

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  
2015 年半年度报告  
2015 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十七日

## § 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                      | 1  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 1  |
| 1.2 目录 .....                                  | 2  |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                         | 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 .....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 5  |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 5  |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 6  |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | 6  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 6  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....              | 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 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....       | 10 |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....                  | 10 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见 .....      | 10 |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | 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 .....                      | 12 |
| 6.4 报表附注 .....                                | 13 |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | 27 |
| 7.1 期末基金资产组合情况（适用于 ETF 联接基金填写） .....          | 27 |
| 7.2 期末投资目标基金明细（适用于 ETF 联接基金填写） .....          | 27 |
| 7.3 期末按行业分类的股票投资组合 .....                      | 27 |
| 7.4 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 |
| 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 28 |
| 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 29 |
| 7.7 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 .....      | 29 |
| 7.8 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 .....   | 29 |
| 7.9 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 .....   | 30 |
| 7.10 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 .....     | 30 |
| 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....               | 30 |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....               | 30 |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                           | 30 |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....                    | 31 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                   | 31 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                | 31 |
| 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 .....        | 31 |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....                    | 31 |
| <b>§ 10 重大事件揭示</b> .....                      | 32 |

|                                       |           |
|---------------------------------------|-----------|
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                | 32        |
| 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..... | 32        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....      | 32        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                  | 32        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....             | 32        |
| 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.....    | 32        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....           | 32        |
| 10.8 其他重大事件 .....                     | 33        |
| <b>§ 11 备查文件目录.....</b>               | <b>37</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                     | 37        |
| 11.2 存放地点 .....                       | 38        |
| 11.3 查阅方式 .....                       | 38        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                |
|------------|--------------------------------|
| 基金名称       | 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 | 35,458,220.47 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。 |

#### 2.2.1 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<br>负责人 | 姓名   | 孙麒清                             | 汤嵩彦                 |
|             | 联系电话 | 0755-83169999                   | 95559               |
|             | 电子邮箱 | service@bosera.com              | tangsy@bankcomm.com |
| 客户服务电话      |      | 95105568                        | 95559               |
| 传真          |      | 0755-83195140                   | 021-62701216        |
| 注册地址        |      | 广东省深圳市福田区深南大道<br>7088号招商银行大厦29层 | 上海市浦东新区银城中路188号     |
| 办公地址        |      | 广东省深圳市福田区深南大道<br>7088号招商银行大厦29层 | 上海市浦东新区银城中路188号     |
| 邮政编码        |      | 518040                          | 200120              |
| 法定代表人       |      | 张光华                             | 牛锡明                 |

## 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（2015年1月1日至2015年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 15,116,195.43             |
| 本期利润          | 27,729,791.95             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.4490                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 37.43%                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 43.33%                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 4,041,407.29              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1140                    |
| 期末基金资产净值      | 52,274,797.91             |
| 期末基金份额净值      | 1.4743                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2015年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 47.43%                    |

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

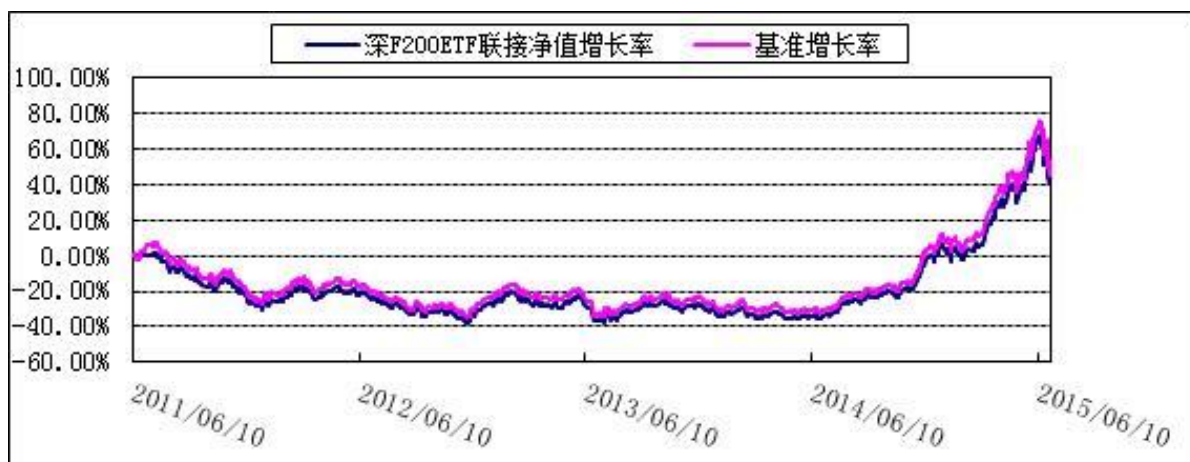
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | -0.78%   | 3.01%       | -0.98%     | 3.16%         | 0.20%  | -0.15% |
| 过去三个月      | 20.77%   | 2.37%       | 18.99%     | 2.46%         | 1.78%  | -0.09% |
| 过去六个月      | 43.33%   | 2.06%       | 41.92%     | 2.12%         | 1.41%  | -0.06% |
| 过去一年       | 121.50%  | 1.67%       | 120.16%    | 1.71%         | 1.34%  | -0.04% |
| 过去三年       | 93.91%   | 1.42%       | 92.49%     | 1.45%         | 1.42%  | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 47.43%   | 1.39%       | 53.59%     | 1.43%         | -6.16% | -0.04% |

