

# 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

## 2013 年半年度报告

### 2013 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：2013 年 8 月 29 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 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 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 .....	2
§ 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合规守信情况的说明 .....	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 .....	9
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 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
§ 5 托管人报告 .....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
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 .....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	11
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	13
6.4 报表附注 .....	14
§ 7 投资组合报告 .....	27
7.1 期末基金资产组合情况 .....	27
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 .....	28
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	36
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 .....	36
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 .....	36
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 .....	36
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	36
7.10 投资组合报告附注 .....	36
§ 8 基金份额持有人信息 .....	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
§ 9 开放式基金份额变动 .....	38

§ 10 重大事件揭示 .....	38
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
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 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	38
10.4 基金投资策略的改变 .....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	38
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 .....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	38
10.8 其他重大事件 .....	40
§ 11 备查文件目录 .....	41
11.1 备查文件目录 .....	41
11.2 存放地点 .....	41
11.3 查阅方式 .....	41

## § 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	13,933,219,117.93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	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853
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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-266,453,333.82
本期利润	-1,114,070,811.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0832
本期加权平均净值利润率	-11.88%
本期基金份额净值增长率	-12.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-5,390,293,300.77
期末可供分配基金份额利润	-0.3869
期末基金资产净值	8,542,925,817.16
期末基金份额净值	0.6131
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2013 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	93.88%

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

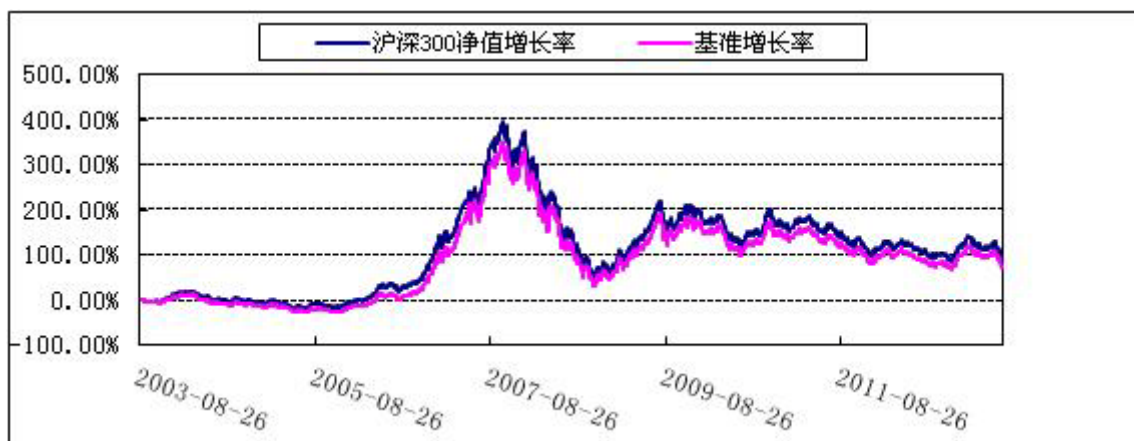
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-14.05%	1.80%	-14.83%	1.77%	0.78%	0.03%

过去三个月	-10.50%	1.39%	-11.21%	1.38%	0.71%	0.01%
过去六个月	-12.33%	1.44%	-12.11%	1.42%	-0.22%	0.02%
过去一年	-10.14%	1.31%	-9.97%	1.30%	-0.17%	0.01%
过去三年	-12.29%	1.31%	-13.11%	1.30%	0.82%	0.01%
自基金成立起至今	93.88%	1.66%	76.09%	1.69%	17.79%	-0.03%

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）有限公司和博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、天津港（集团）有限公司、璟安股权投资有限公司、上海盛业股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广厦建设集团有限责任公司。博时基金公司的经营范围包括基金

募集、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。

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 2013 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金，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 1065.69 亿元人民币，累计分红 602.92 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

- 1) 根据银河证券基金研究中心统计，2013 年上半年，股票型基金中，截至 6 月 28 日，博时医疗保健今年以来净值增长率在 328 只标准型股票基金中排名前 1/3。混合灵活配置型基金方面，博时回报今年以来收益率在 71 只同类基金中排名第 8。
- 2) 固定收益方面，博时信用债纯债基金今年以来收益率在 17 只长期标准债券型基金中排名第 1；博时裕祥分级债券 A 今年以来收益率在 19 只封闭式债券型分级子基金（优先份额）中名列第 2。
- 3) 海外投资方面，博时标普 500 今年以来净值增长率在 15 只 QDII 指数股票型基金中排名第 2，该基金成立以来的涨幅达到 15.94%。

## 2、客户服务

- 1) 2013 年上半年，博时基金共举办各类渠道培训活动逾 841 场，参加人数超过 2 万人。

## 3、其他大事件

- 1) 2013 年 3 月 29 日，由证券时报社主办的 2012 年度中国基金业明星奖颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业基金荣获“2012 年度股票型明星基金奖”。
- 2) 2013 年 3 月 30 日，由中国证券报社主办的第十届中国基金业金牛奖颁奖典礼暨 2013 金牛基金论坛在北京举行。博时基金蝉联“金牛基金管理公司”奖，博时基金价值组投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得“金牛基金十周年特别奖”，博时现金收益荣获“2012 年度货币市场金牛基金”。
- 3) 2013 年 4 月，在股市动态分析杂志主办的“2012 基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜”评选活动中，博时标普 500 指数基金获得“2012 年基金新产品营销策划案



