年 3 月 28 日，中证报“2012 年金牛基金论坛暨第九届中国基金业金牛奖颁奖盛典”在京举行。博时基金荣膺六项大奖，分别是：博时基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”、博时裕隆封闭荣获“五年期封闭式金牛基金”、博时主题行业荣获“五年期股票型金牛基金”、博时第三产业荣获“2011 年度股票型金牛基金”、博时特许价值荣获“2011 年度股票型金牛基金”、博时价值增长荣获“2011 年度混合型金牛基金”。

3) 2012 年 4 月 20 日，由上海证券报社主办的第九届中国“金基金”奖评选揭晓，博时基金管理有限公司获得 2011 年度“金基金·TOP 公司奖”，博时主题行业股票基金获得 2011 年度“五年期金基金·股票型基金奖”，博时价值增长混合基金获得 2011 年度“一年期金基金·偏股混合型基金奖”。

4) 2012 年 5 月 25 日，在由 21 世纪经济报道主办的“2011 年度赢基金奖”评选中，博时基金荣获“2011 年度中国最佳基金公司”奖项。

5) 6 月 28 日，世界品牌实验室(WBL)在京发布 2012 年（第九届）《中国 500 最具价值品牌》排行榜，博时基金以 61.92 亿元的品牌价值位列第 220 名，成为入选该榜单四家基金公司中的第一名。

6) 2012 年 12 月 12 日，在经济观察报“2011-2012 年度中国卓越金融奖”评选活动中，

博时基金凭借出色的线上服务水平和便利的电子交易平台，荣获“年度卓越基金公司电子服务奖”，成为唯一获此殊荣的基金公司。

7) 2012 年 12 月 14 日，东方财富风云榜颁奖典礼在上海举行，博时基金荣获“2012 年度最佳企业年金投资管理人”奖项。

#### 4、其他大事件

1) 博时天颐债券型证券投资基金首募顺利结束并于 2 月 29 日正式成立。

2) 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金及联接基金于 2012 年 3 月 5 日至 3 月 30 日完成了首次募集。

3) 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金于 5 月 11 日起在上交所上市，交易代码为 510410，日常申购、赎回业务也同步开放。

4) 博时于 5 月 15 日开通支付宝支付渠道，成为首家在直销网上交易中引入支付宝渠道的基金公司。

5) 博时标普 500 指数型证券投资基金首募顺利结束并于 6 月 14 日正式成立。

6) 博时医疗保健行业股票型证券投资基金首募顺利结束并于 8 月 28 日正式成立。

7) 博时信用债纯债债券型证券投资基金首募顺利结束并于 9 月 7 日正式成立。

8) 博时安心收益定期开放债券型证券投资基金首募顺利结束并于 12 月 6 日正式成立。

#### 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
		任职日期	离任日期		
刘建伟	基金经理	2010-12-10	-	8	1999 年起先后在中国工商银行(北京)、锦天城律师事务所(上海)、瑞士银行(纽约)个人理财部工作。2004 年 11 月加入博时基金管理有限公司，历任研究部研究员、市场部国际业务经理、股票投资部另类投资组高级分析师、投资经理、博时平衡配置基金基金经理助理。现任博时行业轮动基金基金经理。

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、《博时行业轮动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，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，本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的情况，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 报告期内基金投资策略和运作分析

在本年度的操作中，1) 在周期性和行业把握方面，一季度对周期品种的把握不足，在四季度中对金融的超配取得了较好效果。2) 在个股选择方面，一些长线品种的持有也取得了很好的投资收益，但个别重仓品种的调整过程中操作不够坚决，值得反思。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.751 元，份额累计净值为 0.751 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 4.02%，同期业绩基准增长率为 6.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望全新的 2013 年，全球经济在逐步走出困境，外部压力有所缓解。国内经济则面临挑

战，原有发展模式的转型势在必行，政府换届后政策导向值得重点关注。在投资操作中，我们会优先选取穿越周期变化的长期投资标的，同时结合政府政策导向对组合行业配置做相应调整。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2012 年，我公司根据法律、法规的规定，更新了《基金投资管理制度》、《博时基金公募产品开发管理流程手册》、《员工投资基金管理制度》、《博时基金股指期货投资管理流程手册》、《债券池管理办法》、《博时基金管理有限公司开放式基金业务规则》等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。根据新业务发展情况制定了《博时基金管理公司内幕交易防控制度》、《博时基金管理有限公司产品委员会制度》、《境外券商选择和佣金分配管理办法》等制度和手册，不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 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、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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金收益分配原则：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### **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**

