

博时第三产业成长股票证券投资基金

2013 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2013 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国工商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。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示 | 1 |
| 1.2 目录 | 2 |
| § 2 基金简介 | 4 |
| 2.1 基金基本情况 | 4 |
| 2.2 基金产品说明 | 4 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 4 |
| 2.4 信息披露方式 | 4 |
| 2.5 其他相关资料 | 5 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 5 |
| 3.2 基金净值表现 | 5 |
| § 4 管理人报告 | 6 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 6 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 8 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 8 |
| 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 | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 9 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 10 |
| § 5 托管人报告 | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 10 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 11 |
| 6.1 资产负债表 | 11 |
| 6.2 利润表 | 12 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 13 |
| 6.4 报表附注 | 14 |
| § 7 投资组合报告 | 27 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 27 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 28 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 28 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 29 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 30 |
| 7.6 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 | 30 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 30 |
| 7.8 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 | 30 |
| 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 30 |
| 7.10 投资组合报告附注 | 30 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 31 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 31 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 31 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 32 |

| | |
|--|----|
| § 10 重大事件揭示 | 32 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 32 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 32 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 32 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 32 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 32 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 32 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 32 |
| 10.8 其他重大事件 | 34 |
| § 11 备查文件目录 | 35 |
| 11.1 备查文件目录 | 35 |
| 11.2 存放地点 | 35 |
| 11.3 查阅方式 | 35 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 博时第三产业成长股票证券投资基金 |
| 基金简称 | 博时第三产业股票 |
| 基金主代码 | 050008 |
| 交易代码 | 050008 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年4月12日 |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 6,438,767,358.52份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 基于我国第三产业的快速发展壮大及其战略地位，本基金以高速增长第三产业集群企业为主要投资对象，通过深入研究并积极投资，力争为基金持有人获得超越于业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将通过“自上而下”的宏观分析，以及定性分析与定量分析相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行配置。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只积极主动管理的股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 孙麒麟 | 赵会军 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 95588 |
| 传真 | | 0755-83195140 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 办公地址 | | 广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 邮政编码 | | 518040 | 100140 |
| 法定代表人 | | 杨鹤 | 姜建清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|------------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、证券时报、上海证券报 |
| 登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址 | 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 博时基金管理有限公司 | 北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层 |

§ 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 | 338,324,123.75 |
| 本期利润 | 95,833,878.34 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0143 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.58% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.36% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2013 年 6 月 30 日） |
| 期末可供分配利润 | 978,493,148.60 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1520 |
| 期末基金资产净值 | 5,733,765,192.76 |
| 期末基金份额净值 | 0.891 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2013 年 6 月 30 日） |
| 基金份额累计净值增长率 | 26.96% |

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交易基金的各项费用，计入费用后持有人的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

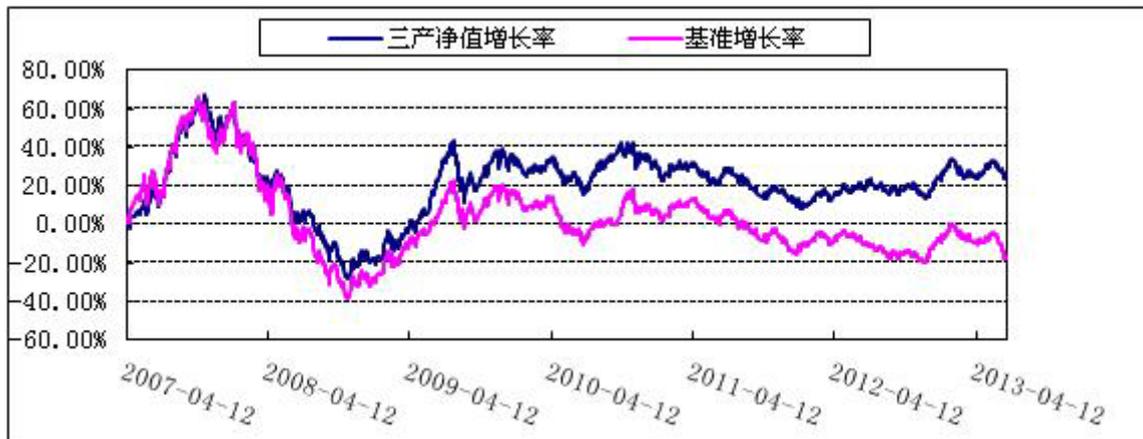
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | -3.88% | 1.01% | -12.67% | 1.50% | 8.79% | -0.49% |
| 过去三个月 | 0.11% | 0.78% | -9.30% | 1.16% | 9.41% | -0.38% |
| 过去六个月 | 1.36% | 0.95% | -9.79% | 1.20% | 11.15% | -0.25% |
| 过去一年 | 6.97% | 0.86% | -7.83% | 1.09% | 14.80% | -0.23% |
| 过去三年 | 6.64% | 0.94% | -8.92% | 1.10% | 15.56% | -0.16% |
| 自基金成立起至 | 26.96% | 1.38% | -16.85% | 1.59% | 43.81% | -0.21% |

| | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 今 | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

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：本基金由原封闭式基金一裕元证券投资基金转型而来，本基金合同于 2007 年 4 月 12 日生效。本基金于 2007 年 4 月 24 日完成了基金份额的集中申购，并向中国证监会提交了“关于博时基金管理有限公司申请延长博时第三产业成长股票证券投资基金证券投资比例调整期的请示”，将调整期由原来的 10 个交易日延长至三个月。按照本基金的基金合同规定，自集中申购份额确认之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十一条（二）投资范围、（五）投资限制的有关约定。调整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

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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------|-------------|-----------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘彦春 | 基金经理 | 2010-8-3 | - | 10.5 | 2002 起先后在汉唐证券研究所、香港中信投资研究有限公司任行业研究员。2006 年加入博时公司，历任研究员、研究员兼基金经理助理、博时新兴成长基金基金经理。现任博时第三产业成长股票基金的基金经理。 |
| 刘阳 | 研究员/基金经理助理 | 2012-5-31 | 2013-6-28 | 5 | 2008 年 7 月加入博时基金管理有限公司，历任研究员、研究员兼基金经理助理、博时第三产业股票基金基金经理助理。现任特定资产管理部投资经理。 |

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、《博时第三产业成长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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，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 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

2013 年上半年，传统行业与新兴产业股票走势严重分化。疲弱的经济基本面使得周期品为主的权重板块继续调整；部分景气度较高板块如传媒、电子持续受到资金追捧，估值高企。创业板、中小板与主板走势差异巨大。

基于政策及经济前景不确定性增加，博时第三产业基金坚守确定性成长，其中在二季度更多采取防守策略，在 6 月份市场大幅调整过程中较好的减少了净值损失。未来我们会继续将投资重心放在企业自身，希望通过选股获得超额收益。

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 0.891 元，累计份额净值为 2.730 元，报告期内净值增长率为 1.36%，同期业绩基准涨幅为-9.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2 季度经济疲弱表现与较高的货币投放继续背离。地产、基建投资平稳增长，但制造业投资、私人消费增速明显下滑。在海外主要经济体货币竞相贬值情况下，人民币基于国际化战略、国际资本流动等原因持续升值，下半年出口可能会面临更多困难。地产销售初现疲态，但地产销售及投资增长对于政府投资能力，甚至整个经济能否稳定都至关重要，但目前房价居高不下，对居民消费已经形成严重挤占，地产领域相关政策调整方向需要密接关注。

目前是我国经济转型的关键时期，传统产业需求不足，新的增长点还没有培育起来。在这样的背景下，未来经济大概率会维持较低增长速度，一旦突破政府容忍底线，仍然会有政策托底，地产和基建估计仍是抓手。但保增长仅是托底，在新的增长点培育起来之前，经济大幅反弹难度很大。流动性方面，尽管外汇占款减少会带来一定压力，但只要政府投资相对平稳，资金价格估计不会出现持续走高情况。

