（上接D31版）

（9）大通证券股份有限公司
注册地址：辽宁省大连市中山区人民路24号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：于宏民
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
传真：0411-39673219
客户服务电话：4008169169
网址：http://www.dalton.com.cn
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
（三）场内代销机构可以通过深圳证券交易所网站查询。
（四）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京西城区太平桥大街17号 @法定代表人：金颖 @电话：010-58598839
传真：010-58598834
联系人：朱立元
（五）律师事务所
机构名称：国浩律师集团（北京）事务所
注册地址：北京市东城区建国门内大街贡院六号E座9层
办公地址：北京市东城区建国门内大街贡院六号E座9层
负责人：王卫东
电话：010-65171188
传真：010-65176800
联系人：黄伟民
经办律师：黄伟民、陈周
（六）会计师事务所
机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：上海市浦东新区东昌路568号
办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：张鸿
经办注册会计师： 汪棣、张鸿

**四、基金的名称**
博时主题行业股票证券投资基金

**五、基金的类型**
契约型上市开放式

**六、基金的投资目标**
分享中国城市化、工业化及消费升级进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。

**七、投资方向**
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发售上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。
本基金主要投资于股票，股票资产占基金净值的比例范围为60%-95%。基金保留的现金以及投资于到期在1年期以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计不低于5%。在基金实际管理过程中，管理人将根据中国证券市场的阶段性变化，适时动态调整基金资产在股票、债券及现金间的配置比例。
本基金用于股票投资的资金中，不低于80%的资金将投资于消费品、基础设施和原材料类上市公司，同时，本基金将根据证券市场的阶段性变化，以不超过股票投资20%的部分投资于消费品、基础设施及原材料以外行业中价值被低估的上市公司股票。

