深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2011年7月13日
公告日期:2011年7月8日

一、重要声明与提示

《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人博时基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人交通银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅完整在2011年4月25日《证券时报》及博时基金管理有限公司网站(www.bosera.com)上公告的《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1.基金二级市场交易简称:深F200
2.二级市场交易代码:159908
3.基金申购赎回简称:深F200
4.申购赎回代码:159908
5.标的指数简称:深证基本面200指数
6.标的指数代码:399703
7.2011年7月6日基金份额总额:403,229,029.00份
8.2011年7月6日基金份额净值:1.0039元
9.本次上市交易份额:403,229,029.00份
10.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
11.上市交易日期:2011年7月13日
12.基金管理人:博时基金管理有限公司
13.基金托管人:交通银行股份有限公司
14.申购赎回代理券商:
(1)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
电话:0731-85832343
传真:0731-85832214
客户服务电话:95571
网址:http://www.foundersc.com
(2)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
法定代表人:杨明辉
联系人:杨瑞芳
电话:0755-82026511
传真:0755-82026539
客户服务电话:4006008008
网址:http://www.cjis.cn
(3)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
客户服务电话:95538
网址:http://www.qlzq.com.cn
(4)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
联系人:谢高得
电话:021-38565785
传真:021-38565783
客户服务电话:4008888123
网址:http://www.xyzq.com.cn
(5)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤凌川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
客户服务电话:4008888993
网址:http://www.dxzq.net.cn
(6)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、37、41和42楼
法定代表人:王志伟
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
客户服务电话:95575
网址:http://www.gf.com.cn
(7)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人:顾伟国
联系人:李洋
电话:010-66568047
传真:010-66568536
客户服务电话:4008888888
网址:http://www.chinastock.com.cn
(8)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219275
传真:021-63602722
客户服务电话:95553
网址:http://www.htsec.com
(9)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人:黄金琳
联系人:余腾
电话:0591-87278701
传真:0591-87841150
客户服务电话:96326(福建省外请加拨0591)
网址:http://www.ghfzq.com.cn

