

基金管理人：博时基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一五年十月二十六日

\$1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人在中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2015年10月23日复核了本报告中的财务数据、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。

本公司未向客户提供财务顾问服务。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

\$2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金名称：博时上证大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金代码：0560013

交易方式：0560013

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

报告期末基金份额总额：273,433,651.64份

投资目标：通过主要投资于上证大盘交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数的表现以实现投资目标。

投资策略：本基金通过主要投资于上证大盘交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数的表现以实现投资目标。

投资范围：本基金通过主要投资于上证大盘交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数的表现以实现投资目标。

投资限制：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的95%，投资于债券等其他金融工具的比例不超过基金资产的5%。

风险收益特征：本基金为交易型开放式股票型联接基金，属于股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

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

基金代码：610020

交易方式：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：273,433,651.64份

投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离度的最小化。

投资策略：本基金通过主要投资于上证大盘交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数的表现以实现投资目标。

投资范围：本基金通过主要投资于上证大盘交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数的表现以实现投资目标。

投资限制：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的95%，投资于债券等其他金融工具的比例不超过基金资产的5%。

风险收益特征：本基金为交易型开放式股票型联接基金，属于股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

2.1.2 报告期内基金产品说明

投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离度的最小化。

投资策略：本基金采用完全复制策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并定期根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。

业绩比较基准：上证超大盘指数(价格)。

风险收益特征：本基金属于股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

2.1.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

报告期：(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 1,741,350.10

2.本期利润 -61,258,506.10

3.加权平均基金份额利润率 -0.2146%

4.期末基金资产净值 216,250,269.00

5.期末基金份额净值 0.7909

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，本期利润与本期已实现公允价值变动收益一致。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计价费用和投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内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(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 3.16% -21.69% 3.10% 0.66% -0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 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(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.5 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.6 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.7 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.8 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.9 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.10 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.11 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.12 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.13 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.14 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.15 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.16 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.17 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.18 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.19 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.20 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.21 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.22 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.23 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.24 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06% 0.11%

3.2.25 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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 准差2% 收益率(%) 业绩比较基准收益率 准差2% ①-③ ②-④

过去三个月 -13.43% 1.60% -12.07% 1.49% -0.06