

**深证基本面 200 交易型开放式指数
证券投资基金
2018 年半年度报告
2018 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：二〇一八年八月二十九日

§ 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 2018 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	11
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	11
§5 托管人报告	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的真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	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
§7 投资组合报告	26
7.1 期末基金资产组合情况	26
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	27
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	27
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	32
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	33
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	33
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	33
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	33
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	33
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	33
7.12 投资组合报告附注	33
§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
8.2 期末上市基金前十名持有人	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	34
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	34
§9 开放式基金份额变动	35

§ 10 重大事件揭示	35
10.1 基金份额持有人大会决议	35
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	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
10.4 基金投资策略的改变	35
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	35
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	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	35
10.8 其他重大事件	36
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	37
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	37
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	38
§ 12 备查文件目录	38
12.1 备查文件目录	38
12.2 存放地点	38
12.3 查阅方式	38

§ 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	32,729,029.00 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	陆志俊
	联系电话	0755-83169999	95559
	电子邮箱	service@bosera.com	luz.j@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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188号
邮政编码		518040	200120
法定代表人		张光华	彭纯

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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,333,033.78
本期利润	-7,606,064.71
加权平均基金份额本期利润	-0.2194
本期加权平均净值利润率	-14.53%
本期基金份额净值增长率	-14.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	10,583,721.77
期末可供分配基金份额利润	0.3234
期末基金资产净值	43,312,750.77
期末基金份额净值	1.3234
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	32.34%

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。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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。

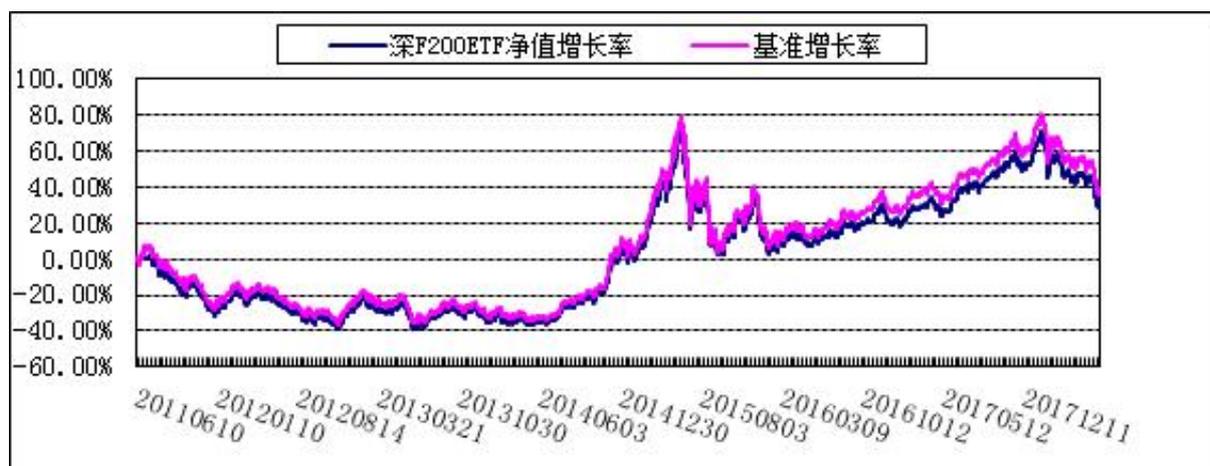
3.2 基金净值表现

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	-8.17%	1.59%	-8.22%	1.60%	0.05%	-0.01%
过去三个月	-10.94%	1.33%	-11.23%	1.34%	0.29%	-0.01%
过去六个月	-14.36%	1.39%	-14.30%	1.40%	-0.06%	-0.01%
过去一年	-4.96%	1.18%	-5.03%	1.19%	0.07%	-0.01%
过去三年	-11.75%	1.55%	-10.35%	1.63%	-1.40%	-0.08%
自基金合同生效起至今	32.34%	1.51%	39.93%	1.56%	-7.59%	-0.05%

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 2018 年 06 月 30 日，博时基金公司共管理 185 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，管理资产总规模逾 8461 亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾 1947 亿元人民币，累计分红逾 872 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，截至 2018 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时中证银联智慧大数据 100 指数(A 类)、博时裕富沪深 300 指数(A 类)等今年以来净值增长率同类排名为前 1/4；股票型分级子基金里，博时中证银行分级指数(B 级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前 1/3；混合偏股型基金中，博时创业成长混合(C 类)今年以来净值增长率同类基金排名第一，博时创业成长混合(A 类)今年以来净值增长率同类基金排名位居前 1/10，博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前 1/3；混合灵活配置型基金中，博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 3.14%，在 166 只同类基金排名第 6，博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 4.38%，同类基金排名位居前 1/10，博时新价值灵活配置混合(A 类)、博时新策略灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率分别为 2.12%、1.93%、1.65%、1.60%，同类基金排名均位居前 1/8，博时新价值灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率为 2.07%，同类基金中排名位于前 1/6。

