# 博时主题行业股票证券投资基金

## 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：中国建设银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国建设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

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 博时主题行业股票证券投资基金 |
| 基金简称 | 博时主题行业股票（LOF） |
| 场内简称 | 博时主题 |
| 基金主代码 | 160505 |
| 交易代码 | 160505 |
| 基金运作方式 | 契约型上市开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年1月6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 | 6,229,216,933.09份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2005年2月22日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 分享中国城市化、工业化及消费升级进程中经济与资本市场的高速成长，谋求基金资产的长期稳定增长。 |
| 投资策略 | 本基金采取价值策略指导下的行业增强型主动投资策略 |
| 业绩比较基准 | 80%×富时中国A600指数+20%×富时中国国债指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动型的股票基金，基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下，谋求实现基金资产的长期稳定增长。 |

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 | 孙麒清 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-83195140 | 010-66275853 |

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 | 208,173,247.57 |
| 本期利润 | -1,054,727,733.72 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1599 |
| 本期基金份额净值增长率 | -9.80% |
| **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 | 0.0480 |
| 期末基金资产净值 | 9,644,304,512.88 |
| 期末基金份额净值 | 1.548 |

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 | -11.85% | 1.78% | -12.43% | 1.48% | 0.58% | 0.30% |
| 过去三个月 | -7.47% | 1.41% | -8.99% | 1.13% | 1.52% | 0.28% |
| 过去六个月 | -9.80% | 1.45% | -8.86% | 1.16% | -0.94% | 0.29% |
| 过去一年 | -1.46% | 1.25% | -8.53% | 1.08% | 7.07% | 0.17% |
| 过去三年 | 14.19% | 1.20% | -10.38% | 1.10% | 24.57% | 0.10% |
| 自基金成立起至今 | 362.95% | 1.43% | 98.95% | 1.50% | 264.00% | -0.07% |

注：本基金的业绩比较基准为：80%×富时中国A600指数＋20%×富时中国国债指数。

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80%、20%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：本基金的基金合同于2005年1月6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6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（五）投资范围”、“（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“做投资价值的发现者”。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 | | |
| 邓晓峰 | 基金经理/股票投资部总经理/价值组投资总监 | 2007-03-14 | - | 11.5 | 1996年起先后在深圳市银业工贸有限公司、国泰君安证券股份有限公司工作。2005年加入博时公司，历任基金经理助理、社保股票基金经理。现任股票投资部总经理、价值组投资总监，兼任博时主题行业股票（LOF）基金经理、社保股票基金基金经理。 |

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、《博时主题行业股票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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、市场回顾

年初普遍预期经济弱复苏的状态没有持续。中央调结构、清理银子银行的行为限制了地方的投资冲动，经济弱复苏的过程中断。悲观预期之下，市场以卖出蓝筹、参与创业板的方式应对。一次次不利的经济数据出炉、一次次中央的调控措施都推动资金从蓝筹股转向创业板，而创业板的不断上涨也形成了自我强化。主板与创业板的分化达到新的水平。

2、上半年基金管理回顾

我们继续增加保险行业的投资。2013年上半年，保险公司的投资收益率开始恢复，盈利大幅增长。即使背负过去快速扭曲发展的包袱，行业保费收入的增速经历了1季度的低谷后开始恢复，上半年保费收入的增速已超过去年同期。同时，悲观的预期使保险公司的估值达到前所未有的低位。基本面与股价的背离使我们对这项投资的兴趣不断增加。我们增加了家电和汽车行业的配置。存在这样一些公司：它们的市值中1/3甚至更多是净现金、市盈率6-9倍、1倍的PB对应超过15%的ROE或者2倍的PB对应接近30%的ROE、收入利润保持两位数的增长。从常识的角度判断，我们认为这些标的有足够吸引力。

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1.548元，累计份额净值为3.386元，报告期内净值增长率为-9.80%，同期业绩基准涨幅为-8.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

即使在6月份“钱荒”袭击之下，最新PMI显示经济出现了企稳的早期迹象。今年来企业盈利维持着增长的局面。我们估计经济有望在8、9月份恢复向上的走势，全年经济最差的阶段正在过去。

从蓝筹股估值水平上看，现有的价格水平说明市场认为经济崩溃就在眼前。只要“市场共识”中的危机没有发生，市场终将产生修正。从公司的基本面来看，时间站在对投资者有利的一边。

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，当存在异议时，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

