（上接D194版）

本基金于基金合同生效后自2011年5月4日至2011年5月30日期间内开放集中申购，共募集265,536,109.09元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息98,487.15元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字〔2011〕第221号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2011年6月1日基金份额折算后的基金份额净值1.000元折合为265,536,109.09份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的98,487.15份基金份额，并于2011年6月3日进行了确认登记。

经深交所深证上字〔2011〕187号文审核同意，本基金510,827,960份基金份额（截至：2011年6月23日）于2011年6月30日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时卓越品牌股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括A股股票、固定收益类证券、货币市场金融工具、现金、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资比例为基金资产的60%-95%；权证投资比例不得超过基金资产的3%，并计入股票投资比例；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于2012年3月23日批准报出。

7.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称"企业会计准则"）、中国证监会公告〔2010〕5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时卓越品牌股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注7.2.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2011年12月31日的财务状况以及2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.2.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外投资人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内投资人只能选择现金红利。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告〔2008〕38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字〔2007〕21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.2.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作，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。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。

（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。

7.2.4.7 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司（"中国工商银行"）	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
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
瑞安实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业资产管理有限公司	基金管理人的股东
丰益实业发展有限公司	基金管理人的股东

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。

7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.2.4.8.2 关联方报酬

7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年4月22日（基金合同生效日）至 2011年12月31日止期间
当期发生的基金应支付的管理费	5,496,145.62
其中：支付销售机构的客户维护费	642,571.34

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。

7.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年4月22日（基金合同生效日）至 2011年12月31日止期间
当期发生的基金应支付的托管费	916,024.26

注：支付基金托管人中国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。

7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年4月22日（基金合同生效日）至 2011年12月31日止期间
期初持有的基金份额	2,500,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	53,075.00
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	2,553,075.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.58%

7.2.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期 2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券	1,276,537.00	0.29%

7.2.4.8.5 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4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	73,273,015.86	555,018.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.2.4.9 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.2.4.9.2 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
002051	中工国际	11/12/08	公告重大事项	25.18	12/3/19	30.00	559,000	15,544,158.35	14,075,620.00	
合计								15,544,158.35	14,075,620.00	

注：本基金截至2011年12月31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。

7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.2.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）公允价值

①不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

②以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

②各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为314,444,016.67元，属于第二层级的余额为14,075,620.00元，无属于第三层级的余额。

③公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

④第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 裕泽证券投资基金

8.1.1 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	345,470,257.17	62.50
2	其中：股票	345,470,257.17	62.50
3	固定收益投资	118,614,000.00	21.46
4	其中：债券	118,614,000.00	21.46
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	83,963,048.69	15.19
10	其他各项资产	4,668,795.55	0.84
11	合计	552,716,101.41	100.00

8.1.2 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	-	-
C	制造业	118,498,767.01	22.14
C0	食品、饮料	69,083,644.01	12.91
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,150,871.25	0.96
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	30,742,751.75	5.74
C8	医药、生物制品	13,521,500.00	2.53
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	21,015,882.00	3.93
G	信息技术业	27,425,645.76	5.12
H	批发和零售贸易	19,020,888.16	3.55
I	金融、保险业	143,130,374.24	26.75
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	16,378,700.00	3.06
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	345,470,257.17	64.56

8.1.3 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	600015	华夏银行	2,770,363	36,014,719.00	6.73
2	601318	中国平安	600,000	31,776,000.00	5.94
3	601939	建设银行	5,857,501	30,693,305.24	5.74
4	000063	中兴通讯	934,116	27,425,645.76	5.12
5	000858	五粮液	700,000	22,365,000.00	4.18
6	000527	美的电器	1,000,000	18,190,000.00	3.40
7	600195	中牧股份	699,901	17,504,524.01	3.27
8	600030	中信证券	1,183,550	17,137,804.00	3.20
9	002051	中工国际	430,000	16,378,700.00	3.06
10	000895	双汇发展	258,100	16,234,490.00	3.03