**八、投资策略**
本基金采取价值策略指导下的行业增强型主动投资策略。
1. 行业基准权重
由于本基金的业绩基准为富时中国A600指数，因此，本基金的股票资产在消费品、基础设施及原材料等三大行业的配置比例将以富时中国A600指数中消费品、基础设施及原材料等三大行业的权重作为配置基准。在基金的实际投资管理中，本基金将根据行业投资价值评估，结果结合个股精选结果，动态调整基金资产在消费品、基础设施及原材料等三大行业间的投资比例。
2. 行业权重的动态调整策略
本基金将通过对消费品、基础设施及原材料等三大行业及各大行业所覆盖的细分行业的产业环境、产业政策和竞争格局的分析与预测，确定行业经济变量的变动对三大行业及不同细分行业的潜在影响，得出各细分行业投资评级并据此调整基金股票资产在消费品、基础设施及原材料等三大行业及其所覆盖的细分行业的配置比例。
本基金将通过基金管理人开发的行业投资评级系统，以三大行业所覆盖的各细分行业为研究对象，从行业成长性、行业盈利能力及行业景气周期三个方面对行业进行投资评级。在各细分行业中，成长性和盈利能力合适的行业，同时具有持续增长前景或正处于景气回升开始或持续阶段的子行业，是本基金增强配置的目标。
具体地，本基金根据以下三方面对细分行业进行投资评级：
（1）评估行业成长性
行业成长性是影响行业盈利能力的重要因素之一。行业成长的动力来源于消费、投资及出口的拉动，本基金将通过对各细分行业横断面分析评估行业短期及长期增长前景。行业所在市场的演进阶段也是影响行业长的重要因素，行业在导入、成长、成熟等不同阶段，行业增长速度会有较大差异。进口占行业销售比例高的行业，进口替代的空间大，行业增长的前景要好于出口比例高的行业。
（2）评估行业盈利能力
评估行业盈利能力的目的在于从定性角度把握行业将增长转化为利润的潜力。行业的盈利能力是由行业对其产品或服务的定价能力、行业集中度、资本密集度等因素决定的。由于自然或政策管制以及品牌、行业集中度高所形成垄断或准垄断会增强行业的定价能力，从而提高行业盈利能力。资本密集度过高、供应商的侃价能力过强以及所提供产品的同质性均会降低行业的盈利能力。
（3）评估行业当前所处的景气周期
本基金将通过分析研究各细分行业净资产收益率、固定资产周转率、存货及应收款周转率、产品或服务价格指数等因素的时间序列的波动特征来评估行业当前所处景气周期。
综合以上三方面评估，基金管理人的行业研究团队将会给出各细分行业的投资评级报告，本基金的行业投资评级分五类，即强烈增强、增强、中性、减配、强烈减配。基金经理将根据行业评级报告及自身判断，对投资组合的行业权重进行调整。
股票组合方面，在主题行业策略指导下，本基金通过行业定位、价值过滤和个股精选构建投资组合阶段。
3. 股票选择策略
本基金将根据上市公司所处行业的风格特征设计股票选择流程和选股变量，具体分三步进行：
第一步：上市公司风格划分，即根据上市公司及其所处行业过去业绩波动特征，采用经营杠杆、投资资金回报率（ROIC，Return on Investment Capital）等指标将全部上市公司分成平稳增长与周期波动两大类别。
第二步：股票初选，即使用基金管理人开发的平稳增长及周期性股票选择模型对全部消费品、基础设施及原材料类上市公司进行初步甄选，以过滤掉大部分不具备竞争力的非主流企业。
对于消费品、基础设施及原材料等三个行业中平稳增长型公司，本基金采用ROIC模型进行筛选，该模型在筛选中主要采用投资资金（IC）、息税后经营性利润（NOPAT）、投资资金回报率（ROIC）、每股息税后经营性利润（OEPS）等表征主营业务健康状况的系列指标。对于上述三个行业中周期性公司，本基金采用周期性股票选择模型进行筛选，该模型在筛选中主要采用经营杠杆、固定资产周转率、应收款及存货周转率、投资资金回报率等反映周期性公司主营业务阶段特征的系列指标。
在完成第二步筛选后，本基金还须对上市公司进行财务诊断，即对上市公司进行财务信息真实性判断及可比性调整，以尽量避免财务欺诈及建立上市公司间业绩的横向可比性。
第三步：个股精选，基金管理人将组织内外部各种研究资源，进行细分行业和重点公司两个层次的研究。
细分行业研究的工作重点是在消费品、基础设施及原材料行业，寻找最具发展潜力的子行业并对其驱动力进行分析研究，以便对各子行业进行配置。而重点公司的研究则是对财务基础稳固、行业地位突出、竞争优势逐渐凸现、治理结构完善且未来增长明确的公司进行深入研究和跟踪。
在完成上述三个步骤的选股流程后，本基金以中国证监会的行业划分标准为基础，以GICS行业分类标准为原则，建立消费品、基础设施及原材料等三个行业精选股票池，并以此作为基金构建投资组合的依据。
4. 债券投资策略
本基金可投资于国债、金融债和企业债（包括可转债），以分散风险，调节投资于股票可能带来的收益波动，使基金收益表现更加稳定；同时满足基金资产对流动性的要求。本基金在进行债券投资时，一方面重点分析利率走势和发行人的基本面情况，综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性等因素；另一方面，综合考虑宏观经济数据，包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。

**九、基金的业绩比较基准**
本基金业绩比较基准为：80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数
富时中国A600指数是富时公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的600只股票并以流通股本加权的股票指数，是目前中国证券市场中与本基金股票投资范围比较适配同时公信力较好的股票指数。
本基金的股票投资比例范围为：60%-95%，虽然股票最高投资比例可达到95%，但这一投资比例所对应的是阶段性、非常态的资产配置比例。在一般市场状况下，为控制基金风险，本基金股票投资比例会控制在80%以内。所以，本基金加入20%的富时中国国债指数与80%的富时中国A600指数一起构成本基金的业绩比较基准。