黄金基金类，博时黄金 ETF 联接(A 类)、博时黄金 ETF 联接(C 类)今年以来净值增长率同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率为 5.11%、4.56%、4.54%，同类 219 只基金中分别排名第 3、第 8、第 9 位，博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)、博时信用债券(C类)、博时宏观回报债券(C类)今年以来净值增长率分别为 4.88%、4.56%、4.34%、4.23%，同类 153 只基金中分别排名第 2、第 4、第 7、第 8 位，博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为 4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%，同类排名前 1/10；货币基金类，博时兴荣货币、博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率分别为 2.21%、2.18%，在 315 只同类基金排名中位列第 15 位与第 24 位。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF(QDII)、博时标普 500ETF 联接(QDII)(A类)，今年以来净值增长率同类排名分别位于前 1/5、1/4。

2、其他大事件

2018 年 6 月 8 日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017 年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018 年 5 月 24 日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业 20 年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾 23 年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业 20 年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有 20 人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继 2016 年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018 年 5 月 23 日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募 20 年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金(000277)获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券(QDII)(人民币 050030：，美元现汇：050202，美元现钞：050203)获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018 年 5 月 17 日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖(DevOps 统一研发平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合业务接入平台)三项大奖，成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018 年 5 月 10 日，由《上海证券报》主办的“2018 中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上，博时基金揽获“金基金 TOP 基金公司”这一最具份量的公司大奖；博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报基金经理奖”。在第 15 届金基金奖评选中，旗下价值投资典范产品博时主题行业(160505)获得“三年期金基金分红奖”

。

2018 年 3 月 26 日，第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业 20 年卓越贡献公司”大奖。同时，旗下绩优产品博时主题行业混合(LOF) (160505) 荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”奖；博时信用债纯债债券 (050027) 荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018 年 3 月 22 日，由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金 20 周年特别评选、中国基金业明星基金颁奖典礼”在北京举办，本次评选中，博时基金一举斩获本届“20 周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金 20 年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖，同时，旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金（二级债）”奖双双收入囊中，博时聚润纯债债券则获得“2017 年度普通债券型明星基金”奖。

2018 年 2 月 2 日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018 年 1 月 11 日，由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业 20 年最佳创新产品颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”，旗下产品博时主题行业混合基金 (160505) 和博时黄金 ETF 分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”，成为当天最大赢家之一。

2018 年 1 月 9 日，由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017 年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

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	-	7.8	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（2013.9.13-2015.2.9）、博时招财一号保本基金（2015.4.29-2016.5.30）、博时中证淘金大数据 100 基金（2015.5.4-2016.5.30）、博时沪深 300 指数基金（2015.5.5-2016.5.30）、上证企债 30ETF 基金（2013.7.11-2018.1.26）基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金（2012.11.13-至今）兼博时深证基本面 200ETF 联接基金

					(2012.11.13-至今)、博时证券保险指数分级基金(2015.5.19-至今)、博时黄金ETF基金(2015.10.8-至今)、博时上证50ETF基金(2015.10.8-至今)、博时上证50ETF联接基金(2015.10.8-至今)、博时银行分级基金(2015.10.8-至今)、博时黄金ETF联接基金(2016.5.27-至今)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

2018年上半年，国内宏观经济仍在筑底阶段，6月官方制造业PMI和新订单小幅下行，预计6月经济景气最多有小幅下行，考虑到去年6月环比增速巨大，6月工业增加值同比增速大概率会掉到6.0%以下。购进价格指数显示PPI同比增速将有所回升。5月工业企业的利润较4月有小幅上升，收入有小幅下降。国内因金融去杠杆、中美贸易战等因素，导致蓝筹股指跌幅较大，而对质押融资风险的担忧，导致中小创指也出现较为明显的下行。上证50和沪深300分别下跌13.30%、12.94%，中证500下跌16.53%，中证1000下跌20.08%，而创业板指表现相对较好，仅下跌8.33%。板块方面，受避险情绪影响，仅餐饮旅游、医药、食品饮料板块上涨，而通信、电力设备、有色金属等板块表现较差。从行情来看，前半年涨跌幅为正的仅有食品饮料、餐饮旅游、食品饮料三个行业，涨幅分别是10.15%、4.46%、1.82%；跌幅较大的行业有综合、电力设备、通信、有色金属、机械，跌幅分别是32.12%、27.00%、26.66%、23.21%、22.15%。