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



## § 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 2015 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理七十只开放式基金，并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。博时基金资产管理净值总规模逾 3027.86 亿元人民币，其中公募基金

资产规模逾 1317.35 亿元人民币，累计分红超过 664.83 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，博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在 379 只标准型股票基金中分别排名前 1/3 和前 1/2；博时深证基本面 200ETF 及联接基金今年以来的净值增长率在 175 只指数股票型基金-标准指数股票基金及 46 只 ETF 联接基金中分别排名前 1/2 和前 1/3；混合基金-偏股型基金中，博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型 36 只产品中排名前 1/3；混合基金-灵活配置型基金中，博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在 126 只同类型基金中分别排名前 1/3 和前 1/2。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债券今年以来收益率在 71 只同类长期标准债券型基金中分别排名前 1/10、前 1/2 和前 1/2；博时上证企债 30ETF 今年以来的收益率在 18 只指数债券型基金-指数债券型基金(A 类)排名前 1/3。

## 2、其他大事件

2015 年 1 月 7 日，博时基金在 2014 年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

2015 年 1 月 15 日，在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中，博时基金获评第十二届中国财经风云榜“年度十大品牌基金公司”奖。

2015 年 1 月 18 日，博时基金（香港）在和讯财经风云榜海外评选中荣获“最佳中资基金公司”奖。

2015 年 1 月 21 日，在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中，博时转债增强荣获第八届金蝉奖“2014 最佳年度债基品牌奖”。

2015 年 3 月 28 日，在第十二届中国基金业金牛奖评选中，博时主题行业（LOF）基金、博时信用债券基金分别获得“2014 年度开放式股票型金牛基金”奖、“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2015 年 3 月 28 日，在中金在线主办的“2014 年度财经排行榜”评选中，邓欣雨获评“2014 年度中金在线财经排行榜最佳基金经理”。

2015 年 4 月 22 日，由上海证券报社主办的第十二届中国“金基金”奖的评选揭晓，博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得 5 年期股票型金基金奖。



#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 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      | —    | 5      | 2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金、博时证券保险指数分级基金基金经理 |
| 张雅洁 | 基金经理助理 | 2013-5-20       | —    | 5      | 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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，中国宏观经济继续处在弱势寻底阶段，宏观经济数据有底部企稳迹象显

现，汇丰 PMI 弱改善，地产销量转暖，但电力等工业品价格仍在下降通道。从流动性方面来看，上半年货币政策持续宽松，央行多次降准降息。6 月份前，各股指屡创新高，以创业板为代表的新兴成长股票，互联网、电子、计算机等行业股票涨幅较大，而以沪深 300 为代表的大盘蓝筹股涨幅较小。6 月份，受监管规范两融、场外配资融资等政策的影响，市场出现大幅调整，主要股指大幅下跌。整个季度市场走势呈现先扬后抑，季末加速下跌的势态。

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%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.4743 元，累计份额净值为 1.4743 元，报告期内净值增长率为 43.33%，同期业绩基准涨幅为 41.92%。

#### 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 2015 年下半年，从宏观经济角度来看，尽管几大重要指标数据显示经济仍在底部，但是有望逐步实现企稳。预计财政政策将作为更重要的调控工具，改革推进整体方向不变。海外方面，美联储仍有预期在 9 月启动加息，届时国内资金或将面临外流压力，因而 3 季度货币政策仍然可能进一步放松。股票市场将呈现震荡调整的格局，但是下行风险有限。部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值。

在投资策略上，深 F200ETF 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 F200ETF 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 F200ETF 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**

本基金报告期内未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

### **§ 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**

2015 年上半年度，基金托管人在博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中，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**

2015 年上半年度，博时基金管理有限公司在博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### **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**

