

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2012年7月20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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月19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运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金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。

本报告中期财务资料未经审计。

本报告日期为2012年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金简称	博时深证基本面200ETF联接
场内简称	BSF200
基金主代码	159008
交易代码	159008
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2011年6月10日
报告期末基金份额总额	271,229,029份

投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略:本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的权重比例买入成份股,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

业绩比较基准:深证基本面200指数(价格/净值)。

风险收益特征:本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

1.本期已实现收益	-7,504,314.10
2.本期利润	2,961,960.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0107
4.期末基金资产净值	203,471,476.98

上述基金净值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②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	1.19%	1.17%	0.86%	1.11%	0.33%	-0.01%

3.2.2 本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:本基金的基金合同于2011年6月10日生效,按照基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的净值增长率符合基金合同第十二条“C)投资范围”、“D)投资禁止行为及限制”的有关规定。本基金定长期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4 基金管理人

4.1 基金经理 或基金经理小组:简介

2012 第二季度报告

注:股票投资的公允价值包含可替代替代的估值增值。
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	946,321.20	0.47
B	采掘业	8,612,255.26	4.23
C	制造业	116,375,893.55	57.20
CD	食品饮料	12,611,187.24	6.20
C1	纺织服装、皮毛	1,648,316.22	0.81
C2	木材、家具	311,775.48	0.15
C3	造纸、印刷	2,636,307.74	1.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,930,166.54	5.86
C5	电子	6,907,469.34	3.39
C6	金属、非金属	37,266,235.10	18.32
C7	机械、设备、仪表	35,587,189.16	17.49
C8	医药、生物制品	7,005,186.53	3.44
C9	其他制造业	472,060.20	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,406,675.10	3.15
E	建筑业	955,839.60	0.47
F	交通运输、仓储业	3,013,853.55	1.48
G	信息技术业	6,442,694.02	3.17
H	批发和零售业	10,757,057.05	5.29
I	金融、保险业	15,175,103.33	7.46
J	房地产业	23,570,124.17	11.58
K	社会服务业	2,832,764.72	1.39
L	传播与文化产业	521,443.68	0.26
M	综合类	2,541,742.43	1.25
合计		198,151,766.75	97.39

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	000002	万科A	1,539,791	13,719,537.81	6.74
2	000709	河北钢铁	1,928,150	5,263,849.50	2.59
3	000651	格力电器	248,192	5,174,803.20	2.54
4	000898	鞍钢股份	1,238,166	4,828,847.40	2.37
5	000001	深发展A	300,070	4,549,061.20	2.24
6	002024	苏宁电器	512,982	4,303,918.98	2.12
7	000825	太原钢铁	1,201,327	4,240,684.31	2.08
8	000063	中兴通讯	272,649	3,806,180.04	1.87
9	000527	美的电器	335,467	3,706,910.35	1.82
10	000402	金通神	553,585	3,619,934.35	1.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益类	655,943.09	0.44
2	其他类	655,943.09	0.44
3	国债	137,266,000.00	92.88
4	央行票据	-	-
5	金融债	-	-
6	企业债	-	-
7	其他信用债	-	-
8	其他类	-	-
9	合计	147,800,348.83	100.00

5.5 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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.6 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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.7 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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本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。

5.8.2 报告期内本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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	4,623,547.41
3	应收股利	-
4	应收利息	466.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,874,013.47

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.8.5 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。

5.8.6 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	
本报告期初基金份额总额	283,229,029
本报告期基金总申购份额	16,500,000
减:本报告期基金总赎回份额	28,500,000
本报告期基金净申购份额	14,500,000
本报告期末基金份额总额	271,229,029

7 影响投资者决策的其他重要信息

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:“做价值的发现者”。截至2012年6月30日,博时基金共管理三十只开放式公募基金和一只封闭式基金,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1194亿元人民币,累计分红570.26亿元人民币,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行业名列前茅。

根据银河证券基金研究中心统计,截至2012年6月29日,开放式基金中,博时大盘ETF及超大ETF联接基金上半年收益率在同类151只基金中分列第二和第四,另外,博时主题行业基金、博时创业成长基金、博时裕祥分级A类、博时信利分级A类基金的上半年收益率都进入了同类基金的前30%。封闭式基金中,基金裕隆上半年收益率在同类25只基金中排名第二。

2.客户服务

2012年二季度,博时基金举办各类渠道培训活动共计18场;“博时·视界”共举办视频直播活动11场,在线人数累计1102人次。

3.品牌荣誉

16月28日,世界品牌实验室(WBL)在京发布2012年 第九届《中国500最具价值品牌》排行榜,博时基金以61.92亿元的品牌价值位列第220名,成为入选榜单的第四家基金公司中的第一名。

2012年7月25日,由《21世纪经济报道》主办的“2011年度基金奖”评选中,博时基金荣获“2011年度中国最佳基金公司”奖项。

3.2012年4月20日,由上海证券报社主办的第九届“中国·基金”奖评选揭晓,博时基金管理有限公司获得2011年度“金牛基金TOP公司奖”,博时主题行业基金荣获2011年度“五年期金牛基金”股票型基金奖,博时价值增长混合基金荣获2011年度“一年期金牛基金”偏股混合型基金奖。

