深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年8月28日

§1重要提示

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	博时深证基本面200ETF
场内简称	深F200
基金主代码	159908
交易代码	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	163,229,029份
基金合同存续期	不定期
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

2.2基金产品说明

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

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	王涛
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	t_wang@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		杨鹤	牛锡明

2.4信息披露方式

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

§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	-2,809,040.90
本期利润	-6,494,508.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0377
本期基金份额净值增长率	-5.21%
3.1.2期末数据和指标	报告期末（2014年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.3426
期末基金资产净值	107,314,871.46
期末基金份额净值	0.6574

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。

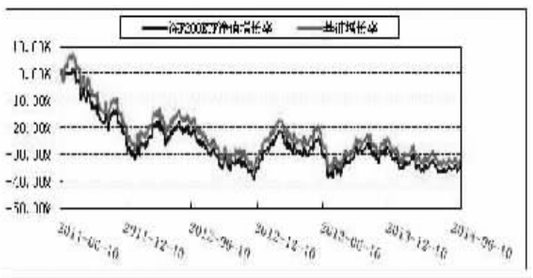
3.2基金净值表现

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	0.57%	0.87%	0.18%	0.89%	0.39%	-0.02%
过去三个月	1.53%	0.93%	0.65%	0.94%	0.88%	-0.01%
过去六个月	-5.21%	1.13%	-5.87%	1.15%	0.66%	-0.02%
过去一年	5.40%	1.24%	4.29%	1.25%	1.11%	-0.01%
过去三年	-34.40%	1.36%	-34.35%	1.38%	-0.05%	-0.02%
自基金成立起至今	-34.26%	1.35%	-31.83%	1.37%	-2.43%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准为深证基本面200指数。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同于2011年6月10日生效。按照基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条“（二）投资范围”、“（八）投资禁止行为与限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
赵云阳	基金经理	2012-11-13	-	4	2003年至2010年在晨星中国研究中心工作。2010年8月加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部量化分析师、博时标普500指数基金基金经理助理和博时深证基本面200ETF基金及其联接基金基金经理助理。现任博时深证基本面200ETF基金及其联接基金、博时上证企债30ETF基金、博时特许价值股票基金的基金经理。
张雅洁	基金经理助理	2013-5-20		4	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遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、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

本基金为交易型开放式指数证券投资基金,为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差,取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求,力求组合成份股紧密跟踪指数,利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因,并在最小化交易成本的同时适时调仓,尽可能地减少跟踪误差。同时,在本报告期,我们严格按照基金合同要求,在年中指数权重及成份股变动时,尽量降低成本、减少市场冲击,逐步调整组合与目标指数的结构一致。

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0.6574元,累计净值为0.6574元。报告期内,本基金份额净值增长率为-5.21%,同期业绩基准增长率为-5.87%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年上半年,国内经济增长中枢不断下移,结构性矛盾未见实质性改善,定向宽松政策对投资企稳回升起到一定成效。从经济数据方面来看,经济活动增速有所放缓;从流动性方面来看,5月下旬定向降准范围有所扩大,且资金面相对宽松;从指数表现来看,沪深300指数下跌7.08%,中证500指数上涨2.50%,创业板上涨7.69%;从大小盘风格方面来看,上半年国内资本市场继续延续去年的小盘成长风格,大盘风格股票在国内经济疲弱情形下并无起色;从行业方面来看,申万一级行业中计算机、通信和电子上涨较多,涨幅均超过10%,采掘、农林牧渔和非银金融跌幅较深,均在10%左右。

展望2014年下半年,政府微刺激政策的效果将逐步有所体现,国内经济将进入寻底和筑底阶段,国内反腐措施的执行力及政府政策的执行力得到市场的认可,为未来中国长期经济环境打下坚实基础,中国经济未来逐步恢复和长远腾飞的希望加强。资本市场方面,对市场持相对乐观的态度,风格转换力度加强,关注小盘成长向大盘价值转换的博弈机会,特别是三季度末具体实施的沪港通措施,进一步平衡市场估值,使其与国际接轨,小盘整体高估值水平较大概率向下移。深证基本面200指数作为基本面加权策略的指数，在未来市场风格转换过程中,将会呈现相对较好的投资价值,值得市场关注。行业主题方面,可关注国企改革主题、新能源汽车、沪港通受益低估值板块、房地产政策放松的阶段性机会等。

