

# 深证基本面 200 交易型开放式指数

## 证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 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：二〇一六年八月二十五日

## § 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 2016 年 8 月 24 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 2016 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	4
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	5
<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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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>	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<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	13
6.4 报表附注	14
<b>§ 7 投资组合报告</b>	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	28
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
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	35
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	35
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	35
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	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	36
7.12 投资组合报告附注	36
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	37

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	37
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
8.4 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的情况 .....	38
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>38</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	38
10.4 基金投资策略的改变 .....	38
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	38
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 其他重大事件 .....	39
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>40</b>
11.1 备查文件目录 .....	40
11.2 存放地点 .....	40
11.3 查阅方式 .....	40

## § 2 基金简介

### 2.1 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	34,229,029.00 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	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 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	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-2,443,220.71
本期利润	-5,655,175.25
加权平均基金份额本期利润	-0.1649
本期加权平均净值利润率	-14.87%
本期基金份额净值增长率	-12.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,462,592.28
期末可供分配基金份额利润	0.1304
期末基金资产净值	38,691,621.28
期末基金份额净值	1.1304
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	13.04%

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	1.95%	1.02%	1.79%	1.10%	0.16%	-0.08%

过去三个月	-0.23%	1.07%	-0.51%	1.12%	0.28%	-0.05%
过去六个月	-12.89%	1.81%	-12.93%	1.87%	0.04%	-0.06%
过去一年	-24.62%	2.26%	-24.76%	2.40%	0.14%	-0.14%
过去三年	81.24%	1.81%	79.67%	1.88%	1.57%	-0.07%
自基金合同生效起至今	13.04%	1.66%	17.44%	1.72%	-4.40%	-0.06%

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



## § 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 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 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。资产管理净值总规模达 4,598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 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，2016 年二季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博



时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

固定收益方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债基金今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；指数债券型基金里，博时上证企债 30ETF 今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第四，博时现金收益货币，今年以来净值增长率在同类 194 只基金中排名前 2/5；博时安丰 18 定期开放债券，今年以来净值增长率在同类 45 只中排名第四。

QDII 基金中，博时亚洲票息，今年以来至 6 月 30 日净值增长 7.12%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名第二。

## 2、其他大事件

2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金凭借在固定收益投资领域的突出表现，荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。wind 数据显示，2015 年博时基金旗下 10 只纯债产品平均收益率达 12.65%，其中 6 只定期开放债基平均收益率更高达 15.17%，博时安丰 18 个月定期开放债券和博时双月薪双双夺得同类基金收益榜冠军。

2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇”315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。



2016 年 1 月 18 日，大众证券报“2015 中国基金风云榜”上，博时创业成长（050014）荣获 2015 “最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰 18 个月定开债（160515）荣获 2015 “最佳固定收益型基金”奖。

2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖盛典在京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

#### 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	-	5.8	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、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、博时证券保险指数分级基金、博时黄金 ETF 基金、博时上证 50ETF 基金、博时上证 50ETF 联接基金、博时银行分级基金、博时黄金 ETF 联接基金的基金经理。

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、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年,宏观经济平稳运行但增速疲软,CPI 在 5 月回落到 2%。房地产略有反弹,基建投资基本持平,投资增速缓慢下行。从汇率方面来看,美联储虽未及预期加息,但受实体经济下行压力和国际市场波动对人民币汇率短期走势的冲击,人民币自四月中旬起出现阶段性贬值。“英国脱欧”的黑天鹅事件出现,导致全球避险情绪陡增,避险资产如黄金和日元出现上涨,但随着事件的演化,延迟美国加息的预期,全球新兴市场呈现喘息机会。国内政策方面,政策重心转向“供给侧改革”,导致市场预期修复,同时也预示着主动引导释放风险概率逐步上升。行情方面,经历了 1 季度快速下跌反弹的行情后,2 季度市场进入弱势横盘整理行情。行业方面出现分化,电子、食品饮料、有色金属、家用电器领涨,传媒、交通运输、建筑装饰跌幅较大。

