

2012年8月25日 星期六

博时价值增长贰号证券投资基金

2012 半年度报告摘要

6.3所有者权益 基金净值变动表

会计主体:博时价值增长贰号证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期		
	2012年1月1日至2012年6月30日	上期	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,094,532,945.99	-2,777,007,814.38	5,317,525,131.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,291,246.29	58,291,246.29
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)	-386,259,299.89	127,966,949.80	-258,262,350.09
其中:1.基金申购款	23,503,287.05	-7,847,650.86	15,655,636.19
2.基金赎回款	-409,762,586.94	135,844,600.66	-273,917,986.28
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)	7,708,273,646.10	-2,590,719,618.29	5,117,554,027.81

项目	上年度可比期间		
	2011年1月1日至2011年6月30日	上期	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,025,673,937.11	-2,465,522,735.46	6,559,151,201.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-114,309,369.14	-114,309,369.14
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)	-651,480,646.31	178,872,137.02	-472,608,509.29
其中:1.基金申购款	46,125,202.87	-12,968,344.02	33,156,858.45
2.基金赎回款	-697,605,849.18	191,840,481.44	-505,765,367.74
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)	8,374,193,290.80	-2,401,959,967.58	5,972,233,323.22

报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理人:何宝 主管会计工作负责人:王德英 会计机构负责人:成江

6.4财务报表

6.4.1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。

6.4.2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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关税收法规和证券交易,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基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

③对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税;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、红利时按按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定扣缴20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

6.4.3基金卖出股票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。

6.4.4关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) 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、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围按一般商业条款进行。

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

单位:人民币元

关联方名称 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上期 2011年1月1日至2011年6月30日

成交金额 成交金额

占当期股票 占当期股票

成交总额的比例 成交总额的比例

招商证券 174,884,927.46 6.15%

6.4.4.1.2 权证交易

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

单位:人民币元

关联方名称 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上期 2011年1月1日至2011年6月30日

当期佣金 占当期佣金总量的比例 期末应付佣金余额 占期末应付佣金余额的比例

招商证券 107,118.32 4.66%

关联方名称 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期 2010年1月1日至2010年6月30日

当期佣金 占当期佣金总量的比例 期末应付佣金余额 占期末应付佣金余额的比例

招商证券 - - - -

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的监管费、经手费后的净额列示。

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上期 2011年1月1日至2011年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费 39,218,563.33 46,416,755.88

其中:支付销售机构的客户维护费 5,920,645.54 6,937,088.57

注:支付基金管理人博时基金的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:

日管理费=前一日基金资产净值x1.5%÷当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上期 2011年1月1日至2011年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费 6,536,427.18 7,736,125.94

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值x0.25%÷当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.5 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6月30日 上期 2011年1月1日至2011年6月30日

期末余额 当期利息收入 期末余额 当期利息收入

中国建设银行 203,159,392.69 2,432,183.85 593,662,720.61 2,553,966.94

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5 期末 2012年6月30日本基金持有的流通受限证券

无。

7.期末基金资产组合情况

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 3,043,585,924.23 59.35

其中:股票 3,043,585,924.23 59.35

2 固定收益投资 1,131,248,134.40 22.06

其中:债券 1,131,248,134.40 22.06

3 资产支持证券 - -

其中:质押式回购 725,800,682.90 14.15

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 203,272,421.81 3.96

6 其他各项资产 24,134,738.76 0.47

7 合计 5,128,041,902.10 100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

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 101,080,000.00 1.98

B 采掘业 147,953,137.37 2.89

C 制造业 1,163,386,382.82 22.73

C0 食品、饮料 234,018,068.91 4.57

C1 纺织、服装、皮毛 - -

C2 木材、家具 - -

C3 造纸、印刷 29,853,980.00 0.58

C4 石油、化学、塑胶、塑料 - -

C5 电子 196,941,173.00 3.85

C6 金属、非金属 65,783,573.62 1.29

C7 机械、设备、仪器 540,611,745.31 10.56

C8 医药、生物制品 96,177,795.98 1.88

C9 其他制造业 - -

D 电力、煤气及水的生产和供应业 366,025,811.32 7.15

E 交通运输业 43,533,319.44 0.66

F 建筑业 37,637,310.44 0.73

G 信息技术业 - -

H 传播与文化产业 26,010,482.68 0.51

I 批发和零售贸易 375,936,359.78 7.35

J 金融、保险业 572,323,393.73 11.18

K 房地产业 115,120,285.12 2.25

L 其他行业 47,634,878.91 0.93

M 合计 3,043,585,924.23 59.47

7.3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

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 600011 三一重工 22,434,203 312,285,497.76 6.10