2015 年上半年度，由博时基金管理有限公司编制并经托管人复核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半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.3.1    | 3,460,943.63                   | 3,256,449.16                     |
| 结算备付金           |            | 1,505,266.61                   | 4,741,396.42                     |
| 存出保证金           |            | 32,758.87                      | 10,877.09                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.3.2    | 48,665,496.99                  | 89,447,139.24                    |
| 其中：股票投资         |            | 286,850.40                     | 1,130,001.03                     |
| 基金投资            |            | 48,378,646.59                  | 88,317,138.21                    |
| 债券投资            |            | -                              | -                                |
| 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         |            | -                              | 1,250,016.13                     |
| 应收利息            | 6.4.3.5    | 975.43                         | 2,184.26                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 2,081,087.06                   | 291,508.70                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.3.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 55,746,528.59                  | 98,999,571.00                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 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         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 3,267,383.51                   | 4,627,475.59                     |
| 应付管理人报酬         |            | 1,197.68                       | 2,227.88                         |
| 应付托管费           |            | 239.54                         | 445.57                           |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.3.7    | 26,214.45                      | 13,755.35                        |
| 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    | 176,695.50                     | 42,791.20                        |
| 负债合计            |            | 3,471,730.68                   | 4,686,695.59                     |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| <b>所有者权益:</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 6.4.3.9  | 35,458,220.47 | 91,686,463.16 |
| 未分配利润         | 6.4.3.10 | 16,816,577.44 | 2,626,412.25  |
| 所有者权益合计       |          | 52,274,797.91 | 94,312,875.41 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 55,746,528.59 | 98,999,571.00 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4743 元，基金份额总额 35,458,220.47 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6<br>月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>28,032,862.75</b>                     | <b>-4,623,284.25</b>                          |
| 1. 利息收入                    |          | 24,796.77                                | 29,184.82                                     |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.3.11 | 24,796.77                                | 29,184.83                                     |
| 债券利息收入                     |          | -  | -0.01   |
| 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）          |          | 15,338,683.16                            | -4,580,707.68                                 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.3.12 | 541,708.33                               | -59,528.05                                    |
| 基金投资收益                     | 6.4.3.13 | 14,794,905.73                            | -4,525,236.95                                 |
| 债券投资收益                     | 6.4.3.14 | -  | -   |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -  | -   |
| 贵金属投资收益                    |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                     | 6.4.3.15 | -  | -   |
| 股利收益                       | 6.4.3.16 | 2,069.10                                 | 4,057.32                                      |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.3.17 | 12,613,596.52                            | -80,493.84                                    |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |          | -  | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.3.18 | 55,786.30                                | 8,732.45                                      |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>303,070.80</b>                        | <b>200,923.06</b>                             |
| 1. 管理人报酬                   |          | 9,774.00                                 | 12,120.67                                     |
| 2. 托管费                     |          | 1,954.82                                 | 2,424.18                                      |
| 3. 销售服务费                   |          | -  | -   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.3.19 | 120,803.70                               | 16,630.21                                     |
| 5. 利息支出                    |          | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -  | -   |
| 6. 其他费用                    | 6.4.3.20 | 170,538.28                               | 169,748.00                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>27,729,791.95</b>                     | <b>-4,824,207.31</b>                          |
| 减：所得税费用                    |          | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>27,729,791.95</b>                     | <b>-4,824,207.31</b>                          |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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）                        | 91,686,463.16                              | 2,626,412.25   | 94,312,875.41   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 27,729,791.95  | 27,729,791.95   |
| 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）      | -56,228,242.69                             | -13,539,626.76 | -69,767,869.45  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 33,034,469.22                              | 8,655,201.56   | 41,689,670.78   |
| 2. 基金赎回款                               | -89,262,711.91                             | -22,194,828.32 | -111,457,540.23 |
| 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）                        | 35,458,220.47                              | 16,816,577.44  | 52,274,797.91   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 136,031,315.80                             | -40,511,311.11 | 95,520,004.69   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | -4,824,207.31  | -4,824,207.31   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -13,888,477.86                             | 4,490,449.34   | -9,398,028.52   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 4,613,174.13                               | -1,545,368.12  | 3,067,806.01    |
| 2. 基金赎回款                               | -18,501,651.99                             | 6,035,817.46   | -12,465,834.53  |
| 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）                        | 122,142,837.94                             | -40,845,069.08 | 81,297,768.86   |

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：江向阳，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

除以下会计估计变更外，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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 3,460,943.63           |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 3,460,943.63           |

##### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |               |               |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 283,097.00             | 286,850.40    | 3,753.40      |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | -             | -             |
|               | 银行间市场                  | -             | -             |
|               | 合计                     | -             | -             |
| 资产支持证券        | -                      | -             | -             |
| 基金            | 32,243,547.38          | 48,378,646.59 | 16,135,099.21 |
| 其他            | -                      | -             | -             |
| 合计            | 32,526,644.38          | 48,665,496.99 | 16,138,852.61 |

注：本基金持有的目标 ETF 的份额按估值日目标 ETF 份额净值确定。本基金可采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