股票投资方面，下半年可能会出现一次经济快速下行后政府重新保增长带来的传统产业反弹机会。从更长远来看，经济增长模式调整带来的资源重新分配是更加难得的投资机遇，各个领域都可能新的优秀企业成长起来，管理层眼光、能力、执行力将变得格外重要。

感谢持有人一直以来对基金经理人的信赖，为您提供专业、勤勉的服务是我们的天职。

投资的道路上有喜悦，偶尔也会遭遇暂时的挫折，我们会及时总结经验和教训，不断提高自己的投资能力。天道酬勤，与赢者共赢。通过默默辛勤劳动和长期积累，通过专业的研究和资产管理，我们有信心在中长期取得优异回报。

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

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 1.53 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

本报告期内，本基金托管人在对博时第三产业成长股票证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，博时第三产业成长股票证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时第三产业成长股票证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时第三产业成长股票证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为1,029,705,228.11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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时第三产业成长股票证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：博时第三产业成长股票证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 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 | 6.4.3.1 | 132,472,501.36 | 220,758,442.56 |
| 结算备付金 | | 161,828,112.17 | 108,857,509.14 |
| 存出保证金 | | 3,885,025.39 | 1,310,410.13 |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 3,604,837,600.38 | 6,047,416,343.21 |
| 其中：股票投资 | | 3,604,837,600.38 | 6,047,416,343.21 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.3.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.3.4 | 1,780,000,870.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 14,155,388.12 | 318,663,003.80 |
| 应收利息 | 6.4.3.5 | 2,048,142.64 | 103,785.33 |
| 应收股利 | | 46,977,434.97 | - |
| 应收申购款 | | 561,448.82 | 1,501,341.85 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.6 | - | - |
| 资产总计 | | 5,746,766,523.85 | 6,698,610,836.02 |

| 负债和所有者权益 | 附注号 | 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 | 6.4.3.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 4,876.14 | - |
| 应付赎回款 | | 2,177,088.09 | 7,628,231.27 |
| 应付管理人报酬 | | 7,176,483.55 | 7,994,654.12 |
| 应付托管费 | | 1,196,080.58 | 1,332,442.36 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.3.7 | 956,104.63 | 4,902,655.74 |
| 应交税费 | | 25,137.60 | 25,137.60 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.8 | 1,465,560.50 | 1,484,201.30 |
| 负债合计 | | 13,001,331.09 | 23,367,322.39 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.3.9 | 2,910,549,129.85 | 2,929,492,607.63 |
| 未分配利润 | 6.4.3.10 | 2,823,216,062.91 | 3,745,750,906.00 |
| 所有者权益合计 | | 5,733,765,192.76 | 6,675,243,513.63 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,746,766,523.85 | 6,698,610,836.02 |

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.891 元，基金份额总额 6,438,767,358.52 份。

6.2 利润表

会计主体：博时第三产业成长股票证券投资基金

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 | 附注号 | 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 | | 159,946,477.67 | 348,467,976.45 |
| 1. 利息收入 | | 24,115,057.28 | 29,875,945.31 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.11 | 2,479,742.62 | 1,843,079.67 |
| 债券利息收入 | | 31,122.73 | 4,423,989.06 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 21,604,191.93 | 23,608,876.58 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 377,522,561.56 | -57,802,117.21 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.12 | 297,268,188.83 | -88,612,031.38 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.3.13 | 633,085.97 | 2,080,820.00 |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.3.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.3.15 | 79,621,286.76 | 28,729,094.17 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.3.16 | -242,490,245.41 | 376,310,253.88 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.3.17 | 799,104.24 | 83,894.47 |
| 减：二、费用 | | 64,112,599.33 | 62,253,322.47 |
| 1. 管理人报酬 | | 45,379,214.32 | 47,446,289.99 |
| 2. 托管费 | | 7,563,202.39 | 7,907,714.93 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.3.18 | 10,934,138.24 | 6,667,653.21 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.3.19 | 236,044.38 | 231,664.34 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 95,833,878.34 | 286,214,653.98 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 95,833,878.34 | 286,214,653.98 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时第三产业成长股票证券投资基金

