

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  
报告送出日期:2012年8月25日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设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该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

基金简称	博时沪深300指数
基金代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2003年8月26日
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
报告期末基金份额总额	13,682,590,186.20份
基金合同存续期	不定期

## 2.2基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金份额净值增长率与标的指数增长率的正相关度在95%以上,并使得年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用被动式投资的方法,按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为:股票资产为95%以内,现金和短期债券资产比例不超过5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%的沪深300指数加5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法,基金净值增长率与标的指数增长率呈高度正相关,风险与收益均类似。本基金资产中除风险管理和风险控制措施外,还将采用数量化风险管理手段,以规避跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

## 2.3基金管理人、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	中国建设银行股份有限公司
姓名	孙树培	尹宏
联系电话	0755-83169999	010-67593003
电子信箱	service@bosera.com	ccit@ccb.com
客户服务电话	95105588	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275855

## 2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## §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	222,619,866.72
本期利润	531,904,547.70
加权平均基金份额本期利润	0.0381
本期基金份额净值增长率	5.62%
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	-0.3177
期末基金资产净值	9,335,939,644.04
期末基金份额净值	0.6823

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

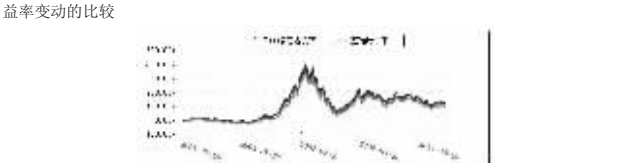
## 3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.33%	1.05%	-6.15%	1.04%	0.82%	0.01%
过去三个月	1.34%	1.07%	0.29%	1.05%	0.09%	0.02%
过去六个月	5.62%	1.26%	4.76%	1.26%	0.86%	0.00%
过去一年	-17.80%	1.28%	-18.16%	1.28%	0.36%	0.00%
过去三年	-21.03%	1.49%	-20.85%	1.49%	-0.18%	0.00%
自基金成立起至今	115.76%	1.70%	95.58%	1.72%	-20.18%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数×95%+银行同业存款利率×5%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照95%、5%的比例采取再平衡,再用每日连速的计算方式得到基准指数的时间序列。

## 3.2.2自基金合同生效以来基金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:本基金合同于2003年8月26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3个月内使基金的资产组合比例符合基金合同第十六条(五)投资对象、(六)投资限制的约定。本基金在基金建仓期对所有资产配置比例符合基金合同约定。

## §4 管理人报告

## 4.1基金管理人及基金管理机构

## 4.1.1基金管理人及其基金经理的经验

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金字[1998]126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。目前公司业务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%;瑞安实业有限公司,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,博时基金共管理32只开放式基金和两只封闭式基金,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。

## 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ABC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·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日至4月2012博时基金管理交流会,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220家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月6日,世界品牌实验室(WBI)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月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月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“五年期基金金”、“股票型基金金”,博时价值增长混合基金获得2011年度“一年期基金金”、“偏股混合型基金金”。

4月3月26日,由理财周报主办的“2012中国金融品牌管理者年会暨2011中国金融品牌颁奖盛典(颁奖典礼)”在京举行。博时执通胀增强回报基金“销售事件荣获2011中国金融品牌金奖”之“2011中国金融品牌年度十大营销事件”。

5月28日,中证报“2012年金基金论坛暨第九届中国基金金牛奖颁奖典礼”在京举行。博时基金荣获六项大奖,分别是:博时基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”、博时裕隆封闭债A类“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”、博时价值增长荣获“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月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”提名,博时价值增长混合基金获得“晨星2012年度混合型基金”提名。

7月3月26日,在“证券时报2011年度中国基金明星奖”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年度平衡型明星基金奖”、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”、博时裕隆封闭债A类“五年期封闭式明星基金奖”。

## 4. 其他大事件

- 1)博时标准500指数证券投资基金首募顺利结束并于7月6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日起在上交所上市,交易代码为510410,日常申购、赎回业务也同步开放。
- 4)博时天颐养老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		
杨义峰	基金经理	2010-3-12	2012-6-11	6	2006年毕业于中国科学院数学与系统科学研究院,获得博士学位。2006年6月加入博时基金管理有限公司,历任金融工程、股票投资、数量化研究员、数量化研究员兼兼任博时特许价值股票基金、基金裕泽的基金经理助理,投资经理兼数量化研究员,博时沪深300指数基金、博时特许价值基金基金经理。
张峰	股票投资部总经理/组合投资部/基金经理	2010-10-11	-	19	1988年起先后在Haugen Financial System, 花旗集团TICCO资产管理公司,摩根士丹利投资公司,ASTEN INVESTMENT ADVISORS 工作。2010年2月加入博时基金管理有限公司,曾任股票投资部总经理,现任股票投资部总经理、组合投资部基金经理、沪深300基金基金经理。
孟亚强	基金经理助理	2012-4-18	-	3	2009年9月加入博时基金,历任投资分析、特定资产投资管理助理。现任沪深300基金基金经理助理。