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，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 2018 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.3234 元，份额累计净值为 1.3234 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-14.36%，同期业绩基准增长率-14.30%。

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 2018 年下半年，宏观经济方面，宏观政策边际上有改善，监管政策也有调整，显示政府对股市下跌有政策应对，过度悲观的情绪将得到修复，看好市场反弹，反弹中相对看好成长板块。利率方面，中美贸易争端、国内金融收缩和货币政策应对性调整，均强化了市场的避险情绪，持续推升利率债的结构性行情，利率水平有望延续下行趋势。综合考虑，中美贸易战、棚改货币化预期及人民币贬值等各类风险因素，我们认为大部分已反映到行情中，看好下半年的市场行情，投资者可关注成长板块的投资机会。结构上，总体仍均衡配置，风格可稍偏成长。但中美贸易争端前景依然迷茫，而 A 股的股权质押风险、信用风险也未得到充分清理。国内股市已处于底部，但即使有所反弹，仍建议保持仓位。

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

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

2018 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

2018 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，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

2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.3.1	883,568.31	653,492.69
结算备付金		137.76	1,818.18
存出保证金		355.25	521.17
交易性金融资产	6.4.3.2	42,689,692.11	54,291,357.53
其中：股票投资		42,689,692.11	54,172,557.53
基金投资		-	-
债券投资		-	118,800.00
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		-	601,282.19
应收利息	6.4.3.5	172.59	-66.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		43,573,926.02	55,548,404.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		19,229.21	23,943.45
应付托管费		16,807.84	52,290.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	12,173.34	24,750.87
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	212,964.86	234,978.36
负债合计		261,175.25	335,962.89
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	32,729,029.00	35,729,029.00
未分配利润	6.4.3.10	10,583,721.77	19,483,413.05
所有者权益合计		43,312,750.77	55,212,442.05
负债和所有者权益总计		43,573,926.02	55,548,404.94

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3234 元，基金份额总额 32,729,029.00 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-7,197,424.80	7,593,532.90
1. 利息收入		3,317.04	4,319.72
其中：存款利息收入	6.4.3.11	2,972.94	3,987.08
债券利息收入		23.56	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		320.54	332.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,739,096.27	60,562.42
其中：股票投资收益	6.4.3.12	1,328,959.54	-344,988.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	23,329.00	-
资产支持证券投资		-	-
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	386,807.73	405,550.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-8,939,098.49	7,528,251.76
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	-739.62	399.00
减：二、费用		408,639.91	389,000.19
1. 管理人报酬		129,786.17	115,707.66
2. 托管费		25,957.28	23,141.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	23,318.53	23,971.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.3.19	229,577.93	226,179.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,606,064.71	7,204,532.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,606,064.71	7,204,532.71

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	35,729,029.00	19,483,413.05	55,212,442.05
二、本期经营活动产生的基金净值变	-	-7,606,064.71	-7,606,064.71

动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,000,000.00	-1,293,626.57	-4,293,626.57
其中：1. 基金申购款	1,500,000.00	1,055,401.66	2,555,401.66
2. 基金赎回款	-4,500,000.00	-2,349,028.23	-6,849,028.23
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）	32,729,029.00	10,583,721.77	43,312,750.77
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	37,229,029.00	7,435,912.03	44,664,941.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,204,532.71	7,204,532.71
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）	-	-27,976.88	-27,976.88
其中：1. 基金申购款	1,500,000.00	406,201.58	1,906,201.58
2. 基金赎回款	-1,500,000.00	-434,178.46	-1,934,178.46
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）	37,229,029.00	14,612,467.86	51,841,496.86

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

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[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令

[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深府办[2011]60 号《深圳市地方教育附加征收管理暂行办法》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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，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。

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	883,568.31
定期存款	-
其他存款	-
合计	883,568.31

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,624,208.91	42,689,692.11	-4,934,516.80
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		47,624,208.91	42,689,692.11
			-4,934,516.80

注：2018 年 6 月 30 日，本基金无可退替代款估值增值余额(2017 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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	172.29
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	0.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	172.59

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,173.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,173.34

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付指数使用费	14,610.58
预提费用	198,354.28
合计	212,964.86

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	35,729,029.00	35,729,029.00
本期申购	1,500,000.00	1,500,000.00
本期赎回 (以“-”号填列)	-4,500,000.00	-4,500,000.00
本期末	32,729,029.00	32,729,029.00

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	26,053,526.94	-6,570,113.89	19,483,413.05
本期利润	1,333,033.78	-8,939,098.49	-7,606,064.71
本期基金份额交易产生的变动数	-2,239,773.15	946,146.58	-1,293,626.57
其中：基金申购款	1,105,817.74	-50,416.08	1,055,401.66
基金赎回款	-3,345,590.89	996,562.66	-2,349,028.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,146,787.57	-14,563,065.80	10,583,721.77

