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：2011年3月31日

博时裕富沪深300指数证券投资基金

【2010】年度报告摘要

§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2011年3月30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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	博时沪深300指数
基金主代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月26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	15,631,026,003.22份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在95%以上，并保持年跟踪误差在4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用被动式投资的方法，按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为：股票资产为95%以内，现金和短期债券资产比例不低于5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%的沪深300指数加5%的银行同业存款利率
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	尹东
	联系电话	0755-83169999	010-67595003
	电子邮箱	service@bosera.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275865

2.4信息披露方式

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

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	-315,071,894.13	-2,047,800,585.62	799,379,334.16
本期利润	-1,596,234,363.47	7,831,267,434.73	-15,103,519,043.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0998	0.4632	-0.8772
本期基金份额净值增长率	-11.98%	88.61%	-63.88%
3.1.2期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1555	-0.0399	-0.4909
期末基金资产净值	13,201,113,477.21	15,028,300,963.94	9,510,958,832.52
期末基金份额净值	0.845	0.960	0.509

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，计入费用后持有人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

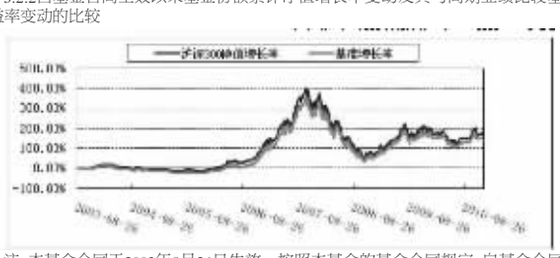
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	6.02%	1.68%	6.28%	1.68%	-0.26%	0.00%
过去六个月	20.89%	1.49%	20.95%	1.47%	-0.06%	0.02%
过去一年	-11.98%	1.52%	-11.77%	1.50%	-0.21%	0.02%
过去三年	-40.03%	2.19%	-39.16%	2.21%	-0.87%	-0.02%
过去五年	193.32%	2.02%	209.00%	2.06%	-15.68%	-0.04%
自基金合同生效起至今	167.21%	1.77%	145.09%	1.81%	22.12%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为沪深300指数×95%+银行同业存款利率×5%。

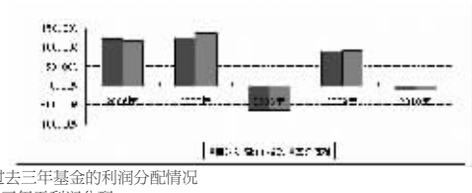
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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：本基金合同于2003年8月26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3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十六条（五）投资对象、（九）投资限制的有关约定。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。

3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3过去三年基金的利润分配情况

过去三年无利润分配。

§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（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、郑州、沈阳设有分公司，此外，还设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；璟安实业有限公司，持有股份6%；上海盛业资产管理有限公司，持有股份6%；丰益实业发展有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。

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2010年12月31日，博时基金公司共管理二十只开放式基金和三只封闭式基金，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、特定资产管理账户，资产管理总规模逾1874亿元，累计分红超过人民币532亿元。博时基金管理有限公司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、客户服务

1）为提供安全、高效的网上交易环境，博时公司不断升级网上交易系统的安全功能：2010年1月，博时快e通系统增加了动态验证码的功能，对客户身份进行验证；2010年3月，博时快e通直销交易系统在所有密码输入区域都设置了密码安全控件，大大提高了交易安全性。

2）2010年4月，博时基金客服中心推出了新版的在线客服系统，新系统能够支持更多新功能，例如，客户和坐席均能查到前面等待的客户数量，客户除了在线等待以外，还可以选择留言功能，留下自己的问题和联系方式，客服代表会及时给予回复。同时在线坐席可以根据等待客户的情况，合理控制在线交流节奏。

3）“博时e视界”于9月18日正式发布，这也是博时基金倾力为投资人打造的与投资专家面对面的全新视听网络平台。

4）2010年10月，博时基金与中国劳动保障报社联合举办“企业年金管理大家谈”有奖征文活动。向较早建立企业年金计划的企业征集管理经验与其他企业分享。

5）2010年，博时在全国各地举办各类客户活动、论坛、沙龙等共计1252场，并创新的采用网络会议室，扩大论坛的覆盖面，充分与投资者沟通当前市场的热点问题，受到了广泛大投资者的广泛欢迎。

