

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2013 年半年度报告摘要

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	13,933,219,117.93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	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqingl.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	-266,453,333.82
本期利润	-1,114,070,811.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0832
本期基金份额净值增长率	-12.33%
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	-0.3869
期末基金资产净值	8,542,925,817.16
期末基金份额净值	0.6131

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

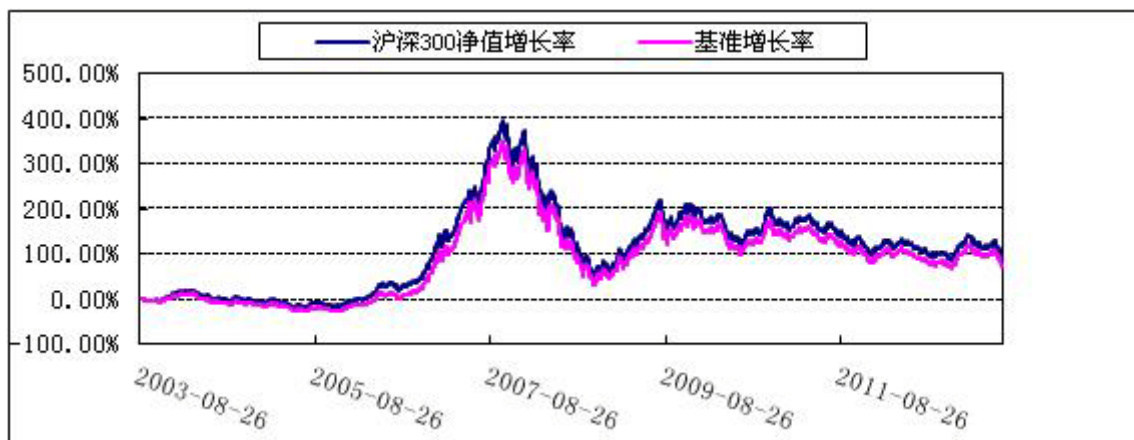
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-14.05%	1.80%	-14.83%	1.77%	0.78%	0.03%
过去三个月	-10.50%	1.39%	-11.21%	1.38%	0.71%	0.01%
过去六个月	-12.33%	1.44%	-12.11%	1.42%	-0.22%	0.02%
过去一年	-10.14%	1.31%	-9.97%	1.30%	-0.17%	0.01%
过去三年	-12.29%	1.31%	-13.11%	1.30%	0.82%	0.01%
自基金成立起至今	93.88%	1.66%	76.09%	1.69%	17.79%	-0.03%

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		
胡俊敏	基金经理	2012-11-22	-	6	1996 年起先后在哈佛大学、惠普安捷伦科技、汤姆森金融公司、贝莱德全球金融公司工作，2011 年 2 月加入博时基金管理有限公司，现任博时特许价值基金、博时上证自然资源 ETF 基金及其联接基金、博时沪深 300 指数基金、博时标普 500 指数基金的基金经理。
王红欣	基金经理 /ETF 及量化投资组投资总监	2013-1-9	-	19	1994 年起先后在 RXR 期货管理公司、Aeltus 投资管理公司、Putnam 投资公司、Acadian 资产管理公司、易方达资产管理（香港）有限公司工作。2012 年 10 月加入博时基金管理有限公司，担任股票投资部 ETF 及量化投资组投资总监、博时标普 500 指数型证券投资基金、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金经理。
孟亚强	基金经理助理	2012-4-5	-	4	2009 年 7 月从南开大学保险学专业毕业后加入博时基金管理有限公司，历任股票投资

					部数量化研究员、股票投资部特定资产投资经理助理兼任量化研究员。现任股票投资部基金经理助理。
郑宇泉	基金经 理助理	2013-1-30	-	6	2007 年起先后在美国 PGAM 对冲基金、盛融（上海）信息技术公司工作。2011 年 4 月加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部量化研究员，特定资产投资经理助理。现任股票投资部基金经理助理。

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，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

