

博时深证基本面 200 交易型开放式指数证  
券投资基金联接基金  
2013 年年度报告摘要  
2013 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2014 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	博时深证基本面 200ETF 联接
基金主代码	050021
交易代码	050021
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金
基金合同生效日	2011 年 6 月 10 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	136,031,315.80 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159908
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2011年6月10日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 7 月 13 日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即深证基本面 200 指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金，方便特定的客户群通过本基金投资深证基本面 200 交易型开放式指数投资基金。本基金不参与深证基本面 200 交易型开放式指数投资基金的投资管理。
业绩比较基准	深证基本面 200 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪深证基本面 200 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

#### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	深证基本面 200 指数（价格指数）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险/高收益的开放式基金。本基金

	为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪深证基本面 200 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
--	---

## 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒麟	裴学敏
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		95105568	95559
传真		0755-83195140	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

# § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2013年	2012年	2011年6月10日（基金合同生效日）至2011年12月31日
本期已实现收益	-14,902,330.45	-3,841,229.79	-2,538,382.02
本期利润	-4,264,330.95	977,355.24	-57,709,107.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0264	0.0050	-0.2555
本期基金份额净值增长率	-3.61%	0.66%	-27.63%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2978	-0.2715	-0.2763
期末基金资产净值	95,520,004.69	136,024,794.83	145,097,932.67
期末基金份额净值	0.7022	0.7285	0.7237

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。

所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

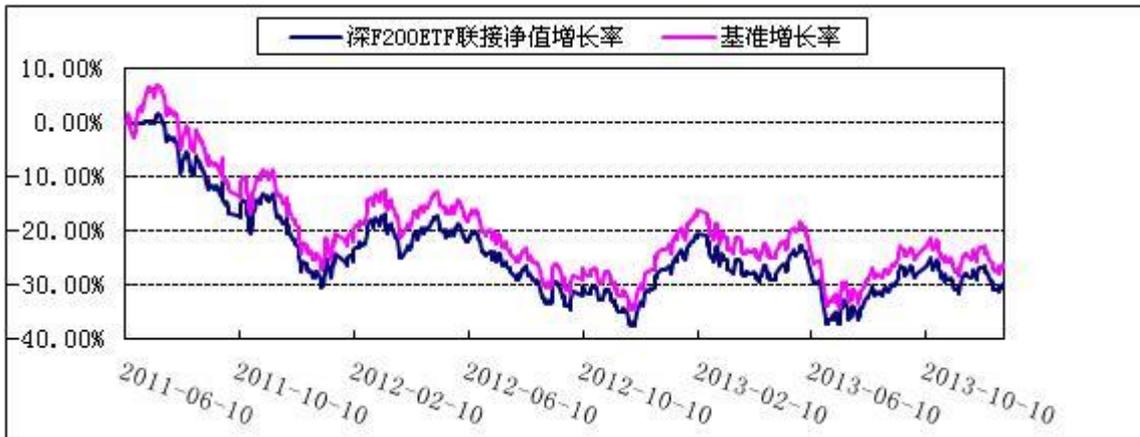
阶段	份额净值	份额净值增长	业绩比较基	业绩比较基准收	①-③	②-④
----	------	--------	-------	---------	-----	-----

	增长率①	率标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去三个月	-2.58%	1.15%	-2.25%	1.16%	-0.33%	-0.01%
过去六个月	10.36%	1.27%	10.30%	1.27%	0.06%	0.00%
过去一年	-3.61%	1.34%	-3.59%	1.35%	-0.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-29.78%	1.31%	-26.14%	1.34%	-3.64%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准：深证基本面 200 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

