博时第三产业成长股票证券投资基金

2012 年度 报告摘要

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年3月26日

§1重要提示

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。

基金托管人中国工商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2012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	博时第三产业股票
基金主代码	050008
交易代码	050008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年4月12日
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
报告期末基金份额总额	6,480,424,122.19份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	基于我国第三产业的快速发展壮大及其战略地位,本基金以高速增长的第三产业集群企业为主要投资对象,通过深入研究并积极投资,力争为基金持有人获得超越于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过"自上而下"的宏观分析,以及定性分析与定量分析相补充的方法,在股票、债券和现金等资产类之间进行配置。
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	本基金是一只积极主动管理的股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	赵会军
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798

2.4信息披露方式

登载基金年度报告摘要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

§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
本期已实现收益	-128,941,366.25	-594,086,265.94	2,009,552,764.81
本期利润	637,230,166.09	-1,047,094,203.84	-339,846,982.27
加权平均基金份额本期利润	0.0963	-0.1467	-0.0383
本期加权平均净值利润率	10.00%	-14.41%	-3.55%
3.1.2期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.2536	0.2731	0.3583
期末基金资产净值	6,675,243,513.63	6,307,071,564.63	8,437,960,376.00
期末基金份额净值	1.030	0.934	1.083

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

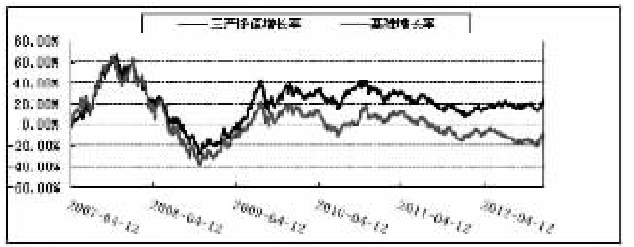
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.86%	0.76%	8.15%	1.02%	-2.29%	-0.26%
过去六个月	5.53%	0.77%	2.18%	0.99%	3.35%	-0.22%
过去一年	10.28%	0.81%	6.87%	1.02%	3.41%	-0.21%
过去三年	-8.19%	0.96%	-21.93%	1.11%	13.74%	-0.15%
过去五年	-19.61%	1.37%	-40.27%	1.58%	20.66%	-0.21%
自基金合同生效起至今	25.26%	1.41%	-7.83%	1.62%	33.09%	-0.21%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

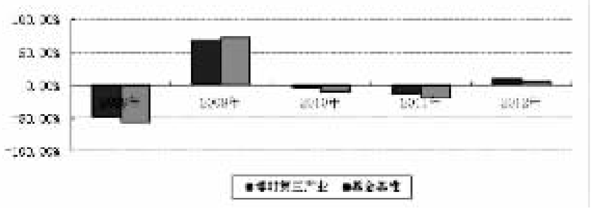
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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:本基金由原封闭式基金—裕元证券投资基金转型而来,本基金合同于2007年4月12日生效。本基金于2007年4月24日完成了基金份额的集中申购,并向中国证监会提交了"关于博时基金管理有限公司申请延长博时第三产业成长股票证券投资基金证券投资比例调整期的请示",将调整期由原来的10个交易日延长至三个月。按照本基金的基金合同规定,自集中申购份额确认之日起3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十一条(二)投资范围、(五)投资限制的有关约定。调整期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年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



3.3过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	1.900	995,135,825.71	705,802,823.60	1,700,938,649.31	分配2009年利润
合计	1.900	995,135,825.71	705,802,823.60	1,700,938,649.31	-

§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日起在上证所上市,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		
刘彦春	基金经理	2010-8-3	-	10.5	2002起先后在汉唐证券研究所、香港中信投资研究有限公司任行业研究员。2006年加入博时公司,历任研究员、研究员兼基金经理助理、博时新兴成长基金基金经理。现任博时第三产业成长股票基金的基金经理。
刘阳	研究员/基金经理助理	2012-5-31		4	2008年毕业后加入博时基金,担任研究部研究员,现任研究员兼任博时第三产业成长股票基金基金经理助理。

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、《博时第三产业成长股票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公平交易制度的执行情况

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本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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、交易执行等各环节,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

2012年,博时第三产业基金始终将自下而上精选个股作为组合构建重点。依靠这一策略,我们的组合在全年涨幅超越业绩基准。四季度时,由于流动性趋于宽松、经济逐步好转,市场风格发生较大变化,我们在这一阶段调整稍显缓慢,导致组合阶段性落后市场。回顾全年市场表现和我们的应对,我们会认真总结,期待未来能更进一步。

