

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 28 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 2014 年 8 月 27 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 2014 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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
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	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§ 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	27
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	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序的前五名债券投资明细	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 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
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	39
§ 9	开放式基金份额变动	39
§ 10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议	40
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.....	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
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	备查文件目录	43
11.1	备查文件目录	43
11.2	存放地点	43
11.3	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	11,484,008,083.74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
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.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（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	-350,620,150.89
本期利润	-356,011,130.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0297
本期加权平均净值利润率	-4.77%
本期基金份额净值增长率	-4.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014年6月30日）
期末可供分配利润	-4,294,515,167.28
期末可供分配基金份额利润	-0.3740
期末基金资产净值	7,189,492,916.46
期末基金份额净值	0.6260
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014年6月30日）
基金份额累计净值增长率	97.96%

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

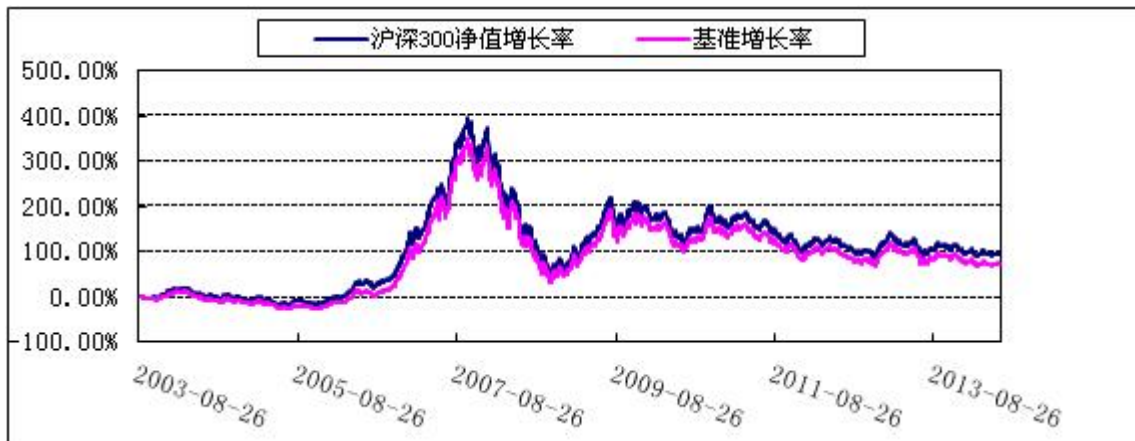
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.15%	0.78%	0.39%	0.74%	0.76%	0.04%

过去三个月	2.17%	0.84%	0.85%	0.83%	1.32%	0.01%
过去六个月	-4.46%	0.99%	-6.69%	0.99%	2.23%	0.00%
过去一年	2.10%	1.12%	-1.42%	1.11%	3.52%	0.01%
过去三年	-24.58%	1.24%	-27.36%	1.23%	2.78%	0.01%
自基金成立起至今	97.96%	1.62%	73.58%	1.64%	24.38%	-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 2014 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理四十七只开放式基金，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 1041 亿元人民币，累计分红超过 628 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，标准股票型基金中，截至 6 月 30 日，博时医疗保健股票基金、博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在 355 只标准型股票基金中排名前 1/4，博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在 355 只标准型股票基金中排名前 1/3。标准指数股票型基金中，博时沪深 300 指数、博时上证超大盘 ETF、博时深证基本面 200ETF 三只基金今年以来净值增长率在 150 只同类基金中排名前 1/2。混合基金方面，今年以来博时裕益收益率在 35 只灵活配置型同类基金中排名前 1/2，博时平衡配置在 16 只股债平衡型同类基金中排名前 1/2。

固定收益方面，博时信用债纯债今年以来收益率在 101 只长期标准债券型基金中排名前 1/4，博时安丰 18 个月定期开放基金排名前 1/3，博时安盈债券基金（A 类）在 6 只中短期标准债券型基金中排名前 1/2。

海外投资方面业绩方面，截至 6 月 30 日，博时亚洲票息收益债券基金在同类可比 7 只 QDII 债券基金中排名第 1，博时大中华亚太精选今年以来收益率在 9 只 QDII 亚太股票型基金中排名第 2，博时抗通胀在 8 只 QDII 商品基金中排名第 2。

2、客户服务

2014 年上半年，博时基金共举办各类渠道培训活动 284 场，参加人数 7355 人。

3、其他大事件

2014 年 1 月 9 日，金融界网站在北京举办“第二届领航中国 2013 金融行业年度颁奖典礼”，博时基金荣获“2013 金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖”。

2014 年 1 月 11 日，在和讯网主办的 2013 年第十一届财经风云榜基金行业评选中，博时基金荣获“2013 年度基金业最佳投资者关系奖”。

2014 年 6 月 16 日，大智慧在上海举办“智慧财经巅峰榜”，博时基金荣获“十佳基金公司”奖项，基金经理张溪冈荣获智慧财经巅峰榜“最佳基金经理”奖项。

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		
王红欣	ETF 及量化投资组投资总监-基金经理	2013-1-9	-	20	1994 年起先后在 RXR 期货公司、Aeltus 投资公司、Putnam 投资公司、Acadian 资产管理公司、易方达资产管理（香港）公司工作。2012 年 10 月加入博时基金管理有限公司。现任股票投资部 ETF 及量化组投资总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

郑宇泉	基金经理助理	2013-1-30		7	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。
林景艺	高级研究员兼基金经理助理	2014-1-13		4	2010年7月加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部高级研究员兼基金经理助理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、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

2014年初A股市场基本延续2013年的风格分化，以创业板为代表的小盘股大幅领先以沪深300为代表的大盘股。2月下旬开始，经济增速减弱逐渐被市场预期并证实，市场出现系统性下跌，新兴成长与传统周期均出现显著回落，两者的收益率差异减少。二季度市场结构分化的波动性加强，风格转换较为频繁，大小盘的收益率差异未再扩大。截至6月30日，沪深300指数收益率为-7.08%，而创业板指则上涨7.69%。板块方面，计算机、通信和餐饮旅游涨幅居前，煤炭、非银金融和农林牧渔跌幅显著。同时，主题性投资机会在上半年也层出不穷，国企改革、信息安全、可穿戴设备等主题都表现抢眼。

