

博时裕富沪深 300 指数证券投资  
基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2012 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	错误! 未定义书签。
§ 2 基金简介 .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
§ 4 管理人报告 .....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
§ 5 托管人报告 .....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
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 .....	12
5.3 托管人对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 .....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	15
§ 7 投资组合报告 .....	28
7.1 期末基金资产组合情况 .....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	37
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 .....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	38
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 .....	38
7.9 投资组合报告附注 .....	38
§ 8 基金份额持有人信息 .....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39

---

§ 9 开放式基金份额变动 .....	39
§ 10 重大事件揭示 .....	39
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 其他重大事件 .....	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	42
§ 12 备查文件目录 .....	42
12.1 备查文件目录 .....	42
12.2 存放地点 .....	43
12.3 查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时裕富沪深300指数证券投资基金
基金简称	博时沪深300指数
基金主代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月26日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,682,590,186.20份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在95%以上，并保持年跟踪误差在4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用被动式投资的方法，按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为：股票资产为95%以内，现金和短期债券资产比例不低于5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为95%的沪深300指数加5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	尹东
	联系电话	0755-83169999	010-67595003
	电子邮箱	service@bosera.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275865
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区金融大街25号

办公地址	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	杨鹤	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

# § 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（2012年1月1日至2012年6月30日）
本期已实现收益	-222,619,866.72
本期利润	531,904,547.70
加权平均基金份额本期利润	0.0381
本期加权平均净值利润率	5.45%
本期基金份额净值增长率	5.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012年6月30日）
期末可供分配利润	-4,346,650,542.16
期末可供分配基金份额利润	-0.3177
期末基金资产净值	9,335,939,644.04
期末基金份额净值	0.6823
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012年6月30日）
基金份额累计净值增长率	115.76%

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）扣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要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 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

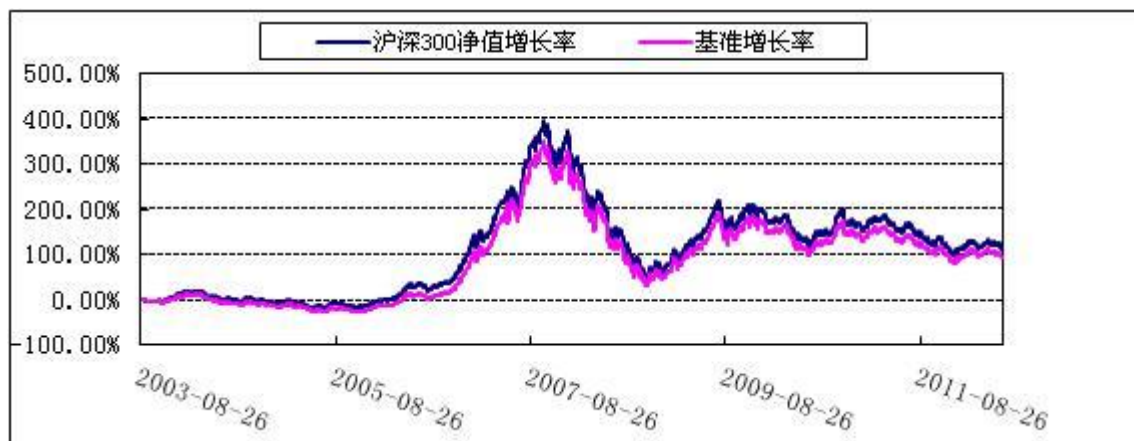
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-5.33%	1.05%	-6.15%	1.04%	0.82%	0.01%
过去三个月	1.34%	1.07%	0.29%	1.07%	1.05%	0.00%
过去六个月	5.62%	1.26%	4.76%	1.26%	0.86%	0.00%
过去一年	-17.80%	1.28%	-18.16%	1.28%	0.36%	0.00%
过去三年	-21.03%	1.49%	-20.85%	1.49%	-0.18%	0.00%
自基金成立起至今	115.76%	1.70%	95.58%	1.72%	20.18%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×95%+银行同业存款利率×5%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自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：本基金合同于 2003 年 8 月 26 日生效。按照本基金的基金合同规定，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十六条（五）投资对象、（九）投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 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（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。注册资本为一亿元人民币，总部设在深圳，在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司，此外，还设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公

司，持有股份 6%；璟安实业有限公司，持有股份 6%；上海盛业资产管理有限公司，持有股份 6%；丰益实业发展有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2012 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理三十只开放式基金和二只封闭式基金，并且受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，公募基金资产规模逾 1194 亿元人民币，累计分红 570.26 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

## 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2012 年 6 月 29 日，开放式基金中，博时超大盘 ETF 及超大盘 ETF 联接基金上半年收益率在同类型 115 只基金中分列第二和第四；另外，博时主题行业基金、博时创业成长基金、博时裕祥分级债 A 类、博时信用债 A/B/C 类的上半年收益率都进入了同类型基金的前 30%。封闭式基金中，基金裕隆上半年收益率在同类的 25 只基金中排名第三。

## 2、客户服务

2012 年 1 月至 6 月，博时基金共举办各类渠道培训活动共计 83 场；“博时 e 视界”共举办视频直播活动 23 场，在线人数累计 2164 人次；1 月 5 日举办“2012 博时基金投资策略媒体交流会”，到会 50 多家媒体。1 月 6 日在中华世纪坛举办“博时基金投资论坛暨 2012 投资策略交流会”，到会约 220 名机构和零售高端客户，通过这些活动，博时与投资者充分沟通了当前市场的热点问题，受到了投资者的广泛欢迎。

## 3、品牌获奖

1) 6 月 28 日，世界品牌实验室(WBL)在京发布 2012 年（第九届）《中国 500 最具价值品牌》排行榜，博时基金以 61.92 亿元的品牌价值位列第 220 名，成为入选该榜单四家基金公司中的第一名。

2) 2012 年 5 月 25 日，在由 21 世纪经济报道主办的“2011 年度赢基金奖”评选中，博时基金荣获“2011 年度中国最佳基金公司”奖项。

3) 2012 年 4 月 20 日，由上海证券报社主办的第九届中国“金基金”奖评选揭晓，博时基金管理有限公司获得 2011 年度“金基金·TOP 公司奖”，博时主题行业股票基金获得 2011



年度“五年期金基金·股票型基金奖”，博时价值增长混合基金获得 2011 年度“一年期金基金·偏股混合型基金奖”。

4) 3 月 28 日，由理财周报主办的“2012 中国金融品牌管理者年会暨 2011 中国金融品牌「金象奖」颁奖典礼”在京举行。“博时抗通胀增强回报基金”营销事件荣获 2011 中国金融品牌「金象奖」之“2011 中国金融品牌年度十大营销事件”。