## 博时裕富沪深300指数证券投资基金

## 【2012】半年度报告摘要

## 6.3所有者权益 基金净值)变动表

会计主体:博时裕富沪深300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	上期可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	14,144,724,458.35	-5,007,639,576.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	531,904,547.70
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)	-462,134,272.15	129,084,486.83
其中:1.基金申购款	-485,822,241.50	-141,656,918.01
2.基金赎回款	-947,956,531.65	270,741,405.10
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)	13,682,590,186.20	-4,346,650,542.16

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上期可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	15,631,026,003.22	-2,429,912,526.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-134,648,411.53
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)	-2,098,721,370.70	258,431,094.96
其中:1.基金申购款	617,116,339.19	-89,611,823.07
2.基金赎回款	-2,715,837,709.89	348,042,918.03
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)	13,532,304,632.52	-2,306,129,842.58

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:

基金管理人负责人:何宝	主管会计工作负责人:王德英	会计机构负责人:成江
6.4报表附注	6.4报表附注	6.4报表附注
6.4.1报表附注所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明	6.4.1报表附注所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明	6.4.1报表附注所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
6.4.2关联方关系	6.4.2关联方关系	6.4.2关联方关系
6.4.2.1本期报告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	6.4.2.1本期报告存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。	6.4.2.2本期报告与基金发生关联方交易各关联方

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金托管人的股东、基金代销机构

注:下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.3本期报告及上年度可比期间的关联方交易

6.4.3.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.3.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上期可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
成交金额	42,353,065.56	110,296,734.82
占当期股票成交总额的比例	2.30%	4.25%

6.4.3.1.2权证交易

无。

6.4.3.1.3债券交易

无。

6.4.3.1.4应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上期可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期佣金	35,894.38	35,894.38
占当期佣金总额的比	2.30%	2.73%

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上期可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期佣金	67,557.60	67,557.60
占当期佣金总额的比	3.14%	7.65%

6.4.3.2关联方管理费

6.4.3.2.1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	上期可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,345,239.23	60,465,227.69
其中:支付销售机构的客户维护费	4,181,999.41	5,316,559.66

注:支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.98%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×0.98%/当年天数。

6.4.3.2.2基金托管费

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上期可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,703,110.13	12,339,842.42

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数。

6.4.3.3与关联方进行银行间同业市场的债券 回购/交易

无。

6.4.3.4各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.3.4.2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

6.4.3.4.3由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	数量(单位:股/张)	基金在承销期内买入金额
招商证券	600005	武钢股份	老股配股	2,223,270	8,226,099.00

6.4.4.4.1 2012年6月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.4.4.1.1因认购新发而受限证券

无。

6.4.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值价格	复牌日期	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	江通化工	2012-6-26	公告重大事件	7.91	2012-7-3	762	1,123,880	12,969,039.27	8,889,890.80
002500	山西证券	2012-5-15	公告重大事件	8.19	未知	未知	1,301,358	12,153,922.27	10,658,122.02

2012年6月30日持有的暂时停牌可流通受限股票										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	复牌日期	复牌 开盘	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注	

6.4.4.4.3 2012年6月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.4.4.4.1因认购新发而受限证券

无。

6.4.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值价格	复牌日期	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	江通化工	2012-6-26	公告重大事件	7.91	2012-7-3	762	1,123,880	12,969,039.27	8,889,890.80
002500	山西证券	2012-5-15	公告重大事件	8.19	未知	未知	1,301,358	12,153,922.27	10,658,122.02

9 / 投资组合报告	
1.1 期末基金资产组合情况	
金额单位:人民币元	
	与基金业务有关

6.4.4.4.4.1 2012年6月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.4.4.4.4.1因认购新发而受限证券

无。

6.4.4.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值价格	复牌日期	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	江通化工	2012-6-26	公告重大事件	7.91	2012-7-3	762	1,123,880	12,969,039.27	8,889,890.80
002500	山西证券	2012-5-15	公告重大事件	8.19	未知	未知	1,301,358	12,153,922.27	10,658,122.02

旅行社、旅行社、导游、票务、酒店、租车、机票、火车票、汽车票、船票、飞机票、火车票、
--

6.4.4.4.4.4.1 2012年6月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.4.4.4.4.4.1因认购新发而受限证券

无。

6.4.4.4.4.4.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值价格	复牌日期	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	江通化工	2012-6-26	公告重大事件	7.91	2012-7-3	762	1,123,880	12,969,039.27	8,889,890.80
002500	山西证券	2012-5-15	公告重大事件	8.19	未知	未知	1,301,358	12,153,922.27	10,658,122.02

金属、非金属	713,333,643.68	7.64
机械、设备、仪表	976,085,243.72	10.46
医药、生物制品	441,626,258.73	4.73