博时标普500交易型开放式指数证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十九日

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个别及连带的法律责任。本半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2018年8月28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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018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
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
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
报告期末基金份额总额	293,819,285.00份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 基金产品说明

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。

2.3 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
信息披露负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@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	英文	–	Brown Brothers Harriman Co.
	中文	–	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		–	–
办公地址		–	–
邮政编码		–	–

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	6,934,944.77
本期利润	13,748,505.30
加权平均基金份额本期利润	0.0481
本期基金份额净值增长率	3.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2313
期末基金资产净值	490,716,769.58
期末基金份额净值	1.6701

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 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①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.55%	0.59%	3.75%	0.59%	-0.20%	–
过去三个月	8.27%	0.78%	8.68%	0.78%	-0.41%	–
过去六个月	3.03%	1.08%	3.65%	1.09%	-0.62%	-0.01%
过去一年	9.94%	0.83%	11.06%	0.83%	-1.12%	–
过去三年	45.01%	0.86%	48.95%	0.87%	-3.94%	-0.01%
过去五年	67.01%	0.81%	74.82%	0.82%	-7.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	67.01%	0.81%	74.82%	0.82%	-7.81%	-0.01%

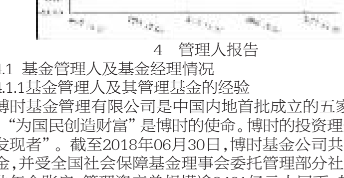
注:本基金的业绩比较基准为:标普500指数(S&P 500 Index(NTR,Net total Return))(经估值汇率调整,以人民币计价)

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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

博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年12月5日至2018年6月30日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

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2018年06月30日,博时基金公司共管理185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,管理资产总规模逾8461亿元人民币,其中非货币公募基金规模逾1947亿元人民币,累计分红逾872亿元人民币,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,截至2018年2季末:

权益基金方面,标准指数股票型基金里,博时中证银联智惠大数据100指数(A类)、博时裕富沪深300指数(A类)等今年以来净值增长率同类排名为前1/4;股票型分级子基金里,博时中证银行分级指数(B级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前1/3;混合偏股型基金中, 博时创业成长混合(C类)今年以来净值增长率同类基金排名第一,博时创业成长混合(A类) 今年以来净值增长率同类基金排名位居前1/10,博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前1/3; 混合灵活配置型基金中,博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为3.14%,在166只同类基金排名第6, 博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为4.38% ,同类基金排名位居前1/10,博时新价值灵活配置混合(A类)、博时新策略灵活配置混合(A类)、博时新起点灵活配置混合(A类)、博时新起点灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率分别为2.12%、1.93%、1.65%、1.60%,同类基金排名均位居前1/8,博时新价值灵活配置混合(C类)今年以来净值增长率为2.07%,同类基金中排名位于前1/6。

黄金基金类,博时黄金ETF联接(A类)、博时黄金ETF联接(C类)今年以来净值增长率同类排名第一。

固收方面,长期标准债券型基金中,博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率为5.11%、4.56%、4.54%,同类219只基金中分别排名第3、第8、第9位,博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)、博时信用债券(C类)、博时宏观回报债券(C类)今年以来净值增长率分别为4.88%、4.56%、4.34%、4.23%,同类153只基金中分别排名第2、第4、第7、第8位,博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%,同类排名前1/10;货币基金类,博时兴荣货币、博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率分别为2.21%、2.18%,在315只同类基金排名中位列第15位与第24位。

QDII基金方面,博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类),今年以来净值增长率同类排名分别位于前1/5、1/4。

2、其他大事件

2018年6月8日,由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届"中国基金业金牛奖"颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选,博时基金获得"2017年度最受信赖金牛基金公司"荣誉称号。

2018年5月24日,由《中国基金报》、《证券时报》主办的"第五届中国基金业英华奖、中国基金业20年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛"在深圳隆重举行。从业经历逾23年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获"中国基金业20年最佳基金经理"殊荣,此荣誉于全行业仅有20人获评;博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺"三年期纯债投资最佳基金经理"称号。值得一提的是,这也是陈凯杨继2016年之后连续两年蝉联该项殊荣, 足见市场对其管理业绩的认可。

