裕阳证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2013年8月29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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月28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2013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	博时裕阳封闭
基金主代码	500006
交易代码	500006
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1998年7月25日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1998年7月30日

2.2基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金的投资组合应本着分散性、安全性、收益性的原则，综合宏观经济、行业企业和证券市场的因素，确定投资组合，达到分散和降低投资风险，确保基金资产安全，谋求基金长期稳定收益的目的。
风险收益特征	本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	李芳菲
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-63201816

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(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	-9,024,119.96
本期利润	9,528,005.77
加权平均基金份额本期利润	0.0048
本期基金份额净值增长率	0.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1871
期末基金资产净值	1,718,026,825.79
期末基金份额净值	0.8590

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。

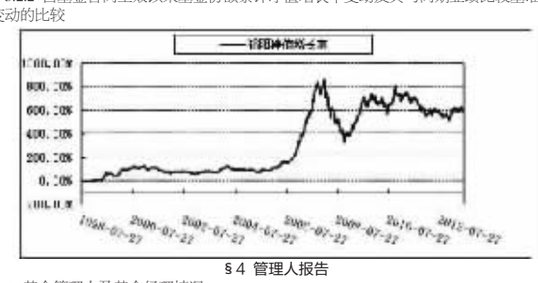
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-5.63%	1.21%	-	-	-	-
过去三个月	-1.60%	1.73%	-	-	-	-
过去六个月	0.56%	1.90%	-	-	-	-
过去一年	1.00%	1.99%	-	-	-	-
过去三年	0.98%	2.10%	-	-	-	-
自基金成立起至今	586.69%	2.67%	-	-	-	-

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



§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成立于1998年7月13日，是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。注册资本2.5亿元人民币，总部设在深圳，在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。同时，博时基金公司拥有博时基金（国际）有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。博时基金公司的股东为招商证券股份有限公司、中国长城资产管理公司、天津港（集团）有限公司、璟安股权投资有限公司、上海盛业股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广厦建设集团有限责任公司。博时基金公司的经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务，是一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构。

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“敬投资价值的发现者”。截至2013年6月30日，博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金，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，公募基金资产规模逾1065.69亿元人民币，累计分红602.92亿元人民币，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

1）根据银河证券基金研究中心统计，2013年上半年，股票型基金中，截至6月28日，博时医疗保健今年以来净值增长率在328只标准型股票基金中排名前1/3。混合灵活配置型基金方面，博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名第8。

2）固定收益方面，博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名第1；博时裕祥分级债券A今年以来收益率在19只封闭式债券型分级子基金（优先份额）中名列第2。

3）海外投资方面，博时标普500今年以来净值增长率在15只QDII指数股票型基金中排名第2，该基金成立以来的涨幅达到15.94%。

2、客户服务

1）2013年上半年，博时基金共举办各类渠道培训活动逾841场，参加人数超过2万人。

3、其他大事件

1）2013年3月29日，由证券时报社主办的2012年度中国基金业明星奖颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业基金荣获“2012 年度股票型明星基金奖”。

2）2013年3月30日，由中国证券报社主办的第十届中国基金业金牛奖颁奖典礼暨2013金牛基金论坛在北京举行。博时基金蝉联“金牛基金管理公司”奖，博时基金价值组投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得“金牛基金十周年特别奖”，博时现金收益荣获“2012年度货币市场金牛基金”。

3）2013年4月，在股市动态分析杂志主办的“2012基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜”评选活动中，博时标普500指数基金获得“2012年基金新产品营销策划案例奖”。

4）2013年4月10日，由上海证券报举办的第十届“金基金奖”颁奖典礼在上海举行，博时基金荣获金“基金十年·卓越公司奖”，博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获“金基金十年·投资回报奖”，博时主题行业基金荣获“金基金·股票型基金奖5年期奖”，博时裕阳封闭荣获“金基金·分红基金奖3年期奖”。

5）2013年4月27日，由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的2013中国网·普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选“年度最佳财富管理基金公司”。

6）2013年6月26日，世界品牌实验室(WBL)在京发布2013年度（第十届）《中国500最具价值品牌》排行榜，博时基金以81.65亿的品牌价值位列第216名，品牌价值一年内提升了近20亿元，排名逐年上升。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
王燕	基金经理	2011-2-28	-	11.5	2004年3月加入博时基金管理有限公司，历任数量化投资部金融工程师、研究部研究员、消费品研究组主管兼研究员、研究部副总经理兼任消费品研究组主管、研究员、投资经理、现任博时策略灵活配置混合型证券投资基金、裕阳证券投资基金基金经理。

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、《裕阳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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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 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说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

上半年指数先扬后抑，上证指数累计下跌12.78%，而中小板指数和创业板指数表现远远好于上证指数。从分行业指数看，表现较好的板块为信息服务、电子、信息设备、医药等，表现较差的行业为有色金属、煤炭、钢铁、建筑建材等。