本托管人复核审查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。



## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 21396 号

博时行业轮动股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的博时行业轮动股票型证券投资基金(以下简称“博时行业轮动基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日资产负债表、2012 年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是博时行业轮动基金的基金管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述博时行业轮动基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时行业轮动基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
 会计师事务所有限公司  
 中国·上海市  
 2013 年 3 月 21 日

注册会计师  
 \_\_\_\_\_  
 汪 棣  
 \_\_\_\_\_  
 注册会计师  
 \_\_\_\_\_  
 金 毅

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时行业轮动股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	94,461,334.46	7,244,154.20
结算备付金		9,143,411.23	5,286,428.65
存出保证金		5,874,652.47	407,362.23
交易性金融资产	7.4.7.2	416,744,594.49	591,921,420.97
其中：股票投资		416,744,594.49	553,265,420.97
基金投资		-	-
债券投资		-	38,656,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	0.00	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,311,353.38	-
应收利息	7.4.7.5	20,446.02	95,825.04
应收股利		-	-
应收申购款		418,648.55	6,813.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		527,974,440.60	604,962,004.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,939,322.42	2,112,252.69
应付赎回款		180,498.27	706,137.30
应付管理人报酬		614,128.49	779,498.27
应付托管费		102,354.74	129,916.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	808,227.89	994,173.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	160,401.94	282,661.20
负债合计		7,804,933.75	5,004,639.81
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	692,265,325.07	831,030,326.29
未分配利润	7.4.7.10	-172,095,818.22	-231,072,962.01
所有者权益合计		520,169,506.85	599,957,364.28
负债和所有者权益总计		527,974,440.60	604,962,004.09

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.751 元，基金份额总额 692,265,325.07 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时行业轮动股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年 12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 12月31日
<b>一、收入</b>		<b>40,370,845.79</b>	<b>-232,171,761.35</b>
1. 利息收入		1,521,104.13	1,771,680.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	322,923.09	1,586,969.38
债券利息收入		1,174,896.18	40,513.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,284.86	144,196.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-48,601,493.84	-207,705,726.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-53,891,413.31	-214,521,944.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,410.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-708,840.00	-
股利收益	7.4.7.15	5,983,349.47	6,816,218.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.16	87,307,913.03	-26,967,931.47



填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“—”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“—”号填列)	7. 4. 7. 17	143, 322. 47	730, 216. 12
<b>减: 二、费用</b>		<b>18, 858, 859. 52</b>	<b>23, 770, 136. 09</b>
1. 管理人报酬		8, 213, 341. 11	12, 809, 355. 22
2. 托管费		1, 368, 890. 15	2, 134, 892. 54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 18	8, 881, 854. 49	8, 407, 167. 05
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7. 4. 7. 19	394, 773. 77	418, 721. 28
<b>三、利润总额 (亏损总额以“—”号填列)</b>		<b>21, 511, 986. 27</b>	<b>-255, 941, 897. 44</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“—”号填列)</b>		<b>21, 511, 986. 27</b>	<b>-255, 941, 897. 44</b>

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 博时行业轮动股票型证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 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)	831, 030, 326. 29	-231, 072, 962. 01	599, 957, 364. 28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	21, 511, 986. 27	21, 511, 986. 27
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)	-138, 765, 001. 22	37, 465, 157. 52	-101, 299, 843. 70
其中: 1. 基金申购款	21, 834, 682. 79	-5, 800, 010. 74	16, 034, 672. 05
2. 基金赎回款	-160, 599, 684. 01	43, 265, 168. 26	-117, 334, 515. 75
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)	692, 265, 325. 07	-172, 095, 818. 22	520, 169, 506. 85
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	1, 400, 439, 291. 65	499, 733. 53	1, 400, 939, 025. 18
二、本期经营活动产生的基金	-	-255, 941, 897. 44	-255, 941, 897. 44

净值变动数（本期利润）			
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）	-569,408,965.36	24,369,201.90	-545,039,763.46
其中：1. 基金申购款	43,026,697.29	-3,895,421.84	39,131,275.45
2. 基金赎回款	-612,435,662.65	28,264,623.74	-584,171,038.91
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）	831,030,326.29	-231,072,962.01	599,957,364.28