2、社会责任

1）为支援舟曲灾区的救灾善后工作，博时基金公司及全体员工通过博时慈善基金会向甘肃省红十字会捐出赈灾款项人民币30万元。

2）博时慈善基金会2010年关爱助学现场捐赠仪式于2010年12月6日在中山大学举办，博时以每人5000元的标准向中山大学的21位贫困学生资助善款105000元，至此博时基金第四届百万关爱助学活动圆满落幕。

3、公司荣誉

1）博时在由证券时报社主办的2009年度中国明星基金奖评选中，荣获两个奖项，博时主题行业基金获得“2009年度三年持续回报股票型明星基金奖”，博时平衡配置获得“2009年度三年持续回报平衡混合型明星基金奖”。

2）博时在由中国证券报社主办的第七届中国基金业金牛奖评选中连续第三次荣获中国基金业最具权威的“金牛基金公司奖”，并获得首次设立的“金牛特别贡献奖”，旗下基金博时裕隆封闭、博时主题行业股票、博时平衡配置混合和博时现金收益货币均蝉联金牛奖项，分别获得“三年期封闭式持续优胜金牛基金”、“三年期开放式股票型持续优胜金牛基金”、“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”和“2009年度开放式货币市场金牛基金”奖项。

3）2010年8月14日博时基金网站在由证券时报主办的“第十一届中国优秀财经证券网站”评选中荣获“最佳基金网站奖”。

4、其他大事件

1）博时创业成长股票型证券投资基金首募顺利结束并于2010年6月1日成立，首次募集资金超过34亿元。

2）博时大中华亚太精选股票证券投资基金及博时宏观回报债券型证券投资基金首募顺利结束并于2010年7月27日成立。

3）博时转债增强债券型证券投资基金及博时行业轮动股票型证券投资基金首次募集顺利结束并分别于2010年11月24日和2010年12月10日成立。

4）根据中国证券监督管理委员会的批复，博时基金已在香港完成博时基金（国际）有限公司（Bosera Asset Management（International）Co.，Limited）的注册登记手续并获香港证券及期货事务监察委员会颁发的第4类（就证券提供意见）和第9类（提供资产管理）牌照；

5）博时基金于2010年8月25日和2010年11月11日分别公告郑州分公司和沈阳分公司成立。至此，博时基金已有4家分公司分别落地北京、上海、郑州和沈阳。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
汤义峰	基金经理	2010-3-12	-	4.5	2006年毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，获得博士学位。2006年6月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票基金、基金裕泽的基金经理助理、投资经理兼数量化研究员，现任博时沪深300指数基金、博时特许价值基金基金经理。
张峰	股票投资部总经理/成长组投资总监/基金经理	2010-10-11	-	18	1988年起先后在Haugen Financial System、花旗集团TIMCO资产管理部、摩根士丹利投资公司、ASTEN INVESTMENT ADVISORS工作。2010年2月加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部总经理、成长组投资总监、沪深300基金基金经理。
张晓军	基金经理	2008-7-2	2010-4-28	5	1992年起在新疆水利电力物资总公司财务科工作。2005年加入博时公司，历任数量化投资部金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼裕富基金经理助理、博时沪深300指数基金、上证超级大盘基金、博时上证超大盘ETF联接基金的基金经理。

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《博时裕富沪深300指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3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

（1）2010年经济回顾

2010年货币政策将真正回归“适度”，但流动性依然充裕，M1的大量增加也契合了股市、房地产市场活跃、投资交易量明显上升的状况。给经济适度降温，抑制资产价格（特别是防止房地产价格过快上涨）并加大经济结构调整成为政府的调控目标。政策的主要目的在于实现经济增速由高位的“软着陆”，货币政策的2季度突然刹车，经济过热的势头得到了明显的抑制作用，2010年10月份后内忧外患以及调整结构带来的资本格局变化都成为了加剧了中国通货膨胀的流动性因素。同时由于外部欧美日依旧维持较低利率水平，随着人民币开启新一轮升值之路，热钱呈现了加速流入新兴经济体的步伐，这也从外部环境加剧了国内流动性过剩的局面，由于政策并不能在第一时间做到有效的贯彻，这就导致了民间资本大量的短期投机行为，资本所到之处，也就出现了价格的暴涨，跷跷板效应非常明显。年末的通胀预期加剧，也进一步加剧了宏观经济的不确定性。

（2）投资组合管理的回顾

本基金是遵循指数投资理念的指数型基金。在整个管理过程中，基金经理借助系统软件的支持严密控制跟踪误差，在最小化成本的前提下做出适当的行业或者个股调整，避免频繁交易带来的损失。管理期间，本基金的跟踪误差主要来自基金申购赎回、基金净值精度计算两个方面，我们力图通过系统软件和精细化管理将本基金的跟踪误差控制在较低水平。此外，我们制定并实施了成份股调整策略，在年中、年底平稳实现了组合中沪深300指数成份股的调整。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日，本基金份额净值为0.845元，份额累计净值为2.825元。报告期内，本基金份额净值增长率为-11.98%，同期业绩基准增长率为-11.77%。