在投资策略上,深证基本面200ETF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,紧密跟踪深证基本面200指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过深证基本面200ETF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。

§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

2014年上半年度，基金托管人在深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,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

2014年上半年度，博时基金管理有限公司在深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金投资运作、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

2014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深证基本面200交易型开放式指数证券投资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:深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	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	1,060,683.75	1,047,493.37
结算备付金	13,362.67	816.45
存出保证金	6,482.57	12,690.84
交易性金融资产	106,480,278.06	125,903,413.35
其中:股票投资	106,480,278.06	125,903,413.35
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	227.68	241.03
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,247.18	-
资产总计	107,591,281.91	126,964,655.04
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	316.56	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	44,142.06	55,363.89
应付托管费	8,828.40	11,072.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	27,241.86	5,300.28
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	195,881.57	176,888.39
负债合计	276,410.45	248,625.34
所有者权益:		
实收基金	163,229,029.00	182,729,029.00
未分配利润	-55,914,157.54	-56,012,999.30
所有者权益合计	107,314,871.46	126,716,029.70
负债和所有者权益总计	107,591,281.91	126,964,655.04

注:报告截止日2014年06月30日,基金份额净值0.6574元,基金份额总额163,229,029.00份。

6.2利润表

会计主体:深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-5,847,298.66	-19,887,697.18
1.利息收入	4,089.08	7,696.69
其中:存款利息收入	4,075.86	7,696.69
债券利息收入	13.22	-
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）	-2,165,919.98	-33,789,037.07
其中:股票投资收益	-3,543,776.32	-35,208,977.56
基金投资收益	-	-
债券投资收益	798.78	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,377,057.56	1,419,940.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,685,467.76	13,124,218.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	769,425.05
减:二、费用	647,210.00	873,271.85
1.管理人报酬	281,381.62	450,156.07
2.托管费	56,276.33	90,031.23
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	54,835.90	57,624.94
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	254,716.15	275,459.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,494,508.66	-20,760,969.03
减:所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,494,508.66	-20,760,969.03

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

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）	182,729,029.00	-56,012,999.30	126,716,029.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,494,508.66	-6,494,508.66
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）	-19,500,000.00	6,593,350.42	-12,906,649.58
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-19,500,000.00	6,593,350.42	-12,906,649.58
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）	163,229,029.00	-55,914,157.54	107,314,871.46
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）	260,729,029.00	-73,663,960.64	187,065,068.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,760,969.03	-20,760,969.03
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）	-33,000,000.00	8,719,858.63	-24,280,141.37
其中:1.基金申购款	301,500,000.00	-86,024,455.44	215,475,544.56
2.基金赎回款	-334,500,000.00	94,744,314.07	-239,755,685.93
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）	227,729,029.00	-85,705,071.04	142,023,957.96

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[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关联方关系

6.4.3.1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。

6.4.3.2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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
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（“深证基本面200ETF联接基金”）	基金管理人管理的其他基金

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1股票交易

无。

6.4.4.1.2权证交易

无。

6.4.4.1.3应支付关联方的佣金

无。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1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	281,381.62	450,156.07
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注: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0.50%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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.4.2.2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	56,276.33	90,031.23

注: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0.10%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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深证基本面200ETF联接基金	116,346,900.00	71.28%	129,846,900.00	71.06%

6.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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
交通银行	1,060,683.75	3,922.09	624,495.22	2,172.13

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2014年06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。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000009	中国宝安	2014-5-28	公告重大事项	10.21	2014-8-15	9.33	32,217	365,385.02	328,935.57
000536	华映科技	2014-5-23	公告重大事项	23.10	2014-8-20	25.41	4,353	82,769.80	100,554.30
000562	宏源证券	2013-10-31	公告重大事项	8.22	2014-7-28	8.93	46,835	401,064.51	384,983.70
000612	焦作万方	2014-04-03	公告重大事项	6.08	2014-8-18	6.69	41,522	297,512.77	252,453.76
000807	云铝股份	2014-05-05	公告重大事项	3.25	2014-7-28	3.58	70,645	441,838.19	229,596.25
000878	云南铜业	2014-04-17	公告重大事项	7.61	2014-7-17	7.50	65,568	952,756.04	498,972.48
000960	锡业股份	2014-05-06	公告重大事项	12.44	2014-8-05	13.68	18,322	388,206.99	227,925.68
002570	贝因美	2014-06-19	公告重大事项	14.36	暂未复牌	暂未复牌	21,896	384,790.98	314,426.56