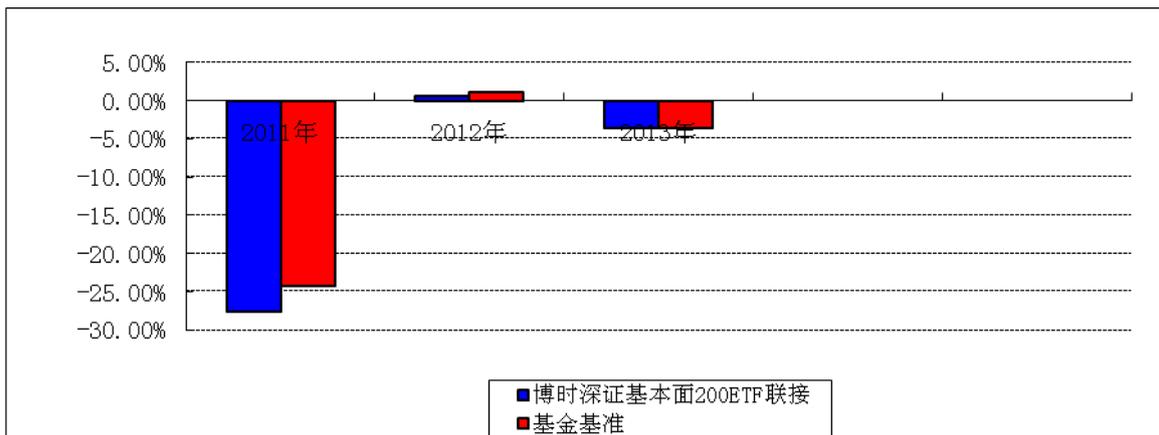
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 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：本基金的基金合同于 2011 年 6 月 10 日生效。按照基金合同规定，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十二条“（二）投资范围”、“（八）投资禁止行为与限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 合同生效日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理四十六只开放式基金和一只封闭式基金，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 1052 亿元人民币，累计分红超过 608 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，股票型基金中，截至 12 月 31 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 1/4。混合灵活配置型基金方面，博时回报今年以来收益率在 71 只同类基金中排名前 1/2。

固定收益方面，2013 年博时信用债纯债基金收益率在 17 只长期标准债券型基金中排名前 1/3；博时裕祥分级债券 A 收益率在 17 只封闭式债券型分级子基金（优先份额）中名列第 2。

海外投资方面，博时大中华亚太精选 2013 年收益率在 7 只 QDII 亚太股票型基金中排名第 2。

##### 2、客户服务

2013 年全年，博时基金共举办各类渠道培训活动 1534 场，参加人数 38251 人。

##### 3、其他大事件

1) 2013 年 1 月 30 日，博时亚洲票息债券基金由于达到募集份额目标上限 18 亿份而提前结束募集，同时启动末日比例配售，配售比例约为 63.35%。

2) 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”。

3) 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”。

4) 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”。

5) 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”。

6) 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”。

7) 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。

8) 2013 年 9 月 24 日, 由理财周报主办的 2013 中国基金业领袖峰会暨“寻找中国最受尊敬基金公司”颁奖典礼在上海举行, 博时基金共获得三个奖项, 分别是: 2013 中国最佳资产配置基金公司、2013 中国最佳价值发现基金公司、2013 中国最佳基金公司投资总监(姜文涛先生)。

9) 2013 年 11 月 18 日, 博时基金在《每日经济新闻》举办的基金金鼎奖评选活动中获得“基金投顾业务-2013 最具竞争力基金公司”奖项。

10) 2013 年 12 月 20 日, 东方财富网在北京中国大饭店举办“东财互联网金融圆桌论坛”和“2013 东方财富风云榜颁奖盛典”活动, 我司获得“最佳企业年金奖”。

#### 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		
赵云阳	基金经理	2012-11-13	-	3	2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年 8 月加入博时基金管理有限公司, 历任股票投资部量化分析师、博时标普 500 指数基金基金经理助理和博时深证基本面 200ETF 基金及其联接基金基金经理助理。现任博时深证基本面 200ETF 基金及其联接基金、博时上证企债 30ETF 基金、博时特许价值股票基金的基金经理。
张雅洁	基金经理助理	2013-5-20	-	3	2003 年起先后在信通担保有限公司、JEA Initial、融通基金工作。2013 年 5 月加入博时基金管理有限公司, 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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他相关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益。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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人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 年国内宏观经济数据呈现经济活动增速放缓的态势。从全年经济基本面来看，第一、二季度经济较为疲软，市场情绪较为低迷；第三季度宏观经济数据出现明显好转，提振了市场情绪；第四季度经济增速继续放缓，国内市场表现弱于美国及欧洲市场。从全年资本市场表现来看，大小盘出现分化-沪深 300 和中小板、创业板的估值和成交活跃度走势呈现分化。市盈率和市净率方面，沪深 300 均有下移，而中小板和创业板的都呈现上升，创业板的升幅表现尤为突出；日均成交量方面，沪深 300 全年呈现下移态势，中小板中枢基本持平，而创业板仍市场追逐的热点。沪深 300 全年下跌 7.65%，深证基本面 200 指数全年下跌 3.91%。整体而言，二级市场的投资者对大盘股的参与热情一般。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.7022 元，累计净值为 0.7022 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-3.61%，同期业绩基准增长率为-3.59%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年是十八届三中后中国进行全面深化改革后的第一年。中国短期面临着调整和改变，过程是持续渐进的，发展的潜力有待各项改革措施的落地和逐步推进。从经济增长层面看，为了确保社会稳定和一定的就业目标，经济或将维持温和增长，但是通胀上行和流动性紧缩又会对增长产生一定的制约。同时，美国和欧洲经济持续复苏，尤其是美国缩减 QE 政策落地，会对全球的流动性产生一定的冲击。全球多方力量的共同作用效果仍需时间验证。