在投资策略上我们运用数量化抽样复制的方法，以估值和基本面为主，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，利用风险模型进行组合优化，在严格的跟踪误差约束、紧密跟踪指数的同时，创造一定超额收益，从而更好的为持有人服

务。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2014 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.626 元，累计净值为 2.606 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-4.46%，同期业绩基准增长率为-6.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年市场对于宏观经济的悲观预期已经充分反应，7 月初的宏观经济数据显示出企稳态势，经济增长率和流动性指标都超出市场预期。虽然宏观经济全面复苏尚未开始，但是进一步恶化的预期不强，市场情绪在波动中逐步转向积极。沪深 300 指数的波动性持续降低，六月末整体市盈率仅 8.1 倍，依然处于历史地位。政策方面，稳增长政策继续推进，基建投资的加速部分对冲房地产市场的疲态，沪港通推出预计有助于抬升蓝筹股估值中枢。流动性方面，六月末并未出现去年同期的紧张情况，货币环境相对宽松。产业资本方面，低估值行业得到关注，2014 年上半年净增持的行业为房地产、银行和商贸零售等，减持居前的则是计算机、电力设备。同时，创业板及全市场解禁规模在三季度将达近四个季度新高，新兴成长估值压力增大。

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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	388,589,456.52	400,774,200.11
结算备付金		14,359,058.44	11,612,183.54

存出保证金		1,159,839.66	991,867.17
交易性金融资产	6.4.3.2	6,804,155,606.73	8,073,770,346.77
其中：股票投资		6,777,706,676.91	7,944,498,295.81
基金投资		-	-
债券投资		26,448,929.82	129,272,050.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		13,836,419.92	52,348,122.27
应收利息	6.4.3.5	153,760.54	410,177.76
应收股利		-	-
应收申购款		418,661.87	928,955.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		7,222,672,803.68	8,540,835,853.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债：			
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		14,762,151.35	39,618,452.75
应付赎回款		3,498,059.87	4,757,452.17
应付管理人报酬		5,751,902.02	7,194,029.98
应付托管费		1,173,857.57	1,468,169.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	7,279,452.47	6,692,364.39
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	714,463.94	733,772.56
负债合计		33,179,887.22	60,464,241.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	11,484,008,083.74	12,942,911,234.67
未分配利润	6.4.3.10	-4,294,515,167.28	-4,462,539,622.64
所有者权益合计		7,189,492,916.46	8,480,371,612.03
负债和所有者权益总计		7,222,672,803.68	8,540,835,853.27

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6260 元，基金份额总额 11,484,008,083.74 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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
一、收入		-288,802,104.87	-1,040,945,669.94
1. 利息收入		2,030,639.41	1,965,356.20
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,494,593.30	1,958,647.97
债券利息收入		532,398.46	6,708.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,647.65	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-286,361,374.43	-196,132,167.49
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-365,676,322.40	-304,432,340.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-11,476,933.42	1,657,183.77
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	90,791,881.39	106,642,989.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-5,390,979.18	-847,617,477.45
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	919,609.33	838,618.80
减：二、费用		67,209,025.20	73,125,141.33
1. 管理人报酬		36,397,870.15	45,705,012.58
2. 托管费		7,428,136.79	9,327,553.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	23,146,190.79	17,860,938.45
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	236,827.47	231,636.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-356,011,130.07	-1,114,070,811.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-356,011,130.07	-1,114,070,811.27

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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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）	12,942,911,234.67	-4,462,539,622.64	8,480,371,612.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-356,011,130.07	-356,011,130.07
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）	-1,458,903,150.93	524,035,585.43	-934,867,565.50
其中：1. 基金申购款	402,378,937.79	-150,163,348.10	252,215,589.69
2. 基金赎回款	-1,861,282,088.72	674,198,933.53	-1,187,083,155.19
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）	11,484,008,083.74	-4,294,515,167.28	7,189,492,916.46
项目	上年度可比期间 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

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度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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、债券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、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

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 2014年6月30日
活期存款	388,589,456.52
定期存款	-
其他存款	-
合计	388,589,456.52

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,173,352,038.69	6,777,706,676.91	-395,645,361.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	24,195,400.00	26,448,929.82
	银行间市场	-	-

	合计	24,195,400.00	26,448,929.82	2,253,529.82
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,197,547,438.69	6,804,155,606.73	-393,391,831.96

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	76,949.28
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	6,463.74
应收债券利息	69,825.62
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	521.90
合计	153,760.54

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,279,452.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,279,452.47

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,166.12
预提费用	213,230.67
其他	67.15

合计	714,463.94
----	------------

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,942,911,234.67	12,942,911,234.67
本期申购	402,378,937.79	402,378,937.79
本期赎回（以“-”号填列）	-1,861,282,088.72	-1,861,282,088.72
本期末	11,484,008,083.74	11,484,008,083.74

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	-2,402,405,905.45	-2,060,133,717.19	-4,462,539,622.64
本期利润	-350,620,150.89	-5,390,979.18	-356,011,130.07
本期基金份额交易产生的变动数	287,269,934.22	236,765,651.21	524,035,585.43
其中：基金申购款	-80,662,967.76	-69,500,380.34	-150,163,348.10
基金赎回款	367,932,901.98	306,266,031.55	674,198,933.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,465,756,122.12	-1,828,759,045.16	-4,294,515,167.28

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	活期存款利息收入
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	107,749.88
其他	15,479.11
合计	1,494,593.30

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	8,694,887,171.66
买卖股票差价收入	-365,676,322.40

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期

	2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	158,373,750.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	168,840,533.89
减：应收利息总额	1,010,149.93
债券投资收益	-11,476,933.42

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 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	90,791,881.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	90,791,881.39

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,390,979.18
——股票投资	-12,736,813.15
——债券投资	7,345,833.97
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-5,390,979.18

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	844,140.22
配股手续费返还	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
转换费收入	75,469.11
配债手续费返还	-
其他	-
合计	919,609.33

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. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资

产。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	23,146,190.79
银行间市场交易费用	-
合计	23,146,190.79

