

信息披露 Disclosure

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2014 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:2014年8月28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责任。本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2014年8月27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。

本年度报告摘要请见半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2014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)
基金代码	050025
交易代码	050025
基金份额类别	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
报告期末基金资产总额	265,291,712.09
基金合同终止日期	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
基金代码	513560
交易代码	513560
基金份额类别	交易型开放式基金
基金合同生效日	2013年12月5日
基金管理人	上海证券交易所
基金托管人	2014年1月15日
报告期末基金资产总额	105,843,065.05
基金合同终止日期	13,801,448.11
报告期末基金份额净值	119,644,513.16

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，力求取得与标的指数相似的收益。
投资策略	本基金主要通过买卖股票、债券回购、货币市场基金、权证、衍生品等金融工具，结合对标的指数成分股的深入研究，通过定期调整和不定期调整两种方式，对标的指数成份股进行跟踪，从而达到与标的指数相似的收益。本基金还将少量投资于期权、期货以及其他标的指数成份股的指数基金或指数基金的衍生品，投资目标更趋全面地跟踪标的指数。
业绩比较基准	人民币汇率调整后的纳斯达克综合指数×95%+人民币活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金主要投资于目标ETF，其预期风险及预期收益水平与目标ETF类似，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，力求取得与标的指数相似的收益。
投资策略	本基金主要通过买卖股票、债券回购、货币市场基金、权证、衍生品等金融工具，结合对标的指数成份股的深入研究，通过定期调整和不定期调整两种方式，对标的指数成份股进行跟踪，从而达到与标的指数相似的收益。本基金还将少量投资于期权、期货以及其他标的指数成份股的指数基金或指数基金的衍生品，投资目标更趋全面地跟踪标的指数。
业绩比较基准	标普500指数(S&P 500 Index/NTTR, Net Reval Return) (经估值调整后, 调整以人民币计价)
风险收益特征	本基金主要投资于目标ETF, 其预期风险及预期收益水平与目标ETF类似, 属于高风险、高收益特征的开放式基金。

2.2.2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
住所	深圳市南山区海天二路3号资本大厦12层	北京市西城区复兴门内大街55号
信息披露负责人	孙晓军	赵会军
联系电话	0755-83169999	010-66105799
电子邮箱	service@bofa.com	custod@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	—	The Bank of New York Mellon
中文	—	纽约梅隆银行
注册地址	—	One Wall Street New York, NY 1026
办公地址	—	One Wall Street New York, NY 1026
邮政编码	—	—

2.5信息披露方式

项目	http://www.bofa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人

§ 3主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标		报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益		28,336,601.31
本期利润		21,909,284.82
加权平均基金份额本期利润		0.1064
本期基金份额净值增长率		7.70%
报告期末(2014年6月30日)		0.2045
期末基金资产净值		365,879,438.03
期末基金份额净值		1.3792

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将低于所列数字。

3.2基金的表决权

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	份额净值增长率	业绩比较基准 收益率	业绩比较基准收 益率	①-③	②-④
过去一个月	1.60%	0.53%	1.60%	0.35%	-0.06%	0.06%
过去三个月	4.56%	0.56%	4.83%	0.57%	-0.27%	-0.01%
过去六个月	7.70%	0.59%	7.41%	0.61%	0.29%	-0.02%
过去一年	22.64%	0.61%	22.86%	0.62%	-0.22%	-0.01%
最近三个季度	42.43%	0.68%	48.96%	0.72%	-6.62%	-0.04%

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基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

固定收益方面,博时信用债基金今年以来收益率在365只标准化股票基金中排名前1/3,标准指数股票型基金中,博时沪深300指数、博时上证大盘ETF、博时深证基本面200ETF三只基金今年以来净值增长率在150只同类基金中排名前1/2,博时平衡配置在16只股债平衡型基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债基金今年以来收益率在101只长期标准债券型基金中排名前1/4,博时纯债基金今年以来收益率在10只纯债型基金中排名前1/2,博时理财债券型基金今年以来收益率在10只货币基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债基金今年以来收益率在9只QDII亚太股票型基金中排名第2,博时通胀债在8只QDII商品基金中排名第2。

2.客户服务

2014年上半年,博时基金共举办各类渠道培训活动284场,参加人数7356人。

3.其他大事件

2014年1月10日,在和讯网举办的2013年第一届财经风云榜基金行业评选中,博时基金荣获“最佳品牌”奖项。

2014年1月11日在,在讯网举办的2013年第一届财经风云榜基金行业评选中,博时基金荣获“最佳品牌”奖项。

2014年6月16日,大智慧在上海举办“智慧财经巅峰榜”,博时基金荣获“十佳基金公司”奖项,基金经理陈圆荣获“荣获智慧财经巅峰榜‘最佳基金经理’”奖项。

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其基金经理的经营情况

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2014年6月30日,博时基金管理公司共管理四十七只开放式基金,并且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,公募基金资产规模逾104亿元人民币,累计分红超过620亿元人民币,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。

4.1.2基金经理/基金经理助理/基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(助理)期限 离任日期 说明

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限	离任日期	说明
王红波	ETP及量化投资总监兼权益投资总监	2013-1-9	-	20 1994年起先后在RJR烟公司、Adhesives公司、Pamco投资公司、Academy资产管理公司、摩根大通资管公司工作。

王红波 基金经理助理 2013-9 7 2013年9月加入博时基金管理有限公司,现任股票投资部股票投资总监。

万峰 基金经理助理 2013-9-1 - 7 2013年9月加入博时基金管理有限公司,现任股票投资部股票投资总监。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金经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。

4.2境外投资顾问向本基金提供投资建议的主要成员简介