

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十四日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时标普 500ETF
场内简称	标普 500
基金主代码	513500
交易代码	513500
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013 年 12 月 5 日
报告期末基金份额总额	162,819,285.00 份
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	<p>本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。</p> <p>为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。</p>
业绩比较基准	标普 500 指数 (S&P 500 Index (NTR, Net total Return)) (经估值汇率调整，以人民币计价)
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险和高预期收益的基金品种。</p> <p>本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票，投资者需承担汇率风险。</p>
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016 年 7 月 1 日-2016 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	1,019,828.65
2. 本期利润	8,574,214.92
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0527
4. 期末基金资产净值	217,506,414.91
5. 期末基金份额净值	1.3359

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。

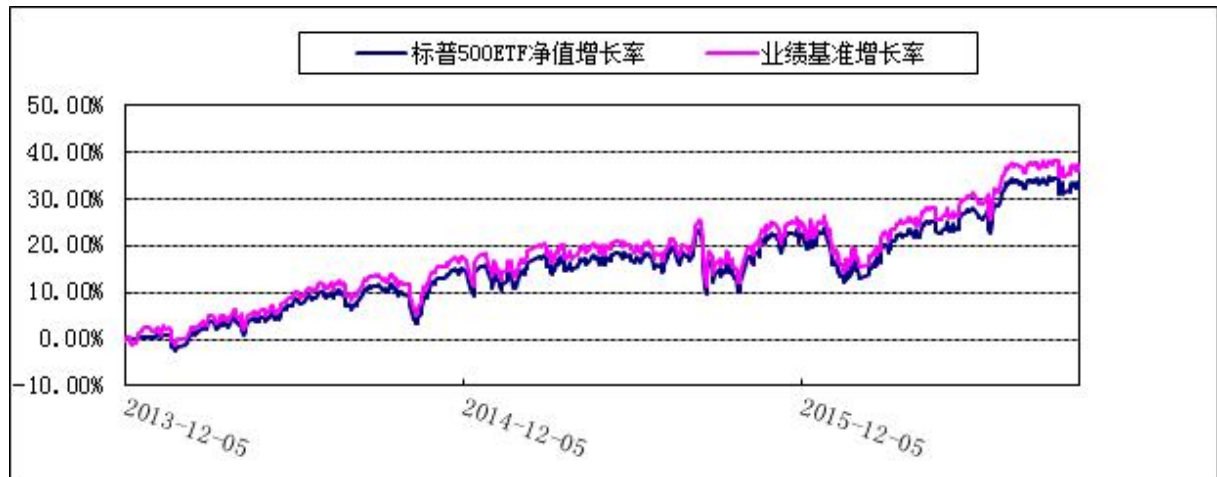
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	4.11%	0.67%	4.42%	0.67%	-0.31%	-

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



注：本基金的基金合同于 2013 年 12 月 5 日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第 14 条“二、投资范围”、“六、投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	基金经理	2015-10-08	-	9.6	2004 年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011 年加入博时基金，历任投资助理，基金经理助理。现任博时上证超大盘 ETF 基金、博时上证超大盘 ETF 联接基金、博时上证自然资源 ETF 基金、博时上证自然资源 ETF 联接基金、博时标普 500ETF 基金、博时标普 500ETF 联接 (QDII) 基金的基金经理。
汪洋	指数与量化投资部副总经理 / 基金经理	2016-05-16	-	7.3	2009 年起先后在华泰联合证券、华泰柏瑞基金、汇添富基金工作。2015 年加入博时基金管理有限公司，历任指数投资部总经理助理、指数投资部副总经理。现任指数与量化投资部副总经理兼博时标普 500ETF 基金、博时标普 500ETF 联接 (QDII) 基金、博时上证 50ETF 基金、博时上证 50ETF 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年 3 季度，美国经济数据好坏不均。劳动力市场方面，非农就业人数增长低于预期，但劳动参与率小幅改善；新增就业人数虽低于预期，但就业结构改善。工业产出和制造业数据表现疲软但通胀指标改善。标普 500 指数在 8 月份创出历史新高，进入 9 月份后，基于对美联储当月加息预期的忧虑，指数也进行了小幅调整。总体而言，标普 500 指数在三季度取得了不错的表现。

本基金主要投资于标普 500 指数成份股及备选成份股，以期获得标的指数所表征的市场平均水平的投资收益。截至季末，基金投资于标的指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%，符合基金合同要求。本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差，本基金用少量资产投资标的指数股指期货，以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.3359 元，累计份额净值为 1.3359 元，本基金报告期内净值增长率为 4.11%，同期业绩基准涨幅为 4.42%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	207,208,731.73	95.07
	其中：普通股	200,966,735.35	92.21
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	6,241,996.38	2.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-