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1.030元,份额累计净值为2.699元。报告期内,本基金份额净值增长率为10.28%,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

我国经济下半年逐步企稳。信托贷款、债券等非信贷融资方式快速发展推动社会融资总量同比大幅增长,政府基建类投资增速快速回升,企业去库存基本结束,这些均构成经济复苏向上力量。四季度房地产、汽车销售回暖可以让我们对本轮经济复苏前景更加乐观一些。未来的变数仍然在于房地产领域,政府对房价上涨的容忍度仍需观察,一旦出现超出预期的严厉调控政策,预期会发生变化。

长期问题仍然没有解决。放松货币刺激地产和基建拉动经济复苏仍然属于传统套路。投资收益率低下问题无法解决,杠杆率处于高位以及房地产长期需求问题都将制约现有经济增长模式发展空间。影子银行支撑下的繁荣在下一轮紧缩时较以往可能会更加脆弱。未来仍然需要观察,新一届政府的执政思路、期盼的制度红利能否兑现最为重要。

在投资方面,我们仍然将自下而上挑选出的个股作为组合的基石。在此基础上考虑适当均衡,在快速上涨之后,市场估值已经很大程度上反映了经济温和复苏的预期,未来我们将视经济复苏强度调整组合的方向。总体上,我们对2013年A股市场较为乐观。

感谢持有人一直以来对基金经理人的信赖,为您提供专业、勤勉的服务是我们的天职。投资的道路上有喜悦,偶尔也会遭遇暂时的挫折,我们会及时总结经验和教训,不断提高自己的投资能力。天道酬勤,与赢者共赢。通过默默辛勤劳动和长期积累,通过专业的研究和资产管理,我们有信心在中长期取得优异回报。

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、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,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次分配比例不得低于可分配收益的60%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。

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,报告期末本基金份额可供分配利润为1,643,500,417.72元。

本基金管理人已于2013年1月14日发布公告,以2012年12月31日可供分配利润为基准,每10份基金份额派发红利1.53元。

§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

2012年,本基金托管人在对博时第三产业成长股票证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年,博时第三产业成长股票证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时第三产业成长股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,博时第三产业成长股票证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时第三产业成长股票证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:博时第三产业成长股票证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	220,758,442.56	4,017,807.56
结算备付金	108,857,509.14	117,715,447.62
存出保证金	1,310,410.13	2,640,521.44
交易性金融资产	6,047,416,343.21	4,687,763,477.34
其中:股票投资	6,047,416,343.21	4,347,763,477.34
基金投资	-	-
债券投资	-	340,000,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	1,400,000,000.00
应收证券清算款	318,663,003.80	111,264,464.78
应收利息	103,785.33	8,057,724.97
应收股利	-	-
应收申购款	1,501,341.85	236,163.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,698,610,836.02	6,331,695,607.50
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:		
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	-	9,593,229.82
应付赎回款	7,628,231.27	2,317,703.68
应付管理人报酬	7,994,654.12	8,128,934.93
应付托管费	1,332,442.36	1,354,822.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,902,655.74	1,373,176.04
应交税费	25,137.60	25,137.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,484,201.30	1,831,038.31
负债合计	23,367,322.39	24,624,042.87
所有者权益:		
实收基金	2,929,492,607.63	3,054,177,931.63
未分配利润	3,745,750,906.00	3,252,893,633.00
所有者权益合计	6,675,243,513.63	6,307,071,564.63
负债和所有者权益总计	6,698,610,836.02	6,331,695,607.50

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.030元,基金份额总额6,480,424,122.19份。

7.2利润表

会计主体:博时第三产业成长股票证券投资基金

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	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	765,057,850.24	-892,442,805.15
1.利息收入	60,335,108.76	34,370,140.56
其中:存款利息收入	3,617,731.37	8,051,886.35
债券利息收入	8,816,038.24	5,121,402.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	47,901,339.15	21,196,851.68
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-61,608,454.68	-474,147,465.12
其中:股票投资收益	-118,664,681.81	-537,234,492.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,775,420.00	754,011.04
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	55,280,807.13	62,333,016.06
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	766,171,532.34	-453,007,937.90
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	159,663.82	342,457.31
减:二、费用	127,827,684.15	154,651,398.69
1.管理人报酬	95,557,534.43	109,239,566.66
2.托管费	15,926,255.68	18,206,594.53
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	15,876,813.52	26,727,031.34
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	467,080.52	478,206.16
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	637,230,166.09	-1,047,094,203.84
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	637,230,166.09	-1,047,094,203.84