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	2,861.52
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	108.67	
其他	2.75	
合计	2,972.94	

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	995,250.02
股票投资收益——赎回差价收入	333,709.52	
合计	1,328,959.54	

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	卖出股票成交总额	8,689,689.93
减：卖出股票成本总额	7,694,439.91	
买卖股票差价收入	995,250.02	

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 2018年1月1日至2018年6月30日
赎回基金份额对价总额	6,849,028.23
减：现金支付赎回款总额	11,150.23
减：赎回股票成本总额	6,504,168.48
赎回差价收入	333,709.52

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	152,365.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	129,000.00
减：应收利息总额	36.45
买卖债券差价收入	23,329.00

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	386,807.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	386,807.73

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,939,098.49
——股票投资	-8,939,098.49
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-8,939,098.49

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-739.62
合计	-739.62

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
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	23,318.53
银行间市场交易费用	-
合计	23,318.53

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018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	75.00
上市费	29,752.78
指数使用费	31,148.65
合计	229,577.93

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、基金销售机构
博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金	基金管理人管理的其他基金

联接基金（“深证基本面 200ETF 联接基金”）

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	129,786.17	115,707.66
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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,957.28	23,141.52

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	27,756,365.00	84.81%	30,056,365.00	84.12%

200ETF 联接基金				
-------------	--	--	--	--

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	883,568.31	2,861.52	1,143,491.12	3,948.02

注：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。

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（2018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
000022	深赤湾 A	2017-11-20	公告重大事项	22.82	2018-07-10	20.55	1,500	40,517.11	34,230.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	公告重大事项	5.84	2018-07-17	5.26	20,470	166,752.79	119,544.80	-
000540	中天金融	2017-08-21	公告重大事项	4.87	-	-	49,367	252,356.63	240,417.29	-
000587	金洲慈航	2018-06-15	公告重大事项	4.96	2018-07-02	4.46	6,900	52,003.92	34,224.00	-
000603	盛达矿业	2018-06-11	公告重大事项	10.83	2018-08-21	9.75	2,700	34,795.52	29,241.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	公告重大事项	18.08	-	-	2,534	54,596.75	45,814.72	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	公告重大事项	8.40	2018-07-16	7.56	15,726	179,447.66	132,098.40	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	公告重大事项	6.00	-	-	88,440	488,455.14	530,640.00	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	公告重大事项	4.99	2018-07-02	4.74	10,300	46,318.55	51,397.00	-
002051	中工国际	2018-04-04	公告重大事项	15.27	-	-	4,479	89,972.43	68,394.33	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	公告重大事项	16.12	-	-	2,360	48,262.61	38,043.20	-
002252	上海莱士	2018-02-23	公告重大事项	19.52	-	-	2,460	50,419.66	48,019.20	-
002309	中利集团	2018-02-05	公告重大事项	14.30	2018-07-30	12.78	6,000	86,177.96	85,800.00	-

002310	东方园林	2018-05-25	公告重大事项	15.03	2018-08-27	13.47	4,822	76,880.79	72,474.66	-
002408	齐翔腾达	2018-06-19	公告重大事项	12.28	-	-	5,390	55,691.91	66,189.20	-
002450	康得新	2018-06-04	公告重大事项	17.08	-	-	6,600	124,114.42	112,728.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	公告重大事项	52.04	-	-	900	51,251.11	46,836.00	-
300072	三聚环保	2018-06-19	公告重大事项	23.28	2018-07-10	24.00	3,700	96,596.56	86,136.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	公告重大事项	16.60	2018-07-31	16.50	7,700	117,359.30	127,820.00	-

注：本基金截至 2018 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同责任，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2017 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.22%)。

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。

于 2018 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。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持证券在证券交易所上市，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，其余均能以合理价格适时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	883,568.31	-	-	-	883,568.31
结算备付金	137.76	-	-	-	137.76
存出保证金	355.25	-	-	-	355.25
交易性金融资产	-	-	-	42,689,692.11	42,689,692.11
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	172.59	172.59
资产总计	884,061.32	-	-	42,689,864.70	43,573,926.02
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	19,229.21	19,229.21
应付托管费	-	-	-	16,807.84	16,807.84
应付交易费用	-	-	-	12,173.34	12,173.34
其他负债	-	-	-	212,964.86	212,964.86
负债总计	-	-	-	261,175.25	261,175.25
利率敏感度缺口	884,061.32	-	-	42,428,689.45	43,312,750.77
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	653,492.69	-	-	-	653,492.69
结算备付金	1,818.18	-	-	-	1,818.18
存出保证金	521.17	-	-	-	521.17
交易性金融资产	-	10,400.00	108,400.00	54,172,557.53	54,291,357.53
应收证券清算款	-	-	-	601,282.19	601,282.19
应收利息	-	-	-	-66.82	-66.82
资产总计	655,832.04	10,400.00	108,400.00	54,773,772.90	55,548,404.94
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	23,943.45	23,943.45
应付托管费	-	-	-	52,290.21	52,290.21
应付交易费用	-	-	-	24,750.87	24,750.87
其他负债	-	-	-	234,978.36	234,978.36
负债总计	-	-	-	335,962.89	335,962.89
利率敏感度缺口	655,832.04	10,400.00	108,400.00	54,437,810.01	55,212,442.05