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况
1.基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2011年4月6日证监许可[2011]498号。
2.基金合同生效日:2011年6月10日。
3.基金运作方式:交易型开放式。
4.基金合同期限:不定期。
5.发售日期:2011年5月3日至2011年6月3日。其中,网下现金发售和网上现金发售的日期为2011年5月3日至2011年6月3日,网下股票发售的日期为2011年5月30日至2011年6月3日。
6.发售价格:人民币1.00元。
7.发售方式:投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
8.发售机构:
(1)网下现金发售直销机构
博时基金管理有限公司
(2)网上现金发售代理机构
网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司:国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰联合、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、国元证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、信达证券、浙商证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券、中航证券、大新证券等(排序不分先后)。
(3)网下现金发售直销机构
博时基金管理有限公司
(2)网上现金发售代理机构
网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司:国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰联合、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、国元证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、信达证券、浙商证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券、中航证券、大新证券等(排序不分先后)。
(3)网下股票发售直销机构
博时基金管理有限公司
(4)网上股票发售代理机构
网上股票发售代理机构包括具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司:国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰联合、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、国元证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、信达证券、浙商证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券、中航证券、大新证券等(排序不分先后)。
9.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
10.募集资金总额及人账情况
本基金于2011年5月3日起公开募集,基金募集工作已于2011年6月3日顺利结束。
经普华永道中天会计师事务所有限公司验资,本次募集的募集金额总额为403,229,029.00元人民币(募集资金扣下2011年6月10日到入本基金在基金交易确认日之前产生的利息共计49,050.00元人民币,募集资金已于2011年6月10日划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户。
本次募集有效认购总户数为8,507户,按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算,募集期募集金额(含所募集股票市值)及利息结转的基金份额共计403,229,029.00份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中本基金管理人博时基金管理有限公司认购基金从业人员投资人员的认购本基金。
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
11.本基金募集备案情况
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金合同》、《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集申请经中国证监会核准,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2011年6月10日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。
(二)本基金上市交易的主要内容
1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上[2011]207号
2.上市交易日期:2011年7月13日
3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4.基金二级市场交易简称:深F200
5.二级市场交易代码:159908
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易
6.本次上市交易份额:403,229,029.00份
7.本上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2011年7月6日,本基金份额持有人户数为8507户,平均每户持有的基金份额为47399.67份。
(二)持有人结构
截至2011年7月6日,本基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的基金份额为107,804,258.00份,占基金总份额的26.74%;个人投资者持有的基金份额为295,424,771.00份,占基金总份额的73.26%。
(三)截至2011年7月6日,前十名基金份额持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例(%)
1	中投证券-中行-中投汇盈基金优选集合资产管理计划	30,003,750	7.44%
2	齐鲁证券-中行-齐鲁山灵活配置集合资产管理计划	20,000,833	4.96%
3	兴业证券股份有限公司	18,000,750	4.46%
4	中国银河证券股份有限公司	14,504,011	3.60%
5	海通证券股份有限公司	10,000,416	2.48%
6	华泰证券股份有限公司	6,000,250	1.49%
7	梁乐文	4,000,166	0.99%
8	叶冬梅	3,000,291	0.74%
9	长沙合盛科技投资有限公司	2,000,250	0.50%
10	张清姝	2,000,194	0.50%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1.名称:博时基金管理有限公司
2.法定代表人:杨鹤
3.总裁:肖风
4.注册资本:壹亿元人民币
5.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
6.设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]26号
7.经营范围:基金募集;基金销售;资产管理以及中国证监会许可的其它业务(涉及行政许可的凭许可证经营)
9.股权结构:招商证券股份有限公司,持有股份49%;中国长城资产管理公司,持有股份25%;天津港(集团)有限公司,持有股份6%;瑞安实业有限公司,持有股份6%;上海盛业资产管理有限公司,持有股份6%;丰益实业发展有限公司,持有股份6%;广厦建设集团有限责任公司,持有股份2%。
10.内部组织结构及职能:
本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的合法权益。公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。
公司下设十四个直属部门和两大销售业务体系,分别是:总裁办公室、股票投资部、特定资产管理部、固定收益部、研究部、交易部、产品规划部、价格部、基金运作部、财务部、信息技术部、监察法律部、风险管理部、人力资源部、零售业务和机构业务、总裁办公室专门负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、外事活动管理、档案管理、董事会、党办及工会工作。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责特定资产的管理和客户咨询服务。固定收益部负责进行固定收益证券的选择和组合管理。研究部负责完成对宏观经济、行业公司及市场投研究、交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护,产品维护以及年金方案设计与精算等业务年金咨询工作。市场部负责基金营销策划、品牌推广等工作。基金运作部负责基金会计、基金注册登记业务、财务部负责公司财务事宜。信息技术部负责系统开发、网络运行及维护。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察,并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。风险管理部负责建立和运营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。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、人事信息管理工作。零售业务下辖北京区域、上海区域、南方区域、客户服务中心和电子商务部,负责公司全国范围内的零售客户、渠道销售和服务工作。其中,零售区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务;客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作;电子商务部负责公司电子商务业务的发展。各部门使用公司方网站资源管理的日常管理权以直销网上交易平台的建设与管理工作;渠道产品组负责公司的银行渠道开拓、销售推广服务工作,以及公司产品销售前包装整合工作。机构业务负责公司全国范围内的机构客户销售和服务工作。机构业务下辖养老金业务部、战略客户部、机构理财部-上海、机构理财部-南方和券商渠道组。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构理财部-上海和机构理财部-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作;券商渠道组负责券商渠道的开拓和销售服务。另设北京分公司、上海分公司、沈阳分公司和郑州分公司,分别负责对驻京、沪、沈阳和郑州人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳和郑州处理公务人员给予协助。此外,还设有境外子公司:博时基金(国际)有限公司。
11.人员情况:
截止到2011年5月31日,博时公司总人数338人,其中64%以上的员工具有硕士以上学历。
12.信息披露负责人:孙鹏清
电话:0755-83169999
13.基金管理业务情况简介:
截至2011年5月31日,博时基金管理有限公司旗下共管理22只开放式基金和2只封闭式基金,旗下管理的封闭式基金有裕阳证券投资基金和裕隆证券投资基金。开放式基金有博时价值增长证券投资基金、博时裕富沪深300指数证券投资基金、博时现金收益证券投资基金、博时精选股票证券投资基金、博时主题行业股票证券投资基金(LOF)、博时稳定价值债券投资基金、博时平衡配置混合型证券投资基金、博时价值增长贰号证券投资基金、博时第三产业成长股票证券投资基金、博时新兴成长股票型证券投资基金、博时特许价值股票型证券投资基金、博时信用债券投资基金、博时策略灵活配置混合型证券投资基金、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金B份额、博时创业成长股票型证券投资基金、博时大中华亚太精选股票证券投资基金、博时宏观回报债券型证券投资基金、博时行业轮动股票型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、博时抗通胀增强回报证券投资基金、博时卓越品牌股票型证券投资基金(LOF)。
14.本基金基金经理
沈龙先生,博士,1995年至1997年在哈佛大学从事博士后研究工作。1997年8月起先后在美国的道琼斯公司、彭博公司、巴克莱全球投资公司工作。2009年5月加入博时基金管理有限公司,现任股票投资部总经理、ETF及量化投资部总监兼博时上证超大盘ETF及联接基金基金经理、博时大中华亚太精选股票基金基金经理、博时深证基本面200ETF及联接基金经理。
(二)基金托管人
1.基金托管人概况
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
法定代表人:胡怀邦
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:562.59亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:张咏东
电话:021-32169999
2.主要人员情况
截至2011年5月末,交通银行资产托管部共有员工124人,平均年龄32岁,员工全部拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有中高级职称。
3.基金托管业务经营情况
截止2011年3月末,交通银行共托管证券投资基金52只,包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宏利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银担保人增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银泰货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全整稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、此外,还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品,托管资产规模超过七千亿元。
(三)验资机构
机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市严鸣区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
法人代表:杨绍信
电话:021-61238888
传真:021-61238800
经办注册会计师:汪棣、张鸿

