# 博时新兴成长股票型证券投资基金

## 2013 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:交通银行股份有限公司**

**报告送出日期:2013年8月29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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月28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。

基金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。

本报告期自2013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 | 博时新兴成长股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 博时新兴成长股票 |
| 基金主代码 | 050009 |
| 交易代码 | 050009 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年7月6日 |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 18,483,798,403.09份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 基于中国经济正处于长期稳定增长周期,本基金通过深入研究并积极投资于全市场各类行业中的新兴高速成长企业,力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将通过“自上而下”的宏观分析,以及定性分析与定量分析相补充的方法,在股票、债券和现金等资产类之间进行配置。本基金将分析和预测众多宏观经济变量,包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等,并关注国家财政、税收、货币、汇率以及股权分置改革政策和其它证券市场政策等。本基金将在此基础上决定股票、固定收益证券和现金等大类资产在给定区间内的动态配置。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,属于预期风险/收益相对较高的基金品种。其预期风险和预期收益均高于债券型基金。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 孙麒清 | 裴学敏 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 95559 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | peixm@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 95559 |
| 传真 | | 0755-83195140 | 021-62701216 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.bosera.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

### §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

金额单位:人民币元

| 3.1.1期间数据和指标 | 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 138,305,851.89 |
| 本期利润 | 316,625,388.14 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0167 |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.01% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1156 |
| 期末基金资产净值 | 9,485,143,556.76 |
| 期末基金份额净值 | 0.513 |

注:本期已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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

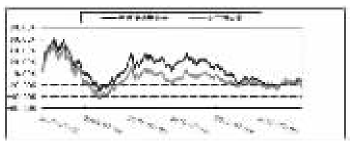
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -9.20% | 1.59% | -12.67% | 1.50% | 3.47% | 0.09% |
| 过去三个月 | -3.02% | 1.22% | -9.30% | 1.16% | 6.28% | 0.06% |
| 过去六个月 | 3.01% | 1.11% | -9.79% | 1.20% | 12.80% | -0.09% |
| 过去一年 | -5.52% | 1.15% | -7.83% | 1.09% | 2.31% | 0.06% |
| 过去三年 | -22.51% | 1.23% | -8.92% | 1.10% | -13.59% | 0.13% |
| 自基金成立起至今 | -16.32% | 1.49% | -24.69% | 1.56% | 8.37% | -0.07% |

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

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80%、20%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。

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



注:本基金由原封闭式基金-裕华证券投资基金转型而来,本基金合同于2007年7月6日生效。本基金于2007年8月3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新兴成长股票型证券投资基金证券投资比例调整期的请示》,将基金投资比例调整期由原来的10个交易日延长至三个月。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十五条“(二)投资范围”、“(七)投资禁止行为与限制”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。

### §4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司成立于1998年7月13日,是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。注册资本2.5亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。同时,博时基金公司拥有博时基金(国际)有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。博时基金公司的股东为招商证券股份有限公司、中国长城资产管理公司、天津港(集团)有限公司、璟安股权投资有限公司、上海盛业股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广厦建设集团有限责任公司。博时基金公司的经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务,是一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构。

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至2013年6月30日,博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金,并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户,公募基金资产规模逾1065.69亿元人民币,累计分红602.92亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

1) 根据银河证券基金研究中心统计,2013年上半年,股票型基金中,截至6月28日,博时医疗保健今年以来净值增长率在328只标准型股票基金中排名前1/3。混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名第8。

2) 固定收益方面,博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名第1;博时裕祥分级债券A今年以来收益率在19只封闭式债券型分级子基金(优先份额)中名列第2。

3) 海外投资方面,博时标普500今年以来净值增长率在15只QDII指数股票型基金中排名第2,该基金成立以来的涨幅达到15.94%。

2、客户服务

2013年上半年,博时基金共举办各类渠道培训活动逾841场,参加人数超过2万人。

3、其他大事件

1) 2013年3月29日,由证券时报社主办的2012年度中国基金业明星奖颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业基金荣获“2012年度股票型明星基金奖”。