2013 年伊始，在 12 年年底宏观经济数据利好的刺激下，A 股走出了一波小行情。过了二月份，随着新一届政府换届的进行，A 股市场对新政府经济政策还处于探索阶段，在这过程中，国内 PMI 等经济数据不断探底，却迟迟不见新政府对经济政策明显的表态，市场整体情绪低迷。进入四、五月份，美国经济复苏前景逐渐明朗，QE 即将退出的情绪在市场蔓延，随着美联储月度会议的召开，退出时间表逐渐明朗，资本市场的流动性开始紧张。六月底，恰逢国内市场季度末资金紧张，大量银行理财产品到期，央行一反常态，未见流动性放松，严格限制银行理财产品的发行，并着手处理影子银行问题，从严对待。随之债券基金降杠杆，金融杠杆较高的商业银行暴跌，拉动股指创下新低。上半年中小板，创业板指数表现对较好，

大消费品板块相对抗跌。在投资策略上我们依靠在各行业内精选个股的量化策略，以多方位的估值和基本面逻辑为主，结合个股短期表现，精选估值水平低，公司盈利持续性好、成长性好的个股，进行沪深 300 指数增强运作。

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 0.6131 元，累计份额净值为 2.5931 元，报告期内净值增长率为-12.33%，同期业绩基准涨幅为-12.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为以结构性行情为主，不确定性因素仍然较多，随着美国经济的复苏，全球资本向美国流动的趋势不可避免，随着 QE 政策退出步伐逐渐清晰，大宗商品价格将进一步承压。国内市场建议关注新政府的城镇化政策，和十八届三中全会前后政府对经济政策的表态。从指数看，市场对悲观的经济前景有了充分的预期，不过在预期还未明朗前，市场还是以结构行情为主，多空双方均有机会，看好交运设备，医药，TMT，电力，公用事业板块。

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

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关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：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	466,870,352.31	505,084,229.71
结算备付金	9,578,880.33	91,497.20
存出保证金	766,803.79	1,444,659.10
交易性金融资产	8,074,607,560.75	8,845,429,727.59
其中：股票投资	8,074,607,560.75	8,845,429,727.59
基金投资	-	-

债券投资	-	-
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	10,351,465.91	55,935,860.21
应收利息	112,877.99	111,895.92
应收股利	20,971,955.89	-
应收申购款	3,182,547.93	1,924,599.93
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,586,442,444.90	9,410,022,469.66
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2013年6月30日	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	26,609,724.15	36,405,745.28
应付赎回款	1,747,606.61	3,923,545.17
应付管理人报酬	7,142,544.74	7,155,835.25
应付托管费	1,457,662.19	1,460,374.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,843,910.09	4,175,287.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	715,179.96	986,629.76
负债合计	43,516,627.74	54,107,417.78
所有者权益：		
实收基金	13,933,219,117.93	13,379,231,495.22
未分配利润	-5,390,293,300.77	-4,023,316,443.34
所有者权益合计	8,542,925,817.16	9,355,915,051.88
负债和所有者权益总计	8,586,442,444.90	9,410,022,469.66

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6131 元，基金份额总额 13,933,219,117.93 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

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

	月 30 日	月 30 日
一、收入	-1,040,945,669.94	592,325,550.04
1. 利息收入	1,965,356.20	4,800,684.84
其中：存款利息收入	1,958,647.97	1,090,466.30
债券利息收入	6,708.23	3,710,218.54
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）	-196,132,167.49	-167,575,772.14
其中：股票投资收益	-304,432,340.65	-271,566,596.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,657,183.77	1,227,841.99
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	106,642,989.39	102,762,981.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-847,617,477.45	754,524,414.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	838,618.80	576,222.92
减：二、费用	73,125,141.33	60,421,002.34
1. 管理人报酬	45,705,012.58	47,545,239.23
2. 托管费	9,327,553.53	9,703,110.13
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,860,938.45	2,944,049.46
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	231,636.77	228,603.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,114,070,811.27	531,904,547.70
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,114,070,811.27	531,904,547.70

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：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）	13,379,231,495.22	-4,023,316,443.34	9,355,915,051.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,114,070,811.27	-1,114,070,811.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	553,987,622.71	-252,906,046.16	301,081,576.55

