

# 博时上证超级大盘交易型开放式指数证券

## 投资基金联接基金摘要

2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

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：二〇一五年八月二十七日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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 2015 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	博时上证超大盘 ETF 联接
基金主代码	050013
交易代码	050013
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金
基金合同生效日	2009 年 12 月 29 日
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
报告期末基金份额总额	291, 579, 962. 13 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510020
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2009 年 12 月 29 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010 年 3 月 19 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	中国建设银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即上证超级大盘指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金，标的指数即上证超级大盘指数成份股和备选成份股等，新股、债券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，紧密跟踪标的指数的表现，以期获得标的指数所表征的市场组合所代表的市场平均水平的投资收益。
业绩比较基准	上证超级大盘指数收益率 X95%+银行活期存款税后利率 X5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪上证超级大盘指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

#### 2.2.1 目标基金产品说明

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，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。
业绩比较基准	上证超级大盘指数（价格指数）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于高风险高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证超级大盘指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	70,886,243.30
本期利润	115,945,750.49
加权平均基金份额本期利润	0.2046
本期基金份额净值增长率	15.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1407
期末基金资产净值	292,013,405.26
期末基金份额净值	1.0015

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	-10.11%	3.21%	-10.11%	3.18%	0.00%	0.03%
过去三个月	7.17%	2.59%	7.07%	2.54%	0.10%	0.05%
过去六个月	15.79%	2.26%	15.84%	2.23%	-0.05%	0.03%
过去一年	80.06%	1.83%	79.27%	1.81%	0.79%	0.02%
过去三年	47.21%	1.50%	41.43%	1.49%	5.78%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.15%	1.40%	-4.82%	1.40%	4.97%	0.00%

注：本基金的业绩比较基准：上证超级大盘指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日

连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 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



注：本基金的基金合同于 2009 年 12 月 29 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 3 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“（二）投资范围”、“（七）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合同约定。

## § 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 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、博时信用债纯债券今年以来收益率在 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 1 月 7 日，博时基金在 2014 年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

2015 年 1 月 15 日，在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中，博时基金获评第十二届中国财经风云榜“年度十大品牌基金公司”奖。

2015 年 1 月 18 日，博时基金（香港）在和讯财经风云榜海外评选中荣获“最佳中资基金公司”奖。

2015 年 1 月 21 日，在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中，博时转债增强荣获第八届金蝉奖“2014 最佳年度债基品牌奖”。

2015 年 3 月 28 日，在第十二届中国基金业金牛奖评选中，博时主题行业（LOF）基金、博时信用债券基金分别获得“2014 年度开放式股票型金牛基金”奖、“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2015 年 3 月 28 日，在中金在线主办的“2014 年度财经排行榜”评选中，邓欣雨获评“2014 年度中金在线财经排行榜最佳基金经理”。

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。

### 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万琼	基金经理	2015-06-08	-	8	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、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 联接基金的基金经理。

方维玲	指数投资部副总经理 / 基金经理	2012-11-13	—	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、北京玖方量子子公司工作。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。
万琼	基金经理助理	2013-09-01	2015-06-08	8	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、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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，中国宏观经济继续处在弱势寻底阶段，宏观经济数据有底部企稳迹象显现，汇丰 PMI 弱改善，地产销量转暖，但电力等工业品价格仍在下降通道。从流动性方面来看，上半年货币政策持续宽松，央行多次降准降息。6 月份前，各股指屡创新高，以创业板为代表的新兴成长股票，互联网、电子、计算机等行业股票涨幅较大，而以沪深 300 为代表的大盘蓝筹股涨幅较小。6 月份，受监管规范两融、场外配资融资等政策的影响，市场出现大幅调整，主要股指大幅下跌。整个季度市场走势呈现先扬后抑，季末加速下跌的势态。

本基金主要投资于上证超大盘交易型开放式指数证券投资基金，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%的资产都投资于上证超大盘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%。

##### 4.4.2 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 1.0015 元，累计份额净值为 1.0015 元，报告期内净值增长率为 15.79%，同期业绩基准涨幅为 15.84%。

#### 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 年下半年，从宏观经济角度来看，尽管几大重要指标数据显示经济仍在底部，但是有望逐步实现企稳。预计财政政策将作为更重要的调控工具，改革推进整体方向不变。海外方面，美联储仍有预期在 9 月启动加息，届时国内资金或将面临外流压力，因而 3 季度货币政策仍然可能进一步放松。股票市场将呈现震荡调整的格局，但是下行风险有限。部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值。

