

博时深证基本面对200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2014】半年度报告摘要

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2014年6月30日,本基金份额净值为0.6665元,累计净值为0.6665元。报告期内,本基金份额净值增长率为-5.21%,同期业绩比较基准增长率为-5.54%。

4.5管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年上半年,国内经济增长中歇下断步,结构性矛盾未见实质性改善,定向宽松政策对投资企稳回升起到一定成效。从经济数据方面来看,经济活动增速有所放缓;从流动性方面来看,6月下旬向降准范围有所扩大,且资金面相对宽松;从指数表现来看,沪深300指数下跌7.08%,中证500指数上涨2.50%,创业板上涨7.69%;从大小盘风格方面来看,上半年国内资本市场继续延续去年的小盘成长风格,大盘风格指数在国内经济疲弱情形下并无起色;从行业方面来看,申万一级行业中计算机、通信和电子上涨较多,涨幅均超过10%,采掘、农林牧渔和非银金融跌幅较大,均在10%左右。

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,国内反腐措施的执行力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下夯实基础,中国经济未来逐步恢复和长远腾飞希望加强。资本市场方面,对市场相对乐观的态度,风格转换力度加强,关注小盘成长向大盘价值转换的博弈机会,特别是二季度末具体实施的沪深通措施,进一步平衡市场估值,使其与国际接轨,小盘整体估值水平较大概率率向下移。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、沪深港受益低估值板块、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联接基金作为一只被动的指数基金,我们会以最小跟踪误差为目标,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增长,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管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人作为确保基金估值程序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、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成,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6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,具有绝对的独立性。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。

参与估值及净值计算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公司作出合理解释,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。

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规守信情况声明

2014年上半年度,基金托管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的投资过程中,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

2014年上半年度,博时基金管理有限公司在博时深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面上,托管人未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等相关信息的真实、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编制并经托管人复核后审核的关于该博时深证基本面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: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:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
银行存款	1,890,862.25	3,988,788.73
结算备付金	2,068,087.98	924,957.11
货币资金	7,390,969.25	14,561,265.25
交易性金融资产	77,423,220.42	90,669,177.88
其中:股票投资	5,335,568.56	320,351.93
基金投资	76,486,452.06	90,048,825.15
债券投资	401,200.00	-
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	482,350.38	120,615.28
应收利息	1,232,978.79	1,925.17
应收股利	-	-
应收申购款	4,247.03	4,766.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	81,888,856.97	95,724,791.49

负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
短期借款	-	-
应付短期融资券	-	-
交易性金融负债	-	-
应付金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	411,878.50	-
应付赎回款	5,148,003.00	59,394.25
应付管理人报酬	1,844.51	2,066.01
应付托管费	368.90	413.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,956.20	2,797.29
应付股利	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	-	-
负债总计	591,088.11	204,786.80

所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
实收基金	122,142,837.94	136,013,315.80
未分配利润	-40,511,311.11	-40,511,311.11
所有者权益合计	81,297,768.86	95,320,049.69
负债和所有者权益总计	81,888,856.97	95,724,791.49

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.6665元,基金份额总额122,142,837.94份。

6.2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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	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	-4,623,284.25	-14,593,139.30
1.利息收入	29,184.82	48,115.08
其中:存款利息收入	29,184.83	48,115.08
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-0.01	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.股息收入	-	-
3.投资收益(损失以“-”填列)	-4,580,707.68	-4,711,071.14
其中:股票投资收益	-59,526.08	52,748.89
基金投资收益	-4,525,236.99	-4,768,087.88
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)	4,057.32	4,187.85
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-80,493.84	-9,957,460.31
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	8,724.45	27,277.07
二、费用	20,020,236.00	217,062.86
1.销售费用	12,126.87	17,828.60
2.管理费用	16,820.21	3,566.14
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	26,300.21	25,074.85
5.其他支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	169,748.00	169,825.27
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-4,824,207.31	-14,810,336.16
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-4,824,207.31	-14,810,336.16

6.3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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	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、期初所有者权益(基金净值)	136,013,315.80	95,520,049.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-4,824,207.31	-4,824,207.31
三、本期基金份额交易产生的基金份额净值变动数(申购减少以“-”号填列)	-13,888,477.86	4,499,449.34
四、本期基金份额交易产生的基金份额净值变动数(赎回减少以“-”号填列)	-1,545,268.12	3,067,286.01
五、本期基金份额交易产生的基金份额净值变动数(申购减少以“-”号填列)	-18,501,651.99	6,035,817.46
六、本期基金份额交易产生的基金份额净值变动数(赎回减少以“-”号填列)	-122,142,837.94	-80,465,069.08
七、期末所有者权益(基金净值)	122,142,837.94	81,297,768.86

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.6665元,基金份额总额122,142,837.94份。

6.4现金流量表

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	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、经营活动产生的现金流量	186,711,934.10	-50,687,139.27
1.销售商品、提供劳务收到的现金	186,711,934.10	-50,687,139.27
2.收到的税费返还	-	-
3.收到的其他与经营活动有关的现金	-	-
二、投资活动产生的现金流量	-14,810,336.16	-14,810,336.16
1.收回投资收到的现金	-	-
2.取得投资收益收到的现金	-	-
3.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额	-	-
4.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额	-	-
5.收到其他与投资活动有关的现金	-	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
1.吸收投资收到的现金	-	-
2.发行债券收到的现金	-	-
3.取得借款收到的现金	-	-
4.收到其他与筹资活动有关的现金	-	-
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	167,272,515.92	-60,824,271.08
六、期初现金及现金等价物余额	122,142,837.94	81,297,768.86
七、期末现金及现金等价物余额	289,415,353.86	20,473,497.78

注:本基金截至2014年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.5.3期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.4期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.5期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.6期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.7期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.8期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.9期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.10期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.11期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.12期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.13期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.14期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.15期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.16期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.17期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.18期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.19期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.20期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.21期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.22期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.23期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.24期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.25期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.26期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.27期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.28期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.29期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.30期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.31期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.32期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.33期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.34期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.35期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.36期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.37期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.38期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.39期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.40期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.41期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.42期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.43期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.44期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.45期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.46期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.47期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.48期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.49期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.50期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.51期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.52期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.53期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.54期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.55期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.56期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.4.5.57期末债券正回购交易作为抵押的债券

无