2018年5月23日,由新浪财经和济安金信主办的"致敬公募20年"颁奖典礼在北京举行,公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获"最佳资产管理公司"、"最受投资者欢迎基金公司"、"行业特别贡献奖"和"区域影响力奖-珠三角"这四项最具份量的公司大奖;博时基金总经理江向阳获得"行业领军人物奖"。同时,博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金(000277)获得"最具价值理念基金产品奖-债券型", 博时亚洲票息收益债券 (QDII)(人民币050030:, 美元现汇:050202,美元现钞:050203)获得"最具投资价值基金产品奖-QDII"。

2018年5月17日,被誉为"证券期货行业科学技术领域最高荣誉"的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出, 一举夺得二等奖 (DevOps统一研发平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合业务接入平台)三项大奖,成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018年5月10日,由《上海证券报》主办的"2018中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼"在上海举行。在此次颁奖典礼上,博时基金摘得"金基金TOP基金公司"这一最具份量的公司大奖;博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评 "金基金最佳投资回报基金经理奖"。在第15届金基金奖评选中,旗下价值投资典范产品博时主题行业(160505)获得"三年期金基金分红奖"。

2018年3月26日, 第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募"老五家"之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的 "中国基金业20年卓越贡献公司" 大奖。同时, 旗下绩优产品博时主题行业混合(LOF)(160505)荣获"2017年度开放式混合型金牛基金"奖;博时信用债纯债债券(050027)荣获"三年期开放式债券型持续优胜金牛基金"奖。

2018年3月22日,由中国基金报、香山财富论坛主办的"第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金20周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼"在北京举办,本次评选中,博时基金一举斩获本届"20周年特别评选"中最具分量的两项公司级大奖——公募基金20年"十大最佳基金管理人"奖和"最佳固定收益基金管理人"奖,同时,旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将"最佳回报混合型基金"奖和"最佳回报债券型基金(二级债)"奖双双收入囊中,博时聚润纯债债券则获得"2017年度普通债券型明星基金"奖。

2018年2月2日,由金融界举办"第二届智能金融国际论坛" 暨第六届金融界"领航中国"年度盛典在南京举办,此次论坛以"安全与创新" 为主题, 邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获"五年期投资回报基金管理公司奖"和"杰出品牌影响力奖"两项大奖。

2018年1月11日,由中国基金报主办的"中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业20年最佳创新产品奖颁奖典礼"在上海举办。博时基金一举摘得"十大产品创新基金公司奖",旗下产品博时主题行业混合基金(160505)和博时黄金ETF分别获得"最佳主动权益创新产品奖"和"最佳互联网创新产品奖",成为当天最大赢家之一。

2018年1月9日, 由信息时报主办的 "第六届信息时报金狮奖——2017年度金融行业风云榜颁奖典礼"在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获"年度最具影响力基金公司"大奖。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
汪洋	指数与量化投资部副总经理/基金经理	2016-05-16	–	9.1	2009年起先后在华泰联合证券、华泰柏瑞基金、汇添富基金工作。2015年加入博时基金管理有限公司,历任指数投资部总经理助理、指数投资部副总经理。现任指数与量化投资部副总经理兼博时标普500ETF基金(2016.5.16-至今)、博时标普500ETF联接(QDII)基金(2016.5.16-至今)、博时上证50ETF基金(2016.5.16-至今)、博时上证50ETF联接基金(2016.5.16-至今)的基金经理。
万琼	基金经理	2015-10-08	–	11.3	2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金,历任投资助理、基金经理助理。现任博时上证超大盘ETF基金(2015.6.8-至今)、博时上证超大盘ETF联接基金(2015.6.8-至今)、博时上证自然资源ETF基金(2015.6.8-至今)、博时上证自然资源ETF联接基金(2015.6.8-至今)、博时标普500ETF基金(2015.10.8-至今)、博时标普500ETF联接(QDII)基金(2015.10.8-至今)、博时富时中国A股指数基金(2017.9.29-至今)的基金经理。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,美国经济增长力度依然强劲。经济基本面方面,美国2季度实际GDP年化环比增速为4.1%, 创2014年年中以来最高增速,但略低于预期值4.2%。此前由于季节性、飓风扰动推高去年四季度基数等原因,美国一季度GDP增速较低,因此市场普遍预期二季度GDP增速将出现明显反弹。得益于税改提振消费,使得消费者支出强劲反弹,同时叠加贸易战下的提前出口,支撑着美国二季度GDP创出新高。受较低的税收及强劲的劳动力市场影响,占美国经济活动主体的消费者支出增长4%,并为GDP贡献了2.7个百分点。此外,美国就业数据表现强劲,劳动力市场基本达到充分就业。政策方面, 美联储在3月,6月两度加息,FOMC上调基准利率至1.75%-2%,2018年年内或仍有2次加息,加息预期相比年初有所调高。中美贸易摩擦仍然在持续,短期内对美国经济影响不大。在报告期内,标普500指数波动加剧,指数涨跌幅为1.15%。