**十、基金的风险收益特征**
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。

**十一、基金的投资组合报告**
博时基金管理人的董事会及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责任。
基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的净值表现和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。
本投资组合报告所载数据截至2011年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。
1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 9,832,036,776.50 | 83.06 |
| | 其中：股票 | 9,832,036,776.50 | 83.06 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,123,541,903.80 | 9.49 |
| | 其中：债券 | 1,123,541,903.80 | 9.49 |
| | 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合计 | 88,571,840.16 | 0.75 |
| 6 | 其他资产 | 792,833,806.21 | 6.70 |
| 7 | 合计 | 11,836,984,326.67 | 100.00 |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采掘业 | 170,745,511.34 | 1.45 |
| C | 制造业 | 3,067,319,695.44 | 25.98 |
| C0 | 食品、饮料 | 638,341,778.36 | 5.41 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,095,000.00 | 0.01 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 66,819,609.49 | 0.57 |
| C5 | 电子 | 5,011,180.00 | 0.04 |
| C6 | 金属、非金属 | 457,915,857.72 | 3.88 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,767,645,949.67 | 14.97 |
| C8 | 医药、生物制品 | 130,490,320.20 | 1.11 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 482,668,396.91 | 4.09 |
| E | 建筑业 | 869,344,027.63 | 7.36 |
| F | 交通运输、仓储业 | 904,995,000.00 | 7.67 |
| G | 信息技术业 | 88,960,674.86 | 0.75 |
| H | 批发和零售贸易 | 184,798,462.73 | 1.57 |
| I | 金融、保险业 | 2,572,834,172.26 | 21.79 |
| J | 房地产业 | 1,490,370,835.33 | 12.62 |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 9,832,036,776.50 | 83.28 |

3、报告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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000002 | 万科A | 125,043,403 | 1,056,616,755.35 | 8.95 |
| 2 | 600104 | 上海汽车 | 55,949,126 | 1,048,486,621.24 | 8.88 |
| 3 | 601006 | 大秦铁路 | 110,500,000 | 904,995,000.00 | 7.67 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 215,718,121 | 869,344,027.63 | 7.36 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 56,500,000 | 735,630,000.00 | 6.23 |
| 6 | 601398 | 工商银行 | 151,000,000 | 673,460,000.00 | 5.70 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 12,415,306 | 443,474,730.32 | 3.76 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 9,119,735 | 440,209,608.45 | 3.73 |
| 9 | 600660 | 福耀玻璃 | 34,583,577 | 358,285,857.72 | 3.03 |
| 10 | 600886 | 国投电力 | 49,047,834 | 355,596,796.50 | 3.01 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 547,470,000.00 | 4.64 |
| 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 | 576,071,903.80 | 4.88 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,123,541,903.80 | 9.52 |

5、报告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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 110009 | 11附息国债09 | 5,500,000 | 547,470,000.00 | 4.64 |
| 2 | 113002 | 工行转债 | 3,965,620 | 469,807,001.40 | 3.98 |
| 3 | 110013 | 国投转债 | 792,480 | 94,566,638.40 | 0.80 |
| 4 | 113001 | 中行转债 | 110,800 | 11,698,264.00 | 0.10 |

6、报告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、报告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。
8、投资组合报告附注
（1）本报告期内本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的情况。本基金投资的前十名证券的发行主体除五粮液（000858）外，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
五粮液（000858）2011年5月28日发布公告称，该公司于2011年5月27日收到中国证监会《行政处罚通知书》（[2011]17号），公司因信息披露问题受到证监会行政处罚。
对该股票投资决策程序的说明：
根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。
（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。
（3）其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,572,159.68 |
| 2 | 应收证券清算款 | 716,543,297.80 |
| 3 | 应收股利 | 63,944,100.00 |
| 4 | 应收利息 | 5,721,470.77 |
| 5 | 应收申购款 | 4,052,777.96 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 792,833,806.21 |

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113002 | 工行转债 | 469,807,001.40 | 3.98 |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 11,698,264.00 | 0.10 |

