博时裕富沪深300指数证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010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:2010年8月24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合同规定,于2010年8月23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2010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	博时沪深300指数
基金主代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月26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	16,181,966,848.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在95%以上,并保持年跟踪误差在4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用被动式投资的方法,按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为:股票资产为95%以内,现金和短期债券资产比例不低于5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%的沪深300指数加5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法,基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序,最大程度地运用数量化风险管理手段,以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

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	孙飘清	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	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(2010年1月1日-2010年6月30日)
本期已实现收益	-114,790,813.30
本期利润	-4,064,382,813.49
加权平均基金份额本期利润	-0.2592
本期基金份额净值增长率	-27.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3014
期末基金资产净值	11,305,053,482.79
期末基金份额净值	0.699

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	-7.05%	1.57%	-7.20%	1.59%	0.15%	-0.02%
过去三个月	-22.25%	1.74%	-22.32%	1.73%	0.07%	0.01%
过去六个月	-27.19%	1.52%	-27.05%	1.51%	-0.14%	0.01%
过去一年	-19.10%	1.80%	-17.99%	1.80%	-1.11%	-
过去三年	-31.20%	2.25%	-31.01%	2.28%	-0.19%	-0.03%
自基金合同生效起至今	121.04%	1.79%	102.64%	1.83%	18.40%	-0.04%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数×95%+银行同业存款利率×5%。

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95%、5%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:本基金合同于2003年8月26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3个 月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十六条(五)投资对象、(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基金合同约定。

§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、上海设有分公司。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%;银安实业有限公司,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%;厦门建设集团有限责任公司,持有股份2%。

截至2010年6月30日,博时基金公司共管理十六只开放式基金和三只封闭式基金,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、特定资产管理账户,资产管理总规模逾1698.46亿元,公募基金累计分红超过人民币531.19亿元。

(1)业绩表现

据银河证券基金研究中心统计,截止到2010年6月30日,博时平衡配置混合基金在股债平衡型基金中排名第二,并获得了银河证券三年期五星基金的评级;债券基金方面,博时信用债券A/B及C类今年以来的净值增长率分列普通二级债基的前两位。

(2)客户服务

1) 2010年,为了更好的服务投资者,博时基金开展了季刊读者调查活动,得到了博时基金持有人的大力支持,共有超过1000位读者填写了问卷,为我们进一步办好季刊提供了很好的意见和建议。

2) 为提供安全、高效的网上交易环境,博时公司不断升级网上交易系统的安全功能:2010年1月,博时快e通系统增加了动态验证码的功能,对客户身份进行验证;2010年3月,博时快e通直销交易系统在所有密码输入区域都设置了密码安全控件,大大提高了交易安全性。

3) 2010年4月,博时基金客服中心推出了新版的在线客服系统,新系统能够支持更多新功能,例如,客户和坐席均能查到前面等待的客户数量,客户除了在线等待以外,还可以选择留言功能,留下自己的问题和联系方式,客服代表会及时给予回复。同时在线坐席可以根据等待客户的情况,合理控制在线交流节奏。

4) 2010年一月至六月,博时高端客户论坛活动共在上海、济南、石家庄、深圳、北京、厦门、青岛、无锡等地举办34场。

(3)公司荣誉

1) 博时基金在中国证券报社主办的2010年金牛奖评选中荣获六项金牛大奖,连续三年蝉联"十大金牛基金公司",并获得首次颁发的"金牛特别贡献奖"。博时旗下博时主题行业、博时裕隆封闭、博时平衡配置、博时现金收益4只基金再度当选金牛基金。其中博时主题行业、博时裕隆封闭蝉联"三年期持续优胜金牛基金",博时现金收益蝉联"年度金牛基金",博时平衡配置由"年度金牛基金"升级为"三年期持续优胜金牛基金"。

2) 博时基金在由《证券时报》主办的2009年度"中国基金业明星基金奖"评选中荣获两项大奖。博时主题行业基金、博时平衡配置基金,以过去三年中稳健而出色的业绩表现,荣获"三年持续回报明星基金奖"。