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014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	14,596.80
银行间帐户服务费	9,000.00
合计	236,827.47

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

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		上年度可比期间	
	2014年1月1日至2014年6月30日		2013年1月1日至2013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	2,680,005,824.71	16.91%	2,095,920,926.03	16.93%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	2,286,248.25	17.82%	1,740,438.96	23.91%
关联方名称	上年度可比期间 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%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	36,397,870.15
其中：支付销售机构的客户维护费	3,174,276.45	3,987,874.91

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	7,428,136.79

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	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	388,589,456.52	1,371,364.31	466,870,352.31	1,852,118.02

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

无。

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（2014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

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
600363	联创光电	2014-6-30	重大事项公告	8.27	2014-7-1	8.29	7,600	60,770.40	62,852.00	
600485	中创信测	2014-6-25	公告重大事项	18.21	2014-7-3	20.03	495,007	8,582,102.77	9,014,077.47	
600637	百视通	2014-5-29	重大资产重组	32.03	暂未公示	尚未复牌	655,226	23,040,114.54	20,986,888.78	
600685	广船国际	2014-4-7	重大资产重组	17.13	暂未公示	尚未复牌	10,900	199,991.82	186,717.00	
600755	厦门国贸	2014-6-27	重大事项公告	4.85	2014-7-7	4.47	195,511	979,192.70	948,228.35	
600819	耀皮玻璃	2014-3-27	重大事项公告	9.24	2014-8-7	9.24	16	91.55	147.84	
600832	东方明珠	2014-5-29	重大资产重组	10.98	暂未公示	尚未复牌	2,308,300	25,325,342.81	25,345,134.00	
600862	南通科技	2014-3-3	重大资产重组	3.03	暂未公示	尚未复牌	152,900	471,828.00	463,287.00	
601012	隆基股份	2014-6-19	重大事项公告	15.50	2014-7-1	15.60	404,200	5,722,612.55	6,265,100.00	
601669	中国电建	2014-5-13	重大事	2.79	暂未公示	尚未复牌	4,278,300	11,521,922.30	11,936,457.00	

			项公告						
000009	中国宝安	2014-5-28	重大事 项公告	10.21	2014-8-1 5	9.33	126,900	1,253,504.00	1,295,649.00
000555	神州信息	2014-5-5	重大资 产重组	22.30	2014-7-2 3	24.53	34,753	743,645.81	774,991.90
000562	宏源证券	2013-10-31	重大资 产重组	8.22	2014-7-2 8	8.93	1,578,018	14,164,173.50	12,971,307.96
000612	焦作万方	2014-4-3	重大资 产重组	6.08	2014-8-1 8	6.69	1,100,000	6,048,168.32	6,688,000.00
000878	云南铜业	2014-4-17	重大事 项公告	7.61	2014-7-1 4	7.50	2,873,484	21,278,355.50	21,867,213.24
000893	东凌粮油	2014-3-26	重大资 产重组	10.64	2014-8-2 6	11.70	631,800	6,811,184.91	6,722,352.00
000960	锡业股份	2014-5-6	重大资 产重组	12.44	2014-8-5	13.68	100,400	1,195,988.16	1,248,976.00
002100	天康生物	2014-5-27	重大资 产重组	9.82	2014-8-2 5	10.80	54,122	514,422.35	531,478.04
002306	湘鄂情	2014-6-23	重大事 项公告	5.57	2014-7-2 9	6.13	59,500	359,191.55	331,415.00
300199	翰宇药业	2014-2-20	重大资 产重组	26.63	2014-8-2 0	29.00	280,232	7,026,190.05	7,462,578.16
合计								135,298,793.59	135,102,850.74

注：本基金截至 2014 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及绩效分析工作，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，将风险控制可在可承受的范围内。

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2014年6月30日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为0.37%（2013年12月31日，1.06%）。

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 2014 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等，其余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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1—5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2014年6月30日					
资产					
银行存款	388,589,456.52	-	-	-	388,589,456.52
结算备付金	14,359,058.44	-	-	-	14,359,058.44
存出保证金	1,159,839.66	-	-	-	1,159,839.66
交易性金融资产		-	26,448,929.82	6,777,706,676.91	6,804,155,606.73
应收证券清算款	-	-	-	13,836,419.92	13,836,419.92
应收利息	-	-	-	153,760.54	153,760.54
应收申购款	-	-	-	418,661.87	418,661.87
资产总计	404,108,354.62		26,448,929.82	6,792,115,519.24	7,222,672,803.68
负债					
应付证券清算款	-	-	-	14,762,151.35	14,762,151.35
应付赎回款	-	-	-	3,498,059.87	3,498,059.87
应付管理人报酬	-	-	-	5,751,902.02	5,751,902.02
应付托管费	-	-	-	1,173,857.57	1,173,857.57
应付交易费用	-	-	-	7,279,452.47	7,279,452.47
其他负债	-	-	-	714,463.94	714,463.94
负债总计	-	-	-	33,179,887.22	33,179,887.22
利率敏感度缺口	404,108,354.62		26,448,929.82	6,758,935,632.02	7,189,492,916.46
上年度末 2013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	400,774,200.11	-	-	-	400,774,200.11
结算备付金	11,612,183.54	-	-	-	11,612,183.54
存出保证金	991,867.17	-	-	-	991,867.17
交易性金融资产	39,544,000.00	71,423,372.00	18,304,678.96	7,944,498,295.81	8,073,770,346.77
应收证券清算款	-	-	-	52,348,122.27	52,348,122.27
应收利息	-	-	-	410,177.76	410,177.76
应收申购款	-	-	-	928,955.65	928,955.65
资产总计	452,922,250.82	71,423,372.00	18,304,678.96	7,998,185,551.49	8,540,835,853.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	39,618,452.75	39,618,452.75
应付赎回款	-	-	-	4,757,452.17	4,757,452.17
应付管理人报酬	-	-	-	7,194,029.98	7,194,029.98
应付托管费	-	-	-	1,468,169.39	1,468,169.39
应付交易费用	-	-	-	6,692,364.39	6,692,364.39
其他负债	-	-	-	733,772.56	733,772.56
负债总计	-	-	-	60,464,241.24	60,464,241.24

