上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012年第1号）

上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可［2009］1258号文核准《核准日期2009年11月26日》募集。本基金的基金合同于2009年12月29日正式生效。本基金为交易型上市开放式指数基金。

重要提示

博时基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者在申购本基金前应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年12月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：	博时基金管理有限公司
注册地址：	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
办公地址：	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦29层
法定代表人：	杨鹤
成立时间：	1998年7月13日
注册资本：	1亿元人民币
存续期间：	持续经营
联系人：	李雪松
联系电话：	（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字［1998］26号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份49%；中国长城资产管理公司，持有股份25%；天津港（集团）有限公司，持有股份6%；瑞安实业有限公司，持有股份6%；上海盛业资产管理有限公司，持有股份6%；丰益实业发展有限公司，持有股份6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份2%。注册资本为1亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设十五个直属部门和两大销售业务体系，分别是：研究部、特定资产管理部、交易部、固定收益部、股票投资部、产品规划部、市场部、基金运作部、总裁办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、监察法律部、风险管理部、宏观策略部、零售业务和机构业务。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。特定资产管理部负责特定资产的管理和客户咨询服务。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。固定收益部负责进行固定收益证券的研究、选择和组合管理。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计与精算等企业年金咨询工作。市场部负责基金营销策划、品牌推广等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。总裁办公室专门负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、外事活动管理、档案管理、董事会、党办及工会工作。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT系统安全及数据备份等工作。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。宏观策略部负责国内外宏观经济研究，并提供针对性的投资策略。零售业务下辖零售区域、客户服务中心、电子商务部和渠道产品组，负责公司全国范围内的零售客户、渠道销售、直销运作和服务工作。其中，零售区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。电子商务部负责公司电子商务业务的发展、各部门使用公司官方网站营销资源的归口管理和公司直销网上交易平台的建设与管理工作。渠道产品组负责公司的银行渠道开拓、销售推广服务工作，以及公司产品销售前包装整合工作。机构业务负责公司全国范围内的机构客户销售和服务工作。机构业务下辖养老金业务部、战略客户部、机构理财部-上海、机构理财部-南方和券商渠道组。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构理财部-上海和机构理财部-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。券商渠道组负责券商渠道的开拓和销售服务。另设非独立核算盈亏的北京分公司、上海分公司、沈阳分公司和郑州分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳和郑州人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳和郑州处理公务人员给予协助。此外，还设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。

截止到2011年12月29日，公司总人数343人，其中64.5%以上的员工具有硕士以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

杨鹤女士，硕士，董事长，中国证券业协会副会长，深圳市五届人大代表。1983年起历任中国银行国际金融研究所助理研究员、香港中银集团经济研究部副研究员、招商银行证券部总经理、深圳中大投资管理公司常务副总经理、长盛基金管理公司副总经理、中信基金管理公司总经理、招商银行独立董事。现任招商证券股份有限公司董事、总裁。2008年7月起，任博时基金管理有限公司董事会董事长。

肖风先生，博士，副董事长。1989年起先后在深圳康佳电子集团股份有限公司、中国人民银行深圳经济特区分行工作，1993年进入深圳市证券监管办公室工作，历任副处长、处长、证管办副主任。1998年4月起负责筹建博时基金管理有限公司，任博时基金管理有限公司副董事长、总经理。现任博时基金管理有限公司副董事长。

汤维清先生，硕士，董事。1988年起历任成都探矿工艺研究所工程师、深圳天极光电技术股份有限公司投资部经理、总经理助理，深圳中大投资管理有限责任公司总裁助理、副总经理，中信基金管理有限责任公司副总经理，招商证券股份有限公司总裁助理。现任招商证券股份有限公司副总裁，分管研究业务、资产管理业务、直接投资业务。2008年7月起，任博时基金管理有限公司董事会董事。

王金宝先生，硕士，董事。1988年起在上海同济大学数学系工作，任教师。1995年4月进入招商证券股份有限公司，历任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、证券投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理。现任招商证券股份有限公司机构业务董事总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司董事会董事。

