

## 博时精选股票证券投资基金 2005 年半年度报告摘要

### 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。

本基金的托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于2005年8月22日复核了本报告中的财务指标、财务会计报告、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。

本报告财务资料未经审计师审计。  
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。

### 一、基金简介

#### (一) 基金基本资料

基金名称: 博时精选股票证券投资基金

基金简称: 博时精选

基金交易代码: 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: 5,200,314,446.37份

投资目标: 本基金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:  $75\% \times \text{新华富时中国A600指数} + 20\% \times \text{新华富时中国国债指数} + 5\% \times \text{现金收益率}$ 。

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。

(二) 基金管理人名称: 博时基金管理有限公司

信息披露负责人：李全

联系电话：0755-83169999

传 真：0755-83195140

电子邮箱：webmaster@boshi.com.cn

(三) 基金托管人名称：中国工商银行

信息披露负责人：庄为

联系电话：010-66107333

传 真：010-66106904

电子邮箱：custody@icbc.com.cn

(四) 登载年度报告正文的管理人互联网网址：

[http:// www.boshi.com.cn](http://www.boshi.com.cn)

基金年度报告置备地点：基金管理人、基金托管人处

## 二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2005年6月30日
1	基金本期净收益	62,736,188.63
2	基金份额本期净收益	0.0113
3	期末可供分配基金份额收益	-0.0517
4	期末基金资产净值	4,931,687,439.19
5	期末基金份额净值	0.9483
6	本期基金份额净值增长率	-5.40%

上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则第1号《主要财务指标的计算及披露》。

上述基金业绩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，计入费用后持有人的实际收益水平要低于所列数字。

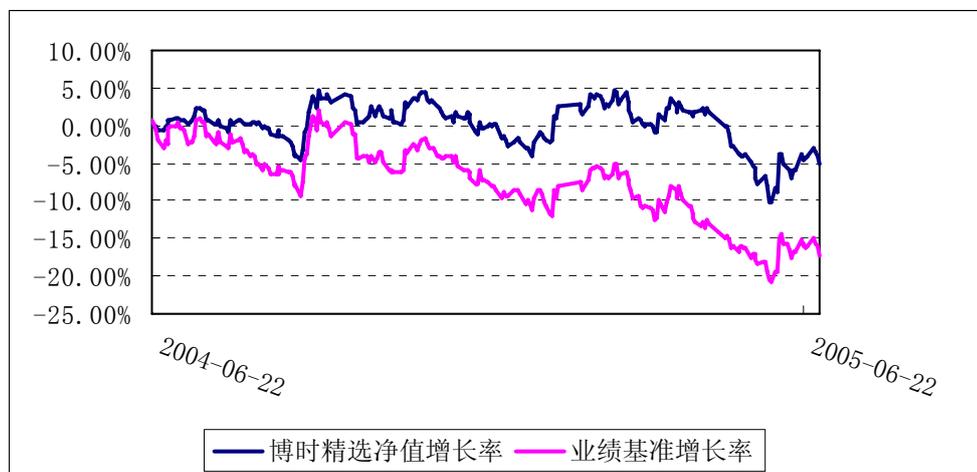
### (二) 基金净值表现

#### 1、过往一定阶段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

期间	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
过去一个月	1.67%	1.61%	0.88%	1.77%	0.79%	-0.16%
过去三个月	-4.43%	1.19%	-6.41%	1.35%	1.98%	-0.16%
过去六个月	-5.40%	1.05%	-10.19%	1.21%	4.79%	-0.16%
过去一年	-5.13%	0.92%	-15.44%	1.11%	10.31%	-0.19%

自基金合同生效起至今	-5.17%	0.91%	-17.36%	1.11%	12.19%	-0.20%
------------	--------	-------	---------	-------	--------	--------

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况及其与同期业绩比较基准的变动情况的比较图



3、本基金业绩比较基准的构建以及再平衡过程

本基金的业绩比较基准： $75\% \times \text{新华富时中国 A600 指数} + 20\% \times \text{新华富时中国国债指数} + 5\% \times \text{现金收益率}$ 。

