

博时主题行业股票证券投资基金 2006年第四季度报告

2006年第4号

一、重要提示
 本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。
 本基金的投资人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年1月18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。
 本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预示其未来表现。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。
 本报告财务数据未经审计师审计。

二、基金产品概况
 基金简称：博时主题
 基金代码：160605
 基金运作方式：契约型上市开放式
 基金合同生效日：2006年1月6日
 报告期末基金份额总额：383,400,284.84份
 投资于本基金中的高风险资产、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%×新华富时中国A600指数+20%×新华富时中国国债指数
 风险收益特征：本基金是一只主动型的股票型基金，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。

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
 上市时间：2006年2月22日
 三、主要财务指标和基金净值表现
 (一)主要财务指标
 2006年4季度主要财务指标

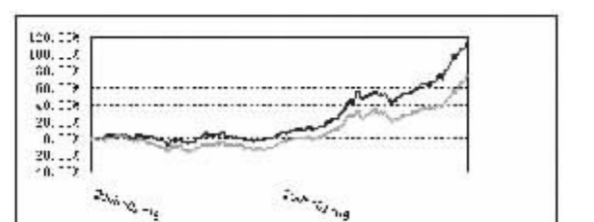
序号	项目	金额
1	基金本期净收益	269,744,289.40
2	加权平均基金份额本期净收益	0.2442
3	期末基金资产净值	5,801,267,407.93
4	期末基金份额净值	1.0776

上述基金净值指标不包括持有人交易基金的各项费用(例如开放式基金的申购赎回费等)，计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数字。

(二)基金净值表现
 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

①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
30.25%	1.03%	30.19%	1.11%	0.06%	-0.08%

2. 所示自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较



3. 本基金业绩比较基准的构建以及再平衡过程
 本基金业绩比较基准为：80%×新华富时中国A600指数+20%×新华富时中国国债指数
 新华富时中国A600指数是新华富时公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流通市值最大的600只股票并以流通股本加权的股票指数，新华富时中国国债指数涵盖了在上海及深圳交易所交易的到期日至少在一年以上且纯息票债券，是目前中国债券市场中与本基金投资范围比较匹配同时公信力较强的宽基指数和债券指数。

四、管理人报告
 (一)基金经理介绍
 杨俊先生，硕士，1999年9月至1999年11月在科信国际证券营业部任投资咨询人员；1999年8月至2001年2月，在上海中野投资管理咨询有限公司工作；2001年2月至2004年5月在融通基金管理有限公司，曾任研究员、部门副经理、基金管理部基金助理助理、新蓝筹基金经理、融通基金管理有限公司总经理助理，2004年6月21日入职博时基金管理有限公司基金管理部，2005年1月起担任博时主题行业股票证券投资基金基金经理。

(二)报告期内基金运作情况说明
 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》、《博时主题行业股票证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定，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，为基金份额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律法规和基金合同的约定，没有损害基金份额持有人的利益的行为。

(三)本报告期内的基金投资策略和业绩表现
 截止2006年12月31日，本基金份额累计净值为1.5986元。报告期内，本基金份额净值增长率为30.25%，同期业绩比较基准收益率为32.67%。

五、投资组合报告
 (一)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	股票市值(元)	占基金总资产比例
A	农林、牧、渔业	18,810,179.41	0.32%
B	采掘业	164,466,096.63	2.84%
C	制造业	1,386,519,996.56	23.90%
C0	其中：食品、饮料	129,731,009.82	2.24%
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	64,469,338.74	1.11%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	139,676,334.73	2.41%
C5	电子	94,303,998.17	1.63%
C6	金属、非金属	522,216,448.10	9.00%
C7	机械、设备、仪表	310,369,992.68	5.35%
C8	医药、生物制品	124,725,762.07	2.15%
C9	其他制造业	1,029,092.25	0.02%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	634,261,968.25	10.93%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	564,712,889.74	9.63%
G	信息技术业	165,784,561.68	2.86%
H	批发和零售贸易	81,627,736.06	1.41%
I	金融、保险业	396,627,176.85	6.82%
J	房地产业	269,352,442.29	4.67%
K	社会服务业	47,681,617.54	0.82%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	82,989,469.82	1.43%
	合计	3,791,733,094.03	65.36%