例奖”。

- 4) 2013 年 4 月 10 日，由上海证券报举办的第十届“金基金奖”颁奖典礼在上海举行，博时基金荣获金“基金十年·卓越公司奖”，博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获“金基金十年·投资回报奖”，博时主题行业基金荣获“金基金·股票型基金奖 5 年期奖”，博时裕阳封闭荣获“金基金·分红基金奖 3 年期奖”。
- 5) 2013 年 4 月 27 日，由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的 2013 中国网·普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获 2013 金手指奖评选“年度最佳财富管理基金公司”。
- 6) 2013 年 6 月 26 日，世界品牌实验室(WBL)在京发布 2013 年度（第十届）《中国 500 最具价值品牌》排行榜，博时基金以 81.65 亿的品牌价值位列第 216 名，品牌价值一年内提升了近 20 亿元，排名逐年上升。

#### 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		
胡俊敏	基金经理	2012-11-22	-	6	1996 年起先后在哈佛大学、惠普安捷伦科技、汤姆森金融公司、贝莱德全球金融公司工作，2011 年 2 月加入博时基金管理有限公司，现任博时特许价值基金、博时上证自然资源 ETF 基金及其联接基金、博时沪深 300 指数基金、博时标普 500 指数基金的基金经理。
王红欣	基金经理 /ETF 及量化投资组投资总监	2013-1-9	-	19	1994 年起先后在 RXR 期货管理公司、Aeltus 投资管理公司、Putnam 投资公司、Acadian 资产管理公司、易方达资产管理（香港）有限公司工作。2012 年 10 月加入博时基金管理有限公司，担任股票投资部 ETF 及量化投资组投资总监、博时标普 500 指数型证券投资基金、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金经理。
孟亚强	基金经理助理	2012-4-5	-	4	2009 年 7 月从南开大学保险学专业毕业后加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部数量化研究员、股票投资部特定资产投资经理助理兼任量化研究员。现任股票投资部基金经理助理。
郑宇泉	基金经理助理	2013-1-30	-	6	2007 年起先后在美国 PGAM 对冲基金、盛融（上海）信息技术公司工作。2011 年 4 月加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部量化研究员，特定资产投资经理助理。

					现任股票投资部基金经理助理。
--	--	--	--	--	----------------

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合规守信情况的说明

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，基金投资管理符合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

##### 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

2013 年伊始，在 12 年年底宏观经济数据利好的刺激下，A 股走出了一波小行情。过了二月份，随着新一届政府换届的进行，A 股市场对新政府经济政策还处于探索阶段，在这过程中，国内 PMI 等经济数据不断探底，却迟迟不见新政府对经济政策明显的表态，市场整体情绪低迷。进入四、五月份，美国经济复苏前景逐渐明朗，QE 即将退出的情绪在市场蔓延，随着美联储月度会议的召开，退出时间表逐渐明朗，资本市场的流动性开始紧张。六月底，恰逢国内市场季度末资金紧张，大量银行理财产品到期，央行一反常态，未见流动性放松，严格限制银行理财产品的发行，并着手处理影子银行问题，从严对待。随之债券基金降杠杆，金融杠杆较高的商业银行暴跌，拉动股指创下新低。上半年中小板，创业板指数表现对较好，大消费品板块相对抗跌。在投资策略上我们依靠在各行业内精选个股的量化策略，以多方面的估值和基本面逻辑为主，结合个股短期表现，精选估值水平低，公司盈利持续性好、成长性好的个股，进行沪深 300 指数增强运作。

##### 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 0.6131 元，累计份额净值为 2.5931 元，报

报告期内净值增长率为-12.33%，同期业绩基准涨幅为-12.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为以结构性行情为主，不确定性因素仍然较多，随着美国经济的复苏，全球资本向美国流动的趋势不可避免，随着 QE 政策退出步伐逐渐清晰，大宗商品价格将进一步承压。国内市场建议关注新政府的城镇化政策，和十八届三中全会前后政府对经济政策的表态。从指数看，市场对悲观的经济前景有了充分的预期，不过在预期还未明朗前，市场还是以结构行情为主，多空双方均有机会，看好交运设备，医药，TMT，电力，公用事业板块。

#### 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、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 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。

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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	466,870,352.31	505,084,229.71
结算备付金		9,578,880.33	91,497.20
存出保证金		766,803.79	1,444,659.10
交易性金融资产	6.4.3.2	8,074,607,560.75	8,845,429,727.59
其中：股票投资		8,074,607,560.75	8,845,429,727.59
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		10,351,465.91	55,935,860.21

应收利息	6.4.3.5	112,877.99	111,895.92
应收股利		20,971,955.89	-
应收申购款		3,182,547.93	1,924,599.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		<b>8,586,442,444.90</b>	<b>9,410,022,469.66</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 2012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		26,609,724.15	36,405,745.28
应付赎回款		1,747,606.61	3,923,545.17
应付管理人报酬		7,142,544.74	7,155,835.25
应付托管费		1,457,662.19	1,460,374.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	5,843,910.09	4,175,287.80
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	715,179.96	986,629.76
负债合计		43,516,627.74	54,107,417.78
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.3.9	13,933,219,117.93	13,379,231,495.22
未分配利润	6.4.3.10	-5,390,293,300.77	-4,023,316,443.34
所有者权益合计		8,542,925,817.16	9,355,915,051.88
负债和所有者权益总计		<b>8,586,442,444.90</b>	<b>9,410,022,469.66</b>

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6131 元，基金份额总额 13,933,219,117.93 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至 2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>-1,040,945,669.94</b>	<b>592,325,550.04</b>
1. 利息收入		1,965,356.20	4,800,684.84
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,958,647.97	1,090,466.30
债券利息收入		6,708.23	3,710,218.54

