

上证超级大盘交易型开放式指数

证券投资基金

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 重要提示及目录

1.1 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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	4
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
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	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§ 7 投资组合报告	25
7.1 期末基金资产组合情况	25
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	25
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	26
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	26
7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	27
7.6 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债券投资明细	28
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	28
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五名贵金属投资明细	28
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权证投资明细	28
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	28
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	28
7.12 投资组合报告附注	28
§ 8 基金份额持有人信息	29
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	29
8.2 期末上市基金前十名持有人	29
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	29
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情况	29
§ 9 开放式基金份额变动	29
§ 10 重大事件揭示	30

10.1 基金份额持有人大会决议	30
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.....	30
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	30
10.4 基金投资策略的改变	30
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	30
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.....	30
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	31
10.8 其他重大事件	31
§ 11 备查文件目录	34
11.1 备查文件目录	34
11.2 存放地点	34
11.3 查阅方式	34

§ 2 基金简介

2.1 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
基金简称	博时上证超大盘 ETF
场内简称	超大 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
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	131,648,002.00 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	2010 年 3 月 19 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
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区金融大街25号
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29层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	张光华	王洪章

2.4 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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	315,489,567.31
本期利润	142,978,743.82
加权平均基金份额本期利润	0.5742
本期加权平均净值利润率	22.49%
本期基金份额净值增长率	16.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	604,859.73
期末可供分配基金份额利润	0.0046
期末基金资产净值	357,544,082.08
期末基金份额净值	2.7159
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.17%

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	-10.39%	3.33%	-10.66%	3.34%	0.27%	-0.01%
过去三个月	7.86%	2.66%	7.33%	2.68%	0.53%	-0.02%
过去六个月	16.97%	2.33%	16.53%	2.34%	0.44%	-0.01%
过去一年	85.51%	1.90%	84.41%	1.91%	1.10%	-0.01%
过去三年	50.13%	1.56%	43.30%	1.57%	6.83%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.17%	1.46%	-5.87%	1.47%	6.04%	-0.01%

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十一部分“（三）投资范围”、“（九）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	2015/6/8	-	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、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	2013/9/1	2015/6/8	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，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 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。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求，力求组合成份股紧密跟踪指数，利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因，并在最小化交易成本的同时适时调仓，尽可能地减少跟踪误差。同时，在本报告期，我们严格按照基金合同要求，在年中指数权重及成份股变动时，尽量降低成本、减少市场冲击，逐步调整组合与目标指数的结构一致。

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 2.7159 元，份额累计净值为 1.0017 元，报告期内净值增长率为 16.97%，同期业绩基准涨幅为 16.53%。

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 ETF 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，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 ETF 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：上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	6,087,744.20	1,548,165.55
结算备付金		215,549.82	415,135.19
存出保证金		7,616.38	19,154.94
交易性金融资产	6.4.3.2	352,358,709.71	781,949,962.72
其中：股票投资		352,358,709.71	781,949,962.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		1,225,895.27	-
应收利息	6.4.3.5	744.17	589.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		359,896,259.55	783,933,007.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,741,293.13	7,494.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		177,989.45	315,048.50
应付托管费		35,597.90	63,009.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	189,025.72	213,392.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	208,271.27	66,000.00
负债合计		2,352,177.47	664,944.42
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	356,939,222.35	914,656,746.57
未分配利润	6.4.3.10	604,859.73	-131,388,683.52
所有者权益合计		357,544,082.08	783,268,063.05
负债和所有者权益总计		359,896,259.55	783,933,007.47

注：注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.7159 元，基金份额总额 131,648,002.00 份。

6.2 利润表

会计主体：上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		145,515,680.45	-30,174,567.46
1. 利息收入		8,034.13	14,551.55
其中：存款利息收入	6.4.3.11	8,034.13	14,551.55
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		318,655,232.04	-67,141,920.43
其中：股票投资收益	6.4.3.12	314,777,165.49	-76,966,194.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	3,878,066.55	9,824,273.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-172,510,823.49	36,952,321.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-636,762.23	480.00
减：二、费用		2,536,936.63	2,416,970.00
1. 管理人报酬		1,579,904.61	1,635,241.93
2. 托管费		315,980.90	327,048.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	432,529.85	241,209.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.19	208,521.27	213,470.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		142,978,743.82	-32,591,537.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		142,978,743.82	-32,591,537.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

