

上证超级大盘交易型开放式指数证券投资 基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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：二〇二四年七月十九日

§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 2024 年 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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	38,248,002.00 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的最小化。
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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	-3,283,554.05
2. 本期利润	-2,325,690.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0603
4. 期末基金资产净值	101,555,120.43
5. 期末基金份额净值	2.6552

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（不包含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	-2.32%	0.66%	-3.62%	0.67%	1.30%	-0.01%
过去六个月	2.64%	0.82%	1.53%	0.83%	1.11%	-0.01%
过去一年	-1.39%	0.85%	-3.20%	0.87%	1.81%	-0.02%
过去三年	-27.40%	1.07%	-33.36%	1.09%	5.96%	-0.02%
过去五年	-5.95%	1.12%	-23.50%	1.14%	17.55%	-0.02%
自基金合同生 效起至今	-2.07%	1.34%	-31.36%	1.36%	29.29%	-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		
李庆阳	基金经理	2024-02-02	-	13.9	李庆阳先生，硕士。2010 年从华南理工大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级系统运维经理。2016 年调任博时资本，任投资经理。2018 年再次加入博时基金管理有限公司。现任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(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时创业板指数证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 2 月 8 日—至今)、博时中证传媒指数型发起式证券投资基金(2024 年 3 月 5 日—至今)、

					博时国证消费电子主题指数型发起式证券投资基金(2024年4月23日—至今)、博时中证全指通信设备指数型发起式证券投资基金(2024年5月7日—至今)、博时中证汽车零部件主题指数型发起式证券投资基金(2024年5月21日—至今)、博时中证信息技术应用创新产业指数型发起式证券投资基金(2024年6月4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，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 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 22 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

2024 年第二季度，国内市场对宏观经济的预期持续调整，负面因素如基本面的疲软和房地产市场数据的不及预期，加剧了市场的不安情绪。市场在此期间整体震荡下行，波动性增强，行业和板块之间的分化

格外显著。尽管消费领域呈现出复苏迹象，但总体表现依然偏弱，内需复苏的动能不足成为市场面临的主要挑战。自四月份开始，经济数据的环比走弱和未达预期进一步加重了这一挑战。信贷数据的大幅下降和制造业 PMI 的跌入收缩区间，以及四五月份 CPI 的意外下降，均揭示了国内消费复苏的艰难以及全球工业品需求的疲软。这些因素综合影响，对市场盈利预期和风险偏好产生了显著的负面冲击。

在国际方面，美国的经济数据虽有波动，但六月份的制造业和服务业数据均好于预期，显示出美国经济的复原力。通胀的放缓有助于减轻市场的一部分压力，但通胀水平依然较高，预示着美联储未来可能面临更加复杂的降息决策过程，这为中国国内市场带来了新增的不确定性。

市场风格方面，4 月初和 6 月初的两次市场波动使得大盘股和小盘股之间的差距进一步扩大，总体上大盘股在二季度占据优势地位。动量风格保持其市场强势。今年以来大盘、龙头风格成为 A 股重要的收益来源，放眼全球也是如此，因为龙头企业相对其它企业的基本面优势在较为疲弱的宏观环境下被不断放大，此外在全球经济、政策和地缘政治风险不确定性加大的时代背景下，资金也趋向于青睐那些更有可能带来稳定回报的龙头资产。

在行业和板块的市场结构上，随着投资风格的演变，价值板块整体上略占优势，而成长板块的分化则更加显著。银行、电力、交通运输和煤炭行业实现了正收益，成长板块中电子行业表现较为坚挺，而其他 TMT 行业则落后于大市。

本基金作为一只专注于被动跟踪指数的基金，旨在通过精细的资产配置和投资管理，最小化与标的指数的跟踪误差，从而为投资者带来与标的指数相一致的投资回报。本基金主要采用完全复制指数的策略，在本报告期内，通过专业的投资团队和精确的市场分析，本基金成功实现了对指数的紧密跟踪，并保持了基金的稳定运行。展望未来，基金将继续关注市场趋势和宏观经济发展，以确保投资策略与市场环境相适应，不断为投资者创造价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 2.6552 元，份额累计净值为 0.9793 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-2.32%，同期业绩基准增长率为-3.62%。

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	100,366,693.21	98.68
	其中：股票	100,366,693.21	98.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,345,706.84	1.32
8	其他各项资产	437.97	0.00
9	合计	101,712,838.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	15,625,305.00	15.39
C	制造业	28,902,626.95	28.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,251,872.00	5.17
E	建筑业	4,866,232.68	4.79
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	5,377,560.00	5.30
J	金融业	31,058,824.58	30.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,530,525.00	4.46
M	科学研究和技术服务业	4,753,747.00	4.68
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	100,366,693.21	98.83

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601728	中国电信	874,400	5,377,560.00	5.30
2	601857	中国石油	514,700	5,311,704.00	5.23
3	601398	工商银行	931,400	5,308,980.00	5.23
4	688041	海光信息	75,454	5,305,925.28	5.22
5	601288	农业银行	1,206,900	5,262,084.00	5.18
6	600900	长江电力	181,600	5,251,872.00	5.17
7	600036	招商银行	151,221	5,170,245.99	5.09
8	601088	中国神华	116,500	5,169,105.00	5.09
9	601166	兴业银行	293,282	5,167,628.84	5.09
10	601899	紫金矿业	292,800	5,144,496.00	5.07

5.4 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行龙岩市中心支行、国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局、襄阳市市场监督管理局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绵阳市分局、国家金融监督管理总局北京监管局、天津市市场监督管理委员会的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行内蒙古自治区分行、国家外汇管理局菏泽市分局、国家金融监督管理总局上海证监局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行南昌中心支行、国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局河南监管局的处罚。中国神华能源股份有限公司在报告编制前一年受到国家矿山安全监察局陕西局和锡林浩特市工业和信息化局的处罚。中国电信股份有限公司在报告编制前一年受到大悟县市场监督管理局、内蒙古自治区通信管理局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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	437.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	437.97

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	40,748,002.00
报告期期间基金总申购份额	6,100,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	8,600,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	38,248,002.00

§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	1	2024-04-01~ 2024-06-30	28,204,899.00	319,600.00	848,600.00	27,675,899.00	72.36%

大 盘 交 易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金							
---	--	--	--	--	--	--	--

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，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。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。
2. 份额占比为四舍五入后的结果。

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 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 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 16037 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 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 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
- 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》
- 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》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 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
- 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

二〇二四年七月十九日