桑自国先生，博士后，董事。1993年起历任山东证券投资银行部副总经理、中经信投资公司总经理助理、中经证券有限公司筹备组组长、永汇信用担保有限公司董事长、总经理、中国华融资产管理公司投资事业部副总经理。现任中国长城资产管理公司投资银行事业部副总经理（主持工作）。2011年7月起，任博时基金管理有限公司董事会董事。

陈小鲁先生，独立董事。1968年加入中国人民解放军，历任战士、班长、排长、副指导员、团政治处副主任、主任。1979年起历任中国人民解放军总参谋部二部参谋、中华人民共和国驻英国大使馆国防副武官、北京国际战略问题研究学会副秘书长、亚龙湾开发股份有限公司总经理、标准国际投资管理公司董事长。2001年4月起，任博时公司独立董事。

赵榆江女士，独立董事。1978年起历任中华人民共和国外交部外交学会北美处研究人员、国家经济体制改革委员会研究人员、英国高诚证券（HK）有限公司董事、北京代表处首席代表、法国兴业证券（HK）有限公司董事总经理、康联马洪（中国）投资管理有限公司董事、高级投资顾问。2001年4月起，任博时基金管理有限公司董事会独立董事。

姚朝先生，独立董事。1985年起历任中国人民大学财政金融讲师、中国经济体制改革研究所微观研究室主任助理、中国社会科学院农村发展研究所副研究员、海南汇通国际信托投资公司任证券业务部副总经理、汇通深圳证券业务部总经理、中国社会科学院经济文化研究中心副主任。2001年4月起，任博时基金管理有限公司董事会独立董事。

2.基金管理人监事会成员

车晓昕女士，硕士，监事。1983年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司监事。

彭毛字先生，学士，监事。1982年8月起历任中国农业银行总行农贷部国营农业信贷处科员、副处长、中国农业发展银行开发信贷部扶贫信贷处处长、中国农业银行信贷管理三部扶贫贷款管理处处长、中国农业银行总行项目评估部副总经理、金桥金融咨询公司副总经理。1999年12月至2011年1月在中国长城资产管理公司工作，先后任评估咨询部副总经理、债权管理部（法律事务部）副总经理、南宁办事处副总经理（党委委员）、监察审计部（纪委办公室）总经理。2007年12月至今兼任新疆长城金融租赁有限公司监事会主席。2011年1月至今任中国长城资产管理公司控股子公司专职监事（总经理级）。2011年7月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

贺广清先生，博士，监事。1987年起历任南军后勤学院财务教研室教员、中国银行塘沽分行会计科员工、中国银行塘沽分行计财科副科长、中国银行塘沽分行计财科科长、中国银行塘沽支行副行长，现任天津港财务有限公司总经理。2010年4月起，任博时基金管理有限公司监事。

杨林峰先生，硕士，监事。1988年8月就职于国家纺织工业部，1992年起历任华源集团控股之上市公司董秘、副总经理、常务副总经理，上海市国资委直属上海大盛资产有限公司战略投资部副总经理。现任上海盛业资产管理有限公司执行董事、总经理。2011年7月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

郑波先生，博士，监事。2001年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司监事。

林琦先生，硕士，监事。1998年起历任南天信息系统集成公司任软件工程师、北京万豪力霸电子科技公司任技术经理、博时基金管理有限公司MIS系统分析员、东方基金管理有限公司总经理助理、博时基金管理有限公司信息技术部副总经理。现任博时基金管理有限公司信息技术部总经理。2010年4月起，任博时基金管理有限公司监事。

3.公司高管人员

杨鹤女士，简历同上。

何宝先生，经济学博士，总经理。1998年起曾先后在上海飞机制造厂、全国社保基金理事会投资部、中国投资公司投资部工作。2011年9月加入博时基金管理有限公司，现任公司总经理。

王德英先生，硕士。1995年起先后任北京清华计算机公司开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部工作。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理、电脑部副经理及信息技术部总经理。现任公司副总裁。

