

博时标普500指数型证券投资基金

2012] 第三季度报告

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:2012年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性承担责任及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，确认复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:博时标普500指数(ODI)

基金主代码:050025

交易代码:050025

基金运作方式:契约型开放式

基金合同期:2012年6月14日

报告期基金份额总额:41,376,946.00份

报告期基金份额净值:1.00元

报告期基金份额累计净值:41,376,946.00元

投资目标:通过投资于标的指数成分股，追求跟踪误差和跟踪误差的最小化。

本基金将主要投资于标的指数成份股，通过投资于标的指数成份股而不直接购买基金资产的85%。其余部分将主要投资于货币市场工具、银行存款、现金等货币市场工具。

投资策略:本基金的主要投资策略为完全复制法，即完全按照标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。

业绩比较基准:标准普尔500指数(S&P 500 Index(Net TR))收益率

风险特征:股票型基金

基金管理人:博时基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

境外托管人英文名称:The Bank of New York Mellon

境外财产托管人中文名称:由该银行托管

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期(2012年7月1日-2012年9月30日) 单位:人民币元

1.本期已实现收益 2,244,572.47

2.本期利润 4,523,967.73

3.加权平均基金份额本期利润 0.0843

4.期末基金资产净值 42,953,097.71

5.期末基金份额净值 1.0331

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益扣减相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

所列数据未包含持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平低于所列数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长 率 年净值增长率差值(%) 业绩比较基准 收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 6.11% 0.64% 6.45% 0.72% -0.34% -0.08%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