利率敏感度缺口	452,922,250.82	71,423,372.00	18,304,678.96	7,937,721,310.25	8,480,371,612.03
---------	----------------	---------------	---------------	------------------	------------------

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2014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0.37%（2013年12月31日为1.52%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2013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 2014年6月30日		上年度末 2013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	6,777,706,676.91	94.27	7,944,498,295.81	93.68

资				
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,777,706,676.91	94.27	7,944,498,295.81	93.68

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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	沪深300指数上升5%	增加约35,026	增加约41,009
	沪深300指数下降5%	减少约35,026	减少约41,009

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2014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6,669,052,755.99元，属于第二层级的余额为135,102,850.74元，无属于第三层级的余额(2013年12月31日：第一层级7,924,265,951.51元，第二层级149,504,395.26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(2013年12月31日：同)。本基金本期无第三层次公允价值变动(2013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	6,777,706,676.91	93.84
	其中：股票	6,777,706,676.91	93.84
2	固定收益投资	26,448,929.82	0.37
	其中：债券	26,448,929.82	0.37
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	402,948,514.96	5.58
7	其他各项资产	15,568,681.99	0.22
8	合计	7,222,672,803.68	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	120,454.29	0.00
B	采矿业	507,158,014.27	7.05
C	制造业	2,434,811,725.90	33.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	183,227,159.70	2.55
E	建筑业	253,493,558.39	3.53
F	批发和零售业	297,725,548.59	4.14
G	交通运输、仓储和邮政业	107,891,486.03	1.50

H	住宿和餐饮业	331,415.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	277,578,160.08	3.86
J	金融业	2,202,927,761.41	30.64
K	房地产业	345,457,689.74	4.81
L	租赁和商务服务业	20,102,747.78	0.28
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	67,187,910.58	0.93
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	78,090,650.15	1.09
S	综合	1,602,395.00	0.02
	合计	6,777,706,676.91	94.27

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	8,351,718	328,556,586.12	4.57
2	601166	兴业银行	24,091,900	241,641,757.00	3.36
3	600036	招商银行	23,400,000	239,616,000.00	3.33
4	600000	浦发银行	23,460,700	212,319,335.00	2.95
5	000001	平安银行	21,088,037	208,982,446.67	2.91
6	601088	中国神华	10,855,369	157,837,065.26	2.20
7	000002	万科A	16,118,825	133,302,682.75	1.85
8	600519	贵州茅台	935,055	132,759,108.90	1.85
9	600030	中信证券	11,579,574	132,701,918.04	1.85
10	600028	中国石化	25,030,894	131,912,811.38	1.83
11	600104	上汽集团	8,459,844	129,435,613.20	1.80
12	600015	华夏银行	15,052,672	123,431,910.40	1.72
13	000651	格力电器	3,479,746	102,478,519.70	1.43
14	601668	中国建筑	32,557,393	91,811,848.26	1.28
15	601929	吉视传媒	7,755,382	88,721,570.08	1.23
16	600016	民生银行	13,777,297	85,557,014.37	1.19
17	601006	大秦铁路	13,286,188	83,835,846.28	1.17
18	600109	国金证券	4,094,232	81,352,389.84	1.13
19	600252	中恒集团	6,741,316	79,075,636.68	1.10
20	600150	中国船舶	3,576,372	75,318,394.32	1.05
21	601299	中国北车	16,056,717	72,897,495.18	1.01
22	600585	海螺水泥	4,616,600	72,572,952.00	1.01
23	600352	浙江龙盛	4,229,100	68,299,965.00	0.95
24	000623	吉林敖东	4,381,222	67,996,565.44	0.95
25	601288	农业银行	26,811,130	67,564,047.60	0.94
26	600690	青岛海尔	4,552,649	67,197,099.24	0.93
27	600887	伊利股份	2,000,500	66,256,560.00	0.92

28	601390	中国中铁	24,946,164	64,361,103.12	0.90
29	600741	华域汽车	6,155,515	60,200,936.70	0.84
30	000333	美的集团	3,070,993	59,331,584.76	0.83
31	601998	中信银行	13,210,208	56,407,588.16	0.78
32	002415	海康威视	3,006,065	50,922,741.10	0.71
33	601607	上海医药	4,001,253	49,735,574.79	0.69
34	600369	西南证券	5,803,482	49,619,771.10	0.69
35	600837	海通证券	5,239,935	47,945,405.25	0.67
36	601009	南京银行	5,990,300	47,922,400.00	0.67
37	600050	中国联通	14,748,975	47,639,189.25	0.66
38	600549	厦门钨业	1,845,768	46,882,507.20	0.65
39	000800	一汽轿车	4,872,410	46,775,136.00	0.65
40	600583	海油工程	6,282,813	46,304,331.81	0.64
41	600153	建发股份	8,440,232	45,999,264.40	0.64
42	000860	顺鑫农业	3,270,540	45,918,381.60	0.64
43	601336	新华保险	2,170,918	45,871,497.34	0.64
44	601186	中国铁建	9,637,621	44,429,432.81	0.62
45	000793	华闻传媒	3,669,765	43,119,738.75	0.60
46	002142	宁波银行	4,623,963	42,540,459.60	0.59
47	000069	华侨城 A	8,825,722	41,392,636.18	0.58
48	601988	中国银行	15,823,000	40,348,650.00	0.56
49	000543	皖能电力	6,068,464	40,051,862.40	0.56
50	000630	铜陵有色	4,323,645	38,739,859.20	0.54
51	600739	辽宁成大	2,462,200	37,499,306.00	0.52
52	601519	大智慧	6,329,191	37,152,351.17	0.52
53	600019	宝钢股份	8,835,632	36,226,091.20	0.50
54	601989	中国重工	7,349,916	35,426,595.12	0.49
55	600642	申能股份	8,185,105	35,359,653.60	0.49
56	000876	新希望	3,060,666	34,554,919.14	0.48
57	601601	中国太保	1,926,676	34,275,566.04	0.48
58	600048	保利地产	6,909,225	34,269,756.00	0.48
59	601808	中海油服	1,942,690	34,171,917.10	0.48
60	000540	中天城投	6,675,177	34,043,402.70	0.47
61	000050	深天马 A	2,718,888	33,986,100.00	0.47
62	600569	安阳钢铁	17,645,101	32,466,985.84	0.45
63	000028	国药一致	768,648	30,707,487.60	0.43
64	002153	石基信息	596,457	30,598,244.10	0.43
65	002437	誉衡药业	591,700	30,472,550.00	0.42
66	002410	广联达	1,115,076	29,482,609.44	0.41
67	000538	云南白药	555,972	29,021,738.40	0.40
68	601618	中国中冶	16,599,644	28,385,391.24	0.39
69	002304	洋河股份	544,800	27,648,600.00	0.38
70	000776	广发证券	2,737,797	26,830,410.60	0.37
71	600518	康美药业	1,770,181	26,464,205.95	0.37