在投资策略上，深证基本面 200ETF 联接基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，通过投资于深证基本面 200ETF 基金紧密跟踪深证基本面 200 指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过深证基本面 200ETF 联接基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

#### 4.6 管理人对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

本本基金收益分配原则：在符合基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 2 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的 10%，基金的收益分配比例应当以收益分配基准日可供分配利润为基准计算。若自基金合同生效日起不满 3 个月，可不进行收益分配；基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

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

### § 5 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

2013 年度，基金托管人在博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013 年度，博时基金管理有限公司在博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。个别工作日托管人发现基金存在个别监督指标超标的情况，托管人对基金管理人进行了提示，基金管理人根据规定进行了调整。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2013 年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	3,988,788.73	3,746,641.76
结算备付金	924,957.11	2,939,740.78
存出保证金	14,561.25	2,000,527.46
交易性金融资产	90,669,177.08	127,452,549.18
其中：股票投资	620,351.93	455,049.18
基金投资	90,048,825.15	126,997,500.00
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	120,615.28	260,777.44
应收利息	1,925.17	3,029.58
应收股利	-	-
应收申购款	4,766.87	40,574.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>95,724,791.49</b>	<b>136,443,840.59</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2013年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	59,394.25	271,331.33
应付管理人报酬	2,066.01	3,525.74
应付托管费	413.18	705.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,797.29	2,460.96
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	140,116.07	141,022.58
<b>负债合计</b>	<b>204,786.80</b>	<b>419,045.76</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	136,031,315.80	186,711,934.10
未分配利润	-40,511,311.11	-50,687,139.27
<b>所有者权益合计</b>	<b>95,520,004.69</b>	<b>136,024,794.83</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>95,724,791.49</b>	<b>136,443,840.59</b>

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7022 元，基金份额总额 136,031,315.80 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年 12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 12月31日
<b>一、收入</b>	<b>-3,822,162.88</b>	<b>1,399,735.36</b>
1. 利息收入	83,159.41	133,639.48
其中：存款利息收入	83,159.41	133,639.48
债券利息收入	-	-
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）	-14,592,348.52	-3,583,857.39
其中：股票投资收益	62,970.00	-1,797.16
基金投资收益	-14,660,264.10	-3,589,067.52
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-

股利收益	4,945.58	7,007.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	10,637,999.50	4,818,585.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	49,026.73	31,368.24
<b>减：二、费用</b>	<b>442,168.07</b>	<b>422,380.12</b>
1. 管理人报酬	31,018.61	47,573.35
2. 托管费	6,203.69	9,514.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	62,301.17	23,367.39
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	342,644.60	341,924.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-4,264,330.95</b>	<b>977,355.24</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-4,264,330.95</b>	<b>977,355.24</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31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）	186,711,934.10	-50,687,139.27	136,024,794.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,264,330.95	-4,264,330.95
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）	-50,680,618.30	14,440,159.11	-36,240,459.19
其中：1. 基金申购款	19,383,324.99	-5,467,321.46	13,916,003.53
2. 基金赎回款	-70,063,943.29	19,907,480.57	-50,156,462.72
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）	136,031,315.80	-40,511,311.11	95,520,004.69
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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）	200,503,555.79	-55,405,623.12	145,097,932.67
二、本期经营活动产生的基金	-	977,355.24	977,355.24

