

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
报告送出日期:2012年3月28日
重要提示
基金管理人承诺:本基金不存在虚假记载、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法律责任。

博时平衡配置混合型证券投资基金

2011年度报告摘要

2011年12月31日

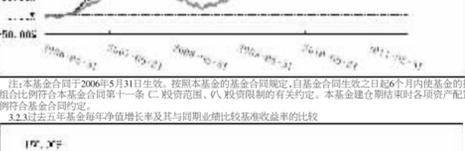
2.1基金基本情况
基金名称:博时平衡配置混合
基金代码:050007
基金简称:博时平衡配置混合

2.2基金产品说明
基金的投资目标:本基金力争在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。
基金的投资策略:本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略,通过定性定量分析,动态调整资产配置比例,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。

2.3基金管理人相关信息
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
基金销售机构:博时基金销售有限公司

3.1主要会计数据和财务指标
2011年 2010年 2009年
本期利润总额:413,645,017.47
本期净利润:382,463,279.69

3.2基金净值表现
基金份额净值:1.056
基金份额累计净值:1.152
业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%



3.3过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比
2011年:1.36%
2010年:2.18%
2009年:3.54%

4.1基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.2基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.3基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.4基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.5基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.6基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.7基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.8基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.9基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

4.10基金管理人及其管理基金的情况
基金管理人:博时基金管理有限公司
基金管理人简介:博时基金管理有限公司成立于1998年6月26日,是经中国证监会批准设立,注册总资本为一亿元人民币。

截至2011年12月31日,本基金份额净值为0.773元,份额累计净值为2.188元。报告期内,本基金份额净值增长率为-28.55%,同期业绩基准增长率为-10.50%。
4.5管理人对于宏观经济、证券市场和行业走势的高要展望
展望未来,世界经济持续增长的动力,以及中国经济持续增长的新模式,目前仍未清晰。过去三十年每年10%的GDP增长速度,在中国成为第二大经济体后将会受到增长的压力,我们预期,经济增速下降是一个长期过程,对经济增速下降的幅度在短期内可能较大,但中长期来看,世界经济危机的影响,仍需要大量的货币刺激,中国的通胀压力缓解后,流动性也会有实质性改善。过量的货币带来的资产领域的投资机会,仍然是对冲经济结构调整的主要工具。

过去三年,我们经历了经济结构的调整,经济增速回落,但经济重回旧增长模式已经消失,未来,需要新的经济增长模式,政府管理经济的体制也应对市场的模式创新,继续寻找新的经济增长点和新兴产业,寻找新的成长空间,这是2012年乃至未来若干年的努力方向。
4.6管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人,为规范基金估值工作,特制定法律法规和基金合同,确保基金估值的公平、合理,有效保护基金份额持有人的利益,设立了博时基金估值委员会(以下简称“估值委员会”),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由首席财务官、首席风控官、首席运营官、首席合规官、首席法律事务负责人等组成,估值委员会成员均具备相应的专业知识和专业技能,具备较好的专业素质和责任心。估值委员会的职责主要包括:制定基金估值的公平、合理、可复制的估值政策和程序,确保估值政策和程序的一致性和连续性;定期评估估值政策和程序的适用性;对估值政策和程序进行修订等。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的协议。
4.7管理人对于报告期内基金利润分配政策的说明
本基金管理人,在符合法律法规的前提下,本基金收益每年至少分配一次,最多为四次,年度收益分配比例不低于基金可分配收益的60%。基金合同规定,本基金收益分配,在符合法律法规的前提下,本基金管理人有权根据基金资产净值、基金收益、基金费用等因素,对基金收益分配比例进行调整。本基金管理人有权根据基金资产净值、基金收益、基金费用等因素,对基金收益分配比例进行调整。本基金管理人有权根据基金资产净值、基金收益、基金费用等因素,对基金收益分配比例进行调整。

7.1资产负债表
单位:人民币元
资产:
货币资金:311,880,382.02
结算备付金:3,536,937.02
银行存款:1,499,132.97
其他货币资金:1,647,178,081.21

7.2利润表
单位:人民币元
营业收入:922,055,735.41
公允价值变动收益:1,206,093,477.69
其他业务收入:18,644,375.67
其他收益:1,499,132.97
其他综合收益:1,647,178,081.21

7.3所有者权益表
单位:人民币元
所有者权益:1,206,093,477.69
其他所有者权益:18,644,375.67
其他综合收益:1,499,132.97
其他权益:1,647,178,081.21

7.4现金流量表
单位:人民币元
经营活动产生的现金流量:1,206,093,477.69
投资活动产生的现金流量:18,644,375.67
筹资活动产生的现金流量:1,499,132.97
其他现金流量:1,647,178,081.21

7.5投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.6投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.7投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.8投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.9投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.10投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.11投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.12投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.13投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.14投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

7.15投资组合报告
截至2011年12月31日,本基金资产组合情况如下:
股票投资:855,362,572.95
债券投资:1,206,093,477.69
其他资产:18,644,375.67

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
7.4.4.1.2权证交易
7.4.4.1.3债券交易
7.4.4.1.4其他关联交易

7.4.4.1.1股票交易
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.1.2权证交易
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.1.3债券交易
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.1.4其他关联交易
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.2关联方资金往来
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.3关联方担保
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.4关联方应收应付款项
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.5关联方委托理财
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.6关联方委托贷款
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.7关联方委托投资
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.8关联方委托管理
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.9关联方委托销售
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.10关联方委托其他
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.11关联方委托其他
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.12关联方委托其他
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.13关联方委托其他
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

7.4.4.14关联方委托其他
单位:人民币元
日期:2011年1月1日至2011年12月31日
2010年1月1日至2010年12月31日
2009年1月1日至2009年12月31日

基金单位:人民币元
基金名称:博时平衡配置混合
基金代码:050007
基金简称:博时平衡配置混合

基金单位:人民币元
基金名称:博时平衡配置混合
基金代码:050007
基金简称:博时平衡配置混合