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） | 2,929,492,607.63 | 3,745,750,906.00 | 6,675,243,513.63 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 95,833,878.34 | 95,833,878.34 |
| 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） | -18,943,477.78 | 11,336,506.68 | -7,606,971.10 |
| 其中：1. 基金申购款 | 493,056,275.78 | 537,751,906.28 | 1,030,808,182.06 |
| 2. 基金赎回款 | -511,999,753.56 | -526,415,399.60 | -1,038,415,153.16 |
| 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） | - | -1,029,705,228.11 | -1,029,705,228.11 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,910,549,129.85 | 2,823,216,062.91 | 5,733,765,192.76 |
| 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） | 3,054,177,931.63 | 3,252,893,633.00 | 6,307,071,564.63 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 286,214,653.98 | 286,214,653.98 |
| 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） | -58,078,153.13 | -68,646,787.17 | -126,724,940.30 |
| 其中：1. 基金申购款 | 92,300,690.83 | 99,378,587.93 | 191,679,278.76 |
| 2. 基金赎回款 | -150,378,843.96 | -168,025,375.10 | -318,404,219.06 |
| 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） | 2,996,099,778.50 | 3,470,461,499.81 | 6,466,561,278.31 |

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报报告相一致。

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 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 |
|------|-------------------|
| 活期存款 | 132,472,501.36 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 132,472,501.36 |

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 | | |
|--------|-------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 2,999,796,585.79 | 3,604,837,600.38 | 605,041,014.59 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 2,999,796,585.79 | 3,604,837,600.38 | 605,041,014.59 |

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 | |
|-----------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所买入返售证券 | 1,280,000,000.00- | - |
| 银行间买入返售证券 | 500,000,870.00- | - |
| 合计 | 1,780,000,870.00- | - |

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 30,014.19 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 72,822.60 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | 1,943,557.65 |
| 应收申购款利息 | - |
| 其他 | 1,748.20 |
| 合计 | 2,048,142.64 |

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 953,701.33 |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,403.30 |
| 合计 | 956,104.63 |

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 1,250,000.00 |
| 应付赎回费 | 2,329.83 |
| 预提费用 | 213,230.67 |
| 合计 | 1,465,560.50 |

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 6,480,424,122.19 | 2,929,492,607.63 |
| 本期申购 | 1,090,870,755.03 | 493,056,275.78 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,132,527,518.70 | -511,999,753.56 |
| 本期末 | 6,438,767,358.52 | 2,910,549,129.85 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------------|------------------|-------------------|
| 上年度末 | 1,643,500,417.72 | 2,102,250,488.28 | 3,745,750,906.00 |
| 本期利润 | 338,324,123.75 | -242,490,245.41 | 95,833,878.34 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 26,373,835.24 | -15,037,328.56 | 11,336,506.68 |
| 其中：基金申购款 | 191,072,602.59 | 346,679,303.69 | 537,751,906.28 |
| 基金赎回款 | -164,698,767.35 | -361,716,632.25 | -526,415,399.60 |
| 本期已分配利润 | -1,029,705,228.11 | - | -1,029,705,228.11 |
| 本期末 | 978,493,148.60 | 1,844,722,914.31 | 2,823,216,062.91 |

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 1,525,126.28 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 927,859.85 |
| 其他 | 26,756.49 |
| 合计 | 2,479,742.62 |

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 4,424,754,583.91 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,127,486,395.08 |
| 买卖股票差价收入 | 297,268,188.83 |

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 23,420,208.70 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 22,756,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 31,122.73 |
| 债券投资收益 | 633,085.97 |

6.4.3.14 衍生工具收益

无余额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 79,621,286.76 |

| | |
|-------------|---------------|
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 79,621,286.76 |

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -242,490,245.41 |
| ——股票投资 | -242,490,245.41 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -242,490,245.41 |