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
（6）其他需说明的重要事项
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。

**十二、基金的业绩**
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
自基金合同生效开始，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

| 期间 | ①净值增长率 | ②净值增长率标准差 | ③业绩比较基准收益率 | ④业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2011.1.1-2011.6.30 | 4.00% | 1.04% | -3.35% | 1.00% | 7.35% | 0.04% |
| 2010年 | -10.61% | 1.41% | -5.55% | 1.24% | -5.06% | 0.17% |
| 2009年 | 71.51% | 1.40% | 71.73% | 1.63% | -0.22% | -0.23% |
| 2008年 | -48.14% | 2.19% | -55.61% | 2.44% | 7.47% | -0.25% |
| 2007年 | 188.61% | 1.71% | 112.31% | 1.83% | 76.30% | -0.12% |
| 2006年 | 104.88% | 1.16% | 89.01% | 1.12% | 15.87% | 0.04% |
| 2005.1.6-2005.12.31 | 3.09% | 0.82% | -7.93% | 1.10% | 11.02% | -0.28% |
| 2005.1.6-2011.6.30 | 404.12% | 1.50% | 157.07% | 1.61% | 247.05% | -0.11% |

**十三、费用概览**
（一）与基金运作有关的费用
1、基金管理人的管理费
基金管理人的管理费按前一日的基金资产净值的1.5%年费率计提。
2、 托管人的托管费
基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的2.5‰的年费率计提。
3、其他费用
其它与基金运作有关的费用，如证券交易费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费、法定信息披露费等其他费用，根据国家有关规定和基金合同约定，按费用实际支出金额，列入当期基金费用。
（二）与基金销售有关的费用
1、申购和赎回费率
申购、赎回费率表

| 申购金额区间 | 场外申购费率 | 场内申购费率 |
|---|---|---|
| 小于50万元 | 1.5% | |
| 大于等于50万元小于500万元 | 1.2% | |
| 大于等于500万元小于1000万元 | 0.6% | |
| 大于等于1000万元 | 收取固定费用1000元 | |
| **持有基金份额期限** | **场外赎回费率** | **场内赎回费率** |
| 小于两年 | 0.5% | 0.5% |
| 大于等于两年小于三年 | 0.25% | |
| 大于等于三年 | 0% | |

2、本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用于本基金的市场推广和销售。
3、赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用的25%归基金资产，余额用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
4、基金管理人可以根据情况调整申购费率，但最高不超过1.5%。基金管理人可以根据情况调低赎回费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在指定媒体上公告。
（三）不列入基金费用的项目
基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。
（四）基金管理费和托管费的调整
基金管理人和基金托管人可以就商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

**十四、对招募说明书更新部分的说明**
本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2011年2月19日刊登的本基金原招募说明书《博时主题行业股票证券投资基金更新招募说明书》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：
1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人博时基金管理公司的基本情况进行了更新；
2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人中国建设银行股份有限公司的基本情况及相关业务经营情况进行了更新；
3、在“五、相关服务机构”中，增加了部分代销机构并更新了相关服务机构的内容；
4、在“二、基金的投资”中，更新了“（三）业绩比较基准”，将原业绩基准“80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数”更改为“80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数”，更新了“九、基金投资组合报告”，数据内容截止时间为2011年6月30日，财务数据未经审计；
5、在“三、基金的业绩”中，更新了“自基金合同生效开始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”的数据及列表内容，数据内容截止时间为2011年6月30日；
6、在“二十五、其它应披露事项”中披露了报告期内我公司在指定信息披露媒体上披露的与本基金相关的所有公告。