5) 3 月 28 日，中证报“2012 年金牛基金论坛暨第九届中国基金业金牛奖颁奖盛典”在京举行。博时基金荣膺六项大奖，分别是：博时基金管理有限公司荣获“金牛基金管理公司”、博时裕隆封闭荣获“五年期封闭式金牛基金”、博时主题行业荣获“五年期股票型金牛基金”、博时第三产业荣获“2011 年度股票型金牛基金”、博时特许价值荣获“2011 年度股票型金牛基金”、博时价值增长荣获“2011 年度混合型金牛基金”。

6) 3 月 26 日，在“晨星 2012 年度基金奖”中，我司旗下两只产品获得提名：博时主题行业股票基金获得“晨星 2012 年度股票型基金奖”提名、博时价值增长混合基金获得“晨星 2012 年度混合型基金奖”提名。

7) 3 月 26 日，在“证券时报 2011 年度中国基金业明星奖”中，我司共获得七项大奖：博时基金管理有限公司获得“2011 年度十大明星基金公司奖”、博时特许价值股票基金获得“三年持续回报股票型明星基金奖”、博时主题行业股票基金和博时特许价值股票基金获得“2011 年度股票型明星基金奖”、博时价值增长基金和博时价值增长贰号基金获得“2011 年度平衡混合型明星基金奖”、博时裕隆封闭获得“2011 年度封闭式明星基金奖”。

#### 4、其他大事件

1) 博时标普 500 指数型证券投资基金首募顺利结束并于 6 月 14 日正式成立。

2) 博时于 5 月 15 日开通支付宝支付渠道，成为首家在直销网上交易中引入支付宝渠道的基金公司。

3) 博时上证自然资源 ETF 于 5 月 11 日起在上交所上市，交易代码为 510410，日常申购、赎回业务也同步开放。

4) 博时天颐债券型证券投资基金首募顺利结束并于 2 月 29 日正式成立。

5) 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金及联接基金于 2012 年 3 月 5 日至 3 月 30 日完成了首次募集。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汤义峰	基金经理	2010-3-12	2012-6-11	6	2006年毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，获得博士学位。2006年6月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票基金、基金裕泽的基金经理助理、投资经理兼数量化研究员、博时沪深300指数基金、博时特许价值基金基金经理。
张峰	股票投资部总经理/混合组投资总监/基金经理	2010-10-11	-	19	1988年起先后在Haugen Financial System, 花旗集团TIMCO资产管理部、摩根士丹利投资公司、ASTEN INVESTMENT ADVISORS工作。2010年2月加入博时基金管理有限公司，曾任股票投资部总经理。现任股票投资部总经理、混合组投资总监、沪深300基金基金经理。
孟亚强	基金经理助理	2012-4-18	-	3	2009年9月加入博时基金，历任投资分析员、特定资产投资经理助理。现任沪深300基金基金经理助理。

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行业开始时间计算。

#### 4.2 管理人对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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《博时裕富沪深300指数证券投资基金基金合同》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和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 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相关制度。

#### 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运作分析

博时沪深300为指数型基金。指数型基金管理的核心任务是有效地追踪指数，严格地将跟踪误差控制在合同规定的范围之内，具体的管理策略就是：尽可能保持基金个股或者个券投资比例与指数样本股比例一致；降低主动交易频次以减少交易环节损耗；积极应对基金申购赎回等因素给跟踪指数带来的影响。本基金将一贯奉行博时基金管理有限公司“为国民创造财富”的使命，珍惜每一位基金份额持有人对我们的信任，谨慎、诚信、勤勉地履行职责，为基金份额持有人谋求最大的合法权益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.6823 元，累计净值为 2.6623 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 5.62%，同期业绩基准增长率为 4.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年市场坐了一次过山车，市场对于经济的底部的确认时间一推再推，对于经济复苏的预期又一次落空。从中国 2000 年之后的 3 波通胀周期来看，中国工业化留下的产能问题越来越严重，2001-2007 年中国和全球经济都经历了高速增长，伴随着是国内中游行业产能的急速扩张，2008 年的金融危机拖累了欧美国家的资产负债表，放缓了其进一步上升的动力；而 2009 年的 4 万亿加剧了这一困境。同时，在铁路、能源、金融领域中，“国进民退”的现象比较突出，引导民间投资进入垄断行业对提升整个经济的 ROE 有着至关重要的作用。由于上市公司资本的回报率低于资金成本，企业增加杠杆的动力有限，大规模的资本开支周期难以启动。对于中国经济来说，当下需要解决的是一次产业结构的重新调整，去工业化产能是必须经历的一个阶段，未来政府将主导行业整合，形成几家有竞争力的行业公司是未来的大趋势，这种现象未来会在房地产、钢铁、化工等行业中出现。

展望未来，经济急速下滑阶段已经过去，通胀的下行为政府调整产业结构创造了更好的条件。长期来看，利率的市场化改革将会在长期打破国企与民企之间的二元化资金成本体制，

这会在一定程度上提升民企的竞争力和 ROE 水平；短期内，资金利率成本和原材料价格会在 3 季度继续下行，这将大大缓解中游制造业的成本，同时随着房地产、家电等下游行业的需求复苏，经济下滑可能会在 3 季度见底，这会对资本市场的估值形成一定的支撑。稳增长的经济政策使得市场情绪短期改善，同时流动性的适度改善和微观理财产能资金吸纳能力的下降使得股市的资金压力有所减轻，我们仍然对市场的结构性机会充满希望，股市的春天不会太远。

#### 4.6 管理人对报告期内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、研究部负责人、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 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。

报告期内, 本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对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

本报告期, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完

全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# § 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：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	398,645,836.21	317,271,724.55
结算备付金		2,610,998.79	895,936.11
存出保证金		1,072,313.41	1,338,812.51
交易性金融资产	6.4.3.2	8,940,952,524.83	8,823,603,953.24
其中：股票投资		8,840,772,524.83	8,558,789,953.24
基金投资		-	-
债券投资		100,180,000.00	264,814,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		2,520,615.72	-
应收利息	6.4.3.5	3,633,791.88	5,277,095.37
应收股利		11,254,303.52	-
应收申购款		2,083,257.69	645,998.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>9,362,773,642.05</b>	<b>9,149,033,520.62</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2011 年 12 月 31 日</b>