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 571,263.16 |
| 配股手续费 | - |
| 印花税返还 | - |
| 转换费收入 | 227,841.08 |
| 其他 | - |
| 合计 | 799,104.24 |

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 10,934,138.24 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 10,934,138.24 |

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 64,464.96 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |

| | |
|----------|------------|
| 银行汇划费 | 13,413.71 |
| 银行间账户维护费 | 9,400.00 |
| 合计 | 236,044.38 |

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 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 | 731,987,764.66 | 11.52% | 187,131,974.06 | 4.16% |

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 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 | 650,742.97 | 11.32% | 107,272.08 | 11.25% |
| 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 | 162,942.63 | 4.51% | 162,942.63 | 7.20% |

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2013年1月1日至2013年6月30日 | 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 | 45,379,214.32 | 47,446,289.99 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 7,934,476.75 | 8,369,107.56 |

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。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2013年1月1日至2013年6月30日 | 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 | 7,563,202.39 | 7,907,714.93 |

注：支付基金托管人中国工商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。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|
| | 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 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 |
| 中国工商银行 | 132,472,501.36 | 1,525,126.28 | 148,055,606.16 | 1,054,863.17 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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 |
| - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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 | 000651 | 格力电器 | 老股东增发配售 | 749,984 | 12,869,725.44 |
| 招商证券 | 600143 | 金发科技 | 增发网上中签 | 1,000,000 | 12,630,000.00 |

6.4.7 利润分配情况

单位: 人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|----------------|----------------|------------------|----|
| 1 | 2013-01-16 | 2013-01-16 | 1.530 | 570,213,277.38 | 459,491,950.73 | 1,029,705,228.11 | - |
| 合计 | - | - | 1.530 | 570,213,277.38 | 459,491,950.73 | 1,029,705,228.11 | - |

6.4.8 期末 (2013 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 |
|--------|------|-----------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 000999 | 华润三九 | 2013-6-03 | 重大资产重组 | 26.55 | 2013-08-19 | 26.51 | 199,987 | 6,077,091.54 | 5,309,654.85 | - |

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只积极主动管理的股票型基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，并通过深入研究并积极投资，力争实现为基金持有人获得超越于业绩比较基准的投资回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察法律部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察法律部对公司执行总裁负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2012 年 12 月 31 日，同)。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金

流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2013年6月 30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|------------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 132,472,501.36 | - | - | - | 132,472,501.36 |
| 结算备付金 | 161,828,112.17 | - | - | - | 161,828,112.17 |
| 存出保证金 | 3,885,025.39 | - | - | - | 3,885,025.39 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 3,604,837,600.38 | 3,604,837,600.38 |
| 买入返售金融资产 | 1,780,000,870.00 | - | - | - | 1,780,000,870.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 14,155,388.12 | 14,155,388.12 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,048,142.64 | 2,048,142.64 |
| 应收股利 | - | - | - | 46,977,434.97 | 46,977,434.97 |
| 应收申购款 | - | - | - | 561,448.82 | 561,448.82 |
| 资产总计 | 2,078,186,508.92 | - | - | 3,668,580,014.93 | 5,746,766,523.85 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 4,876.14 | 4,876.14 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,177,088.09 | 2,177,088.09 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 7,176,483.55 | 7,176,483.55 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,196,080.58 | 1,196,080.58 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 956,104.63 | 956,104.63 |
| 应交税费 | - | - | - | 25,137.60 | 25,137.60 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,465,560.50 | 1,465,560.50 |
| 负债总计 | - | - | - | 13,001,331.09 | 13,001,331.09 |
| 利率敏感度缺口 | 2,078,186,508.92 | - | - | 3,655,578,683.84 | 5,733,765,192.76 |
| 上年度末 2012年12月 31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 220,758,442.56 | - | - | - | 220,758,442.56 |