(二)报告期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票名称	股票市值(元)	占基金总资产比例
A	农林、牧、渔业	20,764,270.61	1.03%
B	采掘业	11,339,331.60	0.55%
C	制造业	626,881,626.26	26.07%
C0	其中：食品、饮料	90,889,000.00	4.50%
C1	纺织、服装、皮毛	735,326.40	0.04%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	13,629,391.38	0.67%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	168,417,416.80	7.92%
C5	电子	20,447,710.48	1.01%
C6	金属、非金属	97,303,860.13	4.61%
C7	机械、设备、仪表	205,521,918.52	10.17%
C8	医药、生物制品	39,929,738.96	1.98%
C9	其他制造业	0.00	0.00%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	38,145,372.14	1.89%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	43,086,216.52	2.13%
G	信息技术业	7,547,736.64	0.37%
H	批发和零售贸易	16,152,343.35	0.80%
I	金融、保险业	310,434,043.28	15.36%
J	房地产业	200,278,786.04	9.91%
K	社会服务业	25,982,093.87	1.29%
L	传播与文化产业	1,531,716.58	0.08%
M	综合类	1,502,446.70	0.07%
	合计	1,203,436,563.18	59.54%

(三)报告期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名债券明细

序号	债券名称	股票市值(元)	占基金总资产比例	
1	600000 浦发转债	6,200,010	122,122,213.10	6.54%
2	600030 中信转债	4,400,000	120,472,000.00	5.96%
3	000002 万科A	6,800,000	104,362,000.00	5.19%
4	600048 保利地产	1,500,000	64,680,000.00	3.22%
5	000058 五粮液	1,800,000	41,130,000.00	2.04%
6	600036 招商银行	2,500,000	40,900,000.00	2.02%
7	600206 兰石股份	2,999,970	38,729,612.70	1.92%
8	600309 烟台万润	1,200,685	29,062,597.55	1.44%
9	000058 神州客运	1,100,000	27,874,000.00	1.38%
10	000051 中国国贸	1,088,157	27,203,925.00	1.35%

(四)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	股票市值(元)	占基金总资产比例
A	农林、牧、渔业	36,968,882.22	1.68%
B	采掘业	21,617,019.10	0.98%
C	制造业	678,750,556.88	30.76%
C0	其中：食品、饮料	92,066,684.82	4.17%
C1	纺织、服装、皮毛	16,265,332.26	0.74%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	0.00	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	30,612,262.76	1.39%
C5	电子	560,596.80	0.02%
C6	金属、非金属	155,099,681.68	7.03%
C7	机械、设备、仪表	341,336,080.03	15.47%
C8	医药、生物制品	42,498,966.22	1.93%
C9	其他制造业	290,973.21	0.01%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	158,362,308.89	7.18%
E	建筑业	884,304.00	0.04%
F	交通运输、仓储业	352,721,790.26	15.99%
G	信息技术业	95,489,226.64	4.33%
H	批发和零售贸易	82,604,226.45	3.80%
I	金融、保险业	164,113,012.42	7.44%
J	房地产业	135,670,610.02	6.15%
K	社会服务业	0.00	0.00%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	28,812,196.60	1.31%
	合计	1,673,379,908.13	75.84%

(五)报告期末按市值占基金总资产比例大小排序的前十名债券明细

序号	债券名称	股票市值(元)	占基金总资产比例	
1	600104 上海汽车	16,452,667	134,418,289.39	6.09%
2	000025 长安汽车	13,656,108	121,812,483.36	5.52%
3	600050 中国联通	20,000,000	93,400,000.00	4.23%
4	000001 深发展A	6,068,886	87,816,780.42	3.98%
5	600887 伊利股份	3,300,000	87,450,000.00	3.96%
6	600900 长江电力	8,454,885	82,604,226.45	3.74%
7	601006 大秦铁路	9,000,000	72,900,000.00	3.30%
8	600029 中航机场	16,862,323	68,966,901.07	3.13%
9	600019 宝钢股份	7,752,789	67,139,152.74	3.04%
10	600951 上海机场	15,094,660	53,736,989.60	2.44%

(六)报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	名称	期末市值(元)	市值占基金总资产比例
1	国家债券	35,769,600.00	1.62%
2	金融债券	419,383,081.77	19.01%