14.00%
12.00%
10.00%
8.00%
6.00%
4.00%
2.00%
-2.00%
-4.00%
-6.00%
-8.00%
-10.00%
-12.00%
-14.00%
-16.00%
-18.00%
-20.00%
-22.00%
-24.00%
-26.00%
-28.00%
-30.00%
-32.00%
-34.00%
-36.00%
-38.00%
-40.00%
-42.00%
-44.00%
-46.00%
-48.00%
-50.00%
-52.00%
-54.00%
-56.00%
-58.00%
-60.00%
-62.00%
-64.00%
-66.00%
-68.00%
-70.00%
-72.00%
-74.00%
-76.00%
-78.00%
-80.00%
-82.00%
-84.00%
-86.00%
-88.00%
-90.00%
-92.00%
-94.00%
-96.00%
-98.00%
-100.00%
-102.00%
-104.00%
-106.00%
-108.00%
-110.00%
-112.00%
-114.00%
-116.00%
-118.00%
-120.00%
-122.00%
-124.00%
-126.00%
-128.00%
-130.00%
-132.00%
-134.00%
-136.00%
-138.00%
-140.00%
-142.00%
-144.00%
-146.00%
-148.00%
-150.00%
-152.00%
-154.00%
-156.00%
-158.00%
-160.00%
-162.00%
-164.00%
-166.00%
-168.00%
-170.00%
-172.00%
-174.00%
-176.00%
-178.00%
-180.00%
-182.00%
-184.00%
-186.00%
-188.00%
-190.00%
-192.00%
-194.00%
-196.00%
-198.00%
-200.00%
-202.00%
-204.00%
-206.00%
-208.00%
-210.00%
-212.00%
-214.00%
-216.00%
-218.00%
-220.00%
-222.00%
-224.00%
-226.00%
-228.00%
-230.00%
-232.00%
-234.00%
-236.00%
-238.00%
-240.00%
-242.00%
-244.00%
-246.00%
-248.00%
-250.00%
-252.00%
-254.00%
-256.00%
-258.00%
-260.00%
-262.00%
-264.00%
-266.00%
-268.00%
-270.00%
-272.00%
-274.00%
-276.00%
-278.00%
-280.00%
-282.00%
-284.00%
-286.00%
-288.00%
-290.00%
-292.00%
-294.00%
-296.00%
-298.00%
-300.00%
-302.00%
-304.00%
-306.00%
-308.00%
-310.00%
-312.00%
-314.00%
-316.00%
-318.00%
-320.00%
-322.00%
-324.00%
-326.00%
-328.00%
-330.00%
-332.00%
-334.00%
-336.00%
-338.00%
-340.00%
-342.00%
-344.00%
-346.00%
-348.00%
-350.00%
-352.00%
-354.00%
-356.00%
-358.00%
-360.00%
-362.00%
-364.00%
-366.00%
-368.00%
-370.00%
-372.00%
-374.00%
-376.00%
-378.00%
-380.00%
-382.00%
-384.00%
-386.00%
-388.00%
-390.00%
-392.00%
-394.00%
-396.00%
-398.00%
-400.00%
-402.00%
-404.00%
-406.00%
-408.00%
-410.00%
-412.00%
-414.00%
-416.00%
-418.00%
-420.00%
-422.00%
-424.00%
-426.00%
-428.00%
-430.00%
-432.00%
-434.00%
-436.00%
-438.00%
-440.00%
-442.00%
-444.00%
-446.00%
-448.00%
-450.00%
-452.00%
-454.00%
-456.00%
-458.00%
-460.00%
-462.00%
-464.00%
-466.00%
-468.00%
-470.00%
-472.00%
-474.00%
-476.00%
-478.00%
-480.00%
-482.00%
-484.00%
-486.00%
-488.00%
-490.00%
-492.00%
-494.00%
-496.00%
-498.00%
-500.00%
-502.00%
-504.00%
-506.00%
-508.00%
-510.00%
-512.00%
-514.00%
-516.00%
-518.00%
-520.00%
-522.00%
-524.00%
-526.00%
-528.00%
-530.00%
-532.00%
-534.00%
-536.00%
-538.00%
-540.00%
-542.00%
-544.00%
-546.00%
-548.00%
-550.00%
-552.00%
-554.00%
-556.00%
-558.00%
-560.00%
-562.00%
-564.00%
-566.00%
-568.00%
-570.00%
-572.00%
-574.00%
-576.00%
-578.00%
-580.00%
-582.00%
-584.00%
-586.00%
-588.00%
-590.00%
-592.00%
-594.00%
-596.00%
-598.00%
-600.00%
-602.00%
-604.00%
-606.00%
-608.00%
-610.00%
-612.00%
-614.00%
-616.00%
-618.00%
-620.00%
-622.00%
-624.00%
-626.00%
-628.00%
-630.00%
-632.00%
-634.00%
-636.00%
-638.00%
-640.00%
-642.00%
-644.00%
-646.00%
-648.00%
-650.00%
-652.00%
-654.00%
-656.00%
-658.00%
-660.00%
-662.00%
-664.00%
-666.00%
-668.00%
-670.00%
-672.00%
-674.00%
-676.00%
-678.00%
-680.00%
-682.00%
-684.00%
-686.00%
-688.00%
-690.00%
-692.00%
-694.00%
-696.00%
-698.00%
-700.00%
-702.00%
-704.00%
-706.00%
-708.00%
-710.00%
-712.00%
-714.00%
-716.00%
-718.00%
-720.00%
-722.00%
-724.00%
-726.00%
-728.00%
-730.00%
-732.00%
-734.00%
-736.00%
-738.00%
-740.00%
-742.00%
-744.00%
-746.00%
-748.00%
-750.00%
-752.00%
-754.00%
-756.00%
-758.00%
-760.00%
-762.00%
-764.00%
-766.00%
-768.00%
-770.00%
-772.00%
-774.00%
-776.00%
-778.00%
-780.00%
-782.00%
-784.00%
-786.00%
-788.00%
-790.00%
-792.00%
-794.00%
-796.00%
-798.00%
-800.00%
-802.00%
-804.00%
-806.00%
-808.00%
-810.00%
-812.00%
-814.00%
-816.00%
-818.00%
-820.00%
-822.00%
-824.00%
-826.00%
-828.00%
-830.00%
-832.00%
-834.00%
-836.00%
-838.00%
-840.00%
-842.00%
-844.00%
-846.00%
-848.00%
-850.00%
-852.00%
-854.00%
-856.00%
-858.00%
-860.00%
-862.00%
-864.00%
-866.00%
-868.00%
-870.00%
-872.00%
-874.00%
-876.00%
-878.00%
-880.00%
-882.00%
-884.00%
-886.00%
-888.00%
-890.00%
-892.00%
-894.00%
-896.00%
-898.00%
-900.00%
-902.00%
-904.00%
-906.00%
-908.00%
-910.00%
-912.00%
-914.00%
-916.00%
-918.00%
-920.00%
-922.00%
-924.00%
-926.00%
-928.00%
-930.00%
-932.00%
-934.00%
-936.00%
-938.00%
-940.00%
-942.00%
-944.00%
-946.00%
-948.00%
-950.00%
-952.00%
-954.00%
-956.00%
-958.00%
-960.00%
-962.00%
-964.00%
-966.00%
-968.00%
-970