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）	914,656,746.57	-131,388,683.52	783,268,063.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	142,978,743.82	142,978,743.82
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）	-557,717,524.22	-10,985,200.57	-568,702,724.79
其中：1. 基金申购款	832,916,014.02	27,217,230.55	860,133,244.57
2. 基金赎回款	-1,390,633,538.24	-38,202,431.12	-1,428,835,969.36
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）	356,939,222.35	604,859.73	357,544,082.08
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）	1,272,008,084.28	-552,526,954.59	719,481,129.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,591,537.46	-32,591,537.46
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）	-93,269,241.28	42,848,626.01	-50,420,615.27
其中：1. 基金申购款	23,317,310.40	-10,837,253.76	12,480,056.64
2. 基金赎回款	-116,586,551.68	53,685,879.77	-62,900,671.91
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）	1,178,738,843.00	-542,269,866.04	636,468,976.96

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票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，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	6,087,744.20
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,087,744.20

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	340,194,896.67	352,358,709.71	12,163,813.04
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约			
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	340,194,896.67	352,358,709.71	12,163,813.04

注：2015 年 6 月 30 日，本基金可退替代款估值增值余额 212,649.00 元。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	643.77
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	97.00
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.40
合计	744.17

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	189,025.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	189,025.72

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
其他应付款	-
预提费用	208,271.27
合计	208,271.27

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	337,348,002.00	914,656,746.57
本期申购	307,200,000.00	832,916,014.02
本期赎回（以“-”号填列）	-512,900,000.00	-1,390,633,538.24
本期末	131,648,002.00	356,939,222.35

6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-334,591,645.21	203,202,961.69	-131,388,683.52
本期利润	315,489,567.31	-172,510,823.49	142,978,743.82
本期基金份额交易产生的变动数	111,905,575.01	-122,890,775.58	-10,985,200.57
其中：基金申购款	115,033,989.09	-87,816,758.54	27,217,230.55
基金赎回款	-3,128,414.08	-35,074,017.04	-38,202,431.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	92,803,497.11	-92,198,637.38	604,859.73

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	5,552.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,354.41
其他	127.37
合计	8,034.13

6.4.3.12 股票投资收益

6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	45,146,424.47
股票投资收益——赎回差价收入	269,630,741.02
合计	314,777,165.49

6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	166,430,632.41
减：卖出股票成本总额	121,284,207.94
买卖股票差价收入	45,146,424.47

6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,428,835,969.36
减：现金支付赎回款总额	48,238,079.36
减：赎回股票成本总额	1,110,967,148.98
赎回差价收入	269,630,741.02

6.4.3.13 债券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,878,066.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,878,066.55

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-172,510,823.49
——股票投资	-172,510,823.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-172,510,823.49

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	-
替代损益	-636,762.23
合计	-636,762.23

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	432,529.85
银行间市场交易费用	0.00
合计	432,529.85

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	250.00
上市费	29,752.78
合计	208,521.27

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、一级交易商
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（“上证超大盘ETF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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

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管理费	1,579,904.61	1,635,241.93
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 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 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	315,980.90	327,048.39

注：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 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 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	6,087,744.20	5,552.35	32,952,647.55	12,335.01

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。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪上证超级大盘指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证超级大盘指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致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，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察法律部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察法律部对公司执行总裁负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出

现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.8 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

本期末 2015年06月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,087,744.20				6,087,744.20
结算备付金	215,549.82				215,549.82
存出保证金	7,616.38				7,616.38
交易性金融资产				352,358,709.71	352,358,709.71
买入返售金融资产					
应收证券清算款				1,225,895.27	1,225,895.27
应收利息				744.17	744.17
资产总计	6,310,910.40			353,585,349.15	359,896,259.55
负债					
应付证券清算款				1,741,293.13	1,741,293.13
应付管理人报酬				177,989.45	177,989.45
应付托管费				35,597.90	35,597.90
应付交易费用				189,025.72	189,025.72
其他负债				208,271.27	208,271.27
负债总计				2,352,177.47	2,352,177.47
利率敏感度缺口	6,310,910.40			351,233,171.68	357,544,082.08
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,548,165.55				1,548,165.55
结算备付金	415,135.19				415,135.19
存出保证金	19,154.94				19,154.94
交易性金融资产				781,949,962.72	781,949,962.72
应收利息				589.07	589.07
资产总计	1,982,455.68			781,950,551.79	783,933,007.47
负债					
应付证券清算款				7,494.02	7,494.02
应付管理人报酬				315,048.50	315,048.50
应付托管费				63,009.70	63,009.70
应付交易费用				213,392.20	213,392.20

