博时主题行业股票证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 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
送出日期:2011 年 8 月 27 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的基金合同规定,于 2011 年 8 月 26 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 2011 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

基金简称	博时主题行业股票(LOF)
场内简称	博时主题
基金主代码	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	6,530,167,765.48 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2005年 2 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。
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
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(免长途话费)	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275865

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(2011 年 1 月 1 日-2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	715,478,174.32
本期利润	494,889,258.74
加权平均基金份额本期利润	0.0755
本期基金份额净值增长率	4.00%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2011 年 6 月 30 日)**
期末可供分配基金份额利润	0.1635
期末基金资产净值	11,805,532,556.32
期末基金份额净值	1.808

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

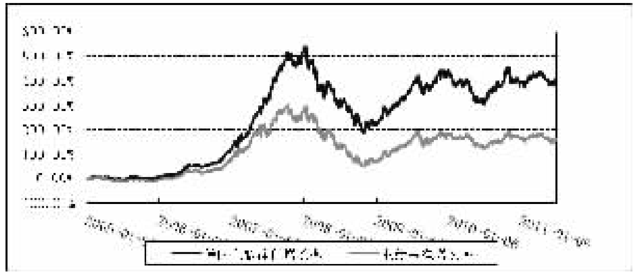
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.20%	1.02%	1.35%	1.01%	1.85%	0.01%
过去三个月	-2.85%	0.89%	-5.15%	0.91%	2.30%	-0.02%
过去六个月	4.00%	1.04%	-3.35%	1.00%	7.35%	0.04%
过去一年	24.35%	1.25%	15.80%	1.11%	8.55%	0.14%
过去三年	26.40%	1.54%	14.52%	1.60%	11.88%	-0.06%
自基金合同生效起至今	404.12%	1.50%	157.07%	1.61%	247.05%	-0.11%

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 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本基金合同第十二条“(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、沈阳和郑州设有分公司;并设有海外子公司: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 2011 年 6 月 30 日,博时基金公司共管理二十五只开放式基金和二只封闭式基金,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,资产管理总规模逾 1856.66 亿元,累计分红超过人民币 552.64 亿元,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

根据银河证券基金研究中心统计,截至 2011 年 6 月 30 日,二季度博时基金参与排名的 15 只公募主动基金中,共有 11 只位列市场前 50%。其中,博时主题行业基金、博时特许价值基金分列 217 只标准股票基金第 3、第 9;博时平衡配置混合基金位列 14 只股债平衡型基金第 8;博时价值增长基金、博时价值增长贰号基金分列 29 只混合偏股型基金第 3 和第 4; 博时裕隆封闭基金位列 30 只封闭式基金第 2; 博时信用债券 A/B、博时信用债券 C、博时宏观回报债券 A/B、博时宏观回报债券 C 分列 64 只普通债券型基金(二级)第 7、第 8、第 9 和第 10。

2、客户服务

2011 年 1 月至 6 月底,博时在北京、山东、南京、唐山、无锡、上海、广州、厦门等地圆满举办博时基金大学、理财沙龙等各类活动共计 75 场;通过网络会议室举办的博时快 e 财富论坛、博时 e 视界等活动共计 36 场;通过这些活动,博时与投资者充分沟通了当前市场的热点问题,受到了投资者的广泛欢迎。

3、品牌获奖

1)2011 年 1 月 19 日,博时公司获得由《亚洲资产管理》(Asia Asset Management)杂志颁发的“2010 年度中国最佳投资者教育奖”。.

2)2011 年 4 月,在由上海证券报主办的第八届中国“金基金奖”评选中,博时平衡配置混合型证券投资基金再度荣膺 2010 年度“金基金三年期产品奖·平衡型基金奖”,博时稳定价值债券投资基金荣获 2010 年度“金基金三年期产品奖·债券基金奖”。

3)博时平衡配置混合基金在由中国证券报社主办、银河证券等机构协办的第八届(2010 年度)中国基金业金牛奖评选中获评为“三年期混合型金牛基金奖”。这是继 2010 年荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖之后,因持续稳定的投资管理能力再度蝉联同一金牛奖项。

4)2011 年 6 月 28 日,世界品牌实验室发布了 2011 年中国 500 最具价值品牌榜,博时基金管理公司凭着 2010 年持续的品牌创新和优秀的客户服务,品牌价值首次突破 50 亿元,以 56.24 亿元的品牌价值,位列品牌榜 227 名,连续 8 年成为国内最具品牌价值的基金公司。

