

# 博时行业轮动股票型证券投资基金

## 2013 年年度摘要

### 2013 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：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。

基金托管人中国建设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	500,611,072.39 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

### 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	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
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	73,658,451.90	-65,795,926.76	-228,973,965.97
本期利润	27,153,879.87	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
本期加权平均净值利润率	5.42%	3.94%	-30.26%
本期基金份额净值增长率	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	-118,046,816.68	-238,407,561.71	-231,072,962.01
期末可供分配基金份额利润	-0.2358	-0.3444	-0.2781
期末基金资产净值	391,462,107.56	520,169,506.85	599,957,364.28
期末基金份额净值	0.782	0.751	0.722
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	-21.80%	-24.90%	-27.80%

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	-6.68%	1.14%	-3.04%	0.90%	-3.64%	0.24%
过去六个月	1.30%	1.14%	3.96%	1.03%	-2.66%	0.11%
过去一年	4.13%	1.24%	-6.22%	1.12%	10.35%	0.12%
过去三年	-21.80%	1.15%	-19.23%	1.06%	-2.57%	0.09%
自基金合同生效起至今	-21.80%	1.13%	-19.06%	1.06%	-2.74%	0.07%

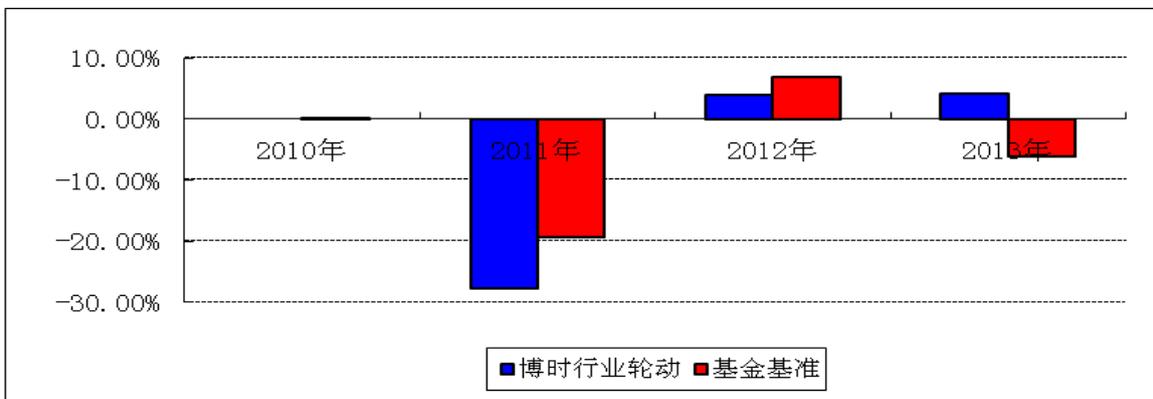
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80% + 中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

#### 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，同时启动末日比例配售，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) 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
		任职日期	离任日期		
刘建伟	基金经理	2010-12-10	-	9	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，上半年的操作比较成功，行业结构和个股选择都有较好收益。下半年基本维持了行业结构。

##### 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 0.782 元，累计净值为 0.782 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 4.13%，同期业绩基准增长率为-6.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年是经济发展模式开始调整最为重要的年份，许多行业都会面对突破性发展或趋势性下降的考验，影响宏观变量不确定性的维度在增加，但主导趋势会日益明晰。同时，新股市场化发行也会带来许多变数。在这种背景下，股市的新主导结构开始形成，各个行业估值中枢会不断进行调整修正。行业和个体公司的成长空间和发展模式会成为我们选股最重要的标准，希望能够分享驱动未来中国经济转型发展的领先企业市值成长的收益。

#### 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

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

本报告已经普华永道中天会计师事务所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：博时行业轮动股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	4,775,391.53	94,461,334.46
结算备付金	20,033,375.37	9,143,411.23
存出保证金	416,734.38	5,874,652.47
交易性金融资产	347,125,901.77	416,744,594.49
其中：股票投资	317,335,901.77	416,744,594.49
基金投资	-	-
债券投资	29,790,000.00	-
资产支持证券投资	-	-

