

博时标普500指数型证券投资基金

[2013] 第二季度报告

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:2013年7月18日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至30日止。

§2基金产品概况

基金简称	博时标普500指数(ODH)
基金代码	050025
交易代码	050025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月14日
报告期末基金份额总额	105,843,065.05份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本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85%。其余部分将主要投资于固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具。
业绩比较基准	标准普尔500总收益指数(SNP 500 Index (Net TR))收益率
风险收益特征	属于高风险、高收益特征的开放式基金
基金管理人	博时基金管理有限公司
境外托管人英文名称	The Bank of New York Mellon
境外托管人中文名称	纽约梅隆银行

§3主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元		报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)	
1.本期已实现收益	1,020,124.63	2.本期利润	506,004.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057	4.本期基金份额净值	119,644,513.16
5.期末基金资产净值	11,304	6.报告期基金份额净值增长率及其相对应的业绩比较基准收益率	1.30%
7.报告期基金份额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	0.87% 1.27% 0.87% 0.06% 0.00%	8.报告期基金份额净值增长率及其相对应的业绩比较基准收益率	1.30%

3.1主要财务指标

单位:人民币元		报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)	
1.本期已实现收益	1,020,124.63	2.本期利润	506,004.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057	4.本期基金份额净值	119,644,513.16
5.期末基金资产净值	11,304	6.报告期基金份额净值增长率及其相对应的业绩比较基准收益率	1.30%
7.报告期基金份额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	0.87% 1.27% 0.87% 0.06% 0.00%	8.报告期基金份额净值增长率及其相对应的业绩比较基准收益率	1.30%

3.2基金净值表现

阶段		净值增长率①	业绩比较基准收益率②	净值增长率标准差③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-	1.33%	0.87%	1.27%	0.87%	0.06%	0.00%
3.2.2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	-	-	-	-	-	-	-

3.3影响投资者决策的其他重要信息

注:本基金的基金合同于2012年6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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第11条“二、投资范围”、“六、投资限制”的有关约定。

本基金建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同第11条“二、投资范围”、“六、投资限制”的有关约定。

4.1管理人报告

4.1.1基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	离任日期	说明
胡俊敏	基金经理	2012-11-13	-	6
王红欣	基金经理/ETF及量化投资组投资总监	2013-1-9	-	19

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

本基金未聘境外投资顾问。

4.3报告期内本基金运作遵守信守情况说明

在本报告期内,本基金管理人员严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《封闭式证券投资基金运作指引》、《证券投资基金销售基金销售基本管理制度》、《并本着诚实信用、勤勉尽责、忠实的原则,履行了相关职责,没有出现损害基金持有人利益的重大违法违规行为。本基金报告期内,基金管理人严格按照法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、忠实的原则,履行了相关职责,没有出现损害基金持有人利益的重大违法违规行为。

4.4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《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易制度。

4.5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。

4.6报告期内基金的报税情况说明

本基金未进行报税。

4.7报告期未进行定期报告的说明

本基金未进行定期报告。

4.8报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.9报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.10报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.11报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.12报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.13报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.14报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.15报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.16报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.17报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.18报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.19报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.20报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.21报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.22报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.23报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.24报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.25报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.26报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.27报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.28报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.29报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.30报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.31报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.32报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.33报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.34报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.35报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.36报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.37报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.38报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.39报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.40报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.41报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.42报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.43报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.44报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.45报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.46报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.47报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.48报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

4.49报告期未进行定期报告的情况说明

本基金未进行定期报告。

4.50报告期未进行定期报告的原因说明

本基金未进行定期报告。

</div