| | | | | | |
|----------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 结算备付金 | 108,857,509.14 | - | - | - | 108,857,509.14 |
| 存出保证金 | - | - | - | 1,310,410.13 | 1,310,410.13 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 6,047,416,343.21 | 6,047,416,343.21 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 318,663,003.80 | 318,663,003.80 |
| 应收利息 | - | - | - | 103,785.33 | 103,785.33 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,501,341.85 | 1,501,341.85 |
| 资产总计 | 329,615,951.70 | - | - | 6,368,994,884.32 | 6,698,610,836.02 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 7,628,231.27 | 7,628,231.27 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 7,994,654.12 | 7,994,654.12 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,332,442.36 | 1,332,442.36 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 4,902,655.74 | 4,902,655.74 |
| 应交税费 | - | - | - | 25,137.60 | 25,137.60 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,484,201.30 | 1,484,201.30 |
| 负债总计 | - | - | - | 23,367,322.39 | 23,367,322.39 |
| 利率敏感度缺口 | 329,615,951.70 | - | - | 6,345,627,561.93 | 6,675,243,513.63 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资(2012 年 12 月 31 日，同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况

或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资为 0%-35%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 3,604,837,600.38 | 62.87 | 6,047,416,343.21 | 90.59 |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 3,604,837,600.38 | 62.87 | 6,047,416,343.21 | 90.59 |

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变 | | |
|-------------|-----------------------|------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元） | |
| | | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
| | 沪深300指数下降5% | 减少约12,043 | 减少约24,607 |
| 沪深300指数上升5% | 增加约12,043 | 增加约24,607 | |

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 3,599,527,945.53 元，属于第二层级的余额为 5,309,654.85 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 5,728,816,343.21 元，第二层级 318,600,000.00 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 3,604,837,600.38 | 62.73 |
| | 其中：股票 | 3,604,837,600.38 | 62.73 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 4 | 买入返售金融资产 | 1,780,000,870.00 | 30.97 |
| | 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 | 294,300,613.53 | 5.12 |
| 6 | 其他各项资产 | 67,627,439.94 | 1.18 |
| 7 | 合计 | 5,746,766,523.85 | 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 | 2,501,345,327.51 | 43.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 73,279,351.60 | 1.28 |
| E | 建筑业 | 28,559,181.28 | 0.50 |
| F | 批发和零售业 | 5,134,800.00 | 0.09 |
| 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 | 838,918,939.99 | 14.63 |
| K | 房地产业 | 157,600,000.00 | 2.75 |
| 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 | - | - |
| | 合计 | 3,604,837,600.38 | 62.87 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 600066 | 宇通客车 | 30,600,000 | 560,898,000.00 | 9.78 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 21,999,981 | 551,319,523.86 | 9.62 |
| 3 | 600535 | 天士力 | 11,700,000 | 458,055,000.00 | 7.99 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 99,999,804 | 414,999,186.60 | 7.24 |
| 5 | 601633 | 长城汽车 | 8,303,865 | 294,122,898.30 | 5.13 |
| 6 | 601288 | XD 农业银 | 100,000,000 | 246,000,000.00 | 4.29 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 1,027,000 | 197,563,990.00 | 3.45 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 7,150,000 | 188,474,000.00 | 3.29 |
| 9 | 000002 | 万科A | 16,000,000 | 157,600,000.00 | 2.75 |
| 10 | 601988 | 中国银行 | 39,999,909 | 108,399,753.39 | 1.89 |
| 11 | 000895 | 双汇发展 | 1,999,718 | 76,869,159.92 | 1.34 |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 2,000,000 | 69,520,000.00 | 1.21 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|---------------|------|
| 13 | 600887 | 伊利股份 | 1,999,925 | 62,557,654.00 | 1.09 |
| 14 | 600795 | 国电电力 | 19,999,922 | 45,599,822.16 | 0.80 |
| 15 | 002250 | 联化科技 | 1,799,419 | 35,970,385.81 | 0.63 |
| 16 | 601117 | 中国化学 | 2,999,914 | 28,559,181.28 | 0.50 |
| 17 | 600900 | 长江电力 | 3,999,932 | 27,679,529.44 | 0.48 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 1,999,923 | 26,418,982.83 | 0.46 |
| 19 | 002317 | 众生药业 | 339,906 | 7,467,734.82 | 0.13 |
| 20 | 600976 | 武汉健民 | 324,965 | 7,019,244.00 | 0.12 |
| 21 | 300026 | 红日药业 | 189,918 | 6,445,816.92 | 0.11 |
| 22 | 002022 | 科华生物 | 425,000 | 6,294,250.00 | 0.11 |
| 23 | 000848 | 承德露露 | 265,000 | 6,018,150.00 | 0.10 |
| 24 | 000625 | 长安汽车 | 600,000 | 5,574,000.00 | 0.10 |
| 25 | 000999 | 华润三九 | 199,987 | 5,309,654.85 | 0.09 |
| 26 | 601933 | 永辉超市 | 440,000 | 5,134,800.00 | 0.09 |
| 27 | 000527 | 美的电器 | 399,910 | 4,966,882.20 | 0.09 |