衍生金融资产	-	0.00
买入返售金融资产	20,000,000.00	-
应收证券清算款	23,599,903.29	1,311,353.38
应收利息	265,974.59	20,446.02
应收股利	-	-
应收申购款	711,682.04	418,648.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	416,928,962.97	527,974,440.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2013年12月31日</b>	<b>2012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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	5,939,322.42
应付赎回款	23,952,587.14	180,498.27
应付管理人报酬	521,832.59	614,128.49
应付托管费	86,972.10	102,354.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	745,198.64	808,227.89
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,264.94	160,401.94
负债合计	25,466,855.41	7,804,933.75
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	500,611,072.39	692,265,325.07
未分配利润	-109,148,964.83	-172,095,818.22
所有者权益合计	391,462,107.56	520,169,506.85
负债和所有者权益总计	416,928,962.97	527,974,440.60

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.782 元，基金份额总额 500,611,072.39 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：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	43,223,442.97	40,370,845.79

1. 利息收入	2,353,462.41	1,521,104.13
其中：存款利息收入	303,021.93	322,923.09
债券利息收入	1,493,599.90	1,174,896.18
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	556,840.58	23,284.86
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	87,112,540.89	-48,601,493.84
其中：股票投资收益	74,194,814.25	-53,891,413.31
基金投资收益	-	-
债券投资收益	809,778.42	15,410.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	9,164,220.00	-708,840.00
股利收益	2,943,728.22	5,983,349.47
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-46,504,572.03	87,307,913.03
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	262,011.70	143,322.47
<b>减：二、费用</b>	<b>16,069,563.10</b>	<b>18,858,859.52</b>
1. 管理人报酬	7,545,913.67	8,213,341.11
2. 托管费	1,257,652.29	1,368,890.15
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,876,089.20	8,881,854.49
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	389,907.94	394,773.77
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>27,153,879.87</b>	<b>21,511,986.27</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>27,153,879.87</b>	<b>21,511,986.27</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：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)	692,265,325.07	-172,095,818.22	520,169,506.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,153,879.87	27,153,879.87
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)	-191,654,252.68	35,792,973.52	-155,861,279.16
其中：1. 基金申购款	88,958,460.12	-17,626,950.31	71,331,509.81
2. 基金赎回款	-280,612,712.80	53,419,923.83	-227,192,788.97

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)	500,611,072.39	-109,148,964.83	391,462,107.56
<b>项目</b>	<b>上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日</b>		
	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>所有者权益合计</b>
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

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：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[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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，应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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(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。

### 7.4.4 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	601,831,216.51	12.83%	47,009,875.85	0.78%

##### 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	547,909.49	14.11%	228,124.96	30.62%
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	39,841.32	0.84%	-	-

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。

#### 7.4.4.2 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	7,545,913.67	8,213,341.11
其中：支付销售机构的客户维护费	2,053,995.27	2,178,397.85

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	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	1,257,652.29	1,368,890.15

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。

#### 7.4.4.3 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
中国建设银行	4,775,391.53	196,421.13	94,461,334.46	270,658.20

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。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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

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317,335,901.77元，属于第二层级的余额为29,790,000.00元，无属于第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级416,744,594.49元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(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	317,335,901.77	76.11
	其中：股票	317,335,901.77	76.11

2	固定收益投资	29,790,000.00	7.15
	其中：债券	29,790,000.00	7.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,000.00	4.80
	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	24,808,766.90	5.95
6	其他资产	24,994,294.30	5.99
7	合计	416,928,962.97	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	采矿业	-	-
C	制造业	261,103,846.96	66.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,803,831.66	3.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,428,223.15	11.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	317,335,901.77	81.06

## 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300146	汤臣倍健	520,000	37,902,800.00	9.68
2	000538	云南白药	200,911	20,490,912.89	5.23
3	002236	大华股份	499,702	20,427,817.76	5.22
4	600887	伊利股份	499,992	19,539,687.36	4.99
5	000895	双汇发展	399,822	18,823,619.76	4.81