报告期内，本基金于2013年1月14日发布了分红公告，以截止到2012年12月31日的可供分配利润为基准，向基金份额持有人每10份基金份额派发红利0.22元。

### §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，本基金实施利润分配的金额为149,507,943.97元。

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：博时主题行业股票证券投资基金

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 | 647,469,166.31 | 745,103,669.91 |
| 结算备付金 | 4,303,977.38 | 4,387,249.84 |
| 存出保证金 | 1,367,455.47 | 2,113,164.60 |
| 交易性金融资产 | 9,045,831,271.37 | 10,983,164,616.03 |
| 其中：股票投资 | 9,034,484,595.87 | 10,829,057,011.63 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 11,346,675.50 | 154,107,604.40 |
| 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 | - | 10,866,401.22 |
| 应收利息 | 150,219.14 | 669,380.22 |
| 应收股利 | 17,986,712.90 | - |
| 应收申购款 | 2,215,501.75 | 4,364,968.17 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 9,719,324,304.32 | 11,750,669,449.99 |
| **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 | 41,522,530.10 | - |
| 应付赎回款 | 10,798,085.13 | 155,799,591.45 |
| 应付管理人报酬 | 12,627,285.82 | 13,287,478.06 |
| 应付托管费 | 2,104,547.63 | 2,214,579.68 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 3,376,945.84 | 2,302,047.75 |
| 应交税费 | 3,569,288.09 | 3,569,288.09 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 1,021,108.83 | 1,695,336.86 |
| 负债合计 | 75,019,791.44 | 178,868,321.89 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6,229,216,933.09 | 6,657,614,980.00 |
| 未分配利润 | 3,415,087,579.79 | 4,914,186,148.10 |
| 所有者权益合计 | 9,644,304,512.88 | 11,571,801,128.10 |
| 负债和所有者权益总计 | 9,719,324,304.32 | 11,750,669,449.99 |

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.548元，基金份额总额6,229,216,933.09份。

6.2 利润表

会计主体：博时主题行业股票证券投资基金

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 | -941,706,685.42 | 837,310,820.44 |
| 1.利息收入 | 3,106,444.73 | 7,351,154.34 |
| 其中：存款利息收入 | 2,716,725.96 | 2,576,879.54 |
| 债券利息收入 | 257,311.45 | 3,966,841.89 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 132,407.32 | 807,432.91 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 316,124,430.85 | 100,391,064.85 |
| 其中：股票投资收益 | 132,286,060.37 | -42,118,967.96 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 42,433,826.95 | 2,641,512.34 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 141,404,543.53 | 139,868,520.47 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -1,262,900,981.29 | 729,020,698.69 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 1,963,420.29 | 547,902.56 |
| 减：二、费用 | 113,021,048.30 | 102,916,557.90 |
| 1.管理人报酬 | 84,340,959.37 | 81,153,492.84 |
| 2.托管费 | 14,056,826.56 | 13,525,582.11 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 14,369,036.59 | 7,982,029.22 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 254,225.78 | 255,453.73 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -1,054,727,733.72 | 734,394,262.54 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -1,054,727,733.72 | 734,394,262.54 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时主题行业股票证券投资基金

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） | 6,657,614,980.00 | 4,914,186,148.10 | 11,571,801,128.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -1,054,727,733.72 | -1,054,727,733.72 |
| 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） | -428,398,046.91 | -294,862,890.62 | -723,260,937.53 |
| 其中：1.基金申购款 | 818,226,154.24 | 591,099,305.05 | 1,409,325,459.29 |
| 2.基金赎回款 | -1,246,624,201.15 | -885,962,195.67 | -2,132,586,396.82 |
| 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） | - | -149,507,943.97 | -149,507,943.97 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 6,229,216,933.09 | 3,415,087,579.79 | 9,644,304,512.88 |
| **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） | 6,423,265,263.00 | 3,667,276,559.09 | 10,090,541,822.09 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 734,394,262.54 | 734,394,262.54 |
| 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） | 374,547,882.27 | 207,098,491.65 | 581,646,373.92 |
| 其中：1.基金申购款 | 791,283,575.91 | 452,010,208.05 | 1,243,293,783.96 |
| 2.基金赎回款 | -416,735,693.64 | -244,911,716.40 | -661,647,410.04 |
| 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） | - | -590,661,103.12 | -590,661,103.12 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 6,797,813,145.27 | 4,018,108,210.16 | 10,815,921,355.43 |

报表附注为本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：

基金管理公司负责人：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） | 基金管理人、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 |

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 | 1,017,071,033.53 | 10.84% | 503,838,821.27 | 9.68% |

6.4.4.1.2 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 | 870,371.21 | 10.63% | 582,783.20 | 17.26% |
| **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 | 411,151.06 | 9.51% | 411,151.06 | 20.01% |

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 | 84,340,959.37 | 81,153,492.84 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,048,653.70 | 6,758,975.18 |

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 | 14,056,826.56 | 13,525,582.11 |

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0.25%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

无。

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 |
| 中国建设银行 | 647,469,166.31 | 2,619,437.98 | 659,077,743.75 | 2,484,598.78 |