#### 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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 334.23                 |
| 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  | 626.50                 |
| 应收债券利息     | -                      |
| 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         | 14.70                  |
| 合计         | 975.43                 |

#### 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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 26,214.45              |



|             |           |
|-------------|-----------|
| 银行间市场应付交易费用 | -         |
| 合计          | 26,214.45 |

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 8,094.00               |
| 其他应付款       | -                      |
| 预提费用        | 168,601.50             |
| 合计          | 176,695.50             |

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                |
|----------------|---------------------------------------|----------------|
|                | 基金份额 (份)                              | 账面金额           |
| 上年度末           | 91,686,463.16                         | 91,686,463.16  |
| 本期申购           | 33,034,469.22                         | 33,034,469.22  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -89,262,711.91                        | -89,262,711.91 |
| 本期末            | 35,458,220.47                         | 35,458,220.47  |

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           | -18,372,026.41 | 20,998,438.66  | 2,626,412.25   |
| 本期利润           | 15,116,195.43  | 12,613,596.52  | 27,729,791.95  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 7,297,238.27   | -20,836,865.03 | -13,539,626.76 |
| 其中：基金申购款       | -3,595,318.95  | 12,250,520.51  | 8,655,201.56   |
| 基金赎回款          | 10,892,557.22  | -33,087,385.54 | -22,194,828.32 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 4,041,407.29   | 12,775,170.15  | 16,816,577.44  |

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 7,162.08                              |
| 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 | 17,371.97                             |
| 其他        | 262.72                                |
| 合计        | 24,796.77                             |

#### 6.4.3.12 股票投资收益

##### 6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                              |
|------------------|---------------------------------|
|                  | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 541,708.33                      |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                               |
| 合计               | 541,708.33                      |

#### 6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额   | 65,508,100.60                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 64,966,392.27                   |
| 买卖股票差价收入   | 541,708.33                      |

#### 6.4.3.12.3 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 卖出/赎回基金成交总额   | 67,352,268.55                   |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 52,557,362.82                   |
| 基金投资收益        | 14,794,905.73                   |

#### 6.4.3.14 债券投资收益

无发生额。

#### 6.4.3.15 衍生工具收益

无发生额。

#### 6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                              |
|-------------|---------------------------------|
|             | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 2,069.10                        |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               |
| 合计          | 2,069.10                        |

#### 6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 12,613,596.52                   |
| ——股票投资     | -5,274.68                       |
| ——债券投资     | -                               |
| ——资产支持证券投资 | -                               |

|         |               |
|---------|---------------|
| ——基金投资  | 12,618,871.20 |
| ——贵金属投资 | -             |
| 2. 衍生工具 | -             |
| ——权证投资  | -             |
| 3. 其他   | -             |
| 合计      | 12,613,596.52 |

#### 6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 37,226.18                  |
| 转换费收入   | 18,560.12                  |
| 合计      | 55,786.30                  |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.3.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 120,803.70                 |
| 银行间市场交易费用 | 0.00                       |
| 合计        | 120,803.70                 |

#### 6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用  | 19,835.79                  |
| 信息披露费 | 148,765.71                 |
| 银行汇划费 | 1,936.78                   |
| 合计    | 170,538.28                 |

#### 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、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(“招商证券”)                 | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 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。

#### 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

无。

###### 6.4.6.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 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              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 9,774.00             | 12,120.67            |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 63,524.86            | 74,198.71            |

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：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

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。

###### 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              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,954.82             | 2,424.18             |

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：

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.1\% / \text{当年}$$

天数。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

无。

#### 6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                   |          | 上年度可比期间              |          |
|-------|----------------------|----------|----------------------|----------|
|       | 2015年1月1日至2015年6月30日 |          | 2014年1月1日至2014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   |
| 交通银行  | 3,460,943.63         | 7,162.08 | 1,890,862.25         | 6,786.62 |

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 2015 年 6 月 30 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(2014 年 6 月 30 日：同)。

#### 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

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有 32,261,034 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 74.63%（于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有 84,846,900 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 73.63%）。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2015 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 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|
|      |      |      |      |        |      |        |       |        |        |