### 三、基金管理人报告

#### (一) 基金管理人和基金经理简介

博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为金信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和广厦建设集团有限责任公司，注册资本为1亿元人民币。

陈丰，1973年出生，硕士学历。1996年至1998年就读于上海财经大学证券期货学院，获经济学硕士学位。1998年至2000年在申银万国证券公司研究所工作。2000年加入博时基金管理有限公司，任研究员。2002年1月起任基金裕元基金经理助理，2003年7月起任基金裕泽基金经理。2004年6月起任博时精选股票证券投资基金基金经理。

#### (二) 本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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》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，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，在严格控制风险的基础上，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，没有发生损害基金持有人利益的行为。

#### (三) 本报告期内基金的投资策略和业绩表现

业绩回顾：

2005年上半年，在股权分置问题不确定性和宏观经济增速可能减缓的预期影响下，

中国股市振荡下跌。2005年6月30日，博时精选基金单位净值0.9483元，报告期内净值增长率为-5.40%，本基金的投资基准增长率为-10.19%。

我们认为，虽然上半年中国股市以振荡下跌为主，但是随着股权分置的逐步推进，其中的不确定性逐渐减少，如关于大致的对价比例，大市值国企股是否会做股权分置，股权分置和再融资的关系等等问题，投资者都已有了自己的答案。因此从5月以来的市场情况看，投资者的心态正在趋向稳定，指数也在低位逐渐走稳。结合目前出现的一个新情况：越来越多的上市公司分红回报率逐步提高，有些已经超过同期银行利率，而且股权分置后分红回报率还将进一步提高，我们认为，目前股市已经进入一个重要的筑底阶段。虽然由于宏观经济的原因，不少行业的盈利增速将会放缓甚至下滑，可能会限制上涨的幅度，也会延长调整的时间，但我们认为在经过足够的调整后，随着宏观经济在未来一段时间逐渐调整到位，以及新老划断问题的逐步明朗，未来市场有望走出逐步攀升的走势。

在行业配置方面，博时精选基金做了一定的调整，减少了煤炭、石化等具有上游周期性特征的个股配置比例，增加了商业零售、金融、食品饮料等消费性行业的配置比例。我们认为，不少上游周期性行业的个股市净率接近甚至低于一倍，即使考虑到未来盈利的下滑，目前估值仍然具有吸引力，但是这一类公司都面临同一问题，即在未来的一两年内盈利能力可能或多或少地有所下降，未来的股价回升可能是恢复性的而不是进攻性的，因此从整体配置结构考虑，我们减少了这一类公司的配置比例，而适当增加了消费性公司的比例。但从事后看，这一调整受到种种因素的制约，调整力度仍略显不足，也在一定程度上影响了博时精选在上半年的净值表现。

展望下半年，我们认为大市还将反复，但总体将呈现温和上升的格局，随着股权分置的进行，一些个股将出现较好的投资机会，我们将抓住时机适当提高股票投资的比例。在行业和公司选择方面，我们将继续看好具有核心竞争力的公司。在兼顾均衡行业配置的基础上，我们认为随着WTO后中国经济不断融入世界经济，在整体经济中那些市场化程度不高的行业将持续改革，一些商品的定价将逐步走向市场化，其中会带来一些投资机会。同时，经过股权分置后，将有更多的上市公司估值下降，也给我们带来了更多的选择机会。这些都是我们的研究重点所在。

#### 四、基金托管人报告

2005年上半年度，本托管人在对博时精选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》及其他有关法律法规、基金合同，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应尽的义务。

2005年上半年度博时精选股票证券投资基金管理人——博时基金管理有限公司在投资运作、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。

本托管人依法对博时精选股票证券投资基金管理人——博时基金管理有限公司在2005年上半年度所编制和披露的博时精选股票证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容具有真实、准确和完整性。