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：

基金管理人负责人：何宝      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 基金基本情况

博时行业轮动股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 1242 号《关于核准博时行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时行业轮动股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集 1,400,439,291.65 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 340 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时行业轮动股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额(包括认购资金利息折算部分)为 1,400,439,291.65 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时行业轮动股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、固定收益类证券、回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-40%，债券等固定

收益类证券投资范围主要包括国债、金融债、公司债、中央银行票据、企业债、短期融资券、可转换债券、资产证券化产品等；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2013 年 03 月 21 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时行业轮动股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年度和财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类

应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流

量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。



#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 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[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》及其他相关财税法规和实务操作，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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
活期存款	94,461,334.46	7,244,154.20
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	94,461,334.46	7,244,154.20

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	358,599,020.91	416,744,594.49	58,145,573.58
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	358,599,020.91	416,744,594.49	58,145,573.58
项目	上年度末 2011年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	578,773,240.42	553,265,420.97	-25,507,819.45
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	38,649,440.00	38,656,000.00
	合计	38,649,440.00	38,656,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	617,422,680.42	591,921,420.97	-25,501,259.45

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
股指期货	40,489,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	40,489,680.00	-	-	-
项目	上年度末 2011年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF1301	IF1301	58	44,150,760.00	3,661,080.00
总额合计				3,661,080.00
减：可抵销期货暂收款				3,661,080.00



股指期货投资净额				0.00
----------	--	--	--	------

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	18,875.83	1,131.75
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,570.19	2,616.79
应收债券利息	-	92,076.50
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	20,446.02	95,825.04

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	808,227.89	993,923.98
银行间市场应付交易费用	-	250.00
合计	808,227.89	994,173.98

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	401.94	2,661.20
应付后端申购费	-	-
债券利息税	-	-
预提费用	160,000.00	280,000.00

银行手续费	-	-
合计	160,401.94	282,661.20

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	831,030,326.29	831,030,326.29
本期申购	21,834,682.79	21,834,682.79
本期赎回（以“-”号填列）	-160,599,684.01	-160,599,684.01
本期末	692,265,325.07	692,265,325.07

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-214,223,695.45	-16,849,266.56	-231,072,962.01
本期利润	-65,795,926.76	87,307,913.03	21,511,986.27
本期基金份额交易产生的变动数	41,612,060.50	-4,146,902.98	37,465,157.52
其中：基金申购款	-6,603,861.40	803,850.66	-5,800,010.74
基金赎回款	48,215,921.90	-4,950,753.64	43,265,168.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-238,407,561.71	66,311,743.49	-172,095,818.22

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
	活期存款利息收入	270,658.20
定期存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	43,078.69	50,551.93
其他存款利息收入	9,179.38	-
其他	6.82	791.84
合计	322,923.09	1,586,969.38

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
	卖出股票成交总额	3,106,104,515.55
减：卖出股票成本总额	3,159,995,928.86	2,891,732,783.16
买卖股票差价收入	-53,891,413.31	-214,521,944.04

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
卖出债券及债券到期兑付 成交总额	39,931,822.68	-
减：卖出债券及债券到期 兑付成本总额	38,649,440.00	-
减：应收利息总额	1,266,972.68	-
债券投资收益	15,410.00	-

**7.4.7.14 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
股指期货投资收益	-708,840.00	-
合计	-708,840.00	-

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,983,349.47	6,816,218.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,983,349.47	6,816,218.04

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
1. 交易性金融资产	83,646,833.03	-26,967,931.47
——股票投资	83,653,393.03	-26,974,491.47
——债券投资	-6,560.00	6,560.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	3,661,080.00	-
——股指期货投资	3,661,080.00	-
3. 其他	-	-
合计	87,307,913.03	-26,967,931.47

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
基金赎回费收入	137,540.46	684,923.04
基金转出费收入	5,782.01	45,293.08
合计	143,322.47	730,216.12

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
交易所市场交易费用	8,881,679.49	8,406,917.05
银行间市场交易费用	175.00	250.00
合计	8,881,854.49	8,407,167.05

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
审计费用	60,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	13,500.00
银行划款手续费	16,773.77	24,321.28
其他	-	900.00
合计	394,773.77	418,721.28

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[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》(以下简称“通知”)，要求个人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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

#### 7.4.9 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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
璟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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	47,009,875.85	0.78%	729,156,373.47	12.34%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	39,841.32	0.84%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	446,612.40	9.67%	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011年12月31日	
当期发生的基金应支付的管理费	8,213,341.11		12,809,355.22	
其中：支付销售机构的客户维护费	2,178,397.85		3,166,251.05	

