

## 深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

## 【2013】半年度报告摘要

体较为低迷。从经济数据方面来看,汇丰PMI连续两个月下跌,5月出口增速回落至1%,5月的PPI为-2.9%,显示经济仍未见起色,工业生产依然较为疲弱。鉴于经济依然弱势,缺乏需求,主要周期品如煤炭、有色、钢铁等依然继续下跌。从流动性方面来看,近期流动性偏紧。从行业方面来看,煤炭产能过剩,产业链仍需要去库存;有色金属全球需求不振,中期内制约其价格。从海外市场方面来看,美国经济持续复苏,QE退出预期的逐步升温,使得全球流动性发生重构,全球资金开始从新兴市场流出,美元指数呈现上涨态势,流动性有紧缩预期,黄金和白银等金属价格大幅回落,国债收益率不断向上攀升。

展望下半年,市场环境仍然存在诸多的不确定性,其主要源于国内外政策变动对经济的调控作用。在國際方面,其主要体现在美国QE退出和日元量化宽松;在国内方面,维稳政策将在很大程度上填补房地产投资及出口增速回落所形成的空缺,各项改革措施的推进效果以及十八届三中全会的召开等都在观察之列。

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管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明  
本基金管理人为了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,有效维护持有人的利益,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、风险管理部负责人、运作部负责人等组成,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,具有独立的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值政策的公平、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人作出合理解释,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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对于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循法律法规情况说明  
2013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  
2013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,符合基金合同的规定。  
5.3托管人对本半年度报告中财务信息等情况的真实、准确和完整发表意见  
2013年上半年度,由博时基金管理有限公司编制并经过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:2013年6月30日

| 资产         | 本期末<br>2013年6月30日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |
|------------|-------------------|---------------------|
|            | 人民币元              | 人民币元                |
| 流动资产:      |                   |                     |
| 银行存款       | 624,495.22        | 205,461.09          |
| 结算备付金      | 658,539.02        | 815,337.55          |
| 存出保证金      | 20,543.29         | 250,000.00          |
| 交易性金融资产    | 141,210,507.60    | 186,306,060.79      |
| 其中:股票投资    | 141,210,507.60    | 186,306,060.79      |
| 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    | -                 | 10,055.88           |
| 应收利息       | 392.78            | 512.37              |
| 应收股利       | -                 | -                   |
| 应收申购款      | -                 | -                   |
| 递延所得税资产    | -                 | -                   |
| 其他资产       | 142,514,477.91    | 187,587,427.68      |
| 资产总计       | 本期末<br>2013年6月30日 | 上年度末<br>2012年12月31日 |
| 负债和所有者权益   |                   |                     |
| 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    | 152,170.27        | -                   |
| 应付赎回款      | -                 | -                   |
| 应付管理人报酬    | 65,324.64         | 74,308.59           |
| 应付托管费      | 13,064.93         | 14,861.72           |
| 应付销售服务费    | -                 | -                   |
| 应付交易费用     | 22,322.85         | 6,513.02            |
| 应交税费       | -                 | -                   |
| 应付利息       | -                 | -                   |
| 应付股利       | -                 | -                   |
| 递延所得税负债    | -                 | -                   |
| 负债合计       | 237,637.26        | 426,675.99          |
| 所有者权益      | 490,519.95        | 522,359.32          |
| 实收基金       | 227,729,029.00    | 260,729,029.00      |
| 未分配利润      | -85,705,071.04    | -73,663,960.64      |
| 所有者权益合计    | 142,023,957.96    | 187,065,068.36      |
| 负债和所有者权益总计 | 142,514,477.91    | 187,587,427.68      |

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.6237元,基金份额总额227,729,029.00份。

| 项目                  | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---------------------|----------------------------|---------------------------------|
|                     | 人民币元                       | 人民币元                            |
| 一、收入                | -19,887,697.18             | 12,977,941.36                   |
| 1.利息收入              | 7,696.69                   | 14,027.24                       |
| 其中:存款利息收入           | 7,696.69                   | 14,027.24                       |
| 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          | -                          | -                               |
| 其他利息收入              | -                          | -                               |
| 2.投资收益(损失以“-”号填列)   | -33,789,037.07             | -16,455,264.02                  |
| 其中:股票投资收益           | -35,208,977.56             | -17,990,762.90                  |
| 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              | -                          | -                               |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 1,419,940.49               | 1,535,498.88                    |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)   | 13,124,218.15              | 29,409,824.11                   |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)   | 769,425.05                 | 9,354.03                        |
| 其中:—费用              | 873,271.85                 | 999,180.82                      |
| 1.管理人报酬             | 450,156.07                 | 544,243.83                      |
| 2.托管费               | 90,031.23                  | 108,848.75                      |
| 3.销售服务费             | -                          | -                               |
| 4.交易费用              | 57,624.94                  | 76,781.55                       |
| 5.利息支出              | -                          | -                               |
| 其中:卖出回购金融资产支出       | -                          | -                               |
| 6.其他费用              | 275,459.61                 | 269,306.69                      |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -20,760,969.03             | 11,978,760.54                   |
| 减:所得税费用             | -                          | -                               |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   | -20,760,969.03             | 11,978,760.54                   |

