博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书摘要

（2016年第1号）

重要提示

博时标普500指数型证券投资基金经中国证监会2012年3月5日证监许可[2012]284号文核准募集，基金合同于2012年6月14日正式生效。根据基金管理人2013年12月27日公告的《博时标普500指数型证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）、博时标普500指数型证券投资基金合同修改方案的公告》，博时标普500指数型证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”），并自应修订基金合同条款。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整，本招募说明书经中国证监会备案，但中国证监会对本招募说明书的备案，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为博时标普500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“博时标普500ETF”）的联接基金，基金份额净值会因为标普500ETF份额净值等因素产生波动。博时标普500ETF主要面临如下风险：标普500指数风险、跟踪误差风险、流动性风险、其他风险等风险。投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险主要包括：类国际市场政治、经济、社会等因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险；汇率风险；本基金特定风险等。本基金为博时标普500ETF的联接基金，主要通过投资于博时标普500ETF获取跟踪标的指数的收益，为投资人提供一种投资于美国股票市场的简单、有效方式等方面存在着联系和区别。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。

投资有风险，投资者申购基金时以认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。

基金的过往业绩不构成对基金份额持有人利益的前提下，根据环境的变化和基金实际投资的需要，有权对上述投资程序做出调整，并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

6.业绩比较基准

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％。

本基金标的指数变更的，业绩比较基准将随之变更。基金管理人可根据投资情况和市场假设调整基金业绩比较基准的组成和权重，不需另行召开基金份额持有人大会。

7.风险收益特征

本基金属于高风险/高收益品种。

8.基金管理人和基金托管人

基金管理人负责管理基金及重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。

基金托管人根据本基金合同规定，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。

本报告披露的投资组合数据截至2015年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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

2.报告期末按全市场股票投资行业分类的股票投资组合

本报告期末未持有股票投资组合。

3.报告期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末未持有股票投资组合。

4.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组合

本报告期末未持有股票投资组合。

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

本报告期末未持有债券。

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五名资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

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一名资产支持证券投资明细

本报告期末未持有资产支持证券。

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一名金融衍生品投资明细

本报告期末未持有金融衍生品。

9.报告期末投资组合数据截至2015年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	博时标普500ETF	股票型	交易型开放式	博时基金管理有限公司	147,220,223.02	94.98

10.投资组合报告附注

(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。

(2)报告期内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。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存放银证金	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

(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)报告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。

(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。

5.基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

自基金合同生效以来，基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较：

期 间	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
2012/6/14-2012/12/31	4.29%	0.70%	8.70%	0.81%	-4.41%	-0.11%
2013/1/1-2013/12/31	26.72%	0.71%	27.58%	0.71%	-0.86%	0.00%
2014/1/1-2014/12/31	12.80%	0.65%	12.74%	0.66%	0.06%	-0.01%
2015/1/1-2015/6/30	0.91%	0.77%	0.82%	0.77%	0.09%	–
2012/6/14-2015/9/30	46.80%	0.76%	53.48%	0.78%	-6.68%	-0.02%

10.基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦20层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦20层

法定代表人：张光华

成立时间：1998年7月13日

注册资本：25亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：韩强

联系电话：（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26号文批准设立，目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份45%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份10%；上海广东实业有限公司，持有股份12%；上海盛业投资投资基金有限公司，持有股份8%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份10%。注册资本25亿人民币。

公司设立了投资决策委员会、投资决策委员会负责指导基金资产的运作，确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大层级和二十七个直属部门，分别是：权益投资总监、固定收益总监以及宏观策略部、交易部、指数投资部、特定资产管理部、年金投资部、产品规划部、资管服务部、客户服务中心、国际业务部、机构业务部、战略管理部、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理和稽核法律部。

权益投资总监负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总监下设研究部、投资决策委员会、基金经理、交易部、指数投资部、特定资产管理部、年金投资部、产品规划部、资管服务部、客户服务中心、国际业务部、战略管理部、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理和稽核法律部。

固定收益总监下设固定收益投资部及相关工作。固定收益总监下设投资决策委员会、交易部、指数投资部、特定资产管理部、年金投资部、产品规划部、资管服务部、客户服务中心、国际业务部、战略管理部、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理和稽核法律部。

销售管理部负责进行市场和目标客户群管理、市场分析与策略管理、协调组织、目标机构管理、市场销售体系专业培训、战略客户管理及其大地区市场营业网络的规划和实施管理等工作。机构一、机构二、机构三、机构四分别主要负责东南区、华南地区以及其他地区区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务部负责养老金业务的管理、长期规划等工作。基金业务部负责养老金业务的投资决策、基金产品设计、业务拓展、业务管理、投资管理、风险控制、财务核算、成本控制、绩效评估、人员培训、人力资源总监管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及管理、IT系统安全及数据维护等工作。基金运作部负责业务流程管理、公司文化建设、品牌推广、公司内部管理、风险管理等工作。风险管理和稽核法律部负责风险管理、内部控制、稽核等管理职能。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察、并向公司管理层和有关机构报告情况、督促、协调有关部门进行改进。

公司设置了公司、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对狂欢、沈阳、郑州和成都人员日常代收管理和赶走京、沈阳和郑州处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止至2015年9月30日，公司总人数为416人，其中研究员和基金经理超过94%拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

（二）主要成员情况

1.基金管理人董事会成员

张光华先生，博士，董事长，历任国家外汇管理局政研室副主任，计划处处长，中国人民银行海南省分行副行长、党委委员、中国人民银行广州分行副行长、党委委书记、广东发展银行行长、党委副书记、招商银行副行长、执行董事、副董事长、党委副书记；在招商银行任职期间曾兼任本届银行副董事长、招商基金管理有限公司董事长、招商证券股份有限公司董事长、招商局国际有限公司董事长、招银金融租赁有限公司董事长、招银金融控股有限公司董事长。2015年8月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

江向阳先生，董事，2015年7月起任博时基金管理有限公司董事、总经理。1994-1997年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006年，就读于南开大学职业经济研究所，获国际金融博士学位。2015年1月至今，任招商局金融集团副总经理。博时基金管理有限公司党委副书记、历任中国证监会办公厅、证券机构监管部副处长、处长；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳证券监管专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长；中国农业工程研究设计院博士后工作站、博士后。

姜昌国先生，博士后，副董事长。1993年起任证券监管及证券行业管理工作，副总经理。曾任证券监管局副主任、证券业协会秘书长、证券业协会副秘书长、证券业协会常务副秘书长、天津证券管理办公室主任、证券业协会副秘书长、证券业协会秘书长、中国证券业协会秘书长、证券业协会副秘书长、中国证券业协会秘书长、中国证券业协会秘书长、中国证券业协会