

## 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

# 2012 年 度 报 告 摘 要

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业务开始时间计算。

2.资产管理人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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律法规,恪守深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同)和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于社会的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。报告期内,由于证券市场波动等原因,本基金曾出现投资监控指标不符合基金合同约定的情况,基金管理人在规定时间内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3资产管理人报告期内公平交易情况的专项说明  
4.3.1公平交易制度和控制方法  
报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场和二级市场的权益类及固定收益类投资的投资交易策略、流程、按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待投资者和不同投资组合。

4.3.2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《公平交易管理制度》的规定,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现有违反公平交易原则的现象。

4.3.3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管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的情况  
4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析  
2012年国内经济增速有所放缓,通胀下行,中国处于经济调整的周期当中,一季度市场在资源和有色

的带动下出现一轮上行行情。第二、三季度国内经济一直在低位运行,A股市场的估值在极低的水平下不断下降,市场情绪较为悲观。四季度国内经济出现了明显的企稳迹象,企业盈利开始恢复正增长,A股跌至新低后小幅反弹,沪深300指数逆转,全年涨幅7.55%;上证指数上涨1.7%,深证成指上涨2.22%。全年大盘和小盘的差异较为明显,深证基本面200指数全年上涨0.97%。

本基金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,以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的表现。在报告期内,本基金严格按照基金合同,以不低于基金资产净值90%的资产投资于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金,保证投资收益紧贴标的指数;基金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。投资于深证基本面200ETF基金的资产主要是通过一级市场的申购,以保证投资行为的公平性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现  
截至2012年12月31日,本基金份额净值为0.7285元,份额累计净值为0.7285元。报告期内,本基金份额净值增长率(含分红)为6.66%,同期业绩比较基准收益率为5.14%。

4.5管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的情况  
展望2013年,中国经济增速将有所放缓,经济复苏的可能性较大。新政府对2013年经济推动将集中在部分基础设施与公共服务等方面。在这种状态下,基础设施投资、房地产投资将保持当前态势,房地产和制造业投资增速或将放缓,出口持续疲软,消费与2012年持平或略有回升。在不实施大规模刺激政策的情况下,通胀的表现将相对温和、弱复苏、低通胀、缓慢增长、低估值组合,使我们对2013年的股市场持较为乐观的预期。

在投资策略上,深证基本面200ETF联接基金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,通过投资于深证基本面200ETF基金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前景,希望通过深证基本面200ETF联接基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.6管理人报告期内基金估值程序等事项的说明  
本基金管理人为保证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,有效维护基金份额持有人的利益,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、运作部负责人等组成或组成,基金治理原则上不参与估值委员会的工作。其职责包括估值委员会成员评估并审核估值、估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的职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:保证基金估值的公平、合理、科学、有效的估值政策和程序;确保对估值各方还执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。

参与估值流程各方还包括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,当有分歧时,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审众环会计师事务所签订服务协议,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管理人报告期内基金利润分配情况的说明  
本基金收益分配原则:在符合基金分红条件的前提下,本基金每年最多分配2次,每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的10%,基金的收益分配比例应当以收益分配基准日可供分配利润为基准计算。若自基金合同生效日起不满3个月,不可进行收益分配;基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金收益分配前净值后不低于面值;基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的运作情况,报告期末本基金未满足收益分配条件,故不进行收益分配。

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明  
2012年度,基金托管人(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的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2基金管理人在报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  
2012年度,博时基金管理人在博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金资产净值的计算、博时基金管理人博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金资产净值的计算、个别工作日托管人发现基金资产净值计算超标情况,托管人对基金管理人进行了提示,基金管理人根据规定进行了调整。

报告期末本基金未进行收益分配,符合基金合同约定。  
5.3管理人关于本期报告中基金业绩数据内容的真实性、准确性和完整性的声明  
2012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年度报告中的基金净值表现、收益分配情况、财务会计资料相关内容,投资组合报告等内容真实、准确、完整。

5.4审计报告  
本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者了解审计报告详细内容,可通过登录博时基金管理有限公司网站的相关内容查看审计报告全文。

5.5年度财务报表  
7.1资产负债表  
会计主体: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  
报告截止日:2012年12月31日  
单位:人民币元

资产  
本期末  
2012年12月31日  
上年度末  
2011年12月31日

负债和所有者权益  
2012年12月31日  
2011年12月31日

注:本报告截止日2012年12月31日,基金份额净值0.7285元,基金份额总额186,711,934.10份。

7.2利润表  
会计主体: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  
本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日  
单位:人民币元

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

7.3所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体: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  
本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日  
单位:人民币元

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月31日  
上年度可比期间  
2011年6月10日至2011年12月31日

项目  
2012年1月1日至2012年12月