本基金主要投资于标普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2018年06月30日,本基金基金份额净值为1.6701元,份额累计净值为1.6701元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为3.03%,同期业绩基准增长率3.65%。

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2018年下半年, 美国经济仍处强劲扩张期, 或将迎来增长峰值。企业投资强劲,通胀率和就业率均保持在低位,就业市场表现强劲。叠加财政政策助力,经济强劲增长的格局仍将持续。对于美国经济过热的预期会导致美联储进一步加息,进而推动美元走强。美元指数在短期内仍可能保持较强的状态。主要的风险点仍然是中美贸易摩擦升级对全球经济与金融市场的冲击。此外,我们也需要关注2018年下半年将进行的中期选举。

在投资策略上,博时标普500ETF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为投资人提供长期配置的良好投资工具。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了博时基金管理有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序; 确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对博时标普500交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,博时标普500交易型开放式指数证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时标普500交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,博时标普500交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时标普500交易型开放式指数证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:	–	–
银行存款	17,452,391.91	37,214,227.76
结算备付金	2,943,322.79	3,652,741.07
存出保证金	815,165.12	969,446.58
交易性金融资产	471,085,157.59	429,085,095.46
其中:股票投资	471,085,157.59	429,085,095.46
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	–
应收利息	3,398.27	6,270.50
应收股利	346,446.17	367,063.79
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	8,870.39	–
资产总计	492,654,752.24	471,294,845.16
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:	–	–
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	–	12,665,002.47
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	236,278.95	219,051.97
应付托管费	98,449.53	91,271.65
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	–	–
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	1,603,254.18	1,498,041.09
负债合计	1,937,982.66	14,473,367.18
所有者权益:	–	–
实收基金	293,819,285.00	281,819,285.00
未分配利润	196,897,484.58	175,002,192.98
所有者权益合计	490,716,769.58	456,821,477.98
负债和所有者权益总计	492,654,752.24	471,294,845.16

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.6701元,基金份额总额293,819,285.00份。

6.2 利润表

会计主体:博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	16,249,412.11	22,404,114.89
1.利息收入	50,066.08	68,508.82
其中:存款利息收入	50,066.08	39,731.05
债券利息收入	–	–
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	28,777.77
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	10,042,100.31	6,396,669.43
其中:股票投资收益	4,787,531.63	1,071,145.54
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	1,460,676.74	2,083,534.15
股利收益	3,793,891.94	3,241,989.74
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6,813,560.53	16,413,229.77
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-130,814.13	-655,338.41
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-525,500.68	181,045.28
减:二、费用	2,500,906.81	2,147,747.69
1. 管理人报酬	1,364,522.22	1,103,808.99
2. 托管费	568,550.91	459,920.45
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	26,688.48	38,878.94
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	536,415.00	545,139.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	13,748,505.30	20,256,367.20
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	13,748,505.30	20,256,367.20

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时标普500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	281,819,285.00	175,002,192.98	456,821,477.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	13,748,505.30	13,748,505.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	12,000,000.00	8,146,786.30	20,146,786.30
其中:1.基金申购款	55,000,000.00	33,865,456.95	88,865,456.95
2.基金赎回款	-43,000,000.00	-25,718,670.65	-68,718,670.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	293,819,285.00	196,897,484.58	490,716,769.58
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	184,819,285.00	80,276,240.08	265,095,525.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	20,256,367.20	20,256,367.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	69,000,000.00	31,230,236.24	100,230,236.24
其中:1.基金申购款	74,000,000.00	33,694,922.21	107,694,922.21
2.基金赎回款	-5,000,000.00	-2,464,685.97	-7,464,685.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	253,819,285.00	131,762,843.52	385,582,128.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:江向阳,主管会计工作负责人:王德英,会计机构负责人:成江

6.4 报表附注

6.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、沪府发[2011]2号《上海市人民政府关于本市开征地方教育附加的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及 金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入和利息收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.3关联方关系

6.4.3.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司("博时基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("工商银行")	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金("标普500ETF联接基金")	基金管理人管理的其他基金

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.4.2关联方报酬

6.4.4.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,364,522.22	1,103,808.99
其中:支付销售机构的客户维护费	–	–

