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

【2013】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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年8月29日

§1 重要提示

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2013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2013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

基金名称	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
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	1,115,342,305.34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	孙麟清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqing1.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(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	-14,230,785.16
本期利润	-162,892,482.68
加权平均基金份额本期利润	-0.1396
本期基金份额净值增长率	-19.82%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4155
期末基金资产净值	651,934,236.16
期末基金份额净值	0.5845

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

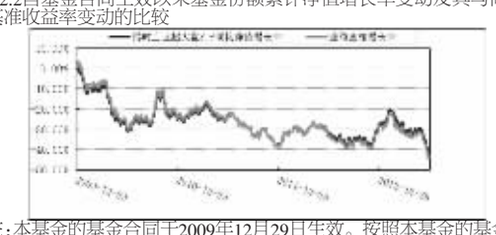
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-15.91%	1.77%	-16.39%	1.77%	0.48%	0.00%
过去三个月	-15.90%	1.42%	-16.26%	1.42%	0.36%	0.00%
过去六个月	-19.82%	1.51%	-20.73%	1.49%	0.91%	0.02%
过去一年	-14.08%	1.35%	-15.59%	1.34%	1.51%	0.01%
过去三年	-16.62%	1.26%	-20.11%	1.27%	3.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-41.55%	1.29%	-43.20%	1.30%	1.65%	-0.01%

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成立于1998年7月13日,是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。注册资本2.5亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。同时,博时基金公司拥有博时基金(国际)有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。博时基金公司的股东为招商证券股份有限公司、中国长城资产管理公司、天津港(集团)有限公司、璟安股权投资有限公司、上海盛业股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广厦建设集团有限责任公司。博时基金公司的经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务,是一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构。

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2013年6月30日,博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金,并且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,公募基金资产规模逾1065.69亿元人民币,累计分红602.92亿元人民币,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

1)根据银河证券基金研究中心统计,2013年上半年,股票型基金中,截至6月28日,博时医疗保健今年以来净值增长率在328只标准型股票基金中排名前1/3。混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名第8。

2)固定收益方面,博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名第1;博时裕祥分级债券A今年以来收益率在19只封闭式债券型分级子基金(优先份额)中名列第2。

3)海外投资方面,博时标普500今年以来净值增长率在15只QDII指数股票型基金中排名第2,该基金成立以来的涨幅达到15.94%。

2、客户服务

2013年上半年,博时基金共举办各类渠道培训活动逾841场,参加人数超过2万人。

3、其他大事件

1)2013年3月29日,由证券时报社主办的2012年度中国基金业明星奖颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业基金荣获"2012年度股票型明星基金奖"。

2)2013年3月30日,由中国证券报社主办的第十届中国基金业金牛奖颁奖典礼暨2013金牛基金论坛在北京举行。博时基金蝉联"金牛基金管理公司"奖,博时基金价值组投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得"金牛基金十周年特别奖",博时现金收益荣获"2012年度货币市场金牛基金"。

3)2013年4月,在股市动态分析杂志主办的"2012基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜"评选活动中,博时标普500指数基金获得"2012年基金新产品营销策划案例奖"。

4)2013年4月10日,由上海证券报举办的第十届"金基金奖"颁奖典礼在上海举行,博时基金荣获"金基十年?卓越公司奖",博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获"金基金十年?投资回报奖",博时主题行业基金荣获"金基金·股票型基金奖5年期奖",博时裕阳封闭荣获"金基金·分红基金奖3年期奖"。

5)2013年4月27日,由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的2013中国网·普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选"年度最佳财富管理基金公司"。

6)2013年6月26日,世界品牌实验室(WBL)在京发布2013年度(第十届)《中国500最具价值品牌》排行榜,博时基金以81.65亿的品牌价值位列第216名,品牌价值一年内提升了近20亿元,排名逐年上升。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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
方维玲	基金经理	2012-11-13	-	21	曾先后在云南大学、海南省信托投资公司证券部、湘财证券有限责任公司海口营业部、北京玖方量子软件技术公司任职。2001年3月加入博时基金管理有限公司,历任金融工程小组金融工程师、数量化投资部副总经理、产品规划部总经理、股票投资部ETF及量化投资组投资经理、博时上证超大盘ETF基金及其联接基金基金经理助理、博时上证超大盘ETF基金及其联接基金和博时上证自然资源ETF基金及其联接基金基金经理助理。现任博时上证超大盘ETF基金及其联接基金基金经理。