2) 2013年3月30日,由中国证券报社主办的第十届中国基金业金牛奖颁奖典礼暨2013金牛基金论坛在北京举行。博时基金蝉联“金牛基金管理公司”奖,博时基金价值组投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得“金牛基金十周年特别奖”,博时现金收益荣获“2012年度货币市场金牛基金”。

3) 2013年4月,在股市动态分析杂志主办的“2012基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜”评选活动中,博时标普500指数基金获得“2012年基金新产品营销策划案例奖”。

4) 2013年4月10日,由上海证券报举办的第十届“金基金奖”颁奖典礼在上海举行,博时基金荣获金“基金十年?卓越公司奖”,博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获“金基金十年?投资回报奖”,博时主题行业基金荣获“金基金·股票型基金奖5年期奖”,博时裕阳封闭荣获“金基金·分红基金奖3年期奖”。

5) 2013年4月27日,由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的2013中国网?普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选“年度最佳财富管理基金公司”。

6) 2013年6月26日,世界品牌实验室(WBL)在京发布2013年度(第十届)《中国500最具价值品牌》排行榜,博时基金以81.65亿的品牌价值位列第216名,品牌价值一年内提升了近20亿元,排名逐年上升。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 韩茂华 | 基金经理 | 2013-1-9 | - | 7 | 2006年7月加入博时基金管理有限公司,历任研究部研究员、公用事业与金融地产研究组主管、原材料组主管兼研究员。历任特定资产投资经理,现任博时新兴成长股票型证券投资基金基金经理。 |
| 曾鹏 | 基金经理 | 2013-1-18 | - | 8 | 2005年起先后在上投摩根基金,嘉实基金投研部门工作。2012年10月加入博时基金管理有限公司,担任股票投资部投资经理。现担任博时新兴成长股票型证券投资基金基金经理。 |
| 李培刚 | 基金经理 | 2008-7-2 | 2013-1-18 | 12 | 1992年起先后在黑龙江省水电建设管理局、北京国际系统控制公司、招商证券研发中心、华安基金研究部工作。2005年加入博时公司,历任研究员、研究部副总经理兼任研究员。现任博时新兴成长基金基金经理。 |

注:上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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》及其各项实施细则、《博时新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,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和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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管理人对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

上半年,市场总体上先扬后抑,进入二季度后分化逐渐明显,以传媒、医药、电子为代表的消费类公司受到市场追捧,而周期性公司表现较差。上半年组合整体保持了中等偏上仓位,在行业配置上主要集中在医药、大众消费品、TMT、地产、汽车等行业的公司配置,回避了与基建相关的周期类公司。组合集中度上升,对个别优质龙头企业和拐点型公司的配置进一步增强。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.513元,累计份额净值为2.495元,报告期内净值增长率为3.01%,同期业绩基准涨幅为-9.79%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济增长的不确定性在增强,存在进一步放缓的可能,企业面临的经营形势将更加复杂。新股发行可能重启,存量市场中估值高的公司蕴藏一定风险,市场整体的估值分化可能收窄,稳定增长的消费类公司受到的冲击相对较小。组合将继续以消费行业、新兴行业为战略配置方向,适时调整组合仓位和结构以应对市场变化。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为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,有效维护投资人的利益,设立了博时基金管理有限公司估值委员会(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、运作部负责人等成员组成,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成员评估后审慎采用。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,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有: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;确保对投资品种进行估值时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。

参与估值流程的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,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。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管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

