深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

【2012】半年度报告摘要

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８月２５日

§１重要提示及目录

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年8月24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2012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

基金名称	深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时深证基本面200ETF
场内简称	深F200
基金主代码	159908
交易代码	159908
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
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
报告期末基金份额总额	271,229,029份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年7月13日

2.2基金产品说明

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基准权重来构建指数化投资组合，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(价格指数)。
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、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪深证基本面200指数，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似。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	张咏东
	联系电话	0755-83169999	021-32169999
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216

2.4信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com

§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(2012年1月1日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-17,431,063.57
本期利润	11,978,760.54
加权平均基金份额本期利润	0.0424
本期基金份额净值增长率	5.35%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2498
期末基金资产净值	203,471,476.98
期末基金份额净值	0.7502

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。

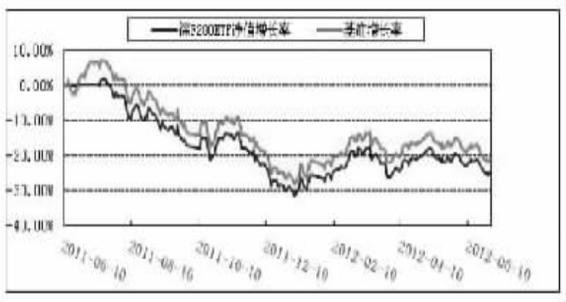
3.2基金净值表现

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	-6.77%	1.09%	-7.05%	1.11%	0.28%	-0.02%
过去三个月	1.19%	1.17%	0.86%	1.18%	0.33%	-0.01%
过去六个月	5.35%	1.44%	5.46%	1.45%	-0.11%	-0.01%
过去一年	-25.14%	1.41%	-24.19%	1.44%	-0.95%	-0.03%
自基金成立起至今	-24.98%	1.37%	-21.28%	1.43%	-3.70%	-0.06%

注：本基金的业绩比较基准为深证基本面200指数。

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个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条“（二）投资范围”、“（八）投资禁止行为与限制”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（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字［1998］26号文批准设立。注册资本为一亿元人民币，总部设在深圳，在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司，此外，还设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；環安实业有限公司，持有股份6%；上海盛业资产管理有限公司，持有股份6%；丰益实业发展有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。

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2012年6月30日，博时基金公司共管理三十只开放式基金和二只封闭式基金，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业中名列前茅。

1、基金业绩

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，博时超大盘ETF及超大盘ETF联接基金上半年收益率在同类型115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、博时裕祥分级债A类、博时信用债A/B/C类的上半年收益率都进入了同类型基金的前30%。封闭式基金中，基金裕隆上半年收益率在同类的25只基金中排名第三。

2、客户服务

2012年1月至6月，博时基金共举办各类渠道培训活动共计83场；“博时e视界”共举办视频直播活动23场，在线人数累计2164人次；1月5日举办“2012博时基金投资策略媒体交流会”，到会50多家媒体。1月6日在中华世纪坛举办“博时基金投资论坛暨2012投资策略交流会”，到会约220名机构和零售高端客户，通过这些活动，博时与投资者充分沟通了当前市场的热点问题，受到了投资者的广泛欢迎。

3、品牌获奖

1）6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，成为入选该榜单四家基金公司中的第一名。

2）2012年5月25日，在由21世纪经济报道主办的“2011年度赢基金奖”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“金基金”奖评选揭晓，博时基金管理有限公司获得2011年度“金基金？TOP公司奖”，博时主题行业股票基金获得2011年度“五年期金基金•股票型基金奖”，博时价值增长混合基金获得2011年度“一年期金基金？偏股混合型基金奖”。

4）3月28日，由理财周报主办的“2012中国金融品牌管理者年会暨2011中国金融品牌『金象奖』颁奖典礼”在京举行。“博时抗通胀增强回报基金”营销事件荣获2011中国金融品牌『金象奖』之“2011中国金融品牌年度十大营销事件”。

5）3月28日，中证报“2012年金牛基金论坛暨第九届中国基金业金牛奖颁奖盛典”在京举行。博时基金荣膺六项大奖，分别是：博时基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”、博时裕隆封闭荣获“五年期封闭式金牛基金”、博时主题行业荣获“五年期股票型金牛基金”、博时第三产业荣获“2011年度股票型金牛基金”、博时特许价值荣获“2011年度股票型金牛基金”、博时价值增长荣获“2011年度混合型金牛基金”。

6）3月26日，在“晨星2012年度基金奖”中，我司旗下两只产品获得提名：博时主题行业股票基金获得“晨星2012年度股票型基金奖”提名、博时价值增长混合基金获得“晨星2012年度混合型基金奖”提名。