72	000883	湖北能源	4,871,783	25,674,296.41	0.36
73	000060	中金岭南	3,768,839	25,628,105.20	0.36
74	600089	特变电工	2,996,550	25,440,709.50	0.35
75	600832	东方明珠	2,308,300	25,345,134.00	0.35
76	601328	交通银行	6,469,000	25,099,720.00	0.35
77	601766	中国南车	5,525,999	24,866,995.50	0.35
78	600240	华业地产	4,899,381	23,908,979.28	0.33
79	600011	华能国际	4,194,862	23,742,918.92	0.33
80	600380	健康元	4,595,616	23,161,904.64	0.32
81	600997	开滦股份	5,252,685	22,901,706.60	0.32
82	601238	广汽集团	2,938,288	22,125,308.64	0.31
83	600893	航空动力	855,364	22,042,730.28	0.31
84	000878	云南铜业	2,873,484	21,867,213.24	0.30
85	600724	宁波富达	5,479,356	21,588,662.64	0.30
86	002462	嘉事堂	1,139,616	21,219,649.92	0.30
87	600827	友谊股份	1,915,240	21,029,335.20	0.29
88	600637	百视通	655,226	20,986,888.78	0.29
89	600998	九州通	1,562,745	20,925,155.55	0.29
90	600694	大商股份	777,162	19,840,945.86	0.28
91	002440	闰土股份	1,071,567	19,823,989.50	0.28
92	000625	长安汽车	1,609,900	19,817,869.00	0.28
93	601169	北京银行	2,457,027	19,803,637.62	0.28
94	000513	丽珠集团	399,913	18,887,890.99	0.26
95	600801	华新水泥	2,829,367	18,871,877.89	0.26
96	000858	五粮液	1,038,948	18,628,337.64	0.26
97	002202	金风科技	1,915,377	18,176,927.73	0.25
98	601098	中南传媒	1,242,115	17,936,140.60	0.25
99	600489	中金黄金	2,239,890	17,023,164.00	0.24
100	600340	华夏幸福	668,235	16,819,474.95	0.23
101	601168	西部矿业	3,040,800	16,633,176.00	0.23
102	002475	立讯精密	506,240	16,594,547.20	0.23
103	000425	徐工机械	2,323,900	15,918,715.00	0.22
104	000966	长源电力	2,351,002	14,999,392.76	0.21
105	600641	万业企业	3,523,943	13,990,053.71	0.19
106	000024	招商地产	1,310,859	13,659,150.78	0.19
107	000562	宏源证券	1,578,018	12,971,307.96	0.18
108	603993	洛阳钼业	1,930,202	12,932,353.40	0.18
109	601718	际华集团	5,173,632	12,727,134.72	0.18
110	600711	盛屯矿业	1,608,134	12,398,713.14	0.17
111	600177	雅戈尔	1,760,800	12,378,424.00	0.17
112	002056	横店东磁	627,302	12,207,296.92	0.17
113	000600	建投能源	2,160,400	12,076,636.00	0.17
114	601669	中国电建	4,278,300	11,936,457.00	0.17
115	601258	庞大集团	2,683,265	11,779,533.35	0.16

116	002456	欧菲光	546,200	11,705,066.00	0.16
117	600547	山东黄金	737,988	11,424,054.24	0.16
118	600438	通威股份	1,201,024	11,397,717.76	0.16
119	002065	东华软件	564,320	11,354,118.40	0.16
120	600791	京能置业	2,494,172	11,273,657.44	0.16
121	002124	天邦股份	1,276,462	11,245,630.22	0.16
122	002540	亚太科技	1,060,300	11,175,562.00	0.16
123	002574	明牌珠宝	431,360	10,995,366.40	0.15
124	000963	华东医药	203,290	10,977,660.00	0.15
125	000758	中色股份	1,100,021	10,934,208.74	0.15
126	000728	国元证券	1,133,600	10,701,184.00	0.15
127	002082	栋梁新材	1,417,651	10,448,087.87	0.15
128	000596	古井贡酒	545,406	10,400,892.42	0.14
129	600761	安徽合力	1,041,054	10,243,971.36	0.14
130	000829	天音控股	1,206,110	10,203,690.60	0.14
131	600201	金宇集团	301,970	9,397,306.40	0.13
132	600869	远东电缆	1,141,000	9,299,150.00	0.13
133	000937	冀中能源	1,583,900	9,234,137.00	0.13
134	000951	中国重汽	783,700	9,224,149.00	0.13
135	601899	紫金矿业	4,223,806	9,207,897.08	0.13
136	600875	东方电气	763,300	9,060,371.00	0.13
137	600485	中创信测	495,007	9,014,077.47	0.13
138	600197	伊力特	996,400	9,007,456.00	0.13
139	600018	上港集团	2,011,517	8,951,250.65	0.12
140	002400	省广股份	361,531	8,886,431.98	0.12
141	601928	凤凰传媒	935,315	8,679,723.20	0.12
142	600872	中炬高新	799,280	8,528,317.60	0.12
143	600239	云南城投	1,938,671	8,355,672.01	0.12
144	000848	承德露露	420,021	8,345,817.27	0.12
145	600027	华电国际	2,702,212	8,295,790.84	0.12
146	600602	仪电电子	1,370,900	8,156,855.00	0.11
147	000061	农产品	855,000	7,891,650.00	0.11
148	000039	中集集团	580,450	7,812,857.00	0.11
149	000709	河北钢铁	4,164,000	7,745,040.00	0.11
150	002508	老板电器	272,464	7,702,557.28	0.11
151	600491	龙元建设	2,285,329	7,518,732.41	0.10
152	300199	翰宇药业	280,232	7,462,578.16	0.10
153	600780	通宝能源	1,700,135	7,327,581.85	0.10
154	002155	辰州矿业	971,700	7,268,316.00	0.10
155	600971	恒源煤电	1,306,638	6,977,446.92	0.10
156	600348	阳泉煤业	1,230,900	6,942,276.00	0.10
157	601600	中国铝业	2,283,600	6,942,144.00	0.10
158	600748	上实发展	934,300	6,941,849.00	0.10
159	600261	阳光照明	702,150	6,937,242.00	0.10