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×1.5%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,368,890.15		2,134,892.54	

注：支付基金托管人中国建设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×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年12月31日		2011年1月1日至2011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
中国建设银行	94,461,334.46	270,658.20	7,244,154.20	1,535,625.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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
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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	总金额
招商证券	002540	亚太科技	新股网上申购	1,000	40,000.00

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末(2012 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金,属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,力争实现在经济周期和行业景气波动下的资产稳定增值的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导,以风险管理委员会为核心的,由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,董事会负责制定公司的风险管理政策,对风险管理负完全的和最终的责任;在董事会下设立风险管理委员会,负责批准公司风险管理系统文件和批准



每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在此可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2011 年 12 月 31 日：同)。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的



基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市因此均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	94,461,334.46	-	-	-	94,461,334.46
结算备付金	9,143,411.23	-	-	-	9,143,411.23
存出保证金	-	-	-	5,874,652.47	5,874,652.47
交易性金融资产	-	-	-	416,744,594.49	416,744,594.49
应收证券清算款	-	-	-	1,311,353.38	1,311,353.38
应收利息	-	-	-	20,446.02	20,446.02

应收申购款	-	-	-	418,648.55	418,648.55
<b>资产总计</b>	<b>103,604,745.69</b>	-	-	<b>424,369,694.91</b>	<b>527,974,440.60</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	5,939,322.42	5,939,322.42
应付赎回款	-	-	-	180,498.27	180,498.27
应付管理人报酬	-	-	-	614,128.49	614,128.49
应付托管费	-	-	-	102,354.74	102,354.74
应付交易费用	-	-	-	808,227.89	808,227.89
其他负债	-	-	-	160,401.94	160,401.94
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>7,804,933.75</b>	<b>7,804,933.75</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>103,604,745.69</b>	-	-	<b>416,564,761.16</b>	<b>520,169,506.85</b>
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	7,244,154.20	-	-	-	7,244,154.20
结算备付金	5,286,428.65	-	-	-	5,286,428.65
存出保证金	-	-	-	407,362.23	407,362.23
交易性金融资产	38,656,000.00	-	-	553,265,420.97	591,921,420.97
应收利息	-	-	-	95,825.04	95,825.04
应收申购款	-	-	-	6,813.00	6,813.00
<b>资产总计</b>	<b>51,186,582.85</b>	-	-	<b>553,775,421.24</b>	<b>604,962,004.09</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	2,112,252.69	2,112,252.69
应付赎回款	-	-	-	706,137.30	706,137.30
应付管理人报酬	-	-	-	779,498.27	779,498.27
应付托管费	-	-	-	129,916.37	129,916.37
应付交易费用	-	-	-	994,173.98	994,173.98
其他负债	-	-	-	282,661.20	282,661.20
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>5,004,639.81</b>	<b>5,004,639.81</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>51,186,582.85</b>	-	-	<b>548,770,781.43</b>	<b>599,957,364.28</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2011 年 12 月 31 日：6.44%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券等固定收益类证券投资比例为基金资产的 0%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占总期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基金资产比例等法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。本基金的基金管理人在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金的基金管理人还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	416,744,594.49	80.12	553,265,420.97	92.22
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	416,744,594.49	80.12	553,265,420.97	92.22

注：于 2012 年 12 月 31 日，本基金还持有衍生金融工具，具体信息请参考附注 7.4.7.3 衍生金融资产/负债。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1.沪深 300 指数上升 5%	增加约 2,279.00	增加约 2,365.00
	2.沪深 300 指数下降 5%	减少约 2,279.00	减少约 2,365.00

#### 7.4.14 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2012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416,744,594.49元，无属于第二层级及第三层级的余额(2011年12月31日：第一层级537,976,074.61元，第二层级53,945,346.36元，无属于第三层级的余额)。

###### (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	416,744,594.49	78.93
	其中：股票	416,744,594.49	78.93
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	103,604,745.69	19.62
6	其他各项资产	7,625,100.42	1.44
7	合计	527,974,440.60	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	19,409,500.00	3.73
C	制造业	87,016,158.17	16.73
C0	食品、饮料	17,460,000.00	3.36
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,720,000.00	2.06
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	6,193,922.07	1.19
C7	机械、设备、仪表	34,089,236.10	6.55
C8	医药、生物制品	18,553,000.00	3.57
C99	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,368,000.00	1.99
E	建筑业	13,670,000.00	2.63
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	10,544,437.60	2.03
I	金融、保险业	248,130,351.32	47.70
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	9,757,087.50	1.88
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	17,849,059.90	3.43
	合计	416,744,594.49	80.12