注:本基金任期的开始和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2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、《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

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2013年6月30日,本基金份额净值为0.5845元,累计份额净值为0.5845元,报告期内净值增长率为-19.82%,同期业绩基准涨幅为-20.73%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年上半年,市场对于经济复苏的预期在逐渐退潮。国内经济依然疲软,市场情绪整体较为低迷。从经济数据方面来看,汇丰PMI连续两个月下跌,5月出口增速回落至1%,5月的PPI为-2.9%,显示经济仍未见起色,工业生产依然较为疲弱。鉴于经济依然弱势,缺乏需求,主要周期品如煤炭、有色、钢铁等依然继续下跌。从流动性方面来看,近期流动性偏紧。从行业方面来看,煤炭产能过剩,产业链仍需要去库存;有色金属全球需求不振,中期内制约其价格。从海外市场方面来看,美国经济持续复苏,QE退出预期的逐步升温,使得全球流动性发生重构,全球资金开始从新兴市场流出,美元指数呈现上涨态势,流动性有紧缩预期,黄金和白银等金属价格大幅回落,国债收益率不断向上攀升。

展望下半年,市场环境仍然存在诸多的不确定性,其主要源于国内外政策变动对经济的调控作用。在国际方面,其主要体现在美国QE退出和日元量化宽松;在国内方面,维稳政策将在多大程度上填补房地产投资及出口增速回落所形成的空缺,各项改革措施的推进效果以及十八届三中全会的召开等都在观察之列。

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基金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。

§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的真实、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:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.3.1	30,402,449.56	41,940,340.02
结算备付金		-	-
存出保证金		20,334.40	250,000.00
交易性金融资产	6.4.3.2	621,904,632.00	840,153,260.00
其中:股票投资		1,561,518.00	-
基金投资		617,346,114.00	840,153,260.00
债券投资		2,997,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
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		-	2,900,863.75
应收利息	6.4.3.5	77,635.66	9,211.22
应收股利		-	-
应收申购款		259,078.21	228,552.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		652,664,129.83	885,482,227.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		-	870.90
应付赎回款		516,693.28	2,023,923.71
应付管理人报酬		15,250.59	16,806.39
应付托管费		3,050.11	3,361.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	20,626.23	11,436.85
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	174,273.46	403,110.03
负债合计		729,893.67	2,459,509.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	1,115,342,305.34	1,211,204,836.12
未分配利润	6.4.3.10	-463,408,069.18	-328,182,117.58
所有者权益合计		651,934,236.16	883,022,718.54
负债和所有者权益总计		652,664,129.83	885,482,227.73

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.5845元,基金份额总额1,115,342,305.34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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		-162,481,655.13	91,135,237.67
1.利息收入		153,270.86	174,579.14
其中:存款利息收入	6.4.3.11	147,561.83	174,579.14
债券利息收入		5,709.03	-
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)		-14,010,784.65	-67,879,076.71
其中:股票投资收益	6.4.3.12	-329,716.66	-585,699.52
基金投资收益	6.4.3.13	-13,682,667.99	-67,293,377.19
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	1,600.00	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.3.17	-148,661,697.52	158,519,944.57
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.3.18	37,556.18	319,790.67
减:二、费用		410,827.55	779,174.96
1.管理人报酬		100,208.65	115,853.16
2.托管费		20,041.77	23,170.68
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.3.19	114,780.79	451,365.76
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.3.20	175,796.34	188,785.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-162,892,482.68	90,356,062.71
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-162,892,482.68	90,356,062.71

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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	1,211,204,836.12	-328,182,117.58	883,022,718.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-162,892,482.68	-162,892,482.68
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)	-95,862,530.78	27,666,531.08	-68,195,999.70
其中:1.基金申购款	42,143,416.44	-11,924,766.20	30,218,650.24
2.基金赎回款	-138,005,947.22	39,591,297.28	-98,414,649.94
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)	1,115,342,305.34	-463,408,069.18	651,934,236.16