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金2011年7月6日资产负债表如下:

资产	2011年7月6日	负债和所有者权益	2011年7月6日
	余额		余额
资产:		负债:	
银行存款	794,528.78	短期借款	
结算备付金	54,886,027.40	交易性金融负债	
存出保证金	250,000.00	衍生金融负债	
交易性金融资产	49,260,893.38	卖出回购金融资产款	
其中:股票投资	49,260,893.38	应付证券清算款	40,313,545.04
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	33,236.74
基金投资		应付托管费	6,647.34
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产	200,000,000.00	应付交易费用	24,728.66
应收证券清算款	140,012,540.30	应付税费	
应收利息	245,997.81	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	287,844.06
其他资产	30.00	负债合计	40,666,001.84
		所有者权益:	
		实收基金	403,229,029.00
		未分配利润	1,554,986.83
		所有者权益合计	404,784,015.83
资产合计:	445,450,017.67	负债与持有人权益总计:	445,450,017.67

八、基金投资组合

截止到2011年7月6日,本基金的投资组合如下:
(一)基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,260,893.38	11.06
	其中:股票	49,260,893.38	11.06
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	200,000,000.00	44.90
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	55,680,556.18	12.50
6	其他各项资产	140,508,568.11	31.54
7	合计	445,450,017.67	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

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	200,314.00	0.05
B	采掘业	1,679,030.00	0.41
C	制造业	30,269,857.64	7.48
C0	食品、饮料	2,726,238.40	0.67
C1	纺织、服装、皮毛	492,786.00	0.12
C2	木材、家具	178,799.00	0.04
C3	造纸、印刷	708,510.00	0.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,472,559.54	0.86
C5	电子	1,366,106.20	0.34
C6	金属、非金属	10,776,904.10	2.66
C7	机械、设备、仪表	9,046,097.70	2.23
C8	医药、生物制品	1,335,442.70	0.33
C99	其他制造业	166,414.00	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,826,393.88	0.45
E	建筑业	264,451.00	0.07
F	交通运输、仓储业	978,702.00	0.24
G	信息技术业	1,625,768.00	0.40
H	批发和零售贸易	2,369,271.00	0.59
I	金融、保险业	3,534,137.04	0.87
J	房地产业	5,309,736.82	1.31
K	社会服务业	581,375.00	0.14
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	621,857.00	0.15
	合计	49,260,893.38	12.17

(三)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	337,501	2,976,758.82	0.74
2	000709	河北钢铁	383,800	1,792,346.00	0.44
3	000898	鞍钢股份	226,100	1,569,134.00	0.39
4	000825	太钢不锈	273,700	1,434,188.00	0.35
5	000001	深发展A	66,000	1,137,840.00	0.28
6	000651	格力电器	47,500	1,100,575.00	0.27
7	002024	苏宁电器	79,200	1,039,104.00	0.26
8	000063	中兴通讯	32,000	911,040.00	0.23
9	000527	美的电器	48,629	889,910.70	0.22
10	000402	金 融 街	109,300	798,983.00	0.20

(四)按券种分类的债券投资组合
本基金2011年7月6日未持有债券。
(五)按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细
本基金2011年7月6日未持有债券。
(六)股票组合报告附注
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、处罚的情况。
2.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。
3.其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	140,012,540.30
3	应收股利	-
4	应收利息	245,997.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	30.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,508,568.11

