

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资 基金

2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十七日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
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	12
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.10 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 管理层对财务报表的责任	14
6.2 注册会计师的责任	14
6.3 审计意见	15
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	76
8.1 期末基金资产组合情况	76
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	80
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	80
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	81
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	82

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	83
8.7 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	83
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	84
8.9 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	84
8.10 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	85
8.11 投资组合报告附注	85
§ 9 基金份额持有人信息	87
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	87
9.2 期末上市基金前十名持有人	88
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	88
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	89
§ 10 开放式基金份额变动	90
§ 11 重大事件揭示	91
11.1 基金份额持有人大会决议	91
11.2 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	91
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	91
11.4 基金投资策略的改变	91
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	91
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	91
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	92
11.8 其他重大事件	93
§ 12 发起式基金发起资金持有份额情况	93
§ 13 影响投资者决策的其他重要信息	95
§ 14 备查文件目录	95
14.1 备查文件目录	95
14.2 存放地点	95
14.3 查阅方式	95

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	184,819,285.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 15 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	<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>

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		张光华	易会满

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	-
办公地址		-	-
邮政编码		-	-

2.5 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	5,073,948.71	18,626,814.38	15,070,698.41
本期利润	35,040,471.72	14,375,127.01	42,158,274.50
加权平均基金份额本期利润	0.2124	0.0571	0.1214
本期加权平均净值利润率	16.54%	5.75%	11.32%
本期基金份额净值增长率	17.58%	6.95%	13.38%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	32,162,308.95	24,007,631.41	13,866,020.78
期末可供分配基金份额利润	0.1740	0.1431	0.0470
期末基金资产净值	265,095,525.08	204,724,572.41	336,263,996.42
期末基金份额净值	1.4343	1.2199	1.1406
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	43.43%	21.99%	14.06%

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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

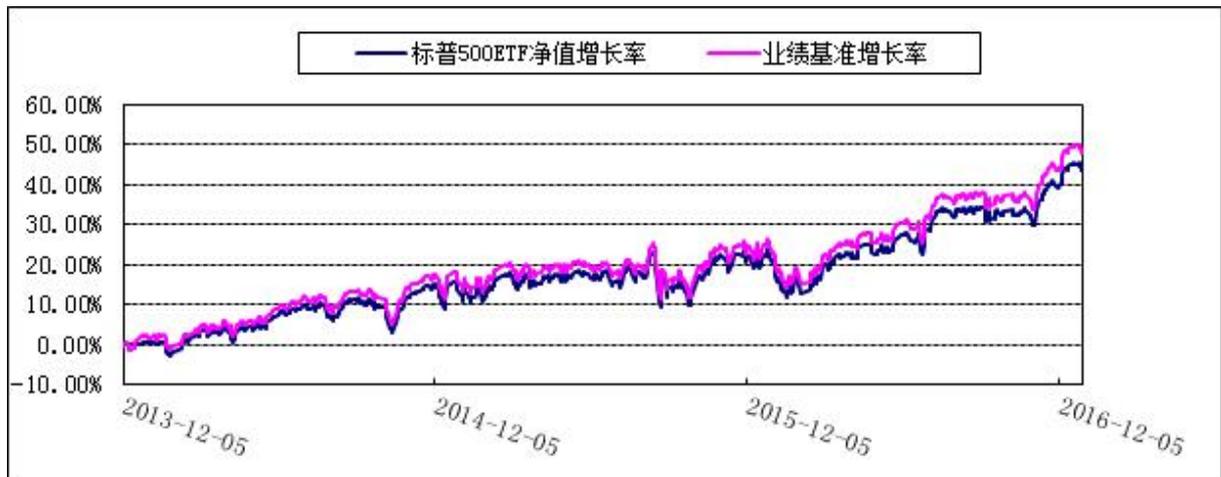
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	7.37%	0.62%	7.68%	0.62%	-0.31%	-
过去六个月	11.78%	0.64%	12.43%	0.64%	-0.65%	-
过去一年	17.58%	0.82%	18.82%	0.83%	-1.24%	-0.01%
过去三年	42.57%	0.86%	44.06%	0.86%	-1.49%	-
自基金合同生效起至今	43.43%	0.85%	47.87%	0.86%	-4.44%	-0.01%

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

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

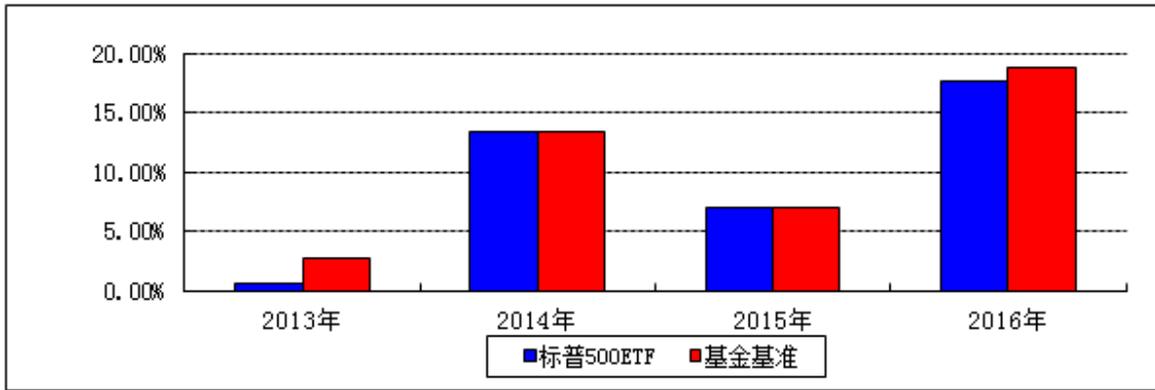
(2013 年 12 月 5 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 164 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 6250 亿元人民币，其中公募基金规模逾 3760 亿元人民币，累计分红逾 781 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 2016 年年末，博时旗下共 94 只（份额分开计算）成立满一年的基金产品参与分类排名。其中排名在同类前 1/2 的产品共有 60 只（主动权益 17 只，债券 16 只，指数 20 只，货币 3 只，QDII 基金 4 只），约 64%；排名在前 1/3 的产品共有 45 只，约 48%；排名前 1/4 的产品共有 34 只，约 36%。博时旗下各类产品均有表现突出的产品位居行业前列。

黄金基金类，博时黄金 ETF (D 类) 今年以来净值增长率 19.10%，在同类 8 只排名第 1。

固收方面，长期标准债券型基金里，博时双月薪定期支付债券，今年以来净值增

长率为 6.54%，在同类 61 只中排名第 2；博时信用债纯债（A 类），今年以来净值增长率为 4.23%，在同类中排名第 4；中短期标准债券型基金，博时安盈债券（A 类）今年以来净值增长率为 2.02%，在同类 66 只排名第 1；普通债券型基金里，博时稳定价值债券（A 类）今年以来净值增长率为 2.31%，在同类排名前 1/3；货币市场基金里，博时外服货币今年以来净值增长率为 3.03%，同类 194 只排名第 6。

QDII 基金，博时标普 500ETF 今年以来净值增长率 18.34%，同类排名前 1/4。博时亚洲票息收益债券(QDII)今年以来净值增长率 14.43%，同类排名第 3。

2、其他大事件

•2016 年 12 月 27 日，2016 金融新媒体峰会暨金 V 榜 2016 颁奖典礼在广州举行，博时基金荣获“最具传播力基金公司”奖项。

•2016 年 12 月 13 日，由中国经营报主办的“2016 第十四届中国企业竞争力年会暨金融高峰论坛”在北京举行，博时基金荣获“2016 卓越竞争力品牌建设金融机构”奖项。

•2016 年 12 月 9 日，在证券日报主办的“第十二届中国证券市场年会”上，博时基金荣膺中国证券市场“2016 年度最全能公募基金龙鼎奖”。

•2016 年 12 月 8 日，金融界网站主办的首届智能金融国际论坛暨第五届金融界“领航中国”年度盛典，博时基金荣获“2016 年杰出品牌奖”。

•2016 年 12 月 6 日，全国社会保障基金理事会发布公告，博时成为基本养老保险基金首批证券投资基金管理机构之一。

•2016 年 12 月 1 日，由《经济观察报》主办的“2015-2016 年度观察家金融峰会”在沪举办，博时基金再次独家蝉联“卓越固定收益投资团队奖”。

•2016 年 11 月 25 日，由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的 2016 年（第二届）CFAC 中国金融年会在深召开，博时基金再次蝉联“年度最佳基金公司大奖”。

•2016 年 11 月 23 日，由新浪财经主办的“2016 新浪全球资产管理论坛”在京举行，“2016 中国（首届）波特菲勒奖综合评选”结果揭晓。博时基金荣获“2016 最具互联网创新基金公司”、基金经理过钧获评“2016 最佳债券基金经理”、何凯获“2016 最佳 QDII 基金经理”。本届波特菲勒奖博时基金共斩获三项大奖，成为获奖最多的公募基金公司之一。

•2016 年 11 月 17 日，全国社保基金境内投资管理人 2016 年座谈会在上海举行，博时基金副总裁董良泓荣获“五年服务社保奖”，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予 5 人，董良泓先生是自 2015 年之后再次蝉联该奖项。

•2016 年 9 月 7 日，第二届结构性融资与资产证券化论坛暨 2016 年度资产证券化·介甫奖颁奖典礼上，“博时资本-平安银行橙鑫橙 e 资产支持专项计划”荣获“应收账款类最受投资者欢迎产品”和“最佳风控产品”两项大奖。

•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。

•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，博时基金荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

•2016 年 4 月 15 日，由中国基金报主办的第三届中国基金业英华奖评选揭晓，博时基金经理过钧先生获评三年期二级债基最佳基金经理、五年期二级债基最佳基金经理。

•2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。

•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

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		
汪洋	指数与量化投资部副总经理 / 基金经理	2016-05-16	-	7.6	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。
万琼	基金经理	2015-10-08	-	9.8	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。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.4.2 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。

4.4.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年，美国经济持续维持弱复苏状态。上半年经济整体偏弱，但 3 季度需求回暖，GDP 增速升至 3.2%，创下两年来的最高纪录。消费对于经济回升的贡献最大，其次出口改善。此外，失业率得到持续改善。4 季度，美国经历了总统大选和美元加息等大事件。特朗普当选新一届美国总统，其所倡导的大规模基建措施和积极的财政政策，提振了美股市场，标普 500 指数也创出历史新高。同时，在四季度美国各项经济数据持续转好，也使得美联储加息靴子落地，并增加明年预期加息的次数，但加息预期调整市场影响不大。2016 年标普 500 指数涨幅为 8.5%，表现优秀。

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 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.4343 元，累计份额净值为 1.4343 元，报告期内净值增长率为 17.58%，同期业绩基准涨幅为 18.82%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，美国新总统将正式上任。特朗普关于扩大财政支、降低企业税收和号召美企海外现金回流美国等想法有利于提振市场，对上市公司股价起到支撑作用。此外，短期内美国加息使得美元走强，未来美元进一步走强的幅度可能有限。美债收益率走高和美元走强，对于美国风险资产和实体经济的或将有负面的影响，这两方面可能会制约美联储进一步加息。从另外一个方面来看，美元走强的同时，也使得美元资产具有很好的投资价值。我们对美国市场持谨慎乐观态度。

