博时保证金实时交易型货币市场基金

【2015】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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时保证金货币ETF
场内简称	博时货币
基金主代码	511860
交易代码	511860
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月25日
报告期末基金份额总额	14,767,211.23份
投资目标	在保持相对低风险和相对高流动性的前提下获得高于业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金在资产配置时应充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征。在风险与收益的配比中,力求降低各类风险,并争取在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的较低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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

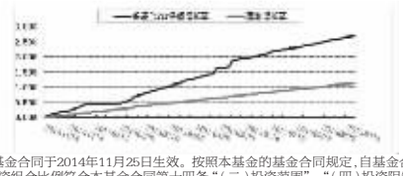
主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	2,778,737.53
2.本期利润	2,778,737.53
3.期末基金资产净值	1,476,721,116.50

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6387%	0.0056%	0.3403%	0.0000%	0.2984%	0.0056%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益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2014年11月25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三个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十四条"(二)投资范围"、"(四)投资限制"的有关约定。

§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		
魏桢	基金经理	2015-06-09	-	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、博时理财30天债券基金的基金经理。现任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。

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。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。

4.3 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第三季度,受汇率波动和央行降准双重影响,货币市场流动性维持总体宽松充裕,回购利率低位稳定。银行间R001均值1.56%,R007均值2.48%。现券市场温和普涨,收益率曲线呈现出短端上行长端下行的平坦化修正走势,10Y-1Y期限利差缩小20BP至110BP。绝对收益追逐下叠加高收益资产缺乏导致中低评级信用债收益率本季下行幅度超过高评级,因此信用利差和评级利差进一步缩窄。1年期短融收益率分别为3.3%(AAA)、3.53%(AA+)、3.84%(AA)。

三季度,本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则,以短期存款和短融为主。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内净值增长率为0.64%,同期业绩基准涨幅为0.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行抑制投机加联储加息暂缓,汇率贬值压力下降,缓解资金外流压力,信用需求疲软的情况下,有助于资金面内生性宽松。不过央行在近期开始净回笼资金,显示一旦金融风险下降后,货币政策并没有大水漫灌的倾向。从这个角度而言,当总需求超预期下行和金融风险上升时,央行一定会加大宽松力度以维持流动性稳定,但一旦恐慌情绪过后,货币政策可能还是会以调结构为取向。目前市场的主要驱动力依然是股市财富效应弱化、风险偏好下降带来的资金回流支撑。预计央行依然会"灵活运用多种货币政策工具保持适度流动性",引导货币利率低位稳定,宽松周期仍在持续。

本基金将坚持作为交易所资金流动性管理工具的定位,继续保持投资组合良好的流动性和较短的组合期限。未来一段时间,继续以存款为主要投资工具,低配短期融资券。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	470,053,644.50	30.68
	其中:债券	470,053,644.50	30.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	40,000,180.00	2.61
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,018,141,404.30	66.45
4	其他各项资产	4,072,231.76	0.27
5	合计	1,532,267,460.56	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	7.35
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	54,647,718.03	3.70
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限最大情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限没有超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	73.69	3.70
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	0.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	29.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.49	3.70

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	70,092,424.68	4.75
	其中:政策性金融债	70,092,424.68	4.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	399,961,219.82	27.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	470,053,644.50	31.83
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041562052	15东方CP002	600,000	59,962,751.33	4.06
2	150419	15农发19	600,000	59,956,008.90	4.06
3	041562043	15盐城东方CP002	500,000	50,007,948.17	3.39
4	011599636	15武钢SCP003	500,000	49,986,236.53	3.38
5	011537010	15中建材SCP010	500,000	49,950,836.20	3.38
6	041558078	15供销CP001	300,000	30,002,492.37	2.03
7	041564073	15津地铁CP001	300,000	29,997,500.15	2.03
8	041553072	15深茂业CP002	300,000	29,982,538.06	2.03
9	041562050	15物产中拓CP001	200,000	19,990,706.34	1.35
10	140432	14农发32	100,000	10,136,415.78	0.69

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	3次
报告期内偏离度的最高值	0.26%
报告期内偏离度的最低值	0.02%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.15%

注:上表中"偏离情况"根据报告期内各工作日数据计算。

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持100.00元。

5.8.2本报告期内,本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,062,565.61
4	应收申购款	-
5	其他应收款	19.01
6	待摊费用	9,647.14
7	其他	-
8	合计	4,072,231.76

5.8.5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

本报告期期初基金份额总额	2,829,470.03
报告期基金总申购份额	14,726,548.89
报告期基金总赎回份额	2,788,807.69
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	14,767,211.23

§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9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

2015年8月3日,博时基金经理过钧和张溪冈,荣获证券时报颁发的英华奖;同时,过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理,张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§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保证金实时交易型货币市场基金设立的文件

9.1.2《博时保证金实时交易型货币市场基金合同》

9.1.3《博时保证金实时交易型货币市场基金托管协议》

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报告期内博时保证金实时交易型货币市场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
二〇一五年十月二十六日

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】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:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	110,842,608.66份
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	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
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称:无
	中文名称:无
境外资产托管人	英文名称:The Bank of New York Mellon
	中文名称:纽约梅隆银行