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 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2017 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债

券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.22%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	42,689,692.11	98.56	54,172,557.53	98.12
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	42,689,692.11	98.56	54,172,557.53	98.12

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	1、深证基本面 200 指数上升 5%	增加约 212	增加约 272
2、深证基本面 200 指数下降 5%	减少约 212	减少约 272	

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 2018 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 40,719,644.31 元，属于第二层次的余额为 1,970,047.80 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次 52,741,607.73 元，第二层次 1,549,749.80 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 2018 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（2017 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	42,689,692.11	97.97
	其中：股票	42,689,692.11	97.97
2	基金投资	-	-
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	883,706.07	2.03
8	其他各项资产	527.84	0.00
9	合计	43,573,926.02	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	924,505.20	2.13
B	采矿业	547,671.33	1.26
C	制造业	25,996,477.54	60.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,091,714.98	2.52
E	建筑业	521,050.79	1.20
F	批发和零售业	1,977,888.24	4.57
G	交通运输、仓储和邮政业	322,884.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	468,582.88	1.08
J	金融业	4,669,809.48	10.78
K	房地产业	5,126,099.95	11.84
L	租赁和商务服务业	565,029.52	1.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	222,678.28	0.51
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	255,299.92	0.59
S	综合	-	-
	合计	42,689,692.11	98.56

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	000651	格力电器	72,824	3,433,651.60	7.93
2	000333	美的集团	43,307	2,261,491.54	5.22
3	000002	万科 A	85,982	2,115,157.20	4.88
4	000001	平安银行	175,362	1,594,040.58	3.68
5	000100	TCL 集团	321,182	931,427.80	2.15
6	000858	五粮液	11,527	876,052.00	2.02
7	000338	潍柴动力	99,320	869,050.00	2.01
8	300498	温氏股份	39,360	866,707.20	2.00
9	000725	京东方 A	233,157	825,375.78	1.91
10	000776	广发证券	52,642	698,559.34	1.61
11	002142	宁波银行	35,552	579,142.08	1.34

12	000895	双汇发展	21,297	562,453.77	1.30
13	000625	长安汽车	61,610	554,490.00	1.28
14	000825	太钢不锈	88,440	530,640.00	1.23
15	002304	洋河股份	4,011	527,847.60	1.22
16	002024	苏宁易购	34,950	492,096.00	1.14
17	002415	海康威视	12,547	465,870.11	1.08
18	001979	招商蛇口	23,626	450,075.30	1.04
19	000709	河钢股份	147,029	433,735.55	1.00
20	000876	新希望	66,554	421,952.36	0.97
21	000157	中联重科	102,645	421,870.95	0.97
22	000069	华侨城 A	57,262	414,004.26	0.96
23	002594	比亚迪	7,844	374,001.92	0.86
24	000630	铜陵有色	161,250	356,362.50	0.82
25	002736	国信证券	37,800	343,980.00	0.79
26	000783	长江证券	63,212	343,241.16	0.79
27	000568	泸州老窖	5,522	336,068.92	0.78
28	000063	中兴通讯	25,388	330,805.64	0.76
29	002202	金风科技	24,432	308,820.48	0.71
30	000778	新兴铸管	69,530	297,588.40	0.69
31	002146	荣盛发展	33,316	290,848.68	0.67
32	000166	申万宏源	65,576	286,567.12	0.66
33	000538	云南白药	2,462	263,335.52	0.61
34	000402	金融街	32,470	261,383.50	0.60
35	000488	晨鸣纸业	19,276	249,045.92	0.57
36	002027	分众传媒	25,776	246,676.32	0.57
37	000039	中集集团	18,427	244,710.56	0.56
38	000540	中天金融	49,367	240,417.29	0.56
39	000066	中国长城	31,624	224,846.64	0.52
40	000425	徐工机械	52,326	221,862.24	0.51
41	000423	东阿阿胶	4,031	216,908.11	0.50
42	000898	鞍钢股份	38,400	213,888.00	0.49
43	000656	金科股份	44,415	213,192.00	0.49
44	000059	华锦股份	30,400	209,456.00	0.48
45	000878	云南铜业	21,277	202,982.58	0.47
46	000728	国元证券	27,212	201,368.80	0.46
47	000623	吉林敖东	11,138	200,261.24	0.46
48	002183	怡亚通	29,896	198,808.40	0.46
49	000581	威孚高科	8,753	193,528.83	0.45
50	000983	西山煤电	25,569	192,023.19	0.44
51	002092	中泰化学	19,680	189,715.20	0.44
52	002241	歌尔股份	18,208	185,539.52	0.43
53	000963	华东医药	3,826	184,604.50	0.43
54	002081	金螳螂	18,139	183,203.90	0.42
55	000413	东旭光电	29,500	178,770.00	0.41
56	000543	皖能电力	40,203	177,295.23	0.41
57	000046	泛海控股	29,700	168,993.00	0.39
58	000703	恒逸石化	11,181	166,373.28	0.38
59	000768	中航飞机	10,636	166,347.04	0.38
60	000926	福星股份	22,976	165,197.44	0.38
61	000690	宝新能源	23,322	162,321.12	0.37