4.其他大事件

1)博时裕祥500指数证券投资基金首募顺利结束并于6月14日正式成立。

2)博时于5月15日开通支付宝支付渠道,成为首家在直销网上交易引入支付宝渠道的基金公司。

3)博时上证红利股票ETF于5月11日起在上交所上市,交易代码为510410,日常申购、赎回业务也同步开放。

8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

8.1.2 博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同

8.1.3 博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议

8.1.4 基金管理人业务资格批准、营业执照和公司章程

8.1.5 博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定报刊上各项公告的原稿

8.1.6 博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金年度报告审计报告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件

投资者对本报告如有任何疑问,可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通:95105888(免长途话费)

博时基金管理有限公司
2012年7月20日

博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2012年7月20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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月19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运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金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。

本报告中期财务资料未经审计。

本报告日期为2012年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金简称	博时深证基本面200ETF联接
场内简称	BSF200
基金主代码	159008
交易代码	159008
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金
基金合同生效日	2011年6月10日
报告期末基金份额总额	193,863,608.75份

投资目标:通过主要投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略:本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的权重比例买入成份股,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

业绩比较基准:深证基本面200指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%

风险收益特征:本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相类似。

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

1.本期已实现收益	-1,321,476.70
2.本期利润	1,876,335.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.0095
4.期末基金资产净值	147,385,822.73
5.期末基金份额净值	0.7623

上述基金净值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②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	1.12%	1.06%	0.85%	1.12%	0.27%	-0.02%

3.2.2 本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:本基金的基金合同于2011年6月10日生效,按照基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的净值增长率符合基金合同第十二条“C)投资范围”、“D)投资禁止行为及限制”的有关规定。本基金定长期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4 基金管理人

4.1 基金经理 或基金经理小组:简介

博时卓越品牌股票型证券投资基金(LOF)

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:2012年7月20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2012年7月19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运用基金资产,但不保证基金一定盈利,基金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。

本报告中期财务资料未经审计。

本报告日期为2012年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况

基金简称	博时卓越品牌股票(LOF)
场内简称	博时卓越
基金主代码	160512
交易代码	160512
基金运作方式	契约型上市开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
报告期末基金份额总额	347,717,727.91份

投资目标:在大类资产配置上,本基金强调通过自上而下的行业、公司分析对估值分析有相结合进行前瞻性的决策。

投资策略:沪深300指数收益率×80%+中债全债指数收益率×20%

风险收益特征:本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。

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

单位:人民币元

1.本期已实现收益	14,511,414.12
2.本期利润	15,754,678.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0450
4.期末基金资产净值	328,675,960.90
5.期末基金份额净值	0.945

上述基金净值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②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	4.54%	0.89%	0.76%	0.89%	3.78%	0.00%

注:本基金的基金合同于2011年4月22日生效,按照基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的净值增长率符合基金合同第十二条“C)投资范围”、“D)投资禁止行为及限制”的有关规定。本基金定长期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

4 基金管理人

4.1 基金经理 或基金经理小组:简介

2012 第二季度报告

注:股票投资的公允价值包含可替代替代的估值增值。
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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	103,926,011.34	31.62
CD	食品饮料	4,053,363.30	1.23
C1	纺织服装、皮毛	6,269,686.50	1.91
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,863,130.20	3.31
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	11,631,186.48	3.54
C7	机械、设备、仪表	40,673,314.67	12.38
C8	医药、生物制品	30,433,329.99	9.26
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	37,979,653.69	11.56
E	建筑业	10,600,649.70	2.66
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	32,498,910.52	9.89
H	批发和零售业	28,012,451.20	8.52
I	金融、保险业	27,069,436.98	8.24
J	房地产业	26,176,796.40	7.96
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		264,413,909.63	80.45

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	000013	丽珠集团	899,675	25,001,968.25	7.61
2	600067	华润百货	800,000	22,576,000.00	6.87
3	000669	华信国际	2,845,684	18,155,465.92	5.52
4	600086	中国国旅	799,840	17,740,451.20	5.40
5	600086	中国国旅	3,861,509	16,758,949.06	5.10
6	600048	保利地产	1,400,000	15,876,000.00	4.83
7	000550	江铃汽车	599,917	12,808,227.95	3.90
8	600660	福耀玻璃	1,487,364	11,631,186.48	3.54
9	000002	万科A	1,256,278	11,193,436.98	3.41
10	601336	新华保险	300,000	10,272,000.00	3.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益类	-	-
2	其他类	-	-
3	国债	-	-
4	央行票据	-	-
5	金融债	-	-
6	企业债	-	-
7	其他信用债	-	-
8	其他类	-	-
9	合计	-	-

5.5 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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.6 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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.7 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权证投资明细

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本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。

5.8.2 报告期内本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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,763,895.21
2	应收证券清算款	5,680,046.08
3	应收股利	535,451.04
4	应收利息	11,686.12
5	应收申购款	10,476.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,001,554.46

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	交通银行2011年第一期资产支持证券	2,817,120.61	5.26
2	招商银行2011年第一期资产支持证券	2,040,085.13	3.88
3	交通银行2011年第二期资产支持证券	147,800,348.83	100.00

5.8.5 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。

5.8.6 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	
本报告期初基金份额总额	385,343,847.88
本报告期基金总申购份额	676,040.65
减:本报告期基金总赎回份额	38,302,160.62
本报告期	