6	002148	北纬通信	399,885	18,190,768.65	4.65
7	600066	宇通客车	1,000,948	17,576,646.88	4.49
8	600867	通化东宝	1,091,917	16,717,249.27	4.27
9	600597	光明乳业	700,901	15,560,002.20	3.97
10	002501	利源精制	1,099,996	15,410,943.96	3.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

## 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	601166	兴业银行	101,012,910.37	19.42
2	600016	民生银行	89,753,604.93	17.25
3	600066	宇通客车	70,391,339.87	13.53
4	600315	上海家化	60,639,124.02	11.66
5	600837	海通证券	59,313,678.46	11.40
6	600887	伊利股份	53,031,067.87	10.19
7	000002	万科 A	52,239,654.74	10.04
8	000800	一汽轿车	50,723,653.10	9.75
9	600519	贵州茅台	48,900,719.94	9.40
10	000895	双汇发展	45,958,236.70	8.84
11	600000	浦发银行	45,796,997.51	8.80
12	002008	大族激光	40,027,258.73	7.70
13	002236	大华股份	37,385,108.75	7.19
14	000001	平安银行	35,318,574.84	6.79
15	002148	北纬通信	34,477,816.00	6.63
16	002353	杰瑞股份	34,432,760.12	6.62
17	600108	亚盛集团	33,997,178.22	6.54
18	600079	人福医药	33,195,714.03	6.38
19	002241	歌尔声学	32,672,005.91	6.28
20	600597	光明乳业	32,095,443.65	6.17
21	600332	白云山	31,840,763.54	6.12
22	300212	易华录	31,355,046.96	6.03
23	000400	许继电气	31,026,826.85	5.96
24	002221	东华能源	30,478,145.59	5.86
25	000063	中兴通讯	29,135,233.71	5.60
26	601788	光大证券	28,100,307.93	5.40
27	000651	格力电器	26,378,996.03	5.07
28	600867	通化东宝	24,563,460.51	4.72
29	002038	双鹭药业	24,432,975.65	4.70
30	000725	京东方 A	24,402,902.36	4.69

31	002501	利源精制	24,139,435.02	4.64
32	300251	光线传媒	23,808,669.45	4.58
33	600030	中信证券	23,565,120.02	4.53
34	600570	恒生电子	22,574,792.78	4.34
35	002250	联化科技	21,802,310.15	4.19
36	000538	云南白药	21,366,678.91	4.11
37	600276	恒瑞医药	20,865,257.85	4.01
38	600383	金地集团	20,781,226.81	4.00
39	000999	华润三九	20,559,774.58	3.95
40	600196	复星医药	19,766,685.84	3.80
41	600256	广汇能源	19,196,763.15	3.69
42	600518	康美药业	18,914,940.69	3.64
43	300104	乐视网	18,213,271.79	3.50
44	002005	德豪润达	17,072,525.31	3.28
45	000858	五粮液	16,753,936.42	3.22
46	601633	长城汽车	15,869,993.14	3.05
47	000539	粤电力 A	15,709,164.33	3.02
48	000661	长春高新	14,778,598.66	2.84
49	002205	国统股份	14,414,910.03	2.77
50	600406	国电南瑞	14,229,251.08	2.74
51	000977	浪潮信息	13,913,332.00	2.67
52	601318	中国平安	13,802,285.29	2.65
53	600750	江中药业	13,791,004.56	2.65
54	300124	汇川技术	13,624,403.14	2.62
55	000561	烽火电子	13,573,268.14	2.61
56	002022	科华生物	13,497,066.15	2.59
57	600739	辽宁成大	13,359,180.62	2.57
58	601989	中国重工	13,348,428.40	2.57
59	600372	中航电子	12,993,059.86	2.50
60	000732	泰禾集团	12,946,187.58	2.49
61	000917	电广传媒	12,662,078.50	2.43
62	601965	中国汽研	12,579,360.91	2.42
63	000568	泸州老窖	12,144,061.36	2.33
64	000876	新希望	11,902,879.43	2.29
65	600637	百视通	11,897,435.38	2.29
66	600387	海越股份	11,751,593.34	2.26
67	600690	青岛海尔	11,544,877.07	2.22
68	600809	山西汾酒	11,329,215.70	2.18
69	000069	华侨城 A	11,112,296.86	2.14
70	002565	上海绿新	10,935,594.63	2.10
71	601933	永辉超市	10,764,283.43	2.07
72	002426	胜利精密	10,648,148.86	2.05