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 | 601939 | 建设银行 | 327,661,560.74 | 4.91 |
| 2 | 601288 | 农业银行 | 224,135,507.23 | 3.36 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 191,801,933.43 | 2.87 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 151,149,117.27 | 2.26 |
| 5 | 601336 | 新华保险 | 146,149,058.01 | 2.19 |
| 6 | 601628 | 中国人寿 | 125,563,010.47 | 1.88 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 118,333,078.58 | 1.77 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 58,990,901.98 | 0.88 |
| 9 | 600795 | 国电电力 | 58,469,214.76 | 0.88 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 42,004,429.09 | 0.63 |
| 11 | 002250 | 联化科技 | 40,916,399.85 | 0.61 |
| 12 | 600011 | 华能国际 | 34,527,384.82 | 0.52 |
| 13 | 600104 | 上汽集团 | 33,740,629.23 | 0.51 |
| 14 | 000417 | 合肥百货 | 31,447,731.68 | 0.47 |
| 15 | 601633 | 长城汽车 | 28,209,546.63 | 0.42 |
| 16 | 601117 | 中国化学 | 27,612,105.13 | 0.41 |
| 17 | 600859 | 王府井 | 25,483,236.99 | 0.38 |
| 18 | 600027 | 华电国际 | 21,755,686.38 | 0.33 |
| 19 | 002277 | 友阿股份 | 20,413,497.49 | 0.31 |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 20,130,291.06 | 0.30 |

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 | 600535 | 天士力 | 358,075,110.48 | 5.36 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 289,007,486.54 | 4.33 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 272,080,895.22 | 4.08 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 266,065,579.75 | 3.99 |
| 5 | 600809 | 山西汾酒 | 243,457,137.96 | 3.65 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 240,789,051.50 | 3.61 |
| 7 | 600066 | 宇通客车 | 235,631,333.39 | 3.53 |
| 8 | 601668 | 中国建筑 | 201,207,901.01 | 3.01 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 193,482,335.79 | 2.90 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 188,405,831.77 | 2.82 |
| 11 | 000002 | 万科A | 153,905,852.35 | 2.31 |
| 12 | 601336 | 新华保险 | 134,531,388.93 | 2.02 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 123,923,137.50 | 1.86 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖 | 114,673,412.19 | 1.72 |
| 15 | 601628 | 中国人寿 | 110,274,544.75 | 1.65 |
| 16 | 000001 | 平安银行 | 93,498,354.62 | 1.40 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 83,523,948.69 | 1.25 |
| 18 | 600694 | 大商股份 | 76,133,638.70 | 1.14 |
| 19 | 600383 | 金地集团 | 74,256,694.11 | 1.11 |
| 20 | 000528 | 柳工 | 71,328,194.59 | 1.07 |

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 | 1,927,397,897.66 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,424,754,583.91 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,885,025.39 |
| 2 | 应收证券清算款 | 14,155,388.12 |
| 3 | 应收股利 | 46,977,434.97 |
| 4 | 应收利息 | 2,048,142.64 |
| 5 | 应收申购款 | 561,448.82 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 67,627,439.94 |