其他负债				66,000.00	66,000.00
负债总计				664,944.42	664,944.42
利率敏感度缺口	1,982,455.68			781,285,607.37	783,268,063.05

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2014 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪上证超级大盘指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，上证超级大盘指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	352,358,709.71	98.55	781,949,962.72	99.83

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	352,358,709.71	98.55	781,949,962.72	99.83

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证超级大盘指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	1. 上证超级大盘指数上升 5%	增加约 1,787	增加约 3,923
2. 上证超级大盘指数下降 5%	减少约 1,787	减少约 3,923	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于本报告期，本基金申购基金份额的对价总额为 12,480,056.64 元，其中包括以股票支付的申购款 12,361,787.00 元和以现金支付的申购款 118,269.64 元。

(2) 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

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：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。本基金持有属于第一层级的金融工具主要包括存在活跃市场的股票(包括网下申购处于限售期的股票)、交易所市场债券等，于 2015 年 6 月 30 日的余额为 352,146,060.71 元(2014 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额 781,949,962.72 元)。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算)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。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有属于第二层级的以公允价值计量的金融工具(2014 年 12 月 31 日：本基金未持有属于第二层级的以公允价值计量的金融工具)。

第三层级：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)。于 2015 年 6 月 30 日, 本基金未持有属于第三层级的以公允价值计量的金融工具 (2014 年 12 月 31 日: 同)。

(3) 除基金申购款和公允价值外, 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(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	352,358,709.71	97.91
	其中: 股票	352,358,709.71	97.91
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	6,303,294.02	1.75
7	其他各项资产	1,234,255.82	0.34
8	合计	359,896,259.55	100.00

注: 2015 年 6 月 30 日, 权益投资金额包含可退替代款估值增值余额 212,649.00 元, 其他各项资产中包含了现金差额 1,699.88 元。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

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	36,914,523.34	10.32
C	制造业	133,543,662.74	37.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,151,291.54	4.80
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,258,119.08	4.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,519,332.55	4.34
J	金融业	119,224,015.30	33.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

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	13,535,116.16	3.79
S	综合	-	-
	合计	352,146,060.71	98.49

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	2,624,302	26,085,561.88	7.30
2	600519	贵州茅台	81,037	20,879,183.05	5.84
3	600887	伊利股份	1,049,722	19,839,745.80	5.55
4	600000	浦发银行	1,164,867	19,756,144.32	5.53
5	601318	中国平安	233,208	19,109,063.52	5.34
6	600036	招商银行	1,014,466	18,990,803.52	5.31
7	600028	中国石化	2,640,439	18,641,499.34	5.21
8	600104	上汽集团	812,489	18,362,251.40	5.14
9	601857	中国石油	1,612,800	18,273,024.00	5.11
10	601166	兴业银行	1,040,382	17,946,589.50	5.02
11	600030	中信证券	644,216	17,335,852.56	4.85
12	601668	中国建筑	2,063,934	17,151,291.54	4.80
13	600585	海螺水泥	796,093	17,076,194.85	4.78
14	600018	上港集团	2,055,388	16,258,119.08	4.55
15	600010	包钢股份	3,065,378	15,909,311.82	4.45
16	600050	中国联通	2,117,235	15,519,332.55	4.34
17	600111	北方稀土	846,293	15,351,755.02	4.29
18	601989	中国重工	1,008,736	14,929,292.80	4.18
19	600637	东方明珠	321,652	13,535,116.16	3.79
20	601766	中国中车	609,800	11,195,928.00	3.13

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601857	中国石油	22,493,774.75	2.87
2	600519	贵州茅台	19,726,600.32	2.52
3	601766	中国中车	17,807,178.63	2.27
4	600028	中国石化	15,191,893.00	1.94
5	600016	民生银行	12,834,963.91	1.64
6	600018	上港集团	11,467,037.75	1.46
7	601318	中国平安	8,600,247.00	1.10
8	600010	包钢股份	8,383,108.76	1.07
9	600104	上汽集团	6,201,787.18	0.79
10	600030	中信证券	4,946,319.00	0.63
11	600637	东方明珠	4,152,253.00	0.53