<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13,808,738.67	-
应付赎回款		1,473,247.29	941,066.04
应付管理人报酬		7,701,126.95	7,846,968.69
应付托管费		1,571,658.57	1,601,422.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	1,313,702.83	477,772.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	965,523.70	1,081,409.20
<b>负债合计</b>		<b>26,833,998.01</b>	<b>11,948,638.96</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.3.9	13,682,590,186.20	14,144,724,458.35
未分配利润	6.4.3.10	-4,346,650,542.16	-5,007,639,576.69
<b>所有者权益合计</b>		<b>9,335,939,644.04</b>	<b>9,137,084,881.66</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>9,362,773,642.05</b>	<b>9,149,033,520.62</b>

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6823 元，基金份额总额 13,682,590,186.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>592,325,550.04</b>	<b>-56,737,166.52</b>
1. 利息收入		4,800,684.84	2,330,857.88
其中：存款利息收入	6.4.3.1 1	1,090,466.30	2,325,253.07
债券利息收入		3,710,218.54	5,604.81
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“-”填列）		-167,575,772.14	-134,708,109.12
其中：股票投资收益	6.4.3.1 2	-271,566,596.00	-234,388,538.79
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.3.1 3	1,227,841.99	3,284,303.19
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.1 4	-	-
股利收益	6.4.3.1 5	102,762,981.87	96,396,126.48
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.3.1 6	754,524,414.42	73,387,919.34
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.3.1 7	576,222.92	2,252,165.38
<b>减: 二、费用</b>		<b>60,421,002.34</b>	<b>77,911,245.01</b>
1. 管理人报酬		47,545,239.23	60,465,227.69
2. 托管费		9,703,110.13	12,339,842.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.1 8	2,944,049.46	4,869,234.56
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.1 9	228,603.52	236,940.34
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>531,904,547.70</b>	<b>-134,648,411.53</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>531,904,547.70</b>	<b>-134,648,411.53</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 博时裕富沪深300指数证券投资基金

本报告期: 2012年1月1日至2012年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	14,144,724,458.35	-5,007,639,576.69	9,137,084,881.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	531,904,547.70	531,904,547.70
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)	-462,134,272.15	129,084,486.83	-333,049,785.32
其中: 1. 基金申购款	485,822,241.50	-141,656,918.18	344,165,323.32
2. 基金赎回款	-947,956,513.65	270,741,405.01	-677,215,108.64
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）	13,682,590,186.20	-4,346,650,542.16	9,335,939,644.04
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,631,026,003.22	-2,429,912,526.01	13,201,113,477.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-134,648,411.53	-134,648,411.53
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）	-2,098,721,370.70	258,431,094.96	-1,840,290,275.74
其中：1. 基金申购款	617,116,339.19	-89,611,823.07	527,504,516.12
2. 基金赎回款	-2,715,837,709.89	348,042,918.03	-2,367,794,791.86
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）	13,532,304,632.52	-2,306,129,842.58	11,226,174,789.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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：何宝      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报报告相一致。

### 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《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 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。
- (b) 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。



(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	398,645,836.21
定期存款	-
其他存款	-
合计	398,645,836.21

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,963,973,378.30	8,840,772,524.83	-2,123,200,853.47
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	99,542,000.00	100,180,000.00
	合计	99,542,000.00	100,180,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,063,515,378.30	8,940,952,524.83	-2,122,562,853.47

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	79,010.42
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,174.90
应收债券利息	3,553,606.56
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	3,633,791.88

#### 6.4.3.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,313,702.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,313,702.83

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	1,683.70
预提费用	213,822.70
其他	17.30
合计	965,523.70

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,144,724,458.35	14,144,724,458.35
本期申购	485,822,241.50	485,822,241.50
本期赎回（以“-”号填列）	-947,956,513.65	-947,956,513.65
本期末	13,682,590,186.20	13,682,590,186.20

注：本期申购含转入份额，本期赎回含转出份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-214,401,823.73	-4,793,237,752.96	-5,007,639,576.69
本期利润	-222,619,866.72	754,524,414.42	531,904,547.70
本期基金份额交易产生的变动数	9,822,416.79	119,262,070.04	129,084,486.83
其中：基金申购款	-10,172,696.49	-131,484,221.69	-141,656,918.18
基金赎回款	19,995,113.28	250,746,291.73	270,741,405.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-427,199,273.66	-3,919,451,268.50	-4,346,650,542.16

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	1,081,495.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,601.23
其他	1,369.84
合计	1,090,466.30

#### 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	1,028,885,730.03
减：卖出股票成本总额	1,300,452,326.03
买卖股票差价收入	-271,566,596.00

#### 6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	185,557,752.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	178,956,550.00
减：应收利息总额	5,373,360.61
债券投资收益	1,227,841.99

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	102,762,981.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	102,762,981.87

#### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	754,524,414.42
——股票投资	755,020,864.42
——债券投资	-496,450.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	754,524,414.42

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	474,133.86
配股手续费返还	-
新股手续费返还	-
印花税返还	29,313.13
转换费收入	72,775.93
配债手续费返还	-
其他	-
合计	576,222.92

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购费补差构成，其中赎回费部分的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	2,944,049.46
银行间市场交易费用	-
合计	2,944,049.46

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	64,644.58
信息披露费	149,178.12
银行汇划费	5,780.82
银行间帐户服务费	9,000.00
合计	228,603.52

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

无。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	42,353,065.56	2.30%	110,296,734.82	4.25%

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	35,894.38	2.30%	35,894.38	2.73%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	67,557.60	3.14%	67,557.60	7.65%

#### 6.4.6.2 关联方报酬

##### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,545,239.23	60,465,227.69
其中：支付销售机构的客户维护费	4,181,999.41	5,316,559.16

注：支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.98% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.98% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,703,110.13	12,339,842.42

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

##### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

##### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

###### 6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

##### 6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	398,645,836.21	1,081,495.23	575,841,695.12	2,304,973.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	000651	格力电器	老股东配股	109,306	1,875,690.96
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	600005	武钢股份	老股东配股	2,223,270	8,226,099.00

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000059	辽通 化工	2012-6-26	公告重 大事项	7.91	2012-7-3	7.62	1,123,880	12,969,039.27	8,889,890.80	
002500	山西 证券	2012-5-15	公告重 大事项	8.19	未知	未知	1,301,358	12,153,922.27	10,658,122.02	

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属被动式股票指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4%以下的投资目标。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察法律部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察法律部对公司执行总裁负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。



本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2011 年 12 月 31 日：同)。

#### **6.4.9.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.9.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.9.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

