

# 上证超级大盘交易型开放式指数证券投资 基金

**2021 年第 4 季度报告**

**2021 年 12 月 31 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：二〇二二年一月二十四日

## §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 2022 年 1 月 20 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时上证超大盘 ETF
场内简称	超大盘 ETF
基金主代码	510020
交易代码	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
报告期末基金份额总额	34,148,002.00 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最小化。
投资策略	<p>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。但因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。</p> <p>本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%。</p> <p>在法律法规允许的情况下，基金管理人在履行相应程序后可以使用相关金融衍生工具，以更好地实现基金的投资目标。但基金管理人使用相关金融衍生工具必须是以提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差等为目的，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数，即上证超级大盘指数。该指数属于价格指数。

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。
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 (2021年10月1日-2021年12月31日)
1.本期已实现收益	287,974.04
2.本期利润	1,812,855.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0521
4.期末基金资产净值	119,235,010.60
5.期末基金份额净值	3.4917

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。

所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	1.45%	0.83%	1.66%	0.86%	-0.21%	-0.03%
过去六个月	-4.53%	1.05%	-5.59%	1.08%	1.06%	-0.03%
过去一年	-7.35%	1.11%	-9.37%	1.13%	2.02%	-0.02%
过去三年	47.14%	1.20%	28.88%	1.22%	18.26%	-0.02%
过去五年	49.15%	1.11%	22.43%	1.14%	26.72%	-0.03%
自基金合同生 效起至今	28.78%	1.39%	-2.75%	1.41%	31.53%	-0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



## §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		
尹浩	基金经理	2019-10-11	-	9.4	尹浩先生，硕士。2012年起先后在华宝证券、国金证券工作。2015年加入博时基金管理有限公司。历任高级研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2019年10月11日—至今)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019年10月11日—至今)、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(2019年10月11日—至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2019年10月11日—至今)、博时中证5G产业50交易型开放式指数证券投资基金(2020年3月27日—至今)、博时中证新能源汽车交

					易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 10 日—至今)、博时中证智能消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)、博时中证 5G 产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021 年 7 月 14 日—至今)、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 7 月 15 日—至今)、博时中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 8 月 19 日—至今)、博时中证金融科技主题交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 9 月 24 日—至今)、博时中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2021 年 11 月 30 日—至今)、博时国证龙头家电交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 12 月 13 日—至今)、博时中证湖北新旧动能转换交易型开放式指数证券投资基金(2021 年 12 月 29 日—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 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、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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 7 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年四季度，海外主要市场指数多数上涨，标普 500 上涨 10.65%，纳斯达克上涨 8.28%，英国富时 100 上涨 4.21%，法国 CAC40 上涨 9.71%，德国 DAX 指数上涨 4.09%，而日经 225 下跌-2.24%，香港恒生指数下跌 4.79%。国内 A 股指数普遍上涨，小盘风格表现占优，大盘与科技板块表现较弱。汇率方面，美元兑人民币相比三季度末跌 1.39%，人民币延续升值趋势。债券市场方面，10 年期国债收益率下行 10 个 BP，12 月底收益率为 2.775%，美国债 10 年期收益率和上季度末持平，全球流动性宽松状态仍没有出现较大变化。展望 2022 年一季度，宏观上，奥密克戎高传播性叠加圣诞出行，海外新增病例急升，经济复苏担忧再起，但总体仍在可控范围内。海外流动性上，美联储 Taper 靴子落地，市场加息预期升温，美国货币政策预计逐步正常化。国内经济方面，稳增长政策发力、疫情逐步缓解两大宏观主线向好，将拉动经济内生性改善。通胀方面，终端消费回暖、猪价周期性回升，中国 CPI 中枢逐步上移，且总体可控，同时，全球供需缺口收窄，中国 PPI 将步入回落周期。在通胀总体可控及稳增长基调下，货币流动性将继续保持宽松。尽管经济扰动货币政策有望保持持续放松，但市场机会需要紧扣上市公司的盈利预期变化，当前我们需要持续关注不同板块景气趋势的变化，适当保持仓位的灵活性，把握结构性机会。风格上均衡配置大盘和中小盘，整体可偏价值板块。行业上，重视稳增长背景下的基建产业链和中游消费板块，同时兼顾硬科技板块的阶段性投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 3.4917 元，份额累计净值为 1.2878 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 1.45%，同期业绩基准增长率为 1.66%。