在投资策略上，博时标普 500ETF 作为一只被动投资的基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪目标基准。我们希望通过博时标普 500ETF 为投资人提供长期配置的良好投资工具。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2016 年，我公司根据法律、法规的规定，制定、修订和完善了《博时货币市场基金投资管理制度》、《博时基金国债期货投资管理流程手册》、《博时基金国债期货风险管理流程手册》、《博时基金流动性风险管理制度》、《关联交易管理办法》、《交易部公平交易管理制度》、《博时 ETF 基金风险管理制度》、《博时基金反洗钱工作手册》、《开放式基金业务规则》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强

了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.8 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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的收益分配原则：基金收益每年最多分配 2 次。每次基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.10 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

本报告期内，本基金托管人在对博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 21561 号

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“博时标普 500ETF”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是博时标普 500ETF 的基金管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映;

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为, 上述 博时标普 500ETF 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了 博时标普 500ETF 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师

薛 竞

中国 · 上海市

注册会计师

2017 年 3 月 24 日

张 振 波

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	12,468,414.90	13,141,300.81
结算备付金		33,111,284.74	1,099,612.07
存出保证金		790,818.00	627,281.76
交易性金融资产	7.4.7.2	244,105,371.25	190,290,710.27
其中：股票投资		244,105,371.25	190,290,710.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,571.04	1,793.51
应收股利		254,896.39	229,504.74
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	31,877.72	-
资产总计		290,766,234.04	205,390,203.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,661,586.36	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		119,222.23	101,235.60
应付托管费		49,675.93	42,181.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	3,840,224.44	522,213.66
负债合计		25,670,708.96	665,630.75
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	184,819,285.00	167,819,285.00
未分配利润	7.4.7.10	80,276,240.08	36,905,287.41
所有者权益合计		265,095,525.08	204,724,572.41
负债和所有者权益总计		290,766,234.04	205,390,203.16

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 184,819,285.00 份。基金份额净值 1.4343 元。

7.2 利润表

会计主体：博时标普 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至

		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
一、收入		37,909,967.02	17,616,206.77
1. 利息收入		29,536.58	81,843.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	29,410.89	77,886.19
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		125.69	3,956.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,634,639.01	22,349,778.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,934,670.63	16,932,517.00
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	736,123.54	333,513.93
股利收益	7.4.7.15	3,963,844.84	5,083,747.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	29,966,523.01	-4,251,687.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		432,143.16	2,084,763.93
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-152,874.74	-2,648,491.28
减：二、费用		2,869,495.30	3,241,079.76
1. 管理人报酬		1,267,702.33	1,509,720.12
2. 托管费		528,209.29	629,050.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	19,546.32	75,333.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	1,054,037.36	1,026,975.69

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,040,471.72	14,375,127.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,040,471.72	14,375,127.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时标普 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	167,819,285.00	36,905,287.41	204,724,572.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,040,471.72	35,040,471.72
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）	17,000,000.00	8,330,480.95	25,330,480.95
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	10,081,742.92	34,081,742.92
2. 基金赎回款	-7,000,000.00	-1,751,261.97	-8,751,261.97
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）	184,819,285.00	80,276,240.08	265,095,525.08
项目	上年度可比期间		

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	294,819,285.00	41,444,711.42	336,263,996.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,375,127.01	14,375,127.01
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）	-127,000,000.00	-18,914,551.02	-145,914,551.02
其中：1. 基金申购款	23,000,000.00	3,848,280.03	26,848,280.03
2. 基金赎回款	-150,000,000.00	-22,762,831.05	-172,762,831.05
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）	167,819,285.00	36,905,287.41	204,724,572.41

注：报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]750 号《关于核准博时标普 500 交易型开放式证券投资基金募集的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 565,038,000.00 元，业经普华永道中天会

会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 743 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博时标普 500 交易型开放式证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 565,043,200.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 5,200.00 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期间不定,本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、境外上市交易的跟踪同一标的指数的公募基金。本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、银行存款、货币市场工具、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生工具、法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的标的指数为标普 500 净总收益指数(S&P500 Index(Net TR))。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件

的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，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。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于2016年5月1日前)或增值税(自2016年5月1日起)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	12,468,414.90	13,141,300.81
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	12,468,414.90	13,141,300.81

注：于 2016 年 12 月 31 日，银行存款中包含的外币余额为美元 1,793,925.55 元(折合人民币 12,444,461.54 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	189,964,191.66	244,105,371.25	54,141,179.59
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	189,964,191.66	244,105,371.25	54,141,179.59
项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	166,100,870.94	190,290,710.27	24,189,839.33
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	166,100,870.94	190,290,710.27	24,189,839.33

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	18,376,851.74	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,376,851.74	-	-	-
项目	上年度末 2015年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,694,392.18	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,694,392.18	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货

合约情况如下：

本期末 2016 年 12 月 31 日				
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ESH7	S&P500 EMINI FUT Mar17	24	18,615,023.28	151,434.71
减：可抵销期货暂收款	-	-		151,434.71
股指期货投资净额	-	-	-	-
上年度末 2015 年 12 月 31 日				
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar16	21	13,877,927.11	136,251.96
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	136,251.96
股指期货投资净额	-	-	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	547.63	1,611.06
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	3,023.41	182.45
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-

合计	3,571.04	1,793.51
----	----------	----------

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
其他应收款-现金差额	31,877.72	-
待摊费用	-	-
合计	31,877.72	-

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应退替代款	3,639,279.49	325,110.54
预提费用	150,000.00	150,000.00
应付指数使用费	50,944.95	47,103.12
合计	3,840,224.44	522,213.66

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	167,819,285.00	167,819,285.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-7,000,000.00	-7,000,000.00
本期末	184,819,285.00	184,819,285.00

7.4.7.10 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	24,007,631.41	12,897,656.00	36,905,287.41
本期利润	5,050,359.18	29,990,112.54	35,040,471.72

本期基金份额交易产生的变动数	3,104,318.36	5,226,162.59	8,330,480.95
其中：基金申购款	4,138,221.61	5,943,521.31	10,081,742.92
基金赎回款	-1,033,903.25	-717,358.72	-1,751,261.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,162,308.95	48,113,931.13	80,276,240.08

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	29,410.89	77,886.19
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	-	-
其他	-	-
合计	29,410.89	77,886.19

7.4.7.12 股票投资收益

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	18,744,620.61	182,689,064.76
减：卖出股票成本总额	15,809,949.98	165,756,547.76
买卖股票差价收入	2,934,670.63	16,932,517.00

7.4.7.13 基金投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日

期货投资收益	736,123.54	333,513.93
合计	736,123.54	333,513.93

7.4.7.15 股利收益

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,963,844.84	5,083,747.43
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,963,844.84	5,083,747.43

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	29,951,340.26	-4,325,388.89
——股票投资	29,951,340.26	-4,325,388.89
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	15,182.75	73,701.52
——期货投资	15,182.75	73,701.52
4. 其他	-	-
合计	29,966,523.01	-4,251,687.37

7.4.7.17 其他收入

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
替代损益	-152,874.74	-2,648,491.28

合计	-152,874.74	-2,648,491.28
----	-------------	---------------

7.4.7.18 交易费用

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	19,546.32	75,333.90
银行间市场交易费用	-	-
合计	19,546.32	75,333.90

7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
标普指数使用费	642,351.83	614,753.97
其他费用	1,043.17	1,743.72
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费用	642.36	478.00
合计	1,054,037.36	1,026,975.69

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。指数使用费取按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率每日计提金额及按指数使用协议规定的费用下限 10 万美元均摊到每日计提的累计金额的孰高者。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策

有关问题的补充通知》(财税[2017]2号), 2017年7月1日(含)以后, 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, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行(“BBH”)	境外资产托管人
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人的子公司
招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(博时标普 500ETF 联接)	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

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 12月31日	2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,267,702.33	1,509,720.12
其中: 支付销售机构的客户维护费	-	-

注: 本基金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 0.60% 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×0.60% / 当年天数。

7.4.10.1.2 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 12月31日	2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	528,209.29	629,050.05

注：本基金支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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× 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.3.2 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 12 月 31 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
博时标普 500ETF 联接	121,611,655.00	65.80%	128,758,755.00	76.72%

7.4.10.4 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12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	6,195,167.32	29,410.89	4,126,656.00	77,886.19
BBH	6,273,247.58	-	9,014,644.81	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，其中由中国工商银行保管的银行存款按适用利率计息，由布朗兄弟哈里曼银行保管的银行存款不计息。

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标普 500 指数成分股，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，跟踪标普 500 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及绩效分析工作，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。

7.4.13.2 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中国工商银行及境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险不重大。在场外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。本基金投资于远期合约时，任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

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 12 月 31 日，本基金无债券投资（2015 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 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

金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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。同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。本基金所持证券和衍生工具在境内外证券交易所上市或在场外市场交易，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 12 月 31 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半月以内且不计息，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(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,195,167.32	-	-	6,273,247.58	12,468,414.90
结算备付金	31,996,839.80	-	-	1,114,444.94	33,111,284.74
存出保证金	-	-	-	790,818.00	790,818.00
交易性金融资产	-	-	-	244,105,371.25	244,105,371.25
应收利息	-	-	-	3,571.04	3,571.04
应收股利	-	-	-	254,896.39	254,896.39
其他资产	-	-	-	31,877.72	31,877.72
资产总计	38,192,007.12	-	-	252,574,226.92	290,766,234.04
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	119,222.23	119,222.23
应付证券清算款	-	-	-	21,661,586.36	21,661,586.36
应付托管费	-	-	-	49,675.93	49,675.93
其他负债	-	-	-	3,840,224.44	3,840,224.44
负债总计	-	-	-	25,670,708.96	25,670,708.96
利率敏感度缺口	38,192,007.12	-	-	226,903,517.96	265,095,525.08
上年度末					
2015年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,126,656.00	-	-	9,014,644.81	13,141,300.81
结算备付金	1,099,612.07	-	-	-	1,099,612.07
存出保证金	627,281.76	-	-	-	627,281.76
交易性金融资产	-	-	-	190,290,710.27	190,290,710.27
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,793.51	1,793.51
应收股利	-	-	-	229,504.74	229,504.74
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,853,549.83	-	-	199,536,653.33	205,390,203.16
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	101,235.60	101,235.60
应付托管费	-	-	-	42,181.49	42,181.49
其他负债	-	-	-	522,213.66	522,213.66
负债总计	-	-	-	665,630.75	665,630.75
利率敏感度缺口	5,853,549.83	-	-	198,871,022.58	204,724,572.41

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，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)。

