

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

[2016]第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本基金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、完整性、及时性、合法性承担责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定,于2016年4月21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,内容真实、准确、完整,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2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:博时标普500ETF

基金简称:标普500

基金代码:613900

交易方式:交易型开放式指数基金

基金合同生效日:2013年12月6日

报告期末基金份额总额:160,819,286.00份

投资目标:紧密跟踪标的指数,追求跟踪效果和净值表现的最小化。

本基金主要投资于标的指数所包含的全部股票,本基金可适当超出证券

投资策略:为了确保由于实施差额支付产生的跟踪误差,本基金将少量资产投资跟踪一标的指数的股票期货,以达到与标的指数的跟踪误差的目标。

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:本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金及货币型基金,属于股票型基金中的高风险品种。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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)

1.本期已实现收益 231,491.70

2.本期利润 1,103,336.73

3.期末基金资产净值 208,149,034.64

4.期末基金份额净值 1.2287

注:本期已实现收益指基金利息收入、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交易基金份额的费用,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 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.48% 1.11% 0.67% 1.11% -0.19% -

3.2.2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15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本基金的基金组合比例符合本基金第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的约定。

§ 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 任期日期 离任日期 证券从业年限 说明

万晓 基金经理 2015-10-08 - 9.1 2004年起先后在中航工业动力科技股份有限公司任职,实习基金经理工作,2011年加入博时基金管理有限公司,现任基金经理。担任时间上超过10年。

4.2对报告期内本基金运作合规性说明

在报告期内,本基金代理人严格遵循了《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运用基金资产,为持有人谋求最大利益。本基金报告期内,基金管理公司符合有关法规和基金合同的规定,没有损害持有人利益的行为。

4.3公平交易制度的执行情况说明

在报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易制度。

4.4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报告期内本基金的投票权使用说明

4.6报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.7报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.8报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.9报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.10报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.11报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.12报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.13报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.14报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.15报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.16报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.17报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.18报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.19报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.20报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.21报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.22报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.23报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.24报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.25报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.26报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.27报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.28报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.29报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.30报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.31报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.32报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.33报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.34报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.35报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.36报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.37报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.38报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.39报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.40报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.41报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.42报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.43报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.44报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.45报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.46报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.47报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.48报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.49报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.50报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.51报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.52报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.53报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.54报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.55报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.56报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.57报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.58报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.59报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.60报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.61报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.62报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.63报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.64报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.65报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.66报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.67报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.68报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.69报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.70报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.71报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.72报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.73报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.74报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.75报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.76报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.77报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.78报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.79报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.80报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.81报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.82报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.83报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.84报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.85报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.86报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.87报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.88报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.89报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.90报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.91报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.92报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.93报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.94报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.95报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.96报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.97报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.98报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.99报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.10报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.11报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.12报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.13报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.14报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.15报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.16报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.17报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.18报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.19报告期内本基金的投票权使用情况说明

4.20报告期内本基金的投票权使用情况说明</p