

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摘要

【2012】年度报告摘要

- 司。
- 5) 博时标普500指数型证券投资基金首募顺利结束并于6月14日正式成立。
- 6) 博时医疗保健行业股票型证券投资基金首募顺利结束并于8月28日正式成立。
- 7) 博时信用纯债债券型证券投资基金首募顺利结束并于9月7日正式成立。
- 8) 博时安心收益定期开放债券型证券投资基金首募顺利结束并于12月6日正式成立。
- 4.1.2基金经理、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(简历年限)	证券从业年限	说明
王政	基金经理/ ETF及量化 投资组合 总监	2010-1-5	2012-11-13	13
方维珍	基金经理	2012-11-13	-	21
方维珍	基金经理助理	2011-4-6	2012-11-13	21

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守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他各项实施准则、《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，本着诚实信用、勤勉尽责、信于市场、信于社会的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场整体等原因，本基金曾出现个别投资指标超标的情况，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公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的相关规定，公司进一步完善了公平交易管理制度，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场和二级市场权益类及固定收益类资产的公平交易原则、流程、按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待投资的不同投资组合。

4.3.2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《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易管理制度下的规定，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合。同时，根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理投资组合的不同时间窗的同向交易进行了价差分析，未发现在违反公平交易原则的情况。

4.3.3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管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内本基金投资策略和运作分析

2012年度国内经济有所放缓，通胀下行，中国处于经济调整的周期当中，一季度市场在资源和有色带动下继续上行并达到峰值，二、三、四季度国内经济一直在低位运行，A股市场估值在低位的水下不断下降，市场情绪较为悲观。四季度国内经济出现了明显的企稳迹象，企业盈利也开始恢复正增长，A股截至新年后强势反弹，沪深300指数连涨，全年涨幅7.55%；上证综指上涨1.17%，深证成指上涨2.22%。全年大盘股和小盘股的差异较为明显，超大盘指数全年上涨15.28%，具有良好的投资价值。

本基金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，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%的资产投资于上证超级大盘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、现金占用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%。投资于上证超级大盘ETF的资产主要是通过一级市场的申购，以保证投资者的公平性。

4.4.2报告期内本基金的投资表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.7290元，份额累计净值为0.7290元。报告期内，本基金净值增长率为16.38%，同期业绩基准增长率为14.59%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望2013年，中国经济增长将会放缓，经济结构调整的可能性较大。新政对2013年经济的推动将集中在部分基础设施与公共服务等方面。在这种状态下，基础设施投资、房地产销售延续当前势头，但房地产和制造业投资增速将会放缓，出口持续疲软，消费与2012年持平或略有回升。在不实施大规模经济刺激政策的情况下，通胀的表现将相对温和、反复。低通胀、缓慢增长、低估值组合，使我们对2013年的A股市场持乐观谨慎的预期。

在投资策略上，超大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ETF及基金紧密跟踪上证超级大盘指数，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程序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、运作部负责人等组成，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：保证基金估值的公平、合理，制订健全、有效的估值政策及程序；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义务，当存在异议时，托管银行有责任督促基金管理人作出合理解释，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

本基金基金合同规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配2次，每次分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；基金收益分配后每一基金份额净值不得低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不得低于面值。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期内本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

5) 基金管理人

5.1报告期内基金托管人遵守情况说明

本报告期，中国建设银行作为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合同人应尽的义务。

5.2管理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基金资产的运作有违反法律法规及基金合同规定的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3管理人对本报告期内基金净值信息的真实、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。

5.4审计报告

本托管人已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告，投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

7) 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：2012年12月31日

资产	附注	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	41,940,340.02	50,459,683.57
结算备付金			
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	840,153,260.00	961,273,176.00
其中：股票投资			48,576.00
基金投资			961,224,600.00
债券投资			
买入返售金融资产	7.4.7.3		
应收证券清算款	7.4.7.4	2,900,863.75	1,227,490.19
应收利息	7.4.7.5	9,211.22	11,179.46
应收股利			
应收申购款			228,552.74
递延所得税资产			44,460.91
其他资产	7.4.7.6	885,482,227.73	1,013,315,990.13
资产总计		885,482,227.73	1,013,315,990.13
负债和所有者权益	附注	2012年12月31日	2011年12月31日
负债：			
短期借款			
交易性金融负债			
衍生金融负债	7.4.7.3		
卖出回购金融资产款			
应付证券清算款		870.90	
应付赎回款		2,023,923.71	309,505.71
应付管理人报酬		16,806.39	22,361.52
应付托管费		3,361.31	4,472.29
应付销售服务费			
应付交易费用	7.4.7.7	11,436.85	7,691.19
应交税费			
应付利息			
应付利润			
递延所得税负债			
其他负债	7.4.7.8	403,110.03	511,042.85
负债合计		2,459,509.19	855,073.56
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,211,204,836.12	1,616,232,363.10
未分配利润	7.4.7.10	-328,182,117.58	-603,771,446.53
所有者权益合计		883,022,718.54	1,012,460,916.57
负债和所有者权益总计		885,482,227.73	1,013,315,990.13