7.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	12,444,461.54	-	12,444,461.54
结算备付金	1,114,444.94	-	1,114,444.94
存出保证金	790,818.00		790,818.00
交易性金融资产	244,105,371.25		244,105,371.25
应收股利	254,896.39		254,896.39
应收利息	21.09	-	21.09
资产合计	258,710,013.21	-	258,710,013.21
以外币计价的负债			
应付证券清算款	21,661,586.36	-	21,661,586.36
负债合计	21,661,586.36	-	21,661,586.36
资产负债表 外汇风险敞口净额	237,048,426.85	-	237,048,426.85
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
银行存款	9,014,822.47	-	9,014,822.47
结算备付金	1,099,612.07	-	1,099,612.07
存出保证金	627,281.76	-	627,281.76
交易性金融资产	190,290,710.27	-	190,290,710.27
应收股利	229,504.74	-	229,504.74
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	193.29	-	193.29
资产合计	201,262,124.60	-	201,262,124.60

以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表			
外汇风险敞口净额	201,262,124.60	-	201,262,124.60

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	所有外币均相对人民币升值 5%	增加 1,185	增加 1,006
	所有外币均相对人民币贬值 5%	减少 1,185	减少 1,006

7.4.13.4.3 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基金和股票，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，跟踪标普 500 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。针对股指期货等高风险的金融衍生工具，管理人会每日对股指期货已占用保证金占总可用资金比例，股指期货账户未占用保证金占总期货账户权益比例，持仓占套保额度上限比例，以及股指期货合约成交金额占上一交易日基金资产净值比例，持有的买入、卖出股指期货合约占基金资产净值比例，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和占基金资产比例等法律法规、基金合同约定的合规、风险比例进行严格监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	244,105,371.25	92.08	190,290,710.27	92.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	244,105,371.25	92.08	190,290,710.27	92.95

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金还持有衍生金融工具，具体信息请参考附注 7.4.7.3 衍生金融资产/负债。(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除标普 500 净总收益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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 标普 500 净总收益指数上升 5%	增加约 1,348	增加约 1,023
2. 标普 500 净总收益指数下降 5%	减少约 1,348	减少约 1,023	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2016 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 34,081,742.92 元，均为以现金支付的申购款。

(2) 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 12 月 31 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 244,105,371.25 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 190,290,710.27 元，无第二层次和第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 12 月 31 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。

(3) 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	244,105,371.25	83.95
	其中：普通股	237,187,724.69	81.57
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	6,917,646.56	2.38
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	45,579,699.64	15.68
8	其他各项资产	1,081,163.15	0.37
9	合计	290,766,234.04	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	244,105,371.25	92.08
合计	244,105,371.25	92.08

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	18,429,236.70	6.95
原材料	6,916,823.62	2.61
工业	25,036,124.67	9.44
非日常生活消费品	29,326,795.03	11.06
日常消费品	22,850,292.36	8.62
医疗保健	33,224,536.65	12.53
金融	36,111,848.39	13.62
信息技术	50,953,311.24	19.22
电信业务	6,484,352.57	2.45

公用事业	7,734,913.43	2.92
房地产	7,037,136.59	2.65
合计	244,105,371.25	92.08

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券市场	所属 国家 (地 区)	数量(股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	9,732.00	7,819,110.58	2.95
2	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	14,191.00	6,117,245.97	2.31
3	ALPHABET INC-CL A	-	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	540.00	2,968,501.85	1.12
3	ALPHABET INC-CL C	-	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	541.00	2,896,576.40	1.09
4	EXXON MOBIL CORP	-	XOM US	纽约证券交易所	美国	7,568.00	4,738,579.24	1.79
5	JOHNSON & JOHNSON	-	JNJ US	纽约证券交易所	美国	4,965.00	3,968,086.44	1.50
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	-	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	3,465.00	3,917,502.18	1.48
7	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	6,530.00	3,908,817.06	1.47
8	AMAZON.COM INC	-	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	719.00	3,740,128.85	1.41
9	GENERAL ELECTRIC CO	-	GE US	纽约证券交易所	美国	16,145.00	3,539,132.53	1.34
10	FACEBOOK INC-A	-	FB US	纳斯达克交易所	美国	4,272.00	3,409,491.10	1.29
11	AT&T INC	-	T US	纽约证券交易所	美国	11,208.00	3,306,703.08	1.25
12	WELLS FARGO & CO	-	WFC US	纽约证券交易所	美国	8,249.00	3,153,576.78	1.19
13	PROCTER & GAMBLE CO/THE	-	PG US	纽约证券交易所	美国	4,884.00	2,848,656.30	1.07
14	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC US	纽约证券交易所	美国	18,443.00	2,827,453.91	1.07
15	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	3,445.00	2,812,790.48	1.06
16	VERIZON COMMUNICATIONS INC	-	VZ US	纽约证券交易所	美国	7,440.00	2,755,010.13	1.04
17	PFIZER INC	-	PFE US	纽约证券交易所	美国	11,075.00	2,495,349.89	0.94
18	INTEL CORP	-	INTC US	纳斯达克交易所	美国	8,649.00	2,176,131.56	0.82
19	CITIGROUP INC	-	C US	纽约证券交易所	美国	5,201.00	2,144,195.00	0.81
20	COMCAST CORP-CLASS A	-	CMCSA US	纳斯达克交易所	美国	4,350.00	2,083,649.35	0.79
21	HOME DEPOT INC	-	HD US	纽约证券交易所	美国	2,223.00	2,067,641.11	0.78
22	MERCK & CO. INC.	-	MRK US	纽约证券交易所	美国	5,032.00	2,054,974.15	0.78
23	COCA-COLA CO/THE	-	KO US	纽约证券交易所	美国	7,084.00	2,037,415.21	0.77
24	WALT DISNEY CO/THE	-	DIS US	纽约证券交易所	美国	2,672.00	1,931,786.90	0.73
25	UNITEDHEALTH GROUP INC	-	UNH US	纽约证券交易所	美国	1,737.00	1,928,413.02	0.73
26	CISCO SYSTEMS INC	-	CSCO US	纳斯达克交易所	美国	9,161.00	1,920,476.68	0.72
27	PEPSICO INC	-	PEP US	纽约证券交易所	美国	2,617.00	1,899,466.52	0.72

28	VISA INC-CLASS A SHARES	-	V US	纽约证券交易所	美国	3,408.00	1,844,493.91	0.70
29	INTL BUSINESS MACHINES CORP	-	IBM US	纽约证券交易所	美国	1,579.00	1,818,175.28	0.69
30	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	-	PM US	纽约证券交易所	美国	2,831.00	1,796,739.81	0.68
31	ALTRIA GROUP INC	-	MO US	纽约证券交易所	美国	3,559.00	1,669,455.51	0.63
32	SCHLUMBERGER LTD	-	SLB US	纽约证券交易所	美国	2,539.00	1,478,614.96	0.56
33	ORACLE CORP	-	ORCL US	纽约证券交易所	美国	5,470.00	1,459,000.25	0.55
34	AMGEN INC	-	AMGN US	纳斯达克交易所	美国	1,357.00	1,376,349.15	0.52
35	3M CO	-	MMM US	纽约证券交易所	美国	1,097.00	1,358,897.88	0.51
36	WAL-MART STORES INC	-	WMT US	纽约证券交易所	美国	2,748.00	1,317,625.99	0.50
37	ABBVIE INC	-	ABBV US	纽约证券交易所	美国	2,966.00	1,288,415.39	0.49
38	MCDONALD'S CORP	-	MCD US	纽约证券交易所	美国	1,515.00	1,279,223.03	0.48
39	MASTERCARD INC - A	-	MA US	纽约证券交易所	美国	1,737.00	1,244,118.00	0.47
40	MEDTRONIC PLC	-	MDT US	纽约证券交易所	美国	2,506.00	1,238,271.01	0.47
41	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	-	BMJ US	纽约证券交易所	美国	3,050.00	1,236,464.75	0.47
42	QUALCOMM INC	-	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	2,695.00	1,218,928.02	0.46
43	BROADCOM LTD	-	AVGO US	纳斯达克交易所	美国	975.00	1,195,597.15	0.45
44	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	纳斯达克交易所	美国	2,404.00	1,194,207.60	0.45
45	CELGENE CORP	-	CELG US	纳斯达克交易所	美国	1,414.00	1,135,382.26	0.43
46	BOEING CO/THE	-	BA US	纽约证券交易所	美国	1,047.00	1,130,709.91	0.43
47	GOLDMAN SACHS GROUP INC	-	GS US	纽约证券交易所	美国	674.00	1,119,557.57	0.42
48	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	-	HON US	纽约证券交易所	美国	1,390.00	1,117,075.52	0.42
49	UNION PACIFIC CORP	-	UNP US	纽约证券交易所	美国	1,504.00	1,081,719.15	0.41
50	CVS HEALTH CORP	-	CVS US	纽约证券交易所	美国	1,946.00	1,065,237.81	0.40
51	UNITED TECHNOLOGIES CORP	-	UTX US	纽约证券交易所	美国	1,397.00	1,062,326.21	0.40
52	US BANCORP	-	USB US	纽约证券交易所	美国	2,916.00	1,039,127.36	0.39
53	STARBUCKS CORP	-	SBUX US	纳斯达克交易所	美国	2,656.00	1,022,937.79	0.39
54	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	-	UPS US	纽约证券交易所	美国	1,258.00	1,000,434.16	0.38
55	ALLERGAN PLC	-	AGN US	纽约证券交易所	美国	684.00	996,478.13	0.38
56	TIME WARNER INC	-	TWX US	纽约证券交易所	美国	1,407.00	942,167.45	0.36
57	TEXAS INSTRUMENTS INC	-	TXN US	纳斯达克交易所	美国	1,824.00	923,295.83	0.35
58	ACCENTURE PLC-CL A	-	ACN US	纽约证券交易所	美国	1,132.00	919,784.88	0.35
59	PRICELINE GROUP INC/THE	-	PCLN US	纳斯达克交易所	美国	90.00	915,305.24	0.35
60	ELI LILLY & CO	-	LLY US	纽约证券交易所	美国	1,773.00	904,613.59	0.34
61	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	-	WBA US	纳斯达克交易所	美国	1,561.00	896,179.65	0.34
62	COSTCO WHOLESALE CORP	-	COST US	纳斯达克交易所	美国	797.00	885,214.41	0.33