#### 6.4.9.4.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	398,645,836.21	-	-	-	398,645,836.21
结算备付金	2,610,998.79	-	-	-	2,610,998.79
存出保证金	-	-	-	1,072,313.41	1,072,313.41
交易性金融资产	100,180,000.00	-	-	8,840,772,524.83	8,940,952,524.83
应收证券清算款	-	-	-	2,520,615.72	2,520,615.72
应收股利	-	-	-	11,254,303.52	11,254,303.52
应收利息	-	-	-	3,633,791.88	3,633,791.88
应收申购款	-	-	-	2,083,257.69	2,083,257.69
资产总计	501,436,835.00	-	-	8,861,336,807.05	9,362,773,642.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	13,808,738.67	13,808,738.67
应付赎回款	-	-	-	1,473,247.29	1,473,247.29
应付管理人报酬	-	-	-	7,701,126.95	7,701,126.95
应付托管费	-	-	-	1,571,658.57	1,571,658.57
应付交易费用	-	-	-	1,313,702.83	1,313,702.83
其他负债	-	-	-	965,523.70	965,523.70
负债总计	-	-	-	26,833,998.01	26,833,998.01
利率敏感度缺口	501,436,835.00	-	-	8,834,502,809.04	9,335,939,644.04
上年度末2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	317,271,724.55	-	-	-	317,271,724.55
结算备付金	895,936.11	-	-	-	895,936.11
存出保证金	140,741.00	-	-	1,198,071.51	1,338,812.51
交易性金融资产	264,814,000.00	-	-	8,558,789,953.24	8,823,603,953.24
应收利息	-	-	-	5,277,095.37	5,277,095.37
应收申购款	-	-	-	645,998.84	645,998.84
资产总计	583,122,401.66	-	-	8,565,911,118.96	9,149,033,520.62

负债					
应付赎回款	-	-	-	941,066.04	941,066.04
应付管理人报酬	-	-	-	7,846,968.69	7,846,968.69
应付托管费	-	-	-	1,601,422.14	1,601,422.14
应付交易费用	-	-	-	477,772.89	477,772.89
其他负债	-	-	-	1,081,409.20	1,081,409.20
负债总计	-	-	-	11,948,638.96	11,948,638.96
利率敏感度缺口	583,122,401.66	-	-	8,553,962,480.00	9,137,084,881.66

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.07%(2011年12月31日:2.90%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011年12月31日：同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产总值的95%以内。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	8,840,772,524.83	94.70	8,558,789,953.24	93.67
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,840,772,524.83	94.70	8,558,789,953.24	93.67

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	沪深300指数下降5%	减少约45,599	减少约42,858
	沪深300指数上升5%	增加约45,599	增加约42,858

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。本基金持有属于第一层级的金融工具主要包括存在活跃市场的股票(包括网下申购处于限售期的股票)、交易所市场债券等，于2012年6月30日的余额为8,840,772,524.83元(2011年12月31日：8,524,596,687.07元)。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。本基金持有属于第二层级的金融工具主要包括参与非公开发行取得并在锁定期内的股票、因重大事项停牌的股票、银行间市场债券等，于2012年6月30日的余额为100,180,000.00元(2011年12月31日：299,007,266.17元)。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观

察输入值)。于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有属于第三层级的以公允价值计量的金融工具 (2010 年 12 月 31 日：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,840,772,524.83	94.42
	其中：股票	8,840,772,524.83	94.42
2	固定收益投资	100,180,000.00	1.07
	其中：债券	100,180,000.00	1.07
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	401,256,835.00	4.29
6	其他各项资产	20,564,282.22	0.22
7	合计	9,362,773,642.05	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	54,817,484.14	0.59
B	采掘业	918,533,220.92	9.84
C	制造业	3,121,460,498.42	33.43
C0	食品、饮料	674,589,379.96	7.23
C1	纺织、服装、皮毛	30,332,753.19	0.32
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	177,155,525.71	1.90
C5	电子	106,352,865.17	1.14
C6	金属、非金属	713,333,643.68	7.64
C7	机械、设备、仪表	976,085,243.72	10.46
C8	医药、生物制品	441,626,258.73	4.73
C99	其他制造业	1,984,828.26	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	209,255,579.81	2.24
E	建筑业	257,298,276.58	2.76
F	交通运输、仓储业	229,184,948.91	2.45

G	信息技术业	256,151,902.66	2.74
H	批发和零售贸易	236,891,482.04	2.54
I	金融、保险业	2,789,818,122.49	29.88
J	房地产业	520,869,139.52	5.58
K	社会服务业	73,466,059.16	0.79
L	传播与文化产业	21,850,171.37	0.23
M	综合类	151,175,638.81	1.62
	合计	8,840,772,524.83	94.70

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	6,986,945	319,582,864.30	3.42
2	600036	招商银行	24,240,000	264,700,800.00	2.84
3	600016	民生银行	40,891,690	244,941,223.10	2.62
4	600519	贵州茅台	796,287	190,432,036.05	2.04
5	601328	交通银行	41,738,904	189,494,624.16	2.03
6	601166	兴业银行	13,744,449	178,402,948.02	1.91
7	600000	浦发银行	21,851,711	177,654,410.43	1.90
8	600837	海通证券	18,012,105	173,456,571.15	1.86
9	000002	万科A	18,314,678	163,183,780.98	1.75
10	600030	中信证券	12,702,492	160,432,473.96	1.72
11	601088	中国神华	6,006,909	135,035,314.32	1.45
12	601601	中国太保	6,075,703	134,759,092.54	1.44
13	000858	五粮液	3,510,000	114,987,600.00	1.23
14	600111	包钢稀土	2,695,285	106,355,946.10	1.14
15	601288	农业银行	39,257,437	101,676,761.83	1.09
16	600048	保利地产	8,569,478	97,177,880.52	1.04
17	601398	工商银行	24,115,437	95,255,976.15	1.02
18	601668	中国建筑	27,166,699	90,736,774.66	0.97
19	000157	中联重科	8,434,018	84,593,200.54	0.91
20	000651	格力电器	3,892,836	81,165,630.60	0.87
21	002304	洋河股份	592,981	79,785,593.55	0.85
22	601169	北京银行	8,073,363	78,876,756.51	0.84
23	600031	三一重工	5,646,512	78,599,447.04	0.84
24	000001	深发展A	4,756,441	72,107,645.56	0.77
25	601006	大秦铁路	9,409,128	66,146,169.84	0.71
26	600256	广汇能源	4,752,776	64,019,892.72	0.69
27	002024	苏宁电器	7,628,431	64,002,536.09	0.69
28	600900	长江电力	9,114,447	61,978,239.60	0.66
29	600887	伊利股份	2,993,726	61,610,881.08	0.66
30	600050	中国联通	15,640,000	58,180,800.00	0.62
31	600015	华夏银行	6,134,235	58,091,205.45	0.62
32	601628	中国人寿	3,108,128	56,878,742.40	0.61

