博时价值增长贰号证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	博时价值增长贰号证券投资基金	
基金简称	博时价值增长贰号混合	
基金主代码	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	7,077,085,839.49份	
基金合同存续期	不定期	

2.2基金产品说明

投资目标	在力争使基金份额净值高于价值增长线水平的前提下,本基金在多层次复合投资策略的投资结构基础上,采取低风险适度收益配比原则,以长期投资为主,保持基金资产良好的流动性,谋求基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略。
业绩比较基准	自本基金成立日至2008年8月31日,本基金的业绩比较基准为价值增长线,自2008年9月1日起本基金业绩比较基准变更为:70%×沪深300指数收益率+30%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种,以在风险约束下期望收益最大化为核心,在收益结构上追求下跌风险有下界、上涨收益无上界的目标。

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	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853

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	51,652,984.57
本期利润	-596,816,331.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0820
本期基金份额净值增长率	-12.58%
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	-0.4230
期末基金资产净值	4,083,269,106.07
期末基金份额净值	0.577

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

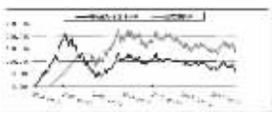
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-11.09%	1.53%	-11.19%	1.33%	0.10%	0.20%
过去三个月	-6.48%	1.23%	-8.05%	1.02%	1.57%	0.21%
过去六个月	-12.58%	1.25%	-8.29%	1.05%	-4.29%	0.20%
过去一年	-13.10%	1.11%	-6.47%	0.96%	-6.63%	0.15%
过去三年	-12.31%	0.93%	-6.39%	0.96%	-5.92%	-0.03%
自基金合同生效起至今	65.91%	1.31%	140.00%	1.04%	-74.09%	0.27%

注:本基金的业绩比较基准为:70%×沪深300指数收益率+30%×中国债券总指数收益率。

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。

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:本基金的基金合同于2006年9月27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个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条"(二)投资范围"、"(八)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。

§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

1)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		
温宇峰	基金经理/成长组投资总监	2012-7-10	-	12	1994年起先后在中国证监会发行部、中银国际控股公司、博时基金管理有限公司、上投摩根基金管理公司、Prime Capital、Fidelity International Limited (Hong Kong)工作。2010年6月21日加入博时基金管理有限公司,现任成长组投资总监兼博时价值增长基金、博时价值增长贰号基金、博时裕隆封闭基金的基金经理。

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、《博时价值增长贰号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,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 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

2013年上半年,本基金基本维持了前期的组合结构;但前期对中国经济将在2013年继续周期性回升的判断受到了挑战。

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0.577元,累计份额净值为2.032元,报告期内净值增长率为-12.58%,同期业绩基准涨幅为-8.29%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于经济转型需要逐步解决结构失衡的问题,预计中国经济增速将在中期内逐步回落,而其间的增速波动将取决于货币政策的变化。为反映经济增长动力的变化,本基金计划在2013年下半年加快组合结构的调整速度,增加在消费升级、技术进步和公共服务方面的组合配置,并从而提高组合的分散度和多样性。就2013年下半年而言,我们仍预计全年通胀温和,并且房地产投资将决定经济走势。

在全球经济背景和国内经济结构均处于快速变化的背景下,本基金将坚持自下而上的原则,努力发掘中国经济增长中的结构性投资机会。面对A股市场中不同行业的巨大估值差距,本基金将坚持估值的纪律性,努力寻找未被充分定价的增长。

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

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,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:博时价值增长贰号证券投资基金

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	112,644,067.70	125,843,735.70
结算备付金	252,492.86	2,092,866.02
存出保证金	365,826.96	1,002,020.12
交易性金融资产	3,953,048,098.01	4,832,600,666.91
其中:股票投资	2,974,008,082.31	3,791,388,642.41
基金投资	-	-
债券投资	979,040,015.70	1,041,212,024.50
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	516,722.96	-
应收利息	15,004,860.73	22,493,451.28
应收股利	9,687,963.25	-
应收申购款	128,411.42	114,620.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,091,648,443.89	4,984,147,360.58
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	-	49,959,352.99
应付赎回款	1,481,914.97	3,765,784.92
应付管理人报酬	5,340,910.68	5,865,431.31
应付托管费	890,151.77	977,571.86
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	434,272.24	1,077,526.48
应交税费	23,280.00	23,280.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	208,808.16	720,921.17
负债合计	8,379,337.82	62,389,868.73
所有者权益:		
实收基金	7,077,085,839.49	7,451,762,014.20
未分配利润	-2,993,816,733.42	-2,530,004,522.35
所有者权益合计	4,083,269,106.07	4,921,757,491.85
负债和所有者权益总计	4,091,648,443.89	4,984,147,360.58

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.577元,基金份额总额7,077,085,839.49份。

6.2利润表

会计主体:博时价值增长贰号证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

资产	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	-553,198,935.82	108,174,276.15
1.利息收入	19,644,325.01	30,865,883.05
其中:存款利息收入	313,086.63	2,465,880.84
债券利息收入	19,331,238.38	27,698,889.92
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	701,112.29
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	75,611,182.80	61,690,552.72
其中:股票投资收益	36,587,818.16	17,429,174.89
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,420,090.00	12,965,300.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	40,443,454.64	31,296,077.83
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-648,469,315.85	15,432,408.39
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	14,872.22	185,431.99
减:二、费用	43,617,395.46	49,883,029.86
1.管理人报酬	34,835,547.84	39,218,563.33
2.托管费	5,805,924.64	6,536,427.18
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,748,426.70	3,896,764.02
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	227,496.28	231,275.33
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-596,816,331.28	58,291,246.29
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-596,816,331.28	58,291,246.29