注:本基金截至2014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。

6.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

§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	106,480,278.06	98.97
	其中:股票	106,480,278.06	98.97
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,074,046.42	1.00
7	其他各项资产	36,957.43	0.03
8	合计	107,591,281.91	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	367,037.73	0.34
B	采矿业	4,475,179.09	4.17
C	制造业	65,219,304.11	60.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,038,336.79	2.83
E	建筑业	1,276,004.62	1.19
F	批发和零售业	5,734,442.87	5.34
G	交通运输、仓储和邮政业	821,096.35	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	820,870.21	0.76
J	金融业	8,878,534.16	8.27
K	房地产业	13,366,061.59	12.45
L	租赁和商务服务业	749,908.99	0.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,186,297.98	1.11
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	218,268.00	0.20
S	综合	328,935.57	0.31
	合计	106,480,278.06	99.22

7.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	903,187	7,469,356.49	6.96
2	000651	格力电器	158,257	4,660,668.65	4.34
3	000001	平安银行	343,761	3,406,671.51	3.17
4	000157	中联重科	630,923	2,794,988.89	2.60
5	000858	五粮液	150,759	2,703,108.87	2.52
6	000333	美的集团	124,978	2,414,574.96	2.25
7	002024	苏宁云商	319,259	2,094,339.04	1.95
8	000338	潍柴动力	116,194	2,067,091.26	1.93
9	000709	河北钢铁	1,065,103	1,981,091.58	1.85
10	000776	广发证券	201,099	1,970,770.20	1.84

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

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	000002	万 科A	1,954,240.48	1.54
2	000568	泸州老窖	979,446.65	0.77
3	000858	五 粮 液	957,464.39	0.76
4	000157	中联重科	853,044.00	0.67
5	000651	格力电器	652,158.94	0.51
6	000001	平安银行	612,231.50	0.48
7	000983	西山煤电	610,435.00	0.48
8	000895	双汇发展	483,845.44	0.38
9	000024	招商地产	388,194.00	0.31
10	002242	九阳股份	386,684.32	0.31
11	000012	南 玻A	347,174.00	0.27
12	000937	冀中能源	318,332.94	0.25
13	000425	徐工机械	301,700.91	0.24
14	000061	农 产 品	266,085.00	0.21
15	002106	莱宝高科	253,546.00	0.20
16	000422	湖北宜化	251,917.53	0.20
17	000423	东阿阿胶	250,905.00	0.20
18	000540	中天城投	248,724.00	0.20
19	002304	洋河股份	245,130.17	0.19
20	000690	宝新能源	233,594.00	0.18

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	002024	苏宁云商	1,453,984.89	1.15
2	000932	华菱钢铁	1,013,552.75	0.80
3	002202	金风科技	824,920.55	0.65
4	000959	首钢股份	777,142.16	0.61
5	000100	TCL 集团	678,524.49	0.54
6	000725	京东方A	524,905.69	0.41
7	000778	新兴铸管	477,241.70	0.38
8	000829	天音控股	426,157.27	0.34
9	000039	中集集团	378,470.02	0.30
10	000531	穗恒运A	362,804.50	0.29
11	000626	如意集团	349,746.86	0.28
12	000939	凯迪电力	340,723.24	0.27
13	002594	比亚迪	320,406.14	0.25
14	002493	荣盛石化	306,656.77	0.24
15	000001	平安银行	306,431.83	0.24
16	000063	中兴通讯	303,347.89	0.24
17	000333	美的集团	288,345.89	0.23
18	000550	江铃汽车	287,497.97	0.23
19	000683	远兴能源	285,144.77	0.23
20	002122	天马股份	273,918.94	0.22

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成