|        |       |           |        |       |           |       |       |           |           |
|--------|-------|-----------|--------|-------|-----------|-------|-------|-----------|-----------|
| 000022 | 深赤湾 A | 2015-4-23 | 公告重大事项 | 26.69 | -         | -     | 600   | 16,014.00 | 16,014.00 |
| 000024 | 招商地产  | 2015-4-3  | 公告重大事项 | 31.64 | -         | -     | 500   | 15,200.00 | 15,820.00 |
| 000543 | 皖能电力  | 2015-6-15 | 公告重大事项 | 21.36 | 2015-7-14 | 19.22 | 500   | 10,680.00 | 10,680.00 |
| 000630 | 铜陵有色  | 2015-3-9  | 公告重大事项 | 10.32 | -         | -     | 2,200 | 18,623.00 | 22,704.00 |
| 000683 | 远兴能源  | 2015-6-15 | 公告重大事项 | 11.52 | 2015-8-18 | 10.37 | 300   | 3,462.00  | 3,456.00  |
| 000786 | 北新建材  | 2015-4-10 | 公告重大事项 | 19.08 | -         | -     | 4,000 | 75,180.00 | 76,320.00 |
| 000793 | 华闻传媒  | 2015-5-26 | 公告重大事项 | 20.75 | -         | -     | 400   | 8,320.00  | 8,300.00  |
| 000917 | 电广传媒  | 2015-5-28 | 公告重大事项 | 42.89 | -         | -     | 100   | 4,289.00  | 4,289.00  |
| 000979 | 中弘股份  | 2015-5-25 | 公告重大事项 | 6.04  | -         | -     | 2,560 | 15,296.00 | 15,462.40 |
| 002069 | 獐子岛   | 2015-6-1  | 公告重大事项 | 19.76 | -         | -     | 200   | 3,952.00  | 3,952.00  |
| 002106 | 莱宝高科  | 2015-4-7  | 公告重大事项 | 16.42 | -         | -     | 2,200 | 36,168.00 | 36,124.00 |
| 002203 | 海亮股份  | 2015-4-27 | 公告重大事项 | 12.71 | -         | -     | 1,200 | 15,348.00 | 15,252.00 |
| 002242 | 九阳股份  | 2015-6-15 | 公告重大事项 | 19.45 | 2015-7-7  | 17.51 | 400   | 8,020.00  | 7,780.00  |
| 002269 | 美邦服饰  | 2015-5-22 | 公告重大事项 | 11.86 | 2015-7-2  | 10.67 | 1,300 | 15,418.00 | 15,418.00 |
| 002310 | 东方园林  | 2015-5-27 | 公告重大事项 | 38.30 | -         | -     | 100   | 3,836.00  | 3,830.00  |
| 002353 | 杰瑞股份  | 2015-5-27 | 公告重大事项 | 44.35 | -         | -     | 300   | 13,305.00 | 13,305.00 |
| 002416 | 爱施德   | 2015-5-5  | 公告重大事项 | 20.67 | 2015-7-29 | 18.6  | 500   | 10,335.00 | 10,335.00 |

注：本基金截至 2015 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资等。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

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交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，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 2015 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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及存出保证金，其余金融资产和金融负债均不计息，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<br>2015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                | 3,460,943.63        | -        | -        | -                    | 3,460,943.63         |
| 结算备付金               | 1,505,266.61        | -        | -        | -                    | 1,505,266.61         |
| 存出保证金               | 32,758.87           | -        | -        | -                    | 32,758.87            |
| 交易性金融资产             | -                   | -        | -        | 48,665,496.99        | 48,665,496.99        |
| 应收证券清算款             | -                   | -        | -        | -                    | -                    |
| 应收利息                | -                   | -        | -        | 975.43               | 975.43               |
| 应收申购款               | -                   | -        | -        | 2,081,087.06         | 2,081,087.06         |
| <b>资产总计</b>         | <b>4,998,969.11</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>50,747,559.48</b> | <b>55,746,528.59</b> |
| <b>负债</b>           |                     |          |          |                      |                      |
| 应付证券清算款             | -                   | -        | -        | -                    | -                    |
| 应付赎回款               | -                   | -        | -        | 3,267,383.51         | 3,267,383.51         |
| 应付管理人报酬             | -                   | -        | -        | 1,197.68             | 1,197.68             |
| 应付托管费               | -                   | -        | -        | 239.54               | 239.54               |
| 应付交易费用              | -                   | -        | -        | 26,214.45            | 26,214.45            |
| 其他负债                | -                   | -        | -        | 176,695.50           | 176,695.50           |
| <b>负债总计</b>         | <b>-</b>            | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>3,471,730.68</b>  | <b>3,471,730.68</b>  |
| <b>利率敏感度缺口</b>      | <b>4,998,969.11</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>47,275,828.80</b> | <b>52,274,797.91</b> |
| 上年度末<br>2014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                | 3,256,449.16        | -        | -        | -                    | 3,256,449.16         |
| 结算备付金               | 4,741,396.42        | -        | -        | -                    | 4,741,396.42         |
| 存出保证金               | 10,877.09           | -        | -        | -                    | 10,877.09            |
| 交易性金融资产             | -                   | -        | -        | 89,447,139.24        | 89,447,139.24        |
| 应收证券清算款             | -                   | -        | -        | 1,250,016.13         | 1,250,016.13         |
| 应收利息                | -                   | -        | -        | 2,184.26             | 2,184.26             |
| 应收申购款               | -                   | -        | -        | 291,508.70           | 291,508.70           |
| <b>资产总计</b>         | <b>8,008,722.67</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>90,990,848.33</b> | <b>98,999,571.00</b> |
| <b>负债</b>           |                     |          |          |                      |                      |
| 应付赎回款               | -                   | -        | -        | 4,627,475.59         | 4,627,475.59         |
| 应付管理人报酬             | -                   | -        | -        | 2,227.88             | 2,227.88             |
| 应付托管费               | -                   | -        | -        | 445.57               | 445.57               |
| 应付交易费用              | -                   | -        | -        | 13,755.35            | 13,755.35            |
| 其他负债                | -                   | -        | -        | 42,791.20            | 42,791.20            |
| <b>负债总计</b>         | <b>-</b>            | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>4,686,695.59</b>  | <b>4,686,695.59</b>  |
| <b>利率敏感度缺口</b>      | <b>8,008,722.67</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>86,304,152.74</b> | <b>94,312,875.41</b> |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2015 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无