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

截至 2016 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.1304 元,累计份额净值为 1.1304 元,报告期内净值增长率为-12.89%,同期业绩基准涨幅为-12.93%。

## 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 2016 年下半年,从宏观经济角度来看,在补库存的推动下国内实体经济形式有所改善。流动性方面,在中国稳健的货币政策影响下,总体货币仍将呈现较为宽松态势。汇率从短期看,避险情绪趋于平复,预计人民币未来出现大幅贬值的概率较小;但从全球角度来看,发达市场受“脱欧”事件的影响,中短期需要避险消化,未来一段时间新兴市场可能会有一定的好转。在政策方面,仍将贯彻“供给侧改革”,改革虽对实体经济造成一定的冲击,但预计不会对经济增速造成过大影响。继续关注有业绩支撑的食品饮料以及经济转型和供给侧改革的相关受益股票板块具备投资价值,同时关注行业低配的医药板块、商品周期相关的波

段机会、以及弹性较强的券商板块。

在投资策略上，深 F200ETF 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 F200ETF 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

截至本报告期末，本基金已超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元，针对该情形，本基金管理人已向中国证监会报告了解决方案。

## § 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

2016 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

2016 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，符合基金合同的规定。

### 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

2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.3.1	1,306,033.06	1,000,479.21
结算备付金		1,276.30	325,823.97
存出保证金		391.04	4,964.51
交易性金融资产	6.4.3.2	37,762,041.76	43,278,377.02
其中：股票投资		37,762,041.76	43,278,377.02
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	256.94	296.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>39,069,999.10</b>	<b>44,609,941.43</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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		-	1,264.76
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,750.16	18,226.11
应付托管费		32,937.90	14,016.91
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	8,080.38	5,206.06
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	321,609.38	152,834.35
<b>负债合计</b>		<b>378,377.82</b>	<b>191,548.19</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.3.9	34,229,029.00	34,229,029.00
未分配利润	6.4.3.10	4,462,592.28	10,189,364.24
<b>所有者权益合计</b>		<b>38,691,621.28</b>	<b>44,418,393.24</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>39,069,999.10</b>	<b>44,609,941.43</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1304 元，基金份额总额 34,229,029.00 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
一、收入		-5,304,511.06	44,909,892.42

1. 利息收入		5,049.91	9,348.75
其中：存款利息收入	6.4.3.11	5,049.91	9,348.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,097,157.49	76,876,767.41
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-2,411,866.26	76,442,004.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
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	314,708.77	434,763.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-3,211,954.54	-32,811,218.43
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	-448.94	834,994.69
<b>减：二、费用</b>		<b>350,664.19</b>	<b>646,533.34</b>
1. 管理人报酬		94,604.96	241,457.17
2. 托管费		18,920.99	48,291.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	15,498.86	100,415.75
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	221,639.38	256,369.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-5,655,175.25</b>	<b>44,263,359.08</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-5,655,175.25</b>	<b>44,263,359.08</b>

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	34,229,029.00	10,189,364.24	44,418,393.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,655,175.25	-5,655,175.25



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）	-	-71,596.71	-71,596.71
其中：1. 基金申购款	1,500,000.00	117,450.37	1,617,450.37
2. 基金赎回款	-1,500,000.00	-189,047.08	-1,689,047.08
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）	34,229,029.00	4,462,592.28	38,691,621.28
项目	上年度可比期间 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）	115,229,029.00	4,718,006.89	119,947,035.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,263,359.08	44,263,359.08
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）	-72,000,000.00	-27,383,733.29	-99,383,733.29
其中：1. 基金申购款	268,500,000.00	146,147,814.04	414,647,814.04
2. 基金赎回款	-340,500,000.00	-173,531,547.33	-514,031,547.33
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）	43,229,029.00	21,597,632.68	64,826,661.68

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：

\_\_\_\_\_

基金管理公司负责人：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

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》、财税[2015]101 号《关于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。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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,306,033.06
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,306,033.06

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,448,959.29	37,762,041.76	-9,686,917.53

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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	47,448,959.29	37,762,041.76	-9,686,917.53