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金2011年7月6日未持有债券。
5.报告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无存在流通受限情况。
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。

九、重大事件揭示

基金管理人于2011年7月6日发布了《博时基金管理有限公司关于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金变更英文简称的公告》,本基金的内简称由原“F200200”变为“深F200”,本基金基金名称、基金代码不变,以上变更事项对本基金分额持有人利益无不利影响。
基金管理人于2011年6月30日发布了《关于深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金跟踪指数成份股调整的公告》,根据深证证券交易所和中证指数有限公司2011年6月28日发布的《关于调整深证基本面指数系列样本股的公告》和《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定,博时基金管理有限公司所管理的深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金(基金代码:159908)跟踪指数成份股于2011年7月1日进行相应的调整。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
(二)根据《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查;如发现基金管理人违反《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、基金份额申购、赎回

(一)申购与赎回场所
投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金的申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商,并予以公告。在相关条件许可的前提下,基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构,并予以公告。
目前,本基金申购赎回代理券商的名单如下:方正证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、兴业证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、方联证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、民族证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、新商证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限公司、国海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、中国国际证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、中航证券有限公司、华林证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、广发华福证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、财通证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、江海证券有限公司、天源证券经纪有限公司、华宝证券有限责任公司、厦门证券有限公司、爱建证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司(排序不分先后)。
9.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
10.募集资金总额及人账情况
本基金于2011年5月3日起公开募集,基金募集工作已于2011年6月3日顺利结束。
经普华永道中天会计师事务所有限公司验资,本次募集的募集金额总额为403,229,029.00元人民币(募集资金扣下2011年6月10日到入本基金在基金交易确认日之前产生的利息共计49,050.00元人民币,募集资金已于2011年6月10日划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户。
本次募集有效认购总户数为8,507户,按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算,募集期募集金额(含所募集股票市值)及利息结转的基金份额共计403,229,029.00份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中本基金管理人博时基金管理有限公司认购基金从业人员投资人员的认购本基金。
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
11.本基金募集备案情况
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金合同》、《深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集申请经中国证监会核准,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2011年6月10日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。
(二)本基金上市交易的主要内容
1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上[2011]207号
2.上市交易日期:2011年7月13日
3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4.基金二级市场交易简称:深证基本面200指数
5.二级市场交易代码:159908
6.标的指数代码:399703
7.2011年7月6日基金份额总额:403,229,029.00份
8.2011年7月6日基金份额净值:1.0039元
9.本次上市交易份额:403,229,029.00份
10.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
11.上市交易日期:2011年7月13日
12.基金管理人:博时基金管理有限公司
13.基金托管人:交通银行股份有限公司
14.申购赎回代理券商:
(1)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
电话:0731-85832343
传真:0731-85832214
客户服务电话:95571
网址:http://www.foundersc.com
(2)中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层
法定代表人:杨明辉
联系人:杨瑞芳
电话:0755-82026511
传真:0755-82026539
客户服务电话:4006008008
网址:http://www.cjis.cn
(3)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
客户服务电话:95538
网址:http://www.qlzq.com.cn
(4)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
联系人:谢高得
电话:021-38565785
传真:021-38565783
客户服务电话:4008888123
网址:http://www.xyzq.com.cn
(5)东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:徐勇力
联系人:汤凌川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
客户服务电话:4008888993
网址:http://www.dxzq.net.cn
(6)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、37、41和42楼
法定代表人:王志伟
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
客户服务电话:95575
网址:http://www.gf.com.cn
(7)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层
法定代表人:顾伟国
联系人:李洋
电话:010-66568047
传真:010-66568536
客户服务电话:4008888888
网址:http://www.chinastock.com.cn
(8)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219275
传真:021-63602722
客户服务电话:95553
网址:http://www.htsec.com
(9)广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人:黄金琳
联系人:余腾
电话:0591-87278701
传真:0591-87841150
客户服务电话:96326(福建省外请加拨0591)
网址:http://www.ghfzq.com.cn

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金募集情况
1.基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2011年4月6日证监许可[2011]498号。
2.基金合同生效日:2011年6月10日。
3.基金运作方式:交易型开放式。
4.基金合同期限:不定期。
5.发售日期:2011年5月3日至2011年6月3日。其中,网下现金发售和网上现金发售的日期为2011年5月3日至2011年6月3日,网下股票发售的日期为2011年5月30日至2011年6月3日。
6.发售价格:人民币1.00元。
7.发售方式:投资者可选择网上