在投资策略上，超大盘联接基金作为一只被动的指数基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，通过投资于超大盘 ETF 紧密跟踪上证超大盘指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长，希望通过超大盘联接基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

#### 4.6 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。

#### **4.7 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。

#### **4.8 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查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。

## § 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：博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	5,481,631.84	28,581,415.67
结算备付金	-	37,033.36
存出保证金	121,088.07	23,812.11
交易性金融资产	289,337,955.85	641,830,890.40
其中：股票投资	-	-
基金投资	278,783,846.05	632,760,154.00
债券投资	10,554,109.80	9,070,736.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	655,691.37	575.94
应收利息	326,670.22	163,371.44
应收股利	-	-
应收申购款	1,209,307.14	2,728,078.47
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>297,132,344.49</b>	<b>673,365,177.39</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>	-	-
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	-	3,455,240.16
应付赎回款	4,687,716.25	4,931,379.67
应付管理人报酬	6,103.19	11,607.60
应付托管费	1,220.67	2,321.54
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	242,747.48	43,419.23
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	181,151.64	58,229.17
<b>负债合计</b>	<b>5,118,939.23</b>	<b>8,502,197.37</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-

实收基金	291,579,962.13	768,752,723.55
未分配利润	433,443.13	-103,889,743.53
<b>所有者权益合计</b>	<b>292,013,405.26</b>	<b>664,862,980.02</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>297,132,344.49</b>	<b>673,365,177.39</b>

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0015 元，基金份额总额 291,579,962.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>117,058,990.56</b>	<b>-25,493,516.11</b>
1. 利息收入	219,474.92	172,356.12
其中：存款利息收入	61,414.93	77,521.47
债券利息收入	158,059.99	94,834.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	71,467,324.64	-23,462,476.18
其中：股票投资收益	-1,028,263.16	-88,415.15
基金投资收益	72,467,719.42	-23,393,878.83
债券投资收益	-4,150.90	19,817.80
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	32,019.28	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	45,059,507.19	-2,217,062.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	312,683.81	13,666.04
<b>减：二、费用</b>	<b>1,113,240.07</b>	<b>326,804.57</b>
1. 管理人报酬	56,513.47	66,431.11
2. 托管费	11,302.68	13,286.20
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	862,256.35	71,562.89
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	183,167.57	175,524.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>115,945,750.49</b>	<b>-25,820,320.68</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>115,945,750.49</b>	<b>-25,820,320.68</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	768,752,723.55	-103,889,743.53	664,862,980.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	115,945,750.49	115,945,750.49
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）	-477,172,761.42	-11,622,563.83	-488,795,325.25
其中：1. 基金申购款	225,707,063.59	11,799,911.02	237,506,974.61
2. 基金赎回款	-702,879,825.01	-23,422,474.85	-726,302,299.86
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）	291,579,962.13	433,443.13	292,013,405.26
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,018,780,389.07	-426,471,416.21	592,308,972.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-25,820,320.68	-25,820,320.68
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）	-74,456,926.80	33,239,291.31	-41,217,635.49
其中：1. 基金申购款	28,131,175.95	-12,379,498.95	15,751,677.00
2. 基金赎回款	-102,588,102.75	45,618,790.26	-56,969,312.49
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）	944,323,462.27	-419,052,445.58	525,271,016.69

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

除以下会计估计变更外，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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

### 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、基金注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的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

##### 6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	473,930,534.61	100.00%	37,805,893.85	100.00%

##### 6.4.4.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	336,117.67	100.00%	242,747.48	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	26,828.28	100.00%	11,462.68	100.00%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,513.47	66,431.11
其中：支付销售机构的客户维护费	369,980.87	364,253.74

注：1. 本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人博时基金管理有限公司

司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数, 则取零)的 0.5% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) X 0.5% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议, 客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

#### 6.4.4.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,302.68	13,286.20

注: 本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费, 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数, 则取零)的 0.1% 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 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) X 0.1% / 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

无。

#### 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	5,481,631.84	60,407.31	10,249,631.23	77,233.35

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 按银行同业利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内, 本基金在承销期内未买入关联方所承销的证券(2014年可比期间: 同)。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

于 2015 年 6 月 30 日, 本基金持有 102,648,789.00 份目标 ETF 基金份额, 占其总份额的比例为 77.97% (于 2014 年 12 月 31 日, 本基金持有 272,530,000.00 份目标 ETF 基金份额,

占其总份额的比例为 80.79%。)