杨锐先生，1999年7月毕业于南开大学国际经济研究所，获经济学博士学位，副总经理。1999年8月加入博时基金管理有限公司，历任研究部宏观研究员、博时价值增长混合基金经理助理、研究部副总经理兼策略分析师。2005年至2006年由博时公司派往纽约大学Stern商学院做访问学者，期间在Alliancebersteih的股票投资部门学习。2006年5月至今担任博时平衡配置混合基金经理。2007年后曾兼任博时价值增长混合基金经理、博时价值增长贰号混合基金经理、股票投资部总经理。现任公司副总经理，兼混合组投资总监、博时平衡配置混合基金经理、博时大中华亚太精选股票（QDII）基金经理、博时回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

董良泓先生，CFA、MBA，副总经理。1993年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005年2月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票基金经理，特定资产高级投资经理，研究部总经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理。现任公司副总经理，兼任特定资产管理部总经理、特定资产高级投资经理、社保股票基金经理。

李志惠先生，经济学博士，副总经理。1993年7月起先后在深圳市住宅局房改处、深圳市委政策研究室城市研究处、深圳市委政策研究室综合处工作。2004年9月加入博时基金管理有限公司，历任行政与人力资源部副总经理、总裁办公室总经理兼董事会秘书。现任公司副总经理，兼任机构业务董事总经理、董事会秘书。

李雪松先生，经济学硕士，副总经理。1988年起先后在北京市财政局统计科、日本大和证券综合研究所、中信证券、北京玖方量子软件技术公司工作。2001年3月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程小组金融工程师、市场部南方区域销售主管、市场部南方大区总经理、北京分公司总经理。现任公司副总经理，兼任零售业务部董事总经理。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理。现任公司副总经理，兼任固定收益部总经理、社保债券基金基金经理。

孙麒清女士，商法学硕士。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，曾任监察法律部法律顾问，现任公司督察长兼监察法律部总经理。

4.本基金基金经理

王政先生，1966年生，博士。1995年毕业于美国普林斯顿大学，获博士学位。1995年至1997年在哈佛大学从事博士后研究工作。1997年起先后在美国新泽西州道琼斯公司、美国新泽西州彭博公司研发部、美国加州巴克莱全球投资公司工作。2009年5月加入博时基金管理有限公司，曾任博时大中华亚太精选股票基金（QDII）基金经理（2010年7月27日至2011年11月10日），现任股票投资部总经理、ETF组投资总监、上证超大ETF及联接基金（2010年1月5日至今）、深证基本面200ETF及联接基金（2011年6月10日至今）的基金经理。

本基金历任基金经理：张晓军先生，2009年12月29日至2010年4月28日担任本基金的基金经理。

5.投资决策委员会成员

主任委员：何宝

委员：杨锐、邵凯、董良泓、夏春、张志峰、王政、张峰、温宇峰、马越、魏风春。

何宝先生，简历同上。

杨锐先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

董良泓先生，简历同上。

夏春先生，经济学硕士。1996年毕业于上海交通大学管理工程系。1996年起先后在上海永道（现为普华永道）会计财务咨询公司、招商证券研发中心策略部工作。2004年2月加入博时基金管理有限公司，历任研究部宏观与策略研究员、研究部副总经理、兼任策略分析师、博时平衡配置基金基金经理助理。现任首席策略分析师、博时价值增长基金、博时价值增长贰号基金基金经理。

张志峰先生，数学博士。1996年5月起先后于摩根士丹利集团、巴克莱全球投资集团、LABRENCHE STRUCTUR PRODUCTS工作。2008年1月加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部另类投资组投资总监。

王政先生，简历同上。

张峰先生，博士。1988年起先后在Haugen Finnancial System、花旗集团TIMCO资产管理部、摩根士丹利投资公司、ASTEN INVESTMENT ADVISORS工作。2010年2月加入博时基金管理有限公司，任股票投资部成长组投资总监、博时裕富沪深300指数基金基金经理。

温宇峰先生，硕士。1994年起先后在中国证监会发行部、中银国际控股公司、博时基金管理有限公司、上投摩根基金管理公司、Prime Capital、Fidelity International Limited（Hong Kong）从事投资、研究工作。2010年6月加入博时基金管理有限公司，现任股票投资部成长组投资副总监兼博时裕隆封闭基金经理。

魏风春先生，经济学博士。1993年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011年8月正式加入博时基金管理有限公司，任宏观策略部总经理。

