博时安盈债券型证券投资基金

【2015】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：2015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2015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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时安盈债券
基金主代码	000084
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月23日
报告期末基金份额总额	192,237,868.57份
投资目标	通过基金管理人对以短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断，选择具有投资价值的债券，严格控制风险，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，进行前瞻性的决策。一方面，本基金将分析和预测众多的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等），并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。另一方面，本基金将对短期债券市场收益率曲线和信用利差的变化进行深入细致分析，从而得出对市场走势和波动特征的判断。在此基础上，确定资产在不同行业、不同品种的债券之间的配置比例。
业绩比较基准	中国人民银行公布的1年期定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。
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

下属两级基金的基金简称	博时安盈债券A	博时安盈债券C
下属两级基金的交易代码	000084	000085
报告期末下属两级基金的份额总额	95,207,207.74份	97,030,660.83份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年4月1日-2015年6月30日）	
	博时安盈债券A	博时安盈债券C
1.本期已实现收益	2,068,248.79	1,670,173.78
2.本期利润	1,957,065.25	1,772,284.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0153	0.0150
4.期末基金资产净值	100,031,147.78	101,372,537.82
5.期末基金份额净值	1.051	1.045

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。

所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本报告期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

1、博时安盈债券A：

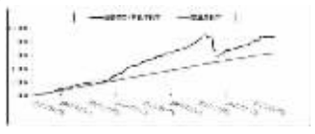
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.25%	0.08%	0.59%	0.01%	0.66%	0.07%

2、博时安盈债券C：

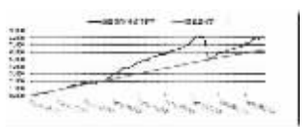
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.16%	0.06%	0.59%	0.01%	0.57%	0.05%

3.2.2自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

1. 博时安盈债券A：



2. 博时安盈债券C：



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏桢	基金经理	2015-05-22	-	7	2004年起在厦门市商业银行任债券交易组主管。2008年加入博时基金管理有限公司，历任债券交易员、固定收益研究员。现任博时理财30天债券基金兼博时岁岁增利一年定期开放债券基金、博时月月薪定期支付债券基金、博时安丰18个月定期开放债券（LOF）基金、博时双月薪定期支付债券基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金、博时现金收益货币基金、博时安盈债券基金、博时保证金货币ETF基金、博时证金宝货币基金的基金经理。
张勇	基金经理/固定收益总部现金管理组投资总监	2014-04-23	2015-5-22	11.5	2001年起先后在南京市商业银行任信贷员、债券交易员，2003年加入博时基金管理有限公司，历任债券交易员、基金经理助理、固定收益部副总经理、博时稳定价值债券投资基金、博时现金收益证券投资基金、博时策略灵活配置混合型证券投资基金、博时安盈债券型证券投资基金、博时安泰债券投资基金、博时天天增利货币市场基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、博时现金宝货币市场基金、博时保证金实时交易型货币市场基金的基金经理、固定收益总部现金管理组投资总监。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、本基金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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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。

4.4报告期内本基金投资策略和运作分析

2015年第二季度，受央行大幅降准影响，货币市场流动性十分充裕。银行间R001均值1.55%（-154BP），R007均值4.39%（-190BP）。现券市场先涨后跌，收益率曲线呈现出短端下行幅度大于长端的陡峭化走势，期限利差扩大。高评级信用债收益率下行幅度大于中低评级收益率下行幅度，因此信用利差扩大。1年期短融收益率分别为3.49%（AAA）、3.97%（AA+）、4.39%（AA）。

二季度，本基金秉承短债的低波动和安全性原则，增配交易所3年内信用短债，增强杠杠收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金A类基金份额净值为1.051元，份额累计净值为1.087元；C类基金份额净值为1.045元，份额累计净值为1.077元。报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为1.25%，C类基金份额净值增长率为1.16%，同期业绩基准增长率0.59%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于IPO频率加快和规模放量可能，资金需求向短端逼近，短期限资金价格将维持低位震荡。预计资金价格仍将保持宽松的状态，且仍有下行空间。广谱利率传导机制不完善，广谱负债利率（理财）对债券收益率下限形成较强约束；传统配置框架的打破需要为配置户的交易化营造环境，长期限的流动性宽松是必要条件，这意味着要么获得疲弱基本面的支持，要么要有长期限的政策承诺。经济看平（弱势企稳），周期力量在回升，政策调整在继续，预期的波动性在上升。我们倾向认为于未来货币政策继续宽松的方向依旧明确，未来资金价格仍处在下降的通道之中，供需矛盾方向与经济方向一致，套息和杠杆带来确定性的收益。