63	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	-	MDLZ US	纳斯达克交易所	美国	2,818.00	866,583.50	0.33
64	NIKE INC -CL B	-	NKE US	纽约证券交易所	美国	2,438.00	859,657.60	0.32
65	DOW CHEMICAL CO/THE	-	DOW US	纽约证券交易所	美国	2,046.00	812,129.30	0.31
66	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	-	DD US	纽约证券交易所	美国	1,586.00	807,552.82	0.30
67	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	-	AIG US	纽约证券交易所	美国	1,780.00	806,438.74	0.30
68	LOCKHEED MARTIN CORP	-	LMT US	纽约证券交易所	美国	459.00	795,829.71	0.30
69	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	-	CHTR US	纳斯达克交易所	美国	395.00	788,933.91	0.30
70	CONOCOPHILLIPS	-	COP US	纽约证券交易所	美国	2,261.00	786,423.69	0.30
71	LOWE'S COS INC	-	LOW US	纽约证券交易所	美国	1,587.00	782,961.43	0.30
72	BIOGEN INC	-	BIIB US	纳斯达克交易所	美国	397.00	780,976.20	0.29
73	CHUBB LTD	-	CB US	纽约证券交易所	美国	849.00	778,122.46	0.29
74	MORGAN STANLEY	-	MS US	纽约证券交易所	美国	2,631.00	771,115.19	0.29
75	METLIFE INC	-	MET US	纽约证券交易所	美国	2,006.00	749,912.87	0.28
76	EOG RESOURCES INC	-	EOG US	纽约证券交易所	美国	1,052.00	737,799.90	0.28
77	COLGATE-PALMOLIVE CO	-	CL US	纽约证券交易所	美国	1,622.00	736,318.71	0.28
78	NVIDIA CORP	-	NVDA US	纳斯达克交易所	美国	983.00	727,867.64	0.27
79	AMERICAN EXPRESS CO	-	AXP US	纽约证券交易所	美国	1,403.00	720,991.82	0.27
80	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	-	PNC US	纽约证券交易所	美国	887.00	719,668.80	0.27
81	ABBOTT LABORATORIES	-	ABT US	纽约证券交易所	美国	2,687.00	715,951.61	0.27
82	SIMON PROPERTY GROUP INC	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	573.00	706,220.66	0.27
83	NEXTERA ENERGY INC	-	NEE US	纽约证券交易所	美国	852.00	706,047.31	0.27
84	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	-	TMO US	纽约证券交易所	美国	720.00	704,743.70	0.27
85	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	-	OXY US	纽约证券交易所	美国	1,394.00	688,806.78	0.26
86	CATERPILLAR INC	-	CAT US	纽约证券交易所	美国	1,067.00	686,440.98	0.26
87	DUKE ENERGY CORP	-	DUK US	纽约证券交易所	美国	1,257.00	676,831.57	0.26
88	NETFLIX INC	-	NFLX US	纳斯达克交易所	美国	783.00	672,440.87	0.25
89	KRAFT HEINZ CO/THE	-	KHC US	纳斯达克交易所	美国	1,088.00	659,043.86	0.25
90	ADOBE SYSTEMS INC	-	ADBE US	纳斯达克交易所	美国	907.00	647,746.88	0.24
91	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	-	BK US	纽约证券交易所	美国	1,929.00	634,014.19	0.24
92	GENERAL DYNAMICS CORP	-	GD US	纽约证券交易所	美国	522.00	625,221.54	0.24
93	TJX COMPANIES INC	-	TJX US	纽约证券交易所	美国	1,189.00	619,679.23	0.23
94	GENERAL MOTORS CO	-	GM US	纽约证券交易所	美国	2,531.00	611,704.94	0.23
95	SOUTHERN CO/THE	-	SO US	纽约证券交易所	美国	1,788.00	610,121.08	0.23
96	DOMINION RESOURCES	-	D US	纽约证券交易所	美国	1,143.00	607,281.42	0.23

	INC/VA							
97	SCHWAB (CHARLES) CORP	-	SCHW US	纽约证券交易所	美国	2,201.00	602,641.26	0.23
98	DANAHER CORP	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	1,110.00	599,373.45	0.23
99	FORD MOTOR CO	-	F US	纽约证券交易所	美国	7,123.00	599,370.60	0.23
100	HALLIBURTON CO	-	HAL US	纽约证券交易所	美国	1,577.00	591,725.61	0.22
101	AUTOMATIC DATA PROCESSING	-	ADP US	纳斯达克交易所	美国	823.00	586,786.54	0.22
102	REYNOLDS AMERICAN INC	-	RAI US	纽约证券交易所	美国	1,509.00	586,622.97	0.22
103	BLACKROCK INC	-	BLK US	纽约证券交易所	美国	221.00	583,397.12	0.22
104	MONSANTO CO	-	MON US	纽约证券交易所	美国	799.00	583,143.57	0.22
105	FEDEX CORP	-	FDX US	纽约证券交易所	美国	446.00	576,084.55	0.22
106	AMERICAN TOWER CORP	-	AMT US	纽约证券交易所	美国	776.00	568,887.28	0.21
107	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	-	PRU US	纽约证券交易所	美国	784.00	565,941.55	0.21
108	PAYPAL HOLDINGS INC	-	PYPL US	纳斯达克交易所	美国	2,048.00	560,749.34	0.21
109	SALESFORCE.COM INC	-	CRM US	纽约证券交易所	美国	1,165.00	553,266.68	0.21
110	AETNA INC	-	AET US	纽约证券交易所	美国	640.00	550,564.72	0.21
111	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	-	FOX US	纳斯达克交易所	美国	2,821.00	543,850.60	0.21
112	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	-	ESRX US	纳斯达克交易所	美国	1,125.00	536,845.76	0.20
113	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	-	COF US	纽约证券交易所	美国	880.00	532,561.81	0.20
114	RAYTHEON COMPANY	-	RTN US	纽约证券交易所	美国	535.00	527,003.89	0.20
115	NORTHROP GRUMMAN CORP	-	NOC US	纽约证券交易所	美国	321.00	517,903.79	0.20
116	KIMBERLY-CLARK CORP	-	KMB US	纽约证券交易所	美国	653.00	516,947.74	0.20
117	TARGET CORP	-	TGT US	纽约证券交易所	美国	1,025.00	513,586.00	0.19
118	KINDER MORGAN INC	-	KMI US	纽约证券交易所	美国	3,503.00	503,259.44	0.19
119	CME GROUP INC	-	CME US	纳斯达克交易所	美国	619.00	495,313.25	0.19
120	ANADARKO PETROLEUM CORP	-	APC US	纽约证券交易所	美国	1,020.00	493,391.35	0.19
121	ILLINOIS TOOL WORKS	-	ITW US	纽约证券交易所	美国	576.00	489,314.89	0.18
122	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	-	JCI US	纽约证券交易所	美国	1,709.00	488,321.17	0.18
123	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	-	HPE US	纽约证券交易所	美国	3,040.00	487,987.43	0.18
124	PHILLIPS 66	-	PSX US	纽约证券交易所	美国	808.00	484,336.35	0.18
125	BB&T CORP	-	BBT US	纽约证券交易所	美国	1,480.00	482,743.06	0.18
126	ANTHEM INC	-	ANTM US	纽约证券交易所	美国	480.00	478,719.60	0.18
127	STRYKER CORP	-	SYK US	纽约证券交易所	美国	567.00	471,246.16	0.18
128	GENERAL MILLS INC	-	GIS US	纽约证券交易所	美国	1,079.00	462,349.87	0.17
129	DELTA AIR LINES INC	-	DAL US	纽约证券交易所	美国	1,344.00	458,614.50	0.17

130	EMERSON ELECTRIC CO	-	EMR US	纽约证券交易所	美国	1,173.00	453,643.38	0.17
131	BECTON DICKINSON AND CO	-	BDX US	纽约证券交易所	美国	387.00	444,438.68	0.17
132	APPLIED MATERIALS INC	-	AMAT US	纳斯达克交易所	美国	1,972.00	441,445.98	0.17
133	MARSH & MCLENNAN COS	-	MMC US	纽约证券交易所	美国	941.00	441,208.39	0.17
134	TRAVELERS COS INC/THE	-	TRV US	纽约证券交易所	美国	518.00	439,899.87	0.17
135	CIGNA CORP	-	CI US	纽约证券交易所	美国	468.00	433,052.77	0.16
136	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	-	CTSH US	纳斯达克交易所	美国	1,107.00	430,268.88	0.16
137	YAHOO! INC	-	YHOO US	纳斯达克交易所	美国	1,602.00	429,742.57	0.16
138	CSX CORP	-	CSX US	纳斯达克交易所	美国	1,709.00	425,962.11	0.16
139	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	-	ICE US	纽约证券交易所	美国	1,087.00	425,436.08	0.16
140	PRAXAIR INC	-	PX US	纽约证券交易所	美国	520.00	422,732.46	0.16
141	PUBLIC STORAGE	-	PSA US	纽约证券交易所	美国	272.00	421,714.10	0.16
142	EXELON CORP	-	EXC US	纽约证券交易所	美国	1,685.00	414,837.11	0.16
143	KROGER CO	-	KR US	纽约证券交易所	美国	1,723.00	412,479.08	0.16
144	MCKESSON CORP	-	MCK US	纽约证券交易所	美国	412.00	401,412.28	0.15
145	NORFOLK SOUTHERN CORP	-	NSC US	纽约证券交易所	美国	532.00	398,830.61	0.15
146	CROWN CASTLE INTL CORP	-	CCI US	纽约证券交易所	美国	658.00	396,065.66	0.15
147	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	-	APD US	纽约证券交易所	美国	396.00	395,081.02	0.15
148	AMERICAN ELECTRIC POWER	-	AEP US	纽约证券交易所	美国	897.00	391,767.91	0.15
149	VALERO ENERGY CORP	-	VLO US	纽约证券交易所	美国	826.00	391,471.00	0.15
150	EBAY INC	-	EBAY US	纳斯达克交易所	美国	1,897.00	390,705.23	0.15
151	ECOLAB INC	-	ECL US	纽约证券交易所	美国	478.00	388,688.16	0.15
152	P G & E CORP	-	PCG US	纽约证券交易所	美国	922.00	388,679.69	0.15
153	SOUTHWEST AIRLINES CO	-	LUV US	纽约证券交易所	美国	1,123.00	388,266.11	0.15
154	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	-	PXD US	纽约证券交易所	美国	309.00	385,985.99	0.15
155	HUMANA INC	-	HUM US	纽约证券交易所	美国	272.00	384,976.86	0.15
156	EATON CORP PLC	-	ETN US	纽约证券交易所	美国	824.00	383,492.34	0.14
157	DEERE & CO	-	DE US	纽约证券交易所	美国	527.00	376,693.53	0.14
158	BOSTON SCIENTIFIC CORP	-	BSX US	纽约证券交易所	美国	2,485.00	372,867.57	0.14
159	AON PLC	-	AON US	纽约证券交易所	美国	480.00	371,368.13	0.14
160	WASTE MANAGEMENT INC	-	WM US	纽约证券交易所	美国	742.00	364,991.78	0.14
161	SPECTRA ENERGY CORP	-	SE US	纽约证券交易所	美国	1,280.00	364,852.90	0.14
162	LYONDELLBASELL INDU-CL A	-	LYB US	纽约证券交易所	美国	609.00	362,389.02	0.14
163	SYNCHRONY FINANCIAL	-	SYF US	纽约证券交易所	美国	1,431.00	360,046.74	0.14
164	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	719.00	359,563.51	0.14