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）		-196,132,167.49	-167,575,772.14
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-304,432,340.65	-271,566,596.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	1,657,183.77	1,227,841.99
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	106,642,989.39	102,762,981.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-847,617,477.45	754,524,414.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	838,618.80	576,222.92
<b>减：二、费用</b>		<b>73,125,141.33</b>	<b>60,421,002.34</b>
1. 管理人报酬		45,705,012.58	47,545,239.23
2. 托管费		9,327,553.53	9,703,110.13
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	17,860,938.45	2,944,049.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.19	231,636.77	228,603.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,114,070,811.27</b>	<b>531,904,547.70</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,114,070,811.27</b>	<b>531,904,547.70</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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	13,379,231,495.22	-4,023,316,443.34	9,355,915,051.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,114,070,811.27	-1,114,070,811.27
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）	553,987,622.71	-252,906,046.16	301,081,576.55
其中：1. 基金申购款	2,027,512,108.90	-670,213,942.04	1,357,298,166.86
2. 基金赎回款	-1,473,524,486.19	417,307,895.88	-1,056,216,590.31
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）	13,933,219,117.93	-5,390,293,300.77	8,542,925,817.16
项目	上年度可比期间 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

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：吴姚东    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》、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》及其他相关税务法规和实务操作，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营业税和企业所得税。

(3) 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。2013 年 1 月 1 日以前，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

(4) 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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	466,870,352.31
定期存款	-
其他存款	-
合计	466,870,352.31

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,334,504,173.22	8,074,607,560.75	-1,259,896,612.47
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,334,504,173.22	8,074,607,560.75	-1,259,896,612.47

#### 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

无余额。



#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	108,222.39
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	4,310.50
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	345.10
合计	112,877.99

#### 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 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,843,910.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,843,910.09

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,931.99
预提费用	213,230.67
其他	17.30
合计	715,179.96

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,379,231,495.22	13,379,231,495.22
本期申购	2,027,512,108.90	2,027,512,108.90
本期赎回（以“-”号填列）	-1,473,524,486.19	-1,473,524,486.19
本期末	13,933,219,117.93	13,933,219,117.93

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	-1,899,311,360.27	-2,124,005,083.07	-4,023,316,443.34
本期利润	-266,453,333.82	-847,617,477.45	-1,114,070,811.27
本期基金份额交易产生的变动数	-91,243,218.26	-161,662,827.90	-252,906,046.16
其中：基金申购款	-312,046,790.06	-358,167,151.98	-670,213,942.04
基金赎回款	220,803,571.80	196,504,324.08	417,307,895.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,257,007,912.35	-3,133,285,388.42	-5,390,293,300.77

**6.4.3.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	1,852,118.02
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	97,308.43
其他	9,221.52
合计	1,958,647.97

**6.4.3.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	6,014,738,502.39
减：卖出股票成本总额	6,319,170,843.04
买卖股票差价收入	-304,432,340.65

**6.4.3.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	35,670,892.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	34,007,000.00
减：应收利息总额	6,708.23
债券投资收益	1,657,183.77

**6.4.3.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**6.4.3.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	106,642,989.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	106,642,989.39

#### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-847,617,477.45
——股票投资	-847,617,477.45
——债券投资	-
——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	-847,617,477.45

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	547,494.57
配股手续费返还	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
转换费收入	291,124.23
配债手续费返还	-
其他	-
合计	838,618.80

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 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	17,860,938.45
银行间市场交易费用	-
合计	17,860,938.45

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	9,406.10
银行间帐户服务费	9,000.00
合计	231,636.77

#### 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	2,095,920,926.03	16.93%	42,353,065.56	2.30%

##### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2013年1月1日至2013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	1,853,408.25	17.90%	1,158,927.91	19.83%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	45,705,012.58	47,545,239.23
其中：支付销售机构的客户维护费	3,987,874.91	4,181,999.41

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
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,327,553.53	9,703,110.13

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

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

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2013年1月1日至2013年6月30日		2012年1月1日至2012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	466,870,352.31	1,852,118.02	398,645,836.21	1,081,495.23

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 2013年1月1日至2013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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2013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
600436	片仔癀	2013-06-21	配股停牌	136.82	2013-07-01	118.73	93,382	11,188,547.12	12,776,525.24	-
600547	山东黄金	2013-04-03	公告重大事项	32.13	2013-07-01	28.77	999,490	31,362,888.52	32,113,613.70	-
000683	远兴能源	2013-04-08	公告重大事项	4.80	2013-07-18	5.09	2,326,794	11,157,027.89	11,168,611.20	-
000999	华润三九	2013-06-03	公告重大事项	26.55	2013-08-19	26.51	1,330,203	33,938,735.34	35,316,889.65	-

注：本基金截至 2013 年 6 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。

#### 6.4.8.3 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和债券投资等。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董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理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，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，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；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2012 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、组合在短期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公司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。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金所承担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。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	466,870,352.31	-	-	-	466,870,352.31
结算备付金	9,578,880.33	-	-	-	9,578,880.33
存出保证金	766,803.79	-	-	-	766,803.79
交易性金融资产	-	-	-	8,074,607,560.75	8,074,607,560.75
应收证券清算款	-	-	-	10,351,465.91	10,351,465.91
应收利息	-	-	-	112,877.99	112,877.99
应收股利	-	-	-	20,971,955.89	20,971,955.89
应收申购款	-	-	-	3,182,547.93	3,182,547.93
<b>资产总计</b>	<b>477,216,036.43</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,109,226,408.47</b>	<b>8,586,442,444.90</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	26,609,724.15	26,609,724.15
应付赎回款	-	-	-	1,747,606.61	1,747,606.61
应付管理人报酬	-	-	-	7,142,544.74	7,142,544.74
应付托管费	-	-	-	1,457,662.19	1,457,662.19
应付交易费用	-	-	-	5,843,910.09	5,843,910.09
其他负债	-	-	-	715,179.96	715,179.96
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>43,516,627.74</b>	<b>43,516,627.74</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>477,216,036.43</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,065,709,780.73</b>	<b>8,542,925,817.16</b>