(4)社会责任

1) 2010年3月,深圳市博时慈善基金会资助深圳市市民情感护理中心10万元,用于其开展"情感护理进企业"项目。

2) 2010年4月,博时公司第三次举办"安心助医"公益活动,通过深圳市博时慈善基金会向爱伯华夏慈善基金会捐助100万元,用于资助孤贫先天性心脏病患儿接受手术治疗等;第二次向北大光华管理学院举办的"北京大学——博时基金全国优秀大学生金融夏令营"赞助人民币10万元;博时基金公司员工及家属利用周末休息时间,到深圳市莲花山公园义务植树,这是博时员工在深圳第六次参加此项活动。

3) 2010年5月,深圳市博时基金慈善会获广东省第二批具备公益性捐赠税前扣除资格;第三次向中国社会科学院赞助5万元,用于中科院设立的"博时奖学金"项目;向青海玉树地震灾区捐款80万元。

(5)其他大事件

1) 博时创业成长股票型证券投资基金首募顺利结束并于2010年6月1日成立,首次募集资金超过34亿元。

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		
张晓军	基金经理	2008-7-2	2010-4-28	5	1992年起在新疆水利电力物资总公司财务科工作。2005年加入博时公司,历任数量化投资部金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼裕富基金经理助理、博时沪深300指数基金、上证超级大盘基金、博时上证超大盘ETF联接基金的基金经理。
汤义峰	基金经理	2010-3-12		4	2006年毕业于中国科学院数学与系统科学研究院,获得博士学位。2006年6月加入博时基金管理有限公司,历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票基金、基金裕泽的基金经理助理、投资经理兼数量化研究员,现任博时沪深300指数基金、博时特许价值基金基金经理。

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、《博时裕富沪深300指数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,本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的情况,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

博时沪深300为指数型基金。指数型基金管理的核心任务是有效地追踪指数,也就是严格地将跟踪误差控制在合同规定的4%之内,具体的管理策略就是:尽可能保持基金个股或者个券投资比例与指数样本股比例一致;降低交易频次,减少交易环节损耗。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年6月30日,本基金份额净值为0.699元,份额累计净值为2.679元。报告期内,本基金份额净值增长率为-27.19%,业绩比较基准的涨幅为-27.05%,相对于投资基准的超额收益为-0.14%,跟踪误差(年化)控制在4%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的投资情景,我们认为中国经济体正处在一个转型期,转型必然是一个持续时间较长的过程,传统优势产业未来继续高增长的动力不足,而新兴产业规模较小,暂时还不能成为拉动经济的中坚力量。所幸是,当前传统的产业的估值水平较低,盈利能力依然较强,因此下跌空间有限,而所谓新兴产业股票鱼龙混杂,需要去芜存菁,细细斟酌,因此接下来的投资过程可能是一个以时间换空间的过程,市场在断断续续的结构性波动中为下一轮的行情积蓄力量。博时沪深300为指数型基金。指数型基金管理的核心任务是有效地追踪指数,也就是严格地将跟踪误差控制在合同规定的4%之内,具体的管理策略就是:尽可能保持基金个股或者个券投资比例与指数样本股比例一致;降低交易频次,减少交易环节损耗。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

§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,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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:博时裕富沪深300指数证券投资基金

报告截止日:2010年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资 产:		
银行存款	626,938,882.94	736,763,331.56
结算备付金	4,915,276.39	598,129.19
存出保证金	614,117.75	2,377,445.71
交易性金融资产	10,628,863,532.35	14,227,203,198.36
其中:股票投资	10,576,968,598.35	14,227,203,198.36
基金投资	-	-
债券投资	51,894,934.00	-
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	-	73,775,614.49
应收利息	148,780.54	163,312.87
应收股利	5,181,418.86	-
应收申购款	108,025,392.98	26,430,723.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	11,374,687,401.81	15,067,311,755.36
负债和所有者权益	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009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	52,781,320.12	-
应付赎回款	3,267,750.05	22,533,770.32
应付管理人报酬	9,596,556.95	12,388,118.96
应付托管费	1,958,481.02	2,528,187.56
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	802,166.87	423,035.71
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,227,644.01	1,137,678.87
负债合计	69,633,919.02	39,010,791.42
所有者权益:		
实收基金	16,181,966,848.09	15,653,254,485.73
未分配利润	-4,876,913,365.30	-624,953,521.79
所有者权益合计	11,305,053,482.79	15,028,300,963.94
负债和所有者权益总计	11,374,687,401.81	15,067,311,755.36