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600837	海通证券	4,999,937	51,249,354.25	9.85
2	600016	民生银行	6,000,000	47,160,000.00	9.07
3	601318	中国平安	1,000,933	45,332,255.57	8.71
4	600030	中信证券	3,000,000	40,080,000.00	7.71
5	601601	中国太保	1,500,855	33,769,237.50	6.49
6	600000	浦发银行	1,999,950	19,839,504.00	3.81
7	600546	山煤国际	900,000	18,315,000.00	3.52
8	600805	悦达投资	1,499,921	17,849,059.90	3.43
9	000651	格力电器	699,911	17,847,730.50	3.43
10	300146	汤臣倍健	300,000	17,460,000.00	3.36
11	600535	天士力	300,000	16,581,000.00	3.19
12	300054	鼎龙股份	400,000	10,720,000.00	2.06
13	601628	中国人寿	500,000	10,700,000.00	2.06
14	600031	三一重工	999,980	10,589,788.20	2.04
15	600153	建发股份	1,499,920	10,544,437.60	2.03
16	600886	国投电力	1,800,000	10,368,000.00	1.99
17	000069	华侨城A	1,300,945	9,757,087.50	1.88
18	601668	中国建筑	2,000,000	7,800,000.00	1.50
19	002032	苏泊尔	499,913	6,193,922.07	1.19
20	601186	中国铁建	1,000,000	5,870,000.00	1.13
21	000418	小天鹅A	599,970	5,651,717.40	1.09
22	600750	江中药业	100,000	1,972,000.00	0.38
23	601699	潞安环能	50,000	1,094,500.00	0.21

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	112,730,197.85	18.79
2	601318	中国平安	107,786,248.76	17.97
3	000002	万科 A	95,678,894.52	15.95
4	601601	中国太保	95,596,219.04	15.93
5	600837	海通证券	89,420,605.39	14.90
6	600585	海螺水泥	87,036,727.77	14.51
7	600016	民生银行	76,059,264.66	12.68
8	601628	中国人寿	71,117,985.18	11.85
9	000157	中联重科	69,927,379.88	11.66
10	601377	兴业证券	59,895,693.72	9.98
11	600252	中恒集团	55,671,760.06	9.28
12	000401	冀东水泥	53,106,828.21	8.85
13	600010	包钢股份	48,767,956.18	8.13
14	000338	潍柴动力	42,742,540.37	7.12
15	600881	亚泰集团	42,296,352.88	7.05
16	000425	徐工机械	38,774,111.70	6.46
17	600085	同仁堂	33,511,524.40	5.59
18	000983	西山煤电	32,488,360.57	5.42
19	600031	三一重工	30,801,508.86	5.13
20	601006	大秦铁路	27,903,444.20	4.65
21	601288	农业银行	26,850,000.00	4.48
22	002024	苏宁电器	25,693,245.80	4.28
23	000651	格力电器	24,994,568.71	4.17
24	000537	广宇发展	24,717,347.53	4.12
25	002353	杰瑞股份	24,505,836.25	4.08
26	600111	包钢稀土	24,398,925.59	4.07
27	600535	天士力	24,304,395.62	4.05
28	300146	汤臣倍健	24,065,407.27	4.01
29	600376	首开股份	23,784,680.63	3.96
30	600785	新华百货	23,442,966.92	3.91
31	600060	海信电器	22,366,738.18	3.73
32	000540	中天城投	21,591,999.12	3.60
33	600256	广汇能源	21,569,193.63	3.60
34	600383	金地集团	21,476,407.61	3.58
35	002422	科伦药业	21,352,444.92	3.56
36	002662	京威股份	21,258,858.52	3.54
37	000069	华侨城 A	21,023,074.69	3.50
38	000528	柳工	20,620,524.19	3.44
39	000680	山推股份	20,238,454.29	3.37
40	000858	五粮液	20,163,056.23	3.36
41	600805	悦达投资	20,082,642.39	3.35