62	002456	欧菲科技	9,950	160,493.50	0.37
63	002244	滨江集团	29,778	154,845.60	0.36
64	000830	鲁西化工	8,969	153,190.52	0.35
65	000600	建投能源	27,010	150,445.70	0.35
66	002008	大族激光	2,825	150,261.75	0.35
67	000959	首钢股份	36,500	150,015.00	0.35
68	000550	江铃汽车	12,300	148,953.00	0.34
69	002078	太阳纸业	15,331	148,557.39	0.34
70	000701	厦门信达	21,164	146,878.16	0.34
71	000750	国海证券	40,850	145,834.50	0.34
72	300226	上海钢联	2,400	143,640.00	0.33
73	002422	科伦药业	4,398	141,175.80	0.33
74	000528	柳工	13,134	140,665.14	0.32
75	002236	大华股份	6,237	140,644.35	0.32
76	000027	深圳能源	27,600	136,344.00	0.31
77	000686	东北证券	21,243	136,167.63	0.31
78	002475	立讯精密	6,025	135,803.50	0.31
79	000883	湖北能源	33,000	135,630.00	0.31
80	300070	碧水源	9,636	134,229.48	0.31
81	000671	阳光城	22,317	133,232.49	0.31
82	000060	中金岭南	27,395	133,139.70	0.31
83	000793	华闻传媒	15,726	132,098.40	0.30
84	000786	北新建材	7,034	130,340.02	0.30
85	002110	三钢闽光	8,100	129,843.00	0.30
86	000961	中南建设	20,442	128,989.02	0.30
87	300146	汤臣倍健	7,700	127,820.00	0.30
88	000726	鲁泰 A	11,774	127,041.46	0.29
89	002493	荣盛石化	12,300	126,936.00	0.29
90	002004	华邦健康	24,800	125,984.00	0.29
91	300124	汇川技术	3,800	124,716.00	0.29
92	000401	冀东水泥	14,056	124,676.72	0.29
93	002673	西部证券	16,471	124,356.05	0.29
94	000718	苏宁环球	33,779	123,968.93	0.29
95	002001	新和成	6,380	120,964.80	0.28
96	000415	渤海金控	20,470	119,544.80	0.28
97	000792	盐湖股份	10,864	117,548.48	0.27
98	000012	南玻 A	23,649	117,062.55	0.27
99	002500	山西证券	17,197	115,907.78	0.27
100	000758	中色股份	25,680	115,560.00	0.27
101	000559	万向钱潮	16,988	115,518.40	0.27
102	000031	中粮地产	19,821	114,565.38	0.26
103	002419	天虹股份	7,800	113,880.00	0.26
104	000917	电广传媒	19,698	113,460.48	0.26
105	002589	瑞康医药	8,300	113,212.00	0.26
106	002450	康得新	6,600	112,728.00	0.26
107	000626	远大控股	15,900	111,936.00	0.26
108	002440	闰土股份	9,556	111,709.64	0.26
109	002311	海大集团	5,287	111,555.70	0.26
110	000937	冀中能源	26,936	110,706.96	0.26
111	000685	中山公用	13,843	110,328.71	0.25