上年度末 2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	505,084,229.71	-	-	-	505,084,229.71
结算备付金	91,497.20	-	-	-	91,497.20
存出保证金	-	-	-	1,444,659.10	1,444,659.10
交易性金融资产	-	-	-	8,845,429,727.59	8,845,429,727.59
应收证券清算款	-	-	-	55,935,860.21	55,935,860.21
应收利息	-	-	-	111,895.92	111,895.92
应收申购款	-	-	-	1,924,599.93	1,924,599.93
<b>资产总计</b>	<b>505,175,726.91</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,904,846,742.75</b>	<b>9,410,022,469.66</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	36,405,745.28	36,405,745.28
应付赎回款	-	-	-	3,923,545.17	3,923,545.17
应付管理人报酬	-	-	-	7,155,835.25	7,155,835.25
应付托管费	-	-	-	1,460,374.52	1,460,374.52
应付交易费用	-	-	-	4,175,287.80	4,175,287.80
其他负债	-	-	-	986,629.76	986,629.76
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>54,107,417.78</b>	<b>54,107,417.78</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>505,175,726.91</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,850,739,324.97</b>	<b>9,355,915,051.88</b>

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 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2012 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012 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，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	8,074,607,560.75	94.52	8,845,429,727.59	94.54
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,074,607,560.75	94.52	8,845,429,727.59	94.54

#### 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 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	沪深300指数下降5%	减少约40,838	减少约44,549
	沪深300指数上升5%	增加约40,838	增加约44,549

#### 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

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

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。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)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。

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)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 8,039,290,671.10 元，属于第二层级的余额为 35,316,889.65 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 8,609,195,689.67 元，第二层级 236,234,037.92 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012 年 12 月 31 日：同)。本基金本期无第三层次公允价值变动(2012 年度：本基金本期净转入/(转出)第三层级金额为零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元，涉及河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票)。

(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	8,074,607,560.75	94.04
	其中：股票	8,074,607,560.75	94.04
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	476,449,232.64	5.55
6	其他各项资产	35,385,651.51	0.41
7	合计	8,586,442,444.90	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	23,515,557.30	0.28
B	采矿业	631,169,970.28	7.39
C	制造业	2,785,492,340.44	32.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	295,505,792.78	3.46
E	建筑业	395,738,368.93	4.63
F	批发和零售业	294,142,056.56	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	162,432,014.04	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	119,835,850.98	1.40
J	金融业	2,719,854,335.50	31.84
K	房地产业	473,351,089.15	5.54
L	租赁和商务服务业	20,294,901.01	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	71,574,053.87	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	30,636,553.99	0.36
S	综合	51,064,675.92	0.60
	合计	8,074,607,560.75	94.52

## 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	600016	民生银行	37,608,865	322,307,973.05	3.77
2	600036	招商银行	24,240,000	281,184,000.00	3.29
3	601166	兴业银行	17,931,546	264,848,934.42	3.10
4	601318	中国平安	5,839,714	202,988,458.64	2.38
5	601088	中国神华	9,942,270	168,422,053.80	1.97
6	600519	贵州茅台	842,012	161,977,848.44	1.90
7	000002	万科A	16,350,462	161,052,050.70	1.89
8	600000	浦发银行	19,201,001	158,984,288.28	1.86
9	600837	海通证券	15,215,146	142,718,069.48	1.67
10	600030	中信证券	13,255,983	134,283,107.79	1.57

11	601328	交通银行	29,242,975	119,018,908.25	1.39
12	000651	格力电器	4,605,161	115,405,334.66	1.35
13	601668	中国建筑	34,720,021	113,534,468.67	1.33
14	601601	中国太保	7,029,328	111,977,195.04	1.31
15	601398	工商银行	25,687,684	103,264,489.68	1.21
16	600015	华夏银行	11,256,533	101,533,927.66	1.19
17	601169	北京银行	12,612,747	100,523,593.59	1.18
18	601288	农业银行	39,133,093	96,267,408.78	1.13
19	000858	五粮液	4,321,597	86,604,803.88	1.01
20	600348	阳泉煤业	9,513,889	86,005,556.56	1.01
21	600028	中国石化	20,318,808	84,932,617.44	0.99
22	600104	上汽集团	6,128,397	80,956,124.37	0.95
23	601186	中国铁建	18,785,426	78,898,789.20	0.92
24	601006	大秦铁路	12,979,437	77,097,855.78	0.90
25	600309	万华化学	4,713,523	75,510,638.46	0.88
26	600887	伊利股份	2,346,579	73,400,991.12	0.86
27	600048	保利地产	7,381,281	73,148,494.71	0.86
28	000069	华侨城 A	13,844,111	71,574,053.87	0.84
29	600050	中国联通	21,722,252	67,773,426.24	0.79
30	600795	国电电力	29,679,658	67,669,620.24	0.79
31	000776	广发证券	5,958,367	66,018,706.36	0.77
32	601009	南京银行	7,823,766	65,954,347.38	0.77
33	600153	建发股份	10,406,174	65,454,834.46	0.77
34	000725	京东方 A	29,396,030	65,259,186.60	0.76
35	600362	江西铜业	4,144,675	65,237,184.50	0.76
36	601390	中国中铁	26,294,456	64,158,472.64	0.75
37	000063	中兴通讯	5,005,301	63,817,587.75	0.75
38	601818	光大银行	19,820,502	57,281,250.78	0.67
39	600383	金地集团	8,213,518	56,344,733.48	0.66
40	000758	中色股份	5,553,613	56,258,099.69	0.66
41	000100	TCL 集团	24,254,519	55,057,758.13	0.64
42	000527	美的电器	4,261,445	52,927,146.90	0.62
43	000625	长安汽车	5,573,348	51,776,402.92	0.61
44	600177	雅戈尔	8,467,750	51,737,952.50	0.61
45	600011	华能国际	9,534,536	50,914,422.24	0.60
46	600256	广汇能源	3,804,773	49,309,858.08	0.58
47	600089	特变电工	6,074,817	48,902,276.85	0.57
48	600066	宇通客车	2,649,710	48,569,184.30	0.57
49	601800	中国交建	11,661,341	47,228,431.05	0.55
50	600497	驰宏锌锗	4,773,096	46,537,686.00	0.54
51	000001	平安银行	4,666,427	46,524,277.19	0.54
52	002142	宁波银行	5,346,744	45,286,921.68	0.53
53	600518	康美药业	2,333,281	44,868,993.63	0.53
54	600019	宝钢股份	11,354,502	44,623,192.86	0.52