42	601166	兴业银行	19,621,929.78	3.27
43	600011	华能国际	18,912,018.09	3.15
44	002304	洋河股份	18,560,708.34	3.09
45	300171	东富龙	18,484,118.92	3.08
46	600000	浦发银行	18,477,047.26	3.08
47	600729	重庆百货	18,302,124.42	3.05
48	002385	大北农	18,090,512.60	3.02
49	000661	长春高新	17,797,169.35	2.97
50	600108	亚盛集团	17,694,407.52	2.95
51	600015	华夏银行	17,466,614.56	2.91
52	600546	山煤国际	17,119,661.82	2.85
53	000527	美的电器	17,083,369.19	2.85
54	300298	三诺生物	16,746,001.10	2.79
55	600066	宇通客车	16,681,675.77	2.78
56	600886	国投电力	16,649,318.68	2.78
57	002570	贝因美	16,642,928.38	2.77
58	600809	山西汾酒	16,642,243.59	2.77
59	000848	承德露露	16,608,727.69	2.77
60	000521	美菱电器	16,318,147.17	2.72
61	002477	雏鹰农牧	16,200,522.34	2.70
62	600750	江中药业	15,778,202.99	2.63
63	600028	中国石化	15,679,281.66	2.61
64	000602	金马集团	15,582,305.69	2.60
65	600739	辽宁成大	15,416,493.92	2.57
66	600674	川投能源	15,249,553.62	2.54
67	000970	中科三环	15,225,447.08	2.54
68	000937	冀中能源	15,018,896.80	2.50
69	002116	中国海诚	14,894,859.30	2.48
70	601311	骆驼股份	14,606,404.31	2.43
71	300054	鼎龙股份	14,525,637.32	2.42
72	002378	章源钨业	14,519,878.22	2.42
73	600104	上汽集团	14,326,884.00	2.39
74	601688	华泰证券	14,208,512.48	2.37
75	600315	上海家化	14,091,616.35	2.35
76	600519	贵州茅台	13,850,997.66	2.31
77	000895	双汇发展	13,576,373.96	2.26
78	002294	信立泰	13,556,374.73	2.26
79	300003	乐普医疗	13,346,661.90	2.22
80	601699	潞安环能	13,230,143.72	2.21
81	600322	天房发展	13,183,450.86	2.20
82	000423	东阿阿胶	13,039,533.30	2.17
83	600827	友谊股份	12,892,353.77	2.15



84	601336	新华保险	12,483,806.77	2.08
85	600801	华新水泥	12,458,292.87	2.08
86	600694	大商股份	12,290,268.30	2.05
87	000568	泸州老窖	12,223,775.02	2.04

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	120,155,743.13	20.03
2	601628	中国人寿	105,730,146.64	17.62
3	600585	海螺水泥	85,342,262.35	14.22
4	600030	中信证券	78,845,522.86	13.14
5	000157	中联重科	73,306,791.35	12.22
6	601318	中国平安	69,975,752.64	11.66
7	601601	中国太保	64,985,349.49	10.83
8	600028	中国石化	61,312,863.44	10.22
9	600252	中恒集团	57,807,621.79	9.64
10	000401	冀东水泥	57,341,409.40	9.56
11	601377	兴业证券	55,212,837.65	9.20
12	600016	民生银行	51,486,997.45	8.58
13	601006	大秦铁路	50,701,773.67	8.45
14	600010	宝钢股份	48,489,008.35	8.08
15	600031	三一重工	47,823,421.37	7.97
16	600085	同仁堂	46,250,653.24	7.71
17	000338	潍柴动力	43,428,926.55	7.24
18	600837	海通证券	43,060,097.27	7.18
19	600881	亚泰集团	41,039,095.60	6.84
20	601288	农业银行	41,023,821.08	6.84
21	002353	杰瑞股份	39,878,366.84	6.65
22	000425	徐工机械	38,717,097.05	6.45
23	000983	西山煤电	37,216,522.55	6.20
24	600011	华能国际	35,920,073.87	5.99
25	600050	中国联通	34,985,937.70	5.83
26	601166	兴业银行	34,779,603.16	5.80
27	600694	大商股份	32,067,707.94	5.34
28	000423	东阿阿胶	31,289,062.59	5.22
29	600015	华夏银行	31,220,980.24	5.20
30	002051	中工国际	30,507,734.59	5.08
31	600519	贵州茅台	28,927,026.25	4.82
32	601933	永辉超市	27,085,715.29	4.51
33	002385	大北农	26,829,584.43	4.47