**博时基金管理有限公司**
**2011年8月19日**

（上接D29版）

母公司现金流量表
2011年1-6月
单位：元 币种：人民币

| 项目 | 附注 | 本期金额 | 上期金额 |
|---|---|---|---|
| 一、经营活动产生的现金流量： | | | |
| 销售商品、提供劳务收到的现金 | | 13,150,212,565.14 | 9,623,980,448.61 |
| 收到的税费返还 | | - | |
| 收到其他与经营活动有关的现金 | | 307,347,554.49 | 13,971,186.22 |
| 经营活动现金流入小计 | | 13,457,560,119.63 | 9,637,951,634.83 |
| 购买商品、接受劳务支付的现金 | | 12,993,859,051.59 | 10,205,574,161.34 |
| 支付给职工以及为职工支付的现金 | | 266,857,544.75 | 216,118,051.59 |
| 支付的各项税费 | | 265,195,867.89 | 154,350,695.02 |
| 支付其他与经营活动有关的现金 | | 70,306,157.93 | 60,933,123.11 |
| 经营活动现金流出小计 | | 13,596,218,622.16 | 10,636,976,031.06 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | | -138,658,502.53 | -999,024,396.23 |
| 二、投资活动产生的现金流量： | | | |
| 收回投资收到的现金 | | | |
| 取得投资收益收到的现金 | | 11,384,625.83 | |
| 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额 | | - | |
| 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额 | | | |
| 收到其他与投资活动有关的现金 | | | |
| 投资活动现金流入小计 | | 11,384,625.83 | |
| 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 | | 55,097,543.41 | 76,132,824.83 |
| 投资支付的现金 | | 621,120,936.29 | 206,096,000.00 |
| 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额 | | | - |
| 支付其他与投资活动有关的现金 | | | - |
| 投资活动现金流出小计 | | 676,218,479.70 | 282,228,824.83 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | | -664,833,853.87 | -282,228,824.83 |
| 三、筹资活动产生的现金流量： | | | |
| 吸收投资收到的现金 | | | - |
| 取得借款收到的现金 | | 3,268,477,840.00 | 3,183,546,940.00 |
| 发行债券收到的现金 | | 3,959,000,000.00 | |
| 收到其他与筹资活动有关的现金 | | | |
| 筹资活动现金流入小计 | | 7,227,477,840.00 | 3,183,546,940.00 |
| 偿还债务支付的现金 | | 4,578,566,251.25 | 1,515,000,000.00 |
| 分配股利、利润或偿付利息支付的现金 | | 117,891,391.25 | 140,951,177.10 |
| 支付其他与筹资活动有关的现金 | | 8,503,876.36 | - |
| 筹资活动现金流出小计 | | 4,704,961,518.86 | 1,655,951,177.10 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | 2,522,516,321.14 | 1,527,595,762.90 |
| 四、汇率变动对现金及现金等价物的影响 | | | |
| 五、现金及现金等价物净增加额 | | 1,719,023,964.74 | 246,342,541.84 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | | 698,306,975.81 | 620,577,154.28 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | | 2,417,330,940.55 | 866,919,696.12 |