160	601678	滨化股份	920,468	6,885,100.64	0.10
161	600460	士兰微	1,162,807	6,883,817.44	0.10
162	002577	雷柏科技	258,800	6,853,024.00	0.10
163	600428	中远航运	2,320,965	6,800,427.45	0.09
164	000893	东凌粮油	631,800	6,722,352.00	0.09
165	000612	焦作万方	1,100,000	6,688,000.00	0.09
166	000671	阳光城	749,282	6,586,188.78	0.09
167	600481	双良节能	670,138	6,547,248.26	0.09
168	600188	兖州煤业	932,303	6,451,536.76	0.09
169	600594	益佰制药	155,100	6,379,263.00	0.09
170	600183	生益科技	1,030,600	6,348,496.00	0.09
171	002064	华峰氨纶	733,526	6,278,982.56	0.09
172	601012	隆基股份	404,200	6,265,100.00	0.09
173	002214	大立科技	344,160	6,187,996.80	0.09
174	300127	银河磁体	435,328	5,937,873.92	0.08
175	300267	尔康制药	167,600	5,783,876.00	0.08
176	002254	泰和新材	682,300	5,765,435.00	0.08
177	300269	联建光电	165,766	5,707,323.38	0.08
178	000915	山大华特	212,886	5,688,313.92	0.08
179	002001	新和成	455,138	5,639,159.82	0.08
180	600211	西藏药业	216,253	5,568,514.75	0.08
181	002547	春兴精工	458,700	5,490,639.00	0.08
182	000786	北新建材	387,800	5,320,616.00	0.07
183	600077	宋都股份	1,476,641	5,286,374.78	0.07
184	002203	海亮股份	454,652	5,005,718.52	0.07
185	002500	山西证券	760,150	4,933,373.50	0.07
186	300146	汤臣倍健	199,187	4,909,959.55	0.07
187	600816	安信信托	335,308	4,828,435.20	0.07
188	601099	太平洋	746,300	4,753,931.00	0.07
189	000756	新华制药	855,459	4,713,579.09	0.07
190	600312	平高电气	336,301	4,688,035.94	0.07
191	002309	中利科技	267,390	4,649,912.10	0.06
192	600426	华鲁恒升	643,500	4,633,200.00	0.06
193	002683	宏大爆破	187,910	4,594,399.50	0.06
194	600429	三元股份	633,354	4,579,149.42	0.06
195	600812	华北制药	924,751	4,540,527.41	0.06
196	600657	信达地产	1,428,692	4,528,953.64	0.06
197	000550	江铃汽车	155,800	4,515,084.00	0.06
198	600886	国投电力	884,727	4,512,107.70	0.06
199	600825	新华传媒	573,600	4,479,816.00	0.06
200	300017	网宿科技	70,122	4,473,783.60	0.06
201	600180	瑞茂通	421,400	4,445,770.00	0.06
202	600537	亿晶光电	425,100	4,387,032.00	0.06
203	002028	思源电气	456,000	4,286,400.00	0.06

204	002481	双塔食品	312,182	4,183,238.80	0.06
205	002249	大洋电机	295,727	4,110,605.30	0.06
206	000528	柳工	670,900	3,904,638.00	0.05
207	002198	嘉应制药	436,700	3,869,162.00	0.05
208	000027	深圳能源	666,400	3,745,168.00	0.05
209	002328	新朋股份	327,822	3,724,057.92	0.05
210	000042	中洲控股	342,478	3,719,311.08	0.05
211	600037	歌华有线	349,400	3,675,688.00	0.05
212	600782	新钢股份	1,340,816	3,673,835.84	0.05
213	000690	宝新能源	868,601	3,543,892.08	0.05
214	600597	光明乳业	220,799	3,541,615.96	0.05
215	002233	塔牌集团	559,700	3,391,782.00	0.05
216	600255	鑫科材料	405,600	3,390,816.00	0.05
217	300058	蓝色光标	125,270	3,324,665.80	0.05
218	000665	湖北广电	268,730	3,211,323.50	0.04
219	002461	珠江啤酒	222,000	3,134,640.00	0.04
220	002218	拓日新能	309,261	3,089,517.39	0.04
221	600703	三安光电	130,800	3,064,644.00	0.04
222	000030	富奥股份	460,996	2,973,424.20	0.04
223	002416	爱施德	199,990	2,969,851.50	0.04
224	600500	中化国际	459,800	2,961,112.00	0.04
225	000065	北方国际	222,485	2,712,092.15	0.04
226	600026	中海发展	661,172	2,671,134.88	0.04
227	600517	置信电气	248,402	2,523,764.32	0.04
228	002184	海得控制	211,800	2,456,880.00	0.03
229	000927	一汽夏利	670,920	2,395,184.40	0.03
230	002483	润邦股份	250,813	2,350,117.81	0.03
231	600595	中孚实业	648,430	2,347,316.60	0.03
232	002370	亚太药业	170,856	2,268,967.68	0.03
233	600890	中房股份	397,200	2,260,068.00	0.03
234	002146	荣盛发展	235,260	2,227,912.20	0.03
235	000572	海马汽车	600,876	2,223,241.20	0.03
236	002099	海翔药业	313,500	2,172,555.00	0.03
237	601216	内蒙君正	200,030	2,106,315.90	0.03
238	601208	东材科技	303,400	2,047,950.00	0.03
239	600096	云天化	290,514	2,042,313.42	0.03
240	002110	三钢闽光	457,906	1,978,153.92	0.03
241	000780	平庄能源	489,549	1,928,823.06	0.03
242	600823	世茂股份	224,300	1,915,522.00	0.03
243	300134	大富科技	50,800	1,889,760.00	0.03
244	002358	森源电气	75,888	1,886,575.68	0.03
245	600277	亿利能源	287,977	1,871,850.50	0.03
246	000100	TCL集团	795,900	1,814,652.00	0.03
247	601992	金隅股份	321,999	1,809,634.38	0.03

