

## 博时策略灵活配置混合型证券投资基金

### 2013 第三季度 报告

2013年9月30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10月23日

**1.1 重要提示**  
基金管理人及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
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10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。  
本报告自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	博时策略灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	050102
交易代码	050102
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2009年4月11日
报告期末基金份额总额	1,863,244,494.04份
投资目标	通过灵活运用投资策略,在股票和债券之间灵活配置资产,对成长、价值风格突出的股票进行重点投资,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合,定性分析和定量分析相结合的方法,在股票、债券和现金等资产之间进行相对稳定的动态配置,并根据自上而下的宏观分析与自下而上的行业分析相结合的方法进行资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,混合配置的风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险、较高收益的品种。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

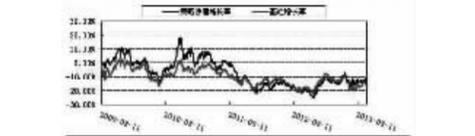
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2013年7月1日至2013年9月30日)
1.本期已实现收益	39,540,286.54
2.本期利润	79,304,840.29
3.加权平均基金份额本期利润	0.0412
4.本期基金份额净值增长率	1,664,772,976.36
5.本期基金份额持有人数	0.861

### 3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②
过去三个月	5.00%	0.95%	4.05%
	0.95%	4.97%	0.80%
	0.80%	0.03%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2009年8月11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基金合同第十二条(二)“投资策略”、“(六)投资限制”的有关规定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	证券从业年限	说明
张勇	基金经理/固定收益投资总监	2009-9-11	9.5	2001年起先后在南京市商业银行总行、南京证券资产管理部、南京证券资产管理部工作,2003年12月加入博时基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部副经理、固定收益部副经理兼固定收益部副经理、固定收益部副经理兼固定收益部副经理、固定收益部副经理兼固定收益部副经理、固定收益部副经理兼固定收益部副经理。
王燕	基金经理	2011-2-28	9	2004年3月加入博时基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、固定收益部副经理、固定收益部副经理兼固定收益部副经理、固定收益部副经理兼固定收益部副经理、固定收益部副经理兼固定收益部副经理。

4.2 报告期内本基金运作遵信情况说明  
在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《博时策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,并未有损害基金份额持有人利益、未发生内幕交易、操纵市场等违法违规行为,基金管理人恪尽职守,勤勉尽责,基金份额持有人利益得到充分保障。

4.3 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相关制度。

4.4 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。

4.5 管理人及基金经理承诺  
管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.7 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.8 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.9 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.10 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.11 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.12 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.13 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.14 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.15 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.16 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.17 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.18 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.19 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.20 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.21 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.22 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.23 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.24 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.25 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.26 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.27 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.28 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.29 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.30 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.31 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.32 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.33 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.34 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.35 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.36 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.37 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.38 基金管理人及基金经理承诺  
基金管理人及基金经理承诺:严格遵守相关法律法规,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人谋求最大利益,不从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	矿业	17,740,000.00	1.11
C	制造业	695,413,636.98	43.33
D	建筑业	43,668,953.34	2.72
E	房地产业	38,392,566.88	2.39
F	批发零售业	90,935,325.15	5.67
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	采矿业	160,690,204.47	10.01
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	46,153,529.00	2.88
O	住宿和餐饮业	-	-
P	房地产业	-	-
Q	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
R	交通运输业	-	-
S	合计	1,092,820,273.82	68.10

### 5.3 报告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

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	000002	万科A	12,999,919	118,689,204.47	7.40
2	002024	苏宁云商	7,076,679	90,935,325.15	5.67
3	600882	伊泰股份	1,999,753	89,348,044.04	5.49
4	600538	天士力	1,600,000	72,020,000.00	4.57
5	600519	贵州茅台	499,922	67,399,368.68	4.23
6	000651	格力电器	2,499,872	46,396,603.32	4.14
7	000538	云南白药	449,969	52,665,347.54	3.28
8	000009	华国际A	7,087,268	46,323,600.00	2.86
9	002008	双汇发展	800,000	44,680,800.00	2.78
10	600177	壹安石	5,999,894	43,799,226.20	2.73

### 5.4 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	334,722,797.30	20.86
8	其他	-	-
9	合计	364,722,797.30	22.75

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110016	川债转股	752,770	95,315,737.40	5.94
2	113001	中行转债	807,340	87,340,220.20	5.03
3	113002	工行转债	450,000	49,735,500.00	3.11
4	110018	国电转债	500,000	55,000,000.00	3.42
5	110011	石化转债	338,570	34,079,849.78	2.14

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注  
5.10.1 报告期内本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。  
5.10.2 报告期末本基金前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。  
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	238,133.14
2	应收证券清算款	4,468,057.32
3	应收利息	3,218,260.50
4	应收股利	221,490.28
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,145,941.24

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110016	川债转股	95,315,737.40	5.94
2	113001	中行转债	80,758,220.20	5.03
3	113002	工行转债	49,735,500.00	3.11
4	110018	国电转债	35,000,000.00	2.24
5	110011	石化转债	34,079,849.78	2.14
6	110015	石化转债	91,137,968.00	5.69
7	110020	南钢转债	11,725,100.00	0.72
8	110012	国电转债	7,821,490.00	0.49

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

5.10.7 报告期末本基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	179,660,521.58	89.20
2	其中:普通股	176,324,502.02	87.63
3	存出保证金	-	-
4	应收利息	3,218,260.50	1.75
5	其他资产	8,145,941.24	4.12
6	其他	-	-
7	合计	197,884,723.32	100.00

5.10.8 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	制造业	695,413,636.98	43.33
2	采矿业	160,690,204.47	10.01
3	房地产业	38,392,566.88	2.39
4	批发零售业	90,935,325.15	5.67
5	建筑业	43,668,953.34	2.72
6	其他	-	-
7	合计	1,092,820,273.82	68.10

5.10.9 报告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

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	000002	万科A	12,999,919	118,689,204.47	7.40
2	002024	苏宁云商	7,076,679	90,935,325.15	5.67
3	600882	伊泰股份	1,999,753	89,348,044.04	5.49
4	600538	天士力	1,600,000	72,020,000.00	4.57
5	600519	贵州茅台	499,922	67,399,368.68	4.23
6	000651	格力电器	2,499,872	46,396,603.32	4.14
7	000538	云南白药	449,969	52,665,347.54	3.28
8	000009	华国际A	7,087,268	46,323,600.00	2.86
9	002008	双汇发展	800,000	44,680,800.00	2.78
10	600177	壹安石	5,999,894	43,799,226.20	2.73

5.10.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110016	川债转股	752,770	95,315,737.40	5.94
2	113001	中行转债	807,340	87,340,220.20	5.03
3	113002	工行转债	450,000	49,735,500.00	3.11
4	110018	国电转债	500,000	55,000,000.00	3.42
5	110011	石化转债	338,570	34,079,849.78	2.14

5.10.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

5.10.12 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.13 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。

5.10.14 投资组合报告附注  
5.10.14.1 报告期内本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。  
5.10.14.2 报告期末本基金前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。  
5.10.14.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	238,133.14
2	应收证券清算款	4,468,057.32
3	应收利息	3,218,260.50
4	应收股利	221,490.28
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,145,941.24

5.10.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	----	---------	--------------