

博时特许价值股票型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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,维护持有人利益,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。估值委员会成员由基金运营的副总经理、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致性;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人作出合理解释,通过双方协商一致意见。会计师事务所对于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。

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。
 6.4.4.4关联方及上年度可比期间的关联交易
 6.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易
 6.4.4.1.1股票交易无。
 6.4.4.1.2权证交易无。
 6.4.4.1.3应支付关联方的佣金无。
 6.4.4.2关联方报酬
 6.4.4.2.1基金管理费

项目	本期	上期可比期间
当期发生的基金支付的管理费	5,572,894.27	1,240,941.07
其中:支付基金托管人博时基金的管理费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:日管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。	5,572,894.27	1,240,941.07

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与关联方为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
 6.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况无。
 6.4.4.4.2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。
 6.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期	上期可比期间
中国建设银行	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
期末余额	3,226,991.32	7,455,646.16
当期利息收入	839,574.52	798,838.79

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本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况无。
 6.4.5利润分配情况无。
 6.4.6期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券
 6.4.6.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券无。
 6.4.6.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末持仓数量(股)	期末公允价值	期末账面余额	备注
000829	金城医药	2014-5-12	公告重大事项	6,87	254,747.63	254,190.00	—
002090	金智科技	2014-6-23	公告重大事项	14,30	507,370.90	588,731.00	—
300025	华星创业	2014-6-16	公告重大事项	15,64	758,984.96	837,048.00	—
300049	汇创世纪	2014-6-16	公告重大事项	6,14	56,801.00	62,900.00	—
300137	新亚制程	2014-6-16	公告重大事项	20,86	372,807.48	362,964.00	—
300199	翰宇药业	2014-2-20	公告重大事项	26,63	578,149.59	628,468.00	—
300271	华宇制药	2014-6-27	公告重大事项	40,30	421,201.00	435,240.00	—
600378	天利科技	2014-6-18	公告重大事项	12,84	303,995.00	303,024.00	—
600606	长城铝业	2014-5-27	公告重大事项	10,25	246,527.00	246,500.00	—
600637	冠城大通	2014-5-29	公告重大事项	32,03	116,736.91	90,324.00	—
600758	广汇能源	2014-6-27	公告重大事项	4,85	1,232,426.91	1,130,465.00	—
600855	华联发展	2014-2-11	公告重大事项	13,40	950,860.50	1,107,349.00	—

注:本基金截至2014年6月30日正持有以上因公布的重大的事项可能产生重大影响而被暂时停牌的交易,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。
 6.4.6.3期末债券正回购到期交易中作为抵押的债券
 6.4.6.3.1银行间市场债券正回购无。
 6.4.6.3.2交易所市场债券正回购无。

序号	投资组合	金额(人民币元)
1	权益投资	356,985,325.90
2	其中:股票	356,985,325.90
3	固定收益投资	4,426,770.00
4	其中:债券	4,426,770.00
5	资产支持证券投资	—
6	衍生金融资产	—
7	其他资产	20,483,772.21
8	负债	4,641,662.72
9	净资产	366,809,589.83

注:本基金截至2014年6月30日正持有以上因公布的重大的事项可能产生重大影响而被暂时停牌的交易,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。
 6.4.6.3.1银行间市场债券正回购无。
 6.4.6.3.2交易所市场债券正回购无。

序号	投资组合	金额(人民币元)
1	权益投资	356,985,325.90
2	其中:股票	356,985,325.90
3	固定收益投资	4,426,770.00
4	其中:债券	4,426,770.00
5	资产支持证券投资	—
6	衍生金融资产	—
7	其他资产	20,483,772.21
8	负债	4,641,662.72
9	净资产	366,809,589.83

注:本基金截至2014年6月30日正持有以上因公布的重大的事项可能产生重大影响而被暂时停牌的交易,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。
 6.4.6.3.1银行间市场债券正回购无。
 6.4.6.3.2交易所市场债券正回购无。

序号	投资组合	金额(人民币元)
1	权益投资	356,985,325.90
2	其中:股票	356,985,325.90
3	固定收益投资	4,426,770.00
4	其中:债券	4,426,770.00
5	资产支持证券投资	—
6	衍生金融资产	—
7	其他资产	20,483,772.21
8	负债	4,641,662.72
9	净资产	366,809,589.83

代码	行业名称	持仓数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,315,895.48	—	0.87
B	采矿业	22,627,624.30	—	3.84
C	制造业	18,089,638.17	—	36.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	238,136,691.14	—	42.36
E	建筑业	16,249,779.37	—	2.62
F	批发和零售业	33,538,186.93	—	8.89
G	交通运输、仓储和邮政业	5,577,539.35	—	1.20
H	住宿和餐饮业	12,362,086.65	—	3.24
I	信息技术业	94,461,196.82	—	22.20
J	金融业	21,547,632.29	—	5.62
K	房地产业	1,947,568.41	—	0.51
M	科学研究和技术服务业	1,281,001.71	—	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	8,249,637.80	—	2.16
O	医药、生物和医药服务业	13,577,454.60	—	3.68
P	教育	—	—	—
Q	综合	418,648.00	—	0.11
R	文化、体育和娱乐业	428,130.00	—	0.11
S	综合	1,864,387.00	—	0.49
合计		356,985,325.90	—	93.56

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	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。
 7.4报告期内基金投资情况的重大变动
 7.4.1累计买入股票投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。
 7.4报告期内基金投资情况的重大变动
 7.4.1累计买入股票投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。
 7.4报告期内基金投资情况的重大变动
 7.4.1累计买入股票投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。
 7.4报告期内基金投资情况的重大变动
 7.4.1累计买入股票投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。
 7.4报告期内基金投资情况的重大变动
 7.4.1累计买入股票投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。
 7.4报告期内基金投资情况的重大变动
 7.4.1累计买入股票投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。
 7.4报告期内基金投资情况的重大变动
 7.4.1累计买入股票投资期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600053	建发股份	2,628,264	4,526,079.80	1.24
2	601318	中国平安	339,285	12,993,411.00	3.43
3	601166	兴业银行	1,183,904	11,874,537.12	3.11
4	600739	辽宁成大	760,752	11,586,252.96	3.04
5	600004	平安银行	942,540	9,340,571.40	2.45
6	600000	浦发银行	1,023,256	9,269,466.80	2.43
7	600986	中国铁建	847,314	7,957,048.56	2.09
8	600039	民生银行	1,259,176	7,800,852.96	2.04
9	600085	海南机场	409,653	7,767,345.16	2.02
10	600649	厦门国贸	297,600	7,560,310.00	1.98

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读披露于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文