248	601628	中国人寿	127,800	1,739,358.00	0.02
249	000539	粤电力A	366,835	1,735,129.55	0.02
250	600269	赣粤高速	625,500	1,720,125.00	0.02
251	000748	长城信息	75,400	1,709,318.00	0.02
252	600859	王府井	106,300	1,679,540.00	0.02
253	300210	森远股份	151,916	1,634,616.16	0.02
254	000409	山东地矿	176,800	1,608,880.00	0.02
255	600105	永鼎股份	204,900	1,546,995.00	0.02
256	600990	四创电子	56,310	1,525,437.90	0.02
257	000959	首钢股份	610,350	1,495,357.50	0.02
258	600508	上海能源	174,176	1,372,506.88	0.02
259	600584	长电科技	152,647	1,347,873.01	0.02
260	000768	中航飞机	127,400	1,341,522.00	0.02
261	002495	佳隆股份	163,511	1,339,155.09	0.02
262	601818	光大银行	527,100	1,338,834.00	0.02
263	002375	亚厦股份	58,500	1,319,760.00	0.02
264	002673	西部证券	121,300	1,310,040.00	0.02
265	600717	天津港	162,600	1,297,548.00	0.02
266	000009	中国宝安	126,900	1,295,649.00	0.02
267	000960	锡业股份	100,400	1,248,976.00	0.02
268	600350	山东高速	389,041	1,155,451.77	0.02
269	600372	中航电子	50,800	1,151,636.00	0.02
270	002563	森马服饰	42,202	1,145,784.30	0.02
271	600118	中国卫星	56,700	1,047,816.00	0.01
272	600705	中航投资	63,700	1,023,659.00	0.01
273	002470	金正大	53,179	1,020,505.01	0.01
274	001896	豫能控股	154,323	1,016,988.57	0.01
275	600170	上海建工	236,860	1,016,129.40	0.01
276	000895	双汇发展	27,774	994,031.46	0.01
277	600755	厦门国贸	195,511	948,228.35	0.01
278	601555	东吴证券	131,900	939,128.00	0.01
279	000411	英特集团	74,502	862,733.16	0.01
280	300212	易华录	26,013	814,727.16	0.01
281	600072	*ST 钢构	92,700	803,709.00	0.01
282	600487	亨通光电	54,642	785,751.96	0.01
283	000555	神州信息	34,753	774,991.90	0.01
284	600219	南山铝业	152,499	765,544.98	0.01
285	000541	佛山照明	71,400	711,144.00	0.01
286	600316	洪都航空	41,207	704,227.63	0.01
287	300020	银江股份	22,007	673,414.20	0.01
288	000719	大地传媒	56,026	663,908.10	0.01
289	002092	中泰化学	105,700	653,226.00	0.01
290	600122	宏图高科	128,505	639,954.90	0.01
291	000839	中信国安	80,500	611,800.00	0.01

292	000685	中山公用	54,700	556,299.00	0.01
293	002568	百润股份	29,830	536,940.00	0.01
294	002100	天康生物	54,122	531,478.04	0.01
295	000900	现代投资	114,200	526,462.00	0.01
296	600004	白云机场	68,200	480,128.00	0.01
297	600862	南通科技	152,900	463,287.00	0.01
298	600563	法拉电子	13,900	462,175.00	0.01
299	002473	圣莱达	21,443	461,024.50	0.01
300	601107	四川成渝	167,200	453,112.00	0.01
301	600845	宝信软件	14,400	427,824.00	0.01
302	000988	华工科技	41,601	390,633.39	0.01
303	000767	漳泽电力	122,800	336,472.00	0.00
304	002306	湘鄂情	59,500	331,415.00	0.00
305	000533	万家乐	75,900	308,154.00	0.00
306	600783	鲁信创投	19,100	306,746.00	0.00
307	000739	普洛药业	43,600	277,732.00	0.00
308	600729	重庆百货	14,113	275,768.02	0.00
309	600707	彩虹股份	36,831	268,866.30	0.00
310	600098	广州发展	53,200	252,700.00	0.00
311	000888	峨眉山 A	12,289	226,363.38	0.00
312	300144	宋城演艺	8,419	223,777.02	0.00
313	600546	山煤国际	61,600	220,528.00	0.00
314	600655	豫园商城	26,774	197,056.64	0.00
315	002311	海大集团	17,700	194,877.00	0.00
316	000997	新大陆	11,000	190,960.00	0.00
317	002312	三泰电子	9,300	189,441.00	0.00
318	600685	广船国际	10,900	186,717.00	0.00
319	600398	海澜之家	19,501	179,409.20	0.00
320	600716	凤凰股份	20,074	163,402.36	0.00
321	000726	鲁泰 A	17,900	157,341.00	0.00
322	601339	百隆东方	15,100	122,159.00	0.00
323	002447	壹桥苗业	9,801	120,454.29	0.00
324	600510	黑牡丹	19,316	100,443.20	0.00
325	000969	安泰科技	10,700	98,440.00	0.00
326	002179	中航光电	4,574	80,273.70	0.00
327	002626	金达威	3,600	72,216.00	0.00
328	600363	联创光电	7,600	62,852.00	0.00
329	600376	首开股份	12,200	52,704.00	0.00
330	600660	福耀玻璃	5,800	48,720.00	0.00
331	000048	康达尔	5,200	47,788.00	0.00
332	300207	欣旺达	1,300	37,960.00	0.00
333	000961	中南建设	400	2,612.00	0.00
334	002271	东方雨虹	42	1,043.70	0.00
335	000418	小天鹅 A	27	275.67	0.00

