

博时精选股票证券投资基金

[2012] 第二季度报告

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7月7日
§ 重要提示
基金管理人的董事会及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2012年7月19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代表未来表现,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时精选股票
基金代码	050004
交易代码	050004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年6月22日
报告期末基金份额总额	6,880,434,772.87份
基金净值	1.4596(单位:人民币)
基金份额净值	1.4596(单位:人民币)
基金总资产	8,519,437,052.94(单位:人民币)
基金总负债	1,639,518,278.06(单位:人民币)
基金份额净值	8,519,437,052.94(单位:人民币)

本基金是一只主动型的股票基金,本基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金,属于证券投资基金中的高风险品种。本基金力争在资产成长、分享中国经济与资本市场的高速增长,谋求实现基金资产的长期稳定增长。

投资策略
自下而上精选个股,适度主动配置资产,系统有效管理风险。

75%以上投资于中国A股股票+20%以上投资于中国国债指数+5%现金收益。

业绩比较基准
本基金是一只主动型的股票基金,本基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金,属于证券投资基金中的高风险品种。本基金力争在资产成长、分享中国经济与资本市场的高速增长,谋求实现基金资产的长期稳定增长。

基金管理人
博时基金管理有限公司

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

单位:人民币

主要财务指标

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 92,943,355.04

2.本期利润 519,650,436.70

3.加权平均基金份额本期利润 0.0751

4.期末基金资产净值 8,519,437,052.94

5.期末基金份额净值 1.4596(单位:人民币)

注:本期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,本期费用的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

所述基金业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据。

3.2基金净值表现

3.2.1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) 净值增长率(②) 业绩比较基准收益率(③) 准收益基准(④)

过去三个月 6.38% 1.20% 0.86% 0.83% 5.52% 0.37%

3.2.2基金管理人对基金本期业绩表现的评价

本基金合同自2004年6月22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1个月内使基金的总资产的组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、9)禁止行为的有关约定。本基金建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1基金管理人基本情况简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

马乐 基金经理 2011-4-12 - 6 2006年加入博时公司,历任研究员,公司事业部及金融地产行业研究员兼研究组投资经理,现任博时精选股票基金经理。

4.2报告期内本基金运作遵循守信情况说明

在报告期内,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》及其他各项实施细则、《基金合同》、《基金招募说明书》、《基金产品资料概要》及其他相关法律的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理基金,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理行为均符合法律法规和基金合同的有关规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易执行的情况

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。

4.3.2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报告期内本基金的业绩表现说明

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。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将密切关注宏观经济形势,把握政策导向,密切关注行业动态,通过分析他们的成长性,努力为投资者创造长期回报。

§ 5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 8,034,618,214.62 93.27

其中:股票 8,034,618,214.62 93.27

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

3 货币衍生品投资 - -

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 570,563,852.30 6.62

6 其他各项资产 9,504,921.50 0.11

7 合计 8,614,686,988.42 100.00

5.2报告期末行业分类的股票投资组合

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

杨锐 基金经理/副总裁 2006-4-31 - 13 1999年加入公司,任研究员,2004年转任基金经理,历任消费行业研究员兼基金经理,现任基金经理,公司事业部及金融地产行业研究员兼研究组投资经理,现任博时精选股票基金经理。

安敏 基金经理 2009-12-8 - 7 2006年1月加入博时基金管理有限公司,任固定收益组研究员,后担任固收组基金经理,现任基金经理,公司事业部及金融地产行业研究员兼研究组投资经理,现任博时精选股票基金经理。

§ 6 基金产品概况

单位:人民币

主要财务指标

报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 21,645,920.61

2.本期利润 37,379,196.46

3.加权平均基金份额本期利润 0.0156

4.期末基金资产净值 1,894,379,700.63

5.期末基金份额净值 0.801

注:本基金合同于2006年5月31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个月内使基金的总资产的组合比例符合本基金合同第一条(二)投资范围、9)禁止投资的有关规定,本基金建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同的约定。

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

7.1报告期内本基金运作遵守信情况说明

在报告期内,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》及其他各项实施细则、《基金合同》、《基金招募说明书》、《基金产品资料概要》及其他相关法律的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理基金,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理行为均符合法律法规和基金合同的有关规定,没有损害基金持有人利益的行为。

7.2公平交易专项说明

7.2.1公平交易执行的情况

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。

7.2.2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。

7.3报告期内本基金的业绩表现说明

本基金合同于2006年5月31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个月内使基金的总资产的组合比例符合本基金合同第一条(二)投资范围、9)禁止投资的有关规定,本基金建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同的约定。

7.4管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金将密切关注宏观经济形势,把握政策导向,密切关注行业动态,通过分析他们的成长性,努力为投资者创造长期回报。

§ 8 投资组合报告

8.1备查文件目录

8.1.1中国证监会批准博时精选股票证券投资基金设立的文件

8.1.2《博时精选股票证券投资基金基金合同》

8.1.3《博时精选股票证券投资基金托管协议》

8.1.4《基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程》

8.1.5《报告期前博时精选股票证券投资基金年度审计报告》

8.1.6《基金衍生品投资决策委员会章程》

8.1.7《基金估值政策和程序》

8.1.8《基金投资决策委员会会议制度》

8.1.9《基金投资禁止行为和投资限制》

8.1.10《基金资产估值方法》

8.1.11《基金收益分配原则和方法》

8.1.12《基金费用计提方法、用途及标准》

8.1.13《基金信息披露管理办法》

8.1.14《基金托管协议》

8.1.15《基金合同》

8.1.16《基金托管协议》

8.1.17《基金合同》

8.1.18《基金合同》

8.1.19《基金合同》

8.1.20《基金合同》

8.1.21《基金合同》

8.1.22《基金合同》

8.1.23《基金合同》

8.1.24《基金合同》

8.1.25《基金合同》

8.1.26《基金合同》

8.1.27《基金合同》

8.1.28《基金合同》

8.1.29《基金合同》

8.1.30《基金合同》

8.1.31《基金合同》

8.1.32《基金合同》

8.1.33《基金合同》

8.1.34《基金合同》

8.1.35《基金合同》

8.1.36《基金合同》

8.1.37《基金合同》

8.1.38《基金合同》

8.1.39《基金合同》

8.1.40《基金合同》

8.1.41《基金合同》

8.1.42《基金合同》

8.1.43《基金合同》

8.1.44《基金合同》

8.1.45《基金合同》

8.1.46《基金合同》

8.1.47《基金合同》

8.1.48《基金合同》

8.1.49《基金合同》

8.1.50《基金合同》

8.1.51《基金合同》

8.1.52《