

博时上证50交易型开放式证券投资基金联接基金

2015 第四季度 报告

2015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：招商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一六年一月二十日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2015年10月1日起至12月31日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	博时上证50ETF联接
基金代码	001217
交易币种	人民币
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月14日
报告期末基金份额总额	13,970,300.00份

投资目标：通过主要投资于目标ETF，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：本基金主要投资于目标ETF，力争做到在每个开放日申购资金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的申购赎回。

业绩比较基准：上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

风险收益特征：本基金为ETF联接基金，通过投资于目标ETF间接投资于沪深50指数的成份股，具有与标的指数及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

1.3 基金管理人基本情况

基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

1.4 基金业绩比较基准

基金名称	博时上证50交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	510120
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2015年8月27日

1.5 基金投资组合报告

报告期末本基金投资组合的行业分布情况：

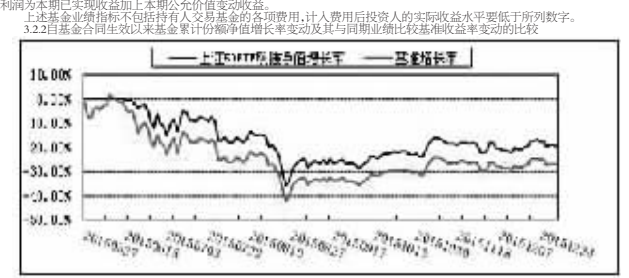
行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 农林牧渔	290,490.00	0.23
2 采矿业	—	—
3 制造业	—	—
4 建筑业	—	—
5 交通运输、仓储和邮政业	—	—
6 信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
7 金融业	—	—
8 房地产业	—	—
9 公共事业	—	—
10 其他	—	—

1.6 基金业绩比较基准

项目	权重
上证50指数收益率	95%
银行活期存款利率	5%

1.7 基金业绩比较基准

项目	权重
上证50指数收益率	95%
银行活期存款利率	5%



注：本基金合同于2015年12月14日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（四）投资限制”的有关规定。

1.8 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.9 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.10 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.11 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.12 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.13 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.14 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.15 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.16 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.17 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.18 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.19 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.20 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.21 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.22 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.23 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.24 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

1.25 基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	期初	期末
基金管理人持有本基金份额	—	—

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	—	—	—
B 采矿业	—	—	—
C 制造业	—	—	—
D 建筑业	—	—	—
E 交通运输、仓储和邮政业	—	—	—
F 信息传输、软件和信息技术服务业	—	—	—
G 金融业	—	—	—
H 房地产业	—	—	—
I 公共事业	—	—	—
J 其他	—	—	—

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	600000	浦发银行	3,100	24,900.00	0.03
2	601318	中国平安	38,800.00	39,800.00	0.03
3	600016	民生银行	2,100	20,240.00	0.02
4	601166	兴业银行	900	15,360.00	0.02
5	600036	招商银行	700	12,500.00	0.01
6	600029	中国联通	600	11,600.00	0.01
7	600000	浦发银行	600	10,520.00	0.01
8	601228	交通银行	1,600	10,240.00	0.01
9	601288	农业银行	1,700	8,710.00	0.01
10	600887	伊泰煤炭	500	8,210.00	0.01

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—
4	600029	中国联通	—	—	—
5	600000	浦发银行	—	—	—
6	601228	交通银行	—	—	—
7	601288	农业银行	—	—	—
8	600887	伊泰煤炭	—	—	—

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	000001	平安银行	290,490.00	2,904,900.00	0.23
2	601166	兴业银行	—	—	—
3	600036	招商银行	—	—	—