336	600674	川投能源	23	270.02	0.00
337	002244	滨江集团	32	181.44	0.00
338	600819	耀皮玻璃	16	147.84	0.00
339	002327	富安娜	10	111.30	0.00
340	002122	天马股份	10	47.00	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	000001	平安银行	196,876,206.21	2.32
2	601318	中国平安	138,272,866.48	1.63
3	600000	浦发银行	117,616,273.21	1.39
4	600109	国金证券	117,244,928.53	1.38
5	600028	中国石化	102,760,545.61	1.21
6	601929	吉视传媒	97,181,580.62	1.15
7	601166	兴业银行	91,868,687.23	1.08
8	601519	大智慧	86,929,481.96	1.03
9	600150	中国船舶	80,160,405.23	0.95
10	601088	中国神华	79,351,611.07	0.94
11	601299	中国北车	69,573,812.22	0.82
12	600015	华夏银行	67,504,714.85	0.80
13	601988	中国银行	64,735,182.75	0.76
14	600252	中恒集团	61,213,443.52	0.72
15	601398	工商银行	60,260,419.03	0.71
16	601009	南京银行	60,104,189.49	0.71
17	601390	中国中铁	59,644,814.66	0.70
18	000623	吉林敖东	56,631,156.10	0.67
19	000800	一汽轿车	56,396,349.81	0.67
20	601099	太平洋	54,698,646.65	0.65

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	600016	民生银行	253,565,784.74	2.99
2	600000	浦发银行	110,875,858.29	1.31
3	000001	平安银行	89,560,608.17	1.06
4	600837	海通证券	82,325,451.63	0.97
5	000651	格力电器	73,981,287.35	0.87
6	601601	中国太保	72,438,650.40	0.85
7	601328	交通银行	71,217,393.88	0.84
8	000858	五粮液	69,552,680.84	0.82
9	601398	工商银行	69,014,351.57	0.81

10	600111	包钢稀土	68,562,589.77	0.81
11	601166	兴业银行	68,431,685.54	0.81
12	600886	国投电力	68,183,794.46	0.80
13	002230	科大讯飞	59,988,436.00	0.71
14	601600	中国铝业	59,286,142.19	0.70
15	600674	川投能源	56,636,578.75	0.67
16	000625	长安汽车	52,669,925.26	0.62
17	600535	天士力	50,711,585.53	0.60
18	600089	特变电工	50,072,693.02	0.59
19	000063	中兴通讯	49,918,528.86	0.59
20	600406	国电南瑞	49,779,732.94	0.59

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	7,540,832,365.91
卖出股票收入（成交）总额	8,329,210,849.26

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	26,448,929.82	0.37
8	其他	-	-
9	合计	26,448,929.82	0.37

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	113005	平安转债	170,000	18,159,400.00	0.25
2	110025	国金转债	71,440	8,201,312.00	0.11
3	128002	东华转债	514	88,217.82	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除中国石化（600028）外，没有出现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、处罚的情形。

中国石油化工股份有限公司与 2014 年 1 月 12 日发布公告称，国务院对山东省青岛市“1122”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复，同意国务院事故调查组的调查处理结果，认定是一起特别重大责任事故；同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议，对中国石化及当地政府的 48 名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯罪的 15 名责任人移送司法机关依法追究法律责任。

对该股票投资决策程序的说明：

根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,159,839.66
2	应收证券清算款	13,836,419.92
3	应收股利	-
4	应收利息	153,760.54
5	应收申购款	418,661.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,568,681.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113005	平安转债	18,159,400.00	0.25
2	128002	东华转债	88,217.82	0.00

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
583,216	19,690.83	685,806,361.18	5.97%	10,798,201,722.56	94.03%

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	1,656,179.61	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50-100
本基金基金经理持有本开放式基金	0.00

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、本基金的基金经理持有本基金的区间为：0.00份(含)。

§ 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
本报告期初基金份额总额	12,942,911,234.67
本报告期基金总申购份额	402,378,937.79
减：本报告期基金总赎回份额	1,861,282,088.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	11,484,008,083.74

§ 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

基金管理人于 2014 年 4 月 19 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，李志惠不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元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	
招商证券	3	2,680,005,824.71	16.91%	2,286,248.25	17.82%	-
中金公司	1	2,249,150,145.39	14.19%	2,047,658.74	15.96%	-
广州证券	1	1,886,199,137.23	11.90%	1,339,806.91	10.44%	-
新时代	1	1,649,004,301.78	10.40%	1,171,447.91	9.13%	新增
东方证券	3	1,438,515,561.91	9.08%	1,021,919.78	7.97%	-
国泰君安	4	1,308,651,995.48	8.26%	1,191,414.38	9.29%	-
民生证券	1	1,305,865,627.05	8.24%	927,685.61	7.23%	
中信建投	3	1,291,970,763.94	8.15%	1,176,181.08	9.17%	
中投证券	2	780,963,806.64	4.93%	711,004.15	5.54%	
华创证券	1	630,163,949.56	3.98%	447,658.72	3.49%	新增

中信证券	3	481,048,853.22	3.04%	371,729.35	2.90%	
平安证券	1	148,343,716.98	0.94%	135,052.54	1.05%	
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
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》（证监基金字[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；能根据本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	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加北京晟视天下投资管理有限公司其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	2014/5/29
2	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通建行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014/5/27
3	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014/5/22

	惠活动的公告		
4	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	2014/5/10
5	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	2014/4/29
6	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	2014/4/29
7	关于博时旗下部分基金增加北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构并参加其网上交易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	2014/4/15
8	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	2014/4/11
9	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	2014/4/3
10	关于博时旗下部分基金参加东莞银行股份有限公司手机银行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	2014/4/1
11	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	2014/3/29
12	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	2014/3/11
13	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	2014/2/28
14	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	2014/2/25
15	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	2014/2/18
16	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通工行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014/2/17
17	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	2014/2/15
18	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	2014/2/15
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	2014/1/23
20	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	2014/1/10
21	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司定期定额投资业务与网上及电话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	2014/1/3

§ 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

2014 年 8 月 28 日