少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	2,027,512,108.90	-670,213,942.04	1,357,298,166.86
2. 基金赎回款	-1,473,524,486.19	417,307,895.88	-1,056,216,590.31
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）	13,933,219,117.93	-5,390,293,300.77	8,542,925,817.16
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）	14,144,724,458.35	-5,007,639,576.69	9,137,084,881.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	531,904,547.70	531,904,547.70
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）	-462,134,272.15	129,084,486.83	-333,049,785.32
其中：1. 基金申购款	485,822,241.50	-141,656,918.18	344,165,323.32
2. 基金赎回款	-947,956,513.65	270,741,405.01	-677,215,108.64
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）	13,682,590,186.20	-4,346,650,542.16	9,335,939,644.04

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 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

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	2,095,920,926.03	16.93%	42,353,065.56	2.30%

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	1,853,408.25	17.90%	1,158,927.91	19.83%
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	35,894.38	2.30%	35,894.38	2.73%

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	45,705,012.58
其中：支付销售机构的客户维护费	3,987,874.91	4,181,999.41

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。

6.4.4.2.2 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	9,327,553.53

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。

6.4.4.3 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	466,870,352.31	1,852,118.02	398,645,836.21	1,081,495.23

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

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
招商证券	-	-	-	-	-
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	老股东配股	109,306	1,875,690.96

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

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
600436	片仔癀	2013-06-21	配股停牌	136.82	2013-07-01	118.73	93,382	11,188,547.12	12,776,525.24	-
600547	山东黄金	2013-04-03	公告重大事项	32.13	2013-07-01	28.77	999,490	31,362,888.52	32,113,613.70	-
000683	远兴能源	2013-04-08	公告重大事项	4.80	2013-07-18	5.09	2,326,794	11,157,027.89	11,168,611.20	-
000999	华润三九	2013-06-03	公告重大事项	26.55	2013-08-19	26.51	1,330,203	33,938,735.34	35,316,889.65	-

注：本基金截至 2013 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 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	8,074,607,560.75	94.04
	其中：股票	8,074,607,560.75	94.04
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	-	-
	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	476,449,232.64	5.55
6	其他各项资产	35,385,651.51	0.41
7	合计	8,586,442,444.90	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	23,515,557.30	0.28
B	采矿业	631,169,970.28	7.39
C	制造业	2,785,492,340.44	32.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	295,505,792.78	3.46
E	建筑业	395,738,368.93	4.63
F	批发和零售业	294,142,056.56	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	162,432,014.04	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	119,835,850.98	1.40
J	金融业	2,719,854,335.50	31.84
K	房地产业	473,351,089.15	5.54
L	租赁和商务服务业	20,294,901.01	0.24

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	71,574,053.87	0.84
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	30,636,553.99	0.36
S	综合	51,064,675.92	0.60
	合计	8,074,607,560.75	94.52

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	600016	民生银行	37,608,865	322,307,973.05	3.77
2	600036	招商银行	24,240,000	281,184,000.00	3.29
3	601166	兴业银行	17,931,546	264,848,934.42	3.10
4	601318	中国平安	5,839,714	202,988,458.64	2.38
5	601088	中国神华	9,942,270	168,422,053.80	1.97
6	600519	贵州茅台	842,012	161,977,848.44	1.90
7	000002	万科A	16,350,462	161,052,050.70	1.89
8	600000	浦发银行	19,201,001	158,984,288.28	1.86
9	600837	海通证券	15,215,146	142,718,069.48	1.67
10	600030	中信证券	13,255,983	134,283,107.79	1.57

