博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】半年度报告摘要

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:二〇一五年八月二十七日

§1重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时标普500ETF联接(QDII)
基金主代码	050025
交易代码	050025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月14日
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
报告期末基金份额总额	129,137,657.03份
基金合同存续期	不定期

2.1.1目标基金基本情况

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	513500
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2013年12月5日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
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

2.2 基金产品说明

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所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况,本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率等因素分析,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。本基金还将投资于期权、期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品,投资目标是更紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	经人民币汇率调整的标的指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金主要投资于目标ETF,其预期收益及预期风险水平与目标ETF类似,高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险/高收益特征的开放式基金

2.2.1目标基金产品概况

投资目标	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	本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。 同时,为了更好地实现本基金的投资目标,本基金可适当借出证券。 为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差,本基金将用少量资产投资跟踪同一标的指数的股指期货,以达到最有效跟踪标的指数的投资目标。
业绩比较基准	标普500指数(S&P 500 Index(NTR,Net total Return))(经估值汇率调整,以人民币计价)
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高预期风险和高预期收益的基金品种。 本基金主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现,其风险收益特征与标的指数相似。本基金主要投资于美国证券市场的股票,投资者需承担汇率风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	蒋松云
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York, NY 10286
办公地址		-	One Wall Street New York, NY 10286
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

项目		
	http://www.bosera.com	
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处	

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	12,239,297.55
本期利润	3,882,427.75
加权平均基金份额本期利润	0.0224
本期基金份额净值增长率	0.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2934
期末基金资产净值	185,069,571.91
期末基金份额净值	1.4331

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

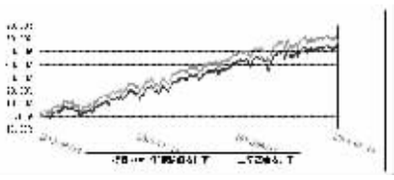
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.92%	0.67%	-1.97%	0.67%	0.05%	0.00%
过去三个月	-0.03%	0.62%	-0.31%	0.62%	0.28%	0.00%
过去六个月	0.91%	0.77%	0.82%	0.77%	0.09%	0.00%
过去一年	5.69%	0.74%	5.83%	0.73%	-0.14%	0.01%
自基金合同生效起至今	50.43%	0.70%	57.64%	0.72%	-7.21%	-0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:经人民币汇率调整的标的指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年6月14日至2015年6月30日)



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

§4管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。"为国民创造财富"是博时的使命。博时的投资理念是"做投资价值的发现者"。截至2015年6月30日,博时基金公司共管理七十只开放式基金,并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户。博时基金资产管理净值总规模逾3027.86亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1317.35亿元人民币,累计分红超过664.83亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,标准股票型基金中,截至6月30日,博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在379只标准型股票基金中分别排名前1/3和前1/2;博时深证基本面200ETF及联接基金今年以来的净值增长率在175只指数股票型基金-标准指数股票基金及46只ETF联接基金中分别排名前1/2和前1/3;混合基金-偏股型基金中,博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型36只产品中排名前1/3;混合基金-灵活配置型基金中,博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在126只同类型基金中分别排名前1/3和前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债债券今年以来收益率在71只同类长期标准债券型基金中分别排名前1/10、前1/2和前1/2;博时上证企债30ETF今年以来的收益率在18只指数债券型基金-指数债券型基金(A类)排名前1/3。

2、其他大事件

2015年1月7日,博时基金在2014年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

2015年1月15日,在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中,博时基金获评第十二届中国财经风云榜"年度十大品牌基金公司"奖。

2015年1月18日,博时基金(香港)在和讯财经风云榜海外评选中荣获"最佳中资基金公司"奖。

2015年1月21日,在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中,博时转债增强荣获第八届金蝉奖"2014最佳年度债基品牌奖"。

2015年3月28日,在第十二届中国基金业金牛奖评选中,博时主题行业(LOF)基金、博时信用债券基金分别获得"2014年度开放式股票型金牛基金"奖、"三年期开放式债券型持续优胜金牛基金"奖。

