

博时平衡配置混合型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

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:2010年8月24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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本半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。

基金管理人、基金托管人、中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2010年8月23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,保证复核后不存在虚假记载、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。

基金管理人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摘要。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时平衡配置混合型证券投资基金
基金代码	059007
基金合同生效日	2006年5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
报告期末基金总资产	2,909,824,686.05份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置基础上,获得长期稳定收益。
投资策略	本基金遵循货币市场、股票市场、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置,在严格控制风险的前提下,通过资产配置、行业配置、个股选择等方法,在不同资产类别之间进行动态调整,以期在不同市场环境下获得稳定收益。
业绩比较基准	45%×深证综合指数A股+50%×国债收益率指数+5%×银行存款利率
风险收益特征	本基金的预期风险低于股票基金,预期收益高于债券基金。本基金属于证券投资基金中的中等风险,中等收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
姓名	孙洁清	隋松云
信息披露负责人	0755-83169999	010-66105799
电子邮箱	service@btaa.com.cn	
客户服务电话	95105568	95588
传真	0755-83195140	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.btaa.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2010年1月1日—2010年6月30日)	金额单位:人民币元
本期已实现收益	-18,814,076.50
本期利润	-337,921,806.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1177
本期基金份额净值增长率为	-9.90%

3.1.2 报告期利润和亏损

报告期末(2010年6月30日)	金额单位:人民币元
期末可供基金份额利润	0.0752
期末基金份额净值	3,128,626,437.26
期末基金份额净值	1.075

注:本期已实现收益为基金本期利息收入、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。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后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变动的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-④
过去一个月	-4.87%	0.71%	-3.56%	0.75%	-1.31% -0.04%
过去三个月	-5.70%	0.98%	-10.12%	0.80%	4.42% 0.18%
过去六个月	-9.90%	0.87%	-10.91%	0.71%	1.01% 0.16%
过去一年	-3.69%	1.05%	-4.68%	0.84%	0.99% 0.21%
过去三年	25.35%	1.10%	-2.39%	1.07%	27.74% 0.03%
自基金合同生效至今	163.44%	1.15%	53.02%	1.03%	110.42% 0.12%

注:本基金的业绩比较基准:45%×深证综合指数A股+50%×中债国债总指数+5%×同业存款利率。

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45%、50%、5%的七比例采取再平衡,再用每日均乘的计算方式得到基准指数的时时间序列。

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

阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-④
过去一个月	-4.87%	0.71%	-3.56%	0.75%	-1.31% -0.04%
过去三个月	-5.70%	0.98%	-10.12%	0.80%	4.42% 0.18%
过去六个月	-9.90%	0.87%	-10.91%	0.71%	1.01% 0.16%
过去一年	-3.69%	1.05%	-4.68%	0.84%	0.99% 0.21%
过去三年	25.35%	1.10%	-2.39%	1.07%	27.74% 0.03%
自基金合同生效至今	163.44%	1.15%	53.02%	1.03%	110.42% 0.12%

注:本基金的业绩比较基准:45%×深证综合指数A股+50%×中债国债总指数+5%×同业存款利率。

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45%、50%、5%的七比例采取再平衡,再用每日均乘的计算方式得到基准指数的时时间序列。

3.2.3 基金管理人及其管理基金的基本情况

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。注册资本为一亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海设有分公司。目前公司股东为招商银行股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津信托有限公司,持有股份6%;深圳平安大业有限公司,持有股份6%;上海长城资产管理有限公司,持有股份6%;丰实投资发展有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限公司,持有股份2%。

截至2010年6月30日,博时基金管理公司共管理十六只开放式基金(三只封闭式基金,并且受全国社会基本医疗保险基金管理部部分社保基金,以及多个企业年金账户、特定资产管理账户,资产管理总规模逾1698.46亿元,公募基金合计超过人民币531.19亿元)。

0 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的基本情况

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。注册资本为一亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海设有分公司。目前公司股东为招商银行股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津信托有限公司,持有股份6%;深圳平安大业有限公司,持有股份6%;上海长城资产管理有限公司,持有股份6%;丰实投资发展有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限公司,持有股份2%。

截至2010年6月30日,博时基金管理公司共管理十六只开放式基金(三只封闭式基金,并且受全国社会基本医疗保险基金管理部部分社保基金,以及多个企业年金账户、特定资产管理账户,资产管理总规模逾1698.46亿元,公募基金合计超过人民币531.19亿元)。

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45%、50%、5%的七比例采取再平衡,再用每日均乘的计算方式得到基准指数的时时间序列。

4.2 基金管理人及其管理基金的基本情况

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。注册资本为一亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海设有分公司。目前公司股东为招商银行股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津信托有限公司,持有股份6%;深圳平安大业有限公司,持有股份6%;上海长城资产管理有限公司,持有股份6%;丰实投资发展有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限公司,持有股份2%。

截至2010年6月30日,博时基金管理公司共管理十六只开放式基金(三只封闭式基金,并且受全国社会基本医疗保险基金管理部部分社保基金,以及多个企业年金账户、特定资产管理账户,资产管理总规模逾1698.46亿元,公募基金合计超过人民币531.19亿元)。

0 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的基本情况

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。注册资本为一亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海设有分公司。目前公司股东为招商银行股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津信托有限公司,持有股份6%;深圳平安大业有限公司,持有股份6%;上海长城资产管理有限公司,持有股份6%;丰实投资发展有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限公司,持有股份2%。

截至2010年6月30日,博时基金管理公司共管理十六只开放式基金(三只封闭式基金,并且受全国社会基本医疗保险基金管理部部分社保基金,以及多个企业年金账户、特定资产管理账户,资产管理总规模逾1698.46亿元,公募基金合计超过人民币531.19亿元)。

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45%、50%、5%的七比例采取再平衡,再用每日均乘的计算方式得到基准指数的时时间序列。

4.2 基金管理人及其管理基金的基本情况

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。注册资本为一亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海设有分公司。目前公司股东为招商银行股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津信托有限公司,持有股份6%;深圳平安大业有限公司,持有股份6%;上海长城资产管理有限公司,持有股份6%;丰实投资发展有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限公司,持有股份2%。

截至2010年6月30日,博时基金管理公司共管理十六只开放式基金(三只封闭式基金,并且受全国社会基本医疗保险基金管理部部分社保基金,以及多个企业年金账户、特定资产管理账户,资产管理总规模逾1698.46亿元,公募基金合计超过人民币531.19亿元)。

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45%、50%、5%的七比例采取再平衡,再用每日均乘的计算方式得到基准指数的时时间序列。

4.3 基金管理人及其管理基金的基本情况

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。注册资本为一亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海设有分公司。目前公司股东为招商银行股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津信托有限公司,持有股份6%;深圳平安大业有限公司,持有股份6%;上海长城资产管理有限公司,持有股份6%;丰实投资发展有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限公司,持有股份2%。

截至2010年6月30日,博时基金管理公司共管理十六只开放式基金(三只封闭式基金,并且受全国社会基本医疗保险基金管理部部分社保基金,以及多个企业年金账户、特定资产管理账户,资产管理总规模逾1698.46亿元,公募基金合计超过人民币531.19亿元)。

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45%、50%、5%的七比例采取再平衡,再用每日均乘的计算方式得到基准指数的时时间序列。

4.4 基金管理人及其管理基金的基本情况

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