33	601899	紫金矿业	14,550,175	56,454,679.00	0.60
34	000776	广发证券	1,878,266	56,028,674.78	0.60
35	000568	泸州老窖	1,303,589	55,154,850.59	0.59
36	600104	上汽集团	3,817,367	54,550,174.43	0.58
37	600585	海螺水泥	3,503,257	51,918,268.74	0.56
38	600383	金地集团	7,951,421	51,525,208.08	0.55
39	601857	中国石油	5,600,000	50,680,000.00	0.54
40	601818	光大银行	17,202,409	48,854,841.56	0.52
41	600028	中国石化	7,616,277	47,982,545.10	0.51
42	000063	中兴通讯	3,349,249	46,755,516.04	0.50
43	000983	西山煤电	2,895,500	45,169,800.00	0.48
44	600739	辽宁成大	2,875,137	44,852,137.20	0.48
45	600518	康美药业	2,857,945	44,069,511.90	0.47
46	600547	山东黄金	1,331,221	43,717,297.64	0.47
47	000338	潍柴动力	1,449,109	43,024,046.21	0.46
48	601989	中国重工	8,241,757	42,774,718.83	0.46
49	000069	华侨城A	6,562,430	41,868,303.40	0.45
50	000423	东阿阿胶	1,045,488	41,829,974.88	0.45
51	600019	宝钢股份	9,551,290	41,261,572.80	0.44
52	000527	美的电器	3,661,478	40,459,331.90	0.43
53	600489	中金黄金	1,872,148	40,288,624.96	0.43
54	000024	招商地产	1,624,638	39,852,370.14	0.43
55	000792	盐湖股份	1,173,284	39,621,800.68	0.42
56	601788	光大证券	2,917,866	38,428,295.22	0.41
57	601688	华泰证券	3,541,424	37,184,952.00	0.40
58	600690	青岛海尔	3,101,306	36,347,306.32	0.39
59	600362	江西铜业	1,518,138	36,298,679.58	0.39
60	600276	恒瑞医药	1,225,676	35,189,157.96	0.38
61	600348	阳泉煤业	2,292,167	35,070,155.10	0.38
62	000895	双汇发展	558,517	34,561,031.96	0.37
63	600089	特变电工	5,000,000	33,850,000.00	0.36
64	600123	兰花科创	1,874,110	33,846,426.60	0.36
65	601988	中国银行	11,999,942	33,839,836.44	0.36
66	601699	潞安环能	1,625,933	33,721,850.42	0.36
67	000538	云南白药	554,404	32,865,069.12	0.35
68	601600	中国铝业	5,309,194	32,757,726.98	0.35
69	600795	国电电力	12,098,828	32,666,835.60	0.35
70	601009	南京银行	3,823,266	32,574,226.32	0.35
71	600406	国电南瑞	1,727,220	32,281,741.80	0.35
72	000783	长江证券	3,536,537	32,182,486.70	0.34
73	000629	攀钢钒钛	4,867,901	32,030,788.58	0.34
74	601299	中国北车	7,783,909	31,213,475.09	0.33
75	601377	兴业证券	2,906,967	30,465,014.16	0.33
76	601168	西部矿业	3,424,757	29,315,919.92	0.31

77	600309	烟台万华	2,172,260	28,999,671.00	0.31
78	601766	中国南车	6,340,987	28,914,900.72	0.31
79	000402	金融街	4,415,813	28,835,258.89	0.31
80	600642	申能股份	5,807,032	26,770,417.52	0.29
81	601898	中煤能源	3,435,700	26,592,318.00	0.28
82	000623	吉林敖东	1,516,102	26,289,208.68	0.28
83	600068	葛洲坝	3,994,902	26,086,710.06	0.28
84	000630	铜陵有色	1,345,156	25,961,510.80	0.28
85	601186	中国铁建	5,754,630	25,608,103.50	0.27
86	600066	宇通客车	1,132,950	25,446,057.00	0.27
87	600010	包钢股份	5,133,818	25,053,031.84	0.27
88	600600	青岛啤酒	654,944	25,012,311.36	0.27
89	000425	徐工机械	1,724,422	24,728,211.48	0.26
90	000728	国元证券	2,243,741	24,479,214.31	0.26
91	601390	中国中铁	9,512,583	24,447,338.31	0.26
92	002142	宁波银行	2,441,476	24,365,930.48	0.26
93	600100	同方股份	2,845,930	23,962,730.60	0.26
94	600150	中国船舶	1,040,497	23,900,216.09	0.26
95	000709	河北钢铁	8,687,371	23,716,522.83	0.25
96	601958	金钼股份	1,834,321	23,240,847.07	0.25
97	600009	上海机场	1,813,489	23,103,849.86	0.25
98	600535	天士力	526,204	23,005,638.88	0.25
99	000878	云南铜业	1,278,063	22,877,327.70	0.25
100	601618	中国中冶	9,205,640	22,829,987.20	0.24
101	600369	西南证券	2,016,724	22,809,148.44	0.24
102	000060	中金岭南	2,637,674	22,736,749.88	0.24
103	600196	复星医药	2,188,817	22,566,703.27	0.24
104	601666	平煤股份	2,218,162	22,447,799.44	0.24
105	600549	厦门钨业	505,115	22,179,599.65	0.24
106	600085	同仁堂	1,269,243	22,148,290.35	0.24
107	600741	华域汽车	2,435,242	21,844,120.74	0.23
108	600005	武钢股份	8,117,646	21,836,467.74	0.23
109	000012	南玻A	2,386,784	21,481,056.00	0.23
110	600177	雅戈尔	2,525,530	21,441,749.70	0.23
111	600415	小商品城	2,743,454	21,398,941.20	0.23
112	600881	亚泰集团	3,863,000	21,246,500.00	0.23
113	601991	大唐发电	3,756,070	21,146,674.10	0.23
114	000100	TCL集团	10,325,660	20,961,089.80	0.22
115	600660	福耀玻璃	2,661,850	20,815,667.00	0.22
116	600188	兖州煤业	1,096,478	20,811,152.44	0.22
117	000800	一汽轿车	1,908,146	20,722,465.56	0.22
118	002415	海康威视	760,874	20,695,772.80	0.22
119	002422	科伦药业	442,534	20,648,636.44	0.22
120	000009	中国宝安	2,059,805	20,598,050.00	0.22