34	600111	包钢稀土	26,795,025.37	4.47
35	600535	天士力	26,702,099.98	4.45
36	601311	骆驼股份	26,228,083.64	4.37
37	002024	苏宁电器	26,052,632.05	4.34
38	000069	华侨城 A	25,177,963.75	4.20
39	600809	山西汾酒	23,867,675.20	3.98
40	600376	首开股份	23,316,645.55	3.89
41	000537	广宇发展	23,072,970.83	3.85
42	600256	广汇能源	22,924,220.16	3.82
43	300298	三诺生物	22,166,813.77	3.69
44	000639	西王食品	21,389,455.22	3.57
45	600060	海信电器	21,338,606.54	3.56
46	002422	科伦药业	21,004,095.91	3.50
47	600048	保利地产	20,939,318.69	3.49
48	002662	京威股份	20,921,489.33	3.49
49	600383	金地集团	20,760,133.18	3.46
50	000680	山推股份	20,633,624.54	3.44
51	600785	新华百货	20,296,121.85	3.38
52	000661	长春高新	20,288,322.19	3.38
53	002299	圣农发展	20,054,663.55	3.34
54	000528	柳工	19,786,288.69	3.30
55	600108	亚盛集团	19,717,418.42	3.29
56	000540	中天城投	19,533,761.72	3.26
57	601100	恒立油缸	19,156,888.72	3.19
58	300171	东富龙	18,097,050.20	3.02
59	600729	重庆百货	17,552,305.21	2.93
60	000527	美的电器	17,351,272.51	2.89
61	002304	洋河股份	17,327,777.80	2.89
62	000858	五粮液	16,949,109.71	2.83
63	002477	雏鹰农牧	16,747,031.30	2.79
64	000521	美菱电器	16,203,491.82	2.70
65	000895	双汇发展	16,073,132.16	2.68
66	600066	宇通客车	15,689,461.15	2.62
67	600674	川投能源	15,599,371.11	2.60
68	601398	工商银行	15,455,000.00	2.58
69	000848	承德露露	15,444,397.43	2.57
70	600315	上海家化	14,973,269.98	2.50
71	000970	中科三环	14,973,179.13	2.50
72	600104	上汽集团	14,903,815.47	2.48
73	600739	辽宁成大	14,655,787.31	2.44
74	002294	信立泰	14,581,326.33	2.43
75	600027	华电国际	14,388,212.00	2.40

76	002570	贝因美	14,336,937.62	2.39
77	000937	冀中能源	14,253,420.49	2.38
78	000602	金马集团	14,247,331.31	2.37
79	600322	天房发展	13,751,088.59	2.29
80	600827	友谊股份	13,003,756.98	2.17
81	601336	新华保险	12,804,010.13	2.13
82	600009	上海机场	12,797,242.64	2.13
83	000729	燕京啤酒	12,692,183.83	2.12
84	601688	华泰证券	12,605,815.10	2.10
85	002378	章源钨业	12,580,746.16	2.10
86	002116	中国海诚	12,485,405.38	2.08
87	000651	格力电器	12,323,721.92	2.05
88	300003	乐普医疗	12,302,694.70	2.05
89	601699	潞安环能	12,150,499.11	2.03

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,939,821,709.35
卖出股票的收入（成交）总额	3,106,104,515.55

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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债券。

#### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

#### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,874,652.47
2	应收证券清算款	1,311,353.38
3	应收股利	-
4	应收利息	20,446.02
5	应收申购款	418,648.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,625,100.42

#### 8.9.4 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。

#### 8.9.5 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。

#### 8.9.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
14,614	47,370.01	58,589,480.30	8.46%	633,675,844.77	91.54%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	988.28	0.0001%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年12月10日)基金份额总额	1,400,439,291.65
----------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	831,030,326.29
本报告期基金总申购份额	21,834,682.79
减：本报告期基金总赎回份额	160,599,684.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	692,265,325.07

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1) 基金管理人于 2012 年 8 月 14 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，杨锐先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。2) 基金管理人于 2012 年 9 月 15 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，李雪松先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

2012 年 11 月 15 日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕961 号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2012〕1036 号）。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 60,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	222,760,111.90	3.68%	189,346.73	3.99%	-