7.3所有者权益(基金净值)变动表所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时第三产业成长股票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)	3,054,177,931.63	3,252,893,633.00	6,307,071,564.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	637,230,166.09	637,230,166.09
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)	-124,685,324.00	-144,372,893.09	-269,058,217.09
其中:1.基金申购款	168,060,960.31	189,406,997.35	357,467,957.66
2.基金赎回款	-292,746,284.31	-333,779,890.44	-626,526,174.75
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)	2,929,492,607.63	3,745,750,906.00	6,675,243,513.63
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)	3,521,941,958.93	4,916,018,417.07	8,437,960,376.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,047,094,203.84	-1,047,094,203.84
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)	-467,764,027.30	-616,030,580.23	-1,083,794,607.53
其中:1.基金申购款	82,153,380.87	102,140,846.51	184,294,227.38
2.基金赎回款	-549,917,408.17	-718,171,426.74	-1,268,088,834.91
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)	3,054,177,931.63	3,252,893,633.00	6,307,071,564.63

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:

基金管理公司负责人:何宝　　主管会计工作的负责人: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[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。

7.4.3关联方关系

7.4.3.1与基金存在重大利益关系的主要关联方的名称及关联关系

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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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 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	1,946,322,952.84	17.67%	-	-

7.4.4.1.2权证交易

无。

7.4.4.1.3债券交易

无。

7.4.4.1.4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	1,746,267.22	18.86%	1,337,523.03	27.29%
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	-	-	-	-

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	95,557,534.43	109,239,566.66
其中:支付销售机构的客户维护费	16,696,820.72	22,202,085.65

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 X 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	15,926,255.68	18,206,594.53

注:支付基金托管人中国工商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 X 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

份额单位:份

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
期初持有的基金份额	-	33,181,825.24
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	33,181,825.24
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注:博时基金赎回本基金的交易委托招商证券办理,适用费率为0。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	220,758,442.56	2,024,988.34	4,017,807.56	7,261,583.05

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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

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)	总金额
招商证券	000651	格力电器	老股东增发配售	749,984	12,869,725.44
招商证券	600143	金发科技	增发网上申签	1,000,000	12,630,000.00
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:张)	总金额
招商证券	110015	石化转债	新债网下申购	147,890	14,789,000.00

7.4.5期末(2012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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	12/12/26	公告重大事项	10.62	13/01/21	11.13	30,000,000	263,156,653.48	318,600,000.00	

注: 本基金截至2012年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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5,728,816,343.21元,属于第二层级的余额为318,600,000.00元,无属于第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级4,347,763,477.34元,第二层级340,000,000.00元,无第三层级)。

(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	6,047,416,343.21	90.28
	其中:股票	6,047,416,343.21	90.28
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	329,615,951.70	4.92
6	其他各项资产	321,578,541.11	4.80
7	合计	6,698,610,836.02	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	74,038,440.51	1.11
C	制造业	3,483,559,568.57	52.19
C0	食品、饮料	773,527,085.26	11.59
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,587,201,834.89	23.78
C8	医药、生物制品	1,122,830,648.42	16.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	35,129,127.39	0.53
E	建筑业	262,449,195.10	3.93
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	97,333,199.33	1.46
I	金融、保险业	1,578,108,397.87	23.64
J	房地产业	456,798,414.44	6.84
K	社会服务业	60,000,000.00	0.90
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	6,047,416,343.21	90.59

8.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600535	天士力	11,899,966	657,711,120.82	9.85
2	000651	格力电器	24,800,000	632,400,000.00	9.47
3	600066	宇通客车	24,999,735	629,993,322.00	9.44
4	600276	恒瑞医药	15,452,476	465,119,527.60	6.97
5	000002	万 科A	30,000,000	318,600,000.00	4.77
6	600519	贵州茅台	1,499,933	313,515,995.66	4.70
7	600809	山西汾酒	6,253,585	260,524,351.10	3.90
8	600030	中信证券	17,999,865	240,478,196.40	3.60
9	601318	中国平安	4,999,897	226,445,335.13	3.39
10	601668	中国建筑	57,499,823	224,249,309.70	3.36