121	000528	柳工	1,655,409	20,543,625.69	0.22
122	601998	中信银行	5,041,964	20,167,856.00	0.22
123	601919	中国远洋	4,340,174	20,138,407.36	0.22
124	601111	中国国航	3,264,900	20,079,135.00	0.22
125	600153	建发股份	2,795,534	20,016,023.44	0.21
126	600875	东方电气	1,116,676	20,010,833.92	0.21
127	600115	东方航空	4,747,983	19,846,568.94	0.21
128	000937	冀中能源	1,296,552	19,798,349.04	0.21
129	600271	航天信息	1,001,139	18,931,538.49	0.20
130	000039	中集集团	1,419,000	18,872,700.00	0.20
131	600809	山西汾酒	496,948	18,729,970.12	0.20
132	002155	辰州矿业	966,641	18,714,169.76	0.20
133	002202	金风科技	2,915,089	18,685,720.49	0.20
134	000562	宏源证券	1,120,973	18,540,893.42	0.20
135	600694	大商股份	551,269	18,439,948.05	0.20
136	601808	中海油服	1,115,441	18,415,930.91	0.20
137	600029	南方航空	3,994,400	18,414,184.00	0.20
138	000625	长安汽车	3,771,503	18,404,934.64	0.20
139	600395	盘江股份	675,244	18,150,558.72	0.19
140	000768	西飞国际	2,294,547	18,012,193.95	0.19
141	600497	驰宏锌锗	1,279,892	18,008,080.44	0.19
142	600058	五矿发展	799,805	17,859,645.65	0.19
143	000869	张裕A	263,536	17,725,431.36	0.19
144	600655	豫园商城	2,231,226	17,582,060.88	0.19
145	000960	锡业股份	891,381	17,560,205.70	0.19
146	600376	首开股份	1,300,932	17,224,339.68	0.18
147	600252	中恒集团	1,570,501	17,212,690.96	0.18
148	600832	东方明珠	3,202,721	17,198,611.77	0.18
149	600166	福田汽车	2,399,852	17,158,941.80	0.18
150	000581	威孚高科	625,550	17,140,070.00	0.18
151	000758	中色股份	887,940	16,844,221.80	0.18
152	000933	神火股份	1,840,967	16,789,619.04	0.18
153	600011	华能国际	2,599,999	16,769,993.55	0.18
154	600779	水井坊	689,590	16,736,349.30	0.18
155	000401	冀东水泥	1,187,471	16,695,842.26	0.18
156	600583	海油工程	2,709,527	16,501,019.43	0.18
157	601117	中国化学	2,857,148	16,485,743.96	0.18
158	600143	金发科技	2,733,376	16,318,254.72	0.17
159	000999	华润三九	739,692	16,162,270.20	0.17
160	000422	湖北宜化	1,316,258	16,124,160.50	0.17
161	601607	上海医药	1,429,548	15,253,277.16	0.16
162	002106	莱宝高科	759,042	15,233,972.94	0.16
163	000729	燕京啤酒	2,079,706	15,181,853.80	0.16
164	600649	城投控股	2,098,441	15,150,744.02	0.16

165	600588	用友软件	985,697	15,041,736.22	0.16
166	601888	中国国旅	531,190	14,990,181.80	0.16
167	601106	中国一重	4,719,356	14,913,164.96	0.16
168	600259	广晟有色	224,316	14,789,153.88	0.16
169	000825	太钢不锈	4,189,184	14,787,819.52	0.16
170	600216	浙江医药	586,296	14,745,344.40	0.16
171	600267	海正药业	843,336	14,741,513.28	0.16
172	002001	新和成	697,511	14,738,407.43	0.16
173	002038	双鹭药业	454,498	14,634,835.60	0.16
174	600811	东方集团	2,653,792	14,542,780.16	0.16
175	600320	振华重工	3,432,169	14,483,753.18	0.16
176	600062	华润双鹤	749,800	14,306,184.00	0.15
177	600219	南山铝业	2,105,098	14,104,156.60	0.15
178	000898	鞍钢股份	3,611,605	14,085,259.50	0.15
179	600372	中航电子	772,955	13,905,460.45	0.15
180	600703	三安光电	1,018,857	13,866,643.77	0.15
181	600839	四川长虹	6,548,602	13,817,550.22	0.15
182	600208	新湖中宝	3,321,657	13,718,443.41	0.15
183	600664	哈药股份	2,079,835	13,706,112.65	0.15
184	600315	上海家化	349,644	13,639,612.44	0.15
185	600546	山煤国际	649,878	13,595,447.76	0.15
186	601001	大同煤业	1,223,046	13,392,353.70	0.14
187	600893	航空动力	1,028,113	13,375,750.13	0.14
188	002007	华兰生物	543,457	13,358,173.06	0.14
189	002385	大北农	685,836	13,305,218.40	0.14
190	600108	亚盛集团	2,687,083	13,247,319.19	0.14
191	600863	内蒙华电	1,675,115	13,233,408.50	0.14
192	600718	东软集团	1,535,038	13,216,677.18	0.14
193	600859	王府井	477,367	13,060,761.12	0.14
194	601336	新华保险	379,969	13,010,138.56	0.14
195	600804	鹏博士	2,182,905	12,966,455.70	0.14
196	600109	国金证券	887,734	12,774,492.26	0.14
197	002310	东方园林	217,543	12,771,949.53	0.14
198	600266	北京城建	840,216	12,762,881.04	0.14
199	601918	国投新集	1,045,033	12,759,852.93	0.14
200	002241	歌尔声学	339,919	12,403,644.31	0.13
201	600125	铁龙物流	1,442,173	12,229,627.04	0.13
202	601179	中国西电	3,025,909	12,043,117.82	0.13
203	600997	开滦股份	1,138,599	11,921,131.53	0.13
204	601717	郑煤机	1,023,910	11,877,356.00	0.13
205	000876	新希望	791,151	11,851,441.98	0.13
206	600221	海南航空	2,426,164	11,839,680.32	0.13
207	600895	张江高科	1,378,156	11,810,796.92	0.13
208	600352	浙江龙盛	2,040,729	11,693,377.17	0.13