73	601117	中国化学	10,577,112.74	2.03
74	600048	保利地产	10,573,235.69	2.03
75	600855	航天长峰	10,523,348.76	2.02
76	002023	海特高新	10,450,335.13	2.01

注：本项“买入金额”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	600016	民生银行	139,671,585.89	26.85
2	600837	海通证券	109,982,630.31	21.14
3	601166	兴业银行	100,204,679.72	19.26
4	600030	中信证券	69,111,363.45	13.29
5	600000	浦发银行	63,825,840.29	12.27
6	600315	上海家化	61,389,067.42	11.80
7	601318	中国平安	58,472,271.84	11.24
8	600066	宇通客车	53,111,451.50	10.21
9	000800	一汽轿车	48,798,664.36	9.38
10	000002	万科 A	47,052,824.64	9.05
11	600519	贵州茅台	46,344,883.60	8.91
12	000651	格力电器	44,760,336.01	8.60
13	600108	亚盛集团	44,659,832.38	8.59
14	600887	伊利股份	43,251,428.95	8.31
15	002008	大族激光	40,621,067.81	7.81
16	601601	中国太保	37,934,100.38	7.29
17	000001	平安银行	35,585,857.02	6.84
18	002353	杰瑞股份	34,202,699.08	6.58
19	600332	白云山	31,732,613.70	6.10
20	000063	中兴通讯	30,568,806.02	5.88
21	000400	许继电气	29,714,660.88	5.71
22	000895	双汇发展	29,274,279.97	5.63
23	002038	双鹭药业	28,204,539.98	5.42
24	002221	东华能源	26,334,473.65	5.06
25	601788	光大证券	23,849,868.61	4.59
26	600079	人福医药	23,831,730.96	4.58
27	000725	京东方 A	23,742,203.20	4.56
28	002236	大华股份	23,397,552.28	4.50
29	300251	光线传媒	22,806,698.68	4.38
30	600535	天士力	22,791,090.43	4.38
31	600196	复星医药	22,276,079.32	4.28
32	600256	广汇能源	22,002,535.41	4.23
33	600383	金地集团	21,646,505.34	4.16

34	002250	联化科技	21,064,577.06	4.05
35	000999	华润三九	20,910,898.45	4.02
36	600276	恒瑞医药	20,838,689.30	4.01
37	601628	中国人寿	20,597,149.55	3.96
38	002241	歌尔声学	20,506,778.81	3.94
39	600518	康美药业	19,427,722.81	3.73
40	000069	华侨城 A	19,289,441.32	3.71
41	300212	易华录	19,080,113.46	3.67
42	600546	山煤国际	18,337,423.95	3.53
43	600597	光明乳业	18,153,207.50	3.49
44	600805	悦达投资	17,349,988.16	3.34
45	300104	乐视网	17,306,262.41	3.33
46	000661	长春高新	16,749,401.51	3.22
47	000858	五粮液	16,526,810.38	3.18
48	601633	长城汽车	15,842,721.13	3.05
49	600750	江中药业	15,192,344.74	2.92
50	002005	德豪润达	15,146,778.47	2.91
51	002148	北纬通信	14,897,783.52	2.86
52	002022	科华生物	14,891,964.96	2.86
53	600153	建发股份	14,863,847.67	2.86
54	000539	粤电力 A	14,787,697.04	2.84
55	002205	国统股份	13,863,711.87	2.67
56	000917	电广传媒	13,519,428.91	2.60
57	600690	青岛海尔	13,280,746.11	2.55
58	000561	烽火电子	13,180,098.08	2.53
59	601989	中国重工	12,768,223.46	2.45
60	300054	鼎龙股份	12,647,197.66	2.43
61	300027	华谊兄弟	12,300,000.00	2.36
62	600372	中航电子	12,223,761.88	2.35
63	000977	浪潮信息	12,209,810.50	2.35
64	600406	国电南瑞	12,186,207.09	2.34
65	300315	掌趣科技	12,066,557.26	2.32
66	000732	泰禾集团	11,973,550.04	2.30
67	600809	山西汾酒	11,814,534.31	2.27
68	000568	泸州老窖	11,693,884.53	2.25
69	600637	百视通	11,682,260.62	2.25
70	601668	中国建筑	11,370,000.00	2.19
71	601928	凤凰传媒	11,328,908.18	2.18
72	300146	汤臣倍健	11,290,235.41	2.17
73	002023	海特高新	11,212,581.07	2.16
74	600570	恒生电子	11,010,702.90	2.12
75	600048	保利地产	10,802,536.00	2.08