注：2016 年 6 月 30 日，本基金无可退替代款估值增值余额 (2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	256.14
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	0.60
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	0.20
合计	256.94

#### 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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	8,080.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,080.38

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付指数使用费	22,705.22
预提费用	298,904.16
合计	321,609.38

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,229,029.00	34,229,029.00
本期申购	1,500,000.00	1,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,500,000.00	-1,500,000.00
本期末	34,229,029.00	34,229,029.00

#### 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	26,209,249.40	-16,019,885.16	10,189,364.24
本期利润	-2,443,220.71	-3,211,954.54	-5,655,175.25
本期基金份额交易产生的变动数	3,207.00	-74,803.71	-71,596.71
其中：基金申购款	1,125,938.81	-1,008,488.44	117,450.37
基金赎回款	-1,122,731.81	933,684.73	-189,047.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,769,235.69	-19,306,643.41	4,462,592.28

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,949.44
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	92.53
其他	7.94
合计	5,049.91

#### 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,852,605.97
股票投资收益——赎回差价收入	-559,260.29
合计	-2,411,866.26

#### 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,791,126.36
减：卖出股票成本总额	7,643,732.33
买卖股票差价收入	-1,852,605.97

#### 6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,689,047.08
减：现金支付赎回款总额	319,875.08
减：赎回股票成本总额	1,928,432.29
赎回差价收入	-559,260.29

#### 6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	314,708.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	314,708.77

#### 6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,211,954.54
——股票投资	-3,211,954.54
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,211,954.54

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-448.94
合计	-448.94

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	15,498.86
银行间市场交易费用	0.00
合计	15,498.86

#### 6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	149,178.12
银行汇划费	30.00
上市费	29,835.26
指数使用费	22,705.22
合计	221,639.38

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值及指数许可使用费率每日计提，逐日累计，按季支付。在本基金成立之后的前四个年度，指数许可使用费率分别为万分之四(第一年度)、万分之六(第二年度)、万分之八(第三年度)、万分之十(第四年度)。从本基金成立的第五个年度起，如果本基金资产净值超过或等于人民币 40 亿元，指数许可使用费率年费率为万分之十；如果本基金资产净值不足人民币 40 亿元，则指数许可使用费率年费率为万分之十二。

#### 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
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

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	94,604.96	241,457.17
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。

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	18,920.99	48,291.38

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。

#### 6.4.6.3 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	26,849,262.00	78.44%	26,727,041.00	78.08%

#### 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	1,306,033.06	4,949.44	2,049,798.71	5,987.59

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 2016 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(2015 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

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2016 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2015-12-21	公告重大事项	24.43	2016-7-4	21.99	210,782	3,035,474.48	5,149,404.26	-
000401	冀东水泥	2016-4-6	公告重大事项	10.90	2016-7-14	11.32	10,556	164,929.37	115,060.40	-
000415	渤海金控	2016-2-1	公告重大事项	6.82	2016-8-11	7.50	11,270	120,661.44	76,861.40	-
000629	*ST 钒钛	2016-5-26	公告重大事项	2.39	-	-	61,805	320,635.52	147,713.95	-
000651	格力电器	2016-2-22	公告重大事项	19.22	-	-	93,124	2,489,009.21	1,789,843.28	-
000718	苏宁环球	2016-1-4	公告重大事项	13.09	2016-7-18	11.78	8,579	111,677.11	112,299.11	-
000728	国元证券	2016-6-8	公告重大事项	16.72	2016-7-8	17.37	9,875	296,565.04	165,110.00	-
002065	东华软件	2015-12-22	公告重大事项	25.10	2016-7-4	22.59	2,862	99,082.87	71,836.20	-
002249	大洋电机	2016-6-8	公告重大事项	11.97	2016-7-28	10.77	2,828	33,277.44	33,851.16	-
002465	海格通信	2016-6-13	公告重大事项	12.44	-	-	4,400	54,354.00	54,736.00	-

