

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

展望2014年下半年,政府刺激政策的效果将逐步有所体现,国内经济将进入寻底和筑底阶段,国内反通胀措施的执行力度及政府政策的执行力得到市场的认可,为未来中国长期经济环境打下坚实基础,中国经济未来逐步恢复和长远“看”的希望加强。资本市场方面,对市场持相对乐观的态度,风格转换力度加强,关注A股成长向大市值价值转换的博弈机会,特别关注三季度末具体实施的沪港通措施,进一步平衡市场估值,使其与国际接轨,小盘整体高估值水平较大概率下降。深证基本面200指数作为基本面加权策略的指数,在未来市场风格转换过程中,将会呈现相对较好的投资价值,值得市场关注。行业主题方面,可关注国企改革主题,新能源汽车、沪港通受益低估值板块,房地产政策放松的阶段性机会等。

在投资策略上,深证基本面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。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过深证基本面200ETF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、估值委员会负责人、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,具有相对的独立性。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;确保对投资组合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,当存在异议时,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技术、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。

5.1报告期内本基金托管人遵守情况说明
2014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份额持有人利益的行为。

5.2管理人对于报告期内基金投资运作遵守情况、净值计算、利润分配等情况的说明
2014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份额持有人利益的行为。

本报告管理人对于本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见
2014年上半年度,由博时基金管理有限公司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。

5.6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:2014年6月30日

资产	期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币:		
银行存款	1,060,683.75	1,047,493.37
结算备付金	13,362.67	816.48
存出保证金	6,482.57	12,609.04
其他货币资金	106,480,278.06	125,933,413.35
其中:结算备付金	106,480,278.06	125,933,413.35
基金投资	—	—
债券投资	—	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	227.68	241.03
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	30,247.18	—
资产总计	107,591,281.91	126,964,655.04
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	—	—
应付短期融资款	—	—
应付账款	44,142.06	55,363.89
应付赎回款	8,828.49	11,072.78
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	27,241.86	5,300.28
应付利息	—	—
应付股利	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	195,881.57	176,888.39
负债合计	276,410.45	248,625.34
所有者权益:		
实收基金	163,229,029.00	162,729,029.00
未分配利润	-55,314,157.54	-56,012,999.30
所有者权益合计	107,514,871.46	126,716,029.70
负债和所有者权益总计	107,591,281.91	126,964,655.04

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值0.6574元,基金份额总额163,229,029.00份。

6.2净值表
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:2014年1月1日至2014年6月30日

资产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-5,847,298.66	-19,887,697.18
1.利息收入	4,089.08	7,606.69
其中:存款利息收入	4,075.86	7,606.69
2.股利收入	—	13.22
3.债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
4.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	—	—
5.其他收入	—	—
二、费用	-647,210.00	873,271.85
1.管理人费用	281,381.62	456,156.07
2.托管费	56,276.33	90,031.23
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	54,835.99	57,624.94
5.其他费用	—	—
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
6.其他费用	254,716.15	275,459.61
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-6,494,588.66	-20,760,969.03
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-6,494,588.66	-20,760,969.03

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:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	182,729,029.00	-56,012,999.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-6,494,588.66
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)	-19,500,000.00	6,593,350.42
其中:1.基金申购款	—	—
2.基金赎回款	-19,500,000.00	6,593,350.42
四、本期向基金份额持有人分配股利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)	163,229,029.00	-55,914,157.54

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	260,729,029.00	-73,663,960.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-20,760,969.03
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)	-33,000,000.00	8,719,856.63
其中:1.基金申购款	301,500,000.00	-86,024,483.44
2.基金赎回款	-334,500,000.00	94,743,141.07
四、本期向基金份额持有人分配股利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	-88,765,071.04

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告已166.4,财务报表由下列负责人签署:
基金管理人负责人:吴昊东 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
6.4.1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《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税收法规和实务操作,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收营业税和企业所得税。

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

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	002024	苏宁云商	1,453,984.89	1.15
2	000032	华鲁钢铁	1,013,552.75	0.80
3	002202	金风科技	824,920.55	0.65
4	000959	普民股份	777,142.16	0.61
5	000106	TCI集团	676,524.49	0.54
6	000725	新东方A	524,965.69	0.41
7	000778	诺德股份	477,241.70	0.38
8	000829	天奇控股	426,157.27	0.34
9	000039	中集集团	378,470.02	0.30
10	000531	德冠运A	362,804.50	0.29
11	000626	如意集团	349,746.86	0.28
12	000939	凯迪电力	340,723.24	0.27
13	002594	比亚迪	320,406.14	0.25
14	002493	康盛石花	306,656.77	0.24
15	000901	平安银行	306,431.83	0.24
16	000063	中兴通讯	303,347.89	0.24
17	000333	美的集团	288,345.89	0.23
18	000550	江铃汽车	287,497.97	0.23
19	000683	远光能源	285,144.77	0.23
20	002120	天马股份	273,918.94	0.22

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

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
21,132,298.36	20,488,134.37

注:本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(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序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序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序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
7.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
7.10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。
7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期末本基金未投资国债期货交易。
7.12投资组合报告附注
7.12.1 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。
7.12.2 报告期内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。
7.12.3 报告期内其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,482.57
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	227.68
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	30,247.18
8	其他	—
9	合计	36,957.43

7.12.4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。
7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
7.12.6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

持有人户数(户)	户内持有基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
1,913	85,326.20	持有份额 414,520.00	占总份额比例 0.25%	持有份额 46,467,669.00	占总份额比例 28.47%

8.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	富国基金	892,012.00	0.58%
2	鹏华基金	507,225.00	0.33%
3	东联基金	505,168.00	0.33%
4	丁明华	500,111.00	0.33%
5	王亚武	500,020.00	0.33%
6	杨振山	498,002.00	0.33%
7	毛庆华	485,000.00	0.30%
8	恒信医药	488,509.00	0.25%
9	于雷雷	344,301.00	0.23%
10	战海岩	309,022.00	0.18%

注:前10名持有人为除博时深200ETF联接基金之外的前十名持有人。
8.3期末基金基金管理人的从业人员持有本基金的情况

序号	持有份额总数量(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金数量	—	—

8.4期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本基金基金份额数量	—
本基金基金投资持有本开放式基金	—

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究人员未持有本基金;
2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9开放式基金份额变动

基金合同生效日(2011年6月10日)	基金份额总额
本报告期初基金份额总额	403,229,029.00
本报告期间基金总申购份额	182,729,029.00
减:本报告期间基金总赎回份额	—
本报告期间基金总申购份额	19,500,000.00
本报告期末基金份额总额	163,229,029.00

§ 10重大事件揭示

10.1基金份额持有人会议决议
本报告期内未召开持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动
基金管理人于2014年4月19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》,李志惠不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。
10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)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,基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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单元用于股票投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应付该券商的佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国信证券	1	416,014,532.53	100.00%	29,358.80	100.00%	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
恒泰证券	1	—	—	—	—	—

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了选择专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选取标准如下:
(1)经营行为规范规范,内部控制健全,在业内有良好的声誉;
(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
(3)具有较好的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分行的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司的管理基金的特有要求,提供专门研究报告,具有开发基金投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选取程序如下:
(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
(2)基金管理人 and 被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

博时基金管理有限公司
2014年8月28日