法定代表人：杨思明 主管会计工作负责人：梅家秀 会计机构负责人：赵瑞江

合并所有者权益变动表
2011年1-6月
单位：元 币种：人民币

| 项目 | 本期金额 | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 归属于母公司所有者权益 | | | | | | | 少数股东权益 | 所有者权益合计 |
| | 实收资本（或股本） | 资本公积 | 减：库存股 | 专项储备 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | 其他 | |
| 一、上年年末金额 | 3,875,752,457.00 | 404,824,894.87 | | 42,466,509.56 | 658,676,402.50 | | 5,169,383,940.84 | -6,137,452.35 | 7,416,811.61 | 10,152,383,564.03 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | | | |
| 二、本年年初金额 | 3,875,752,457.00 | 404,824,894.87 | | 42,466,509.56 | 658,676,402.50 | | 5,169,383,940.84 | -6,137,452.35 | 7,416,811.61 | 10,152,383,564.03 |
| 三、本期增减变动金额（减少以"-"号填列） | | | | -5,271,353.42 | | | 586,126,714.67 | -1,108,738.30 | 375,850.57 | 580,122,273.52 |
| （一）净利润 | | | | | | | 586,126,714.67 | | 375,850.57 | 586,502,565.24 |
| （二）其他综合收益 | | | | | | | | -1,108,738.30 | | -1,108,738.30 |
| 上述（一）和（二）小计 | | | | | | | 586,126,714.67 | -1,108,738.30 | 375,850.57 | 585,393,826.94 |
| （三）所有者投入和减少资本 | | | | | | | | | | |
| 1.所有者投入资本 | | | | | | | | | | |
| 2.股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | | | |
| 3.其他 | | | | | | | | | | |
| （四）利润分配 | | | | | | | | | | |
| 1.提取盈余公积 | | | | | | | | | | |
| 2.提取一般风险准备 | | | | | | | | | | |
| 3.对所有者（或股东）的分配 | | | | | | | -67,392,000.00 | | | -67,392,000.00 |
| 4.其他 | | | | | | | | | | |
| （五）所有者权益内部结转 | | | | | | | | | | |
| 1.资本公积转增资本（或股本） | | | | | | | | | | |
| 2.盈余公积转增资本（或股本） | | | | | | | | | | |
| 3.盈余公积弥补亏损 | | | | | | | | | | |
| 4.其他 | | | | | | | | | | |
| （六）专项储备 | | | | | | | | | | |
| 1.本期提取 | | | | | | | | | | |
| 2.本期使用 | | | | | | | | | | |
| （七）其他 | | | | | | | | | | |
| 四、本期期末金额 | 3,875,752,457.00 | 404,824,894.87 | | 37,194,956.14 | 658,676,402.50 | | 5,755,510,655.52 | -7,246,190.65 | 7,792,662.18 | 10,732,505,837.55 |

法定代表人：杨思明 主管会计工作负责人：梅家秀 会计机构负责人：赵瑞江

母公司所有者权益变动表
2011年1-6月
单位：元 币种：人民币

| 项目 | 本期金额 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 实收资本（或股本） | 资本公积 | 减：库存股 | 专项储备 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、上年年末金额 | 3,875,752,457.00 | 2,060,352,421.29 | | 5,194,514.43 | 658,676,402.50 | | 1,167,144,613.20 | 7,767,120,408.42 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | |
| 二、本年年初金额 | 3,875,752,457.00 | 2,060,352,421.29 | | 5,194,514.43 | 658,676,402.50 | | 1,167,144,613.20 | 7,767,120,408.42 |
| 三、本期增减变动金额（减少以"-"号填列） | | | | 1,388,981.56 | | | 13,936,513.58 | 15,325,495.14 |
| （一）净利润 | | | | | | | 13,936,513.58 | 13,936,513.58 |
| （二）其他综合收益 | | | | | | | | |
| 上述（一）和（二）小计 | | | | | | | 13,936,513.58 | 13,936,513.58 |
| （三）所有者投入和减少资本 | | | | | | | | |
| 1.所有者投入资本 | | | | | | | | |
| 2.股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | |
| 3.其他 | | | | | | | | |
| （四）利润分配 | | | | | | | | |
| 1.提取盈余公积 | | | | | | | | |
| 2.对所有者（或股东）的分配 | | | | | | | | |
| 3.其他 | | | | | | | | |
| （五）所有者权益内部结转 | | | | | | | | |
| 1.资本公积转增资本（或股本） | | | | | | | | |
| 2.盈余公积转增资本（或股本） | | | | | | | | |
| 3.盈余公积弥补亏损 | | | | | | | | |
| 4.其他 | | | | | | | | |
| （六）专项储备 | | | | 1,388,981.56 | | | | 1,388,981.56 |
| 1.本期提取 | | | | 1,388,981.56 | | | | 1,388,981.56 |
| 2.本期使用 | | | | | | | | |
| （七）专项储备 | | | | | | | | |
| 四、本期期末金额 | 3,875,752,457.00 | 2,060,352,421.29 | | 6,583,495.99 | 658,676,402.50 | | 1,181,081,126.78 | 7,782,445,903.56 |