76	600387	海越股份	10,777,068.66	2.07
77	601965	中国汽研	10,682,695.61	2.05
78	600886	国投电力	10,665,598.71	2.05
79	000418	小天鹅 A	10,552,817.88	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	2,287,421,591.55
卖出股票的收入（成交）总额	2,418,178,156.49

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,790,000.00	7.61
	其中：政策性金融债	29,790,000.00	7.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	29,790,000.00	7.61

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130243	13 国开 43	300,000	29,790,000.00	7.61

#### 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证券。

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	套保交易盈亏

公允价值变动总额合计（元）	
股指期货投资本期收益（元）	9,164,220.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）	

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

投资政策：本基金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。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

### 8.11.3 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	416,734.38
2	应收证券清算款	23,599,903.29
3	应收股利	-
4	应收利息	265,974.59
5	应收申购款	711,682.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,994,294.30

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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中不存在流通受限情况。

### 8.11.6 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
11,871	42,170.93	4,951,735.93	0.99%	495,659,336.46	99.01%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	0.00

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究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	692,265,325.07
本报告期基金总申购份额	88,958,460.12
减：本报告期基金总赎回份额	280,612,712.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	500,611,072.39

## § 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 2013 年 6 月 1 日发布《博

时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，何宝先生不再担任公司总经理职务，由公司董事长杨鹞女士代任公司总经理职务。2) 基金管理人于 2013 年 7 月 26 日发布《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴姚东先生担任公司总经理职务。

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知, 聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 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 60000 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

2013年9月3日, 中国证监会向我司下发了《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》, 责令我司进行为期6个月的整改, 深圳证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此我司高度重视, 对公司内部控制和风险管理工作进行了全面梳理, 彻底排查业务中存在的风险隐患, 针对性的制定、实施整改措施, 进而提升了公司内部控制和风险管理的能力, 目前公司已经完成相关整改工作并向中国证监会及深圳证监局提交了整改完成报告, 监管部门进行了整改完成的现场检查。除上述情况外, 本报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
中信证券	2	1,078,290,948.03	22.98%	981,676.84	25.27%	新增 1 个
中金公司	1	811,949,676.80	17.30%	732,436.37	18.86%	
招商证券	1	601,831,216.51	12.83%	547,909.49	14.11%	
长城证券	1	596,059,033.76	12.70%	423,438.68	10.90%	
东方证券	3	406,223,509.65	8.66%	286,087.12	7.37%	新增 1 个
东海证券	1	292,390,472.54	6.23%	207,712.24	5.35%	新增 1 个
东北证券	1	159,248,038.46	3.39%	113,117.90	2.91%	新增 1 个
中信建投	1	157,197,390.30	3.35%	143,110.88	3.68%	

爱建证券	1	146,516,601.49	3.12%	104,085.23	2.68%	
瑞银证券	1	145,976,879.40	3.11%	132,897.24	3.42%	
信达证券	1	130,387,070.36	2.78%	92,628.13	2.38%	新增 1 个
东兴证券	1	79,123,242.64	1.69%	56,208.95	1.45%	新增 1 个
海通证券	1	72,985,752.67	1.56%	49,988.07	1.29%	
银河证券	1	14,100,915.43	0.30%	12,837.78	0.33%	新增 1 个
渤海证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	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。

博时基金管理有限公司

2014 年 3 月 29 日