净值变动数（本期利润）			
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）	-13,791,621.69	3,741,128.61	-10,050,493.08
其中：1. 基金申购款	19,735,457.58	-4,694,249.34	15,041,208.24
2. 基金赎回款	-33,527,079.27	8,435,377.95	-25,091,701.32
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）	186,711,934.10	-50,687,139.27	136,024,794.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：吴姚东      主管会计工作的负责人：王德英      会计机构负责人：成江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.2 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[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》及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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。

### 7.4.3 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构

招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
璟安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
上海丰益股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 (“目标 ETF”)	基金管理人管理的其他基金

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。

#### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.4.2 关联方报酬

###### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,018.61	47,573.35
其中：支付销售机构的客户维护费	203,121.69	251,043.29

注：

1. 本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的 0.5% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.5% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,203.69	9,514.67

注：本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的 0.1% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.1% / 当年天数。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.4.5 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,988,788.73	15,776.62	3,746,641.76	14,795.19

注：

1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于 2013 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有 129,846,900 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 71.06%。

#### 7.4.5 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.5.2 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
000562	宏源证券	2013/10/30	公告重大事项	8.22	暂未复牌	暂未复牌	151	1,234.31	1,241.22	-
000625	长安汽车	2013/12/31	公告重大事项	11.45	2014/01/03	11.72	402	4,542.60	4,602.90	-
000666	经纬纺机	2013/12/11	公告重大事项	9.76	2014/3/21	10.50	400	3,904.00	3,904.00	-
001696	宗申动力	2013/12/09	公告重大事项	4.70	2014/01/09	4.41	1,000	4,700.00	4,700.00	-

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 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。

#### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.6 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12月31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90,654,728.96元，属于第二层级的余额为14,448.12元，无属于第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级127,301,321.66元，第二层级151,227.52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，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

无。

(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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
----	----	-------	--------------

1	权益投资	620,351.93	0.65
	其中：股票	620,351.93	0.65
2	基金投资	90,048,825.15	94.07
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,913,745.84	5.13
7	其他各项资产	141,868.57	0.15
8	合计	95,724,791.49	100.00

### 8.2 报告期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金	股票指数型	交易型开放式指数基金	博时基金管理有限公司	90,048,825.15	94.27

### 8.3 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	1,957.47	-
B	采矿业	21,635.94	0.02
C	制造业	404,124.59	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,761.62	0.02
E	建筑业	3,981.10	-
F	批发和零售业	50,132.94	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	6,234.29	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,028.26	-
J	金融业	49,514.52	0.05
K	房地产业	53,572.81	0.06
L	租赁和商务服务业	1,413.04	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,994.30	0.01
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	1,366.20	0.00
S	综合	1,634.85	0.00
	合计	620,351.93	0.65

#### 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000002	万科 A	3,641	29,237.23	0.03
2	000651	格力电器	748	24,429.68	0.03
3	002024	苏宁云商	2,626	23,712.78	0.02
4	000778	新兴铸管	2,733	17,409.21	0.02
5	000001	平安银行	1,352	16,562.00	0.02
6	000039	中集集团	973	14,458.78	0.02
7	000333	美的集团	283	14,150.00	0.01
8	000100	TCL 集团	5,768	13,439.44	0.01
9	000776	广发证券	1,045	13,041.60	0.01
10	000157	中联重科	2,392	13,036.40	0.01
11	000709	河北钢铁	6,053	12,106.00	0.01
12	000338	潍柴动力	564	10,716.00	0.01
13	000063	中兴通讯	785	10,259.95	0.01
14	000825	太钢不锈	3,616	9,365.44	0.01
15	000402	金融街	1,545	8,080.35	0.01
16	000858	五粮液	507	7,939.62	0.01
17	002202	金风科技	911	7,679.73	0.01
18	000983	西山煤电	975	6,922.50	0.01
19	000895	双汇发展	138	6,497.04	0.01
20	000568	泸州老窖	300	6,042.00	0.01
21	000069	华侨城 A	1,131	5,994.30	0.01
22	000932	华菱钢铁	3,041	5,899.54	0.01
23	000783	长江证券	563	5,855.20	0.01
24	000425	徐工机械	759	5,775.99	0.01
25	000629	攀钢钒钛	2,647	5,664.58	0.01
26	002399	海普瑞	279	5,663.70	0.01
27	002142	宁波银行	610	5,630.30	0.01
28	000630	铜陵有色	526	5,270.52	0.01
29	002594	比亚迪	133	5,011.44	0.01
30	000066	长城电脑	1,304	4,942.16	0.01
31	000800	一汽轿车	407	4,843.30	0.01
32	000876	新希望	337	4,829.21	0.01
33	000488	晨鸣纸业	1,027	4,826.90	0.01