165	AFLAC INC	-	AFL US	纽约证券交易所	美国	744.00	359,214.51	0.14
166	STATE STREET CORP	-	STT US	纽约证券交易所	美国	661.00	356,373.95	0.13
167	INTUIT INC	-	INTU US	纳斯达克交易所	美国	445.00	353,797.06	0.13
168	PROLOGIS INC	-	PLD US	纽约证券交易所	美国	964.00	353,020.88	0.13
169	SYSCO CORP	-	SYU US	纽约证券交易所	美国	918.00	352,605.35	0.13
170	S&P GLOBAL INC	-	SPGI US	纽约证券交易所	美国	472.00	352,114.35	0.13
171	REGENERON PHARMACEUTICALS	-	REGN US	纳斯达克交易所	美国	137.00	348,870.96	0.13
172	BAKER HUGHES INC	-	BHI US	纽约证券交易所	美国	771.00	347,487.30	0.13
173	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	-	ALXN US	纳斯达克交易所	美国	409.00	347,135.46	0.13
174	ALLSTATE CORP	-	ALL US	纽约证券交易所	美国	672.00	345,522.54	0.13
175	CONSTELLATION BRANDS INC-A	-	STZ US	纽约证券交易所	美国	324.00	344,577.72	0.13
176	SUNTRUST BANKS INC	-	STI US	纽约证券交易所	美国	895.00	340,542.53	0.13
177	MARATHON PETROLEUM CORP	-	MPC US	纽约证券交易所	美国	963.00	336,354.67	0.13
178	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	-	MAR US	纳斯达克交易所	美国	584.00	334,953.88	0.13
179	ZOETIS INC	-	ZTS US	纽约证券交易所	美国	901.00	334,575.19	0.13
180	ARCHER-DANIELS- MIDLAND CO	-	ADM US	纽约证券交易所	美国	1,050.00	332,507.75	0.13
181	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	-	ORLY US	纳斯达克交易所	美国	172.00	332,188.79	0.13
182	ROSS STORES INC	-	ROST US	纳斯达克交易所	美国	723.00	329,013.59	0.12
183	EQUINIX INC	-	EQIX US	纳斯达克交易所	美国	130.00	322,315.91	0.12
184	HP INC	-	HPQ US	纽约证券交易所	美国	3,122.00	321,394.54	0.12
185	SEMPRA ENERGY	-	SRE US	纽约证券交易所	美国	456.00	318,351.69	0.12
186	PPG INDUSTRIES INC	-	PPG US	纽约证券交易所	美国	481.00	316,185.41	0.12
187	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	-	CBS US	纽约证券交易所	美国	715.00	315,552.34	0.12
188	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	-	FIS US	纽约证券交易所	美国	599.00	314,304.09	0.12
189	ACTIVISION BLIZZARD INC	-	ATVI US	纳斯达克交易所	美国	1,247.00	312,367.35	0.12
190	TE CONNECTIVITY LTD	-	TEL US	纽约证券交易所	美国	648.00	311,425.79	0.12
191	INTUITIVE SURGICAL INC	-	ISRG US	纳斯达克交易所	美国	70.00	307,946.61	0.12
192	AVALONBAY COMMUNITIES INC	-	AVB US	纽约证券交易所	美国	250.00	307,222.39	0.12
193	WELLTOWER INC	-	HCN US	纽约证券交易所	美国	661.00	306,897.94	0.12
194	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	-	AAL US	纳斯达克交易所	美国	945.00	306,074.66	0.12
195	M & T BANK CORP	-	MTB US	纽约证券交易所	美国	282.00	306,013.68	0.12
196	APACHE CORP	-	APA US	纽约证券交易所	美国	692.00	304,681.64	0.11

197	DEVON ENERGY CORP	-	DVN US	纽约证券交易所	美国	955.00	302,556.21	0.11
198	ELECTRONIC ARTS INC	-	EA US	纳斯达克交易所	美国	550.00	300,496.97	0.11
199	EQUITY RESIDENTIAL	-	EQR US	纽约证券交易所	美国	667.00	297,792.37	0.11
200	EDISON INTERNATIONAL	-	EIX US	纽约证券交易所	美国	594.00	296,640.41	0.11
201	PPL CORP	-	PPL US	纽约证券交易所	美国	1,240.00	292,894.01	0.11
202	CORNING INC	-	GLW US	纽约证券交易所	美国	1,736.00	292,274.68	0.11
203	FISERV INC	-	FISV US	纳斯达克交易所	美国	396.00	291,956.69	0.11
204	CARDINAL HEALTH INC	-	CAH US	纽约证券交易所	美国	584.00	291,565.44	0.11
205	ST JUDE MEDICAL INC	-	STJ US	纽约证券交易所	美国	521.00	289,820.85	0.11
206	MICRON TECHNOLOGY INC	-	MU US	纳斯达克交易所	美国	1,900.00	288,912.18	0.11
207	WEYERHAEUSER CO	-	WY US	纽约证券交易所	美国	1,365.00	284,922.36	0.11
208	AUTOZONE INC	-	AZO US	纽约证券交易所	美国	52.00	284,896.21	0.11
209	CONSOLIDATED EDISON INC	-	ED US	纽约证券交易所	美国	556.00	284,181.70	0.11
210	PACCAR INC	-	PCAR US	纳斯达克交易所	美国	639.00	283,252.28	0.11
211	ANALOG DEVICES INC	-	ADI US	纳斯达克交易所	美国	562.00	283,115.90	0.11
212	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	-	PEG US	纽约证券交易所	美国	923.00	280,957.10	0.11
213	VENTAS INC	-	VTR US	纽约证券交易所	美国	646.00	280,171.00	0.11
214	YUM! BRANDS INC	-	YUM US	纽约证券交易所	美国	636.00	279,407.65	0.11
215	CARNIVAL CORP	-	CCL US	纽约证券交易所	美国	765.00	276,272.27	0.10
216	INTERNATIONAL PAPER CO	-	IP US	纽约证券交易所	美国	750.00	276,057.92	0.10
217	BAXTER INTERNATIONAL INC	-	BAX US	纽约证券交易所	美国	893.00	274,674.82	0.10
218	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	-	SHW US	纽约证券交易所	美国	147.00	274,044.66	0.10
219	HCA HOLDINGS INC	-	HCA US	纽约证券交易所	美国	533.00	273,683.10	0.10
220	NEWELL BRANDS INC	-	NWL US	纽约证券交易所	美国	880.00	272,568.60	0.10
221	WILLIAMS COS INC	-	WMB US	纽约证券交易所	美国	1,247.00	269,374.67	0.10
222	CUMMINS INC	-	CMI US	纽约证券交易所	美国	281.00	266,410.42	0.10
223	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	-	UAL US	纽约证券交易所	美国	526.00	265,929.06	0.10
224	AMPHENOL CORP-CL A	-	APH US	纽约证券交易所	美国	563.00	262,451.68	0.10
225	XCEL ENERGY INC	-	XEL US	纽约证券交易所	美国	927.00	261,725.38	0.10
226	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	-	ZBH US	纽约证券交易所	美国	365.00	261,302.92	0.10
227	PROGRESSIVE CORP	-	PGR US	纽约证券交易所	美国	1,059.00	260,793.05	0.10
228	FIFTH THIRD BANCORP	-	FITB US	纳斯达克交易所	美国	1,379.00	257,998.34	0.10
229	OMNICOM GROUP	-	OMC US	纽约证券交易所	美国	430.00	253,875.47	0.10
230	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	-	EW US	纽约证券交易所	美国	390.00	253,498.79	0.10
231	KEYCORP	-	KEY US	纽约证券交易所	美国	1,972.00	249,929.29	0.09
232	PAYCHEX INC	-	PAYX US	纳斯达克交易所	美国	587.00	247,904.52	0.09

233	WESTERN DIGITAL CORP	-	WDC US	纳斯达克交易所	美国	521.00	245,583.33	0.09
234	INGERSOLL-RAND PLC	-	IR US	纽约证券交易所	美国	471.00	245,180.22	0.09
235	CONCHO RESOURCES INC	-	CXO US	纽约证券交易所	美国	266.00	244,679.09	0.09
236	BOSTON PROPERTIES INC	-	BXP US	纽约证券交易所	美国	280.00	244,310.04	0.09
237	NUCOR CORP	-	NUE US	纽约证券交易所	美国	581.00	239,889.23	0.09
238	NORTHERN TRUST CORP	-	NTRS US	纳斯达克交易所	美国	388.00	239,683.06	0.09
239	ILLUMINA INC	-	ILMN US	纳斯达克交易所	美国	268.00	238,041.21	0.09
240	DOLLAR GENERAL CORP	-	DG US	纽约证券交易所	美国	463.00	237,900.32	0.09
241	PARKER HANNIFIN CORP	-	PH US	纽约证券交易所	美国	243.00	235,996.74	0.09
242	KELLOGG CO	-	K US	纽约证券交易所	美国	461.00	235,721.41	0.09
243	ROPER TECHNOLOGIES INC	-	ROP US	纽约证券交易所	美国	185.00	234,954.80	0.09
244	WEC ENERGY GROUP INC	-	WEC US	纽约证券交易所	美国	576.00	234,348.51	0.09
245	T ROWE PRICE GROUP INC	-	TROW US	纳斯达克交易所	美国	444.00	231,802.91	0.09
246	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	-	VRTX US	纳斯达克交易所	美国	452.00	230,994.05	0.09
247	CITIZENS FINANCIAL GROUP	-	CFG US	纽约证券交易所	美国	934.00	230,852.40	0.09
248	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	-	DLPH US	纽约证券交易所	美国	494.00	230,800.23	0.09
249	DOLLAR TREE INC	-	DLTR US	纳斯达克交易所	美国	430.00	230,220.99	0.09
250	NEWMONT MINING CORP	-	NEM US	纽约证券交易所	美国	968.00	228,780.60	0.09
251	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	-	HIG US	纽约证券交易所	美国	689.00	227,747.61	0.09
252	MONSTER BEVERAGE CORP	-	MNST US	纳斯达克交易所	美国	739.00	227,306.48	0.09
253	MOLSON COORS BREWING CO -B	-	TAP US	纽约证券交易所	美国	336.00	226,813.26	0.09
254	TYSON FOODS INC-CL A	-	TSN US	纽约证券交易所	美国	530.00	226,773.30	0.09
255	VORNADO REALTY TRUST	-	VNO US	纽约证券交易所	美国	313.00	226,616.60	0.09
256	REGIONS FINANCIAL CORP	-	RF US	纽约证券交易所	美国	2,246.00	223,736.01	0.08
257	VF CORP	-	VFC US	纽约证券交易所	美国	604.00	223,533.73	0.08
258	DTE ENERGY COMPANY	-	DTE US	纽约证券交易所	美国	327.00	223,459.99	0.08
259	MYLAN NV	-	MYL US	纳斯达克交易所	美国	839.00	222,038.46	0.08
260	AMERIPRISE FINANCIAL INC	-	AMP US	纽约证券交易所	美国	288.00	221,642.14	0.08
261	EVERSOURCE ENERGY	-	ES US	纽约证券交易所	美国	578.00	221,449.43	0.08
262	STANLEY BLACK & DECKER INC	-	SWK US	纽约证券交易所	美国	275.00	218,791.25	0.08
263	ROCKWELL AUTOMATION INC	-	ROK US	纽约证券交易所	美国	234.00	218,165.88	0.08
264	LAM RESEARCH CORP	-	LRCX US	纳斯达克交易所	美国	297.00	217,834.36	0.08
265	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	-	EL US	纽约证券交易所	美国	405.00	214,897.51	0.08
266	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	-	DPS US	纽约证券交易所	美国	335.00	210,707.56	0.08

