



Disclosure 信息披露

2016年1月11日 星期一
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B23

（上接B22页）

联系电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：沈文杰
经办注册会计师：薛竟、沈礼杰

四、基金名称

博时上证50交易型开放式证券投资基金联接基金

五、基金类型

联接基金

六、基金运作方式

本基金运作方式为契约开放式，存续期间为不定期

七、基金的投资目标

通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

八、基金的投资范围

本基金主要投资于目标ETF，标的指数成份股和备选成份股。国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依法法律法规或监管机构的规定执行。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，对现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略

本基金主要投资于目标ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的投资管理。

1、资产配置策略
为实现投资目标，本基金将始终不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依法法律法规或监管机构的规定执行。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，对现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

2、基金投资策略
(1) 投资组合的构建
基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的基础权重构建股票组合，并在建仓期内将投资组合换购成目标ETF。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。

(2) 投资组合的投资方式
本基金投资目标ETF的两种方式如下：
1) 申购赎回：目标ETF开放申购赎回后，以组合证券进行申购赎回；
2) 二级市场交易：目标ETF上市交易后，在二级市场进行目标ETF的交易。本基金投资于目标ETF的方式以申购和赎回为主，但在目标ETF二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，减小与标的指数的跟踪误差和跟踪偏离度，也可以通过二级市场交易买卖目标ETF。

3、成份股、备选成份股投资策略
本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为复制和跟踪投资组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的基本条件，主要考虑完全复制策略，即完全复制标的指数的成份股及其权重。本基金将根据标的指数成分及其权重的变化情况及时进行相应调整，但在因特殊因素（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将依据其他合理方法进行适当的替代。

4、债券投资策略
本基金债券投资组合将考虑债券基金的流动性管理及策略性投资的需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。债券投资的目的主要是进行流动性管理，有效利用基金资产，提高基金资产的投资效益。

5、股指期货及其他金融衍生品投资策略
本基金在股指期货投资中将遵循有效管理投资资产，根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行择机操作。

6、权证及资产支持证券的投资策略
本基金将通过上述权证标的证券的基本面以及资产支持证券基础资产及结构设计的分析，结合多种定价模型，根据基金资产净值合理确定权证投资及资产支持证券的投资。

十、业绩比较基准

上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
如上述业绩比较基准发生变化或停止上述的指数编制及发布，或者上述的指数由其他指数取代，或由指数编制方法发生重大变更导致上述指数不再能够作为标的指数，或证券市场有其他更具代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金的投资目标可以相应调整。本基金管理人有权根据法律法规的规定，变更上述的业绩比较基准，并相应调整基金名称和业绩比较基准。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

十一、基金的风险特征

本基金为ETF联接基金，通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数及标的指数所代表的证券市场相类似的风险收益特征。
同时，本基金为被动式投资的股票型基金，跟踪上证50指数，其预期风险与预期收益高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金，其风险收益特征与标的指数的风险收益特征相类似。

十二、基金投资组合报告

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定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。

本报告中报告期末数据截至2015年9月30日，报告中所有财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额/元	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	89,084.00	0.05
2	债券投资	89,084.00	0.05
3	货币资金	97,808,111.66	60.27
4	应收利息	-	-
5	其他资产	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产	-	-
9	其他	5,734,628.39	3.52
10	其他	170,826.63	0.10
11	合计	103,834,648.08	100.00

2.期末投资目标基金比例情况

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金总资产比例(%)
1	博时上证50交易型开放式证券投资基金	股票型	交易型开放式	博时基金管理有限公司	97,808,111.66	94.86

3.报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	医药、生物	-	-
B	制造业	2,206.00	0.00
C	制造业	11,015.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,244.00	0.01
F	采矿业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	信息技术业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,257.00	0.00
J	金融业	23,022.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
P	金融业	-	-
Q	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	49,044.00	0.05

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投资明细

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	600088	大冶特钢	1,600	6,200.00	0.00
2	600190	金鸿能源	500	5,470.00	0.00
3	400100	中国铁建	200	4,430.00	0.00
4	600046	海信电器	300	4,257.00	0.00
5	600086	海康电子	200	3,570.00	0.00
6	600028	中铁二局	200	3,052.00	0.00
7	600029	中铁二局	100	2,555.00	0.00
8	600091	华兰生物	400	2,540.00	0.00
9	600004	白云机场	200	2,374.00	0.00
10	600000	浦发银行	100	1,680.00	0.00

5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券。

7. 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资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属。

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五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

10. 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指期货投资明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

11. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

12. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

13. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

14. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

15. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

16. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

17. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

18. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

19. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

20. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

21. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

22. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

23. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

24. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

25. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

26. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

27. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

28. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

29. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

30. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

31. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

32. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

33. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

34. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

35. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

36. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

37. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

38. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

39. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

40. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

41. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

42. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

43. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

44. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

45. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

46. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

47. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

48. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

49. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

50. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

51. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

52. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

53. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

54. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

55. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

本基金本报告期末未持有权证。

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

12. 投资组合报告附注
(1) 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除方正证券（601901）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制前十二个月内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 方正证券股份有限公司2015年8月26日发布公告称，因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，被中国证监会立案调查。

针对投资涉及程序的事项，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

(3) 本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。

(4) 其他各项资产构成

序号	名称	金额/元
1	存保证金	84,043.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,511.00
5	应收申购款	85,660.61
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	170,826.63

(5) 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可转换债券。

(6) 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。

(7) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
(8) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

由于沪深两市涨跌幅限制，部分买入和卖出申请当日可能存在尾盘。

本基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效后开始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：

期间	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率-业绩比较基准
2015年1月1日至2015年9月30日	-27.00%	7.79%	-34.79%

十四、基金的费用概览

一、与基金运作有关的费用
(一) 基金费用的种类
1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金的证券交易费用；
7. 基金的银行汇划费用；
8. 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1. 基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H=H×0.30%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
F为前一日的基金资产净值
基金管理人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金管理费。

前一日的基金资产净值已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净值，金额为负时以零计。
基金管理费每日计提，逐日累计至每个月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H=H×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
F为前一日的基金资产净值
基金管理人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金托管费。

前一日的基金资产净值已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净值，金额为负时以零计。
基金托管费每日计提，逐日累计至每个月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3. 基金的销售费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

4. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

5. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

6. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

7. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

8. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

9. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

10. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

11. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

12. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

13. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

14. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

15. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

16. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

17. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

18. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

19. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

20. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

21. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

22. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

23. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

24. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

25. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

26. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

27. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

28. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

29. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

30. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

31. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

32. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

33. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

34. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

35. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

36. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

37. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

38. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

39. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

40. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

41. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

42. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

43. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售费用在基金认购费中列支。

44. 基金的其他费用
本基金在基金募集期间发生的基金销售费用，由基金管理人承担。基金销售