

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
报告送出日期：二〇一八年一月二十日

§1 重要提示
基金管理人及董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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19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，也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年10月1日起至12月31日止

2.1 基金产品概况

基金简称	博时上证超级大盘ETF联接
基金代码	050013
交易代码	050013
基金运作方式	交易型开放式指数基金联接基金
基金合同生效日	2009年12月28日
报告期末基金份额总额	209,619,230.06
投资目标	通过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，紧密跟踪标的指数即上证超级大盘指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过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，紧密跟踪标的指数即上证超级大盘指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。
业绩比较基准	上证超级大盘指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金，债券基金与货币市场基金，属于高风险收益的投资品种。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。
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

2.2 目标基金基本情况

基金名称	博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	050003
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28日
基金份额上市证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年3月19日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
2.2.1 目标基金产品说明	
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过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，紧密跟踪标的指数即上证超级大盘指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。
业绩比较基准	上证超级大盘指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金，债券基金与货币市场基金，属于高风险收益的投资品种。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年10月1日至2017年12月31日)
1.本期已实现收益	7,426,126.29
2.本期基金份额持有人应得利息	13,086,066.66
3.期末可供基金份额持有人分配的利润	6,627,093.62
4.期末基金资产净值	218,007,622.19
5.期末基金份额净值	1.0400

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数字。

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：二〇一八年一月二十日

§1 重要提示
基金管理人及董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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19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，也不保证基金份额持有人不受损失。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年10月1日起至12月31日止

2.1 基金产品概况

基金简称	博时上证自然资源ETF联接
基金代码	060004
交易代码	060004
基金运作方式	交易型开放式指数基金联接基金
基金合同生效日	2012年4月10日
报告期末基金份额总额	71,636,965.07
投资目标	通过主要投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即上证自然资源指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即上证自然资源指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。
业绩比较基准	上证自然资源指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金，债券基金与货币市场基金，属于高风险收益的投资品种。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。
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

2.2 目标基金基本情况

基金名称	博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	050101
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2012年4月10日
基金份额上市证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年5月11日
基金管理人名称	博时基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
2.2.1 目标基金产品说明	
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即上证自然资源指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。
业绩比较基准	上证自然资源指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合基金，债券基金与货币市场基金，属于高风险收益的投资品种。本基金为被动式投资策略，主要采用完全复制策略，即按照标的指数的构成，以最小化跟踪误差为原则，进行资产配置。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2017年10月1日至2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,666,892.87
2.本期基金份额持有人应得利息	-0.0344
3.期末可供基金份额持有人分配的利润	56,710,277.32
4.期末基金资产净值	67,091.62
5.期末基金份额净值	0.9796

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

截至2017年12月31日，本基金基金份额的净值增长率为-3.77%，同期业绩比较基准收益率为-4.33%。
4.6 报告期内基金份额持有人或基金资产净值预警说明
无。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	469,471.00	0.70
其中：股票	469,471.00	0.70	
2	基金投资	53,351,076.00	91.71
3	固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-	
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	其他金融资产投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他	-	-
9	合计	53,820,547.00	100.00

5.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,312.00	0.01
B	采矿业	229,713.00	0.41
C	制造业	171,367.00	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
S	综合	4,070.00	0.01
合计	469,471.00	0.72	

5.1.3 报告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

序号	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4	600111 北方稀土	1,300	18,967.00	0.03
5	600028 中国石化	2,900	17,771.00	0.03
6	600516 方大特钢	600	17,380.00	0.03
7	601226 陕西能源	2,100	17,136.00	0.03
8	601857 中国石油	2,100	16,980.00	0.03
9	602799 华友钴业	200	16,040.00	0.03
10	600647 山东墨龙	600	15,050.00	0.03

5.1.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600460 中国银证	5,600	37,302.00	0.07
2	601088 中国国旅	900	20,853.00	0.04
3	601899 紫金矿业	4,900	20,186.00	0.04
4				