注：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。

6.4.4.6 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

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 | 9,034,484,595.87 | 92.95 |
| | 其中：股票 | 9,034,484,595.87 | 92.95 |
| 2 | 固定收益投资 | 11,346,675.50 | 0.12 |
| | 其中：债券 | 11,346,675.50 | 0.12 |
| | 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 | 651,773,143.69 | 6.71 |
| 6 | 其他各项资产 | 21,719,889.26 | 0.22 |
| 7 | 合计 | 9,719,324,304.32 | 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 | 15,497,943.25 | 0.16 |
| C | 制造业 | 2,498,342,822.25 | 25.90 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,326,211,158.44 | 13.75 |
| E | 建筑业 | 637,650,000.00 | 6.61 |
| F | 批发和零售业 | 39,617,266.22 | 0.41 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,940,000.00 | 0.18 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 162,800,000.00 | 1.69 |
| J | 金融业 | 3,584,301,926.89 | 37.16 |
| K | 房地产业 | 590,999,704.50 | 6.13 |
| 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 | - | - |
| 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 | 162,123,774.32 | 1.68 |
| | 合计 | 9,034,484,595.87 | 93.68 |

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） | 公允值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 25,199,471 | 875,933,611.96 | 9.08 |
| 2 | 600886 | 国投电力 | 228,906,904 | 773,705,335.52 | 8.02 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 42,753,776 | 681,067,651.68 | 7.06 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 195,000,000 | 637,650,000.00 | 6.61 |
| 5 | 000002 | 万 科A | 59,999,970 | 590,999,704.50 | 6.13 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 44,981,795 | 521,788,822.00 | 5.41 |
| 7 | 600104 | 上汽集团 | 36,025,163 | 475,892,403.23 | 4.93 |
| 8 | 601628 | 中国人寿 | 30,500,000 | 417,545,000.00 | 4.33 |
| 9 | 601336 | 新华保险 | 14,811,825 | 366,000,195.75 | 3.79 |
| 10 | 600674 | 川投能源 | 31,885,488 | 324,275,412.96 | 3.36 |

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 | 359,054,205.99 | 3.10 |
| 2 | 600674 | 川投能源 | 265,667,337.93 | 2.30 |
| 3 | 000527 | 美的电器 | 257,708,833.35 | 2.23 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 251,195,995.81 | 2.17 |
| 5 | 000858 | 五 粮 液 | 234,609,819.47 | 2.03 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 232,727,266.52 | 2.01 |
| 7 | 601336 | 新华保险 | 231,454,406.62 | 2.00 |
| 8 | 600690 | 青岛海尔 | 229,760,431.23 | 1.99 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 213,601,614.95 | 1.85 |
| 10 | 600805 | 悦达投资 | 165,170,303.52 | 1.43 |
| 11 | 601633 | 长城汽车 | 144,106,111.07 | 1.25 |
| 12 | 600886 | 国投电力 | 137,493,912.51 | 1.19 |
| 13 | 601318 | 中国平安 | 124,933,249.48 | 1.08 |
| 14 | 600837 | 海通证券 | 107,304,827.33 | 0.93 |
| 15 | 600030 | 中信证券 | 97,989,357.99 | 0.85 |
| 16 | 600761 | 安徽合力 | 78,460,294.52 | 0.68 |
| 17 | 600000 | 浦发银行 | 70,370,148.18 | 0.61 |
| 18 | 600016 | 民生银行 | 69,083,334.34 | 0.60 |
| 19 | 000418 | 小天鹅A | 64,831,843.28 | 0.56 |
| 20 | 600585 | 海螺水泥 | 58,874,731.11 | 0.51 |

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 | 600795 | 国电电力 | 373,608,958.89 | 3.23 |
| 2 | 600104 | 上汽集团 | 316,402,699.43 | 2.73 |
| 3 | 002008 | 大族激光 | 307,541,140.16 | 2.66 |
| 4 | 600660 | 福耀玻璃 | 288,920,106.06 | 2.50 |
| 5 | 601006 | 大秦铁路 | 252,708,283.70 | 2.18 |
| 6 | 000858 | 五 粮 液 | 225,016,458.95 | 1.94 |
| 7 | 000063 | 中兴通讯 | 216,333,996.65 | 1.87 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 207,642,367.83 | 1.79 |
| 9 | 600741 | 华域汽车 | 196,681,209.38 | 1.70 |
| 10 | 600015 | 华夏银行 | 190,048,214.15 | 1.64 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 147,318,185.57 | 1.27 |
| 12 | 601633 | 长城汽车 | 141,730,504.66 | 1.22 |
| 13 | 000539 | 粤电力A | 141,163,770.89 | 1.22 |
| 14 | 600805 | 悦达投资 | 127,279,236.11 | 1.10 |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 122,680,217.00 | 1.06 |
| 16 | 600837 | 海通证券 | 122,001,266.62 | 1.05 |
| 17 | 600674 | 川投能源 | 105,167,074.50 | 0.91 |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 98,977,423.34 | 0.86 |
| 19 | 000895 | 双汇发展 | 95,976,790.97 | 0.83 |
| 20 | 600016 | 民生银行 | 94,238,602.20 | 0.81 |

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 | 4,389,757,961.51 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,076,447,788.92 |

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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
|