4、其他大事件

1)2011 年 3 月 19 日,博时公司深圳员工在莲花山公园种下了第七片“博时林”,自 2003 年至今,博时基金已先后在深圳中心公园、笔架山公园、大沙河公园、南山公园、梅林公园等地开辟了七片“博时林”。

2)博时抗通胀增强回报(QDII-FOF)基金首募顺利结束并于 2011 年 4 月 25 日成立。

3)深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金及博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金首募顺利结束并于 2011 年 6 月 10 日成立。

4)博时裕祥分级债券型证券投资基金首募顺利结束并于 2011 年 6 月 10 日成立。

5)博时卓越品牌股票型证券投资基金(LOF)是由博时裕泽封闭基金转型而来,基金合同于 2011 年 4 月 22 日生效,5 月份进行了集中申购,并于 2011 年 6 月 30 日在深交所上市交易。

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		
邓晓峰	基金经理/特定资产管理部副总经理/价值组投资副总监	2007-3-14	-	9.5	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。现任特定资产管理部副总经理、价值组投资副总监、博时主题行业基金经理,兼任社保股票基金经理。

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、《博时主题行业股票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 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

市场回顾

上半年的市场环境可谓多事之秋,风雨飘摇。中东事变、日本地震,欧洲债务危机迫近,美国经济复苏乏力又显。国内通胀不断创新高,宏观紧缩力度不减。A 股市场在重重压力下表现不佳,高估的中小板及创业板大幅下挫,蓝筹股表现相对较好。

上半年基金管理回顾

我们维持了原有的结构,降低了股票仓位。我们降低了汽车、家电、IT 等行业的配置,增加了地产行业的配置。地产行业龙头公司在调整的环境中扩大了自己的市场份额,同时降低了杠杆,构建了保守资产负债表,增加了未来的灵活性。无论从什么角度考量,这些公司均已经比较便宜。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.808 元,累计净值为 3.536 元。报告期内,本基金份额净值增长率为 4.00%,同期业绩基准增长率为-3.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回归基本面是今年的主流,市场的调整将继续。

许多蓝筹公司估值水平已经充分反映了潜在的各种负面因素,下跌的空间较为有限。在通胀的压力缓解后,存在明显的估值修复需求。低估的蓝筹公司只是需要等待一个合适的契机。另一方面,中小板、创业板公司的调整才到中局,并未结束,短暂的反弹后将继续向下寻求基本面的支撑。在这些高估值公司的风险彻底释放后,市场才会出现系统性机会。

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。

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

报告期内,本基金于 2011 年 1 月 17 日发布了分红公告,以截止到 2010 年 12 月 31 日的可供分配利润为基准,向基金份额持有人每 10 份基金份额派发红利 0.83 元。

§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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为 530,277,013.26 元。

5.3 托管人对本半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:博时主题行业股票证券投资基金

报告截止日:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	82,149,197.13	647,971,498.88
结算备付金	6,422,643.03	5,365,412.31
存出保证金	2,572,159.68	1,725,932.62
交易性金融资产	10,955,578,680.30	10,724,804,208.05
其中:股票投资	9,832,036,776.50	10,341,374,407.25
基金投资	-	-
债券投资	1,123,541,903.80	383,429,800.80
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	716,543,297.80	302,905,485.91
应收利息	5,721,470.77	608,174.08
应收股利	63,944,100.00	-
应收申购款	4,052,777.96	909,261.77
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	11,836,984,326.67	11,684,289,973.62
负债和所有者权益	**本期末 2011年 6 月 30 日**	**上年度末 2010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	8,369,564.70	5,591,184.85
应付管理人报酬	14,143,600.40	15,393,586.39
应付托管费	2,357,266.74	2,565,597.74
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,671,055.32	3,572,069.30
应交税费	2,652,543.90	2,652,543.90
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,257,739.29	1,149,987.80
负债合计	31,451,770.35	30,924,969.98
所有者权益:		
实收基金	6,530,167,765.48	6,400,103,312.88
未分配利润	5,275,364,790.84	5,253,261,690.76
所有者权益合计	11,805,532,556.32	11,653,365,003.64
负债和所有者权益总计	11,836,984,326.67	11,684,289,973.62