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: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)	7,451,762,014.20	-2,530,004,522.35	4,921,757,491.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-596,816,331.28	-596,816,331.28
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)	-374,676,174.71	133,004,120.21	-241,672,054.50
其中:1.基金申购款	22,013,555.69	-7,928,870.06	14,084,685.63
2.基金赎回款	-396,689,730.40	140,932,990.27	-255,756,740.13
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)	7,077,085,839.49	-2,993,816,733.42	4,083,269,106.07
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)	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	127,996,949.80	-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

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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,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营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,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。2013年1月1日以前,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、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按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。

6.4.3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。

6.4.4 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

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	136,595,124.59	7.48%	174,884,927.46	6.15%

6.4.4.1.2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	124,356.98	8.21%	109,292.02	25.20%

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	107,118.32	4.66%	-	-

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。

6.4.4.2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 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	34,835,547.84	39,218,563.33
其中:支付销售机构的客户维护费	5,303,959.88	5,920,645.54

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。

6.4.4.2.2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	5,805,924.64	6,536,427.18

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。

6.4.4.3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

无。

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 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
中国建设银行	112,644,067.70	295,133.39	203,159,392.69	2,432,183.85

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。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2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
300133	华策影视	13/5/28	公告重大事项	23.89	13/7/30	26.87	3,180,000	32,944,809.87	75,970,200.00	

注:本基金截至2013年6月30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。

6.4.5.3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	2,974,008,082.31	72.68
	其中:股票	2,974,008,082.31	72.68
2	固定收益投资	979,040,015.70	23.93
	其中:债券	979,040,015.70	23.93
	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	112,896,560.56	2.76
6	其他各项资产	25,703,785.32	0.63
7	合计	4,091,648,443.89	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	-	-
B	采矿业	15,166,314.24	0.37
C	制造业	1,106,428,521.18	27.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	95,040,153.60	2.33
F	批发和零售业	83,439,417.90	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	97,227,302.80	2.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	948,501,653.51	23.23
K	房地产业	549,649,519.08	13.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,585,000.00	0.06
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	75,970,200.00	1.86
S	综合	-	-
	合计	2,974,008,082.31	72.83

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	000002	万 科A	37,274,892	367,157,686.20	8.99
2	600519	贵州茅台	1,686,518	324,435,467.66	7.95
3	601318	中国平安	8,511,470	295,858,697.20	7.25
4	601601	中国太保	14,163,251	225,620,588.43	5.53
5	600030	中信证券	18,183,518	184,199,037.34	4.51
6	600383	金地集团	26,602,308	182,491,832.88	4.47
7	600585	海螺水泥	9,900,406	132,467,432.28	3.24
8	000338	潍柴动力	7,548,207	130,961,391.45	3.21
9	000625	长安汽车	10,389,650	96,519,848.50	2.36
10	601186	中国铁建	22,628,608	95,040,153.60	2.33

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	000625	长安汽车	97,342,932.45	1.98
2	000002	万 科A	77,539,054.43	1.58
3	600519	贵州茅台	72,945,185.35	1.48
4	601288	农业银行	69,764,095.94	1.42
5	601633	长城汽车	34,250,442.59	0.70
6	601601	中国太保	33,938,090.95	0.69
7	000338	潍柴动力	33,383,579.24	0.68
8	600383	金地集团	32,794,325.43	0.67
9	601988	中国银行	31,567,970.90	0.64
10	000039	中集集团	30,264,759.77	0.61
11	600009	上海机场	29,570,405.53	0.60
12	600801	华新水泥	27,026,703.39	0.55
13	601318	中国平安	25,324,911.69	0.51
14	000581	威孚高科	25,085,792.02	0.51
15	600027	华电国际	22,798,297.41	0.46
16	601238	广汽集团	22,519,757.68	0.46
17	600011	华能国际	20,689,657.52	0.42
18	000157	中联重科	20,583,012.15	0.42
19	600585	海螺水泥	12,432,804.75	0.25
20	300133	华策影视	11,624,432.97	0.24

注:本项"买入金额"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	601628	中国人寿	215,811,429.78	4.38
2	600048	保利地产	90,245,845.41	1.83
3	600887	伊利股份	84,369,487.86	1.71
4	000651	格力电器	50,342,956.49	1.02
5	300133	华策影视	49,009,789.68	1.00
6	002051	中工国际	45,463,611.02	0.92
7	601088	中国神华	44,829,530.43	0.91
8	600031	三一重工	44,395,089.83	0.90
9	600893	航空动力	42,978,948.47	0.87
10	000858	五 粮 液	39,268,544.22	0.80
11	600030	中信证券	26,665,488.19	0.54
12	600859	王府井	25,056,188.11	0.51
13	600027	华电国际	20,171,916.76	0.41
14	600694	大商股份	19,897,097.81	0.40
15	600011	华能国际	19,725,214.74	0.40
16	600018	上港集团	19,227,335.28	0.39
17	601633	长城汽车	18,612,553.20	0.38
18	601766	中国南车	13,489,278.15	0.27
19	600837	海通证券	12,371,784.47	0.25
20	002656	卡奴迪路	11,867,133.04	0.24

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	809,317,177.00
卖出股票收入(成交)总额	1,015,789,998.21

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	931,701,000.00	22.82
	其中:政策性金融债	931,701,000.00	22.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	47,339,015.70	1.16