2.1.1目标基金基本情况

基金简称	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

2.1.2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期货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。

§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

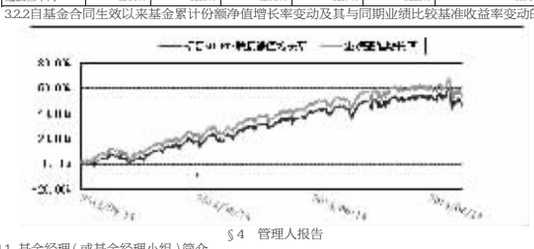
主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	1,585,857.06
2.本期利润	-4,277,413.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0364
4.期末基金资产净值	155,008,680.34
5.期末基金份额净值	1.3985

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	-2.41%	1.28%	-2.63%	1.27%	0.22%	0.01%

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



§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(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、北京欧方量子公司工作。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	2015-07-07	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 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。

4.3 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年3季度,美国宏观数据普遍向好,美国经济重拾增长动力。2季度实际GDP环比增速为3.7%,CPI稳步上升,房屋销量和个人消费支出均好于预期,失业率持续创新低、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。受加息预期以及中国经济下行风险影响,3季度标普500指数从季度初的震荡行情后大幅回调。

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,以期获得标的指数所表征的市场平均水平的投资收益。截至季末,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90%,符合基金合同要求。本基金主要采取完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪。为了减轻由于现金拖累产生的跟踪误差,本基金用少量资产投资标的指数股指期货,以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9月30日,本基金份额净值为1.1211元,累计份额净值为1.1211元,报告期内净值增长率为-2.66%,同期业绩基准涨幅为-2.80%。

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4季度,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,美联储可能年内加息。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。4季度标普500指数大概率会延续震荡走势。

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

序号	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	147,220,223.02	93.29
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	8,620,362.46	5.46
8	其他各项资产	1,966,368.68	1.25
9	合计	157,806,954.16	100.00

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	-	147,220,223.02	94.98

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.10投资组合报告附注

本基金本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	-	147,220,223.02	94.98

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

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(人民币元)
1	存出保证金	204,833.86
2	应收证券清算款	1,164,199.11
3	应收股利	-
4	应收利息	1,656.63
5	应收申购款	595,679.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,966,368.68

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

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	129,137,657.03
报告期基金总申购份额	15,747,416.99
减:报告期基金总赎回份额	34,042,465.36
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	110,842,608.66

§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9月30日,博时基金公司共管理七十一只开放式基金,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3010.43亿元人民币,其中公募基金资产规模逾1,427.53亿元人民币,累计分红超过670.72亿元人民币,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,指数股票型基金中,截至9月30日,博时裕富沪深300基金及博时深证基本面200ETF今年以来净值增长率在172只标准型股票基金中分别排名前1/2;混合基金-偏股型基金中,博时创业成长混合基金、博时卓越品牌混合(LOF)、博时医疗保健行业混合基金今年以来净值增长率在360只混合偏股基金中排名前1/2;混合基金-灵活配置型基金中,博时灵活配置混合基金今年以来收益率在103只同类基金中排名前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券LOF今年以来在15只同类封闭普通股票型基金中排名第一。在长期标准债券基金A类中,博时双月薪定期支付债券今年以来收益率在同类68只排名前1/10,博时岁岁增利一年定期开放债券、博时月月薪定期支付债券排名前1/3,博时信用债纯债A、博时安心收益定期开放债券A以及博时优势收益信用债债券基金排名前1/2;在长期标准债券基金B/C类中,博时安心收益定期开放债券C类今年以来收益率在同类47只中排名前1/3;普通债券型基金中,博时稳定价值债券A类和B类在同类88只一级A类和51只一级B类中,今年以来收益率都排名前1/5;可转债基金中,博时转债增强A今年以来收益率在同类15只排名前1/2;指数债券型中,博时上证企债30ETF在同类18只中排名前1/3;货币市场基金里,博时现金宝货币A类在同类150只中排名前1/2。

2、其他大事件

2015年8月3日,博时基金经理过钧和张溪冈,荣获证券时报颁发的英华奖;同时,过钧获得证券时报评选的三年期和五年期固定收益类-最佳基金经理,张溪冈获得证券时报评选的三年期海外投资-最佳基金经理。

§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
二〇一五年十月二十六日

博时标普500交易型开放式指数证券投资资金

【2015】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:二〇一五年十月二十六日

§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10月23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	176,819,285.00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期货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。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。
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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	3,477,548.60
2.本期利润	-5,291,273.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0291
4.期末基金资产净值	198,232,742.21
5.期末基金份额净值	1.1211

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。

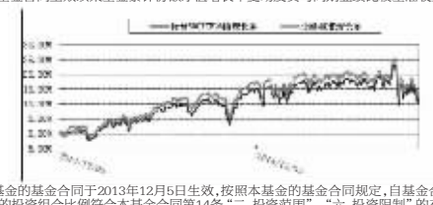
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-2.66%	1.34%	-2.80%	1.34%	0.14%	-

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2