### §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

2013年上半年度,基金托管人在博时新兴成长股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013年上半年度,博时基金管理有限公司在博时新兴成长股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013年上半年度,由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时新兴成长股票型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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:博时新兴成长股票型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 2,951,330.29 | 800,324,316.16 |
| 结算备付金 | 1,414,673,295.37 | 2,450,920,632.69 |
| 存出保证金 | 2,490,710.55 | 4,281,517.39 |
| 交易性金融资产 | 8,052,702,965.02 | 6,600,174,828.67 |
| 其中:股票投资 | 7,984,955,643.22 | 6,537,493,972.87 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 67,747,321.80 | 62,680,855.80 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 28,671,180.45 | 31,096,933.86 |
| 应收利息 | 858,445.18 | 1,014,683.02 |
| 应收股利 | 6,932,662.65 | - |
| 应收申购款 | 338,062.39 | 729,942.56 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 9,509,618,651.90 | 9,888,542,854.35 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 288.61 | 219,683,224.43 |
| 应付赎回款 | 3,934,794.81 | 4,877,812.52 |
| 应付管理人报酬 | 12,259,218.30 | 11,544,557.79 |
| 应付托管费 | 2,043,203.04 | 1,924,092.99 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 3,475,962.08 | 15,926,828.58 |
| 应交税费 | 47,234.40 | 47,234.40 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 2,714,393.90 | 4,981,054.70 |
| 负债合计 | 24,475,095.14 | 258,984,805.41 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 4,926,941,289.97 | 5,157,714,895.05 |
| 未分配利润 | 4,558,202,266.79 | 4,471,843,153.89 |
| 所有者权益合计 | 9,485,143,556.76 | 9,629,558,048.94 |
| 负债和所有者权益总计 | 9,509,618,651.90 | 9,888,542,854.35 |

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.513元,基金份额总额18,483,798,403.09份。

6.2利润表

会计主体:博时新兴成长股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 420,128,917.11 | 561,146,703.30 |
| 1.利息收入 | 14,752,262.16 | 11,846,572.56 |
| 其中:存款利息收入 | 12,092,215.36 | 11,060,176.35 |
| 债券利息收入 | 211,309.72 | 258,993.19 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 2,448,737.08 | 527,403.02 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 227,015,961.73 | -1,019,246,160.83 |
| 其中:股票投资收益 | 144,603,006.21 | -1,074,879,217.91 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | 275,593.72 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 82,412,955.52 | 55,357,463.36 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 178,319,536.25 | 1,568,491,828.07 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 41,156.97 | 54,463.50 |
| 减:二、费用 | 103,503,528.97 | 173,519,072.79 |
| 1.管理人报酬 | 74,384,634.13 | 82,529,131.71 |
| 2.托管费 | 12,397,439.05 | 13,754,855.28 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 16,485,893.78 | 77,003,603.54 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 235,562.01 | 231,482.26 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 316,625,388.14 | 387,627,630.51 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 316,625,388.14 | 387,627,630.51 |

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时新兴成长股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 5,157,714,895.05 | 4,471,843,153.89 | 9.629,558,048.94 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 316,625,388.14 | 316,625,388.14 |
| 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) | -230,773,605.08 | -230,266,275.24 | -461,039,880.32 |
| 其中:1.基金申购款 | 25,803,123.45 | 25,222,189.55 | 51,025,313.00 |
| 2.基金赎回款 | -256,576,728.53 | -255,488,464.79 | -512,065,193.32 |
| 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) | 4,926,941,289.97 | 4,558,202,266.79 | 9,485,143,556.76 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 5,435,925,898.40 | 5,248,163,173.70 | 10,684,089,072.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 387,627,630.51 | 387,627,630.51 |
| 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) | -152,979,507.55 | -165,828,865.60 | -318,808,373.15 |
| 其中:1.基金申购款 | 26,475,466.35 | 28,043,827.65 | 54,519,294.00 |
| 2.基金赎回款 | -179,454,973.90 | -193,872,693.25 | -373,327,667.15 |
| 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) | 5,282,946,390.85 | 5,469,961,938.61 | 10,752,908,329.46 |

报表附注为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:

基金管理公司负责人:吴姚东,主管会计工作负责人:王德英,会计机构负责人:成江

6.4报表附注

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关联方关系

6.4.2.1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。

6.4.2.2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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 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”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 招商证券 | 514,035,988.91 | 4.34% | 3,135,960,262.12 | 5.82% |

