

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表示其未来表现,投资者有风险,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。

1.2 基金产品概况

基金名称	博时策略基金
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	通过运用多种投资策略,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长期投资,以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、债券和现金等资产类别之间进行对稳定的动态调整,并通过自上而下的宏观分析与自下而上的微观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%+中国国债指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为股票型基金,混合配置的风格高于市场中债券和平衡型基金,属于股票型基金,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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2013年7月1日~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	0.0442
4.期末基金份额净值	1.044,772,076.36
5.期末基金份额持有人户数(户)	0.861

3.2 基金业绩
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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
张勇	基金经理/固定收益投资部总经理	2009-9-11	-	9.5
王燕	基金经理	2011-2-28	-	9

4.2 报告期内本基金基金经理变动情况
在本报告期内,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。
4.3 公平交易专项说明
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 报告期内基金投资策略和运作分析
4.6 报告期内基金业绩表现和运作分析
4.7 报告期内基金资产净值变动分析
4.8 报告期内基金资产净值变动分析

5.1 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.2 基金投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年7月1日~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	0.0442
4.期末基金份额净值	1.044,772,076.36
5.期末基金份额持有人户数(户)	0.861

5.4 基金业绩
5.4.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.6 基金业绩
5.6.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.7 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.8 基金业绩
5.8.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.9 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.10 基金业绩
5.10.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.11 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.12 基金业绩
5.12.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.13 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.14 基金业绩
5.14.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.15 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.16 基金业绩
5.16.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.17 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.18 基金业绩
5.18.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.19 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.20 基金业绩
5.20.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.21 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.22 基金业绩
5.22.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.23 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30	22.60
4	其他资产	364,727,797.30	22.60
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	60,000,000.00	3.72
7	资产支持证券	-	-
8	其他负债	87,763,862.38	5.44
9	其他	81,454,941.24	5.00
10	合计	1,613,472,874.74	100.00

5.24 基金业绩
5.24.1 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%
过去六个月	11.90%	2.00%	9.90%
过去一年	21.50%	3.50%	18.00%

注:本基金合同于2009年4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)投资范围、“(六)投资策略”的有关约定,本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同规定。

5.25 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,092,829,273.82	67.73
2	固定收益投资	1,092,829,273.82	67.73
3	银行存款和拆出资金	364,727,797.30</	