

上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:2015年7月18日

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		36,914,522.34	10.32
B 采矿业		133,643,662.74	37.26
C 制造业		—	—
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		—	—
E 建筑业		17,151,291.54	4.90
F 批发和零售业		—	—
G 交通运输、仓储和邮政业		16,258,119.08	4.56
H 住宿和餐饮业		—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业		16,519,332.66	4.34
J 金融业		119,224,015.30	33.26
K 房地产业		—	—
L 租赁和商务服务业		—	—
M 科学研究和技术服务业		—	—
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		13,105,116.16	3.79
S 综合		—	—
合计		362,144,060.91	96.49

投资目标:紧密跟踪上证超级大盘指数,追求跟踪误差的最小化。
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构成比例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,其预期风险及预期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,并可能因此面临投资风险,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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时上证大盘ETF
场内简称	超大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31日
报告期末基金份额总额	131,648,002,000.00

投资目标:紧密跟踪上证超级大盘指数,追求跟踪误差的最小化。

本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的构成比例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,其预期风险及预期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,并可能因此面临投资风险,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。

基金销售机构: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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	267,738,194.24
2.本期利润	68,291,320.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.4467
4.期末基金份额净值	367,544,062.06
5.期末基金份额净值	2,715.0

注:本期已实现收益指基金本期收入扣减所有费用后的余额,即本期利润加上本期公允价值变动收益。

在上述基金业绩指标中不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平将低于所列数字。

§ 2.1 基金净值表现

单位:人民币元

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	7.80%	2.0%	7.33%	2.0%

注:本基金净值增长率是扣除管理费后的净值增长率。

注:本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率之差为-0.53%,-0.02%。

3.2.2 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

注:本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

注:本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