注：本基金截至 2016 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

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

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪深证基本面 200 指数，具有和标的指数所代表的股票市场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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪深证基本面 200 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2015 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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、组合在短时间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 2016 年 06 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 2016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	1,306,033.06	-	-	-	1,306,033.06
结算备付金	1,276.30	-	-	-	1,276.30
存出保证金	391.04	-	-	-	391.04
交易性金融资产	-	-	-	37,762,041.76	37,762,041.76
应收利息	-	-	-	256.94	256.94
<b>资产总计</b>	<b>1,307,700.40</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>37,762,298.70</b>	<b>39,069,999.10</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	15,750.16	15,750.16
应付托管费	-	-	-	32,937.90	32,937.90
应付交易费用	-	-	-	8,080.38	8,080.38
其他负债	-	-	-	321,609.38	321,609.38
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>378,377.82</b>	<b>378,377.82</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,307,700.40</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>37,383,920.88</b>	<b>38,691,621.28</b>
上年度末 2015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	1,000,479.21	-	-	-	1,000,479.21
结算备付金	325,823.97	-	-	-	325,823.97
存出保证金	4,964.51	-	-	-	4,964.51
交易性金融资产	-	-	-	43,278,377.02	43,278,377.02
应收利息	-	-	-	296.72	296.72
<b>资产总计</b>	<b>1,331,267.69</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>43,278,673.74</b>	<b>44,609,941.43</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	1,264.76	1,264.76
应付管理人报酬	-	-	-	18,226.11	18,226.11
应付托管费	-	-	-	14,016.91	14,016.91
应付交易费用	-	-	-	5,206.06	5,206.06
其他负债	-	-	-	152,834.35	152,834.35
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>191,548.19</b>	<b>191,548.19</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,331,267.69</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>43,087,125.55</b>	<b>44,418,393.24</b>

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 2016 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(2015 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。

本基金采用完全复制法, 跟踪深证基本面 200 指数, 以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则, 进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中, 深证基本面 200 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	37,762,041.76	97.60	43,278,377.02	97.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	37,762,041.76	97.60	43,278,377.02	97.43
----	---------------	-------	---------------	-------

#### 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影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 深证基本面 200 指数下降 5%	减少约 204	减少约 238
2. 深证基本面 200 指数上升 5%	增加约 204	增加约 238	

#### 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 2016 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 30,045,326.00 元，属于第二层次的余额为 7,716,715.76 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 36,172,536.49 元，第二层次 7,105,840.53 元，无第三层次)。

##### (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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(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	37,762,041.76	96.65
	其中：股票	37,762,041.76	96.65
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	1,307,309.36	3.35
7	其他各项资产	647.98	0.00
8	合计	39,069,999.10	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	47,086.00	0.12



B	采矿业	866,404.85	2.24
C	制造业	21,163,702.85	54.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,206,909.23	3.12
E	建筑业	558,620.57	1.44
F	批发和零售业	1,355,053.98	3.50
G	交通运输、仓储和邮政业	275,124.02	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	431,544.05	1.12
J	金融业	3,558,423.36	9.20
K	房地产业	7,266,220.74	18.78
L	租赁和商务服务业	317,863.37	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	488,542.48	1.26
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	226,546.26	0.59
S	综合	-	-
	合计	37,762,041.76	97.60

### 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	000002	万科 A	210,782	5,149,404.26	13.31
2	000651	格力电器	93,124	1,789,843.28	4.63
3	000333	美的集团	47,207	1,119,750.04	2.89
4	000001	平安银行	124,362	1,081,949.40	2.80
5	000858	五粮液	27,827	905,212.31	2.34
6	000338	潍柴动力	85,560	668,223.60	1.73
7	000157	中联重科	157,845	651,899.85	1.68
8	000725	京东方 A	261,457	603,965.67	1.56
9	000100	TCL 集团	179,182	589,508.78	1.52
10	000776	广发证券	34,842	583,951.92	1.51
11	000568	泸州老窖	18,222	541,193.40	1.40
12	002024	苏宁云商	49,650	539,199.00	1.39
13	002142	宁波银行	32,694	483,217.32	1.25
14	002304	洋河股份	6,611	475,463.12	1.23
15	000063	中兴通讯	32,988	473,047.92	1.22
16	000709	河钢股份	165,029	457,130.33	1.18