112	000729	燕京啤酒	16,222	109,174.06	0.25
113	300059	东方财富	8,200	108,076.00	0.25
114	000800	一汽轿车	14,434	107,966.32	0.25
115	002470	金正大	15,676	107,850.88	0.25
116	002385	大北农	25,731	106,269.03	0.25
117	000933	神火股份	21,700	104,377.00	0.24
118	002065	东华软件	12,024	103,406.40	0.24
119	002572	索菲亚	3,200	102,976.00	0.24
120	000050	深天马 A	7,200	102,384.00	0.24
121	000501	鄂武商 A	8,275	101,699.75	0.23
122	002221	东华能源	10,400	101,608.00	0.23
123	002701	奥瑞金	18,530	101,173.80	0.23
124	000829	天音控股	13,798	101,139.34	0.23
125	002128	露天煤业	11,053	100,140.18	0.23
126	000028	国药一致	2,000	99,800.00	0.23
127	002242	九阳股份	5,571	98,550.99	0.23
128	002294	信立泰	2,647	98,388.99	0.23
129	000960	锡业股份	8,108	97,377.08	0.22
130	002048	宁波华翔	7,833	96,580.89	0.22
131	000999	华润三九	3,466	96,458.78	0.22
132	002129	中环股份	12,300	96,309.00	0.22
133	002416	爱施德	16,349	95,968.63	0.22
134	000732	泰禾集团	4,900	95,305.00	0.22
135	000418	小天鹅 A	1,342	93,067.70	0.21
136	002085	万丰奥威	9,812	92,232.80	0.21
137	300408	三环集团	3,900	91,650.00	0.21
138	002091	江苏国泰	14,000	88,900.00	0.21
139	000826	启迪桑德	5,060	88,448.80	0.20
140	000006	深振业 A	14,958	87,653.88	0.20
141	002050	三花智控	4,630	87,275.50	0.20
142	002563	森马服饰	6,100	87,230.00	0.20
143	000400	许继电气	11,166	87,206.46	0.20
144	000807	云铝股份	16,811	87,080.98	0.20
145	000921	海信科龙	8,400	87,024.00	0.20
146	300072	三聚环保	3,700	86,136.00	0.20
147	002007	华兰生物	2,674	85,995.84	0.20
148	002309	中利集团	6,000	85,800.00	0.20
149	000887	中鼎股份	5,900	85,019.00	0.20
150	000906	浙商中拓	16,352	84,049.28	0.19
151	000598	兴蓉环境	20,087	81,553.22	0.19
152	000513	丽珠集团	1,820	79,989.00	0.18
153	002466	天齐锂业	1,600	79,344.00	0.18
154	002157	正邦科技	19,300	78,551.00	0.18
155	000078	海王生物	16,200	77,922.00	0.18
156	002249	大洋电机	18,028	77,700.68	0.18
157	002233	塔牌集团	6,746	77,174.24	0.18
158	300027	华谊兄弟	12,397	76,365.52	0.18
159	002152	广电运通	12,973	76,281.24	0.18
160	000089	深圳机场	9,900	75,735.00	0.17
161	002601	龙麟佰利	5,800	74,994.00	0.17

162	000717	韶钢松山	11,400	74,784.00	0.17
163	000536	华映科技	26,777	73,636.75	0.17
164	300433	蓝思科技	3,500	73,430.00	0.17
165	000021	深科技	10,637	72,544.34	0.17
166	002310	东方园林	4,822	72,474.66	0.17
167	000627	天茂集团	10,100	70,902.00	0.16
168	002508	老板电器	2,300	70,426.00	0.16
169	002051	中工国际	4,479	68,394.33	0.16
170	002375	亚厦股份	12,732	67,988.88	0.16
171	002408	齐翔腾达	5,390	66,189.20	0.15
172	002251	步步高	5,641	64,194.58	0.15
173	002372	伟星新材	3,490	61,738.10	0.14
174	002013	中航机电	7,875	59,613.75	0.14
175	002267	陕天然气	8,400	58,800.00	0.14
176	000828	东莞控股	7,300	58,254.00	0.13
177	002714	牧原股份	1,300	57,798.00	0.13
178	002203	海亮股份	6,800	55,080.00	0.13
179	000981	银亿股份	7,300	54,385.00	0.13
180	002399	海普瑞	2,400	53,136.00	0.12
181	002032	苏泊尔	1,000	51,500.00	0.12
182	000939	凯迪生态	10,300	51,397.00	0.12
183	002252	上海莱士	2,460	48,019.20	0.11
184	000869	张裕 A	1,200	47,832.00	0.11
185	002739	万达电影	900	46,836.00	0.11
186	000666	经纬纺机	2,534	45,814.72	0.11
187	000429	粤高速 A	6,300	45,486.00	0.11
188	000761	本钢板材	11,100	44,844.00	0.10
189	000938	紫光股份	700	43,820.00	0.10
190	000631	顺发恒业	12,500	42,875.00	0.10
191	001965	招商公路	4,800	39,072.00	0.09
192	000582	北部湾港	5,100	38,607.00	0.09
193	002075	沙钢股份	2,360	38,043.20	0.09
194	002302	西部建设	3,300	35,541.00	0.08
195	000022	深赤湾 A	1,500	34,230.00	0.08
196	000587	金洲慈航	6,900	34,224.00	0.08
197	000553	沙隆达 A	2,000	31,620.00	0.07
198	002352	顺丰控股	700	31,500.00	0.07
199	000603	盛达矿业	2,700	29,241.00	0.07
200	002608	江苏国信	4,000	27,600.00	0.06
201	000987	越秀金控	2,354	18,502.44	0.04
202	002010	传化智联	1,200	14,580.00	0.03
203	000617	中油资本	1,000	11,240.00	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	000100	TCL 集团	344,797.00	0.62
2	000625	长安汽车	262,449.00	0.48
3	000046	泛海控股	216,780.00	0.39
4	300498	温氏股份	208,952.92	0.38
5	000725	京东方 A	182,471.00	0.33
6	000550	江铃汽车	173,486.00	0.31
7	000027	深圳能源	160,568.00	0.29
8	002027	分众传媒	155,897.00	0.28
9	000166	申万宏源	154,175.00	0.28
10	300226	上海钢联	148,549.00	0.27
11	000783	长江证券	146,969.00	0.27
12	000883	湖北能源	146,888.00	0.27
13	000776	广发证券	140,749.00	0.25
14	002493	荣盛石化	135,580.00	0.25
15	000709	河钢股份	134,083.00	0.24
16	002456	欧菲科技	133,569.00	0.24
17	000933	神火股份	127,075.97	0.23
18	002221	东华能源	121,687.44	0.22
19	000778	新兴铸管	116,511.00	0.21
20	002589	瑞康医药	116,448.00	0.21