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2011年，全球经济再平衡继续。危机并未过去，发达国家经济复苏缓慢，美国经济二次探底的可能性很小，发达国家继续执行宽松的货币政策，导致资本流向包括中国在内的新兴市场；而新兴市场国家货币将维持走强格局，与发达市场脱钩，内需支撑增长，但通胀压力、资产泡沫现象严重，导致这些国家的宏观经济政策开始收紧。总体看，我国经济存在巨大的内需增长空间，城市化和工业化在快速推进，处在消费高速增长的阶段。其次，政府、银行、企业、居民资产负债表表现良好，为投资和消费提供了较为坚实的基本面“后盾”，在连续两年宽松的货币政策之后，中国面临的是经济强劲增长和通胀压力较大，货币政策回归到正常化的轨道，2011年的货币政策可能会从紧。但2011年是“十二五规划”的元年，是中国经济转型的关键之年，我们相信随着中国经济结构调整和转型的逐步成功，中国经济的长期增长态势能够支撑中国资本市场的走强，“十二五”展开的中国经济转型之旅或成为中国新一轮上涨的开始。本基金对中国经济中长期的前景持乐观的判断。期望博时裕富沪深300指数基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供更好的投资机会。

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、运作部负责人共五名成员组成，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。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：基金投资当期亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；基金当期收益应先弥补以前亏损后，才可进行当期收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若成立不满3个月则可不进行收益分配。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

§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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：博时裕富沪深300指数证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	683,516,647.91	736,763,331.56
结算备付金	1,601,265.54	598,129.19
存出保证金	1,279,453.17	2,377,445.71
交易性金融资产	12,526,668,462.51	14,227,203,198.36
其中：股票投资	12,526,668,462.51	14,227,203,198.36
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	73,775,614.49
应收利息	148,683.29	163,312.87
应收股利	-	-
应收申购款	6,919,280.76	26,430,723.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	13,220,133,793.18	15,067,311,755.36
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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	-	-
应付赎回款	2,097,110.24	22,533,770.32
应付管理人报酬	11,245,825.21	12,388,118.96
应付托管费	2,295,066.36	2,528,187.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,239,447.52	423,035.71
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,142,866.64	1,137,678.87
负债合计	19,020,315.97	39,010,791.42
所有者权益：		
实收基金	15,631,026,003.22	15,653,254,485.73
未分配利润	-2,429,912,526.01	-624,953,521.79
所有者权益合计	13,201,113,477.21	15,028,300,963.94
负债和所有者权益总计	13,220,133,793.18	15,067,311,755.36

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值0.845元，基金份额总额15,631,026,003.22份。

7.2利润表

会计主体：博时裕富沪深300指数证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	-1,427,940,914.26	8,014,974,011.85
1.利息收入	5,720,741.06	5,544,734.57
其中：存款利息收入	5,627,115.16	5,543,216.83
债券利息收入	93,625.90	1,517.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-156,647,641.23	-1,879,243,882.43
其中：股票投资收益	-296,659,215.53	-2,002,789,578.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	12,312,457.62	1,482,013.76
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	127,699,116.68	122,063,682.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,281,162,469.34	9,879,068,020.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,148,455.25	9,605,139.36
减：二、费用	168,293,449.21	183,706,577.12
1.管理人报酬	130,694,021.45	131,192,111.60
2.托管费	26,672,249.26	26,773,900.33
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	10,453,349.70	25,289,322.10
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	473,828.80	451,243.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,596,234,363.47	7,831,267,434.73
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,596,234,363.47	7,831,267,434.73

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时裕富沪深300指数证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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）	15,653,254,485.73	-624,953,521.79	15,028,300,963.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,596,234,363.47	-1,596,234,363.47
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）	-22,228,482.51	-208,724,640.75	-230,953,123.26
其中：1.基金申购款	4,877,346,475.54	-887,070,930.23	3,990,275,545.31
2.基金赎回款	-4,899,574,958.05	678,346,289.48	-4,221,228,668.57
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）	15,631,026,003.22	-2,429,912,526.01	13,201,113,477.21
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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）	18,681,572,214.48	-9,170,613,381.96	9,510,958,832.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,831,267,434.73	7,831,267,434.73
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）	-3,028,317,728.75	714,392,425.44	-2,313,925,303.31
其中：1.基金申购款	8,100,204,763.47	-1,472,346,122.42	6,627,858,641.05
2.基金赎回款	-11,128,522,492.22	2,186,738,547.86	-8,941,783,944.36
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）	15,653,254,485.73	-624,953,521.79	15,028,300,963.94