2015年3月28日,在中金在线主办的"2014年度财经排行榜"评选中,邓欣雨获评"2014年度中金在线财经排行榜最佳基金经理"。

2015年4月22日,由上海证券报社主办的第十二届中国"金基金"奖的评选揭晓,博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得5年期股票型金基金奖。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方维玲	指数投资部副总经理/基金经理	2015-05-06	-	23.5	1982年起先后在云南大学、海南省信托投资公司、湘财证券、北京玖万量子公司工作。2001年加入博时基金管理有限公司,历任金融工程师、数量化投资部副总经理、产品规划部总经理、投资经理、基金经理助理。现任指数投资部副总经理兼博时上证超大盘ETF基金、博时上证超大盘ETF联接基金、博时上证自然资源ETF基金、博时上证自然资源ETF联接基金、博时黄金ETF基金、博时标普500ETF基金、博时标普500ETF联接(QDII)基金、博时上证50ETF基金、博时上证50ETF联接基金、博时银行分级基金的基金经理。
王红欣	指数投资部总经理/基金经理	2013-01-09	-	21	1994年起先后在RXR期货公司、Aeltus投资公司,Putnam投资公司、Acadian资产管理公司,易方达资产管理(香港)公司工作。2012年10月加入博时基金管理有限公司。曾任股票投资部ETF及量化组投资总监。现任指数投资部总经理兼博时裕富沪深300指数证券投资基金、博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时标普500交易型开放式指数证券投资基金、博时上证超大盘ETF联接基金、博时上证自然资源ETF基金、博时上证自然资源ETF联接基金的基金经理。
万琼	基金经理助理	2013-09-01	2015-06-08	8	2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金,历任投资助理、基金经理助理。现任博时上证超大盘ETF基金、博时上证超大盘ETF联接基金、博时上证自然资源ETF基金、博时上证自然资源ETF联接基金的基金经理。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

博时基金管理有限公司于2015年7月9日发布公告称,王红欣先生不再担任本基金的基金经理。

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

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.4.2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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年,美股震荡起伏。经历一季度的寒冬后,二季度宏观经济逐步回暖。二季度末,美国宏观数据普遍向好,美国经济重拾增长动力。1季度实际GDP环比增速由-0.7%上修为-0.2%,其中居民消费增速由1.8%上修至2.1%是GDP增速上修的主因,房屋销量和个人消费支出均好于预期,就业市场持续回暖,消费信心指数持续攀升。这些数据均显示居民消费仍将是2015年美国经济增长的主力。

本基金主要投资于标普500交易型开放式指数证券投资基金以及标普500指数成份股及备选成份股,以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的收益。在报告期内,本基金严格按照基金合同,以不低于基金资产净值90%的资产都投资于标普500交易型开放式指数证券投资基金,保证投资收益紧贴标的指数;现金或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%。为了更加有效的进行现金管理,本基金用少量资产投资于标普500指数相关股指期货,以期达到最有效跟踪标的指数的投资目标。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.4331元,累计份额净值为1.4921元,报告期内净值增长率为0.91%,同期业绩基准涨幅为0.82%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年下半年,居民消费和房地产市场持续上行将对美国经济增长构成支撑。经济重拾增长动能,失业率逐步逼近美联储理想目标,美联储年内加息成为大概率事件。另一方面,欧元区经济数据总体向好,欧元区受希腊危机影响有限。美债长端利率持续上行,实际利率上行对风险资产价格的冲击值得关注。预计下半年,标普500指数延续窄幅震荡走势的概率较大。

在投资策略上,博时标普500ETF联接基金作为一只被动投资的基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,紧密跟踪目标基准。我们希望通过博时标普500ETF联接基金为投资人提供长期配置的良好投资工具。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了博时基金管理有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人已于2015年1月8日发布公告,以2014年12月31日可分配利润为基准,每10份基金份额派发红利0.244元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为5,104,876.82元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2015年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	16,999,880.50	22,535,123.17
结算备付金	92,040.44	3,116,579.27
存出保证金	196,857.92	281,474.00
交易性金融资产	171,462,509.28	284,724,161.55
其中:股票投资	-	-
基金投资	171,462,509.28	284,724,161.55
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,156,506.11	4,570,702.93
应收利息	3,673.24	5,317.27
应收股利	-	-
应收申购款	573,241.18	2,208,866.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	190,484,708.67	317,442,224.94
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,026.89	-
应付赎回款	5,127,430.64	12,307,556.14
应付管理人报酬	6,844.34	9,965.65
应付托管费	2,851.81	4,152.33
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-1,816.71	-6,025.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	274,799.79	178,478.27
负债合计	5,415,136.76	12,494,126.49
所有者权益:	-	-
实收基金	129,137,657.03	211,111,843.37
未分配利润	55,931,914.88	93,836,255.08
所有者权益合计	185,069,571.91	304,948,098.45
负债和所有者权益总计	190,484,708.67	317,442,224.94

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.4331元,基金份额总额129,137,657.03份。