注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	568,550.91	459,920.45

注: 支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
博时标普500ETF联接	205,232,860.00	69.85%	183,549,860.00	65.13%

6.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
工商银行	16,587,656.08	50,052.65	4,583,325.85	26,179.07
布朗兄弟哈里曼银行	864,735.83	–	12,880,133.12	–

注:本基金的银行存款分别由基金托管人工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管,按适用利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.5期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2交易所市场债券正回购

无。

6.4.6有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层次:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层次:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 471,085,157.59元,无属于第二层次和第三层次的余额。(2017年12月31日:第一层次余额为429,085,095.46元,无属于第二层次和第三层次的余额。)

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	471,085,157.59	95.62
	其中:普通股	457,935,380.16	92.95
	存托凭证	–	–
	优先股	–	–
	房地产信托凭证	13,149,777.43	2.67
2	基金投资	–	–
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	20,395,714.70	4.14
8	其他各项资产	1,173,879.95	0.24
9	合计	492,654,752.24	100.00

注:于2018年6月30日,本基金还持有衍生金融工具,具体信息请参考附注6.4.3.3。

7.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	471,085,157.59	96.00
合计	471,085,157.59	96.00

7.3期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
能源	29,848,122.04	6.08
原材料	12,295,909.47	2.51
工业	44,798,166.35	9.13
非日常生活消费品	60,845,685.74	12.40
日常消费品	32,799,541.95	6.68
医疗保健	66,263,100.97	13.50
金融	65,192,450.59	13.29
信息技术	122,312,216.36	24.93
电信业务	9,397,548.97	1.92
公用事业	13,887,609.08	2.83
房地产	13,444,806.07	2.74
合计	471,085,157.59	96.00

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)

7.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号	公司名称	公司名称	证券	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	–	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	15,197.00	18,613,267.76	3.79
2	MICROSOFT CORP	–	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	23,756.00	15,499,909.27	3.16
3	AMAZON.COM INC	–	AMZN US	纳斯达克交易所	美国	1,245.00	14,002,386.37	2.85
4	GOOGLE INC-CL C	–	GOOG US	纳斯达克交易所	美国	938.00	6,924,137.58	1.41
	GOOGLE INC-CL A	–	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	923.00	6,896,100.87	1.41
5	FACEBOOK INC-A	–	FB US	纳斯达克交易所	美国	7,416.00	9,535,030.87	1.94
6	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	–	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	5,951.00	7,349,415.91	1.50
7	JPMORGAN CHASE & CO	–	JPM US	纽约证券交易所	美国	10,527.00	7,257,837.20	1.48
8	EXXON MOBIL CORP	–	XOM US	纽约证券交易所	美国	13,091.00	7,165,899.74	1.46
9	JOHNSON & JOHNSON	–	JNJ US	纽约证券交易所	美国	8,293.00	6,658,103.42	1.36
10	BANK OF AMERICA CORP	–	BAC US	纽约证券交易所	美国	29,156.00	5,438,234.09	1.11

注:所用证券代码采用当地市场代码。

7.5报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	AT&T INC	T US	1,951,085.98	0.43
2	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,724,645.87	0.38
3	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	863,121.31	0.19
	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	834,030.37	0.18
4	APPLE INC	AAPL US	1,680,376.30	0.37
5	AMAZON.COM INC	AMZN US	1,603,208.93	0.35
6	FACEBOOK INC-A	FB US	1,124,434.86	0.25
7	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	966,551.97	0.21
8	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	873,191.77	0.19
9	EXXON MOBIL CORP	XOM US	837,883.46	0.18
10	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	821,928.86	0.18
11	DOWDUPONT INC	DWDP US	697,448.68	0.15
12	CHEVRON CORP	CVX US	604,649.57	0.13
13	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	598,579.80	0.13
14	TWITTER INC	TWTR US	584,556.84	0.13
15	WELLS FARGO & CO	WFC US	579,172.49	0.13
16	INTEL CORP	INTC US	566,766.03	0.12
17	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	554,406.86	0.12
18	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	519,823.95	0.11
19	HOME DEPOT INC	HD US	495,376.44	0.11
20	BECTON DICKINSON AND CO	BDX US	493,865.24	0.11