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：肖风　主管会计工作负责人：王德英　会计机构负责人：成江

7.4报表附注

7.4.1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。

7.4.2关联方关系

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
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”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）
璟安实业有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）
上海盛业资产管理有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）
丰益实业发展有限公司	基金管理人的股东（自2009年11月16日起）

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。

7.4.3本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.3.2关联方报酬

7.4.3.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	130,694,021.45	131,192,111.60
其中：支付销售机构的客户维护费	11,423,141.63	11,527,177.44

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.98%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 X 0.98%／当年天数。

7.4.3.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	26,672,249.26	26,773,900.33

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0.20%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 X 0.20%／当年天数。

7.4.3.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.3.4各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.3.5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 2010年1月1日至2010年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国建设银行	683,516,647.91	5,312,828.98	736,763,331.56	5,235,748.76

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。

7.4.3.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日 关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	600036	招商银行	老股东配股	3,680,655	32,573,796.75
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	601668	中国建筑	新股网上申购	141,000	589,380.00

7.4.4期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1因认购新发增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.4.2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
600518	康美药业	10/12/28	配股停牌	19.71	11/01/06	17.29	2,762,798	26,539,387.51	54,454,748.58	-
600664	哈药股份	10/12/29	资产重组	22.57	11/02/16	24.83	1,747,200	24,462,946.13	39,434,304.00	-
600816	安信信托	10/06/02	重大事项未公告	13.60	未知	未知	786,365	14,275,886.44	10,694,564.00	-
000059	辽通化工	10/12/02	资产重组	11.59	未知	未知	1,444,973	16,674,299.37	16,747,237.07	-
000652	泰达股份	10/11/22	公告重大事项	7.78	未知	未知	2,528,640	40,822,131.48	19,672,819.20	-
000959	首钢股份	10/10/29	资产重组	4.42	未知	未知	3,066,481	22,851,588.53	13,553,846.02	-

注：本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.4.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无余额。

7.4.5有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（b）以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。本基金持有属于第一层级的的金融工具主要包括存在活跃市场的股票（包括网下申购处于限售期的股票）、交易所市场债券等，于2010年12月31日的余额为12,372,110,943.64元（2009年12月31日：13,919,991,880.92元）。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。本基金持有属于第二层级的金融工具主要包括参与非公开发行取得并在锁定期内的股票、因重大事项停牌的股票、银行间市场债券等，于2010年12月31日的余额为154,557,518.87元（2009年12月31日：307,211,317.44元）。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。于2010年12月31日，本基金未持有属于第三层级的以公允价值计量的金融工具（2009年12月31日：同）。

（c）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1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	12,526,668,462.51	94.75
	其中：股票	12,526,668,462.51	94.75
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	685,117,913.45	5.18
6	其他各项资产	8,347,417.22	0.06
7	合计	13,220,133,793.18	100.00

8.2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	52,390,648.54	0.40
B	采掘业	1,575,485,040.24	11.93
C	制造业	4,378,998,726.62	33.17
C0	食品、饮料	699,110,152.49	5.30
C1	纺织、服装、皮毛	46,333,788.62	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9,544,301.04	0.07
C4	石油、化学、塑胶、塑料	307,819,266.44	2.33
C5	电子	65,147,734.32	0.49
C6	金属、非金属	1,156,213,489.39	8.76
C7	机械、设备、仪表	1,559,639,112.34	11.81
C8	医药、生物制品	492,032,621.36	3.73
C99	其他制造业	43,158,260.62	0.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	344,213,856.54	2.61
E	建筑业	398,300,273.06	3.02
F	交通运输、仓储业	562,676,926.36	4.26
G	信息技术业	380,020,071.18	2.88
H	批发和零售贸易	388,800,259.10	2.95
I	金融、保险业	3,358,001,814.21	25.44
J	房地产业	659,488,166.72	5.00
K	社会服务业	117,512,170.17	0.89
L	传播与文化产业	21,456,716.00	0.16
M	综合类	289,323,793.77	2.19
	合计	12,526,668,462.51	94.89

8.3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

代码	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	452,960,614.08	3.43
2	600036	招商银行	381,341,453.64	2.