重大影响（2014 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的基金和股票，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。

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，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<br>2015 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 286,850.40             | 0.55              | 1,130,001.03             | 1.20              |
| 交易性金融资产—基金投资  | 48,378,646.59          | 92.55             | 88,317,138.21            | 93.64             |
| 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            | 48,665,496.99          | 93.10             | 89,447,139.24            | 94.84             |

注：其他为目标 ETF 投资。

##### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设             | 除深证基本面200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<br>影响金额（单位：人民币万元） |                     |
|                |                          | 本期末<br>2015年6月30日                | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|                | 深证基本面200指数上升5%           | 增加约232                           | 增加约263              |
| 深证基本面200指数下降5% | 减少约232                   | 减少约263                           |                     |

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 48,386,455.59 元，属于第二层次的余额为 279,041.40 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 89,245,581.82 元，第二层次 201,557.42 元，无第三层次)。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；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次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.1)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况（适用于 ETF 联接基金填写）

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              | 286,850.40    | 0.51          |
|    | 其中：股票             | 286,850.40    | 0.51          |
| 2  | 基金投资              | 48,378,646.59 | 86.78         |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 4,966,210.24  | 8.91          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,114,821.36  | 3.79          |
| 9  | 合计                | 55,746,528.59 | 100.00        |

### 7.2 期末投资目标基金明细（适用于 ETF 联接基金填写）

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 | 48,378,646.59 | 92.55         |

### 7.3 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         | 3,952.00   | 0.01          |
| B  | 采矿业              | -          | -             |
| C  | 制造业              | 198,168.00 | 0.38          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,680.00  | 0.02          |
| E  | 建筑业              | 3,830.00   | 0.01          |
| F  | 批发和零售业           | 10,335.00  | 0.02          |

|   |                 |            |      |
|---|-----------------|------------|------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 16,014.00  | 0.03 |
| H | 住宿和餐饮业          | -          | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,289.00   | 0.01 |
| J | 金融业             | -          | -    |
| K | 房地产业            | 31,282.40  | 0.06 |
| L | 租赁和商务服务业        | -          | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | -          | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -          | -    |
| 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       | 8,300.00   | 0.02 |
| S | 综合              | -          | -    |
|   | 合计              | 286,850.40 | 0.55 |

#### 7.4 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  | 000786 | 北新建材 | 4,000 | 76,320.00 | 0.15         |
| 2  | 002106 | 莱宝高科 | 2,200 | 36,124.00 | 0.07         |
| 3  | 000630 | 铜陵有色 | 2,200 | 22,704.00 | 0.04         |
| 4  | 000022 | 深赤湾A | 600   | 16,014.00 | 0.03         |
| 5  | 000024 | 招商地产 | 500   | 15,820.00 | 0.03         |
| 6  | 000979 | 中弘股份 | 2,560 | 15,462.40 | 0.03         |
| 7  | 002269 | 美邦服饰 | 1,300 | 15,418.00 | 0.03         |
| 8  | 002203 | 海亮股份 | 1,200 | 15,252.00 | 0.03         |
| 9  | 002353 | 杰瑞股份 | 300   | 13,305.00 | 0.03         |
| 10 | 000543 | 皖能电力 | 500   | 10,680.00 | 0.02         |
| 11 | 002416 | 爱施德  | 500   | 10,335.00 | 0.02         |
| 12 | 000793 | 华闻传媒 | 400   | 8,300.00  | 0.02         |
| 13 | 002701 | 奥瑞金  | 300   | 7,809.00  | 0.01         |
| 14 | 002242 | 九阳股份 | 400   | 7,780.00  | 0.01         |
| 15 | 000917 | 电广传媒 | 100   | 4,289.00  | 0.01         |
| 16 | 002069 | 獐子岛  | 200   | 3,952.00  | 0.01         |
| 17 | 002310 | 东方园林 | 100   | 3,830.00  | 0.01         |
| 18 | 000683 | 远兴能源 | 300   | 3,456.00  | 0.01         |