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	000651	格力电器	789,867.00	1.43
2	000858	五粮液	726,525.00	1.32
3	000333	美的集团	712,997.00	1.29
4	002304	洋河股份	382,415.00	0.69
5	000830	鲁西化工	364,096.00	0.66
6	000002	万科 A	326,582.00	0.59
7	000568	泸州老窖	307,157.00	0.56
8	000338	潍柴动力	248,835.00	0.45
9	002024	苏宁易购	234,037.00	0.42
10	000860	顺鑫农业	198,238.00	0.36
11	002422	科伦药业	164,822.00	0.30
12	000789	万年青	144,514.75	0.26
13	000001	平安银行	135,544.00	0.25
14	002142	宁波银行	130,774.00	0.24
15	002001	新和成	125,954.00	0.23
16	000690	宝新能源	120,989.98	0.22
17	000792	盐湖股份	108,557.00	0.20
18	002419	天虹股份	103,696.00	0.19
19	002237	恒邦股份	101,640.12	0.18
20	000596	古井贡酒	100,601.00	0.18

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	9,128,374.46
卖出股票的收入（成交）总额	8,689,689.93

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 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。

7.12.2 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	355.25

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	172.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	527.84

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		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
420	77,926.26	-	-	4,972,664.00	15.19%	27,756,365.00	84.81%

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	杨振山	470,000.00	1.44%
2	朱洪宏	253,800.00	0.78%
3	徐国忠	230,474.00	0.70%
4	王宗武	200,000.00	0.61%
5	韩伟锋	147,702.00	0.45%
6	陈焯	141,605.00	0.43%
7	何东银	140,005.00	0.43%
8	付玉珍	140,000.00	0.43%
9	荣红	128,026.00	0.39%
10	肖竞松	115,012.00	0.35%
	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	27,756,365.00	84.81%

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	35,729,029.00
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	4,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	32,729,029.00

§ 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	17,818,064.39	100.00%	13,027.17	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	152,365.45	100.00%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	20180629 关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-29

	申购及定投业务费率优惠活动的公告		
2	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-20
3	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年年度报告 (摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
4	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年年度报告 (正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
5	20180330 关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投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	2018-03-30
6	博时深证基本面 200ETF 托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-27
7	博时深证基本面 200ETF 基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-27
8	流动性风险管理规定: 深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修改法律文件对照表	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-24
9	关于博时基金管理有限公司根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》变更旗下部分基金法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-24
10	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-21
11	博时深证基本面 200ETF 招募更新说明书 2018 年第 1 号 (摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-24
12	博时深证基本面 200ETF 招募更新说明书 2018 年第 1 号 (正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-24
13	深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-20

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
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	1	2018-01-01~2018-06-30	30,056,365.00	1,500,000.00	3,800,000.00	27,756,365.00	84.81%

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：本基金同时可在场内交易，因场内交易导致的投资者份额变动管理人无法获悉。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录**12.1 备查文件目录**

- 12.1.1 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
- 12.1.2 《深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 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
- 12.1.6 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 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
二〇一八年八月二十九日