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	600066	宇通客车	443,247,771.76	7.03
2	000869	张 裕A	420,229,899.35	6.66
3	000858	五 粮 液	331,700,740.95	5.26
4	600535	天士力	262,720,690.39	4.17
5	601318	中国平安	208,505,637.37	3.31
6	600030	中信证券	206,294,116.19	3.27
7	600519	贵州茅台	201,078,838.82	3.19
8	601166	兴业银行	192,430,840.01	3.05
9	601668	中国建筑	189,412,608.25	3.00
10	600837	海通证券	168,037,110.56	2.66
11	000157	中联重科	157,843,505.34	2.50
12	600031	三一重工	146,906,565.47	2.33
13	601633	长城汽车	146,007,456.75	2.31
14	600276	恒瑞医药	144,394,842.71	2.29
15	601601	中国太保	142,540,840.42	2.26
16	000568	泸州老窖	140,258,022.22	2.22
17	601939	建设银行	131,702,782.33	2.09
18	000527	美的电器	122,123,079.07	1.94
19	600809	山西汾酒	116,014,679.33	1.84
20	601288	农业银行	108,080,788.80	1.71

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	600519	贵州茅台	532,587,469.37	8.44
2	600050	中国联通	512,350,991.37	8.12
3	000063	中兴通讯	313,018,888.75	4.96
4	000858	五 粮 液	279,446,892.04	4.43
5	600809	山西汾酒	269,801,684.19	4.28
6	000869	张 裕A	262,685,765.79	4.16
7	600535	天士力	252,598,149.12	4.00
8	600887	伊利股份	205,303,830.32	3.26
9	600036	招商银行	188,179,672.74	2.98
10	600588	用友软件	177,720,833.41	2.82
11	000157	中联重科	145,234,579.53	2.30
12	600031	三一重工	133,278,356.39	2.11
13	000651	格力电器	122,569,162.52	1.94
14	601318	中国平安	119,510,813.62	1.89
15	000527	美的电器	115,957,405.66	1.84
16	600600	青岛啤酒	115,874,004.57	1.84
17	002029	七 匹 狼	83,754,153.17	1.33
18	000423	东阿阿胶	79,196,371.03	1.26
19	000338	潍柴动力	73,510,314.43	1.17
20	000538	云南白药	70,386,723.06	1.12

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	6,054,802,681.03
卖出股票的收入(成交)总额	5,004,737,485.69

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前十名资产支持证券投资明细

本基金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	1,310,410.13
2	应收证券清算款	318,663,003.80
3	应收股利	-
4	应收利息	103,785.33
5	应收申购款	1,501,341.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	321,578,541.11

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	318,600,000.00	4.77	公告重大事项

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
393,197	16,481.37	328,219,629.02	5.06%	6,152,204,493.17	94.94%

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	份额级别	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基金	-	66,765.14	0.00%
	合计	66,765.14	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(2007年4月12日)基金份额总额	1,500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	6,756,274,352.66
本报告期期间基金总申购份额	371,769,487.17
减:本报告期期间基金总赎回份额	647,619,717.64
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,480,424,122.19

§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。

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130,000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	
招商证券	2	1,946,322,952.84	17.67%	1,746,267.22	18.86%	新增2个
中信证券	3	1,653,995,354.64	15.02%	1,306,425.31	14.11%	新增1个
广发证券	2	1,404,135,707.99	12.75%	1,269,789.47	13.71%	-
中信建投	2	1,007,544,236.04	9.15%	869,734.38	9.39%	新增1个
中金公司	1	764,751,840.92	6.94%	650,418.44	7.02%	-
银河证券	1	668,182,011.69	6.07%	605,403.46	6.54%	新增1个
宏源证券	1	567,846,433.44	5.16%	389,453.02	4.21%	-
西部证券	1	483,953,346.05	4.39%	314,567.01	3.40%	-
光大证券	3	460,706,809.83	4.18%	388,889.80	4.20%	新增3个
国信证券	1	429,000,525.77	3.89%	376,798.76	4.07%	新增1个
华泰证券	3	364,650,096.26	3.31%	305,241.19	3.30%	-
长江证券	1	245,884,236.47	2.23%	208,999.66	2.26%	-
方正证券	2	232,250,178.25	2.11%	200,421.82	2.16%	-
国海证券	1	229,282,441.42	2.08%	193,415.71	2.09%	-
齐鲁证券	1	131,389,332.57	1.19%	85,401.23	0.92%	新增1个
国元证券	1	124,355,761.48	1.13%	110,042.95	1.19%	新增1个
中航证券	1	111,821,754.23	1.02%	79,437.57	0.86%	新增1个
平安证券	1	108,968,754.31	0.99%	99,206.84	1.07%	新增1个
申银万国	1	31,173,264.80	0.28%	28,379.68	0.31%	-
华创证券	1	28,062,004.86	0.25%	18,885.57	0.20%	新增1个
开源证券	1	20,350,843.20	0.18%	12,465.07	0.13%	-

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,我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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;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
2013年3月26日