

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。
本报告期指2013年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

基金名称	博时主题行业股票证券投资基金
基金简称	博时主题 (LOF)
场内简称	博时主题
基金代码	160505
交易代码	160505
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2005年1月6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	6,229,216,933.09份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005年12月22日

2.2基金产品说明

投资目标	分享中国城市化、工业化及消费升级过程中经济与资本市场的高速成长,谋求基金资产的长期稳定增长。
投资策略	本基金采取价值投资指导下的行业增强型主动投资策略
业绩比较基准	80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数
风险收益特征	本基金是一只主动型的股票基金,基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下,谋求实现基金资产的长期稳定增长。

2.3基金管理人

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: 孙麒麟 联系电话: 0755-83169999 电子邮箱: service@bosera.com	姓名: 田青 联系电话: 010-67595096 电子邮箱: tianqing@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

查阅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

主要会计数据和财务指标	金额单位:人民币元
-------------	-----------

3.1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	208,173,247.57
本期利润	-1,054,727,733.72
加权平均基金份额本期利润	-0.1599
本期基金份额净值增长率	-9.80%
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	0.0480
期末基金资产净值	9,644,304,512.88
期末基金份额净值	1.548

注:本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数。
由于基金资产净值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法得到基准指数的时间序列。

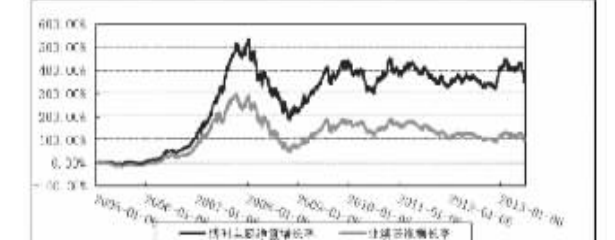
3.2自基金合同生效以来基金业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
----	---------	--------	-----------	-----	-----

过去一个月	-11.85%	1.78%	-12.43%	1.48%	0.30%
过去三个月	-7.47%	1.41%	-8.99%	1.13%	0.28%
过去六个月	-9.80%	1.45%	-8.86%	1.16%	0.29%
过去一年	-1.46%	1.25%	-8.53%	1.08%	0.17%
过去三年	14.19%	1.20%	-10.38%	1.10%	24.57%
自基金合同生效起至今	362.95%	1.43%	98.95%	1.50%	264.00%

注:本基金的业绩比较基准为:80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数。
由于基金资产净值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法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业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的基金合同于2005年1月6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基金合同第十二条“(五)投资范围”、“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合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1基金管理人及基金情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的情况
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)、瑞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证券投资的资产管理机构。
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二十七只开放式基金和两只封闭式基金,并且是全国社会保障基金理事會委托管理部分社保基金,以及多年年金账户。公募基金资产规模逾1065.69亿元人民币,累计分红60.92亿元人民币,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业内名列前茅。

4.1.2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,博时稳健今年以来净值增长率先在328只标准型股票基金中排名前13。灵活配置型股票基金中,博时回报今年以来收益率先在71只同类基金中排名第八。
2. 固定收益方面,博时信用债纯债基金今年以来收益率先在17只固定收益型债券型基金中排名第1;博时裕祥分级债券A今年以来收益率先在19只封闭式债券型子基金(优先份额)中名列第二。
3. 海外投资方面,博时标普500今年以来净值增长率先在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%。

4.2客户报告

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。
2. 其他大事件
1) 2013年3月29日,由证券时报社主办的2012年度中国基金明星颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业股票证券投资基金荣获 2012年度股票型基金金奖。
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“金牛基金管理人”奖,博时基金价值投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得“金牛基金十年特别奖”,博时现金收益荣获 2012年度货币市场基金金牛奖。

3) 2013年4月,在股市动态分析杂志主办的 2012基金公司产品管理与营销策划能力排行榜”评选活动,博时标普500指数基金获得 2012年基金公司产品营销策划奖。
4) 2013年4月10日,由上海证券报举办的第十届“金基金”颁奖盛典在上海举行,博时基金荣获“基金十年”、“卓越公司奖”,博时裕阳封闭和博时裕利封闭荣获“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·普益财富基金论坛”在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选活动“年度最佳资产管理基金公司”。

6) 2013年6月26日,世界品牌实验室《WBL》在京发布2013年度“第10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基金业绩

姓名	职务	在本基金基金经理(助理)任期	证券从业年限	说明
邓晓峰	基金经理/股票投资部总经理/价值投资总监	2007-3-14	11.5	1996年起先后在深圳市银业工贸有限公司、国泰君安证券股份有限公司工作。2005年加入博时公司,历任基金经理助理、社保股票基金经理、现任股票投资部总经理、价值投资总监、兼任博时主题行业股票(LOF)基金基金经理、社保股票基金基金经理。

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、《博时主题行业股票证券投资基金合同》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,为基金份额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,没有损害基金份额持有人的利益。