#### 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.5.1 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 | 000166 | 申万宏源 | 6,160.32 | 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。

### 7.5.2 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   | 4,116,153.00 | 4.36            |
| 2  | 000651 | 格力电器   | 2,441,675.25 | 2.59            |
| 3  | 000001 | 平安银行   | 1,865,986.61 | 1.98            |
| 4  | 000776 | 广发证券   | 1,668,370.45 | 1.77            |
| 5  | 000100 | TCL 集团 | 1,639,309.42 | 1.74            |
| 6  | 000333 | 美的集团   | 1,617,973.47 | 1.72            |
| 7  | 000709 | 河北钢铁   | 1,504,330.69 | 1.60            |
| 8  | 000157 | 中联重科   | 1,495,505.38 | 1.59            |
| 9  | 002024 | 苏宁云商   | 1,415,710.76 | 1.50            |
| 10 | 000825 | 太钢不锈   | 1,322,119.20 | 1.40            |
| 11 | 000858 | 五粮液    | 1,269,731.88 | 1.35            |
| 12 | 000338 | 潍柴动力   | 1,189,271.35 | 1.26            |
| 13 | 000402 | 金融街    | 1,057,446.00 | 1.12            |
| 14 | 000063 | 中兴通讯   | 1,044,519.28 | 1.11            |
| 15 | 000425 | 徐工机械   | 899,099.60   | 0.95            |
| 16 | 000066 | 长城电脑   | 882,322.81   | 0.94            |
| 17 | 000568 | 泸州老窖   | 854,642.12   | 0.91            |
| 18 | 000783 | 长江证券   | 848,666.04   | 0.90            |
| 19 | 000983 | 西山煤电   | 817,138.86   | 0.87            |
| 20 | 000778 | 新兴铸管   | 762,795.36   | 0.81            |

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。

### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |               |
|---------------|---------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 6,160.32      |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 65,508,100.60 |

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。

### 7.6 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。

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 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。

### 7.9 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投资。

### 7.10 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。

### 7.11 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。

### 7.12 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。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

### 7.13.3 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   | 32,758.87    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 975.43       |
| 5  | 应收申购款   | 2,081,087.06 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,114,821.36 |

### 7.13.4 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。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1  | 000786 | 北新建材 | 76,320.00   | 0.15          | 公告重大事项   |
| 2  | 002106 | 莱宝高科 | 36,124.00   | 0.07          | 公告重大事项   |

|    |        |       |           |      |        |
|----|--------|-------|-----------|------|--------|
| 3  | 000630 | 铜陵有色  | 22,704.00 | 0.04 | 公告重大事项 |
| 4  | 000022 | 深赤湾 A | 16,014.00 | 0.03 | 公告重大事项 |
| 5  | 000024 | 招商地产  | 15,820.00 | 0.03 | 公告重大事项 |
| 6  | 000979 | 中弘股份  | 15,462.40 | 0.03 | 公告重大事项 |
| 7  | 002269 | 美邦服饰  | 15,418.00 | 0.03 | 公告重大事项 |
| 8  | 002203 | 海亮股份  | 15,252.00 | 0.03 | 公告重大事项 |
| 9  | 002353 | 杰瑞股份  | 13,305.00 | 0.03 | 公告重大事项 |
| 10 | 000543 | 皖能电力  | 10,680.00 | 0.02 | 公告重大事项 |

### 7.13.6 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 |
| 1,544    | 22,965.17 | 297,153.70 | 0.84%  | 35,161,066.77 | 99.16% |

### 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 | 136,194.93 | 0.38%    |

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | -                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | -                 |

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研发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。

## § 9 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              | 91,686,463.16  |
| 本报告期基金总申购份额               | 33,034,469.22  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 89,262,711.91  |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 35,458,220.47  |



## § 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 2015 年 4 月 13 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》，吴姚东不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英代任总经理职务。2、基金管理人于 2015 年 6 月 20 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》，徐卫担任博时基金管理有限公司副总经理职务。3、基金管理人于 2015 年 7 月 10 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》，江向阳担任博时基金管理有限公司总经理职务。4、基金管理人于 2015 年 8 月 8 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》，张光华任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人，洪小源不再任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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

2015 年 2 月，我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求公司对后台权限设置等问题进行改正，我司立即进行了改正并已经完成了验收。