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年度报告正文。

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600029	南方航空	29,206,869.83	5.02
2	601939	建设银行	29,179,152.98	5.02
3	600660	福耀玻璃	28,891,367.36	4.97
4	000063	中兴通讯	28,576,354.90	4.91
5	600048	保利地产	25,497,641.34	4.38
6	000527	美的电器	18,480,148.00	3.18
7	600030	中信证券	17,506,723.00	3.01
8	601601	中国太保	16,909,726.28	2.91
9	002008	大族激光	16,887,185.45	2.90
10	601919	中国远洋	16,872,535.67	2.90
11	601179	中国西电	16,498,680.00	2.84
12	000895	双汇发展	15,965,108.00	2.74
13	600837	海通证券	15,326,252.76	2.63
14	600016	民生银行	14,519,385.64	2.50
15	601808	中海油服	13,846,614.81	2.38
16	002165	红宝丽	13,513,943.84	2.32
17	600809	山西汾酒	11,940,699.40	2.05
18	000625	长安汽车	11,830,417.40	2.03
19	300169	天晟新材	11,769,941.52	2.02
20	601166	兴业银行	11,670,000.00	2.01

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。

8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000527	美的电器	62,721,964.81	10.78
2	600875	东方电气	38,282,829.96	6.58
3	600029	南方航空	32,770,761.91	5.63
4	601601	中国太保	32,638,504.63	5.61
5	600660	福耀玻璃	30,778,207.00	5.29
6	002165	红宝丽	24,531,389.73	4.22
7	600048	保利地产	24,083,546.67	4.14
8	600312	平高电气	21,965,845.82	3.78
9	600970	中材国际	19,576,055.55	3.36
10	601919	中国远洋	16,314,013.10	2.80
11	000983	西山煤电	16,103,143.45	2.77
12	601808	中海油服	15,847,411.07	2.72
13	600741	华域汽车	15,719,584.27	2.70
14	600837	海通证券	15,648,162.46	2.69
15	601179	中国西电	15,204,497.07	2.61
16	002008	大族激光	15,052,634.96	2.59
17	600809	山西汾酒	12,679,825.19	2.18
18	600066	宇通客车	12,443,844.75	2.14
19	000625	长安汽车	11,857,518.58	2.04
20	300169	天晟新材	11,739,324.38	2.02

注：本项的"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。

8.1.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	437,870,154.52
卖出股票的收入（成交）总额	545,013,700.78

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。

8.1.5 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	68,419,000.00	12.79
3	金融债券	50,195,000.00	9.38
	其中：政策性金融债	50,195,000.00	9.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	118,614,000.00	22.17

8.1.6 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	080412	08农发12	500,000	50,195,000.00	9.38
2	1101018	11央行票据18	500,000	48,415,000.00	9.05
3	0801047	08央行票据47	200,000	20,004,000.00	3.74

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.1.8 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。

8.1.9 投资组合报告附注

8.1.9.1 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。

8.1.9.2 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。

8.1.9.3 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	1,294,129.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	498,665.34
4	应收利息	2,876,000.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,668,795.55

8.1.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.1.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.1.9.6 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。

8.2 博时卓越品牌股票型证券投资基金（LOF）

8.2.1 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	328,519,636.67	81.30
	其中：股票	328,519,636.67	81.30
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	73,758,286.49	18.25
6	其他各项资产	1,816,820.23	0.45
7	合计	404,094,743.39	100.00

8.2.2 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	-	-
C	制造业	123,840,958.80	31.32
C0	食品、饮料	36,583,850.00	9.25
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,131,140.39	1.30
C5	电子	9,723,913.65	2.46
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	62,196,784.76	15.73
C8	医药、生物制品	10,205,270.00	2.58
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	46,296,586.89	11.71
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,561,763.64	1.15
H	批发和零售贸易	40,456,732.26	10.23
I	金融、保险业	59,856,733.48	15.14
J	房地产业	39,431,241.60	9.97
K	社会服务业	14,075,620.00	3.56
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	328,519,636.67	83.09