34	001696	宗申动力	1,000	4,700.00	0.00
35	000422	湖北宜化	744	4,664.88	0.00
36	000625	长安汽车	402	4,602.90	0.00
37	000933	神火股份	925	4,458.50	0.00
38	000623	吉林敖东	248	4,404.48	0.00
39	000612	焦作万方	753	4,389.99	0.00
40	000729	燕京啤酒	529	4,284.90	0.00
41	000528	柳工	644	4,095.84	0.00
42	000725	京东方 A	1,878	4,037.70	0.00
43	000666	经纬纺机	400	3,904.00	0.00
44	000581	威孚高科	124	3,819.20	0.00
45	000792	盐湖股份	226	3,780.98	0.00
46	002001	新和成	182	3,512.60	0.00
47	002422	科伦药业	76	3,487.64	0.00
48	000728	国元证券	327	3,335.40	0.00
49	000883	湖北能源	518	3,310.02	0.00
50	000024	招商地产	155	3,220.90	0.00
51	000829	天音控股	451	3,184.06	0.00
52	002415	海康威视	136	3,125.28	0.00
53	000028	国药一致	67	3,102.10	0.00
54	000963	华东医药	64	2,944.00	0.00
55	000878	云南铜业	337	2,935.27	0.00
56	000937	冀中能源	394	2,923.48	0.00
57	000060	中金岭南	459	2,882.52	0.00
58	000027	深圳能源	522	2,871.00	0.00
59	000877	天山股份	471	2,863.68	0.00
60	000900	现代投资	407	2,849.00	0.00
61	000059	辽通化工	568	2,834.32	0.00
62	000759	中百集团	398	2,817.84	0.00
63	000680	山推股份	875	2,782.50	0.00
64	000951	中国重汽	240	2,745.60	0.00
65	000012	南玻 A	333	2,710.62	0.00
66	000550	江铃汽车	106	2,693.46	0.00
67	002241	歌尔声学	75	2,631.00	0.00
68	000959	首钢股份	1,261	2,585.05	0.00
69	000726	鲁泰 A	243	2,558.79	0.00
70	002465	海格通信	123	2,555.94	0.00
71	000926	福星股份	357	2,541.84	0.00
72	000830	鲁西化工	608	2,511.04	0.00
73	002416	爱施德	132	2,494.80	0.00
74	000401	冀东水泥	285	2,416.80	0.00
75	002092	中泰化学	453	2,400.90	0.00

76	000531	穗恒运 A	191	2,305.37	0.00
77	000423	东阿阿胶	57	2,254.92	0.00
78	000652	泰达股份	477	2,194.20	0.00
79	002648	卫星石化	75	2,173.50	0.00
80	002304	洋河股份	53	2,163.46	0.00
81	002007	华兰生物	71	2,037.70	0.00
82	000768	中航飞机	212	2,022.48	0.00
83	000088	盐田港	333	2,014.65	0.00
84	000021	长城开发	379	2,001.12	0.00
85	000016	深康佳 A	504	1,945.44	0.00
86	000701	厦门信达	168	1,943.76	0.00
87	002083	孚日股份	451	1,925.77	0.00
88	002375	亚厦股份	74	1,909.20	0.00
89	002146	荣盛发展	190	1,900.00	0.00
90	000939	凯迪电力	302	1,863.34	0.00
91	002557	洽洽食品	77	1,858.78	0.00
92	000869	张裕 A	68	1,836.00	0.00
93	000626	如意集团	237	1,829.64	0.00
94	000559	万向钱潮	343	1,821.33	0.00
95	000690	宝新能源	341	1,807.30	0.00
96	000572	海马汽车	460	1,748.00	0.00
97	000417	合肥百货	278	1,743.06	0.00
98	000860	顺鑫农业	112	1,720.32	0.00
99	002440	闰土股份	107	1,719.49	0.00
100	002500	山西证券	248	1,711.20	0.00
101	002293	罗莱家纺	71	1,690.51	0.00
102	000979	中弘股份	478	1,663.44	0.00
103	002385	大北农	101	1,651.35	0.00
104	000541	佛山照明	238	1,639.82	0.00
105	000009	中国宝安	173	1,634.85	0.00
106	000703	恒逸石化	215	1,608.20	0.00
107	000683	远兴能源	397	1,584.03	0.00
108	000589	黔轮胎 A	305	1,576.85	0.00
109	002429	兆驰股份	116	1,566.00	0.00
110	000917	电广传媒	96	1,565.76	0.00
111	002203	海亮股份	134	1,536.98	0.00
112	002050	三花股份	135	1,525.50	0.00
113	000731	四川美丰	154	1,523.06	0.00
114	002673	西部证券	114	1,504.80	0.00
115	002191	劲嘉股份	108	1,492.56	0.00
116	000970	中科三环	116	1,489.44	0.00
117	002269	美邦服饰	120	1,479.60	0.00