55	601111	中国国航	10,393,162	44,067,006.88	0.52
56	002202	金风科技	8,054,817	43,415,463.63	0.51
57	600690	青岛海尔	3,956,181	43,161,934.71	0.51
58	601633	长城汽车	1,206,312	42,727,571.04	0.50
59	600535	天士力	1,059,851	41,493,166.65	0.49
60	600655	豫园商城	6,253,582	40,710,818.82	0.48
61	000895	双汇发展	1,058,104	40,673,517.76	0.48
62	600585	海螺水泥	2,901,406	38,820,812.28	0.45
63	601377	兴业证券	4,245,159	38,546,043.72	0.45
64	601933	永辉超市	3,198,608	37,327,755.36	0.44
65	000024	招商地产	1,511,606	36,701,793.68	0.43
66	600027	华电国际	11,326,783	35,679,366.45	0.42
67	600352	浙江龙盛	3,789,914	35,549,393.32	0.42
68	000999	华润三九	1,330,203	35,316,889.65	0.41
69	601988	中国银行	12,325,824	33,402,983.04	0.39
70	000538	云南白药	393,598	33,066,167.98	0.39
71	601788	光大证券	3,198,812	32,627,882.40	0.38
72	600547	山东黄金	999,490	32,113,613.70	0.38
73	000768	中航飞机	3,608,142	32,112,463.80	0.38
74	601992	金隅股份	6,291,234	31,456,170.00	0.37
75	600266	北京城建	3,039,080	31,089,788.40	0.36
76	002236	大华股份	809,491	30,946,840.93	0.36
77	002353	杰瑞股份	448,360	30,936,840.00	0.36
78	002570	贝因美	1,106,723	30,932,907.85	0.36
79	601688	华泰证券	3,778,164	30,452,001.84	0.36
80	600432	吉恩镍业	3,388,670	29,515,315.70	0.35
81	002038	双鹭药业	502,309	29,435,307.40	0.34
82	000783	长江证券	3,692,765	29,209,771.15	0.34
83	000060	中金岭南	4,352,293	28,812,179.66	0.34
84	600546	山煤国际	2,396,841	28,378,597.44	0.33
85	000623	吉林敖东	1,883,870	27,466,824.60	0.32
86	601299	中国北车	7,146,421	26,870,542.96	0.31
87	601628	中国人寿	1,926,170	26,369,267.30	0.31
88	600315	上海家化	584,623	26,302,188.77	0.31
89	000979	中弘股份	3,799,702	25,723,982.54	0.30
90	000690	宝新能源	5,317,385	24,832,187.95	0.29
91	600583	海油工程	3,805,796	24,623,500.12	0.29
92	600252	中恒集团	1,773,101	24,610,641.88	0.29
93	600029	南方航空	8,591,709	24,228,619.38	0.28
94	600369	西南证券	3,110,567	23,858,048.89	0.28
95	000800	一汽轿车	1,916,919	23,578,103.70	0.28
96	600900	长江电力	3,354,362	23,212,185.04	0.27
97	002241	歌尔声学	617,100	22,394,559.00	0.26
98	000937	冀中能源	2,500,787	22,081,949.21	0.26

