

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:2013年8月29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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,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2013年8月28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。

本半年度报告摘要源自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013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

基金简称	博时深证基本面200ETF
场内简称	深200
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1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
报告期基金份额总额	227,729,029份
基金总资产净值	不定期
基金上市交易所	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。  
本基金为完全复制型指数基金,采用完全复制法,即按照成份股在标的指数中的基准权重构建拟合度较高的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化定期进行调整。

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。

风险收益特征:本基金为被动型指数基金,跟踪指数基金,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示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
姓名	孙树清	黄敬敏
信息披露负责人	0755-83169999	95559
联系电话	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	9510588	95559
传真	0755-83195140	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.bosera.com  
基金管理人、基金托管人

## § 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(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	-33,885,187.18
本期利润	-20,760,969.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0835
期末基金份额净值	1.0370%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3763
期末基金资产净值	142,023,957.96
期末基金份额净值	0.6237

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)减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将低于所列数字。

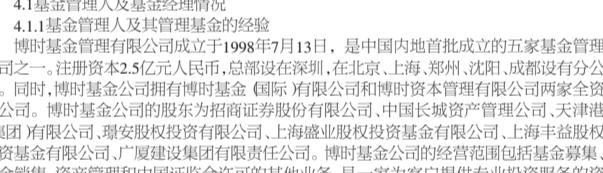
## 3.2 基金份额表现

## 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(%)	份额净值增 长标准差(%)	业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准收 益率标准差(%)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去一个月	-17.45%	1.96%	-17.83%	1.98%	0.38%	-0.02%
过去三个月	-11.83%	1.51%	-12.19%	1.53%	0.36%	-0.02%
过去六个月	-13.07%	1.49%	-13.28%	1.50%	0.21%	-0.01%
过去一年	-16.86%	1.42%	-16.97%	1.43%	0.11%	-0.01%
自基金成立至今	-37.65%	1.40%	-34.64%	1.43%	-2.99%	-0.03%

注:本基金的业绩比较基准为深证基本面200指数。

3.2.2 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规定“C类投资范围”、“八、投资禁止行为与限制”的有关规定。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 基金管理人及其基金经理情况

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成立于1998年7月13日,是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一,注册资本2.5亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。同时,博时基金公司拥有博时基金国际有限公司和时时资本管理有限公司两家全资子公司。博时基金公司的股东为招商证券股份有限公司、中国长城资产管理公司、天津津联信托有限公司、瑞安建设投资有限公司、上海广益股权投资基金有限公司、天津建银投资管理有限公司、天津建银投资有限公司。博时基金公司的经营范围包括基金管理、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务,是一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构。

4.1.2 基金经理

4.1.2.1 基金经理的简历

4.1.2.2 基金经理的从业经验

4.1.2.3 基金经理的管理经验

4.1.2.4 基金经理的获奖情况

4.1.2.5 基金经理的证券投资业绩

4.1.2.6 基金经理的行业情况

4.1.2.7 基金经理的其他情况

4.1.3 基金管理人对报告期内基金运作的说明

在本基金报告期内,基金管理人严格履行了《证券投资基金法》及其各项实施细则,保证本基金符合《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金合同》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好基金资产,为基金持有人谋取最大利益。本报告期内,基金管理人严格按照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

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其各项实施细则,保证本基金符合《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金合同》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好基金资产,为基金持有人谋取最大利益。本报告期内,基金管理人严格按照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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其各项实施细则,保证本基金符合《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金合同》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好基金资产,为基金持有人谋取最大利益。本报告期内,基金管理人严格按照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。

4.3.2 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操作分析

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的平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求,力求基金紧密跟踪指数,利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因,并在小范围内寻求适当的时机适时调仓,尽可能的减少跟踪误差。同时,在本报告期内,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2013年6月30日,本基金份额净值为0.6237元,累计份额净值为0.6237元,报告期内净值增长率为-13.07%,同期业绩基准涨幅为-13.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年上半年,市场对于经济复苏的预期在逐渐退潮。国内经济依然疲软,市场情绪整

## 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

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,融资需求主要集中在煤炭、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,中期仍需关注。从海外市场方面来看,美国经济持续复苏,QE退出预期逐步升温,使得全球流动性发生重构,全球经济开始从新兴市场流走,美元指数呈现上涨态势,流动性有明显预期,黄金白银等金属价格大幅回调,国债收益率不断向上攀升。

展望下半年,市场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。在国际方面,其主要体现在美国QE退出和日元量化宽松;在国内方面,稳增长政策将在多大程度上增加货币政策工具的发挥空间,形成空缺,各项改革措施的推出效果以及十八届三中全会的召开等都在观察之中。

在投资策略上,深200ETF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。

对基金管理人而言,深200ETF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。

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及其更新。

本半年度报告摘要源自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013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

基金简称	博时深证基本面200ETF
场内简称	深200
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1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
报告期基金份额总额	227,729,029份
基金总资产净值	不定期
基金上市交易所	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

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及其更新。

本半年度报告摘要源自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

## § 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