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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,110,045.95	4.64
8	其他各项资产	631,874.74	0.29
9	合计	217,950,652.42	100.00

注：金融衍生品投资项下的期货投资，在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款（结算所得的持仓损益）相抵消后的净额为 0，具体投资情况详见下表：

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值(人民币元)	公允价值变动(人民币元)
股指期货	ESZ6	S&P500 EMINI FUT Dec16	14.00	10,098,703.38	207,312.30
总额合计					207,312.30
减：可抵消期货暂收款					207,312.30
股指期货投资净额					0.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	207,208,731.73	95.27
合计	207,208,731.73	95.27

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	15,040,432.84	6.91
原材料	6,016,400.12	2.77
工业	20,152,664.30	9.27
非日常生活消费品	25,960,372.61	11.94
日常消费品	20,477,253.38	9.41
医疗保健	30,297,728.72	13.93
金融	26,465,664.55	12.17
信息技术	44,191,578.75	20.32
电信业务	5,470,148.93	2.51
公用事业	6,802,189.80	3.13
房地产	6,334,297.73	2.91
合计	207,208,731.73	95.27

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英	公司名称	证券代码	所在证券市场	所属国家	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净
----	--------	------	------	--------	------	-------	------------	--------

	文)	(中 文)			(地 区)			值比例 (%)
1	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	8,916.00	6,730,913.89	3.09
2	ALPHABET INC-CL A	-	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	976.00	5,153,071.48	2.37
3	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	12,894.00	4,959,564.66	2.28
4	EXXON MOBIL CORP	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	6,861.00	3,998,854.15	1.84
5	AMAZON.CO M INC	-	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	651.00	3,639,994.06	1.67
6	JOHNSON & JOHNSON	-	JNJ US	纽约证券交易所	美国	4,527.00	3,571,117.22	1.64
7	FACEBOOK INC-A	-	FB US	纳斯达克交易所	美国	3,843.00	3,291,765.48	1.51
8	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	-	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	3,141.00	3,030,253.89	1.39
9	GENERAL ELECTRIC CO	-	GE US	纽约证券交易所	美国	14,828.00	2,932,925.55	1.35
10	AT&T INC	-	T US	纽约证券交易所	美国	10,179.00	2,760,396.78	1.27

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金 资产净值比例 (%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Dec16	207,312.30	0.10

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	420,701.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	210,423.42
4	应收利息	749.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	631,874.74

5.10.4 报告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。

5.10.5 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不存在流通受限情况。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	162,819,285.00
报告期基金总申购份额	-
减：报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	162,819,285.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

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

9 月 30 日，博时基金公司共管理 138 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，管理资产总规模约为 5,359.54 亿元人民币，其中公募基金规模约 2,912.48 亿元人民币，累计分红约 738.04 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 年三季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 9 月 30 日，权益类方面，标准指数股票型基金中，博时中证淘金大数据 100 指数基金、博时中证银行指数分级，今年以来净值增长率在同类型 316 只基金中排名前 10；偏股型基金里，博时行业轮动基金、博时主题行业混合基金，今年以来净值增长率在同类 372 只基金中排名前 20；灵活配置型基金中，博时灵活配置混合 A，今年以来净值增长率在同类排名前 1/10；保本型基金中，博时招财一号大数据保本混合，今年以来净值增长率在同类排名前 1/4；绝对收益目标基金中，博时新财富混合基金今年以来净值增长率为 5.36%，在同类 165 只基金中排名前 1/7。

黄金基金中，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率为 28.42%，在同类 8 只基金中排名第一。

固定收益方面，标准债券型基金中，博时双月薪定期支付债券、博时月月薪定期支付债券，今年以来净值增长率分别为 6.91%、5.23%，在同类型 61 只基金中分别第二和第五，博时信用债纯债排名前 1/9；普通债券型基金里，稳健回报债券 (LOF) 今年以来净值增长率在同类排名前 1/4；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 只排名第五；封闭式标准债券基金中，博时安丰 18 个月定开债今年以来净值增长率在同类排名前 1/4。

QDII 基金方面，博时亚洲票息，今年以来至 9 月 30 日净值增长 9.98%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名前 1/2。

2、其他大事件

•2016 年 8 月 5 日，由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨 ‘金帆奖’ 系列颁奖礼上，博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖（博时资本）三项大奖。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准标普 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 报告期内博时标普 500 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

二〇一六年十月二十四日