209	601101	昊华能源	682,084	11,677,278.08	0.13
210	000778	新兴铸管	1,735,548	11,610,816.12	0.12
211	000839	中信国安	1,698,815	11,416,036.80	0.12
212	000969	安泰科技	924,505	11,306,696.15	0.12
213	601866	中海集运	4,442,851	11,240,413.03	0.12
214	600598	北大荒	1,497,291	11,154,817.95	0.12
215	600812	华北制药	1,747,599	11,114,729.64	0.12
216	601333	广深铁路	3,738,905	10,992,380.70	0.12
217	000718	苏宁环球	1,351,004	10,943,132.40	0.12
218	002069	獐子岛	521,230	10,867,645.50	0.12
219	000061	农产品	1,864,164	10,812,151.20	0.12
220	002146	荣盛发展	979,900	10,680,910.00	0.11
221	002500	山西证券	1,301,358	10,658,122.02	0.11
222	600516	方大炭素	1,243,599	10,620,335.46	0.11
223	002299	圣农发展	735,300	10,617,732.00	0.11
224	000807	云铝股份	1,800,482	10,604,838.98	0.11
225	600508	上海能源	584,633	10,599,396.29	0.11
226	600550	天威保变	1,206,335	10,531,304.55	0.11
227	000686	东北证券	613,569	10,516,572.66	0.11
228	600331	宏达股份	1,306,963	10,507,982.52	0.11
229	600970	中材国际	904,966	10,443,307.64	0.11
230	600118	中国卫星	820,864	10,334,677.76	0.11
231	002128	露天煤业	771,464	10,090,749.12	0.11
232	601669	中国水电	2,299,954	10,050,798.98	0.11
233	000680	山推股份	1,701,450	9,953,482.50	0.11
234	600160	巨化股份	985,184	9,950,358.40	0.11
235	600037	歌华有线	1,293,533	9,740,303.49	0.10
236	600498	烽火通信	365,881	9,699,505.31	0.10
237	002353	杰瑞股份	199,880	9,694,180.00	0.10
238	000046	泛海建设	2,150,000	9,610,500.00	0.10
239	600169	太原重工	2,677,756	9,398,923.56	0.10
240	002073	软控股份	1,089,109	9,126,733.42	0.10
241	600500	中化国际	1,349,191	9,120,531.16	0.10
242	000780	平庄能源	867,500	9,091,400.00	0.10
243	002092	中泰化学	1,177,781	9,010,024.65	0.10
244	601118	海南橡胶	1,299,850	8,929,969.50	0.10
245	000059	辽通化工	1,123,880	8,889,890.80	0.10
246	600432	吉恩镍业	666,431	8,850,203.68	0.09
247	600170	上海建工	1,225,030	8,844,716.60	0.09
248	600528	中铁二局	1,299,585	8,785,194.60	0.09
249	600456	宝钛股份	452,181	8,487,437.37	0.09
250	601018	宁波港	3,349,269	8,473,650.57	0.09
251	600674	川投能源	1,217,407	8,424,456.44	0.09
252	600418	江淮汽车	1,550,892	8,390,325.72	0.09

253	000961	中南建设	635,070	7,912,972.20	0.08
254	600096	云天化	596,414	7,908,449.64	0.08
255	600183	生益科技	1,523,559	7,846,328.85	0.08
256	000968	煤气化	505,865	7,714,441.25	0.08
257	600595	中孚实业	1,371,166	7,651,106.28	0.08
258	002431	棕榈园林	296,270	7,640,803.30	0.08
259	601992	金隅股份	1,125,375	7,483,743.75	0.08
260	000559	万向钱潮	1,472,366	7,406,000.98	0.08
261	601098	中南传媒	770,386	7,380,297.88	0.08
262	600316	洪都航空	562,801	7,333,297.03	0.08
263	000021	长城开发	1,316,317	7,081,785.46	0.08
264	600873	梅花集团	981,577	6,625,644.75	0.07
265	601901	方正证券	1,300,000	6,604,000.00	0.07
266	300146	汤臣倍健	97,078	6,520,729.26	0.07
267	601099	太平洋	939,980	6,485,862.00	0.07
268	601158	重庆水务	1,079,722	6,359,562.58	0.07
269	002493	荣盛石化	408,046	6,255,345.18	0.07
270	601633	长城汽车	349,921	6,228,593.80	0.07
271	601727	上海电气	1,353,675	6,172,758.00	0.07
272	600770	综艺股份	536,504	6,159,065.92	0.07
273	600635	大众公用	1,318,011	6,141,931.26	0.07
274	600827	友谊股份	519,969	5,880,849.39	0.06
275	002122	天马股份	909,174	5,873,264.04	0.06
276	002344	海宁皮城	220,642	5,754,343.36	0.06
277	600971	恒源煤电	402,811	5,611,157.23	0.06
278	601718	际华集团	1,744,361	5,512,180.76	0.06
279	601933	永辉超市	196,290	5,319,459.00	0.06
280	600307	酒钢宏兴	1,529,439	5,307,153.33	0.06
281	601566	九牧王	189,933	5,289,634.05	0.06
282	600808	马钢股份	2,412,236	5,162,185.04	0.06
283	601369	陕鼓动力	543,696	5,034,624.96	0.05
284	000703	恒逸石化	299,735	4,984,593.05	0.05
285	600783	鲁信创投	309,227	4,935,262.92	0.05
286	002378	章源钨业	153,158	4,848,982.28	0.05
287	600582	天地科技	334,205	4,829,262.25	0.05
288	601928	凤凰传媒	549,950	4,729,570.00	0.05
289	601258	庞大集团	687,055	4,191,035.50	0.04
290	600428	中远航运	989,460	4,027,102.20	0.04
291	600481	双良节能	557,830	3,994,062.80	0.04
292	600008	首创股份	748,655	3,660,922.95	0.04
293	601233	桐昆股份	412,056	3,601,369.44	0.04
294	002399	海普瑞	167,548	3,552,017.60	0.04
295	601555	东吴证券	399,940	3,535,469.60	0.04
296	002603	以岭药业	127,483	3,512,156.65	0.04