## 五、财务会计报告

### (一) 基金半年度会计报表 (未经审计)

#### 1、博时精选股票证券投资基金资产负债表

单位：人民币元

资产	2005年6月30日	2004年12月31日
银行存款	327,184,388.28	473,040,748.24
清算备付金	700,431.29	
交易保证金	1,000,000.00	1,000,000.00
应收证券清算款	3,451,346.09	9,512,350.44
应收股利	3,400,232.36	
应收利息	25,403,504.43	9,747,808.18
应收申购款	525,427.03	2,098,966.47
其他应收款	2,541.42	6,346.52
股票投资市值	3,174,533,112.90	4,275,564,291.75
其中：股票投资成本	3,497,436,721.18	4,249,183,837.72
债券投资市值	1,407,032,708.47	1,367,617,700.20
其中：债券投资成本	1,391,130,195.12	1,363,672,783.19
待摊费用	151,232.48	
资产总计	4,943,384,924.75	6,138,588,211.80
负债与持有人权益		
负债		
应付证券清算款	-	1,865,675.64
应付赎回款	2,984,465.30	2,049,867.18
应付赎回费	10,933.66	7,725.55
应付管理人报酬	6,070,144.96	7,876,558.48
应付托管费	1,011,690.81	1,312,759.73
应付佣金	657,867.46	547,473.52
其他应付款	772,876.00	750,000.00
预提费用	189,507.37	130,000.00
负债合计	11,697,485.56	14,540,060.10
持有人权益		
实收基金	5,200,314,446.37	6,109,633,402.54
未实现利得	-331,019,857.98	15,163,648.98
未分配基金净收益	62,392,850.80	-748,899.82
持有人权益合计	4,931,687,439.19	6,124,048,151.70
负债及持有人权益总计	4,943,384,924.75	6,138,588,211.80

#### 2、博时精选股票证券投资基金经营业绩表

2005年1月1日至2005年6月30日止期间

单位：人民币元

项目	本期数
----	-----

<b>一、收入</b>	111,470,672.39
1、股票差价收入	8,382,458.01
2、债券差价收入	2,684,409.35
3、债券利息收入	21,645,417.55
4、存款利息收入	2,964,309.81
5、股利收入	74,037,223.20
7、其他收入	1,756,854.47
<b>二、费用</b>	48,734,483.76
1、基金管理人报酬	41,198,893.80
2、基金托管费	6,866,482.27
3、卖出回购证券支出	448,330.14
5、其他费用	220,777.55
其中：其他费用	12,502.66
信息披露费用	148,767.52
审计费用	59,507.37
<b>三、基金净收益</b>	62,736,188.63
加：未实现估值增值/（减值）变动数	-337,326,465.97
<b>四、基金经营业绩</b>	-274,590,277.34

## 3、博时精选股票证券投资基金收益分配表

2005年1月1日至2005年6月30日止期间

单位：人民币元

项目	本期数
基金净收益	62,736,188.63
加：年/（期）初基金净收益	-748,899.82
加：本期申购基金份额的损益平准金	370,748.50
本期赎回基金份额的损益平准金	34,813.49
可供分配基金净收益	62,392,850.80
减：本年/（期）已分配基金净收益	
未分配基金净收益	62,392,850.80

## 4、博时精选股票证券投资基金净值变动表

2005年1月1日至2005年6月30日止期间

单位：人民币元

项目	本期数
年/（期）初基金净值	6,124,048,151.70
本年/（期）经营活动	
基金净收益	62,736,188.63
未实现估值增值/（减值）变动数	-337,326,465.97
经营活动产生的基金净值变动数	-274,590,277.34
本年/（期）基金份额交易	
基金申购款	476,491,798.77
其中：分红再投资	
基金赎回款	-1,394,262,233.94
基金份额交易产生的基金净值变动数	-917,770,435.17

本年/(期)向基金份额持有人分配收益	
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	
年/(期)末基金净值	4,931,687,439.19

## (二) 会计报表附注

### 1、本半年度会计事项说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

### 2、重大关联方关系及关联交易

#### (a) 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	基金发起人、基金管理人、 基金注册登记人、基金销售机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
金信信托投资股份有限公司	基金管理人的股东
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
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### (b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2005 年 1 月 1 日							
	至 2005 年 6 月 30 日止期间							
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		回购成交量		交易佣金	
成交量	占本期成交	成交量	占本期成交	成交量	占本期成交	佣金	占本期佣金	
人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	总量的比例	
招商证券	67,354,462.36	3.52%	-	-	250,000,000.00	100.00%	52,729.73	3.43%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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。