17	000630	铜陵有色	173,750	441,325.00	1.14
18	000895	双汇发展	19,997	417,537.36	1.08
19	000783	长江证券	35,212	408,459.20	1.06
20	000625	长安汽车	29,410	402,034.70	1.04
21	000876	新希望	45,154	375,681.28	0.97
22	000825	太钢不锈	113,840	359,734.40	0.93
23	000778	新兴铸管	76,230	353,707.20	0.91
24	000069	华侨城 A	52,962	338,956.80	0.88
25	000983	西山煤电	40,869	333,082.35	0.86
26	000402	金融街	32,270	313,664.40	0.81
27	001979	招商蛇口	20,526	292,495.50	0.76
28	000039	中集集团	19,527	276,697.59	0.72
29	002736	国信证券	15,700	270,825.00	0.70
30	000425	徐工机械	85,326	261,097.56	0.67
31	000066	长城电脑	20,424	260,406.00	0.67
32	000422	湖北宜化	41,555	253,901.05	0.66
33	002202	金风科技	16,640	251,763.20	0.65
34	000423	东阿阿胶	4,631	244,655.73	0.63
35	000898	鞍钢股份	59,700	228,651.00	0.59
36	000656	金科股份	53,315	203,663.30	0.53
37	000878	云南铜业	19,477	198,275.86	0.51
38	000538	云南白药	3,062	196,886.60	0.51
39	000166	申万宏源	23,093	194,212.13	0.50
40	002594	比亚迪	3,144	191,815.44	0.50
41	000540	中天城投	30,745	191,541.35	0.50
42	002415	海康威视	8,698	186,659.08	0.48
43	000623	吉林敖东	7,429	185,353.55	0.48
44	000488	晨鸣纸业	23,276	184,811.44	0.48
45	000528	柳工	26,534	171,940.32	0.44
46	000937	冀中能源	31,536	167,771.52	0.43
47	000060	中金岭南	15,897	165,805.71	0.43
48	000012	南玻 A	14,412	165,161.52	0.43
49	000728	国元证券	9,875	165,110.00	0.43
50	000543	皖能电力	23,003	164,241.42	0.42
51	000792	盐湖股份	7,643	161,267.30	0.42
52	002081	金螳螂	15,739	157,704.78	0.41
53	000581	威孚高科	7,353	148,236.48	0.38
54	002241	歌尔股份	5,154	147,816.72	0.38
55	000629	*ST 钒钛	61,805	147,713.95	0.38
56	000830	鲁西化工	32,469	146,759.88	0.38
57	000729	燕京啤酒	19,222	145,894.98	0.38
58	002146	荣盛发展	21,416	143,915.52	0.37
59	000027	深圳能源	22,246	141,929.48	0.37
60	000786	北新建材	15,434	140,140.72	0.36