6.4.3.1.2权证交易

无。

6.4.3.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013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 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 招商证券 | 467,976.53 | 4.89% | 467,976.53 | 13.47% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 招商证券 | 2,687,945.83 | 6.67% | 1,848,020.24 | 10.42% |

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证管费、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。

6.4.3.2关联方报酬

6.4.3.2.1基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 74,384,634.13 | 82,529,131.71 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 16,117,709.40 | 17,830,604.75 |

注:支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.3.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 12,397,439.05 | 13,754,855.28 |

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.3.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.3.4各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.3.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.3.5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 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 |
| 交通银行 | 2,951,330.29 | 1,370,638.62 | 10,028,596.28 | 1,475,756.69 |

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2013年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2012年6月30日:同)。

6.4.3.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无(上年度可比区间:无)。

6.4.4期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600887 | 伊利股份 | 13/01/10 | 14/01/10 | 非公开发行流通受限 | 18.51 | 24.25 | 15,000,000 | 277,650,000.00 | 363,750,000.00 |

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000999 | 华润三九 | 2013-6-3 | 重大资产重组 | 26.55 | 2013-8-19 | 26.51 | 3,544,148 | 83,626,436.01 | 94,097,129.40 | - |
| 000998 | 隆平高科 | 2013-5-2 | 重大资产重组 | 20.73 | 2013-7-8 | 20.50 | 1,749,849 | 35,271,067.67 | 36,274,369.77 | - |
| 600436 | 片仔癀 | 2013-6-20 | 配股 | 136.82 | 2013-7-1 | 118.73 | 199,957 | 21,361,679.29 | 27,358,116.74 | - |
| 600547 | 山东黄金 | 2013-4-2 | 重大资产重组 | 32.13 | 2013-7-1 | 28.77 | 135,005 | 5,610,041.87 | 4,337,710.65 | - |
| 600983 | 合肥三洋 | 2013-5-13 | 公告重大事项 | 9.96 | 2013-8-14 | 10.90 | 999,945 | 8,933,770.68 | 9,959,452.20 | - |

6.4.4.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

### §7投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 7,984,955,643.22 | 83.97 |
| | 其中:股票 | 7,984,955,643.22 | 83.97 |
| 2 | 固定收益投资 | 67,747,321.80 | 0.71 |
| | 其中:债券 | 67,747,321.80 | 0.71 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 1,417,624,625.66 | 14.91 |
| 6 | 其他各项资产 | 39,291,061.22 | 0.41 |
| 7 | 合计 | 9,509,618,651.90 | 100.00 |

7.2期末按行业分类的股票投资组合金额

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 | 106,776,798.25 | 1.13 |
| B | 采矿业 | 28,521,297.47 | 0.30 |
| C | 制造业 | 5,713,268,191.11 | 60.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 281,241,882.29 | 2.97 |
| E | 建筑业 | 52,385,695.10 | 0.55 |
| F | 批发和零售业 | 400,966,808.80 | 4.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 24,179,316.48 | 0.25 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 334,634,687.50 | 3.53 |
| J | 金融业 | 193,478,296.84 | 2.04 |
| K | 房地产业 | 352,843,538.26 | 3.72 |
| L | 租赁和商务服务业 | 75,413,672.00 | 0.80 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 237,661,875.12 | 2.51 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 183,583,584.00 | 1.94 |
| | 合计 | 7,984,955,643.22 | 84.18 |

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

金额单位: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 | 600887 | 伊利股份 | 21,099,678 | 554,547,927.84 | 5.85 |
| 2 | 600315 | 上海家化 | 9,082,553 | 408,624,059.47 | 4.31 |
| 3 | 000895 | 双汇发展 | 10,271,290 | 394,828,387.60 | 4.16 |
| 4 | 000063 | 中兴通讯 | 25,699,505 | 327,668,688.75 | 3.45 |
| 5 | 002022 | 科华生物 | 17,435,519 | 258,220,036.39 | 2.72 |
| 6 | 600570 | 恒生电子 | 20,258,775 | 253,234,687.50 | 2.67 |
| 7 | 002236 | 大华股份 | 6,599,478 | 252,298,043.94 | 2.66 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 12,219,537 | 244,879,521.48 | 2.58 |
| 9 | 600079 | 人福医药 | 7,782,570 | 202,969,425.60 | 2.14 |
| 10 | 000800 | 一汽轿车 | 16,336,788 | 200,942,492.40 | 2.12 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于博时基金管理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

