

# 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

## 2017年第四季度报告

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  
报告期出日期:二〇一八年一月二十日  
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
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2018年1月10日复核了本报告中的财务指标、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财产，但不保证基金一定盈利。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期末未持有货币基金份额。

本报告期末无货币基金份额。

2.1 基金产品概况

基金简称:博时上证超大盘ETF联接

基金代码:000613

交易方式:交易所开放式

基金运作方式:交易型开放式指数基金的联接基金

基金经理姓名:同上

2009年12月26日

报告期末基金份额总额:9,619,236,006份

投资目标:通过投资于上证超大盘指数成份股，紧密跟踪标的指数，力争在扣除相关费用后取得超越大盘指数的收益，追求净资产的稳定增值。

投资策略:本基金主要投资于上证超大盘指数成份股，紧密跟踪标的指数，力争在扣除相关费用后取得超越大盘指数的收益，追求净资产的稳定增值。

业绩比较基准:上证超大盘指数收益率×90%+银行存款利率×10%

风险收益特征:本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险收益较高的开放式基金。

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:上证超大盘交易型开放式指数证券投资基金

基金代码:510020

基金运作方式:交易型开放式指数基金

基金经理姓名:同上

2009年12月26日

报告期末基金份额总额:210,804,167,000份

投资目标:通过投资于上证超大盘指数成份股，紧密跟踪标的指数，力争在扣除相关费用后取得超越大盘指数的收益，追求净资产的稳定增值。

投资策略:本基金主要投资于上证超大盘指数成份股，紧密跟踪标的指数，力争在扣除相关费用后取得超越大盘指数的收益，追求净资产的稳定增值。

业绩比较基准:上证超大盘指数收益率×90%+银行存款利率×10%

风险收益特征:本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险收益较高的开放式基金。

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 基金产品说明

基金名称:上证超大盘交易型开放式指数证券投资基金

基金代码:510020

基金运作方式:交易型开放式指数基金

基金经理姓名:同上

2009年12月26日

报告期末基金份额总额:210,804,167,000份

投资目标:通过投资于上证超大盘指数成份股，紧密跟踪标的指数，力争在扣除相关费用后取得超越大盘指数的收益，追求净资产的稳定增值。

投资策略:本基金主要投资于上证超大盘指数成份股，紧密跟踪标的指数，力争在扣除相关费用后取得超越大盘指数的收益，追求净资产的稳定增值。

业绩比较基准:上证超大盘指数收益率×90%+银行存款利率×10%

风险收益特征:本基金为股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险收益较高的开放式基金。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年10月1日-2017年12月31日)

1.本期已实现收益 7,425,106.20

2.本期利润 13,086,060.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0663

4.期末基金资产净值 210,804,167.00

5.期末基金份额净值 1.000

注:本报告期内收取的利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和扣除相关费用后的余额,即本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金定期报告不包括持有人交易基金的费用,计算用以报告期间的平均实际收益水平将低于所列数字。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,本基金基金份额净值为1.0400元,份额累计净值为1.0400元。报告期内,本基金

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

注:上述任一日日期,兼任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写,证券从业的含义从协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.6 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定,恪尽职守,勤勉尽责,没有损害基金持有人利益的行为。

4.7 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日,本基金基金份额净值为1.0400元,份额累计净值为1.0400元。报告期间内,本基金

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

注:上述任一日日期,兼任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写,证券从业的含义从协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.8 影响投资者决策的重要因素

报告期内,本基金不存在影响投资者决策的重大因素。

4.9 公平交易专项说明

4.9.1 平均数原则的说明

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金公平交易制度指导意见》和公司制定的

公平交易制度,未发现明显违反公平交易制度的情况。

4.9.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金公平交易制度指导意见》和公司制定的

公平交易制度,未发现明显违反公平交易制度的情况。

4.9.3 其他

本基金不存在异常交易行为。

4.10 管理人对旗下所有基金进行综合评价

本基金综合评价:本基金的综合评价为A级。

4.11 管理人对本基金的管理是否得当

本基金的管理得当。

4.12 管理人对基金持续经营能力的评价

本基金持续经营能力正常。

4.13 管理人对基金的风险揭示

本基金的风险揭示:本基金的预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市

场基金,属于高风险收益较高的开放式基金。

4.14 管理人对基金的未来业绩做出的预测

本基金的未来业绩预测:本基金的未来业绩存在不确定性。

4.15 管理人对本基金的估值方法

本基金的估值方法:本基金的估值方法符合有关规定。

4.16 管理人对基金的流动性风险做出的评估

本基金的流动性风险评估:本基金的流动性风险适中。

4.17 管理人对基金的风险等级的评价

本基金的风险等级:本基金的风险等级为R3。

4.18 管理人对基金的合规性做出的评估

本基金的合规性评估:本基金的合规性符合相关法律法规的规定。

4.19 管理人对基金的透明度做出的评估

本基金的透明度评估:本基金的透明度符合相关法律法规的规定。

4.20 管理人对基金的声誉做出的评估

本基金的声誉评估:本基金的声誉良好。

4.21 管理人对基金的客户服务做出的评估

本基金客户服务评估:本基金客户服务良好。

4.22 管理人对基金的廉洁自律做出的评估

本基金廉洁自律评估:本基金廉洁自律。

4.23 管理人对基金的公平对待做出的评估

本基金公平对待评估:本基金公平对待。

4.24 管理人对基金的合规经营做出的评估

本基金合规经营评估:本基金合规经营。

4.25 管理人对基金的内部控制做出的评估

本基金内部控制评估:本基金内部控制健全。

4.26 管理人对基金的公平交易做出的评估

本基金公平交易评估:本基金公平交易。

4.27 管理人对基金的合规管理做出的评估

本基金合规管理评估:本基金合规管理。

4.28 管理人对基金的合规操作做出的评估

本基金合规操作评估:本基金合规操作。

4.29 管理人对基金的合规宣传做出的评估

本基金合规宣传评估:本基金合规宣传。

4.30 管理人对基金的合规销售做出的评估

本基金合规销售评估:本基金合规销售。

4.31 管理人对基金的合规服务做出的评估

本基金合规服务评估:本基金合规服务。

4.32 管理人对基金的合规信息披露做出的评估

本基金合规信息披露评估:本基金合规信息披露。

4.33 管理人对基金的合规风险管理做出的评估

本基金合规风险管理评估:本基金合规风险管理。

4.34 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.35 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.36 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.37 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.38 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.39 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.40 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.41 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.42 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.43 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.44 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。

4.45 管理人对基金的合规文化建设做出的评估

本基金合规文化建设评估:本基金合规文化建设。