61	000793	华闻传媒	14,026	138,576.88	0.36
62	002001	新和成	6,506	137,471.78	0.36
63	000550	江铃汽车	5,537	134,881.32	0.35
64	000559	万向钱潮	8,557	133,489.20	0.35
65	000539	粤电力 A	26,113	131,087.26	0.34
66	002092	中泰化学	15,480	130,960.80	0.34
67	000690	宝新能源	18,922	128,291.16	0.33
68	002422	科伦药业	8,298	127,872.18	0.33
69	002128	露天煤业	16,953	127,317.03	0.33
70	002269	美邦服饰	28,740	126,456.00	0.33
71	002008	大族激光	5,525	126,191.00	0.33
72	000800	一汽轿车	11,134	121,137.92	0.31
73	000917	电广传媒	7,298	120,635.94	0.31
74	000768	中航飞机	5,936	116,879.84	0.30
75	000726	鲁泰 A	10,474	116,366.14	0.30
76	000401	冀东水泥	10,556	115,060.40	0.30
77	002450	康得新	6,700	114,570.00	0.30
78	000718	苏宁环球	8,579	112,299.11	0.29
79	000829	天音控股	8,298	110,778.30	0.29
80	000600	建投能源	12,610	110,085.30	0.28
81	002440	闰土股份	7,371	109,459.35	0.28
82	000021	深科技	9,937	109,406.37	0.28
83	002385	大北农	13,531	109,059.86	0.28
84	000686	东北证券	8,443	108,999.13	0.28
85	000926	福星股份	9,276	108,807.48	0.28
86	002004	华邦健康	11,900	108,647.00	0.28
87	000999	华润三九	4,466	108,166.52	0.28
88	000883	湖北能源	23,307	107,911.41	0.28
89	000963	华东医药	1,592	107,300.80	0.28
90	002470	金正大	13,276	106,871.80	0.28
91	002048	宁波华翔	4,633	105,956.71	0.27
92	000701	厦门信达	5,964	105,145.32	0.27
93	000839	中信国安	4,861	103,587.91	0.27
94	002051	中工国际	5,249	103,247.83	0.27
95	000877	天山股份	16,689	103,138.02	0.27
96	002701	奥瑞金	11,630	102,692.90	0.27
97	000046	泛海控股	10,031	101,413.41	0.26
98	000417	合肥百货	12,495	101,084.55	0.26
99	002673	西部证券	3,904	100,957.44	0.26
100	002078	太阳纸业	20,631	100,679.28	0.26
101	002183	怡亚通	6,996	100,182.72	0.26
102	000031	中粮地产	10,521	99,213.03	0.26
103	002237	恒邦股份	7,702	99,201.76	0.26
104	000703	恒逸石化	10,015	98,848.05	0.26

105	000900	现代投资	14,567	98,181.58	0.25
106	000572	海马汽车	18,904	98,111.76	0.25
107	002242	九阳股份	5,371	97,644.78	0.25
108	002456	欧菲光	3,300	97,350.00	0.25
109	002191	劲嘉股份	8,328	96,521.52	0.25
110	000860	顺鑫农业	4,028	95,785.84	0.25
111	300124	汇川技术	4,800	93,120.00	0.24
112	000960	锡业股份	8,008	92,572.48	0.24
113	000666	经纬纺机	4,734	92,313.00	0.24
114	000758	中色股份	11,680	90,520.00	0.23
115	000598	兴蓉环境	16,987	89,691.36	0.23
116	300027	华谊兄弟	6,497	87,969.38	0.23
117	000501	鄂武商 A	5,604	87,926.76	0.23
118	000671	阳光城	14,617	86,824.98	0.22
119	002311	海大集团	5,487	86,529.99	0.22
120	000400	许继电气	5,566	85,939.04	0.22
121	000750	国海证券	11,450	84,615.50	0.22
122	000006	深振业 A	11,358	83,708.46	0.22
123	000970	中科三环	5,722	83,026.22	0.21
124	300070	碧水源	5,536	82,375.68	0.21
125	000685	中山公用	7,843	81,410.34	0.21
126	002028	思源电气	7,380	80,811.00	0.21
127	002375	亚厦股份	7,132	80,591.60	0.21
128	002236	大华股份	6,037	79,084.70	0.20
129	002251	步步高	6,041	78,351.77	0.20
130	000789	万年青	12,609	77,923.62	0.20
131	300146	汤臣倍健	5,700	77,178.00	0.20
132	000415	渤海金控	11,270	76,861.40	0.20
133	000869	张裕 A	1,912	76,824.16	0.20
134	002085	万丰奥威	4,460	76,667.40	0.20
135	002500	山西证券	4,597	76,126.32	0.20
136	000089	深圳机场	8,900	75,650.00	0.20
137	300002	神州泰岳	7,100	75,544.00	0.20
138	000413	东旭光电	8,700	74,733.00	0.19
139	002344	海宁皮城	7,663	74,714.25	0.19
140	002250	联化科技	5,200	74,464.00	0.19
141	000418	小天鹅 A	2,242	73,134.04	0.19
142	000906	物产中拓	6,126	72,715.62	0.19
143	002570	贝因美	5,633	72,046.07	0.19
144	002152	广电运通	4,382	72,040.08	0.19
145	002065	东华软件	2,862	71,836.20	0.19
146	002353	杰瑞股份	3,717	71,663.76	0.19
147	000028	国药一致	1,100	71,610.00	0.19
148	000612	焦作万方	9,997	71,378.58	0.18