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	601088	中国神华	125,910,343.96	1.35
2	600348	阳泉煤业	109,397,356.35	1.17
3	600362	江西铜业	93,362,972.25	1.00
4	000758	中色股份	78,798,547.81	0.84
5	601166	兴业银行	73,302,272.39	0.78
6	601006	大秦铁路	70,140,605.91	0.75
7	601009	南京银行	67,871,491.91	0.73
8	600153	建发股份	62,700,961.38	0.67
9	600256	广汇能源	62,312,274.90	0.67
10	600795	国电电力	58,931,304.56	0.63
11	600497	驰宏锌锗	58,572,879.19	0.63
12	600111	包钢稀土	58,449,918.25	0.62
13	002202	金风科技	57,684,535.44	0.62
14	000063	中兴通讯	56,817,564.19	0.61
15	600104	上汽集团	56,525,180.51	0.60

16	600309	万华化学	56,162,341.73	0.60
17	600519	贵州茅台	55,737,114.58	0.60
18	000725	京东方 A	55,725,021.94	0.60
19	600066	宇通客车	55,004,720.46	0.59
20	600177	雅戈尔	53,645,710.97	0.57

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	000568	泸州老窖	102,362,676.55	1.09
2	600028	中国石化	78,698,691.13	0.84
3	601088	中国神华	72,872,120.19	0.78
4	600694	大商股份	71,431,960.12	0.76
5	600111	包钢稀土	71,362,166.94	0.76
6	600596	新安股份	63,585,258.65	0.68
7	600827	友谊股份	62,054,722.19	0.66
8	600016	民生银行	61,464,060.27	0.66
9	600104	上汽集团	58,359,339.07	0.62
10	600970	中材国际	53,499,395.18	0.57
11	601898	中煤能源	52,917,801.39	0.57
12	600219	南山铝业	52,478,283.75	0.56
13	600863	内蒙华电	51,703,397.06	0.55
14	601117	中国化学	51,212,766.65	0.55
15	601607	上海医药	49,872,523.31	0.53
16	601998	中信银行	49,558,043.23	0.53
17	600157	永泰能源	49,210,847.60	0.53
18	601186	中国铁建	48,649,254.66	0.52
19	601390	中国中铁	47,938,414.76	0.51
20	600019	宝钢股份	47,698,997.07	0.51

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	6,395,966,153.65
卖出股票收入（成交）总额	6,014,738,502.39

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。

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仓股指期货。

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	766,803.79
2	应收证券清算款	10,351,465.91
3	应收股利	20,971,955.89
4	应收利息	112,877.99
5	应收申购款	3,182,547.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,385,651.51

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
661,303	21,069.34	1,763,926,294.25	12.66%	12,169,292,823.68	87.34%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	2,287,457.51	0.02%
	合计	2,287,457.51	0.02%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本基金的区间为：50 万份至 100 万份（含）；

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（2003 年 8 月 26 日）基金份额总额	5,126,401,391.87
本报告期期初基金份额总额	13,379,231,495.22
本报告期基金总申购份额	2,027,512,108.90
减：本报告期基金总赎回份额	1,473,524,486.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,933,219,117.93

§ 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

(1) 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，由杨鹤代任公司总经理。

(2) 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。

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	
招商证券	3	2,095,920,926.03	16.93%	1,853,408.25	17.90%	-
东方证券	3	2,018,786,637.34	16.31%	1,424,154.15	13.76%	-
中金公司	1	1,468,828,921.91	11.86%	1,327,810.79	12.83%	-
中信证券	3	1,463,295,597.23	11.82%	1,332,146.86	12.87%	-
中银国际	1	1,328,208,982.51	10.73%	943,564.08	9.11%	-
银河证券	1	1,074,427,060.36	8.68%	978,159.12	9.45%	-
瑞银证券	1	766,020,093.03	6.19%	697,390.11	6.74%	-
民生证券	1	518,213,671.01	4.19%	368,137.40	3.56%	新增
兴业证券	1	515,008,627.41	4.16%	468,858.95	4.53%	-
中信建投	1	432,954,937.87	3.50%	394,167.35	3.81%	-
安信证券	1	327,304,041.05	2.64%	232,515.69	2.25%	新增
高华证券	1	249,023,735.57	2.01%	220,364.12	2.13%	-
中投证券	2	122,207,417.28	0.99%	111,259.84	1.07%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

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，本公司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、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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。

博时基金管理有限公司

2013 年 8 月 29 日