二季度市场剧烈调整，其主要原因为：1）经济持续低迷2）央行主动收紧货币政策以压缩“银子银行”业务3）新政府对原有发展思路进行总结清理，但实质性改革举措尚未推出，影响了投资人对长期经济前景的信心。

本基金在5月底将仓位水平进行了下降，在市场下跌过程中规避了一定的系统性风险。从配置结构上看，医药行业和必需消费品的超配给组合净值带来了较大的正面贡献。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，本基金份额净值为0.8590元，累计份额净值为4.5370元，报告期内净值增长率为0.56%，同期上证指数涨幅为-12.78%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济持续低迷，面临结构调整压力。近期主要经济数据显示：房地产投资、基建投资和制造业投资均处颓势，出口和消费持续低迷，工业增加值同比增速继续下降。由于杠杆比率较高的国企和地方投融资平台本身的投资效率不高，新增的大量流动性用于已开工项目的持续建设，对私营部门的投资带来了较大的挤占效应。经济的结构性调整压力较大，预计中性偏紧的货币政策将会持续，否则将会进一步放大未来的金融风险。

目前市场对盈利增长、流动性走势、长期经济增长信心等各个因素的预期都处在一个相对较为悲观的位置上，整体市场的风险偏好已经有较为明显的下降，股市相对于其他资产类别的长期吸引力有所上升。但由于目前阶段仍处在新一届政府处理历史残留问题的阶段，股市的反应将更多是脉冲式的和间歇式的，尤其需要警惕下半年出现强势个股估值回调带来的风险。

转型的经济环境之下，由于对消费者需求的理解不同，公司采取的竞争策略不同，同一行业中不同企业间的竞争力和盈利能力出现了巨大差异。在传统行业，拥有品牌、技术、渠道、融资能力的领先企业将会不断增强其固有优势，获得更快的增长。而在新兴的行业中（如环保、电子、天然气、娱乐等），很多企业正在逐步形成自己在行业中的领先优势。单纯以“传统”和“新兴”，“小市值”和“大市值”等概念来对个股进行贴标签式的投资操作没有任何意义。我们要做的是在大浪淘沙的过程中，平衡好企业盈利和市场估值的双重因素。

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、风险管理部负责人、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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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

在托管裕阳证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《裕阳证券投资基金基金合同》、《裕阳证券投资基金托管协议》的约定，对裕阳证券投资基金管理人—博时基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在裕阳证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的裕阳证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：裕阳证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	12,143,699.45	7,444,120.89
结算备付金	20,136,712.34	20,893,277.50
存出保证金	327,802.50	-
交易性金融资产	1,225,278,870.59	1,662,516,061.28
其中：股票投资	856,040,870.59	1,320,472,061.28
基金投资	-	-
债券投资	369,238,000.00	342,044,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	461,000,000.00	-
应收证券清算款	-	25,943,305.08
应收利息	12,948,920.23	5,460,174.74
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,731,836,005.11	1,722,256,939.49
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	8,176,404.99	8,333,412.31
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,164,764.90	2,034,257.02
应付托管费	360,794.15	339,042.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	733,469.67	705,768.77
应交税费	167,381.60	167,381.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,206,364.01	2,178,256.95
负债合计	13,809,179.32	13,758,119.47
所有者权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	-281,973,174.21	-291,501,179.98
所有者权益合计	1,718,026,825.79	1,708,498,820.02
负债和所有者权益总计	1,731,836,005.11	1,722,256,939.49

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值0.8590元，基金份额总额2,000,000,000.00份。

6.2利润表

会计主体：裕阳证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	27,746,731.43	35,467,537.90
1.利息收入	11,270,128.32	6,705,165.71
其中：存款利息收入	184,892.49	326,058.99
债券利息收入	8,069,190.57	6,187,926.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,016,045.26	191,180.02
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,101,595.81	-56,109,181.24
其中：股票投资收益	-14,603,147.43	-66,427,281.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,040.00	-423,956.52
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	12,493,511.62	10,742,056.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	18,552,125.73	84,871,553.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	26,073.19	-
减：二、费用	18,218,725.66	16,916,024.93
1.管理人报酬	13,058,015.82	12,743,256.72
2.托管费	2,176,335.93	2,123,876.04
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,683,665.65	1,809,320.84
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	300,708.26	239,571.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,528,005.77	18,551,512.97
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	9,528,005.77	18,551,512.97

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：裕阳证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	2,000,000,000.00	-291,501,179.98	1,708,498,820.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,528,005.77	9,528,005.77
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	2,000,000,000.00	-281,973,174.21	1,718,026,825.79
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	2,000,000,000.00	-317,651,150.01	1,682,348,849.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,551,512.97	18,551,512.97
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	2,000,000,000.00	-299,099,637.04	1,700,900,362.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴姚东　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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。2013年1月1日以前，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。自2013年1月1日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