7）3月26日，在“证券时报2011年度中国基金业明星奖”中，我司共获得七项大奖：博时基金管理有限公司获得“2011年度十大明星基金公司奖”、博时特许价值股票基金获得“三年持续回报股票型明星基金奖”、博时主题行业股票基金和博时特许价值股票基金获得“2011年度股票型明星基金奖”、博时价值增长基金和博时价值增长贰号基金获得“2011年度平衡混合型明星基金奖”、博时裕隆封闭获得“2011年度封闭式明星基金奖”。

4、其他大事件

1）博时标普500指数型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中引入支付宝渠道的基金公司。

3）博时上证自然资源ETF于5月11日起在上证所上市，交易代码为510410，日常申购、赎回业务也同步开放。

4）博时天颐债券型证券投资基金首募顺利结束并于2月29日正式成立。

5）上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金及联接基金于2012年3月5日至3月30日完成了首次募集。

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		
王政	基金经理/ETF及量化投资组投资总监	2011-6-10	-	13	1995年至1997年在哈佛大学从事地球物理博士后研究工作。1997年8月起先后在美国新泽西州道琼斯投资公司、美国新泽西州彭博资讯研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009年5月加入博时基金管理有限公司。现任ETF及量化投资组投资总监、博时上证超大盘ETF及联接基金基金经理、博时深证基本面200ETF及联接基金经理、博时标普500指数基金的基金经理。
赵云阳	量化分析师/基金经理助理	2011-8-25	-	2	2003年起在晨星中国研究中心工作。2010年加入博时，任股票投资部ETF量化分析组量化分析师兼任博时深证基本面200ETF基金、博时深证基本面200ETF基金联接基金、博时标普500指数基金的基金经理助理。

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、《深证基本面200交易型开放式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

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份股紧密跟踪指数，利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能的减少跟踪误差。同时，在本报告期，我们严格按照基金合同要求，在指数权重及成份股变动时，尽量降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合与目标指数的结构一致。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日，本基金份额净值为0.7502元，份额累计净值为0.7502元。报告期内，本基金份额净值增长率为5.35%，同期业绩基准增长率为5.46%，相对于投资基准的累计偏离度为-0.11%，跟踪误差（年化）控制在2%以内。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年上半年，在国内外宏观流动性宽松和经济发展乏力的两大因素博弈下，市场震荡。宽松的货币政策能降低企业成本，刺激企业投资需求，对经济复苏起积极作用。展望下半年，欧债危机的演绎及对经济是否见底的不确定性仍是导致市场动荡的主要因素。目前市场估值处于五年来的低点，甚至低于欧美市场估值，反映了投资者对未来上市公司盈利的悲观预期。未来3-6个月政策对经济的刺激作用或将显现。超预期的宏观宽松政策和经济基本面的好转迹象会是市场上涨的催化剂。

在投资策略上，深F200ETF作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪深证基本面200指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过深F200ETF基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

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、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。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

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

2012年上半年度，基金托管人在深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2012年上半年度，博时基金管理有限公司在深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2012年上半年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日　　单位：人民币元

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	117,715.66	61,090.26
结算备付金	948,434.05	2,997,473.85
存出保证金	250,000.00	524,322.59
交易性金融资产	198,151,765.25	207,189,209.14
其中：股票投资	198,151,765.25	207,189,209.14
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	4,623,547.41	-
应收利息	466.06	1,482.30
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	204,091,928.43	210,773,578.14
负债和所有者权益	**本期末 2012年6月30日**	**上年度末 2011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	1,846.70	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	86,978.79	94,972.60
应付托管费	17,395.76	18,994.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	27,940.74	5,379.33
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	486,289.46	432,271.08
负债合计	620,451.45	551,617.54
所有者权益：		
实收基金	271,229,029.00	295,229,029.00
未分配利润	-67,757,552.02	-85,007,068.40
所有者权益合计	203,471,476.98	210,221,960.60
负债和所有者权益总计	204,091,928.43	210,773,578.14

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.7502元，基金份额总额271,229,029份。

6.2利润表

会计主体：深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日　　单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年6月10日(基金合同生效日)至2011年6月30日
一、收入	12,977,941.36	1,055,788.99
1.利息收入	14,027.24	733,161.26
其中：存款利息收入	14,027.24	140,971.94
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	592,189.32
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-16,455,264.02	16,936.60
其中：股票投资收益	-17,990,762.90	1,204.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,535,498.88	15,732.60
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	29,409,824.11	301,872.00
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	9,354.03	3,819.13
减：二、费用	999,180.82	163,011.70
1.管理人报酬	544,243.83	110,549.24
2.托管费	108,848.75	22,109.84
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	76,781.55	121.10
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	269,306.69	30,231.52
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	11,978,760.54	892,777.29
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	11,978,760.54	892,777.29