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.7290元，基金份额总额1,211,204,836.12份。

7.2附注表

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：2012年1月1日至2012年12月31日

项目	附注	本期 2012年1月1日至2012年 12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 12月31日
一、收入		149,381,927.68	-204,310,375.53
1.利息收入		321,771.70	471,150.09
其中：存款利息收入	7.4.7.11	321,771.70	471,150.09
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)		-78,840,457.82	-35,185,549.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-602,265.86	-1,600,678.93
基金投资收益	7.4.7.13	-78,238,191.96	-34,059,431.63
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	474,561.11
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	227,542,493.64	-170,043,149.30
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	358,120.16	447,173.13
减：费用		1,131,090.94	1,407,291.11
1.管理人报酬		215,120.89	409,615.51
2.托管费		43,024.22	81,923.08
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	511,022.17	531,140.22
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	361,923.66	384,612.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		148,250,836.74	-205,717,666.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		148,250,836.74	-205,717,666.64

7.3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：2012年1月1日至2012年12月31日

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,616,232,363.10	-603,771,446.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	148,250,836.74
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)	-405,027,526.98	127,338,492.21
其中：1.基金申购款	69,433,089.68	-22,033,600.08
2.基金赎回款	-474,460,616.66	149,372,092.29
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)	1,211,204,836.12	-328,182,117.58

报告期末所有者权益的组成情况

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：何宝 主管会计工作负责人：王德英 会计机构负责人：成江

7.4.1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保持一致的说明

7.4.2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保持一致的说明

7.4.3关联方名称

7.4.4关联方交易

7.4.5关联方交易

7.4.6关联方交易

7.4.7关联方交易

7.4.8关联方交易

7.4.9关联方交易

7.4.10关联方交易

7.4.11关联方交易

7.4.12关联方交易

7.4.13关联方交易

7.4.14关联方交易

7.4.15关联方交易

7.4.16关联方交易

7.4.17关联方交易

7.4.18关联方交易

7.4.19关联方交易

7.4.20关联方交易

7.4.21关联方交易

7.4.22关联方交易

7.4.23关联方交易

7.4.24关联方交易

7.4.25关联方交易

7.4.26关联方交易

7.4.27关联方交易

7.4.28关联方交易

7.4.29关联方交易

7.4.30关联方交易

7.4.31关联方交易

7.4.32关联方交易

7.4.33关联方交易

7.4.34关联方交易

7.4.35关联方交易

7.4.36关联方交易

7.4.37关联方交易

7.4.38关联方交易

7.4.39关联方交易

7.4.40关联方交易

7.4.41关联方交易

7.4.42关联方交易

7.4.43关联方交易

7.4.44关联方交易

7.4.45关联方交易

7.4.46关联方交易

7.4.47关联方交易

7.4.48关联方交易

7.4.49关联方交易

7.4.50关联方交易

7.4.51关联方交易

7.4.52关联方交易

7.4.53关联方交易

7.4.54关联方交易

7.4.55关联方交易

7.4.56关联方交易

7.4.57关联方交易

7.4.58关联方交易

7.4.59关联方交易

7.4.60关联方交易

7.4.61关联方交易

7.4.62关联方交易

7.4.63关联方交易

7.4.64关联方交易

7.4.65关联方交易

7.4.66关联方交易

7.4.67关联方交易

7.4.68关联方交易

7.4.69关联方交易

7.4.70关联方交易

7.4.71关联方交易

7.4.72关联方交易

7.4.73关联方交易

7.4.74关联方交易

7.4.75关联方交易

7.4.76关联方交易

7.4.77关联方交易

7.4.78关联方交易

7.4.79关联方交易

7.4.80关联方交易

7.4.81关联方交易

7.4.82关联方交易

7.4.83关联方交易

7.4.84关联方交易

7.4.85关联方交易

7.4.86关联方交易

7.4.87关联方交易

7.4.88关联方交易

7.4.89关联方交易

7.4.90关联方交易

7.4.91关联方交易

7.4.92关联方交易

7.4.93关联方交易

7.4.94关联方交易

7.4.95关联方交易

7.4.96关联方交易

7.4.97关联方交易

7.4.98关联方交易

7.4.99关联方交易

7.4.100关联方交易

7.4.101关联方交易

7.4.102关联方交易

7.4.103关联方交易

7.4.104关联方交易

7.4.105关联方交易

7.4.106关联方交易

7.4.107关联方交易

7.4.108关联方交易

7.4.109关联方交易

7.4.110关联方交易