

博时主题行业股票证券投资基金

2011 第四季度 报告

011年 12 月 31 日

C5	电子	27,374,298.25	0.27
C6	金属、非金属	340,522,370.34	3.37
C7	机械、设备、仪器	1,562,629,854.12	15.49
C8	医药、生物制品	59,127,774.16	0.59
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	905,070,588.81	8.97
E	建筑业	608,190,000.00	6.03
F	交通运输、仓储业	630,370,000.00	6.25
G	信息技术业	273,632,760.20	2.71
H	批发和零售业	306,938,483.20	3.04
I	金融、保险业	2,868,604,545.04	28.43
J	房地产业	1,126,672,222.59	11.17
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	109,293,618.10	1.08
	合计	9,253,186,693.98	91.70

5.1 按行业划分的营业收入和营业利润情况(单位:万元)					
序号	投资行业	投资名称	数量(股)	公允价值(元)	公允价值变动率(%)
1	000002	万科 A	123,999,920	926,279,402.40	8.97
2	000004	上汽集团	69,999,729	905,496,168.06	8.98
3	000018	中信证券	20,840,000	721,404,408.00	7.15
4	000036	招商银行	56,500,000	760,655,000.00	6.65
5	600106	大秦铁路	84,500,000	630,370,000.00	6.25
6	601668	中国铁建	209,000,000	608,190,000.00	6.03
7	601398	工商银行	112,000,000	474,880,000.00	4.71
8	000886	国投电力	75,341,963	472,878,099.48	4.69
9	000661	中国石化	21,699,620	410,890,836.67	4.13
10	805060	恒顺醋业	29,497,892	316,388,122.94	3.14

5.4 按固定收益投资品种分类的债券投资明细			
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	550,000,000.00	5.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	49,205,000.00	0.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债	130,144,067.60	1.29
8	其他	-	-
9	合计	729,349,067.60	7.23



5.8 投资组合报告摘要

5.8.1 报告期末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。

5.8.2 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。

5.8.3 报告期末基金持有的所有受限资产

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,411,404.69
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	12,954,309.82
5	应收申购款	18,163,607.29
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	33,529,321.80

5.8.4 报告期末持有的处于转股期可转换债券明细

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	110013	国投转债	76,815,086.40	0.76
2	113001	中行转债	10,479,464.00	0.10
3	110016	川投转债	5,375,692.80	0.05

	单位:份
本报告期期初基金份额总额	6,341,648,678.82
本报告期基金已申购份额	229,304,657.42
减:本报告期基金已赎回份额	147,688,073.24
本报告期基金拆分变动份额	
本报告期期末基金份额总额	6,423,265,263.00

[illegible][illegible]

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	6,823,180	726,395,742.80	30.19
2	113001	中行转债	7,562,920	715,300,973.60	29.72
3	110013	国债转债	1,634,480	158,420,146.40	6.58
4	110015	石化转债	947,570	95,240,260.70	3.96
5	010153	05国债01	800,000	80,160,000.00	3.33
5.6 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。					
5.7 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。					
5.8 投资组合报告附注					
5.8.1 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。					
5.8.2 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。					
5.8.3 其他资产明细					
序号	资产名称	名称	金额(人民币元)		
1	存保证金		250,000.00		
2	应收证券清算款				
3	应收股利				
4	应收利息		12,302,839.83		
5	其他应收款		179,601.64		
6	其他应收款				
7	待摊费用				
8	其他				
9	合计		12,732,441.47		
5.8.4 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)	占基金资产的净值比例(%)	
1	113002	工行转债	726,395,742.80	30.19	
2	113001	中行转债	715,300,973.60	29.72	
3	110013	国债转债	158,420,146.40	6.58	

[illegible]