99	000423	东阿阿胶	570,486	22,066,398.48	0.26
100	000338	潍柴动力	1,253,173	21,742,551.55	0.25
101	601901	方正证券	3,923,126	21,694,886.78	0.25
102	600511	国药股份	1,463,417	20,985,399.78	0.25
103	000860	顺鑫农业	1,920,360	20,893,516.80	0.24
104	002294	信立泰	721,423	20,877,981.62	0.24
105	002041	登海种业	982,086	20,849,685.78	0.24
106	000778	新兴铸管	4,216,577	20,703,393.07	0.24
107	000825	太钢不锈	7,625,664	19,597,956.48	0.23
108	600406	国电南瑞	1,301,599	19,432,873.07	0.23
109	002219	独一味	1,002,667	19,201,073.05	0.22
110	601336	新华保险	764,827	18,898,875.17	0.22
111	601555	东吴证券	2,739,504	18,765,602.40	0.22
112	601899	紫金矿业	7,840,032	18,659,276.16	0.22
113	600801	华新水泥	1,726,607	18,267,502.06	0.21
114	600132	重庆啤酒	1,195,795	17,972,798.85	0.21
115	600528	中铁二局	3,701,140	17,913,517.60	0.21
116	002285	世联地产	1,799,179	17,883,839.26	0.21
117	601117	中国化学	1,812,183	17,251,982.16	0.20
118	002128	露天煤业	1,930,742	16,874,685.08	0.20
119	000550	江铃汽车	1,083,765	16,592,442.15	0.19
120	000848	承德露露	726,934	16,508,671.14	0.19
121	600058	五矿发展	1,511,425	16,474,532.50	0.19
122	000090	深天健	2,306,062	16,050,191.52	0.19
123	000562	宏源证券	1,795,318	15,780,845.22	0.18
124	600157	永泰能源	2,694,409	15,762,292.65	0.18
125	600060	海信电器	1,502,013	15,605,915.07	0.18
126	600580	卧龙电气	2,828,320	15,272,928.00	0.18
127	600332	广州药业	443,484	15,193,761.84	0.18
128	002204	大连重工	1,456,568	14,958,953.36	0.18
129	002064	华峰氨纶	2,128,351	14,770,755.94	0.17
130	600835	上海机电	1,326,039	14,573,168.61	0.17
131	600418	江淮汽车	2,061,952	14,495,522.56	0.17
132	002081	金螳螂	509,145	14,495,358.15	0.17
133	600596	新安股份	1,353,997	14,284,668.35	0.17
134	002344	海宁皮城	746,331	14,262,385.41	0.17
135	600403	大有能源	1,645,959	14,023,570.68	0.16
136	601139	深圳燃气	1,569,797	13,955,495.33	0.16
137	601669	中国水电	4,834,503	13,923,368.64	0.16
138	600184	光电股份	606,835	13,690,197.60	0.16
139	002106	莱宝高科	887,842	13,628,374.70	0.16
140	000726	鲁泰A	1,612,671	13,610,943.24	0.16
141	000543	皖能电力	2,257,770	13,095,066.00	0.15
142	601808	中海油服	926,669	13,056,766.21	0.15



143	600886	国投电力	3,858,810	13,042,777.80	0.15
144	600436	片仔癀	93,382	12,776,525.24	0.15
145	600694	大商股份	439,271	12,708,110.03	0.15
146	000006	深振业 A	2,980,295	12,696,056.70	0.15
147	600123	兰花科创	999,978	12,649,721.70	0.15
148	600372	中航电子	599,869	12,567,255.55	0.15
149	000960	锡业股份	1,014,154	12,372,678.80	0.14
150	000970	中科三环	939,823	12,255,291.92	0.14
151	002152	广电运通	1,114,099	12,232,807.02	0.14
152	000680	山推股份	3,593,274	12,001,535.16	0.14
153	002410	广联达	623,162	11,815,151.52	0.14
154	601258	庞大集团	1,991,800	11,771,538.00	0.14
155	600549	厦门钨业	437,530	11,682,051.00	0.14
156	600143	金发科技	2,410,217	11,641,348.11	0.14
157	000027	深圳能源	2,277,321	11,454,924.63	0.13
158	002440	闰土股份	551,951	11,408,827.17	0.13
159	600340	华夏幸福	349,001	11,356,492.54	0.13
160	600295	鄂尔多斯	1,686,797	11,267,803.96	0.13
161	000683	远兴能源	2,326,794	11,168,611.20	0.13
162	000963	华东医药	279,295	11,129,905.75	0.13
163	600316	洪都航空	699,896	10,918,377.60	0.13
164	000568	泸州老窖	453,455	10,783,159.90	0.13
165	600500	中化国际	2,253,782	10,773,077.96	0.13
166	000531	穗恒运 A	1,148,959	10,754,256.24	0.13
167	000809	铁岭新城	1,262,622	10,744,913.22	0.13
168	600859	王府井	666,715	10,740,778.65	0.13
169	002073	软控股份	1,279,920	10,738,528.80	0.13
170	601877	正泰电器	538,367	10,681,201.28	0.13
171	002304	洋河股份	195,803	10,632,102.90	0.12
172	601991	大唐发电	2,039,610	10,483,595.40	0.12
173	600481	双良节能	1,452,658	10,342,924.96	0.12
174	002237	恒邦股份	740,930	10,106,285.20	0.12
175	002022	科华生物	671,270	9,941,508.70	0.12
176	600888	新疆众和	1,810,138	9,774,745.20	0.11
177	000539	粤电力 A	2,072,357	9,367,053.64	0.11
178	600873	梅花集团	2,356,863	9,356,746.11	0.11
179	600755	厦门国贸	2,510,560	9,339,283.20	0.11
180	002415	海康威视	257,774	9,109,733.16	0.11
181	601179	中国西电	2,943,327	9,006,580.62	0.11
182	600261	阳光照明	699,866	8,874,300.88	0.10
183	601801	皖新传媒	850,411	8,852,778.51	0.10
184	002466	天齐锂业	249,926	8,477,489.92	0.10
185	601928	凤凰传媒	999,936	8,409,461.76	0.10
186	600551	时代出版	793,796	8,271,354.32	0.10