297	601558	华锐风电	499,714	3,502,995.14	0.04
298	600098	广州控股	491,871	3,403,747.32	0.04
299	300182	捷成股份	139,867	3,286,874.50	0.04
300	600151	航天机电	500,000	3,235,000.00	0.03
301	002570	贝因美	160,000	3,224,000.00	0.03
302	600737	中粮屯河	527,590	3,144,436.40	0.03
303	600161	天坛生物	210,262	3,000,438.74	0.03
304	601216	内蒙君正	412,144	2,872,643.68	0.03
305	000027	深圳能源	432,489	2,798,203.83	0.03
306	601268	二重重装	444,141	2,722,584.33	0.03
307	002405	四维图新	223,697	2,670,942.18	0.03
308	600026	中海发展	525,501	2,653,780.05	0.03
309	600022	山东钢铁	1,000,000	2,570,000.00	0.03
310	600380	健康元	447,568	2,188,607.52	0.02
311	002594	比亚迪	99,941	1,984,828.26	0.02
312	002089	新海宜	235,578	1,740,921.42	0.02
313	002498	汉缆股份	160,576	1,706,922.88	0.02
314	000725	京东方A	799,928	1,527,862.48	0.02
315	002244	滨江集团	147,138	1,334,541.66	0.01
316	002081	金螳螂	29,990	1,139,620.00	0.01
317	002037	久联发展	39,263	887,343.80	0.01
318	002424	贵州百灵	47,116	787,308.36	0.01
319	600611	大众交通	23,250	121,830.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 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	601318	中国平安	72,472,636.51	0.79
2	600837	海通证券	39,891,899.09	0.44
3	601601	中国太保	38,122,076.53	0.42
4	601328	交通银行	36,294,926.01	0.40
5	601288	农业银行	33,813,322.07	0.37
6	600000	浦发银行	27,782,000.00	0.30
7	601818	光大银行	20,178,870.25	0.22
8	600585	海螺水泥	19,986,614.11	0.22
9	000629	攀钢钒钛	19,912,293.48	0.22
10	601398	工商银行	19,682,271.89	0.22
11	601377	兴业证券	19,573,456.17	0.21
12	000002	万科A	19,075,377.04	0.21
13	000581	威孚高科	18,890,338.87	0.21
14	000069	华侨城A	18,176,690.38	0.20
15	600011	华能国际	16,101,062.75	0.18
16	600309	烟台万华	14,500,227.71	0.16

17	601991	大唐发电	13,721,771.92	0.15
18	600315	上海家化	13,573,374.30	0.15
19	600123	兰花科创	12,820,863.20	0.14
20	600048	保利地产	12,785,422.35	0.14

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	601398	工商银行	69,718,612.67	0.76
2	601328	交通银行	63,640,999.51	0.70
3	601318	中国平安	57,893,829.69	0.63
4	601601	中国太保	38,509,711.49	0.42
5	600000	浦发银行	33,408,958.46	0.37
6	600016	民生银行	30,632,764.59	0.34
7	000002	万科A	28,799,386.19	0.32
8	600837	海通证券	26,977,911.98	0.30
9	600030	中信证券	25,274,479.94	0.28
10	000069	华侨城A	24,576,653.19	0.27
11	600585	海螺水泥	24,573,180.73	0.27
12	601166	兴业银行	20,293,176.26	0.22
13	601006	大秦铁路	18,106,967.14	0.20
14	601288	农业银行	17,277,386.65	0.19
15	600309	烟台万华	16,434,369.10	0.18
16	000001	平安银行	16,204,532.05	0.18
17	000402	金融街	14,607,887.48	0.16
18	600048	保利地产	13,249,417.64	0.15
19	600132	重庆啤酒	12,815,706.28	0.14
20	600015	华夏银行	12,579,700.33	0.14

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	827,414,033.20
卖出股票收入（成交）总额	1,028,885,730.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	100,180,000.00	1.07
	其中：政策性金融债	100,180,000.00	1.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	100,180,000.00	1.07

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110414	11 农发 14	1,000,000	100,180,000.00	1.07

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 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	1,072,313.41
2	应收证券清算款	2,520,615.72
3	应收股利	11,254,303.52
4	应收利息	3,633,791.88
5	应收申购款	2,083,257.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,564,282.22

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.9.6 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

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
712,154	19,212.97	802,576,592.12	5.87%	12,880,013,594.08	94.13%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	4,268,624.29	0.03%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金的区间为：100 万份以上；

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

单位：份

基金合同生效日（2003年8月26日）基金份额总额	5,126,401,391.87
本报告期期初基金份额总额	14,144,724,458.35
本报告期基金总申购份额	485,822,241.50
减：本报告期基金总赎回份额	947,956,513.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,682,590,186.20

## § 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 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，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进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	863,598,434.06	46.80%	738,656.45	47.34%	
国泰君安	4	264,281,740.63	14.32%	224,638.94	14.40%	
瑞银证券	1	253,657,533.81	13.75%	218,906.05	14.03%	新增
中信建投	1	115,076,498.16	6.24%	100,463.04	6.44%	
华泰证券	1	81,162,037.30	4.40%	68,987.12	4.42%	
中金公司	1	72,433,273.42	3.93%	59,905.01	3.84%	新增
东方证券	1	62,206,452.05	3.37%	38,101.55	2.44%	
招商证券	2	42,353,065.56	2.30%	35,894.38	2.30%	
高华证券	1	37,226,179.49	2.02%	30,334.81	1.94%	
渤海证券	1	30,081,396.90	1.63%	25,568.88	1.64%	
中投证券	1	18,741,274.64	1.02%	15,227.36	0.98%	新增
山西证券	1	4,422,415.25	0.24%	3,593.21	0.23%	
长江证券	1					
广发证券	1					
国开证券	1					
海通证券	1					
平安证券	1					
兴业证券	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[2007]48号）的有关规定要求，本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，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，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) 具有较强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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化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择程序如下：

(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) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司网上及手机银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/6/29
2	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加江苏银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/6/29
3	关于开通机构直销网上交易业务和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/6/25
4	博时基金管理有限公司关于博时裕富沪深300指数证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/6/12
5	博时基金管理有限公司关于开通中国银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/6/11
6	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/6/8
7	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加金华银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/6/5
8	博时基金管理有限公司成都分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/5/25
9	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加重庆银行股份有限公司网上银行申购费率与定期	中国证券报、上海证券报、证券	2012/5/22

	定额投资业务费率优惠活动的公告	时报	
10	博时基金管理有限公司关于开通支付宝基金专户直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/5/15
11	关于博时旗下部分开放式基金参加中国光大银行股份有限公司电子渠道基金定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/5/10
12	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国邮政储蓄银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/5/2
13	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/3/30
14	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加江苏银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/3/30
15	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国建设银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/3/12
16	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司电子渠道申购费率与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/1/16
17	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通中国农业银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/1/9
18	博时基金管理有限公司关于直销投资者汇款交易业务规则变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/1/4
19	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行股份有限公司网上银行申购费率和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012/1/4

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012年1月16日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自2012年1月16日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时裕富沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时裕富沪深 300 指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

2012 年 8 月 25 日