8.2.3 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	000895	双汇发展	523,000	36,583,850.00	9.25
2	600729	重庆百货	849,929	27,146,732.26	6.87
3	601318	中国平安	742,350	25,566,534.00	6.47
4	000616	亿城股份	7,653,513	24,491,241.60	6.19
5	600015	华夏银行	1,770,276	19,880,199.48	5.03
6	000527	美的电器	1,599,882	19,582,555.68	4.95
7	600967	北方创业	1,021,499	17,150,968.21	4.34
8	000002	万科A	2,000,000	14,940,000.00	3.78
9	601288	农业银行	5,500,000	14,410,000.00	3.64
10	002051	中工国际	559,000	14,075,620.00	3.56

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年度报告正文。

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	63,150,663.53	15.97
2	000895	双汇发展	49,084,813.39	12.41
3	601318	中国平安	37,675,870.10	9.53
4	600835	上海机电	36,811,468.46	9.31
5	600066	宇通客车	33,278,051.53	8.42
6	000002	万科A	32,128,610.00	8.13
7	600729	重庆百货	31,588,582.32	7.99
8	600967	北方创业	31,060,540.35	7.86
9	000616	亿城股份	30,000,309.48	7.59
10	000527	美的电器	29,008,937.21	7.34
11	600875	东方电气	23,425,699.90	5.92
12	600489	中金黄金	21,326,331.82	5.39
13	600016	民生银行	21,046,340.00	5.32
14	601668	中国建筑	20,871,193.00	5.28
15	601628	中国人寿	20,573,224.41	5.20
16	601006	大秦铁路	18,080,681.71	4.57
17	000887	伊利股份	17,949,636.75	4.54
18	600862	南通科技	16,793,430.17	4.25
19	000550	江铃汽车	15,744,400.61	3.98
20	600325	华发股份	15,259,329.15	3.86
21	600362	江西铜业	14,901,783.01	3.77
22	600395	盘江股份	14,475,070.89	3.66
23	601288	农业银行	14,410,000.00	3.64
24	600694	大商股份	13,763,060.68	3.48
25	000963	华东医药	13,739,459.07	3.47
26	601088	中国神华	12,926,849.00	3.27
27	002024	苏宁电器	12,785,762.76	3.23
28	600642	申能股份	12,604,714.17	3.19
29	600563	法拉电子	12,494,226.76	3.16
30	000999	华润三九	12,169,361.75	3.08
31	002142	宁波银行	11,979,379.83	3.03
32	600970	中材国际	11,621,871.37	2.94
33	601117	中国化学	11,569,130.73	2.93
34	000600	建投能源	11,078,892.59	2.80
35	600015	华夏银行	10,875,291.14	2.75
36	600011	华能国际	10,671,629.44	2.70
37	300210	森远股份	10,528,633.87	2.66
38	000571	新大洲A	10,145,902.58	2.57
39	600858	银座股份	9,416,104.82	2.38
40	600221	海南航空	9,000,000.00	2.28
41	000969	安泰科技	8,917,200.00	2.26
42	002158	汉钟精机	8,682,413.15	2.20
43	000513	丽珠集团	8,171,288.05	2.07
44	002564	张化机	7,965,989.44	2.01

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。

8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000063	中兴通讯	88,012,211.72	22.26
2	601318	中国平安	39,494,329.45	9.99
3	600016	民生银行	36,279,035.19	9.18
4	000895	双汇发展	34,166,931.34	8.64
5	600887	伊利股份	31,173,331.26	7.88
6	600835	上海机电	29,749,240.88	7.52
7	601939	建设银行	28,584,604.88	7.23
8	600066	宇通客车	28,422,981.68	7.19
9	000858	五粮液	24,168,735.81	6.11
10	600875	东方电气	23,186,796.00	5.86
11	600015	华夏银行	22,343,307.39	5.65
12	601628	中国人寿	19,647,546.09	4.97
13	601668	中国建筑	18,598,732.34	4.70
14	000527	美的电器	18,504,196.13	4.68
15	600