267	HESS CORP	-	HES US	纽约证券交易所	美国	486.00	210,003.38	0.08
268	VULCAN MATERIALS CO	-	VMC US	纽约证券交易所	美国	241.00	209,227.90	0.08
269	FREEMPORT-MCMORAN INC	-	FCX US	纽约证券交易所	美国	2,286.00	209,166.78	0.08
270	CR BARD INC	-	BCR US	纽约证券交易所	美国	134.00	208,834.50	0.08
271	CONAGRA BRANDS INC	-	CAG US	纽约证券交易所	美国	759.00	208,237.99	0.08
272	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	-	LVL US	纽约证券交易所	美国	532.00	207,995.68	0.08
273	NOBLE ENERGY INC	-	NBL US	纽约证券交易所	美国	782.00	206,465.38	0.08
274	FORTIVE CORP	-	FTV US	纽约证券交易所	美国	548.00	203,873.16	0.08
275	L BRANDS INC	-	LB US	纽约证券交易所	美国	438.00	200,048.65	0.08
276	WILLIS TOWERS WATSON PLC	-	WLTW US	纳斯达克交易所	美国	234.00	198,491.99	0.07
277	MOODY'S CORP	-	MCO US	纽约证券交易所	美国	303.00	198,147.15	0.07
278	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	DLR US	纽约证券交易所	美国	290.00	197,672.59	0.07
279	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	-	PFJ US	纽约证券交易所	美国	488.00	195,870.91	0.07
280	CLOROX COMPANY	-	CLX US	纽约证券交易所	美国	234.00	194,823.43	0.07
281	XILINX INC	-	XLNX US	纳斯达克交易所	美国	460.00	192,641.88	0.07
282	ESSEX PROPERTY TRUST INC	-	ESS US	纽约证券交易所	美国	119.00	191,929.45	0.07
283	LINCOLN NATIONAL CORP	-	LNC US	纽约证券交易所	美国	417.00	191,701.15	0.07
284	LINEAR TECHNOLOGY CORP	-	LLTC US	纳斯达克交易所	美国	438.00	189,444.61	0.07
285	ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	-	9999996D US	纳斯达克交易所	美国	107.00	189,231.51	0.07
286	SYMANTEC CORP	-	SYMC US	纳斯达克交易所	美国	1,137.00	188,429.25	0.07
287	JM SMUCKER CO/THE	-	SJM US	纽约证券交易所	美国	212.00	188,330.67	0.07
288	REALTY INCOME CORP	-	O US	纽约证券交易所	美国	471.00	187,805.96	0.07
289	AGILENT TECHNOLOGIES INC	-	A US	纽约证券交易所	美国	592.00	187,101.43	0.07
290	MARATHON OIL CORP	-	MRO US	纽约证券交易所	美国	1,546.00	185,642.86	0.07
291	GGP INC	-	GGP US	纽约证券交易所	美国	1,065.00	184,549.87	0.07
292	AUTODESK INC	-	ADSK US	纳斯达克交易所	美国	357.00	183,286.43	0.07
293	HERSHEY CO/THE	-	HSY US	纽约证券交易所	美国	254.00	182,243.45	0.07
294	HUNTINGTON BANCSHARES INC	-	HBAN US	纳斯达克交易所	美国	1,979.00	181,488.43	0.07
295	CERNER CORP	-	CERN US	纳斯达克交易所	美国	551.00	181,061.74	0.07
296	GENUINE PARTS CO	-	GPC US	纽约证券交易所	美国	271.00	179,608.23	0.07
297	NATIONAL OILWELL VARCO INC	-	NOV US	纽约证券交易所	美国	689.00	178,947.96	0.07
298	EQUIFAX INC	-	EFX US	纽约证券交易所	美国	218.00	178,795.21	0.07
299	NIELSEN HOLDINGS PLC	-	NLSN US	纽约证券交易所	美国	613.00	178,387.38	0.07

300	MARTIN MARIETTA MATERIALS	-	MLM US	纽约证券交易所	美国	115.00	176,726.67	0.07
301	HOST HOTELS & RESORTS INC	-	HST US	纽约证券交易所	美国	1,350.00	176,435.66	0.07
302	CITRIX SYSTEMS INC	-	CTXS US	纳斯达克交易所	美国	284.00	175,950.35	0.07
303	HCP INC	-	HCP US	纽约证券交易所	美国	853.00	175,861.00	0.07
304	SKYWORKS SOLUTIONS INC	-	SWKS US	纳斯达克交易所	美国	339.00	175,573.67	0.07
305	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	-	MCHP US	纳斯达克交易所	美国	394.00	175,333.37	0.07
306	FRANKLIN RESOURCES INC	-	BEN US	纽约证券交易所	美国	633.00	173,800.57	0.07
307	MOTOROLA SOLUTIONS INC	-	MSI US	纽约证券交易所	美国	302.00	173,652.39	0.07
308	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	-	RCL US	纽约证券交易所	美国	305.00	173,579.00	0.07
309	EXPEDIA INC	-	EXPE US	纳斯达克交易所	美国	220.00	172,881.14	0.07
310	WHIRLPOOL CORP	-	WHR US	纽约证券交易所	美国	137.00	172,748.57	0.07
311	FASTENAL CO	-	FAST US	纳斯达克交易所	美国	527.00	171,749.44	0.06
312	DENTSPLY SIRONA INC	-	XRAY US	纳斯达克交易所	美国	421.00	168,599.14	0.06
313	FIRSTENERGY CORP	-	FE US	纽约证券交易所	美国	777.00	166,929.82	0.06
314	REPUBLIC SERVICES INC	-	RSG US	纽约证券交易所	美国	421.00	166,613.21	0.06
315	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	-	LH US	纽约证券交易所	美国	187.00	166,536.98	0.06
316	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	-	ADS US	纽约证券交易所	美国	105.00	166,435.97	0.06
317	ENTERGY CORP	-	ETR US	纽约证券交易所	美国	326.00	166,149.61	0.06
318	BALL CORP	-	BLL US	纽约证券交易所	美国	319.00	166,122.63	0.06
319	TEXTRON INC	-	TXT US	纽约证券交易所	美国	493.00	166,072.33	0.06
320	AMERISOURCEBERGEN CORP	-	ABC US	纽约证券交易所	美国	305.00	165,433.23	0.06
321	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	-	MJN US	纽约证券交易所	美国	337.00	165,420.53	0.06
322	CENTURYLINK INC	-	CTL US	纽约证券交易所	美国	997.00	164,466.97	0.06
323	LOEWS CORP	-	L US	纽约证券交易所	美国	504.00	163,729.29	0.06
324	CIMAREX ENERGY CO	-	XEC US	纽约证券交易所	美国	173.00	163,093.73	0.06
325	AMERICAN WATER WORKS CO INC	-	AWK US	纽约证券交易所	美国	324.00	162,635.47	0.06
326	WESTROCK CO	-	WRK US	纽约证券交易所	美国	458.00	161,303.70	0.06
327	QUEST DIAGNOSTICS INC	-	DGX US	纽约证券交易所	美国	253.00	161,290.11	0.06
328	WW GRAINGER INC	-	GWW US	纽约证券交易所	美国	100.00	161,111.83	0.06
329	AMEREN CORPORATION	-	AEE US	纽约证券交易所	美国	442.00	160,850.44	0.06
330	HARRIS CORP	-	HRS US	纽约证券交易所	美国	226.00	160,648.57	0.06
331	VERISK ANALYTICS INC	-	VRSK US	纳斯达克交易所	美国	284.00	159,913.67	0.06

332	MOHAWK INDUSTRIES INC	-	MHK US	纽约证券交易所	美国	115.00	159,295.72	0.06
333	RED HAT INC	-	RHT US	纽约证券交易所	美国	327.00	158,107.41	0.06
334	ADVANCE AUTO PARTS INC	-	AAP US	纽约证券交易所	美国	134.00	157,206.85	0.06
335	TRANSDIGM GROUP INC	-	TDG US	纽约证券交易所	美国	91.00	157,160.23	0.06
336	INVESCO LTD	-	IVZ US	纽约证券交易所	美国	745.00	156,799.09	0.06
337	KLA-TENCOR CORP	-	KLAC US	纳斯达克交易所	美国	285.00	155,553.90	0.06
338	CARMAX INC	-	KMX US	纽约证券交易所	美国	347.00	154,995.68	0.06
339	VIACOM INC-CLASS B	-	VIAB US	纳斯达克交易所	美国	634.00	154,371.84	0.06
340	HENRY SCHEIN INC	-	HSIC US	纳斯达克交易所	美国	146.00	153,652.19	0.06
341	ONEOK INC	-	OKE US	纽约证券交易所	美国	384.00	152,929.22	0.06
342	ROCKWELL COLLINS INC	-	COL US	纽约证券交易所	美国	237.00	152,503.84	0.06
343	PERRIGO CO PLC	-	PRGO US	纽约证券交易所	美国	261.00	150,692.66	0.06
344	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	-	1479997D US	纽约证券交易所	美国	141.00	148,781.38	0.06
345	COMERICA INC	-	CMA US	纽约证券交易所	美国	314.00	148,358.43	0.06
346	CAMPBELL SOUP CO	-	CPB US	纽约证券交易所	美国	353.00	148,076.58	0.06
347	BEST BUY CO INC	-	BBY US	纽约证券交易所	美国	498.00	147,408.89	0.06
348	DOVER CORP	-	DOV US	纽约证券交易所	美国	283.00	147,100.40	0.06
349	CMS ENERGY CORP	-	CMS US	纽约证券交易所	美国	509.00	146,957.43	0.06
350	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	-	AKAM US	纳斯达克交易所	美国	316.00	146,168.69	0.06
351	CHURCH & DWIGHT CO INC	-	CHD US	纽约证券交易所	美国	471.00	144,383.18	0.05
352	CINCINNATI FINANCIAL CORP	-	CINF US	纳斯达克交易所	美国	273.00	143,455.43	0.05
353	EQT CORP	-	EQT US	纽约证券交易所	美国	315.00	142,909.14	0.05
354	AMETEK INC	-	AME US	纽约证券交易所	美国	422.00	142,272.32	0.05
355	SEAGATE TECHNOLOGY	-	STX US	纳斯达克交易所	美国	537.00	142,189.70	0.05
356	HOLOGIC INC	-	HOLX US	纳斯达克交易所	美国	507.00	141,104.41	0.05
357	MID-AMERICA APARTMENT COMM	-	MAA US	纽约证券交易所	美国	207.00	140,609.11	0.05
358	EASTMAN CHEMICAL CO	-	EMN US	纽约证券交易所	美国	267.00	139,302.38	0.05
359	MACY'S INC	-	M US	纽约证券交易所	美国	557.00	138,366.58	0.05
360	ALASKA AIR GROUP INC	-	ALK US	纽约证券交易所	美国	224.00	137,876.48	0.05
361	CABOT OIL & GAS CORP	-	COG US	纽约证券交易所	美国	848.00	137,416.98	0.05
362	SL GREEN REALTY CORP	-	SLG US	纽约证券交易所	美国	184.00	137,277.68	0.05
363	WATERS CORP	-	WAT US	纽约证券交易所	美国	147.00	137,042.72	0.05
364	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	-	MTD US	纽约证券交易所	美国	47.00	136,466.88	0.05
365	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	-	CMG US	纽约证券交易所	美国	52.00	136,108.38	0.05
366	JUNIPER NETWORKS INC	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	694.00	136,051.50	0.05
367	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	-	MKC US	纽约证券交易所	美国	209.00	135,312.91	0.05