法定代表人：杨思明 主管会计工作负责人：梅家秀 会计机构负责人：赵瑞江

母公司所有者权益变动表（续）
单位：元 币种：人民币

| 项目 | 上年同期金额 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 实收资本（或股本） | 资本公积 | 减：库存股 | 专项储备 | 盈余公积 | 一般风险准备 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、上年年末金额 | 1,684,800,000.00 | 747,969,821.37 | | 3,246,986.38 | 657,299,693.33 | | 1,222,146,230.65 | 4,315,462,731.73 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | |
| 二、本年年初金额 | 1,684,800,000.00 | 747,969,821.37 | | 3,246,986.38 | 657,299,693.33 | | 1,222,146,230.65 | 4,315,462,731.73 |
| 三、本期增减变动金额（减少以"-"号填列） | | | | 924,649.06 | | | -8,568,225.31 | -7,643,576.25 |
| （一）净利润 | | | | | | | 58,823,774.69 | 58,823,774.69 |
| （二）其他综合收益 | | | | | | | | |
| 上述（一）和（二）小计 | | | | | | | 58,823,774.69 | 58,823,774.69 |
| （三）所有者投入和减少资本 | | | | | | | | |
| 1.所有者投入资本 | | | | | | | | |
| 2.股份支付计入所有者权益的金额 | | | | | | | | |
| 3.其他 | | | | | | | | |
| （四）利润分配 | | | | | | | -67,392,000.00 | -67,392,000.00 |
| 1.提取盈余公积 | | | | | | | | |
| 2.对所有者（或股东）的分配 | | | | | | | -67,392,000.00 | -67,392,000.00 |
| 3.其他 | | | | | | | | |
| （五）所有者权益内部结转 | | | | | | | | |
| 1.资本公积转增资本（或股本） | | | | | | | | |
| 2.盈余公积转增资本（或股本） | | | | | | | | |
| 3.盈余公积弥补亏损 | | | | | | | | |
| 4.其他 | | | | | | | | |
| （六）专项储备 | | | | 924,649.06 | | | | 924,649.06 |
| 1.本期提取 | | | | 1,195,433.92 | | | | 1,195,433.92 |
| 2.本期使用 | | | | 270,784.86 | | | | 270,784.86 |
| （七）专项储备 | | | | | | | | |
| 四、本期期末金额 | 1,684,800,000.00 | 747,969,821.37 | | 4,171,635.44 | 657,299,693.33 | | 1,213,578,005.34 | 4,307,819,155.48 |

法定代表人：杨思明 主管会计工作负责人：梅家秀 会计机构负责人：赵瑞江

7.3 本报告期无会计政策、会计估计的变更。
7.4 本报告期无前期会计差错更正。
7.5 企业合并及合并财务报表
7.5.1 合并范围发生变更的说明
公司四届十九次董事会审议通过《关于设立南京鑫龙钢材销售有限公司的议案》，本公司于2011年3月30日投资设立全资子公司南京鑫龙钢材销售有限公司，2011年将其纳入合并报表范围。
子公司南京南钢产业发展有限公司于2011年5月31日投资设立全资子公司宿迁南钢金鑫钢铁有限公司，2011年将其纳入合并报表范围。
7.5.2 本期新纳入合并范围的主体和本期不再纳入合并范围的主体
7.5.2.1 本期新纳入合并范围的子公司、特殊目的主体、通过受托经营或承租等方式形成控制权的经营实体
单位：元 币种：人民币

| 名 称 | 期末净资产 | 本期净利润 |
|---|---|---|
| 南京鑫龙钢材销售有限公司 | 1,444,921.97 | 444,921.97 |
| 宿迁南钢金鑫钢铁有限公司 | 50,000,000.00 | - |