#### (c) 基金管理人报酬

支付基金管理人博时基金管理有限公司的基金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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 41,198,893.80 元。

#### (d) 基金托管费

支付基金托管人中国工商银行的基金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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

本基金在本会计期间需支付基金托管费 6,866,482.27 元。

#### (e) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2005 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 327,184,388.28 元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 2,862,418.28 元。

### 16 流通受限制不能自由转让的基金资产

#### (1) 流通受限制不能自由转让的股票

根据中国证监会的政策规定，2000 年 5 月 18 日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外，根据中国证监会证监发行字[2002]54 号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》及其配套规定，自 2002 年 5 月 20 日起，恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股票市值参与配售，但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

本基金截至 2005 年 6 月 30 日止流通受限制的股票情况如下：

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数	成本	估值
宝钢股份	2005.4.26	2005.5.9	2005.7.11	5.12	4.98	3,803,000.00	19,471,360.00	18,938,940.00
中材国际	2005.3.25	2005.4.12	2005.7.12	7.53	16.12	65,618.00	494,103.54	1,057,762.16
成霖股份	2005.5.12	2005.5.31	2005.8.31	8.60	9.09	104,300.00	896,980.00	948,087.00
广州国光	2005.4.27	2005.5.23	2005.8.23	10.80	11.45	63,467.00	685,443.60	726,697.15
登海种业	2005.4.1	2005.4.18	2005.7.20	16.70	21.53	29,165.00	487,055.50	627,922.45
兔宝宝	2005.4.15	2005.5.10	2005.8.10	4.98	6.80	60,775.00	302,659.50	413,270.00
轴研科技	2005.4.30	2005.5.26	2005.8.26	6.39	11.80	31,879.00	203,706.81	376,172.20

#### (2) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

代码	名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
125488	晨鸣转债	69,235,287.96	1.40%
110036	招行转债	58,888,843.20	1.19%
126002	万科转 2	9,773,658.51	0.20%
125822	海化转债	8,262,973.60	0.17%

## 六、投资组合报告

### (一) 本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	股票投资	3,174,533,112.90	64.22%
2	债券投资	1,407,032,708.47	28.46%
3	银行存款和清算备付金合计	327,884,819.57	6.63%
4	其它资产	33,934,283.81	0.69%
5	合计	4,943,384,924.75	100.00%

### (二) 本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)	占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	627,922.45	0.01%
B	采掘业	278,591,706.86	5.65%
C	制造业	1,266,312,621.36	25.68%
C0	其中: 食品、饮料	92,720,670.73	1.88%
C1	纺织、服装、皮毛	49,400,186.54	1.00%
C2	木材、家具	413,270.00	0.01%
C3	造纸、印刷	54,193,058.16	1.10%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	255,025,626.97	5.17%
C5	电子	11,858,445.83	0.24%
C6	金属、非金属	508,970,792.03	10.32%
C7	机械、设备、仪表	234,754,973.48	4.76%
C8	医药、生物制品	58,975,597.62	1.20%
C99	其他制造业		
D	电力、煤气及水的生产和供应业	249,363,172.63	5.06%
E	建筑业	1,057,762.16	0.02%
F	交通运输、仓储业	811,386,102.88	16.45%
G	信息技术业	205,986,020.74	4.18%
H	批发和零售贸易	66,020,829.05	1.34%
I	金融、保险业	44,220,000.00	0.90%
J	房地产业	179,729,789.89	3.64%
K	社会服务业		
L	传播与文化产业		
M	综合类	71,237,184.88	1.44%
	合计	3,174,533,112.90	64.37%

### (三) 基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600019	宝钢股份	53,002,940.00	263,954,641.20	5.35%

2	000900	现代投资	16,335,172.00	177,890,023.08	3.61%
3	600033	福建高速	18,100,649.00	151,321,425.64	3.07%
4	600050	中国联通	50,042,383.00	131,111,043.46	2.66%
5	600900	长江电力	14,029,384.00	114,620,067.28	2.32%
6	600269	赣粤高速	10,767,454.00	104,121,280.18	2.11%
7	000002	万科A	32,951,925.00	103,469,044.50	2.10%
8	000898	鞍钢新轧	26,993,443.00	99,875,739.10	2.03%
9	000866	扬子石化	9,856,685.00	93,441,373.80	1.89%
10	600028	中国石化	23,799,726.00	84,013,032.78	1.70%

