

# 博时精选股票证券投资基金

## 2013 年第 3 季度报告

### 2013 年 9 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 10 月 23 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	博时精选股票
基金主代码	050004
交易代码	050004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 6 月 22 日
报告期末基金份额总额	6,239,403,040.48 份
投资目标	始终坚持并不断深化价值投资的基本理念，充分发挥专业研究与管理能力，自下而上精选个股，适度主动配置资产，系统有效控制风险，与产业资本共成长，分享中国经济与资本市场的高速成长，谋求实现基金资产的长期稳定增长。
投资策略	自下而上精选个股，适度主动配置资产，系统有效管理风险。
业绩比较基准	75%×富时中国 A600 指数 + 20%×富时中国国债指数 + 5%×现金收益率。
风险收益特征	本基金是一只主动型的股票基金，本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长期稳定增长。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1. 本期已实现收益	-516,122,364.18
2. 本期利润	73,815,830.33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0115
4. 期末基金资产净值	6,971,716,531.97
5. 期末基金份额净值	1.1174

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。

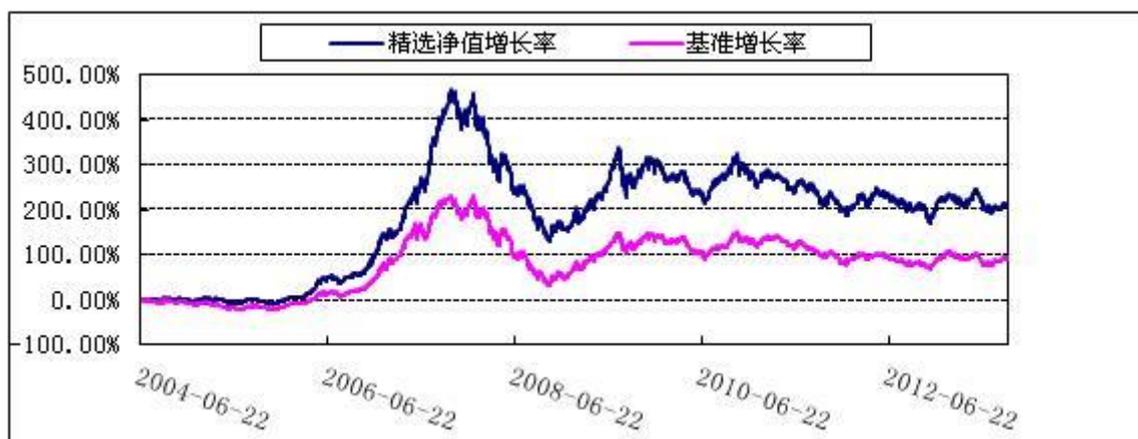
所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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
过去三个月	1.03%	0.99%	8.47%	1.02%	-7.44%	-0.03%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 2004 年 6 月 22 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（二）投资范围、（九）禁止行为的有关约定。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 基金经理（或基金经理小组）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		
孙占军	基金经理/ 成长组投资 副总监	2013-6-21	-	12	1998 年起先后在宝山钢铁股份公司、申银万国证券研究所、香港中信证券研究有限公司工作。2005 年 12 月加入博时基金管理有限公司，历任研究部研究员、研究员兼任博时裕隆封闭基金经理助理。2008 年 2 月至 2010 年 10 月任博时裕隆封闭基金经理。2010 年 6 月至 2013 年 8 月任博时创业成长股票基金基金经理。现任股票投资部成长组投资副总监，兼任博时精选股票基金经理。

### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《博时精选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 公平交易专项说明

#### 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 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

三季度国内经济仍然呈现弱复苏的状态，政府政策在强调经济转型的同时，也同时提出关注经济增长下限。从实际数据看，三季度的增长略超年中预期，在经济改革和转型的预期下，三季度市场震荡上行：报告期内上证指数涨 9.88%，深成指上涨 11.66%；

中小板涨 17.46%，而创业板更是大涨 35.2%，结构化牛市进一步深化。在震荡市中，TMT、商业贸易、旅游等表现靠前；而食品饮料、建筑建材和电力等表现落后。

基于对三季度市场缺乏系统性机会的判断，博时精选基金平均仓位维持在 70% 左右，配置方面以均衡配置为主，适当降低了食品饮料、地产、能源的配置比例。从实际操作上看，精选三季度主要增加了资本品、医药和消费品的配置比例，而金属和公用事业等行业低配。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.1174 元，累计份额净值为 2.6734 元，报告期内净值增长率为 1.03%，同期业绩基准涨幅为 8.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，在保证经济增长符合下限的同时，政府会加大改革的推进力度，尤其是即将召开的“三中全会”，将为未来几年经济发展奠定政策基础。因此，可以预见四季度“改革”将是影响股市最重要的词汇，第三季度的“自贸区”行情只是改革大背景下的预演，未来随着改革政策的进一步落实，行情有望进一步深化。但是考虑到当前经济结构的大背景，改革的阵痛难免，因此市场也难有系统性机会，更多以结构性行情为主。基于这种判断，精选配置策略仍以成长和消费为主，未来重点关注三大类机会：一是长期受益于经济结构调整，有较大的发展空间成长性行业如军工、节能环保、文化传媒等。二是看好消费升级相关行业，如医药、品牌消费、旅游等。三是在转型背景下制造业升级相关行业：如人工替代、新材料、工业服务等。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,566,492,628.12	79.55
	其中：股票	5,566,492,628.12	79.55
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	1,425,624,483.62	20.37
6	其他各项资产	5,005,087.03	0.07
7	合计	6,997,122,198.77	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	89,699,150.84	1.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,728,312,644.44	39.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	486,764,543.13	6.98
F	批发和零售业	309,756,733.44	4.44
G	交通运输、仓储和邮政业	181,554,311.12	2.60
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	699,448,108.59	10.03
K	房地产业	355,177,905.04	5.09
L	租赁和商务服务业	422,674,822.08	6.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	293,104,409.44	4.20
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	5,566,492,628.12	79.84

### 5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601888	中国国旅	10,199,682	422,674,822.08	6.06
2	600837	海通证券	33,499,609	419,080,108.59	6.01
3	000513	丽珠集团	8,748,287	377,313,618.31	5.41
4	600372	中航电子	21,526,792	374,996,716.64	5.38
5	000858	五粮液	19,880,002	357,840,036.00	5.13
6	600383	金地集团	58,999,652	355,177,905.04	5.09
7	600261	阳光照明	29,167,123	344,463,722.63	4.94
8	002140	东华科技	15,799,523	311,408,598.33	4.47
9	601933	永辉超市	21,999,768	309,756,733.44	4.44
10	002672	东江环保	7,913,186	293,104,409.44	4.20

### 5.4 报告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。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.8 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。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

#### 5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,541,628.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	285,688.85
5	应收申购款	1,177,770.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,005,087.03

#### 5.10.4 报告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可转换债券。

#### 5.10.5 报告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。

#### 5.10.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	6,499,092,002.50
本报告期基金总申购份额	36,903,848.94
减：本报告期基金总赎回份额	296,592,810.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,239,403,040.48

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

2013 年 9 月 3 日，我司收到中国证监会下发的《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》，责令我司进行为期 6 个月的整改。我司高度重视，通过对公司内部控制和风险管理工作进行全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升公司内部控制和风险管理的能力，并将及时向中国证监会及深圳证监局提交整改报告。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准博时精选股票证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时精选股票证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时精选股票证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 博时精选股票证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时精选股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 9.2 存放地点：

基金管理人、基金托管人处

### 9.3 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 10 月 23 日