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日　　单位：人民币元

项目	本期 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)	295,229,029.00	-85,007,068.40	210,221,960.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,978,760.54	11,978,760.54
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)	-24,000,000.00	5,270,755.84	-18,729,244.16
其中：1.基金申购款	37,500,000.00	-8,540,441.15	28,959,558.85
2.基金赎回款	-61,500,000.00	13,811,196.99	-47,688,803.01
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)	271,229,029.00	-67,757,552.02	203,471,476.98
项目	**上年度可比期间 2011年6月10日(基金合同生效日)至2011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)	403,229,029.00	-	403,229,029.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	892,777.29	892,777.29
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	403,229,029.00	892,777.29	404,121,806.29

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：

——何　宝————　　——王　德　英————　　——成江————

基金管理公司负责人：何宝　　主管会计工作的负责人：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度报告相一致。

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》及其他相关财税法规和实务操作，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。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。

（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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、一级交易商
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(“深证基本面200ETF联接基金”)	基金管理人管理的其他基金

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

无。

6.4.4.1.2权证交易

无。

6.4.4.1.3应支付关联方的佣金

无。

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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年6月10日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	544,243.83	110,549.24
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.4.2.2基金托管费　　单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年6月10日(基金合同生效日)至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	108,848.75	22,109.84

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 × 0.10% / 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

6.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况　　份额单位：份

关联方名称	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深证基本面200ETF联接基金	183,000,000	67.47%	189,000,000	64.02%

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年6月10日(基金合同生效日)至2011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
交通银行	117,715.66	1,010.05	927,217.86	24,024.26

注：1.本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2.本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于2012年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5期末（2012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
000767	*ST漳电	12/06/01	重大资产重组	3.72	12/07/27	3.90	108,541	551,155.97	403,772.52	-
002500	山西证券	12/05/15	公告重大事项	8.19	未知	未知	24,738	218,292.99	202,604.22	-
000059	辽通化工	12/06/26	公告重大事项	7.91	12/07/03	8.15	70,100	850,341.42	554,491.00	-

注：本基金截至2012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

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	198,151,765.25	97.09
	其中：股票	198,151,765.25	97.09
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	1,066,149.71	0.52
6	其他各项资产	4,874,013.47	2.39
7	合计	204,091,928.43	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	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
C0	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
C99	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	955,838.69	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	批发和零售贸易	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

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	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	太钢不锈	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 融 街	553,895	3,616,934.35	1.78

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	000629	攀钢钒钛	1,517,477.37	0.72
2	000100	TCL 集团	1,302,723.00	0.62
3	000063	中兴通讯	1,104,848.00	0.53
4	002202	金风科技	879,766.00	0.42
5	000527	美的电器	874,060.00	0.42
6	002024	苏宁电器	789,497.40	0.38
7	000983	西山煤电	726,323.75	0.35
8	000425	徐工机械	668,646.60	0.32
9	000002	万 科A	501,236.00	0.24
10	000728	国元证券	487,888.83	0.23
11	000157	中联重科	480,898.00	0.23
12	000528	柳 工	465,936.00	0.22
13	000651	格力电器	459,402.00	0.22
14	002092	中泰化学	422,093.00	0.20
15	000652	泰达股份	421,348.00	0.20
16	000877	天山股份	399,236.55	0.19
17	000012	南 玻A	380,135.95	0.18
18	000783	长江证券	353,266.00	0.17
19	000725	京东方A	335,782.00	0.16
20	000792	盐湖股份	334,066.00	0.16

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	000002	万 科A	3,218,826.62	1.53
2	000709	河北钢铁	2,231,408.35	1.06
3	000825	太钢不锈	1,334,651.18	0.63
4	000539	粤电力A	772,217.71	0.37
5	000651	格力电器	682,926.02	0.32
6	000951	中国重汽	634,932.19	0.30
7	000728	国元证券	624,332.45	0.30
8	000402	金 融 街	564,870.42	0.27
9	000069	华侨城A	556,991.23	0.26
10	000001	深发展A	554,842.02	0.26
11	000895	双汇发展	548,614.50	0.26
12	000878	云南铜业	504,935.91	0.24
13	000027	深圳能源	473,578.11	0.23
14	000046	泛海建设	449,412.65	0.21