高华证券	1	351,829,022.89	5.82%	288,014.03	6.07%	新增 1 个
长城证券	1	739,622,725.42	12.23%	525,419.64	11.07%	新增 1 个
长江证券	1	42,017,946.10	0.69%	35,715.51	0.75%	-
东方证券	2	517,319,329.25	8.56%	329,342.28	6.94%	新增 1 个
大通证券	1	120,781,040.52	2.00%	82,910.81	1.75%	-
国泰君安	2	138,762,090.53	2.30%	124,113.59	2.62%	-
海通证券	1	346,560,761.02	5.73%	233,913.72	4.93%	新增 1 个
中投证券	2	1,210,812,898.56	20.03%	1,015,408.48	21.40%	-
瑞银证券	1	174,381,730.19	2.88%	148,225.37	3.12%	新增 1 个
山西证券	2	1,507,132,867.42	24.93%	1,282,398.79	27.03%	-
中金公司	1	42,538,762.10	0.70%	37,642.47	0.79%	新增 1 个
招商证券	1	47,009,875.85	0.78%	39,841.32	0.84%	新增 1 个
中信建投	1	123,075,194.73	2.04%	106,420.83	2.24%	-
中信证券	2	461,321,868.42	7.63%	305,757.77	6.44%	新增 2 个
申银万国	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时旗下部分基金参加工商银行定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-12-31
2	博时旗下部分基金参加东莞银行网银申购费率和定期定额申购费率	中国证券报、	2012-12-28



	优惠活动的公告	上海证券报、 证券时报	
3	关于博时旗下部分基金参加浙商银行网银及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-12-28
4	关于博时旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司定投及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-12-28
5	关于博时旗下部分基金增加上海天天基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-12-28
6	关于博时旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司非现场交易费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-12-20
7	关于博时旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-12-20
8	关于直销网上交易系统工商银行网上支付切换为协议代扣模式的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-12-17
9	关于博时旗下部分基金参加中国银行网银、定投业务及手机银行费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-30
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-28
11	关于博时旗下部分基金增加杭州数米基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-16
12	关于博时旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司定投及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-16
13	关于博时旗下部分基金增加长量基金销售公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-9
14	关于博时旗下部分基金参加长量基金销售公司非现场交易费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-9
15	关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通广发银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-5
16	博时基金管理有限公司关于添利宝业务开通工商银行借记卡的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-11-5

17	博时基金管理有限公司关于开通直销网上交易添利宝业务的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-10-30
18	关于博时旗下部分基金增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-10-30
19	关于博时旗下部分基金参加众禄基金销售公司网银申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-10-30
20	关于博时旗下部分基金参加展恒基金销售公司非现场交易费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-10-29
21	关于博时旗下部分基金增加温州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-10-26
22	关于博时旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-10-18
23	关于博时公司旗下部分基金增加东海证券为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-10-11
24	关于博时旗下部分基金增加北京展恒基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-9-28
25	关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国银行、交通银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-9-21
26	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-9-21
27	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-9-13
28	关于博时基金参加河北银行网银申购和定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-9-8
29	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的“11 国债 13”估值方法变更的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-9-1
30	关于博时旗下部分基金增加江阴农村商业银行作为代销机构的公告	中国证券报、 上海证券报、 证券时报	2012-8-28
31	博时基金管理有限公司关于和中国银行合作进行直销网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 上海证券报、	2012-8-15

		证券时报	
32	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加嘉兴银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-8-1
33	博时基金管理有限公司关于直销手机交易和电话交易业务新增使用中国邮政储蓄银行、中国农业银行借记卡和招行 i 理财账户、支付宝基金专户进行支付的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-30
34	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增西部证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-13
35	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加江苏常熟农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-7-12
36	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司网上及手机银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-29
37	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加江苏银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-29
38	关于开通机构直销网上交易业务和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-25
39	博时基金管理有限公司关于开通中国银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-11
40	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-8
41	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加金华银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-6-5
42	博时基金管理有限公司成都分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-25
43	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加重庆银行股份有限公司网上银行申购费率与定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-22
44	博时基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-15
45	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国邮政储蓄银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-5-2

46	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-30
47	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加江苏银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-30
48	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国建设银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-3-12
49	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司电子渠道申购费率与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-1-16
50	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国农业银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-1-9
51	博时基金管理有限公司关于直销投资者汇款交易业务规则变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-1-4
52	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行股份有限公司网上银行申购费率和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-1-4

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自2012年1月16日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日, 根据工作需要, 中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时行业轮动股票型证券投资基金设立的文件

13.1.2 《博时行业轮动股票型证券投资基金基金合同》

13.1.3 《博时行业轮动股票型证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 博时行业轮动股票型证券投资基金各年度审计报告正本

13.1.6 报告期内博时行业轮动股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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

客户服务中心电话：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

2013 年 3 月 26 日