4.3管理人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.市场回顾

年初普遍预期经济复苏的状态没有持续。中央调控下,清理银行的行为限制了地方的投资冲动,经济复苏的过程中断。悲观预期之下,市场以卖出蓝筹、参与创业板的方式应对。一次次不利的经济数据出炉,一次次中央的调控措施都推动资金从蓝筹股转向创业板,而创业板的不断上涨也形成了自我强化的。主板与创业板的分化达到新的水平。

博时主题行业股票证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:吴晓东 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 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收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、红利时暂按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计缴20%的个人所得税,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,暂按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂按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所有关联方

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

关联方名称	本期	上年度可比期间
成交金额	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
招商证券	1,017,071,033.53	503,838,821.27

6.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期	上年度可比期间
当期	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
佣金	870,371.21	582,783.20

关联方名称	本期	上年度可比期间
佣金	411,151.06	9,516,411.51

注:上述佣金参考市场公允价格并经基金管理人及对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费和经手费后的净额列示。

2. 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等服务。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

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

注:支付基金管理人博时基金的基金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

项目	本期	上年度可比期间
2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日	
当期发生的基础支付的管理费	14,056,826.56	13,525,582.11

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

元。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

元。

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

元。

6.4.4.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

元。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

元。

6.4.5 期末2013年6月30日 本基金持有的流通受限证券

元。

§ 7 投资组合报告

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,034,484,595.87	92.95
2	其中:股票	9,034,484,595.87	92.95
3	其中:债券	11,346,675.50	0.12

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,497,943.25	0.16
C	制造业	2,498,342,822.25	25.90
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	1,326,211,158.44	13.75
E	建筑业	637,650,000.00	6.61
F	批发和零售业	39,617,266.23	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	16,940,000.00	0.18
H	信息、软件和信息技术服务业	162,800,000.00	1.69
I	金融业	3,584,301,926.89	37.16
J	房地产业	590,999,704.50	6.13
K	租赁和商务服务业	-	-
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施服务业	-	-
N	居民服务、修理和其他服务业	-	-
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	162,123,774.32	1.68
合计		9,034,484,595.87	93.68

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

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	600138	中国平安	25,199,477	875,933,611.96	9.08
2	600896	招商证券	228,006,904	773,705,335.52	8.02
3	601601	中国铁建	42,753,776	687,607,651.68	7.06
4	601668	中国铝业	195,000,000	631,060,000.00	6.61
5	000002	万科A	59,999,970	590,999,704.50	6.13
6	600036	招商银行	44,981,795	521,788,822.00	5.41
7	600104	上汽集团	36,025,163	475,892,403.23	4.93
8	601028	中国中冶	30,500,000	417,545,000.00	4.33
9	601336	新华保险	14,811,825	366,000,195.75	3.79
10	600674	川投能源	31,885,488	324,275,412.96	3.36

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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	359,054,205.99	3.10
2	600674	川投能源	265,667,337.93	2.30
3	000527	美的电器	257,708,833.35	2.23
4	601166	兴业银行	251,195,995.81	2.17
5	000058	五粮液	234,609,919.47	2.03
6	601601	中国铁建	232,737,266.52	2.03
7	601336	新华保险	231,454,406.62	2.00
8	600390	青岛啤酒	229,760,431.23	1.99
9	000063	中兴通讯	213,601,614.95	1.85
10	600805	信达投资	165,170,303.52	1.43
11	601633	长城汽车	144,106,111.07	1.28
12	600896	招商证券	137,493,912.51	1.19
13	601318	中国平安	124,933,249.48	1.09
14	600837	海南发展	107,304,827.33	0.93
15	600360	中信证券	97,989,357.99	0.85
16	600761	安徽合力	78,460,294.52	0.68
17	600000	浦发银行	70,570,148.18	0.61
18	600016	民生银行	69,083,334.34	0.60
19	000418	小天鹅A	64,831,843.28	0.56
20	600585	海康威视	58,874,731.11	0.51

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

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	359,054,205.99	3.10
2	600674	川投能源	265,667,337.93	2.30
3	000527	美的电器	257,708,833.35	2.23
4	601166	兴业银行	251,195,995.81	2.17
5	000058	五粮液	234,609,919.47	2.03
6	601601	中国铁建	232,737,266.52	2.03
7	601336	新华保险	231,454,406.62	2.00
8	600390	青岛啤酒	229,760,431.23	1.99
9	000063	中兴通讯	213,601,614.95	1.85
10	600805	信达投资	165,170,303.52	1.43
11	601633	长城汽车	144,106,111.07	1.28
12	600896	招商证券	137,493,912.51	1.19
13	601318	中国平安	124,933,249.48	1.09
14	600837	海南发展	107,304,827.33	0.93
15	600360	中信证券	97,989,357.99	0.85
16	600761	安徽合力	78,460,294.52	0.68
17	600000	浦发银行	70,570,148.18	0.61
18	600016	民生银行	69,083,334.34	0.60
19	000418	小天鹅A	64,831,843.28	0.56</