187	002051	中工国际	294,590	8,210,223.30	0.10
188	600449	宁夏建材	1,199,999	8,123,993.23	0.10
189	300274	阳光电源	499,930	8,078,868.80	0.09
190	002422	科伦药业	150,775	8,037,815.25	0.09
191	000488	晨鸣纸业	2,190,200	7,819,014.00	0.09
192	600004	白云机场	1,225,352	7,707,464.08	0.09
193	000612	焦作万方	905,539	7,669,915.33	0.09
194	002244	滨江集团	909,852	7,642,756.80	0.09
195	600162	香江控股	1,322,665	7,433,377.30	0.09
196	600056	中国医药	449,799	7,372,205.61	0.09
197	000686	东北证券	439,566	7,138,551.84	0.08
198	002092	中泰化学	1,399,908	7,111,532.64	0.08
199	002454	松芝股份	799,976	7,023,789.28	0.08
200	600246	万通地产	2,213,487	6,883,944.57	0.08
201	600507	方大特钢	1,838,372	6,746,825.24	0.08
202	600196	复星医药	642,796	6,736,502.08	0.08
203	600976	武汉健民	299,941	6,478,725.60	0.08
204	000975	银泰资源	773,729	6,282,679.48	0.07
205	600893	航空动力	379,884	6,260,488.32	0.07
206	002269	美邦服饰	707,346	6,252,938.64	0.07
207	600570	恒生电子	499,927	6,249,087.50	0.07
208	600811	东方集团	1,228,959	6,058,767.87	0.07
209	000656	金科股份	522,475	6,055,485.25	0.07
210	601888	中国国旅	206,593	6,032,515.60	0.07
211	600009	上海机场	501,683	5,980,061.36	0.07
212	002065	东华软件	299,981	5,939,623.80	0.07
213	600438	通威股份	1,152,316	5,911,381.08	0.07
214	000603	盛达矿业	458,470	5,859,246.60	0.07
215	600021	上海电力	1,392,517	5,737,170.04	0.07
216	000597	东北制药	999,666	5,688,099.54	0.07
217	002308	威创股份	599,957	5,519,604.40	0.06
218	600600	青岛啤酒	145,167	5,513,442.66	0.06
219	600616	金枫酒业	747,472	5,292,101.76	0.06
220	000156	华数传媒	316,954	5,102,959.40	0.06
221	600161	天坛生物	348,195	4,913,031.45	0.06
222	600079	人福医药	180,000	4,694,400.00	0.05
223	000830	鲁西化工	1,166,229	4,256,735.85	0.05
224	300088	长信科技	199,932	4,216,565.88	0.05
225	603993	洛阳钼业	616,898	4,133,216.60	0.05
226	600498	烽火通信	250,000	4,120,000.00	0.05
227	600594	益佰制药	133,279	4,119,653.89	0.05
228	600068	葛洲坝	1,033,900	4,073,566.00	0.05
229	600804	鹏博士	364,615	3,861,272.85	0.05
230	600487	亨通光电	201,617	3,828,706.83	0.04

231	300145	南方泵业	149,977	3,669,937.19	0.04
232	600312	平高电气	389,440	3,590,636.80	0.04
233	000418	小天鹅 A	499,963	3,554,736.93	0.04
234	002386	天原集团	537,397	3,466,210.65	0.04
235	000513	丽珠集团	91,291	3,405,154.30	0.04
236	000425	徐工机械	432,318	3,393,696.30	0.04
237	600872	中炬高新	481,344	3,383,848.32	0.04
238	600129	太极集团	399,999	3,311,991.72	0.04
239	600718	东软集团	400,000	3,256,000.00	0.04
240	002465	海格通信	99,914	2,992,424.30	0.04
241	600231	凌钢股份	935,557	2,956,360.12	0.03
242	601333	广深铁路	1,276,200	2,935,260.00	0.03
243	601699	潞安环能	235,760	2,819,689.60	0.03
244	002470	金正大	199,929	2,815,000.32	0.03
245	002005	德豪润达	299,985	2,789,860.50	0.03
246	600780	通宝能源	486,476	2,763,183.68	0.03
247	000759	中百集团	500,095	2,725,517.75	0.03
248	000807	云铝股份	730,927	2,719,048.44	0.03
249	600809	山西汾酒	109,672	2,686,964.00	0.03
250	600108	亚盛集团	408,876	2,665,871.52	0.03
251	000897	津滨发展	1,200,600	2,581,290.00	0.03
252	600578	京能热电	367,170	2,544,488.10	0.03
253	000718	苏宁环球	393,400	2,313,192.00	0.03
254	600641	万业企业	690,222	2,174,199.30	0.03
255	600816	安信信托	171,910	2,143,717.70	0.03
256	600166	福田汽车	350,000	1,785,000.00	0.02
257	600805	悦达投资	191,574	1,754,817.84	0.02
258	000682	东方电子	659,100	1,667,523.00	0.02
259	000581	威孚高科	47,015	1,569,830.85	0.02
260	600038	哈飞股份	70,000	1,569,400.00	0.02
261	600010	包钢股份	378,695	1,552,649.50	0.02
262	600208	新潮中宝	493,430	1,524,698.70	0.02
263	600637	百视通	53,872	1,508,416.00	0.02
264	600199	金种子酒	97,674	1,319,575.74	0.02
265	600827	友谊股份	182,156	1,251,411.72	0.01
266	002048	宁波华翔	129,578	1,083,272.08	0.01
267	600761	安徽合力	129,900	1,008,024.00	0.01
268	000400	许继电气	34,909	945,335.72	0.01
269	002028	思源电气	57,000	896,610.00	0.01
270	002254	泰和新材	135,100	856,534.00	0.01
271	600333	长春燃气	100,340	812,754.00	0.01
272	000028	国药一致	26,335	735,273.20	0.01
273	600115	东方航空	162,401	415,746.56	0.00
274	600380	健康元	52,505	218,420.80	0.00