149	000683	远兴能源	27,240	71,368.80	0.18
150	002489	浙江永强	8,941	70,812.72	0.18
151	000979	中弘股份	25,523	69,933.02	0.18
152	000966	长源电力	10,526	68,419.00	0.18
153	300408	三环集团	3,800	68,248.00	0.18
154	002416	爱施德	3,391	67,345.26	0.17
155	000826	启迪桑德	2,200	67,210.00	0.17
156	002244	滨江集团	9,978	66,852.60	0.17
157	000541	佛山照明	6,439	66,257.31	0.17
158	002210	飞马国际	3,250	66,105.00	0.17
159	000961	中南建设	11,442	64,189.62	0.17
160	000767	漳泽电力	17,400	62,988.00	0.16
161	000050	深天马 A	3,000	62,610.00	0.16
162	002475	立讯精密	3,150	61,897.50	0.16
163	002233	塔牌集团	7,646	61,397.38	0.16
164	002294	信立泰	2,247	61,118.40	0.16
165	002267	陕天然气	5,799	60,889.50	0.16
166	000807	云铝股份	9,211	60,332.05	0.16
167	000939	凯迪生态	6,700	59,965.00	0.15
168	300059	东方财富	2,700	59,940.00	0.15
169	002309	中利科技	3,300	59,103.00	0.15
170	002310	东方园林	2,389	57,144.88	0.15
171	000536	华映科技	3,511	56,456.88	0.15
172	000043	中航地产	6,768	55,836.00	0.14
173	002465	海格通信	4,400	54,736.00	0.14
174	002204	大连重工	13,504	54,556.16	0.14
175	000732	泰禾集团	2,800	54,432.00	0.14
176	000828	东莞控股	5,800	52,664.00	0.14
177	002050	三花股份	5,430	52,399.50	0.14
178	300003	乐普医疗	2,806	51,181.44	0.13
179	000090	天健集团	5,740	50,512.00	0.13
180	000042	中洲控股	2,900	49,648.00	0.13
181	002498	汉缆股份	11,400	49,476.00	0.13
182	000088	盐田港	7,551	48,628.44	0.13
183	002429	兆驰股份	5,795	48,562.10	0.13
184	300498	温氏股份	1,300	47,086.00	0.12
185	002293	罗莱生活	3,400	46,580.00	0.12
186	002482	广田集团	5,967	45,229.86	0.12
187	002013	中航机电	3,300	44,484.00	0.11
188	000620	新华联	4,800	43,920.00	0.11
189	002157	正邦科技	1,700	39,882.00	0.10
190	000631	顺发恒业	7,936	38,648.32	0.10
191	000596	古井贡酒	800	38,360.00	0.10
192	002007	华兰生物	1,174	36,863.60	0.10

193	002399	海普瑞	2,079	36,299.34	0.09
194	002662	京威股份	2,400	36,264.00	0.09
195	002249	大洋电机	2,828	33,851.16	0.09
196	002075	沙钢股份	2,160	30,931.20	0.08
197	002252	上海莱士	700	26,376.00	0.07
198	002651	利君股份	2,500	26,275.00	0.07
199	300433	蓝思科技	900	25,308.00	0.07
200	002408	齐翔腾达	3,690	20,258.10	0.05
201	000987	广州友谊	1,054	13,596.60	0.04
202	002010	传化股份	600	11,874.00	0.03