368	KIMCO REALTY CORP	-	KIM US	纽约证券交易所	美国	775.00	135,264.56	0.05
369	GLOBAL PAYMENTS INC	-	GPN US	纽约证券交易所	美国	280.00	134,819.21	0.05
370	CENTERPOINT ENERGY INC	-	CNP US	纽约证券交易所	美国	786.00	134,349.16	0.05
371	WESTERN UNION CO	-	WU US	纽约证券交易所	美国	884.00	133,193.73	0.05
372	SCANA CORP	-	SCG US	纽约证券交易所	美国	260.00	132,169.27	0.05
373	MASCO CORP	-	MAS US	纽约证券交易所	美国	599.00	131,389.42	0.05
374	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	-	CHRW US	纳斯达克交易所	美国	258.00	131,116.79	0.05
375	HARLEY-DAVIDSON INC	-	HOG US	纽约证券交易所	美国	322.00	130,314.87	0.05
376	MOSAIC CO/THE	-	MOS US	纽约证券交易所	美国	639.00	130,012.35	0.05
377	TESORO CORP	-	TSO US	纽约证券交易所	美国	213.00	129,214.46	0.05
378	FEDERAL REALTY INVS TRUST	-	FRT US	纽约证券交易所	美国	131.00	129,142.04	0.05
379	UNUM GROUP	-	UNM US	纽约证券交易所	美国	423.00	128,906.04	0.05
380	DAVITA INC	-	DVA US	纽约证券交易所	美国	288.00	128,262.36	0.05
381	ACUITY BRANDS INC	-	AYI US	纽约证券交易所	美国	80.00	128,118.07	0.05
382	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	-	DISCA US	纳斯达克交易所	美国	679.00	127,350.35	0.05
383	XL GROUP LTD	-	XL US	纽约证券交易所	美国	491.00	126,910.06	0.05
384	UNDER ARMOUR INC- CLASS A	-	UA US	纽约证券交易所	美国	672.00	126,350.80	0.05
385	CINTAS CORP	-	CTAS US	纳斯达克交易所	美国	157.00	125,857.44	0.05
386	CA INC	-	CA US	纳斯达克交易所	美国	571.00	125,841.83	0.05
387	TRACTOR SUPPLY COMPANY	-	TSCO US	纳斯达克交易所	美国	239.00	125,688.66	0.05
388	SNAP-ON INC	-	SNA US	纽约证券交易所	美国	105.00	124,750.50	0.05
389	COACH INC	-	COH US	纽约证券交易所	美国	511.00	124,139.14	0.05
390	WHOLE FOODS MARKET INC	-	WFM US	纳斯达克交易所	美国	581.00	123,975.01	0.05
391	UDR INC	-	UDR US	纽约证券交易所	美国	487.00	123,241.08	0.05
392	NETAPP INC	-	NTAP US	纳斯达克交易所	美国	502.00	122,823.33	0.05
393	EXTRA SPACE STORAGE INC	-	EXR US	纽约证券交易所	美国	229.00	122,701.38	0.05
394	ALBEMARLE CORP	-	ALB US	纽约证券交易所	美国	205.00	122,413.08	0.05
395	CENTENE CORP	-	CNC US	纽约证券交易所	美国	311.00	121,915.07	0.05
396	FOOT LOCKER INC	-	FL US	纽约证券交易所	美国	246.00	120,973.93	0.05
397	EXPEDITORS INTL WASH INC	-	EXPD US	纳斯达克交易所	美国	329.00	120,869.18	0.05
398	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	-	UHS US	纽约证券交易所	美国	163.00	120,287.16	0.05
399	E*TRADE FINANCIAL CORP	-	ETFC US	纳斯达克交易所	美国	499.00	119,943.16	0.05
400	CBRE GROUP INC - A	-	CBG US	纽约证券交易所	美国	547.00	119,490.03	0.05
401	F5 NETWORKS INC	-	FFIV US	纳斯达克交易所	美国	119.00	119,466.79	0.05

402	LKQ CORP	-	LKQ US	纳斯达克交易所	美国	561.00	119,279.29	0.04
403	MATTEL INC	-	MAT US	纳斯达克交易所	美国	624.00	119,255.35	0.04
404	HORMEL FOODS CORP	-	HRL US	纽约证券交易所	美国	492.00	118,806.67	0.04
405	PENTAIR PLC	-	PNR US	纽约证券交易所	美国	305.00	118,632.06	0.04
406	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	-	IFF US	纽约证券交易所	美国	144.00	117,703.69	0.04
407	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	-	IPG US	纽约证券交易所	美国	724.00	117,574.10	0.04
408	DR HORTON INC	-	DHI US	纽约证券交易所	美国	619.00	117,355.10	0.04
409	ARTHUR J GALLAGHER & CO	-	AJG US	纽约证券交易所	美国	324.00	116,784.67	0.04
410	KANSAS CITY SOUTHERN	-	KSU US	纽约证券交易所	美国	196.00	115,366.47	0.04
411	DARDEN RESTAURANTS INC	-	DRI US	纽约证券交易所	美国	224.00	112,998.74	0.04
412	XYLEM INC	-	XYL US	纽约证券交易所	美国	327.00	112,331.12	0.04
413	UNITED RENTALS INC	-	URI US	纽约证券交易所	美国	153.00	112,058.49	0.04
414	ZIONS BANCORPORATION	-	ZION US	纳斯达克交易所	美国	371.00	110,768.91	0.04
415	SEALED AIR CORP	-	SEE US	纽约证券交易所	美国	352.00	110,712.30	0.04
416	KOHL'S CORP	-	KSS US	纽约证券交易所	美国	322.00	110,300.80	0.04
417	HASBRO INC	-	HAS US	纳斯达克交易所	美国	204.00	110,084.36	0.04
418	PINNACLE WEST CAPITAL	-	PNW US	纽约证券交易所	美国	203.00	109,882.70	0.04
419	ALLIANT ENERGY CORP	-	LNT US	纽约证券交易所	美国	415.00	109,079.82	0.04
420	COTY INC-CL A	-	COTY US	纽约证券交易所	美国	858.00	108,980.13	0.04
421	MACERICH CO/THE	-	MAC US	纽约证券交易所	美国	220.00	108,111.76	0.04
422	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	-	JBHT US	纳斯达克交易所	美国	159.00	107,066.56	0.04
423	COOPER COS INC/THE	-	COO US	纽约证券交易所	美国	88.00	106,787.07	0.04
424	LENNAR CORP-A	-	LEN US	纽约证券交易所	美国	358.00	106,614.34	0.04
425	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	-	VAR US	纽约证券交易所	美国	170.00	105,876.66	0.04
426	HELMERICH & PAYNE	-	HP US	纽约证券交易所	美国	197.00	105,773.99	0.04
427	TIFFANY & CO	-	TIF US	纽约证券交易所	美国	195.00	104,740.72	0.04
428	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	-	FBHS US	纽约证券交易所	美国	281.00	104,209.42	0.04
429	WYNDHAM WORLDWIDE CORP	-	WYN US	纽约证券交易所	美国	196.00	103,836.62	0.04
430	BROWN-FORMAN CORP- CLASS B	-	BF/B US	纽约证券交易所	美国	332.00	103,454.53	0.04
431	HANESBRANDS INC	-	HBI US	纽约证券交易所	美国	689.00	103,095.82	0.04
432	ARCONIC INC	-	ARNC US	纽约证券交易所	美国	800.00	102,889.58	0.04
433	TORCHMARK CORP	-	TMK US	纽约证券交易所	美国	201.00	102,846.30	0.04
434	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	-	TSS US	纽约证券交易所	美国	301.00	102,376.45	0.04

435	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	-	GT US	纳斯达克交易所	美国	476.00	101,933.11	0.04
436	FMC TECHNOLOGIES INC	-	1482276D US	纽约证券交易所	美国	411.00	101,299.83	0.04
437	NEWFIELD EXPLORATION CO	-	NFX US	纽约证券交易所	美国	360.00	101,141.46	0.04
438	AFFILIATED MANAGERS GROUP	-	AMG US	纽约证券交易所	美国	100.00	100,794.61	0.04
439	IRON MOUNTAIN INC	-	IRM US	纽约证券交易所	美国	447.00	100,715.25	0.04
440	BORGWARNER INC	-	BWA US	纽约证券交易所	美国	365.00	99,862.28	0.04
441	HARMAN INTERNATIONAL	-	HAR US	纽约证券交易所	美国	127.00	97,931.85	0.04
442	AES CORP	-	AES US	纽约证券交易所	美国	1,203.00	96,971.35	0.04
443	NASDAQ INC	-	NDAQ US	纳斯达克交易所	美国	208.00	96,847.18	0.04
444	FMC CORP	-	FMC US	纽约证券交易所	美国	244.00	95,735.04	0.04
445	LEUCADIA NATIONAL CORP	-	LUK US	纽约证券交易所	美国	591.00	95,319.58	0.04
446	XEROX CORP	-	XRX US	纽约证券交易所	美国	1,554.00	94,110.26	0.04
447	ENVISION HEALTHCARE CORP	-	EVHC US	纽约证券交易所	美国	214.00	93,955.14	0.04
448	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	-	CF US	纽约证券交易所	美国	425.00	92,810.12	0.04
449	FLUOR CORP	-	FLR US	纽约证券交易所	美国	254.00	92,540.13	0.03
450	NISOURCE INC	-	NI US	纽约证券交易所	美国	589.00	90,461.67	0.03
451	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	-	AIV US	纽约证券交易所	美国	286.00	90,171.98	0.03
452	PVH CORP	-	PVH US	纽约证券交易所	美国	144.00	90,143.26	0.03
453	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	-	KORS US	纽约证券交易所	美国	299.00	89,147.53	0.03
454	VERISIGN INC	-	VRSN US	纳斯达克交易所	美国	166.00	87,597.80	0.03
455	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	-	JEC US	纽约证券交易所	美国	220.00	86,989.98	0.03
456	WYNN RESORTS LTD	-	WYNN US	纳斯达克交易所	美国	144.00	86,417.26	0.03
457	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	-	SNI US	纳斯达克交易所	美国	173.00	85,651.21	0.03
458	QORVO INC	-	QRVO US	纳斯达克交易所	美国	233.00	85,228.61	0.03
459	STERICYCLE INC	-	SRCL US	纳斯达克交易所	美国	155.00	82,836.10	0.03
460	LEGGETT & PLATT INC	-	LEG US	纽约证券交易所	美国	243.00	82,396.58	0.03
461	SIGNET JEWELERS LTD	-	SIG US	纽约证券交易所	美国	126.00	82,389.08	0.03
462	RANGE RESOURCES CORP	-	RRC US	纽约证券交易所	美国	342.00	81,517.52	0.03
463	ROBERT HALF INTL INC	-	RHI US	纽约证券交易所	美国	235.00	79,520.91	0.03
464	FLOWERVE CORP	-	FLS US	纽约证券交易所	美国	238.00	79,330.84	0.03
465	AVERY DENNISON CORP	-	AVY US	纽约证券交易所	美国	162.00	78,912.81	0.03
466	BED BATH & BEYOND INC	-	BBBY US	纳斯达克交易所	美国	277.00	78,091.75	0.03
467	ALLEGION PLC	-	ALLE US	纽约证券交易所	美国	175.00	77,694.40	0.03