6.2 利润表

会计主体:博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	4,138,836.88	22,629,566.59
1.利息收入	84,393.75	220,294.47
其中:存款利息收入	84,393.75	101,182.50
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	119,111.97
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	12,111,431.29	28,038,088.17
其中:股票投资收益	-	25,179,810.30
基金投资收益	11,962,338.86	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	149,092.43	2,229,559.81
股利收益	-	628,718.06
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-8,356,869.80	-6,427,316.31
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	40,930.68	587,075.66
5.其他收入(损失以"-"号填列)	258,950.96	211,424.60
减:二、费用	256,409.13	720,281.77
1. 管理人报酬	49,417.53	315,534.03
2. 托管费	20,590.60	131,472.48
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,269.65	34,933.82
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	185,131.35	238,341.44
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	3,882,427.75	21,909,284.82
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	3,882,427.75	21,909,284.82

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	211,111,843.37	93,836,255.08	304,948,098.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,882,427.75	3,882,427.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-81,974,186.34	-36,681,891.13	-118,656,077.47
其中:1.基金申购款	64,474,458.05	28,358,974.39	92,833,432.44
2.基金赎回款	-146,448,644.39	-65,040,865.52	-211,489,509.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-5,104,876.82	-5,104,876.82
五、期末所有者权益(基金净值)	129,137,657.03	55,931,914.88	185,069,571.91
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	159,198,734.27	45,714,284.63	204,913,018.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	21,909,284.82	21,909,284.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	106,092,437.02	34,022,648.72	140,115,085.74
其中:1.基金申购款	234,206,122.94	75,064,742.29	309,270,865.23
2.基金赎回款	-128,113,685.92	-41,042,093.57	-169,155,779.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-1,057,951.43	-1,057,951.43
五、期末所有者权益(基金净值)	265,291,171.29	100,588,266.74	365,879,438.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:江向阳　　主管会计工作负责人:王德英　　会计机构负责人:成江

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.3关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司("博时基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人、基金代销机构
纽约梅隆银行有限公司("纽约梅隆")	境外资产托管人
博时标普500交易型开放式指数证券投资基金("目标ETF")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	49,417.53	315,534.03
其中:支付销售机构的客户维护费	-	290,256.37

注:1. 本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取管理费,支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取零)的0.6%年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)X 0.6% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议,客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,590.60	131,472.48

注:本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取零)的0.25%年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)X 0.25% /当年天数。

6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	16,999,880.50	83,392.95	53,184,509.56	96,010.64
纽约梅隆	-	-	1,122,383.64	-

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人纽约梅隆保管,截止2015年6月30日在境外资产托管人纽约梅隆的银行存款余额为0。按适用利率或约定利率计息。

6.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7其他关联交易事项的说明

于2015年6月30日,本基金持有148,877,754.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为75.64%。(于2014年6月30日,本基金持有269,673,214.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为78.66%)。

6.4.5期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1银行间市场债券正回购

无余额。

6.4.5.3.2交易所市场债券正回购

无余额。

§7投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	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	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	171,462,509.28	90.01
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,091,920.94	8.97
8	其他各项资产	1,930,278.45	1.01
9	合计	190,484,708.67	100.00

注:金融衍生品投资项下的期货投资,在当日无负债结算制度下,结算备付金已包括所持期货合约产生的持仓损益,则金融衍生品投资项下的期货投资与相关的期货结算暂收款(结算所得的持仓损益)相抵消后的净额为0,具体投资情况详见下表:

期货类型	期货代码	期货名称	持仓量(买/卖)	合约价值(人民币元)	公允价值变动(人民币元)
股指期货	ESU5	S&P500 EMINI FUT?? Sep15	7.00	4,395,922.94	-74,356.66
总额合计		?			-74,356.66
减:可抵消期货暂收款		?			-74,356.66
股指期货投资净额		?			0.00

7.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.3期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.5报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期内无股票及存托凭证的买入。

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期内无股票及存托凭证的卖出。

7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期内无股票及存托凭证的买入及卖出。

7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位:人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Sep15	-74,356.66	-0.04

7.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	513500 CG	ETF基金	开放式	博时基金管理有限公司	171,462,509.28	92.65

7.11投资组合报告附注

7.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.11.2 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。

7.11.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	196,857.92
2	应收证券清算款	1,156,506.11
3	应收股利	-
4	应收利息	3,673.24
5	应收申购款	573,241.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,930,278.45

7.11.4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处于转股期的可转换债券。

7.11.5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。

7.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,729	13,273.48	6,920,435.21	5.36%	122,217,221.82	94.64%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	28,769.92	0.02%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-	-
	合计	-

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;
2、本基金的基金经理未持有本基金。

§9开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年6月14日)基金份额总额	310,182,625.61
本报告期期初基金份额总额	211,111,843.37
本报告期基金总申购份额	64,474,458.05
减:本报告期基金总赎回份额	146,448,644.39
本报告期基金拆分变动份额	-