

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:2015年3月28日

基金管理人的董事会、监事会在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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年3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。

本年度报告所载数据截至年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2基金简介

## 深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

### 2014年度报告摘要

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年度，“查查新政”逐步改变了投资者对中国资本市场的传统认识，在反反复复的大幅预期、改革深度和广度以及执行上的超预期，以及“沪港通”、“新三板”等市场的热闹的市场行情，不管是股票市场还是债券市场，市场情绪均大幅超越过年初各大机构的市场预期。股票市场方面，2014年明显地彻底实现了久违的价格转移，权益投资各放异彩，最后两月大盘风格实现大逆转。2014年度沪深300指数上涨51.66%，中证500指数上涨39.01%，创业板指数上涨12.83%。从行业来看，非银、建筑、钢铁、地产、交运和银行涨幅靠前，医药、食品饮料、家电、传媒、电子和计算机涨幅靠后。债券方面，受股票市场的上涨，转债市场表现优异。总之，2014年度债市市场实现双牛行情，大盘蓝筹最后时刻实现大幅逆转，在牛市背景下，被动能推升市场也是市场资金最后的投资选择。

2015年中国资本市场对投资品种的逐步丰富的大背景下，机构投资者以其专业性优势的显性体现，期货期权等产品的深度参与，资本市场的新颖性逐步提升。在中国政府的积极引导下，资本市场将逐步会逐步实现合理的理性行情，将会打破历史的牛熊魔咒的形成。随着新工具的不断丰富，以及衍生品市场的积极拓展，中国的资产配置时代将会悄然来临。大类资产配置迎来权益类投资的精英时代；国人最爱加杠杆争取财富“中国梦”，以前是楼市，现在是股市。

我们认为2015年中国经济增速将延续下去，股市受政策的支撑以及资金的关注而继续有所表现。遵循经济、改革的逻辑，我们认为改革依然将是市场的主要问题，国企改革总体方案，“一带一路”规划可能正式发布，注册制改革也将稳步推进等，这些改革措施，都对资本市场产生深远影响。

在投资策略上，深证200ETF作为一种只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为原则，坚持跟踪指数的基本面200指数。同时我们仍然看好中国经济的长期经济增长，希望通过深证200ETF为投资人提供分享中国经济长期经济增长的机会。

4.6管理人对报告期内基金估值政策和估值方法的说明

本基金基金管理人遵循《基金合同》及《基金估值政策》的规定，确保基金资产估值的公平、合理、有效维护投资者的利益，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《基金估值政策和估值程序》，估值委员会由王晋管理，由基金总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运营总监、基金核算部负责人、基金运营部负责人、基金销售部负责人、基金客户服务部负责人、基金估值委员会成员共5人组成，其中专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有独立的独立性。估值委员会的主要职责是：保证基金估值的公平、合理；制订、健全估值政策和程序，确保对投资品种进行估值的政策和程序的一致性；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含本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律、法规的要求对本基金估值及净值计算进行复核审查。当存在异议时，托管银行有责任要求基金管理人作出合理的解释，通过积极磋商达成一致意见。会计师事务所对相关估值委员会采用的相关的估值模型、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政策和利润分配情况的说明

本基金收益分配政策详见本基金《基金合同》“收益分配”条款。本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于可供分配利润的95%。若自基金合同生效之日起不满60日，不进行收益分配；若在基金合同生效之日起60日后，每60日进行一次收益分配。

根据相关法律法规及基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期末本基金未满足基金利润分配条件，故不进行收益分配。

5.1报告期末管理人遵规守信情况声明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.2报告人对报告期内基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，托管人未发现存在违反基金合同、损害基金份额持有人利益的行为。

5.3报告期内基金利润分配情况

本基金管理人对报告期内基金利润分配情况的说明，参见本报告“四、利润分配”部分。

5.4报告期末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

报告期末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，参见本报告“四、利润分配”部分。

5.5报告期末管理人报告

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.6报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，托管人未发现存在违反基金合同、损害基金份额持有人利益的行为。

5.7报告期末管理人对报告期内基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，托管人未发现存在违反基金合同、损害基金份额持有人利益的行为。

5.8报告期末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

报告期末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，参见本报告“四、利润分配”部分。

5.9报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.10报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.11报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.12报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.13报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.14报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.15报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.16报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.17报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.18报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.19报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.20报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.21报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.22报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.23报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.24报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.25报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.26报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.27报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.28报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.29报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.30报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.31报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.32报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.33报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.34报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.35报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.36报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.37报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.38报告期末管理人对基金投资运作遵规守信、净值表现、利润分配等情况的说明

2014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，严格按照《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，不存在任何损害持有人利益的行为。

5.39报告