#### 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	权益投资	116,842,259.81	97.78
	其中：股票	116,842,259.81	97.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	759,000.00	0.64
	其中：债券	759,000.00	0.64
	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	1,890,216.52	1.58
8	其他各项资产	9,504.53	0.01
9	合计	119,500,980.86	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	58,518,676.03	49.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,437,572.00	5.40
E	建筑业	6,030,853.80	5.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	34,829,896.31	29.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,967,952.00	5.01
M	科学研究和技术服务业	5,027,792.00	4.22
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.02
S	综合	-	-
	合计	116,842,259.81	97.99

### 5.3 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明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600905	三峡能源	857,200	6,437,572.00	5.40
2	600519	贵州茅台	3,001	6,152,050.00	5.16
3	601012	隆基股份	70,720	6,096,064.00	5.11
4	601668	中国建筑	1,205,228	6,026,140.00	5.05
5	600585	海螺水泥	149,100	6,008,730.00	5.04
6	600309	万华化学	59,200	5,979,200.00	5.01
7	601888	中国中免	27,200	5,967,952.00	5.01
8	601166	兴业银行	312,582	5,951,561.28	4.99
9	600276	恒瑞医药	117,262	5,946,356.02	4.99
10	601318	中国平安	117,616	5,929,022.56	4.97

### 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	-	-
	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（可交换债）	759,000.00	0.64
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	759,000.00	0.64

### 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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113052	兴业转债	7,590	759,000.00	0.64

### 5.6 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。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。



## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 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。

## 5.10 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。

## 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除中国建筑(601668)、兴业银行(601166)、恒瑞医药(600276)的发行主体外，没有出现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、处罚的情形。

主要违规事实：2021 年 10 月 18 日，因中国建筑股份有限公司存在危大工程管理不到位的情形，重庆市住房和城乡建设委员会对其处以罚款等处罚。

主要违规事实：2021 年 8 月 5 日，因存在 1.违规办理内保外贷业务 2.未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料 3.违反外汇市场交易管理规定 4.未按规定保存交易通讯记录 5.违规办理银行卡业务的违规行为，国家外汇管理局福建省分局对兴业银行股份有限公司处以罚款等行政处罚。2021 年 8 月 20 日，因存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，中国人民银行对兴业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021 年 2 月 19 日，因存在违反《会计法》第九条规定的情形，财政部对江苏恒瑞医药股份有限公司处以罚款 5 万元的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

**5.11.2** 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,126.28
2	应收证券清算款	7,092.55
3	应收股利	-
4	应收利息	285.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,504.53

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 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。

## §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	35,548,002.00
报告期期间基金总申购份额	300,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	1,700,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	34,148,002.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

### 7.2 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

### 8.1 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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比
博时上证超级大盘交易型开放式指数证券	1	2021-10-01~2021-10-26; 2021-10-28~2021-12-31	27,795,999.00	-	1,000,000.00	26,795,999.00	78.47%

投 资 基 金 联 接 基金							
<b>产品特有风险</b>							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

## 8.2 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 2021 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 只公募基金，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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16687 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 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。

### 其他大事件

2021 年 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021 年 11 月 20 日，第五届中国海外基金金牛奖评选揭晓，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司旗下的博时大中华债券基金凭借优异的业绩，荣膺“一年期金牛海外中国债券基金”奖。

## §9 备查文件目录

---

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证券监督管理委员会批准上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 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 上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内上证超级大盘交易型开放式指数证券投资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询，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

二〇二二年一月二十四日