468	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	-	PBCT US	纳斯达克交易所	美国	568.00	76,282.58	0.03
469	STAPLES INC	-	SPLS US	纳斯达克交易所	美国	1,187.00	74,519.68	0.03
470	NEWS CORP - CLASS A	-	NWS US	纳斯达克交易所	美国	915.00	73,254.86	0.03
471	TRANSOCEAN LTD	-	RIG US	纽约证券交易所	美国	710.00	72,598.48	0.03
472	PERKINELMER INC	-	PKI US	纽约证券交易所	美国	199.00	71,991.15	0.03
473	GARMIN LTD	-	GRMN US	纳斯达克交易所	美国	209.00	70,302.40	0.03
474	NORDSTROM INC	-	JWN US	纽约证券交易所	美国	211.00	70,155.48	0.03
475	PULTEGROUP INC	-	PHM US	纽约证券交易所	美国	543.00	69,233.62	0.03
476	SOUTHWESTERN ENERGY CO	-	SWN US	纽约证券交易所	美国	895.00	67,177.21	0.03
477	ASSURANT INC	-	AIZ US	纽约证券交易所	美国	104.00	66,993.66	0.03
478	TRIPADVISOR INC	-	TRIP US	纳斯达克交易所	美国	208.00	66,907.09	0.03
479	MALLINCKRODT PLC	-	MNK US	纽约证券交易所	美国	193.00	66,701.06	0.03
480	QUANTA SERVICES INC	-	PWR US	纽约证券交易所	美国	275.00	66,482.47	0.03
481	CHESAPEAKE ENERGY CORP	-	CHK US	纽约证券交易所	美国	1,360.00	66,228.93	0.02
482	RALPH LAUREN CORP	-	RL US	纽约证券交易所	美国	102.00	63,908.08	0.02
483	MURPHY OIL CORP	-	MUR US	纽约证券交易所	美国	295.00	63,704.90	0.02
484	NAVIENT CORP	-	NAVI US	纳斯达克交易所	美国	553.00	63,028.13	0.02
485	GAP INC/THE	-	GPS US	纽约证券交易所	美国	400.00	62,266.51	0.02
486	FLIR SYSTEMS INC	-	FLIR US	纳斯达克交易所	美国	248.00	62,260.41	0.02
487	H&R BLOCK INC	-	HRB US	纽约证券交易所	美国	378.00	60,284.06	0.02
488	CSRA INC	-	CSRA US	纽约证券交易所	美国	265.00	58,531.63	0.02
489	TEGNA INC	-	TGNA US	纽约证券交易所	美国	391.00	58,017.53	0.02
490	DUN & BRADSTREET CORP	-	DNB US	纽约证券交易所	美国	67.00	56,386.99	0.02
491	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	-	FTR US	纳斯达克交易所	美国	2,140.00	50,176.71	0.02
492	RYDER SYSTEM INC	-	R US	纽约证券交易所	美国	97.00	50,089.86	0.02
493	NRG ENERGY INC	-	NRG US	纽约证券交易所	美国	575.00	48,902.38	0.02
494	TERADATA CORP	-	TDC US	纽约证券交易所	美国	237.00	44,669.35	0.02
495	PATTERSON COS INC	-	PDCO US	纳斯达克交易所	美国	152.00	43,263.02	0.02
496	ENDO INTERNATIONAL PLC	-	ENDP US	纳斯达克交易所	美国	362.00	41,359.37	0.02
497	AUTONATION INC	-	AN US	纽约证券交易所	美国	119.00	40,160.72	0.02
498	PITNEY BOWES INC	-	PBI US	纽约证券交易所	美国	339.00	35,721.46	0.01
499	URBAN OUTFITTERS INC	-	URBN US	纳斯达克交易所	美国	161.00	31,808.09	0.01
500	FIRST SOLAR INC	-	FSLR US	纳斯达克交易所	美国	142.00	31,610.38	0.01

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 (%)
1	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	450,067.65	0.22
	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	405,079.35	0.20
2	APPLE INC	AAPL US	842,952.21	0.41
3	BROADCOM LTD	AVGO US	819,038.18	0.40
4	MICROSOFT CORP	MSFT US	775,722.48	0.38
5	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	732,869.64	0.36
6	EXXON MOBIL CORP	XOM US	633,773.43	0.31
7	AMAZON.COM INC	AMZN US	569,214.67	0.28
8	FACEBOOK INC-A	FB US	556,782.74	0.27
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	552,670.70	0.27
10	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	512,942.78	0.25
11	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	458,097.86	0.22
12	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	458,078.69	0.22
13	AT&T INC	T US	449,559.78	0.22
14	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	413,942.62	0.20
15	WELLS FARGO & CO	WFC US	401,317.25	0.20
16	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	389,932.73	0.19
17	CHEVRON CORP	CVX US	365,776.00	0.18
18	PFIZER INC	PFE US	355,924.95	0.17
19	FORMER CHARTER COMMUNICATION	9876540D US	334,389.04	0.16
20	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	321,350.80	0.16

注：“买入金额”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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比例 (%)
1	APPLE INC	AAPL US	456,494.34	0.22
2	BROADCOM LTD	AVGO US	367,333.02	0.18
3	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	JCI US	348,927.23	0.17
4	BROADCOM CORP-CL A	BRCM US	338,256.61	0.17
5	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	CHTR US	336,630.93	0.16
6	TIME WARNER CABLE	TWC US	328,027.50	0.16
7	MONSTER BEVERAGE CORP	MNST US	286,393.25	0.14
8	GENERAL ELECTRIC CO	GE US	281,720.78	0.14
9	MICROSOFT CORP	MSFT US	268,273.85	0.13

10	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	AIG US	191,854.98	0.09
11	SHIRE PLC-ADR	SHPG US	191,568.91	0.09
12	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	94,358.96	0.05
	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	86,800.29	0.04
13	GILEAD SCIENCES INC	GILD US	168,440.47	0.08
14	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	167,982.02	0.08
15	EXXON MOBIL CORP	XOM US	167,500.53	0.08
16	CHUBB CORP	9876566D US	158,199.55	0.08
17	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	155,217.87	0.08
18	MCDONALD'S CORP	MCD US	151,276.47	0.07
19	WELLS FARGO & CO	WFC US	147,714.18	0.07
20	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	145,014.30	0.07

注：“卖出金额”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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	39,673,270.70
卖出收入（成交）总额	18,744,620.61

注：本项“买入成交总金额”、“卖出成交总金额”按买入、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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 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

金额单位：人民币元

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 Mar17	151,434.71	0.06

8.9 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

本基金本报告期末未持有基金。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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	790,818.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	254,896.39
4	应收利息	3,571.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	31,877.72
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,081,163.15

8.10.4 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。

8.10.5 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情况。

8.10.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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		博时标普 500 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
3663	50,455.72	12,735,961.00	6.89%	50,471,669.00	27.31%	121,611,655.00	65.80%

9.2 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	中信证券股份有限公司	5,000,000	2.71
2	华润深国投信托有限公司－鑫狮善渊守中集合资金信托计	2,036,661	1.10
3	广发证券股份有限公司	2,000,000	1.08
4	周诗琪	2,000,000	1.08
5	闫增凯	1,009,100	0.54
6	韩松	1,000,000	0.54
	柳蓓	1,000,000	0.54
	南京盛泉恒元投资有限公司－盛泉恒元多策略市场中性 3 号专项证券投资基金	1,000,000	0.54
	宁波睿正投资管理中心（有限合伙）-进睿马拉松量化对冲私募证券投资基金	1,000,000	0.54
	邱丽丽	1,000,000	0.54
	任良	1,000,000	0.54
	闻杏娟	1,000,000	0.54
	杨巧伟	1,000,000	0.54
	章宁翔	1,000,000	0.54
	赵永刚	1,000,000	0.54
	征和瑞森（北京）资本管理有限公司－征和瑞森价值基金	1,000,000	0.54
7	宋新华	683,161	0.37
8	兰兆玉	548,300	0.30
9	罗从斌	540,300	0.29
10	张芳	500,000	0.27
	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	121,611,655.00	65.80

注：前十名持有人为除博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

9.3 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	-	-

9.4 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 研究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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年12月5日)基金份额总额	565,043,200.00
本报告期期初基金份额总额	167,819,285.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	7,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	184,819,285.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 50000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	

Morgan Stanley Asia Limited	-	50,428,867.22	100.00%	16,562.12	100.00%
-----------------------------	---	---------------	---------	-----------	---------

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，在多家券商开立了券商交易账户。

1、基金券商交易账户的选择标准如下：

- (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；能根据基金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、基金券商交易账户的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构；
- (2) 基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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	关于博时旗下部分基金开通在工行定投业务并参加工行定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-30
2	关于博时旗下部分开放式基金增加北京恒天明泽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	2016-12-28
3	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金恢复申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-27
4	博时标普 500 交易型开放式证券投资基金交易风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-24
5	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	2016-12-22
6	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年境外主要市场节假日暂停申购赎回	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-21

	业务的公告		
7	博时标普 500 交易型开放式证券投资基金交易风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-08
8	关于博时旗下部分开放式基金增加天津国美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	2016-11-11
9	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-10-24
10	关于博时旗下部分开放式基金增加东海期货有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-10-20
11	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海欧中联合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	2016-09-02
12	关于博时旗下部分开放式基金新增华融湘江银行股份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	2016-08-26
13	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-25
14	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-25
15	关于博时旗下部分开放式基金增加上海万得投资顾问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	2016-07-29
16	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-20
17	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（2016 年第 2 号）-正文	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-20
18	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（2016 年第 2 号）-摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-20
19	关于博时旗下部分开放式基金增加桂林银行股份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	2016-07-18
20	关于博时旗下部分开放式基金开通上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参加其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	2016-07-15
21	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
22	关于博时旗下部分开放式基金增加新增乾道金融信息服务（北京）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	2016-05-27
23	博时基金管理有限公司关于博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-18
24	博时标普 500 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

25	博时标普 500 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
26	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
27	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书(2016 年第 1 号)(正文)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-28
28	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书(2016 年第 1 号)(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-28
29	博时标普 500 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
30	博时标普 500 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
31	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(2016 年第 1 号)-摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-19
32	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(2016 年第 1 号)-正文	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-19
33	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-12
34	博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金暂停申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-12

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 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
- 12.1.6 博时标普 500 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
二〇一七年三月二十七日