#### 6.4.5 期末（2015 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。

## § 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	278,783,846.05	93.82
3	固定收益投资	10,554,109.80	3.55
	其中：债券	10,554,109.80	3.55
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,481,631.84	1.84
8	其他各项资产	2,312,756.80	0.78
9	合计	297,132,344.49	100.00

### 7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金	股票指数型	交易型开放式指数基金	博时基金管理有限公司	278,783,846.05	95.47



### 7.3 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。

### 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股票投资明细

报告期末本基金未持有股票。

### 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 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	1,372,766.17	0.21
2	600637	东方明珠	1,069,935.00	0.16
3	601668	中国建筑	1,066,035.00	0.16
4	601989	中国重工	996,689.00	0.15
5	600010	包钢股份	979,696.00	0.15
6	601318	中国平安	937,777.00	0.14
7	600050	中国联通	935,998.00	0.14
8	600887	伊利股份	808,400.00	0.12
9	601166	兴业银行	798,811.00	0.12
10	600030	中信证券	765,951.00	0.12
11	600000	浦发银行	746,782.00	0.11
12	600256	广汇能源	716,711.00	0.11
13	600028	中国石化	709,023.00	0.11
14	600036	招商银行	677,151.00	0.10
15	600585	海螺水泥	675,040.00	0.10
16	600111	北方稀土	662,099.00	0.10
17	600016	民生银行	628,492.00	0.09
18	600196	复星医药	604,850.00	0.09
19	600104	上汽集团	597,413.00	0.09
20	600018	上港集团	431,850.00	0.06

注：本项“买入股票成本”按买卖成交金额（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 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	39,182,905.56	5.89
2	601668	中国建筑	30,049,527.26	4.52
3	600010	包钢股份	28,190,195.25	4.24
4	601318	中国平安	28,083,282.51	4.22
5	601989	中国重工	27,933,418.98	4.20
6	600050	中国联通	26,078,076.86	3.92
7	600887	伊利股份	23,914,109.16	3.60
8	600637	东方明珠	22,886,890.18	3.44
9	600030	中信证券	22,212,840.84	3.34
10	601166	兴业银行	21,986,192.65	3.31
11	600028	中国石化	21,820,920.50	3.28

12	600111	北方稀土	21,526,414.14	3.24
13	600585	海螺水泥	20,304,660.22	3.05
14	600016	民生银行	19,451,855.47	2.93
15	600000	浦发银行	18,997,227.61	2.86
16	600036	招商银行	18,952,749.91	2.85
17	600104	上汽集团	17,629,945.32	2.65
18	600196	复星医药	16,796,659.84	2.53
19	600256	广汇能源	15,425,532.15	2.32
20	600018	上港集团	14,221,889.03	2.14

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

### 7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	16,181,469.17
卖出股票的收入（成交）总额	457,749,065.44

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	10,554,109.80	3.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,554,109.80	3.61

### 7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019414	14 国债 14	85,000	8,503,400.00	2.91
2	019506	15 国债 06	10,000	1,011,100.00	0.35
3	019217	12 国债 17	10,000	1,002,500.00	0.34
4	010603	06 国债(3)	300	30,093.00	0.01
5	019418	14 国债 18	70	7,016.80	0.00

### 7.8 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 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。

### 7.10 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持有股指期货。

### 7.11 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持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	121,088.07
2	应收证券清算款	655,691.37
3	应收股利	-
4	应收利息	326,670.22
5	应收申购款	1,209,307.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,312,756.80

#### 7.12.4 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可转换债券。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额

					比例
10,566.00	27,596.06	6,827,712.61	2.34%	284,752,249.52	97.66%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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	11,129.78	0.00%

### 8.3 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（2009年12月29日）基金份额总额	1,906,351,367.48
本报告期期初基金份额总额	768,752,723.55
本报告期基金总申购份额	225,707,063.59
减：本报告期基金总赎回份额	702,879,825.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	291,579,962.13

## § 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

1、基金管理人于 2015 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴姚东不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英代任总经理职务。2、基金管理人于 2015 年 6 月 20 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫担任博时基金管理有限公司副总经理职务。3、基金管理人于 2015 年 7 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，江向阳担任博时基金管理有限公司总经理职务。4、基金管理人于 2015 年 8 月 8 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人，洪小源不再任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

本报告期内无涉及基金托管人的重大人事变动。

### 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

2015 年 2 月，我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求公司对后台权限设置等问题进行改正，我司立即进行了改正并已经完成了验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	473,930,534.61	100.00%	336,117.67	100.00%	-

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，本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，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (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；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、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

博时基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十七日