（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。

6.4.3关联方关系

6.4.3.1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。

6.4.3.2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”)	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金发起人
中国长城信托投资公司(“长城信托”)	基金发起人
金信信托投资股份有限公司(“金信信托”)	基金发起人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金发起人、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。

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	-	-	82,169,434.56	6.41%

6.4.4.1.2权证交易

无。

6.4.4.1.3应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	69,844.36	6.65%	11,909.19	2.84%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 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。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,058,015.82	12,743,256.72

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 X 1.5% / 当年天数。

6.4.4.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,176,335.93	2,123,876.04

注：支付基金托管人中国农业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 X 0.25% / 当年天数。

6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	12,000,000.00	12,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.60%	0.60%

6.4.4.4.2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	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
光大证券	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%
长城信托	6,001,000.00	0.30%	6,001,000.00	0.30%
金信信托	8,020,000.00	0.40%	8,020,000.00	0.40%
招商证券	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%

6.4.4.5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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国农业银行	12,143,699.45	124,016.04	48,964,449.21	294,970.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3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	856,040,870.59	49.43
	其中：股票	856,040,870.59	49.43
2	固定收益投资	369,238,000.00	21.32
	其中：债券	369,238,000.00	21.32
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	461,000,000.00	26.62
	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	32,280,411.79	1.86
6	其他各项资产	13,276,722.73	0.77
7	合计	1,731,836,005.11	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	采矿业	-	-
C	制造业	576,935,978.97	33.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,482,373.76	5.91
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	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	148,257,052.28	8.63
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	29,365,465.58	1.71
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	856,040,870.59	49.83

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	11,999,834	118,198,364.90	6.88
2	002038	双鹭药业	2,000,000	117,200,000.00	6.82
3	600519	贵州茅台	448,630	86,302,953.10	5.02
4	600887	伊利股份	2,499,660	78,189,364.80	4.55
5	000651	格力电器	2,499,791	62,644,762.46	3.65
6	600535	天士力	1,600,000	62,640,000.00	3.65
7	000858	五 粮 液	1,999,996	40,079,919.84	2.33
8	600674	川投能源	3,873,840	39,396,952.80	2.29
9	600886	国投电力	9,359,592	31,635,420.96	1.84
10	300146	汤臣倍健	700,000	30,793,000.00	1.79

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	600519	贵州茅台	85,742,518.78	5.02
2	002646	青青稞酒	42,567,132.77	2.49
3	002385	大北农	42,309,006.74	2.48
4	002408	齐翔腾达	31,852,656.27	1.86
5	600418	江淮汽车	29,519,602.55	1.73
6	000858	五 粮 液	28,135,308.67	1.65
7	000402	金 融 街	24,084,583.70	1.41
8	600396	金山股份	23,386,634.27	1.37
9	300298	三诺生物	22,865,995.37	1.34
10	601965	中国汽研	22,585,831.47	1.32
11	002022	科华生物	22,284,394.10	1.30
12	002081	金 螳 螂	18,750,330.10	1.10
13	002230	科大讯飞	15,625,338.80	0.91
14	601808	中海油服	15,597,547.23	0.91
15	300005	探路者	15,438,356.90	0.90
16	000651	格力电器	14,526,741.98	0.85
17	300146	汤臣倍健	13,921,766.75	0.81
18	600887	伊利股份	12,897,545.30	0.75
19	002508	老板电器	12,681,881.72	0.74
20	600266	北京城建	12,050,578.69	0.71

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	600694	大商股份	89,947,924.33	5.26
2	601808	中海油服	74,791,424.13	4.38
3	002408	齐翔腾达	59,384,501.51	3.48
4	002051	中工国际	48,562,188.96	2.84
5	000729	燕京啤酒	47,648,097.28	2.79
6	002385	大北农	46,728,521.90	2.74
7	600276	恒瑞医药	46,417,231.23	2.72
8	002035	华帝股份	44,468,954.75	2.60
9	002646	青青稞酒	40,717,448.47	2.38
10	600761	安徽合力	40,302,230.79	2.36
11	601369	陕鼓动力	37,380,391.50	2.19
12	000786	北新建材	36,150,065.60	2.12
13	600266	北京城建	33,963,657.43	1.99
14	002662	京威股份	29,736,574.50	1.74
15	600011	华能国际	29,037,781.01	1.70
16	300251	光线传媒	27,676,461.47	1.62
17	600009	上海机场	26,455,318.44	1.55
18	600535	天士力	23,783,683.47	1.39
19	600418	江淮汽车	23,155,892.67	1.36
20	000422	湖北宜化	22,820,852.26	1.34