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。

#### (四) 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1、报告期内累计买入价值超出期末基金资产净值2%或前二十名的股票明细

单位：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的比例
1	600019	宝钢股份	145,423,206.40	2.37%
2	000002	万科A	100,738,484.80	1.64%
3	600123	兰花科创	43,273,485.51	0.71%
4	600028	中国石化	33,895,978.80	0.55%
5	600628	新世界	31,087,020.86	0.51%
6	000895	双汇发展	29,814,259.71	0.49%
7	600000	浦发银行	27,445,935.24	0.45%
8	600415	小商品城	24,136,193.61	0.39%
9	600027	华电国际	22,628,088.00	0.37%
10	000089	深圳机场	18,996,308.56	0.31%
11	600600	青岛啤酒	18,116,544.91	0.30%
12	600887	伊利股份	17,683,635.83	0.29%
13	000039	中集集团	16,378,093.62	0.27%
14	600276	恒瑞医药	15,393,702.06	0.25%
15	600036	招商银行	15,045,799.72	0.25%
16	000629	新钢钒	13,278,486.42	0.22%
17	000759	武汉中百	11,785,302.19	0.19%
18	600361	华联综超	10,502,276.33	0.17%
19	600002	齐鲁石化	10,442,116.39	0.17%
20	600087	南京水运	9,395,131.74	0.15%

##### 2、报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值2%或前二十名的股票明细

单位：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的比例
1	000039	中集集团	138,735,580.52	2.27%

2	600005	武钢股份	101,774,509.03	1.66%
3	600900	长江电力	94,355,822.20	1.54%
4	000983	西山煤电	76,904,594.91	1.26%
5	000069	华侨城 A	69,390,383.93	1.13%
6	600135	乐凯胶片	66,622,395.83	1.09%
7	000778	新兴铸管	62,958,006.63	1.03%
8	600012	皖通高速	60,307,547.12	0.98%
9	600002	齐鲁石化	58,754,239.68	0.96%
10	600660	福耀玻璃	49,863,250.85	0.81%
11	600348	国阳新能	43,538,024.34	0.71%
12	600019	宝钢股份	38,764,009.22	0.63%
13	600362	江西铜业	26,672,696.97	0.44%
14	000866	扬子石化	25,439,402.43	0.42%
15	600027	华电国际	25,076,475.97	0.41%
16	600740	山西焦化	23,537,920.86	0.38%
17	000581	威孚高科	22,231,006.28	0.36%
18	600018	上港集箱	20,363,484.09	0.33%
19	000731	四川美丰	19,135,167.96	0.31%
20	600036	招商银行	18,308,075.43	0.30%

## 3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票的成本总额	663,564,962.56
卖出股票的收入总额	1,424,887,296.90

## (五) 报告期末的债券投资组合

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国家债券	438,691,945.20	8.90%
2	央行票据	822,180,000.00	16.67%
3	可转换债券	146,160,763.27	2.96%
4	债券投资合计	1,407,032,708.47	28.53%

## (六) 报告期末的基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	04 央行票据 79	483,600,000.00	9.81%
2	04 央行票据 77	290,220,000.00	5.88%
3	20 国债(4)	237,705,360.00	4.82%
4	20 国债(10)	170,881,585.20	3.46%
5	晨鸣转债	69,235,287.96	1.40%

## （七）投资组合报告附注

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、处罚的。
2. 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3. 基金的其他资产包括：交易保证金 1,000,000.00 元，应收证券清算款 3,451,346.09 元，应收申购款 525,427.03 元，应收利息 25,403,504.43 元，应收股利 3,400,232.36 元，待摊费用 151,232.48 元，其他应收款 2,541.42 元。
4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

代码	名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
110036	招行转债	58,888,843.20	1.19%
125488	晨鸣转债	69,235,287.96	1.40%
125822	海化转债	8,262,973.60	0.17%
126002	万科转 2	9,773,658.51	0.20%