12	600585	海螺水泥	3,823,450.00	0.49
13	601989	中国重工	3,273,294.00	0.42
14	601668	中国建筑	2,924,758.00	0.37
15	601166	兴业银行	2,697,632.00	0.34
16	600000	浦发银行	2,630,409.20	0.34
17	600050	中国联通	2,281,881.00	0.29
18	600887	伊利股份	1,945,050.00	0.25
19	600036	招商银行	1,688,590.00	0.22
20	600111	北方稀土	1,534,972.90	0.20

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

7.4.2 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	600196	复星医药	31,275,081.12	3.99
2	600256	广汇能源	29,538,163.78	3.77
3	600018	上港集团	17,372,508.53	2.22
4	600010	包钢股份	10,968,202.18	1.40
5	600050	中国联通	10,193,829.89	1.30
6	601668	中国建筑	10,071,379.08	1.29
7	600028	中国石化	9,694,689.60	1.24
8	601989	中国重工	9,622,120.24	1.23
9	600637	东方明珠	6,583,798.73	0.84
10	600036	招商银行	5,355,281.79	0.68
11	600585	海螺水泥	4,334,134.63	0.55
12	600104	上汽集团	3,647,858.36	0.47
13	601166	兴业银行	3,169,215.75	0.40
14	600000	浦发银行	2,872,532.00	0.37
15	600111	北方稀土	2,622,432.00	0.33
16	600030	中信证券	2,402,019.84	0.31
17	600887	伊利股份	2,220,501.54	0.28
18	600016	民生银行	2,070,418.00	0.26
19	601318	中国平安	933,496.38	0.12
20	600519	贵州茅台	807,111.97	0.10

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。

7.4.3 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	157,175,185.40
卖出股票的收入（成交）总额	166,430,632.41

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。

7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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 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。

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	7,616.38
2	应收证券清算款	1,225,895.27
3	应收股利	-
4	应收利息	744.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,234,255.82

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		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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,166	14,362.64	7,697,793.00	5.85%	21,301,420.00	16.18%	102,648,789.00	77.97%

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	海通证券股份有限公司	5,228,781.00	3.97%
2	谢曼琪	1,582,810.00	1.20%
3	深圳市大鹏大坑上村股份合作公司	737,650.00	0.56%
4	北京金座投资管理有限公司劳务服务分公司	664,051.00	0.50%
5	陈萍	442,590.00	0.34%
6	李晓青	442,590.00	0.34%
7	何文良	419,723.00	0.32%
8	钱桂庭	368,825.00	0.28%
9	深圳市大鹏大坑下村股份合作公司	368,825.00	0.28%
10	苏立波	368,825.00	0.28%
	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	102,648,789.00	77.97%

注：前十名持有人为除博时超大盘 ETF 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	-	-

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	1,406,754,806.00
本报告期期初基金份额总额	337,348,002.00
本报告期基金总申购份额	307,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	512,900,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	131,648,002.00

§ 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

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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	323,605,817.81	100.00%	229,889.69	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，我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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/30
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/27
3	博时基金管理有限公司关于参加数米基金销售有限公司认申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/27
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/26
5	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/25
6	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
7	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加上海好买基金销售有限公司申购费率优惠活动的公	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20

	告		
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
9	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/19
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/17
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/16
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/12
13	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/11
14	博时基金管理有限公司关于上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/9
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/6
16	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/4
17	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/3
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/2
19	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/1
20	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/28
21	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/27
22	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/22
23	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/21
24	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/20
25	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/15
26	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/14
27	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/13
28	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/12
29	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/11
30	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/7
31	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长	中国证券报、上海证	2015/4/30

	期停牌股票调整估值方法的公告	券报、证券时报	
32	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/30
33	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司认、申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/25
34	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/23
35	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/14
36	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/13
37	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/11
38	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/9
39	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/3
40	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/2
41	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
42	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/31
43	博时基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/26
44	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/26
45	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/24
46	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/19
47	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/18
48	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/17
49	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/14
50	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/11
51	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/3
52	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/27
53	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/17
54	博时基金管理有限公司关于暂停货币基金快速赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/14

55	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/12
56	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/10
57	关于厦门市鑫鼎盛控股有限公司暂停代理博时旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/7
58	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/23
59	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/20
60	公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17
61	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

11.1.1 中国证监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

11.1.2 《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

11.1.3 《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

11.1.5 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

11.1.6 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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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
二〇一五年八月二十七日