118	000839	中信国安	234	1,462.50	0.00
119	002078	太阳纸业	243	1,448.28	0.00
120	000999	华润三九	58	1,443.62	0.00
121	000807	云铝股份	416	1,414.40	0.00
122	002344	海宁皮城	68	1,413.04	0.00
123	002249	大洋电机	133	1,392.51	0.00
124	002008	大族激光	103	1,389.47	0.00
125	002048	宁波华翔	162	1,367.28	0.00
126	000793	华闻传媒	115	1,366.20	0.00
127	002470	金正大	64	1,363.20	0.00
128	000960	锡业股份	126	1,345.68	0.00
129	000539	粤电力 A	283	1,344.25	0.00
130	002493	荣盛石化	161	1,342.74	0.00
131	000006	深振业 A	272	1,340.96	0.00
132	002081	金螳螂	61	1,340.78	0.00
133	000685	中山公用	117	1,329.12	0.00
134	002570	贝因美	43	1,320.10	0.00
135	000031	中粮地产	350	1,298.50	0.00
136	000822	山东海化	388	1,292.04	0.00
137	002419	天虹商场	125	1,285.00	0.00
138	000562	宏源证券	151	1,241.22	0.00
139	000708	大冶特钢	215	1,236.25	0.00
140	000698	沈阳化工	322	1,230.04	0.00
141	002233	塔牌集团	189	1,215.27	0.00
142	002299	圣农发展	126	1,213.38	0.00
143	002128	露天煤业	151	1,211.02	0.00
144	000598	兴蓉投资	207	1,192.32	0.00
145	000501	鄂武商 A	93	1,186.68	0.00
146	002122	天马股份	275	1,160.50	0.00
147	000758	中色股份	107	1,150.25	0.00
148	002011	盾安环境	125	1,143.75	0.00
149	000780	平庄能源	249	1,135.44	0.00
150	002463	沪电股份	304	1,121.76	0.00
151	000987	广州友谊	114	1,088.70	0.00
152	002275	桂林三金	71	1,085.59	0.00
153	000718	苏宁环球	237	1,083.09	0.00
154	000418	小天鹅 A	107	1,078.56	0.00
155	000912	泸天化	228	1,039.68	0.00
156	002430	杭氧股份	135	999.00	0.00
157	000789	江西水泥	100	946.00	0.00
158	000543	皖能电力	131	935.34	0.00
159	002534	杭锅股份	75	882.75	0.00

160	000927	一汽夏利	246	880.68	0.00
161	002444	巨星科技	108	879.12	0.00
162	002042	华孚色纺	189	852.39	0.00
163	000968	煤气化	103	841.51	0.00
164	300003	乐普医疗	50	837.50	0.00
165	000786	北新建材	46	805.00	0.00
166	002029	七匹狼	101	783.76	0.00
167	000969	安泰科技	105	780.15	0.00
168	002155	辰州矿业	97	765.33	0.00
169	002069	獐子岛	51	744.09	0.00
170	000918	嘉凯城	267	742.26	0.00
171	000828	东莞控股	158	739.44	0.00
172	000620	新华联	134	737.00	0.00
173	000961	中南建设	104	731.12	0.00
174	002408	齐翔腾达	50	715.00	0.00
175	002075	沙钢股份	230	710.70	0.00
176	000046	泛海建设	155	695.95	0.00
177	002237	恒邦股份	50	687.00	0.00
178	002244	滨江集团	97	683.85	0.00
179	002267	陕天然气	65	666.90	0.00
180	000686	东北证券	40	632.80	0.00
181	000022	深赤湾 A	40	631.20	0.00
182	002311	海大集团	53	622.22	0.00
183	002251	步步高	44	606.32	0.00
184	002028	思源电气	39	581.10	0.00
185	300307	慈星股份	52	559.52	0.00
186	002585	双星新材	37	425.13	0.00
187	002489	浙江永强	37	377.40	0.00
188	000656	金科股份	43	347.44	0.00
189	002498	汉缆股份	46	344.08	0.00
190	002194	武汉凡谷	39	336.57	0.00
191	002662	京威股份	39	286.65	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