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.808 元,基金份额总额 6,530,167,765.48 份。

6.2 利润表

会计主体:博时主题行业股票证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入	610,165,040.54	-3,753,602,404.15
1.利息收入	5,263,087.60	5,546,957.77
其中:存款利息收入	3,244,991.72	3,110,790.79
债券利息收入	1,242,579.79	2,436,166.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	775,516.09	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	824,371,439.43	-200,145,028.41
其中:股票投资收益	671,014,307.42	-322,436,433.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	619,271.26	16,978,126.39
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	152,737,860.75	105,313,278.44
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-220,588,915.58	-3,561,278,056.95
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,119,429.09	2,273,723.44
减:二、费用	115,275,781.80	130,129,275.89
1.管理人报酬	88,865,518.30	99,892,609.43
2.托管费	14,810,919.74	16,648,768.24
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	11,339,288.71	13,246,772.15
5.利息支出	-	81,030.11
其中:卖出回购金融资产支出	-	81,030.11
6.其他费用	260,055.05	260,095.96
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	494,889,258.74	-3,883,731,680.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	494,889,258.74	-3,883,731,680.04

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时主题行业股票证券投资基金

本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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)	6,400,103,312.88	5,253,261,690.76	11,653,365,003.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	494,889,258.74	494,889,258.74
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)	130,064,452.60	57,490,854.60	187,555,307.20
其中:1.基金申购款	1,090,920,479.62	880,050,541.22	1,970,971,020.84
2.基金赎回款	-960,856,027.02	-822,559,686.62	-1,783,415,713.64
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)	-	-530,277,013.26	-530,277,013.26
五、期末所有者权益(基金净值)	6,530,167,765.48	5,275,364,790.84	11,805,532,556.32

项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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)	8,004,758,023.13	8,828,638,907.02	16,833,396,930.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,883,731,680.04	-3,883,731,680.04
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)	-696,865,430.58	-632,667,889.29	-1,329,533,319.87
其中:1.基金申购款	437,473,219.99	378,156,117.40	815,629,337.39
2.基金赎回款	-1,134,338,650.57	-1,010,824,006.69	-2,145,162,657.26
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)	-	-489,461,021.30	-489,461,021.30
五、期末所有者权益(基金净值)	7,307,892,592.55	3,822,778,316.39	11,130,670,908.94

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:肖风　　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 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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。

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	708,020,293.88	9.14%	163,237,658.68	1.97%

6.4.3.1.2 权证交易

无。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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	433,665.29	7.85%	433,665.29	16.25%
关联方名称	**上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	132,633.63	1.91%	132,633.63	7.69%

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。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	88,865,518.30	99,892,609.43
其中:支付销售机构的客户维护费	7,818,226.84	8,743,644.31

注: 支付基金管理人博时基金管理有限公司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。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,810,919.74	16,648,768.24

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。

6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	**上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日**					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	250,000,000.00	39,205.14

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.3.4.2 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。

6.4.3.5 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 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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	82,149,197.13	3,175,963.56	655,903,600.81	3,065,789.49

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。

6.4.3.6 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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日 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	6,500,000	57,525,000.00
招商证券	002399	海普瑞	新股网下申购	10,982	1,625,336.00

6.4.4 期末(2011 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.4.2 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
601998	中信银行	2011/6/29	配股停牌	4.75	2011/7/7	4.59	1,200,000	6,750,957.00	5,700,000.00
002372	伟星新材	2011/6/28	重大事项	17.39	2011/7/5	18.90	1,841,007	37,107,473.65	32,015,111.73

6.4.4.3 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	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金合计	88,571,840.16	0.75
6	其他各项资产	792,833,806.21	6.70
7	合计	11,836,984,326.67	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

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	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

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	000629	攀钢钒钛	396,800,887.68	3.41
2	000002	万 科A	252,443,496.02	2.17
3	601318	中国平安	236,246,706.37	2.03
4	600048	保利地产	225,061,562.39	1.93
5	000858	五 粮 液	214,882,207.96	1.84
6	601808	中海油服	214,131,143.21	1.84
7	601088	中国神华	179,055,109.52	1.54
8	002024	苏宁电器	163,717,194.57	1.40
9	000999	华润三九	101,061,262.49	0.87
10	600718	东软集团	92,148,681.80	0.79
11	600325	华发股份	91,827,653.87	0.79
12	600030	中信证券	84,219,562.19	0.72
13	601899	紫金矿业	58,932,129.15	0.51
14	600015	华夏银行	55,446,171.77	0.48
15	002244	滨江集团	54,331,005.39	0.47
16	601628	中国人寿	45,891,565.15	0.39
17	601179	中国西电	43,942,671.61	0.38
18	601607	上海医药	41,267,757.14	0.35
19	600694	大商股份	40,770,408.54	0.35
20	601288	农业银行	40,696,486.00	0.35