275	600720	祁连山	12,700	108,458.00	0.00
276	600858	银座股份	13,030	102,285.50	0.00
277	601607	上海医药	9,592	101,962.96	0.00
278	600978	宜华木业	21,100	92,629.00	0.00
279	601101	昊华能源	9,300	73,749.00	0.00
280	300127	银河磁体	1	16.09	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	601088	中国神华	125,910,343.96	1.35
2	600348	阳泉煤业	109,397,356.35	1.17
3	600362	江西铜业	93,362,972.25	1.00
4	000758	中色股份	78,798,547.81	0.84
5	601166	兴业银行	73,302,272.39	0.78
6	601006	大秦铁路	70,140,605.91	0.75
7	601009	南京银行	67,871,491.91	0.73
8	600153	建发股份	62,700,961.38	0.67
9	600256	广汇能源	62,312,274.90	0.67
10	600795	国电电力	58,931,304.56	0.63
11	600497	驰宏锌锗	58,572,879.19	0.63
12	600111	包钢稀土	58,449,918.25	0.62
13	002202	金风科技	57,684,535.44	0.62
14	000063	中兴通讯	56,817,564.19	0.61
15	600104	上汽集团	56,525,180.51	0.60
16	600309	万华化学	56,162,341.73	0.60
17	600519	贵州茅台	55,737,114.58	0.60
18	000725	京东方 A	55,725,021.94	0.60
19	600066	宇通客车	55,004,720.46	0.59
20	600177	雅戈尔	53,645,710.97	0.57

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	000568	泸州老窖	102,362,676.55	1.09
2	600028	中国石化	78,698,691.13	0.84
3	601088	中国神华	72,872,120.19	0.78
4	600694	大商股份	71,431,960.12	0.76
5	600111	包钢稀土	71,362,166.94	0.76
6	600596	新安股份	63,585,258.65	0.68
7	600827	友谊股份	62,054,722.19	0.66
8	600016	民生银行	61,464,060.27	0.66

9	600104	上汽集团	58,359,339.07	0.62
10	600970	中材国际	53,499,395.18	0.57
11	601898	中煤能源	52,917,801.39	0.57
12	600219	南山铝业	52,478,283.75	0.56
13	600863	内蒙华电	51,703,397.06	0.55
14	601117	中国化学	51,212,766.65	0.55
15	601607	上海医药	49,872,523.31	0.53
16	601998	中信银行	49,558,043.23	0.53
17	600157	永泰能源	49,210,847.60	0.53
18	601186	中国铁建	48,649,254.66	0.52
19	601390	中国中铁	47,938,414.76	0.51
20	600019	宝钢股份	47,698,997.07	0.51

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	6,395,966,153.65
卖出股票收入（成交）总额	6,014,738,502.39

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名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓股指期货。

#### 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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	766,803.79
2	应收证券清算款	10,351,465.91
3	应收股利	20,971,955.89
4	应收利息	112,877.99
5	应收申购款	3,182,547.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,385,651.51

#### 7.10.4 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。

#### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.10.6 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
661,303	21,069.34	1,763,926,294.25	12.66%	12,169,292,823.68	87.34%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（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	-	2,287,457.51	0.02%
	合计	2,287,457.51	0.02%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的区间为：50 万份至 100 万份（含）；

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	13,379,231,495.22
本报告期基金总申购份额	2,027,512,108.90
减：本报告期基金总赎回份额	1,473,524,486.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	13,933,219,117.93

## § 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

(1) 基金管理人于 2013 年 6 月 1 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》，何宝不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由杨鵬代任公司总经理。

(2) 基金管理人于 2013 年 7 月 26 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》，经博时基金管理有限公司第五届董事会 2013 年第三次会议审议并通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】962 号文核准批复，博时基金管理有限公司聘任吴姚东担任博时基金管理有限公司总经理。

### 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

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	
招商证券	3	2,095,920,926.03	16.93%	1,853,408.25	17.90%	-
东方证券	3	2,018,786,637.34	16.31%	1,424,154.15	13.76%	-
中金公司	1	1,468,828,921.91	11.86%	1,327,810.79	12.83%	-
中信证券	3	1,463,295,597.23	11.82%	1,332,146.86	12.87%	-
中银国际	1	1,328,208,982.51	10.73%	943,564.08	9.11%	-
银河证券	1	1,074,427,060.36	8.68%	978,159.12	9.45%	-
瑞银证券	1	766,020,093.03	6.19%	697,390.11	6.74%	-
民生证券	1	518,213,671.01	4.19%	368,137.40	3.56%	新增
兴业证券	1	515,008,627.41	4.16%	468,858.95	4.53%	-
中信建投	1	432,954,937.87	3.50%	394,167.35	3.81%	-
安信证券	1	327,304,041.05	2.64%	232,515.69	2.25%	新增
高华证券	1	249,023,735.57	2.01%	220,364.12	2.13%	-
中投证券	2	122,207,417.28	0.99%	111,259.84	1.07%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

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》（证监基字[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；能根据公司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	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-22
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-14
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-8
4	关于博时旗下部分基金增加泛华普益基金销售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	2013-6-5
5	关于博时旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-6-5
6	关于博时旗下部分基金继续参加重庆银行股份有限公司网上银行基金申购及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	2013-5-22
7	关于博时旗下部分基金参加中期时代基金销售（北京）有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-5-22
8	关于博时旗下部分基金增加中期时代基金销售（北京）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	2013-5-22
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的上海家化估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-5-15
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加徽商银行股份有限公司非现场渠道申购及定期定额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	2013-5-10
11	关于博时旗下部分基金开通在好买基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-5-6
12	博时基金管理有限公司关于开通基金直销网上交易和查询系统移动版的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-15
13	关于博时公司旗下部分基金增加第一创业证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-12
14	关于博时旗下部分基金开通在好买基金定投业务并参加好买基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-4-1
15	关于博时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	2013-4-1
16	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-3-23
17	博时基金管理有限公司关于股东名称变更、增加注册资本及修改《公司章程》的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-3-13
18	博时基金管理有限公司关于成立博时资本管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-2-28
19	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-2-27

20	关于博时公司旗下部分基金增加国金证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-2-22
21	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-2-8
22	博时基金管理有限公司关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-1-12
23	关于博时旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司非现场交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-1-11
24	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-1-4

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 11.1.1 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
- 11.1.2 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 11.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 11.1.6 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

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 11.3 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

2013 年 8 月 29 日