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值0.699元,基金份额总额16,181,966,848.09份。

6.2 利润表

会计主体:博时裕富沪深300指数证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
一、收入	-3,983,396,001.22	6,342,640,244.72
1.利息收入	2,612,615.90	2,542,919.59
其中:存款利息收入	2,596,309.16	2,542,919.59
债券利息收入	16,306.74	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-37,548,337.94	-1,899,921,035.84
其中:股票投资收益	-111,995,382.64	-1,984,325,207.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	74,447,044.70	84,404,171.95
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-3,949,592,000.19	8,235,048,850.11
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,131,721.01	4,969,510.86
减:二、费用	80,986,812.27	84,378,869.23
1.管理人报酬	64,485,156.91	57,943,186.63
2.托管费	13,160,236.13	11,825,140.12
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,112,206.47	14,382,017.10
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	229,212.76	228,525.38
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-4,064,382,813.49	6,258,261,375.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-4,064,382,813.49	6,258,261,375.49

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时裕富沪深300指数证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	15,653,254,485.73	-624,953,521.79	15,028,300,963.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,064,382,813.49	-4,064,382,813.49
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)	528,712,362.36	-187,577,030.02	341,135,332.34
其中:1.基金申购款	1,815,159,444.63	-354,191,692.75	1,460,967,751.88
2.基金赎回款	-1,286,447,082.27	166,614,662.73	-1,119,832,419.54
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	16,181,966,848.09	-4,876,913,365.30	11,305,053,482.79
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	18,681,572,214.48	-9,170,613,381.96	9,510,958,832.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,258,261,375.49	6,258,261,375.49
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)	-2,235,577,405.84	676,814,239.10	-1,558,763,166.74
其中:1.基金申购款	4,056,050,101.19	-1,127,801,267.83	2,928,248,833.36
2.基金赎回款	-6,291,627,507.03	1,804,615,506.93	-4,487,012,000.10
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	16,445,994,808.64	-2,235,537,767.37	14,210,457,041.27

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报报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年报报告相一致。

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、基金注册登记机构、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

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

无。

6.4.3.1.2 权证交易

无。

6.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

金额单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	64,485,156.91	57,943,186.63
其中:支付销售机构的客户维护费	5,854,596.00	4,881,387.39

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0.98%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 × 0.98% / 当年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费

金额单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,160,236.13	11,825,140.12

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0.20%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 × 0.20% / 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

无。

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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
中国建设银行股份有限公司	626,938,882.94	2,542,790.09	751,059,927.48	2,404,767.69

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

本期 2010年1月1日至2010年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	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	3,680,655	32,573,796.75
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.4 期末(2010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
601318	中国平安	2010629	资产重组	44.55	未知	未知	7,356,413	344,809,254.98	327,728,199.15	-
000895	双汇发展	2010322	资产重组	43.57	未知	未知	753,436	23,012,160.43	32,827,206.52	-
000001	深发展A	2010630	资产重组	17.51	未知	未知	8,689,031	154,298,200.04	152,144,932.81	-
600675	中华企业	2010517	公告重大事项	7.18	未知	未知	2,440,581	30,208,876.67	17,523,371.58	-
600816	安信信托	201062	公告重大事项	13.60	未知	未知	786,365	14,275,886.44	10,694,564.00	-