本组合投资思路上保持谨慎乐观，策略上依然保持中上杠杆水平，通过短债降低波动性，以控制信用风险和提高票息收入为主。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	256,189,272.80	93.30
	其中：债券	256,189,272.80	93.30
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	7,717,210.60	2.81
7	其他各项资产	10,681,903.77	3.89
8	合计	274,588,387.17	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,993,000.00	4.96
	其中：政策性金融债	9,993,000.00	4.96
4	企业债券	73,599,272.80	36.54
5	企业短期融资券	121,527,000.00	60.34
6	中期票据	51,070,000.00	25.36
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	256,189,272.80	127.20

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	041464048	14鲁晨曦CP001	500,000	50,700,000.00	25.17
2	041455036	14鲁焦化CP002	300,000	30,489,000.00	15.14
3	122163	12鄂资债	280,000	27,498,800.00	13.65
4	1382044	13特变集MTN1	200,000	20,538,000.00	10.20
5	1282537	12美凯龙MTN2	200,000	20,432,000.00	10.14

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本报告期内，本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的情况。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,975.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,572,884.14
5	应收申购款	2,103,044.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,681,903.77

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时安盈债券A	博时安盈债券C
本报告期期初基金份额总额	154,033,562.33	172,753,078.24
本报告期基金总申购份额	35,517,108.67	117,346,054.78
减：本报告期基金总赎回份额	94,343,463.26	193,068,472.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	95,207,207.74	97,030,660.83

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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、博时信用债纯债基金今年以来收益率在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。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会批准博时安盈债券型证券投资基金设立的文件

9.1.2《博时安盈债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《博时安盈债券型证券投资基金托管协议》

9.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5博时安盈债券型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6报告期内博时安盈债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

【2015】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：2015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2015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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时标普500ETF
场内简称	标普500
基金主代码	513500
交易代码	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
报告期末基金份额总额	196,819,285.00份
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。
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
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2015年4月1日-2015年6月30日）
1.本期已实现收益	9,000,972.42
2.本期利润	-1,014,696.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0044
4.期末基金资产净值	226,669,040.62
5.期末基金份额净值	1.1517

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。

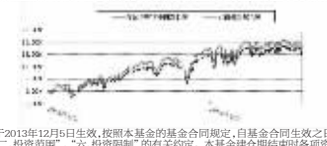
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-0.06%	0.65%	-0.34%	0.65%	0.28%	-

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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



注：本基金的基金合同于2013年12月5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14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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、北京欣万量子公司工作。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	2013-12-06	-	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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、本基金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 公平交易专项说明

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。

4.4.3报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

2015年2季度，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。2季度标普500指数震荡起伏，本季度内略微下探。

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。

4.4.4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，份额累计净值为1.4921元，报告期内净值增长率为-0.03%，同期业绩基准涨幅为-0.31%。

4.5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年二季度，严寒过后美国经济“冰封”解除可期，消费者信心将仍处于高位。3月中旬美联储的鸽派言论再次出现，二季度加息的可能性减小，预计美联储将会在三季度启动加息。同时，加息的节奏也会趋于渐进式，是否加息如何加息，仍然依赖于经济数据、就业情况以及通胀情况。未来这个季度，市场或将对相关经济数据更加敏感。

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。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

姓名	项目	金额(人民币元)	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	-	-
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

5.2期末投资目标基金明细

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	-	171,462,509.28	92.65

5.3 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.6 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本报告期末未持有债券投资。

5.7报告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。

5.8报告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。

5.9报告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

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

5.10报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	513500 CG	ETF基金	开放式	-	171,462,509.28	92.65

5.11 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
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

5.11.4报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	175,587,371.13
本报告期基金总申购份额	25,975,964.29
减：本报告期基金总赎回份额	72,425,668.39
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	129,137,657.03

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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、博时信用债纯债基金今年以来收益率在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。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

9.1.1中国证监会批准博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金设立的文件

9.1.2《博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

9.1.3《博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

9.1.4基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金各年度审计报告正本

9.1.6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在指定报刊上各项公告的原稿

9.2存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日