2 601933 永辉超市 9,208,645 249,554,279.50 4.88

3 600060 海信电器 11,000,000 184,910,290.00 3.61

4 600011 潍柴动力 3,856,550 146,459,964.50 2.86

5 600299 圣农发展 7,000,000 101,080,000.00 1.98

6 600016 民生银行 14,909,964 89,310,684.36 1.75

7 600535 天士力 1,893,075 82,765,239.00 1.62

8 002051 中工国际 2,872,778 76,308,983.68 1.49

9 601328 交通银行 14,739,845 66,918,896.30 1.31

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2012年8月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年8月24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,也不保证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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2012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

基金简称	博时价值增长贰号混合
基金代码	050201
交易代码	050201(前端) 051201(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月27日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,708,273,646.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

在力争使基金份额净值高于价值增长贰号混合的前提下,本基金在多层次复合投资策略的基础上,采取低风险追求收益配比原则,以中长期投资为主,保持投资组合良好的流动性,谋求基金资产的长期稳定增长。

投资目标 本基金采取避险对冲策略的多层次复合投资策略。本基金成立以来至2008年8月31日,本基金的业绩比较基准为价值增长贰号混合证券投资基金业绩比较基准,70%沪深300指数收益率+30%*中国国债一年期收益率。

业绩比较基准 本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,以下列基金为“长期业绩比较基准”,在收益稳定性上追求下跌风险小于上述收益类资产的上界比例。

风险收益特征

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名: 杨利娟 联系电话: 0755-83169999 0755-83169999 e-mail: service@bosera.com	尹东 010-67590500 yindong_zh@ccb.com
客户服务电话	95105568 0755-83195140	95506 010-66275865

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称 中国证券报、证券时报、上海证券报

登载基金半年度报告正文的互联网网址 http://www.bosera.com

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要数据和指标

单位:人民币元

指标	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	42,858,837.90
本期利润	58,291,246.29
加权平均基金份额本期利润	0.007422
本期基金份额净值增长率	1.07%

3.2 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	①净值增长率	②业绩比较基准收益率	③-②	④-③
过去一个月	-1.63%	-4.49%	0.75%	2.86%
过去三个月	3.59%	0.64%	0.84%	2.75%
过去六个月	1.07%	4.39%	0.93%	-3.32%
过去一年	-6.87%	0.68%	-11.49%	4.73%
过去三年	-6.87%	0.94%	-11.98%	5.11%
自基金成立起至今	90.93%	1.35%	156.60%	1.05%

注:自本基金成立至2008年8月31日,本基金的业绩比较基准为价值增长贰号混合证券投资基金业绩比较基准,70%沪深300指数收益率+30%*中国国债一年期收益率。

由于基金资产配置比例随动态变化的过程中,需要通过再平衡来使基金的资产配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照70%-30%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。

上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。

3.2.1 基金净值表现

3.2.1.1 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	①净值增长率	②业绩比较基准收益率	③-②	④-③
过去一个月	-1.63%	-4.49%	0.75%	2.86%
过去三个月	3.59%	0.64%	0.84%	2.75%
过去六个月	1.07%	4.39%	0.93%	-3.32%
过去一年	-6.87%	0.68%	-11.49%	4.73%
过去三年	-6.87%	0.94%	-11.98%	5.11%
自基金成立起至今	90.93%	1.35%	156.60%	1.05%

注:自本基金的基金合同于2006年9月27日生效。按照本基金的基金合同约定,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“C)投资范围”、“D)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基金合同约定。

3.2.1.2 自基金合同生效以来基金业绩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:本基金的基金合同于2006年9月27日生效。按照本基金的基金合同约定,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“C)投资范围”、“D)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基金合同约定。

3.2.1.3 基金业绩比较基准

3.2.1.4 基金业绩比较基准

3.2.1.5 基金业绩比较基准

3.2.1.6 基金业绩比较基准

3.2.1.7 基金业绩比较基准

3.2.1.8 基金业绩比较基准

3.2.1.9 基金业绩比较基准

3.2.1.10 基金业绩比较基准

3.2.1.11 基金业绩比较基准

3.2.1.12 基金业绩比较基准

3.2.1.13 基金业绩比较基准

3.2.1.14 基金业绩比较基准

3.2.1.15 基金业绩比较基准

3.2.1.16 基金业绩比较基准

3.2.1.17 基金业绩比较基准

3.2.1.18 基金业绩比较基准

3.2.1.19 基金业绩比较基准

3.2.1.20 基金业绩比较基准

3.2.1.21 基金业绩比较基准

3.2.1.22 基金业绩比较基准

3.2.1.23