金额单位:人民币元

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600887 | 伊利股份 | 381,720,904.59 | 3.96 |
| 2 | 600315 | 上海家化 | 301,317,206.96 | 3.13 |
| 3 | 000063 | 中兴通讯 | 289,711,571.64 | 3.01 |
| 4 | 600256 | 广汇能源 | 265,455,598.06 | 2.76 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 247,676,514.58 | 2.57 |
| 6 | 600570 | 恒生电子 | 244,344,997.50 | 2.54 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 232,473,376.16 | 2.41 |
| 8 | 002022 | 科华生物 | 215,744,502.26 | 2.24 |
| 9 | 600612 | 老凤祥 | 179,385,759.62 | 1.86 |
| 10 | 000513 | 丽珠集团 | 178,375,146.81 | 1.85 |
| 11 | 000800 | 一汽轿车 | 177,563,737.67 | 1.84 |
| 12 | 002236 | 大华股份 | 142,268,475.57 | 1.48 |
| 13 | 000069 | 华侨城A | 135,519,831.79 | 1.41 |
| 14 | 600048 | 保利地产 | 132,505,472.97 | 1.38 |
| 15 | 600517 | 置信电气 | 124,297,617.78 | 1.29 |
| 16 | 600812 | 华北制药 | 118,252,277.90 | 1.23 |
| 17 | 601288 | 农业银行 | 115,158,538.43 | 1.20 |
| 18 | 600380 | 健康元 | 102,701,075.98 | 1.07 |
| 19 | 601991 | 大唐发电 | 96,317,476.73 | 1.00 |
| 20 | 601766 | 中国南车 | 95,511,435.66 | 0.99 |

注:本项的“买入金额”均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)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

金额单位:人民币元

| 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(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601688 | 华泰证券 | 444,022,889.82 | 4.61 |
| 2 | 600594 | 益佰制药 | 302,484,119.80 | 3.14 |
| 3 | 002005 | 德豪润达 | 247,021,133.75 | 2.57 |
| 4 | 600823 | 世茂股份 | 219,955,015.28 | 2.28 |
| 5 | 600895 | 张江高科 | 208,897,585.72 | 2.17 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 181,443,968.19 | 1.88 |
| 7 | 600739 | 辽宁成大 | 176,860,678.30 | 1.84 |
| 8 | 601800 | 中国交建 | 174,661,050.04 | 1.81 |
| 9 | 600271 | 航天信息 | 162,801,553.83 | 1.69 |
| 10 | 000598 | 兴蓉投资 | 157,035,941.98 | 1.63 |
| 11 | 600578 | 京能热电 | 153,384,272.68 | 1.59 |
| 12 | 600658 | 电子城 | 130,270,883.38 | 1.35 |
| 13 | 000501 | 鄂武商A | 118,852,128.27 | 1.23 |
| 14 | 300039 | 上海凯宝 | 113,362,230.17 | 1.18 |
| 15 | 600256 | 广汇能源 | 111,931,535.24 | 1.16 |
| 16 | 002179 | 中航光电 | 111,413,371.10 | 1.16 |
| 17 | 000568 | 泸州老窖 | 107,765,436.96 | 1.12 |
| 18 | 600079 | 人福医药 | 106,407,901.52 | 1.11 |
| 19 | 600718 | 东软集团 | 102,495,361.26 | 1.06 |
| 20 | 600967 | 北方创业 | 99,494,847.65 | 1.03 |

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)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

单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本(成交)总额 | 6,625,394,901.40 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 5,500,773,307.51 |

注:本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)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