7.5.3 境外经营实体主要报表项目的折算汇率

| 财务报表项目 | 折算汇率（港币） | 备注 |
|---|---|---|
| 资产、负债 | 0.83162 | |
| 实收资本 | 1.0658 | |
| 收入、成本和费用 | 0.84131 | |

# 关于万家基金在邮储银行开通旗下基金定投业务并同时参加定投申购费率优惠和个人网上申购费率优惠的公告

一、开通旗下部分基金在邮储银行的定投业务
为满足广大投资者的理财需求，万家基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定于2011年8月19日起在中国邮政储蓄银行有限责任公司（以下简称"邮储银行"）开通万家公用事业行业股票型证券投资基金（基金简称：万家公用，基金代码：161903）和万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：万家引擎，基金代码：519183）的定期定额申购业务（以下简称"基金定投"）。
基金定投是指投资者通过向本基金管理人指定的邮储银行提交申请，约定申购周期、申购时间和申购金额，由邮储银行在设定期限内按照约定的自动投资日在投资者指定资金账户内自动完成基金申购申请的一种长期投资方式。有关基金定投事宜公告如下：
（一）适用投资者范围
符合相关基金合同规定的所有投资者。
（二）办理方式
1、申请办理定期定额申购业务的投资者须拥有中国证券登记结算公司开放式基金账户，具体开户程序请遵循邮储银行的相关规定。
2、投资者开立基金账户后即可到邮储银行网点申请办理相关万家开放式基金的定期定额申购业务，具体办理程序请遵循邮储银行的相关规定。
（三）办理时间
本业务的申请受理时间与基金日常申购业务受理时间相同。
（四）申购金额
投资者可与邮储银行约定每期固定投资金额，每期定期定额申购金额最低下限为人民币100元，倍增金额为人民币100元（即超过人民币100元的必须为人民币100元的整数倍），最高上限为人民币5000元（含）。
原已参加邮储银行基金定投的产品万家180指数证券投资基金（基金简称：万家180，基金代码：519180）、万家和谐增长混合型证券投资基金（前端）（基金简称：万家和前，基金代码：519181）和万家增强收益债券型证券投资基金（基金简称：万家债券，基金代码：161902）每期定期定额申购金额最高上限参照邮储银行最新公告已相应调整为人民币5000元（含）。
（五）扣款日期及扣款方式
1、投资者应遵循相关邮储银行的规定与其约定每期扣款日期。
2、邮储银行将按照投资者申请时所约定的每期约定扣款日、扣款金额扣款，若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日，并以该日为基金申购申请日。
3、投资者需指定相关邮储银行认可的资金账户作为每期固定扣款账户。
4、扣款等其他相关事项请以邮储银行的规定为准。
（六）申购费率
定期定额申购费率及计费方式等同于一般的申购业务。
（七）扣款和交易确认
基金的注册登记人按照本公告第（五）条规则确定的基金申购申请日（T日）的基金份额净值为基准计算申购份额。申购份额将在T+1工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户。投资者可自T+2工作日起查询申购成交情况。
（八）变更与解约
如果投资者想变更每期扣款金额和扣款日期，可提出变更申请；如果投资者想终止定期定额申购业务，可提出解除申请，具体办理程序请遵循邮储银行的相关规定。
二、参加定投申购费率优惠活动
为满足广大投资者的理财需求，自公告之日起，我司旗下万家180指数证券投资基金（基金简称：万家180，基金代码：519180）、万家和谐增长混合型证券投资基金（前端）（基金简称：万家和前，基金代码：519181）、万家公用事业行业股票型证券投资基金（基金简称：万家公用，基金代码：161903）和万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：万家引擎，基金代码：519183）参加邮储银行定投申购费率优惠活动。
注：万家增强收益债券型证券投资基金（基金简称：万家债券，基金代码：161902）无申购费。
（一）优惠活动内容
自公告之日起，投资者通过邮储银行进行上述基金的定投申购，享有申购费率八折优惠，折扣后申