

(上B221续)

7.1.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本及交易费用	卖出股票的收入
60,833,276.61	306,529,216.39

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。

7.1.5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	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	20,160,000.00	0.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	536,701,000.00	22.43
其中:政策性金融债	536,701,000.00	22.43	
4	企业债券	10,200,000.00	0.43
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	567,061,000.00	23.70

7.1.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(亿)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120239	国开1239	1,700,000	18,929,000.00	7.06
2	090214	国开0514	1,500,000	14,805,000.00	6.21
3	110257	国开1157	700,000	7,007,000.00	2.93
4	120229	国开1229	700,000	69,384,000.00	2.90
5	130237	国开1337	300,000	29,967,000.00	1.23

7.1.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

7.1.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末持有贵金属。

7.1.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.1.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.1.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.1.12投资组合报告附注

7.1.12.1报告期内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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.1.12.2报告期内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。

7.1.12.3期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	671,355.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,522,295.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,193,651.41

7.1.12.4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。

7.1.12.5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。

7.1.12.6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。

7.2转型前基金名称:裕隆证券投资基金

7.2.1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	1,909,297,444.44	75.53
其中:股票	1,909,297,444.44	75.53	
2	固定收益投资	565,794,000.00	22.38
其中:债券	565,794,000.00	22.38	
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	37,086,923.43	1.47
8	其他各项资产	15,582,190.86	0.62
9	合计	2,527,760,573.73	100.00

7.2.2报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	825,440,722.23	32.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,582,020.90	1.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	775,049,314.14	30.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	214,597,583.26	8.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	59,627,803.91	2.36
S	综合	-	-
合计		1,909,297,444.44	75.71

(上B222续)

7.1基金名称:博时稳健回报债券型证券投资基金(LOF)

7.1.1期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中:股票	-	-	
2	固定收益投资	1,026,085,738.79	82.27
其中:债券	1,026,085,738.79	82.27	
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	19,424,118.66	1.56
8	其他各项资产	18,689,520.83	1.50
9	合计	1,247,199,278.28	100.00

7.1.2期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.1.3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

本基金本报告期末未持有股票。

7.1.4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资产支持证券投资

7.1.4.1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

本基金本报告期内未持有股票。

7.1.4.2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

本基金本报告期内未持有股票。

7.1.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.1.5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	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	9,955,000.00	0.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,170,000.00	8.07
其中:政策性金融债	100,170,000.00	8.07	
4	企业债券	24,025,093.69	1.93
5	企业短期融资券	361,387,000.00	29.11
6	中期票据	49,211,000.00	3.97
7	可转债	283,899,641.10	21.21
8	其他	-	-
9	合计	1,026,085,738.79	82.65

7.1.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(亿)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041453007	14农发债001	1,000,000	10,055,000.00	8.10
2	140212	14国开12	1,000,000	100,170,000.00	8.07
3	110025	11国开25	888,020	91,653,696.40	7.38
4	110015	石化转债	700,000	75,579,000.00	6.09
5	118075	11国债转债	700,000	71,729,000.00	5.78

7.1.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.1.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.1.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.1.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.1.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.1.12投资组合报告附注

7.1.12.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除中国石油天然气股份有限公司(石化转债)外,没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.1.12.2报告期内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。

7.1.12.3期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	379,518.63
2	应收证券清算款	7,637,404.03
3	应收股利	-
4	应收利息	10,642,350.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.18
8	其他	-
9	合计	18,689,520.83

7.1.12.4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	占基金资产净值比例(%)
1	110005	平安转债	91,653,696.40	7.38
2	110055	石化转债	75,579,000.00	6.09
3	110023	民生转债	46,400,000.00	3.74
4	110001	中行转债	44,425,276.60	3.58
5	110016	工行转债	5,251,711.16	0.42

7.1.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.3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

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	300212	易华录	7,281,720	235,053,921.60	9.32
2	300070	碧水源	6,428,927	214,597,583.26	8.51
3	002701	碧水源	8,759,430	189,028,099.40	7.50
4	600570	恒生电子	6,465,757	179,200,784.04	7.11
5	300334	神州高铁	4,587,773	148,827,356.12	5.90
6	000020	神州高铁	9,485,516	126,400,708.88	5.02
7	300020	银江股份	3,518,850	105,565,500.00	4.19
8	002465	海格通信	5,192,926	78,257,394.82	3.10
9	601515	东风股份	2,566,635	60,829,349.50	2.41
10	300133	华星光电	2,071,129	59,627,803.91	2.36

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.2.4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资产支持证券投资

7.2.4.1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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300070	碧水源	246,715,151.01	9.02
2	300212	易华录	228,546,669.59	8.36
3	002701	碧水源	177,111,915.27	6.48
4	300034	神州高铁	154,274,809.87	5.64
5	300214	神州高铁	146,384,481.80	5.37
6	600570	恒生电子	135,738,432.41	4.97
7	300020	银江股份	114,517,543.43	4.19
8	002465	海格通信	67,552,406.95	2.85
9	009001	航天科技	65,912,000.00	2.40
10	601515	东风股份	63,583,737.08	2.33
11	300045	华力创通	62,785,956.11	2.30
12	600422	昆明钢铁	60,972,977.03	2.23
13	600372	中航电子	59,371,843.62	2.17
14	000895	双汇发展	54,929,270.21	2.01
15	300335	通富微电子	44,793,533.94	1.64
16	300104	乐视网	44,529,405.00	1.63
17	600809	华鲁化工	42,462,418.32	1.55
18	300101	振芯科技	42,295,405.50	1.55
19	600089	紫光股份	39,144,702.84	1.43
20	600015	山东钢铁	37,037,083.22	1.35

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。

7.2.4.2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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	241,861,749.17	8.85
2	000002	万科A	145,358,124.36	5.32
3	000625	长安汽车	128,276,763.29	4.69
4	600030	中信证券	106,601,837.47	3.90
5	601601	中国太保	104,783,415.86	3.83
6	601186	中国铁路	92,378,280.83	3.38
7	600585	海螺水泥	85,407,166.70	3.12
8	002415	海康视讯	81,093,923.32	2.97
9	601988	中国国旅	72,386,975.43	2.65
10	600009	中国南航	70,527,296.13	2.58
11	600600	青岛啤酒	58,797,492.80	2.15
12	002581	顺孚精工	54,490,886.39	1.99
13	000538	云南铜业	53,515,5	