7.10.4 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。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.10.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|-----------|---------------|--------|------------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 373,467 | 17,240.53 | 94,985,169.31 | 1.48% | 6,343,782,189.21 | 98.52% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|-------------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 144,853.83 | 0.00% |

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2007 年 4 月 12 日）基金份额总额 | 1,500,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 6,480,424,122.19 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,090,870,755.03 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,132,527,518.70 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 6,438,767,358.52 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于2013年6月1日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，何宝不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由杨鹁代任公司总经理。

基金管理人于 2013 年 7 月 26 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经博时基金管理有限公司第五届董事会 2013 年第三次会议审议并通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】962 号文核准批复，博时基金管理有限公司聘任吴姚东担任博时基金管理有限公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|--------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中金公司 | 2 | 1,618,519,666.76 | 25.48% | 1,471,070.12 | 25.59% | 新增 1 个 |
| 银河证券 | 1 | 1,289,063,512.27 | 20.29% | 1,173,565.99 | 20.42% | - |
| 国金证券 | 1 | 1,160,905,564.75 | 18.28% | 1,056,888.04 | 18.39% | 新增 1 个 |
| 招商证券 | 2 | 731,987,764.66 | 11.52% | 650,742.97 | 11.32% | - |
| 广发证券 | 2 | 688,672,555.51 | 10.84% | 626,964.04 | 10.91% | - |
| 安信证券 | 1 | 630,613,588.15 | 9.93% | 574,109.79 | 9.99% | 新增 1 个 |
| 海通证券 | 1 | 93,780,823.86 | 1.48% | 85,378.58 | 1.49% | 新增 1 个 |
| 中信证券 | 3 | 82,413,169.34 | 1.30% | 58,545.46 | 1.02% | - |
| 华林证券 | 2 | 56,195,836.27 | 0.88% | 51,137.22 | 0.89% | 新增 1 个 |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 2 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；

能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|------------------|-----------|
| 1 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/6/22 |
| 2 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/6/14 |
| 3 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/6/8 |
| 4 | 关于博时旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/6/5 |
| 5 | 关于博时旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司申购及定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/6/5 |
| 6 | 关于博时旗下部分基金继续参加重庆银行股份有限公司网上银行基金申购及定期定额申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/5/22 |
| 7 | 关于博时旗下部分基金参加中期时代基金销售（北京）有限公司申购及定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/5/22 |
| 8 | 关于博时旗下部分基金增加中期时代基金销售（北京）有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/5/22 |
| 9 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的上海家化估值方法调整的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/5/15 |
| 10 | 关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司非现场渠道申购及定期定额申购业务费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/5/10 |
| 11 | 关于博时旗下部分基金开通在好买基金转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/5/6 |
| 12 | 博时基金管理有限公司关于开通基金直销网上交易和查询系统移动版的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/4/15 |
| 13 | 关于博时公司旗下部分基金增加第一创业证券为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/4/12 |
| 14 | 关于博时旗下部分基金开通在好买基金定投业务并参加好买基金定投优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/4/1 |
| 15 | 关于博时旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/4/1 |
| 16 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/3/23 |

| | | | |
|----|---|------------------|-----------|
| 17 | 博时基金管理有限公司关于股东名称变更、增加注册资本及修改《公司章程》的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/3/13 |
| 18 | 博时基金管理有限公司关于成立博时资本管理有限公司的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/2/28 |
| 19 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/2/27 |
| 20 | 关于博时公司旗下部分基金增加国金证券为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/2/22 |
| 21 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/2/8 |
| 22 | 博时旗下部分基金参加浦发银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/1/31 |
| 23 | 博时第三产业成长股票证券投资基金分红公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/1/14 |
| 24 | 关于博时旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司非现场交易费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/1/11 |
| 25 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2013/1/4 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时第三产业成长股票证券投资基金设立的文件
- 11.1.2 《博时第三产业成长股票证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时第三产业成长股票证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 11.1.5 博时第三产业成长股票证券投资基金各年度审计报告正本
- 11.1.6 报告期内博时第三产业成长股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司。

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
2013 年 8 月 29 日