注:"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	TIME WARNER INC	TWX US	1,576,588.94	0.35
2	MONSANTO CO	MON US	1,143,514.11	0.25
3	APPLE INC	AAPL US	1,137,943.63	0.25
4	AT&T INC	T US	881,823.24	0.19
5	MICROSOFT CORP	MSFT US	757,112.46	0.17
6	DOWDUPONT INC	DWDP US	740,510.68	0.16
7	ALPHABET INC-CL C	GOOG US	344,287.95	0.08
	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	339,731.38	0.07
8	AMAZON.COM INC	AMZN US	597,796.84	0.13
9	FACEBOOK INC-A	FB US	467,051.39	0.10
10	CR BARD INC	BCR US	452,357.18	0.10
11	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	428,414.56	0.09
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BRK/B US	421,009.26	0.09
13	ABBVIE INC	ABBV US	412,424.60	0.09
14	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	387,007.38	0.08
15	EXXON MOBIL CORP	XOM US	361,823.81	0.08
16	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	347,298.55	0.08
17	AMGEN INC	AMGN US	303,570.02	0.07
18	WELLS FARGO & CO	WFC US	278,458.50	0.06
19	CISCO SYSTEMS INC	CSCO US	277,859.77	0.06
20	CITIGROUP INC	C US	277,368.09	0.06

注:"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	62,776,494.89
卖出收入(成交)总额	33,044,071.71

注:"买入成交总金额"、" 卖出成交总金额"按买入、卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7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。

7.8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。

7.9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

金额单位:人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	期货投资	S&P500 EMINI FUT Sep18	-472,971.11	-0.10

7.10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

本基金本期末未持有基金投资。

7.11投资组合报告附注

7.11.1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.

7.11.2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。

7.11.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	815,165.12
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	346,446.17
4	应收利息	3,398.27
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	8,870.39
9	合计	1,173,879.95

7.11.4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。

7.11.5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。

7.11.6投资组合报告附注的其他需要说明的事项

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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例	博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金 持有份额	博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金 占总份额比例
4,557	64,476.47	13,574,386.00	4.62%	75,012,039.00	25.53%	205,232,860.00	69.85%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	安湘娟	2,510,800.00	0.85%
2	中国平安人寿保险股份有限公司-传统-银保账户	2,361,400.00	0.80%
3	杨巧伟	1,981,200.00	0.67%
4	上海培蓝股权投资基金管理有限公司-培蓝价值1号私募证券投资基金	1,528,000.00	0.52%
5	来立波	1,500,000.00	0.51%
	鲁利玲	1,500,000.00	0.51%
7	长江证券-招商银行-长江证券超越理财基金管家II集合资产管理计划	1,281,900.00	0.44%
8	北京彼立弗投资管理有限公司-彼立弗复利一期私募证券投资基金	1,209,300.00	0.41%
9	广发证券股份有限公司	1,057,091.00	0.36%
10	钱韶红	1,052,100.00	0.36%
	标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	205,232,860.00	69.85%

注:前十名持有人为除博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	–	–

注:本公司所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	–
本基金基金经理持有本开放式基金	–

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;

2、本基金的基金经理未持有本基金。

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年12月5日)基金份额总额	565,043,200.00
本报告期期初基金份额总额	281,819,285.00
本报告期基金总申购份额	55,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	43,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	293,819,285.00

10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
Morgan Stanley Asia Limited	–	48,589,095.29	53.09%	13,288.42	53.53%	–
CICC	–	42,925,290.15	46.91%	11,536.63	46.47%	–

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,在多家券商开立了券商交易账户。

1、基金券商交易账户的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金券商交易账户的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构;

(2)基金管理人在被选中的证券经营机构开立交易账户。

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2018年1月1日至2018年6月30日	183,549,860.00	42,783,000.00	21,100,000.00	205,232,860.00	69.85%

产品特有风险

本报告期内,本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况,当该基金份额持有人选择大比例赎回时,可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时,存在一定的流动性风险;为应对巨额赎回而进行投资标的变现时,可能存在仓位调整困难,甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理,但当基金出现巨额赎回并被全部确认时,申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险, 未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况,根据基金合同相关约定,该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会,并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估,充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下,当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

本报告期内,本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况,当该基金份额持有人选择大比例赎回时,可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时,存在一定的流动性风险;为应对巨额赎回而进行投资标的变现时,可能存在仓位调整困难,甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理,但当基金出现巨额赎回并被全部确认时,申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险, 未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况,根据基金合同相关约定,该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会,并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估,充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下,当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外, 当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时, 本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

博时基金管理有限公司

二〇一八年八月二十九日