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:2013年1月1日至2013年6月30日

| 项目                  | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---------------------|----------------------------|---------------------------------|
|                     | 人民币元                       | 人民币元                            |
| 一、收入                | -19,887,697.18             | 12,977,941.36                   |
| 1.利息收入              | 7,696.69                   | 14,027.24                       |
| 其中:存款利息收入           | 7,696.69                   | 14,027.24                       |
| 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          | -                          | -                               |
| 其他利息收入              | -                          | -                               |
| 2.投资收益(损失以“-”号填列)   | -33,789,037.07             | -16,455,264.02                  |
| 其中:股票投资收益           | -35,208,977.56             | -17,990,762.90                  |
| 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              | -                          | -                               |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 1,419,940.49               | 1,535,498.88                    |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)   | 13,124,218.15              | 29,409,824.11                   |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)   | 769,425.05                 | 9,354.03                        |
| 其中:—费用              | 873,271.85                 | 999,180.82                      |
| 1.管理人报酬             | 450,156.07                 | 544,243.83                      |
| 2.托管费               | 90,031.23                  | 108,848.75                      |
| 3.销售服务费             | -                          | -                               |
| 4.交易费用              | 57,624.94                  | 76,781.55                       |
| 5.利息支出              | -                          | -                               |
| 其中:卖出回购金融资产支出       | -                          | -                               |
| 6.其他费用              | 275,459.61                 | 269,306.69                      |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -20,760,969.03             | 11,978,760.54                   |
| 减:所得税费用             | -                          | -                               |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   | -20,760,969.03             | 11,978,760.54                   |

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:2013年1月1日至2013年6月30日

| 项目                                     | 本期<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | 所有者权益合计        |
|--|----------------------------|----------------|
|  | 人民币元                       | 人民币元           |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 260,729,029.00             | 187,065,068.36 |
| 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  |
| 三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -33,000,000.00             | -24,280,141.37 |
| 其中:1.基金申购款                             | 301,500,000.00             | -86,024,455.44 |
| 2.基金赎回款                                | -334,500,000.00            | 94,744,314.07  |
| 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)                        | 227,729,029.00             | -85,705,071.04 |
| 六、其他费用                                 | -                          | -              |
| 七、利润总额(亏损总额以“-”号填列)                    | -20,760,969.03             | 11,978,760.54  |
| 减:所得税费用                                | -                          | -              |
| 八、净利润(净亏损以“-”号填列)                      | -20,760,969.03             | 11,978,760.54  |

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:2013年1月1日至2013年6月30日

6.4报表附注  
6.4.1报表附注为财务报表的组成部分。  
本报附注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:吴姚东,主管会计工作负责人:王德英,会计机构负责人:成江

6.4.2报表附注  
6.4.1报表附注为财务报表的组成部分。  
本报附注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:吴姚东,主管会计工作负责人:王德英,会计机构负责人:成江

## 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         | 000527 | 美的电器 | 4,743,492.00 | 2.54           |
| 2         | 000776 | 广发证券 | 1,641,735.00 | 0.88           |
| 3         | 000898 | 鞍钢股份 | 1,291,767.52 | 0.69           |
| 4         | 000024 | 招商地产 | 1,180,943.80 | 0.63           |
| 5         | 000651 | 格力电器 | 929,374.30   | 0.50           |
| 6         | 000825 | 太钢不锈 | 797,061.00   | 0.43           |
| 7         | 002422 | 科伦药业 | 493,306.92   | 0.26           |
| 8         | 000538 | 云南白药 | 452,741.00   | 0.24           |
| 9         | 002570 | 中国美  | 442,453.21   | 0.24           |
| 10        | 002128 | 露笑科技 | 440,210.32   | 0.24           |
| 11        | 002594 | 比亚迪  | 439,370.00   | 0.23           |
| 12        | 000002 | 万科A  | 418,270.00   | 0.22           |
| 13        | 000731 | 四川美丰 | 336,946.00   | 0.19           |
| 14        | 002415 | 海康威视 | 302,840.00   | 0.16           |
| 15        | 000531 | 碧水源  | 297,154.83   | 0.16           |
| 16        | 000932 | 华鲁钢铁 | 287,285.00   | 0.15           |
| 17        | 002241 | 歌尔声学 | 281,973.81   | 0.15           |
| 18        | 000789 | 江西水泥 | 268,750.00   | 0.14           |
| 19        | 002375 | 亚厦股份 | 260,456.38   | 0.14           |
| 20        | 002299 | 圣农发展 | 249,367.00   | 0.13           |

