

# 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 年 度 报 告 摘 要

4.1报告期内本基金投资策略和运作分析

2013年度宏观经济保持温和增速放缓的态势,从全年经济基本面来看,第一、二季度经济较为疲软,市场情绪较为低迷;第三季度宏观经济数据出现明显好转,提振了市场情绪;第四季度经济继续放缓,国内市场表现弱于美国及欧洲市场。从全年资本市场表现来看,大小盘出现分化-沪深300和中小板、创业板的估值和成交活跃度呈现金字塔,沪深300均有下降,而中小板和创业板的估值明显上升,创业板涨幅尤为突出;日均成交量方面,沪深300全年呈现下移态势,中小板中概基持平,而创业板仍市场追捧的热点,沪深300全年下跌7.85%,超大市值指数全年下跌22.88%。整体而言,二级市场的投资者对大盘股的参与热情一般。

本基金主要投资于上证超大市值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,本基金严格按照投资基准合同,以不低于基金资产净值90%的资产都投资于上证超大市值交易型开放式指数证券投资基金,保证投资组合跟踪标的指数,现金或到期日在一年以内的国债的持仓比例不低于基金资产净值的5%。投资于上证超大市值ETF的资产主要是通过一级市场的申购,以保证投资组合的公平性。

4.2报告期内基金的投资表现和风险分析

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.3报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.4报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.5报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.6报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.7报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.8报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.9报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.10报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.11报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.12报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.13报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.14报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.15报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.16报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.17报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.18报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.19报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.20报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.21报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.22报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.23报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.24报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.25报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.26报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.27报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.28报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.29报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.30报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.31报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.32报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.33报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.34报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.35报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.36报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.37报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.38报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.39报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.40报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.41报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.42报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

4.43报告期内基金管理人及基金经理的变更情况

截至2013年12月31日,本基金资产净值为0.5814亿元,累计净值为0.5814亿元。报告期内,本基金份额净值增长率为-20.25%,同期业绩比较基准增长率为-21.76%。

8.4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

基金单位: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 600547 山东黄金 3,200 55,200.00 0.01

8.5报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1累计买入股票超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

基金单位: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 600016 民生银行 158,080.00 0.02

2 601166 兴行银行 146,400.00 0.02

3 601318 中国平安 140,310.00 0.02

4 600000 浦发银行 134,290.00 0.02

5 600030 中信证券 114,160.00 0.01

6 601006 大秦铁路 108,360.00 0.01

7 600547 山东黄金 104,880.00 0.01

8 600104 上汽集团 103,840.00 0.01

9 600348 阳泉煤电 102,410.00 0.01

10 600031 三一重工 102,660.00 0.01

11 600028 中国石化 100,520.00 0.01

12 601668 江南建设 98,740.00 0.01

13 600602 江西铜业 97,640.00 0.01

14 600050 中国联通 97,470.00 0.01

15 600111 包钢稀土 97,110.00 0.01

16 600585 海螺水泥 95,300.00 0.01

17 601899 紫金矿业 93,000.00 0.01

18 600089 中国神华 92,600.00 0.01

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

8.5.2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

基金单位: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 600016 民生银行 7,987,057.35 0.90

2 600000 浦发银行 7,835,456.31 0.89

3 601166 兴行银行 7,810,112.53 0.88

4 601318 中国平安 7,770,182.78 0.88

5 600030 中信证券 6,696,553.70 0.76

6 600111 包钢稀土 6,596,963.71 0.75

7 601006 大秦铁路 6,467,469.81 0.73

8 600585 海螺水泥 6,212,137.08 0.70

9 600104 上汽集团 5,982,540.00 0.68

10 600028 中国石化 5,927,875.23 0.67

11 600050 中国联通 5,879,262.94 0.67

12 600602 江西铜业 5,813,786.26 0.66

13 601668 江南建设 5,794,709.21 0.66

14 600031 三一重工 5,633,500.52 0.64

15 601088 中国神华 5,291,292.48 0.60

16 600547 山东黄金 4,870,651.35 0.55

17 600348 阳泉煤电 3,067,166.12 0.35

18 601899 紫金矿业 2,744,217.75 0.31

19 600036 招商银行 2,595,923.53 0.29

20 600089 中国神华 2,510,611.79 0.28

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

8.5.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额 1,988,024.00

卖出股票的收入(成交)总额 115,888,514.49

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

8.6期末按债券品种分类的债券投资组合

基金单位:人民币元

序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 国债逆回购 3,184,320.00 0.34

2 央行票据 - -

3 中期票据 - -

其中:政策性金融债 - -

4 企业债 - -

5 企业中期票据 - -

6 中期票据 - -

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 3,184,320.00 0.34

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

基金单位: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 019297 13国债(附) 32,000 3,184,320.00 0.34

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期内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。

8.11报告期内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。

8.12投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 14,047.45

2 应收证券清算款 736.40

3 应收股利 -

4 应收利息 66,753.10

5 应收中购款 93,346.59

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 174,883.54

8.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细