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 67,747,321.80 | 0.71 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 67,747,321.80 | 0.71 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 113002 | 工行转债 | 572,010 | 62,566,453.80 | 0.66 |
| 2 | 110023 | 民生转债 | 49,840 | 5,180,868.00 | 0.05 |

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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,490,710.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | 28,671,180.45 |
| 3 | 应收股利 | 6,932,662.65 |
| 4 | 应收利息 | 858,445.18 |
| 5 | 应收申购款 | 338,062.39 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 39,291,061.22 |

7.10.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113002 | 工行转债 | 62,566,453.80 | 0.66 |

7.10.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600887 | 伊利股份 | 363,750,000.00 | 3.83 | 非公开发行认购 |

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §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

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 879,333 | 21,020.25 | 86,282,295.48 | 0.47% | 18,397,516,107.61 | 99.53% |

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 25,873.67 | 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

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2007年7月6日)基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 19,349,552,916.30 |
| 本报告期基金总申购份额 | 96,810,159.24 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 962,564,672.45 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 18,483,798,403.09 |

### §10重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本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》,何宝不再担任博时基金管理有限公司总经理职务,由杨鶤代任公司总经理。

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年第三次会议审议并通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]962号文核准批复,博时基金管理有限公司聘任吴姚东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、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中金公司 | 1 | 1,844,458,072.24 | 15.57% | 1,671,235.71 | 17.45% | - |
| 国泰君安 | 2 | 1,167,981,839.68 | 9.86% | 799,952.29 | 8.35% | |
| 国金证券 | 1 | 1,124,613,776.94 | 9.50% | 798,923.74 | 8.34% | |
| 德邦证券 | 1 | 1,094,041,489.84 | 9.24% | 996,013.58 | 10.40% | - |
| 方正证券 | 2 | 951,032,906.96 | 8.03% | 860,999.37 | 8.99% | - |
| 国信证券 | 1 | 942,904,893.35 | 7.96% | 858,417.91 | 8.97% | - |
| 兴业证券 | 2 | 927,266,509.53 | 7.83% | 635,087.62 | 6.63% | - |
| 高华证券 | 1 | 893,654,141.35 | 7.55% | 634,848.26 | 6.63% | - |
| 申银万国 | 2 | 589,829,264.65 | 4.98% | 536,980.38 | 5.61% | - |
| 广发华福 | 1 | 549,185,561.25 | 4.64% | 390,142.01 | 4.07% | - |
| 招商证券 | 1 | 514,035,988.91 | 4.34% | 467,976.53 | 4.89% | - |
| 中信证券 | 1 | 371,831,370.98 | 3.14% | 264,147.88 | 2.76% | - |
| 天源证券 | 1 | 263,128,317.50 | 2.22% | 186,925.01 | 1.95% | - |
| 安信证券 | 1 | 222,004,554.47 | 1.87% | 152,051.52 | 1.59% | - |
| 东莞证券 | 1 | 159,635,898.24 | 1.35% | 113,404.59 | 1.18% | - |
| 华安证券 | 1 | 117,395,314.05 | 0.99% | 106,875.78 | 1.12% | - |
| 国海证券 | 1 | 63,778,774.29 | 0.54% | 58,064.06 | 0.61% | - |
| 瑞银证券 | 2 | 46,924,534.68 | 0.40% | 42,720.18 | 0.45% | - |
| 浙商证券 | 1 | | | | | 撤销1个 |
| 中银国际 | 2 | | | | | |
| 华林证券 | 1 | | | | | |
| 华宝证券 | 1 | | | | | |
| 海通证券 | 1 | | | | | |
| 长城证券 | 1 | | | | | |
| 齐鲁证券 | 2 | | | | | |
| 国盛证券 | 1 | | | | | |
| 华西证券 | 1 | | | | | |
| 广发证券 | 1 | | | | | |
| 银河证券 | 1 | | | | | |
| 华泰证券 | 1 | | | | | |
| 国元证券 | 1 | | | | | |
| 渤海证券 | 1 | | | | | |
| 民族证券 | 1 | | | | | |

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,向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好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的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为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:

(1)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。

(2)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**