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

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	000527	美的电器	891,534,672.68	7.65
2	000895	双汇发展	300,744,804.21	2.58
3	000629	攀钢钒钛	270,336,117.82	2.32
4	601179	中国西电	261,609,496.23	2.24
5	601088	中国神华	202,724,819.95	1.74
6	600104	上海汽车	185,979,004.50	1.60
7	000800	一汽轿车	177,430,514.49	1.52
8	600660	福耀玻璃	148,369,561.51	1.27
9	600741	华域汽车	130,909,137.16	1.12
10	601899	紫金矿业	105,625,511.19	0.91
11	000858	五 粮 液	99,384,748.92	0.85
12	000002	万 科A	97,899,771.77	0.84
13	600030	中信证券	89,545,757.55	0.77
14	600674	川投能源	87,176,763.83	0.75
15	600050	中国联通	76,442,568.07	0.66
16	601628	中国人寿	75,255,800.75	0.65
17	601328	交通银行	69,744,313.51	0.60
18	600048	保利地产	62,365,145.17	0.54
19	600089	特变电工	50,621,595.43	0.43
20	601668	中国建筑	48,588,662.08	0.42

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	3,403,427,999.65
卖出股票收入(成交)总额	4,345,370,093.21

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	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

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	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

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
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

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	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

7.9.5 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。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
462,631	14,115.28	518,102,937.52	7.93%	6,012,064,827.96	92.07%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	魏威	4,600,095.00	1.56%
2	浙商证券有限责任公司	3,000,000.00	1.02%
3	永诚财产保险股份有限公司-传统保险产品	2,000,000.00	0.68%
4	赵素萍	1,600,000.00	0.54%
5	王凤娜	1,505,100.00	0.51%
6	刘志巍	1,420,085.00	0.48%
7	杨柳	1,165,270.00	0.40%
8	王志博	1,095,343.00	0.37%
9	邱志敏	1,000,480.00	0.34%
10	张洁芳	992,700.00	0.34%

注:上述基金份额持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	-	74,151.38	0.001%
	合计	74,151.38	0.001%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2005 年 1 月 6 日)基金份额总额	1,209,641,741.07
本报告期期初基金份额总额	6,400,103,312.88
本报告期基金总申购份额	1,090,920,479.62
减:本报告期基金总赎回份额	960,856,027.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,530,167,765.48

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1)本报告期内,本基金管理人未发生重大人事变动;

(2)本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115 号),解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务;

(3)本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	3,126,767,088.97	40.35%	1,945,519.04	35.24%	新增
高华证券	1	1,234,626,646.39	15.93%	1,023,762.52	18.54%	-
招商证券	2	708,020,293.88	9.14%	433,665.29	7.85%	新增 1 个
兴业证券	1	685,843,907.43	8.85%	582,961.93	10.56%	新增
国泰君安	4	498,336,929.29	6.43%	422,900.91	7.66%	新增 3 个
湘财证券	1	415,940,373.91	5.37%	270,365.65	4.90%	新增
中信建投	1	260,262,054.01	3.36%	221,151.99	4.01%	-
华泰联合	1	229,839,508.53	2.97%	195,362.39	3.54%	-
日信证券	1	172,092,147.49	2.22%	111,860.00	2.03%	新增
国元证券	1	164,020,888.29	2.12%	139,416.85	2.53%	新增
安信证券	1	142,684,378.94	1.84%	92,745.03	1.68%	-
广发证券	1	56,290,577.08	0.73%	45,736.80	0.83%	-
长城证券	1	51,896,280.29	0.67%	33,732.10	0.61%	新增
中投证券	2	2,177,018.36	0.03%	1,768.82	0.03%	新增 1 个
浙商证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	撤销
平安证券	1	-	-	-	-	撤销

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48 号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

博时基金管理有限公司
2011 年 8 月 27 日