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         | 000898 | 鞍钢股份  | 1,330,459.28 | 0.71           |
| 2         | 000002 | 万科A   | 997,069.91   | 0.53           |
| 3         | 002304 | 洋河股份  | 929,668.05   | 0.50           |
| 4         | 000725 | 京东方A  | 557,603.54   | 0.30           |
| 5         | 000858 | 五粮液   | 517,837.68   | 0.28           |
| 6         | 002415 | 海康威视  | 508,371.63   | 0.27           |
| 7         | 000446 | 芝海建设  | 501,520.76   | 0.27           |
| 8         | 000538 | 云南白药  | 476,137.76   | 0.25           |
| 9         | 000402 | 金新农   | 459,703.10   | 0.25           |
| 10        | 002422 | 科伦药业  | 443,699.78   | 0.24           |
| 11        | 000039 | 中集集团  | 419,423.99   | 0.22           |
| 12        | 000717 | 都邮股份  | 339,329.16   | 0.18           |
| 13        | 002022 | 新华生物  | 319,853.36   | 0.17           |
| 14        | 002244 | 浙江集团  | 274,516.22   | 0.15           |
| 15        | 000970 | 中科三环  | 274,516.22   | 0.15           |
| 16        | 002242 | 九阳股份  | 268,938.68   | 0.14           |
| 17        | 000423 | 东阿阿胶  | 256,227.09   | 0.14           |
| 18        | 002051 | 农产品   | 234,172.20   | 0.13           |
| 19        | 000661 | 农产品   | 226,508.50   | 0.13           |
| 20        | 000100 | TCL集团 | 227,500.36   | 0.12           |

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

## 7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 单位:人民币元      |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本(成交)总额 | 25,831,585.31 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 20,138,365.09 |

注:本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

## 7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。  
7.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细  
本基金本报告期末未持有债券。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

7.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
报告期末本基金未投资股指期货交易。

7.10投资组合报告附注  
7.10.1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。

7.10.2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。

## 7.10.3期末其他各项资产构成

| 单位:人民币元 |         |           |  |  |
|---------|---------|-----------|--|--|
| 序号      | 名称      | 金额        |  |  |
| 1       | 存出保证金   | 20,543.29 |  |  |
| 2       | 应收证券清算款 | -         |  |  |
| 3       | 应收股利    | -         |  |  |
| 4       | 应收利息    | 392.78    |  |  |
| 5       | 应收申购款   | -         |  |  |
| 6       | 其他应收款   | -         |  |  |
| 7       | 待摊费用    | -         |  |  |
| 8       | 其他      | -         |  |  |
| 9       | 合计      | 20,936.07 |  |  |

7.10.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5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的情况。

7.10.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 序号 | 名称      |           | 金额     |           |
|----|---------|-----------|--------|-----------|
|    | 持有基金份额  | 持有基金份额的比例 | 持有基金份额 | 持有基金份额的比例 |
| 1  | 存在保证金   | 20,543.29 |        |           |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |        |           |
| 3  | 应收股利    | -         |        |           |
| 4  | 应收利息    | 392.78    |        |           |
| 5  | 应收申购款   | -         |        |           |
| 6  | 其他应收款   | -         |        |           |
| 7  | 待摊费用    | -         |        |           |
| 8  | 其他      | -         |        |           |
| 9  | 合计      | 20,936.07 |        |           |

8.2期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 名称                           |                | 金额     |           |
|----|------------------------------|----------------|--------|-----------|
|    | 持有基金份额                       | 持有基金份额的比例      | 持有基金份额 | 持有基金份额的比例 |
| 1  | 华泰证券股份有限公司                   | 6,000,280.00   | 2,630  |           |
| 2  | 博时资产                         | 990,402.00     | 0.43%  |           |
| 3  | 李哲名                          | 842,986.00     | 0.37%  |           |
| 4  | 吴蔚青                          | 747,093.00     | 0.33%  |           |
| 5  | 陈元生                          | 700,111.00     | 0.31%  |           |
| 6  | 陈元生                          | 700,029.00     | 0.31%  |           |
| 7  | 王爱林                          | 635,312.00     | 0.28%  |           |
| 8  | 陆建伟                          | 507,225.00     | 0.22%  |           |
| 9  | 朱松林                          | 505,168.00     | 0.22%  |           |
| 10 | 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 | 160,500,000.00 | 70.48% |           |

注:前十名持有人为除博时深F200ETF联接基金之外的前十名持有人。

## 8.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位:份

| 基金合同生效日(2011年6月10日) | 基金份额总额         | 403,229,029.00 |
|---------------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额        | 260,729,029.00 |                |
| 本报告期基金总申购份额         | 301,500,000.00 |                |
| 减:本报告期基金总赎回份额       | 334,500,000.00 |                |
| 本报告期基金拆分变动份额        | -              |                |
| 本报告期末基金份额总额         | 227,729,029.00 |                |

## § 10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议  
本报告期内未召开持有人大会。

10.2基金经理人、基金托管人的专门基金托管部(人)的重大人事变动  
①基金管理人于2013年6月1日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,何宝不再担任博时基金管理有限公司总经理职务,由杨鹤代任公司总经理。

②基金管理人于2013年7月26日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经博时基金管理有限公司第五届董事会2013年第三次会议审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]362号文核准批复,博时基金管理有限公司聘任吴姚东担任博时基金管理有限公司总经理。

10.3涉及基金管理人、基金托管人、基金托管业务的诉讼  
本报告期内无涉及本基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变  
本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况  
本基金自基金合同生效之日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况  
本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况  
10.7.1基金租用证券公司交易