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。

### 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 | 佣金        | 占当期佣金总量的 |    |
|      |        |      |          |           |          |    |

|      |   |               | 额的比例    |           | 比例      |   |
|------|---|---------------|---------|-----------|---------|---|
| 兴业证券 | 1 | 65,501,940.28 | 100.00% | 46,521.21 | 100.00% | - |
| 浙商证券 | 1 | -             | -       | -         | -       | - |
| 招商证券 | 1 | -             | -       | -         | -       | - |
| 国盛证券 | 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  | 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 | 2015/6/30 |
| 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 | 2015/6/27 |
| 3  | 博时基金管理有限公司关于参加数米基金销售有限公司认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 | 2015/6/27 |
| 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 | 2015/6/26 |
| 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 | 2015/6/25 |
| 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 | 2015/6/20 |
| 7  | 关于博时基金管理有限公司旗下基金参加上海好买基金销售有限公司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 | 2015/6/20 |
| 8  | 博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/6/20 |

|    |                                       |                  |           |
|----|---------------------------------------|------------------|-----------|
|    |                                       | 报、证券时报           |           |
| 9  | 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 | 2015/6/19 |
| 10 | 关于博时旗下部分开放式基金增加东莞农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/6/19 |
| 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 | 2015/6/17 |
| 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 | 2015/6/16 |
| 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 | 2015/6/12 |
| 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 | 2015/6/11 |
| 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 | 2015/6/6  |
| 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 | 2015/6/4  |
| 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 | 2015/6/3  |
| 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 | 2015/6/2  |
| 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 | 2015/6/1  |
| 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 | 2015/5/28 |
| 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 | 2015/5/27 |
| 22 | 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 | 2015/5/22 |
| 23 | 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 | 2015/5/21 |
| 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 | 2015/5/20 |
| 25 | 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 | 2015/5/15 |

|    |  |                  |           |
|----|--|------------------|-----------|
|    | 股票调整估值方法的公告  | 报、证券时报           |           |
| 26 | 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 | 2015/5/14 |
| 27 | 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 | 2015/5/13 |
| 28 | 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 | 2015/5/12 |
| 29 | 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 | 2015/5/11 |
| 30 | 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 | 2015/5/7  |
| 31 | 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 | 2015/4/30 |
| 32 | 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 | 2015/4/30 |
| 33 | 关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司认、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 | 2015/4/25 |
| 34 | 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 | 2015/4/23 |
| 35 | 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 | 2015/4/14 |
| 36 | 博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/4/13 |
| 37 | 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 | 2015/4/11 |
| 38 | 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 | 2015/4/9  |
| 39 | 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 | 2015/4/3  |
| 40 | 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 | 2015/4/2  |
| 41 | 关于博时旗下部分开放式基金增加深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并参加其网上交易申购业务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 | 2015/4/2  |

|    |   |                  |           |
|----|---|------------------|-----------|
| 42 | 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 | 2015/4/1  |
| 43 | 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 | 2015/3/31 |
| 44 | 关于博时旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参加其网上交易和手机交易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 | 2015/3/30 |
| 45 | 关于博时旗下部分开放式基金增加苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其网上银行、手机银行和柜面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 | 2015/3/27 |
| 46 | 博时基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/3/26 |
| 47 | 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 | 2015/3/26 |
| 48 | 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 | 2015/3/24 |
| 49 | 关于博时旗下部分开放式基金增加泉州银行股份有限公司为代销机构的公告                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/3/20 |
| 50 | 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 | 2015/3/19 |
| 51 | 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 | 2015/3/18 |
| 52 | 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 | 2015/3/17 |
| 53 | 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 | 2015/3/14 |
| 54 | 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 | 2015/3/11 |
| 55 | 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 | 2015/3/3  |
| 56 | 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 | 2015/2/27 |
| 57 | 关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司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 | 2015/2/26 |

|    |  |                  |           |
|----|--|------------------|-----------|
| 58 | 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 | 2015/2/17 |
| 59 | 博时基金管理有限公司关于暂停货币基金快速赎回业务的公告                                | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/2/14 |
| 60 | 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 | 2015/2/12 |
| 61 | 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 | 2015/2/10 |
| 62 | 关于厦门市鑫鼎盛控股有限公司暂停代理博时旗下开放式基金销售业务的公告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/2/7  |
| 63 | 关于博时旗下部分基金参加东莞银行股份有限公司网上银行、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 | 2015/1/31 |
| 64 | 关于博时旗下部分开放式基金参加江苏张家港农村商业银行股份有限公司柜面、网上银行、手机银行申购和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 | 2015/1/31 |
| 65 | 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 | 2015/1/23 |
| 66 | 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 | 2015/1/20 |
| 67 | 关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构并参加其网上交易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 | 2015/1/19 |
| 68 | 公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015/1/17 |
| 69 | 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 | 2015/1/17 |

## § 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深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

11.1.2 《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》

11.1.3 《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 博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金各年度审计报告正本

11.1.6 报告期内博时深证基本面 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  
二〇一五年八月二十七日