注:上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2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、《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

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2013年6月30日,本基金份额净值为0.5845元,累计份额净值为0.5845元,报告期内净值增长率为-19.82%,同期业绩基准涨幅为-20.73%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年上半年,市场对于经济复苏的预期在逐渐退潮。国内经济依然疲软,市场情绪整体较为低迷。从经济数据方面来看,汇丰PMI连续两个月下跌,5月出口增速回落至1%,5月的PPI为-2.9%,显示经济仍未见起色,工业生产依然较为疲弱。鉴于经济依然弱势,缺乏需求,主要周期品如煤炭、有色、钢铁等依然继续下跌。从流动性方面来看,近期流动性偏紧。从行业方面来看,煤炭产能过剩,产业链仍需要去库存;有色金属全球需求不振,中期内制约其价格。从海外市场方面来看,美国经济持续复苏,QE退出预期的逐步升温,使得全球流动性发生重构,全球资金开始从新兴市场流出,美元指数呈现上涨态势,流动性有紧缩预期,黄金和白银等金属价格大幅回落,国债收益率不断向上攀升。

展望下半年,市场环境仍然存在诸多的不确定性,其主要源于国内外政策变动对经济的调控作用。在国际方面,其主要体现在美国QE退出和日元量化宽松;在国内方面,维稳政策将在多大程度上填补房地产投资及出口增速回落所形成的空缺,各项改革措施的推进效果以及十八届三中全会的召开等都在观察之列。

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基金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。

§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的真实、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:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.3.1	30,402,449.56	41,940,340.02
结算备付金		-	-
存出保证金		20,334.40	250,000.00
交易性金融资产	6.4.3.2	621,904,632.00	840,153,260.00
其中:股票投资		1,561,518.00	-
基金投资		617,346,114.00	840,153,260.00
债券投资		2,997,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
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		-	2,900,863.75
应收利息	6.4.3.5	77,635.66	9,211.22
应收股利		-	-
应收申购款		259,078.21	228,552.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		652,664,129.83	885,482,227.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		-	870.90
应付赎回款		516,693.28	2,023,923.71
应付管理人报酬		15,250.59	16,806.39
应付托管费		3,050.11	3,361.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	20,626.23	11,436.85
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	174,273.46	403,110.03
负债合计		729,893.67	2,459,509.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.3.9	1,115,342,305.34	1,211,204,836.12
未分配利润	6.4.3.10	-463,408,069.18	-328,182,117.58
所有者权益合计		651,934,236.16	883,022,718.54
负债和所有者权益总计		652,664,129.83	885,482,227.73

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.5845元,基金份额总额1,115,342,305.34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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		-162,481,655.13	91,135,237.67
1.利息收入		153,270.86	174,579.14
其中:存款利息收入	6.4.3.11	147,561.83	174,579.14
债券利息收入		5,709.03	-
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)		-14,010,784.65	-67,879,076.71
其中:股票投资收益	6.4.3.12	-329,716.66	-585,699.52
基金投资收益	6.4.3.13	-13,682,667.99	-67,293,377.19
债券投资收益	6.4.3.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	1,600.00	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.3.17	-148,661,697.52	158,519,944.57
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.3.18	37,556.18	319,790.67
减:二、费用		410,827.55	779,174.96
1.管理人报酬		100,208.65	115,853.16
2.托管费		20,041.77	23,170.68
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.3.19	114,780.79	451,365.76
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.3.20	175,796.34	188,785.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-162,892,482.68	90,356,062.71
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-162,892,482.68	90,356,062.71

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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	1,211,204,836.12	-328,182,117.58	883,022,718.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-162,892,482.68	-162,892,482.68
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)	-95,862,530.78	27,666,531.08	-68,195,999.70
其中:1.基金申购款	42,143,416.44	-11,924,766.20	30,218,650.24
2.基金赎回款	-138,005,947.22	39,591,297.28	-98,414,649.94
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)	1,115,342,305.34	-463,408,069.18	651,934,236.16

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:

基金管理公司负责人:吴姚东,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[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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,