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

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	10,576,968,598.35	92.99
	其中:股票	10,576,968,598.35	92.99
2	固定收益投资	51,894,934.00	0.46
	其中:债券	51,894,934.00	0.46
	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	631,854,159.33	5.55
6	其他资产	113,969,710.13	1.00
7	合计	11,374,687,401.81	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	38,195,390.57	0.34
B	采掘业	1,141,538,712.70	10.10
C	制造业	3,172,061,191.42	28.06
C0	食品、饮料	467,167,416.10	4.13
C1	纺织、服装、皮毛	49,088,623.10	0.43
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	27,558,815.72	0.24
C4	石油、化学、塑胶、塑料	224,917,640.70	1.99
C5	电子	53,273,527.68	0.47
C6	金属、非金属	806,727,118.68	7.14
C7	机械、设备、仪表	1,095,633,815.22	9.69
C8	医药、生物制品	416,944,378.26	3.69
C99	其他制造业	30,749,855.96	0.27
D	电力、煤气及水的生产和供应业	392,436,576.10	3.47
E	建筑业	308,726,871.13	2.73
F	交通运输、仓储业	482,866,435.28	4.27
G	信息技术业	351,796,017.94	3.11
H	批发和零售贸易	350,333,222.62	3.10
I	金融、保险业	3,417,964,599.00	30.23
J	房地产业	592,276,221.42	5.24
K	社会服务业	106,214,377.20	0.94
L	传播与文化产业	29,751,359.44	0.26
M	综合类	192,807,623.53	1.71
	合计	10,576,968,598.35	93.56

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	占基金资产净值的比例(%)
1	600036	招商银行	31,701,882	412,441,484.82	3.65
2	600016	民生银行	54,272,856	328,350,778.80	2.90
3	601318	中国平安	7,356,413	327,728,199.15	2.90
4	601328	交通银行	53,763,390	323,117,973.90	2.86
5	600000	浦发银行	20,013,808	272,187,788.80	2.41
6	601166	兴业银行	11,684,021	269,083,003.63	2.38
7	600030	中信证券	17,413,302	203,735,633.40	1.80
8	601088	中国神华	8,917,869	195,925,581.93	1.73
9	601601	中国太保	8,059,266	183,509,486.82	1.62
10	601398	工商银行	42,739,727	173,523,291.62	1.53

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	601899	紫金矿业	72,282,841.25	0.48
2	601668	中国建筑	68,638,155.77	0.46
3	601328	交通银行	67,174,370.16	0.45
4	601166	兴业银行	53,706,266.82	0.36
5	601618	中国中冶	42,558,642.00	0.28
6	600015	华夏银行	41,391,734.76	0.28
7	000709	河北钢铁	39,290,270.14	0.26
8	600016	民生银行	37,421,650.25	0.25
9	600166	福田汽车	33,752,225.33	0.22
10	600036	招商银行	32,573,796.75	0.22
11	600000	浦发银行	31,236,272.98	0.21
12	601299	中国北车	29,875,179.16	0.20
13	002007	华兰生物	25,963,979.24	0.17
14	601607	上海医药	23,577,393.99	0.16
15	601398	工商银行	21,594,085.40	0.14
16	600062	双鹤药业	20,597,345.27	0.14
17	601169	北京银行	20,252,590.31	0.13
18	601088	中国神华	19,129,704.01	0.13
19	601788	光大证券	18,711,801.46	0.12
20	600312	平高电气	18,609,472.39	0.12

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	601328	交通银行	52,213,338.31	0.35
2	601988	中国银行	43,145,979.44	0.29
3	601857	中国石油	27,634,681.76	0.18
4	600030	中信证券	24,244,297.96	0.16
5	600276	恒瑞医药	19,804,427.54	0.13
6	600653	申华控股	19,780,691.42	0.13
7	000002	万 科A	17,016,348.53	0.11
8	002038	双鹭药业	17,013,586.35	0.11
9	600308	华泰股份	16,290,220.29	0.11
10	600050	中国联通	15,602,486.42	0.10
11	600016	民生银行	14,042,807.49	0.09
12	601318	中国平安	13,713,613.91	0.09
13	600110	中科英华	12,748,143.45	0.08
14	600770	综艺股份	12,722,520.28	0.08
15	601166	兴业银行	12,620,282.47	0.08
16	600616	金枫酒业	12,374,122.23	0.08
17	600117	西宁特钢	12,306,215.20	0.08
18	002269	美邦服饰	11,880,022.98	0.08
19	601088	中国神华	9,834,239.76	0.07
20	600000	浦发银行	9,779,694.93	0.07

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	1,357,652,249.75
卖出股票收入(成交)总额	945,714,532.93

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(元)	占基金资产净值比例(%)