(七)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	期末市值(元)	市值占基金总资产比例
1	600104	上海汽车	16,452,667	134,418,289.39	6.09%
2	000025	长安汽车	13,656,108	121,812,483.36	5.52%
3	600050	中国联通	20,000,000	93,400,000.00	4.23%
4	000001	深发展A	6,068,886	87,816,780.42	3.98%
5	600887	伊利股份	3,300,000	87,450,000.00	3.96%
6	600900	长江电力	8,454,885	82,604,226.45	3.74%
7	601006	大秦铁路	9,000,000	72,900,000.00	3.30%
8	600029	中航机场	16,862,323	68,966,901.07	3.13%
9	600019	宝钢股份	7,752,789	67,139,152.74	3.04%
10	600951	上海机场	15,094,660	53,736,989.60	2.44%

(八)报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	名称	期末市值(元)	市值占基金总资产比例
1	国家债券	35,769,600.00	1.62%
2	金融债券	419,383,081.77	19.01%

(九)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	股票市值(元)	占基金总资产比例
A	农林、牧、渔业	36,968,882.22	1.68%
B	采掘业	21,617,019.10	0.98%
C	制造业	678,750,556.88	30.76%
C0	其中：食品、饮料	92,066,684.82	4.17%
C1	纺织、服装、皮毛	16,265,332.26	0.74%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	0.00	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	30,612,262.76	1.39%
C5	电子	560,596.80	0.02%
C6	金属、非金属	155,099,681.68	7.03%
C7	机械、设备、仪表	341,336,080.03	15.47%
C8	医药、生物制品	42,498,966.22	1.93%
C9	其他制造业	290,973.21	0.01%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	158,362,308.89	7.18%
E	建筑业	884,304.00	0.04%
F	交通运输、仓储业	352,721,790.26	15.99%
G	信息技术业	95,489,226.64	4.33%
H	批发和零售贸易	82,604,226.45	3.80%
I	金融、保险业	164,113,012.42	7.44%
J	房地产业	135,670,610.02	6.15%
K	社会服务业	0.00	0.00%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	28,812,196.60	1.31%
	合计	1,673,379,908.13	75.84%

(十)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	股票市值(元)	占基金总资产比例
A	农林、牧、渔业	36,968,882.22	1.68%
B	采掘业	21,617,019.10	0.98%
C	制造业	678,750,556.88	30.76%
C0	其中：食品、饮料	92,066,684.82	4.17%
C1	纺织、服装、皮毛	16,265,332.26	0.74%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	0.00	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	30,612,262.76	1.39%
C5	电子	560,596.80	0.02%
C6	金属、非金属	155,099,681.68	7.03%
C7	机械、设备、仪表	341,336,080.03	15.47%
C8	医药、生物制品	42,498,966.22	1.93%
C9	其他制造业	290,973.21	0.01%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	158,362,308.89	7.18%
E	建筑业	884,304.00	0.04%
F	交通运输、仓储业	352,721,790.26	15.99%
G	信息技术业	95,489,226.64	4.33%
H	批发和零售贸易	82,604,226.45	3.80%
I	金融、保险业	164,113,012.42	7.44%
J	房地产业	135,670,610.02	6.15%
K	社会服务业	0.00	0.00%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	28,812,196.60	1.31%
	合计	1,673,379,908.13	75.84%

(十一)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业	股票市值(元)	占基金总资产比例
A	农林、牧、渔业	36,968,882.22	1.68%
B	采掘业	21,617,019.10	0.98%
C	制造业	678,750,556.88	30.76%
C0	其中：食品、饮料	92,066,684.82	4.17%
C1	纺织、服装、皮毛	16,265,332.26	0.74%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	0.00	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	30,612,262.76	1.39%
C5	电子	560,596.80	0.02%
C6	金属、非金属	155,099,681.68	7.03%
C7	机械、设备、仪表	341,336,080.03	15.47%
C8	医药、生物制品	42,498,966.22	1.93%
C9	其他制造业	290,973.21	0.01%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	158,362,308.89	7.18%
E	建筑业	884,304.00	0.04%
F	交通运输、仓储业	352,721,790.26	15.99%
G	信息技术业	95,489,226.64	4.33%
H	批发和零售贸易	82,604,226.45	3.80%
I	金融、保险业	164,113,012.42	7.44%
J	房地产业	135,670,610.02	6.15%
K	社会服务业	0.00	0.00%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	28,812,196.60	1.31%
	合计	1,673,379,908.13	75.84%