

博时第三产业成长股票证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2013年上半年,传统行业与新兴产业股票走势严重分化。疲弱的经济基本面对以周期品为主的权重板块继续调整;部分景气度较高板块如传媒、电子持续受到资金追捧,估值高企。创业板、中小板与主板走势差异巨大。

基于政策及经济前景不确定性加剧,博时第三产业基金坚守确定性成长,其中在二季度更多采取防守策略,在6月份市场大幅调整过程中较好的减少了净值损失。未来我们会继续将投资重心放在企业自身,希望通过选股获得超额收益。

4.4.2 报告期内基金业绩表现
截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.891元,累计份额净值为2.730元,报告期内净值增长率为1.36%,同期业绩基准涨幅为-9.79%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
二季度经济疲弱表现与较高的货币投放继续背离。地产、基建投资平稳增长,但制造业投资、私人消费增速明显下滑。在海外主要经济体货币竞相贬值情况下,人民币基于国际化战略、国际资本流动等原因持续升值,下半年出口可能会面临诸多困难。地产销售初现疲态,但地产销售及投资增长对于政府投资能力,甚至整个经济能否稳定都至关重要,但目前房价居高不下,对居民消费已经形成严重挤压,地产领域相关政策调整需要密切关注。

目前是我国经济转型的关键时期,传统产业需求不足,新的增长点还没有培育起来。在这样的背景下,未来经济大概率会维持较低增长速度,一旦突破政府容忍底线,仍然会有政策托底,地产和基建投资仍是抓手。但保障长期仍是托底,在新的增长点培育起来之前,经济大幅反弹难度很大。流动性方面,尽管外汇占款减少会带来一定压力,但只要政府投资相对平稳,资金价格估计不会出现持续走高情况。

股票投资方面,下半年可能会出现一次经济快速下行后政府重新保增长带来的传统产业反弹机会。从更长周期来看,经济增长模式调整带来的资源重新分配是更加难得的投资机会,各个领域都可能涌现新的优秀企业成长起来,管理能力、执行能力将变得格外重要。投资者应该从一开始就对基金经理人的信赖,为您提供专业、勤勉的服务是我们的天职。感谢的道路上有喜悦,偶尔也会遭遇暂时的挫折,我们会及时总结经验和教训,不断提高自己的投资能力。天道酬勤,与福者共福。通过默默辛勤劳动和长期积累,通过专业的研究和资产管理,我们对于信心在中长期取得优秀回报。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护持有人的利益,设立了博时基金管理人估值委员会(以下简称“估值委员会”),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会更加评估后审慎发表。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有较好的独立性。估值委员会的职责主要包括:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种包括估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存在异议时,托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释,通过积极沟通达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。
4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
报告期内,本基金于2013年1月14日发布了分红公告,以截止至2012年12月31日的可供分配利润为基准,向基金份额持有人每10份基金份额派发红利1.53元。

§5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,本基金托管人在对博时第三产业成长股票证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,博时第三产业成长股票证券投资基金的托管人——博时基金管理有限公司在博时第三产业成长股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格依照基金合同的规定进行。本报告期内,博时第三产业成长股票证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为1,029,705,228.11元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等方面的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时第三产业成长股票证券投资基金2013半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表
会计主体:博时第三产业成长股票证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 单位:人民币元. Rows include 资产, 负债, 所有者权益.

注:本基金由原封闭式基金-裕元证券投资基金转型而来,本基金合同于2007年4月12日生效。本基金于2007年4月24日完成了基金份额的集中申购,并向中国证监会提交了关于博时基金管理有限公司申请延长博时第三产业成长股票证券投资基金投资比例调整期限的请示,将调整期由原来的10个交易日延长至三个月。按照本基金基金合同约定,自集中申购份额确认之日起3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条(二)投资范围、伍、投资限制的有关约定。调整期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

有限公司网站的半年度报告正文。
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%). Rows include 601939, 601288, 601318, etc.

注:本项的“买入金额”均按买入成交金额(成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%). Rows include 600535, 601318, 601601, etc.

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额. Values: 1,927,397,897.66, 4,424,754,583.91

注:本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交均价乘以成交量)填列,不考虑相关交易费用。
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。
7.9 期末本基金投资的股指期货投资情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货投资。
7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内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。
7.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
7.10.3 期末其他各项资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, etc.

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
7.10.5 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的情况。
7.10.6 投资组合报告附注其他文字描述部分
由于组合内原因,分派之和与合同之间可能存在尾差。
§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with columns: 持有人户数, 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者. Values: 373, 467, 94,985,169.31, 1.48%, 6,343,782,189.21

8.2 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

基金管理人所有从业人员持有本基金 144,853.83 0.00%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;
2、本基金的基金经理未持有本基金。
§ 9 开放式基金份额变动

Table with columns: 基金合同生效日(2007年4月12日)基金份额总额, 本期申购份额, etc. Values: 1,500,000,000.00, 6,480,424,122.19

§ 10 重大事件揭示
10.1 基金份额持有人大会决议
本基金报告期内未召开持有人大会。
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于2013年6月1日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,何宇不再担任博时基金管理有限公司总经理职务,由杨鹤代任公司总经理。
基金管理人于2013年7月26日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经博时基金管理有限公司第五届董事会2013年第二次会议审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]362号文核准批复,博时基金管理有限公司聘任吴姚荣担任博时基金管理有限公司总经理。
本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。
10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。
10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。
10.7 基金租用证券公司交易席位的情况

10.7.1 基金租用证券公司交易席位进行股票投资及佣金支付情况

Table with columns: 券商名称, 交易席位数量, 股票交易, 佣金, etc. Rows include 申银万国, 中信证券, etc.

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用本基金专用交易席位。
1. 基金专用交易席位的选择标准如下:
a) 经营行为规范,内部控制健全,在业内有良好的声誉;
b) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施能满足基金进行证券交易的需要;
c) 具有较较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据本公司所管理资产的特点,提供专门研究报告,具有开发量化投资模型的能力;能就公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
2. 基金专用交易席位的选择程序如下:
a) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
b) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

博时基金管理有限公司
2013年8月29日