## 8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	000002	万科 A	83,325.00	0.06
2	000651	格力电器	39,210.00	0.03
3	000001	平安银行	30,368.00	0.02

4	000100	TCL 集团	27,840.00	0.02
5	000898	*ST 鞍钢	22,445.00	0.02
6	000825	太钢不锈	21,190.00	0.02
7	000709	河北钢铁	20,737.00	0.02
8	000776	广发证券	20,040.00	0.01
9	002024	苏宁云商	19,040.00	0.01
10	000063	中兴通讯	18,542.00	0.01
11	000338	潍柴动力	18,440.00	0.01
12	000157	中联重科	18,408.00	0.01
13	000402	金 融 街	16,646.00	0.01
14	000895	双汇发展	16,078.00	0.01
15	000783	长江证券	14,745.00	0.01
16	000983	西山煤电	13,845.00	0.01
17	000625	长安汽车	13,507.00	0.01
18	000800	一汽轿车	12,089.00	0.01
19	000039	中集集团	11,833.27	0.01
20	000858	五 粮 液	11,055.00	0.01

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。

#### 8.5.2 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	000002	万 科 A	2,318,908.21	1.70
2	000651	格力电器	1,169,643.45	0.86
3	002024	苏宁云商	948,928.96	0.70
4	000001	平安银行	937,891.57	0.69
5	000100	TCL 集团	770,485.28	0.57
6	000776	广发证券	686,131.85	0.50
7	000157	中联重科	682,195.06	0.50
8	000709	河北钢铁	666,827.32	0.49
9	000825	太钢不锈	592,060.99	0.44
10	000063	中兴通讯	588,805.04	0.43
11	000338	潍柴动力	558,904.63	0.41
12	000527	美的电器	521,078.88	0.38
13	000402	金 融 街	500,077.17	0.37
14	000858	五 粮 液	473,762.43	0.35
15	000983	西山煤电	441,890.40	0.32
16	000039	中集集团	397,826.31	0.29
17	000069	华侨城 A	376,282.04	0.28
18	000783	长江证券	360,181.23	0.26
19	002202	金风科技	351,264.45	0.26
20	000800	一汽轿车	350,221.17	0.26

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。

### 8.5.3 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

买入股票的成本（成交）总额	1,026,666.76
卖出股票的收入（成交）总额	33,045,662.04

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。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金未投资股指期货交易。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	14,561.25
2	应收证券清算款	120,615.28
3	应收股利	-
4	应收利息	1,925.17
5	应收申购款	4,766.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	141,868.57
---	----	------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
2,743	49,592.17	2,178,967.80	1.60%	133,852,348.00	98.40%

### 9.2 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	134,543.13	0.10%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；

2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年6月10日)基金份额总额	289,478,620.55
本报告期期初基金份额总额	186,711,934.10
本报告期基金总申购份额	19,383,324.99
减：本报告期基金总赎回份额	70,063,943.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	136,031,315.80

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1) 基金管理人于 2013 年 6 月 1 日发布《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，何宝先生不再担任公司总经理职务，由公司董事长杨鹁女士代任公司总经理职务。2) 基金管理人于 2013 年 7 月 26 日发布《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴姚东先生担任公司总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期内本基金应付审计费 40,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2013年9月3日，中国证监会向我司下发了《关于对博时基金管理有限公司采取责令整改等措施的决定》，责令我司进行为期6个月的整改，深圳证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此我司高度重视，对公司内部控制和风险管理工作进行了全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力，目前公司已经完成相关整改工作并向中国证监会及深圳证监局提交了整改完成报告，监管部门进行了整改完成的现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
兴业证券	1	34,072,302.05	100.00%	24,056.33	100.00%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；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。

博时基金管理有限公司

2014 年 3 月 29 日