## 七、基金份额持有人户数、持有人结构（截止2005年6月30日）

### （一）基金份额持有人户数

基金份额持有人户数	110,135
平均每户持有基金份额	47,217.64

### （二）基金持有人结构

	持有份额（份）	占总份额的比例
机构投资者	1,152,855,737.07	22.17%
个人投资者	4,047,458,709.30	77.83%
合计	5,200,314,446.37	100.00%

## 八、开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	报告期末基金份额总额:	5,200,314,446.37
2	报告期初的基金份额总额:	5,345,969,341.27
3	报告期间基金总申购份额:	209,990,023.11
4	报告期间基金总赎回份额:	355,644,918.01

## 九、重大事件揭示

- （一）基金管理人、托管人本会计期间内无重大诉讼事项；

(二) 2005 年 1 月 22 日, 我公司在三大证券报上公告了《博时精选股票证券投资基金季度报告 2004 年第 2 号》;

(三) 2005 年 2 月 4 日, 我公司在三大证券报上公告了《博时精选股票证券投资基金更新招募说明书摘要》;

(四) 2005 年 3 月 29 日, 我公司在三大证券报上公告了《博时精选股票证券投资基金 2004 年年度报告摘要》;

(五) 2005 年 4 月 20 日, 我公司在三大证券报上公告了《博时精选股票证券投资基金季度报告 2005 年第 1 号》;

(六) 中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字[1998]29 号)中关于“每只基金通过一个证券经营机构买卖证券的年成交量, 不得超过该基金买卖证券年成交量的 30%”的要求, 我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, 博时精选基金向多家券商租用了基金专用交易席位, 博时精选基金本报告期通过各证券经营机构的席位买卖证券的交易量及支付的佣金如下:

### 1、 股票及债券交易量 (2005年1月1日至2005年6月30日)

券商名称	席位 数量	券商交易量 (元)			券商交易量比例		
		股票	债券	回购	股票	债券	回购
联合证券	1	210,372,121.17	15,780,855.80	-	10.98%	3.44%	
国元证券	1	95,944,649.06	-	-	5.01%		
华夏证券	1	218,732,482.58	207,482,460.80	-	11.42%	45.27%	
东吴证券	1	107,728,731.33	-	-	5.62%		
国泰君安	1	331,525,612.66	-	-	17.31%		
兴业证券	1	310,538,265.35	8,934,280.80	-	16.21%	1.95%	
中信证券	1	218,343,493.39	-	-	11.40%		
长江证券	1	34,651,121.52	67,032,492.50	-	1.81%	14.63%	
光大证券	1	116,540,504.57	-	-	6.08%		
申银万国证券	1	52,403,442.32	-	-	2.74%		
广发证券	1	151,354,566.23	159,058,394.10	-	7.90%	34.71%	
招商证券	1	67,354,462.36	-	250,000,000.00	3.52%		100%
合计	12	1,915,489,452.54	458,288,484.00	250,000,000.00	100%	100%	100%

### 2、 支付佣金 (2005年1月1日至2005年6月30日)

序号	券商名称	支付佣金	占报告期佣金总量的比例
1	联合证券	172,503.59	11.23%
2	国元证券	75,078.37	4.89%
3	华夏证券	177,259.17	11.54%
4	东吴证券	84,298.83	5.49%
5	国泰君安	271,848.09	17.69%
6	兴业证券	243,000.41	15.82%
7	中信证券	170,855.88	11.12%
8	长江证券	27,737.74	1.81%
9	光大证券	95,561.67	6.22%
10	申银万国证券	42,970.73	2.80%

11	广发证券	122,490.57	7.97%
12	招商证券	52,729.73	3.43%
13	合计	1,536,334.78	100.00%

### 3、 证券公司席位的变更情况

本基金在报告期内没有新增或取消证券公司席位的情况发生。

## 十、 备查文件目录

- 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
- 2、《博时精选股票证券投资基金基金合同》
- 3、《博时精选股票证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、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

存放地点：基金管理人、基金托管人处

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

客户服务中心电话：010-65171155

信息披露电话：0755-83195001

本基金管理人：博时基金管理有限公司

2005年8月23日