

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 第三季度 报告

2014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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27日

1.1 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

基金名称	博时标普500ETF联接(QDII)
基金主代码	080205
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月14日
报告期末基金份额总额	266,908,485.21份
投资目标	通过投资于博时标普500交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过交易买卖或申购赎回的方式投资于标的指数的成份股,根据投资者申购、赎回的情况对本基金投资组合进行实时调整,力求跟踪标的指数的变动,追求跟踪误差的最小化。同时,为了更好地实现本基金的投资目标,本基金可适当运用股指期货、期权等金融衍生工具进行套期保值,以对冲标的指数的波动风险,提高本基金跟踪标的指数的精度。
业绩比较基准	标普500指数 S&P 500 Index (NTR, Net Total Return) 经汇率调整后,以人民币计价。
风险收益特征	本基金属于通过交易买卖或申购赎回的方式投资于境外证券市场,跟踪标的指数的开放式基金,其风险和收益特征与标的指数所跟踪的境外证券市场相似,属于中高风险收益型证券投资基金。

2.1.1 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
基金主代码	513100
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月5日
上市证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014年1月15日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期2014年7月1日-2014年9月30日
1.本期已实现收益	3,774,246.32
2.本期利润	2,594,956.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094
4.期末基金份额净值	370.79183033
5.期末基金资产净值	1,380,171,428.14

3.2 本基金业绩比较基准	
业绩比较基准	标普500指数 S&P 500 Index (NTR, Net Total Return) 经汇率调整后,以人民币计价。
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.3 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.4 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.5 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.6 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.7 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.8 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.9 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.10 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.11 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.12 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.13 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.14 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.15 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.16 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.17 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.18 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.19 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.20 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.21 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.22 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.23 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.24 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.25 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.26 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.27 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.28 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

3.29 本基金跟踪误差	
跟踪误差	报告期内跟踪误差未超过0.5%。

5.1 投资组合报告			
5.1.1 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		
	其中:普通股		
	存托凭证		
	优先股		
	房地产信托		
2	基金投资	349,766,853.24	91.01
3	固定收益投资		
	其中:债券		
4	金融衍生品投资		
	其中:中期票据		
	期权		
5	买入返售金融资产		
	其中:买入返售金融资产		
6	货币工具		
7	银行存款和结算备付金合计	30,136,789.59	7.90
8	其他资产	4,214,854.80	1.10
9	合计	384,137,997.63	100.00

5.2 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.3 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.4 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.5 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.6 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.7 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.8 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.9 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.10 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.11 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.12 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.13 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.14 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.15 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.16 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.17 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.18 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.19 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.20 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.21 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.22 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.23 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.24 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.25 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.26 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.27 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.28 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.29 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.30 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.31 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.32 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.33 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.34 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.35 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.36 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.37 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33
基金份额净值	370.79183033

5.38 基金资产净值	
基金资产净值	1,380,171,428.14
基金份额总额	3,707,918,303.33