## 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	002736	国信证券	189,290.00	0.43
2	000725	京东方 A	187,011.00	0.42
3	000338	潍柴动力	143,883.00	0.32
4	000540	中天城投	142,088.00	0.32
5	000157	中联重科	141,311.00	0.32
6	000100	TCL 集团	122,414.00	0.28
7	000001	平安银行	118,005.00	0.27
8	000166	申万宏源	115,576.00	0.26
9	000656	金科股份	113,091.00	0.25
10	002450	康得新	112,806.00	0.25
11	000783	长江证券	112,150.00	0.25
12	000069	华侨城 A	108,133.00	0.24
13	000333	美的集团	108,017.00	0.24
14	000630	铜陵有色	107,566.00	0.24
15	300433	蓝思科技	103,751.64	0.23
16	000625	长安汽车	102,877.00	0.23
17	000825	太钢不锈	79,308.00	0.18
18	002128	露天煤业	78,188.72	0.18
19	000060	中金岭南	73,959.00	0.17
20	000413	东旭光电	71,186.21	0.16

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	000858	五粮液	594,802.00	1.34

2	000333	美的集团	460,784.11	1.04
3	001979	招商蛇口	311,020.00	0.70
4	000568	泸州老窖	289,754.11	0.65
5	002304	洋河股份	232,935.00	0.52
6	000983	西山煤电	147,304.00	0.33
7	000933	*ST 神火	145,877.75	0.33
8	000066	长城电脑	135,770.45	0.31
9	000069	华侨城 A	128,629.00	0.29
10	000951	中国重汽	90,545.44	0.20
11	000680	山推股份	85,124.44	0.19
12	300433	蓝思科技	71,633.00	0.16
13	002024	苏宁云商	70,665.00	0.16
14	002419	天虹商场	69,457.64	0.16
15	000012	南玻 A	67,969.00	0.15
16	000531	穗恒运 A	65,812.00	0.15
17	002557	洽洽食品	64,775.12	0.15
18	000792	盐湖股份	63,688.00	0.14
19	002242	九阳股份	63,675.00	0.14
20	000402	金融街	60,821.00	0.14

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	6,049,580.90
卖出股票的收入（成交）总额	5,791,126.36

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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投资。



## 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

报告期末本基金未投资股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金未投资国债期货交易。

## 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广发证券（000776）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。

广发证券股份有限公司 2015 年 9 月 12 日发布公告称，因未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》。

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 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。

## 7.12.3 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	391.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	256.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	647.98

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 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	000002	万科 A	5,149,404.26	13.31	公告重大事项
2	000651	格力电器	1,789,843.28	4.63	公告重大事项

### 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		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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
554	61,785.25	422,515.00	1.23%	6,957,252.00	20.33%	26,849,262.00	78.44%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	潮州市恒信医药有限公司	408,509.00	1.19%
2	徐国忠	230,474.00	0.67%
3	周荣相	166,940.00	0.49%
4	杨月仙	150,029.00	0.44%
5	何东银	140,005.00	0.41%
6	付玉珍	140,000.00	0.41%
7	荣红	128,026.00	0.37%
8	许金煌	100,000.00	0.29%
9	易世会	100,000.00	0.29%
10	范孝强	80,010.00	0.23%
	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	26,849,262.00	78.44%

注：前十名持有人为除博时深 200ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 8.3 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	-	-

#### 8.4 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的情况

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	403,229,029.00
本报告期期初基金份额总额	34,229,029.00
本报告期基金总申购份额	1,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	34,229,029.00

### § 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

#### 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

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	
中泰证券	1	11,830,655.70	100.00%	8,652.65	100.00%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，我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服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

#### 2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

## 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 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-20
2	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-20
3	关于新增深证基本面 200ETF 代办券商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-15
4	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
5	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资	中国证券报、上海证券	2016-03-26

	基金 2015 年年度报告（摘要）	报、证券时报	
6	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-22
7	关于博时旗下部分开放式基金增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为代销机构公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-01
8	博时基金管理有限公司关于深 F200ETF 申购赎回清单新增申赎数量限制指标的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-02
9	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-06

## § 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深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件

11.1.2 《深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

11.1.3 《深证基本面 200 交易型开放式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 报告期内深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

11.1.6 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本

### 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  
二〇一六年八月二十五日