马越女士，硕士。2001年起先后在华夏基金担任研究员，雷曼兄弟担任研究员，花旗集团担任亚洲交通运输组主管/董事。2011年5月9日加入博时基金管理有限公司，现任研究部总经理。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］12号

联系人：尹　东

联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2011年3月31日，中国建设银行资产总额113,125.16亿元，较上年末增加5,021.99亿元，增长4.65%。2011年一季度，中国建设银行实现净利润472.33亿元，较上年同期增长34.23%；年化平均资产回报率1.71%，年化加权平均净资产收益率26.19%；利息净收入716.30亿元，较上年同期增长25.27%；净利差为2.58%，净利息收益率为2.69%，分别较上年同期提高0.28和0.30个百分点；手续费及佣金净收入231.54亿元，较上年同期增长37.29%。其中，结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长，收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）39,874台，拥有员工313,867人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位，在“全球银行品牌500强”列第13位，并被评为2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年6月30日，中国建设银行已托管195只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rateol），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1.申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

（1）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670161

客户服务电话：95521

网址：http://www.gtja.com

（2）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客户服务电话：4008888108

网址：http://www.csc108.com

（3）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：http://www.guosen.com.cn

（4）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82943636

客户服务电话：4008888111；95565

网址：http://www.newone.com.cn

（5）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：林治海

联系人：黄凤

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：http://www.gf.com.cn

（6）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南路7088号招商银行大厦A层

办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84588888

传真：010-84865560

客户服务电话：010-84588888

网址：http://www.cs.ecitic.com

（7）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层

法定代表人：顾伟国

联系人：李洋

电话：010-66568047

传真：010-66568536

客户服务电话：4008888888

网址：http://www.chinastock.com.cn

（8）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021-63602722

客户服务电话：95553

网址：http://www.htsec.com

（9）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

联系人：黄维琳、曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客户服务电话：95523

网址：http://www.sywg.com

（10）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

办公地址：上海浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565783

客户服务电话：4008888123

网址：http://www.xyzq.com.cn

（11）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579；4008-888-999

网址：http://www.95579.com

（12）欧信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国风凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

客户服务电话：4008001001

网址：http://www.essences.com.cn

（13）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦

法定代表人：王珠林

联系人：陈诚

电话：023-63786464

传真：023-63810422

客户服务电话：4008096096

网址：http://www.swsc.com.cn

（14）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层

法定代表人：刘军

联系人：丁思聪

电话：0571-87112510

传真：0571-85783771

客户服务电话：0571-96598

网址：http://www.96598.com.cn

（15）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：张威

电话：025-84457777

传真：025-84579763

客户服务电话：95597

网址：http://www.htsc.com.cn

（16）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：0532-96577

网址：http://www.zxwt.com.cn

（17）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888-3108

传真：021-63326173

客户服务电话：95503

网址：http://www.dfzq.com.cn

（18）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

客户服务电话：4006666888

网址：http://new.cgws.com

（19）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：021-22169081

传真：021-22169134

客户服务电话：4008888788；95525

网址：http://www.ebscn.com

（20）新商证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

办公地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人：吴承根

联系人：吴颖

电话：0571-87902080

传真：0571-87901913

客户服务电话：0571-967777

网址：http://www.stocke.com.cn

（21）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626172

传真：0755-82400862

客户服务电话：4008816168

网址：http://www.pingan.com

（22）齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

办公地址：山东省济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客户服务电话：95538

网址：http://www.qlzq.com.cn

（23）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号

办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客户服务电话：0931-4890619　4890618　4890100

网址：http://www.hlzqgs.com

（24）财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市解放路111号

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87925100

客户服务电话：96336（上海地区962336）

网址：http://www.ctsec.com

（25）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客户服务电话：4006008008

网址：http://www.cjis.cn

（26）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人：陈林

联系人：徐方亮

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898；021-38929908

网址：http://www.cnhbstock.com

2.二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3.基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

联系人：陈龙

电话：（021）58876741

传真：（021）68870311

（三）律师事务所

机构名称：国浩律师集团（北京）事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层

办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层

电话：010-65890699

传真：010-65176800

联系人：黄伟民

经办律师：黄伟民、陈周

（四）会计师事务所

机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区东昌路568号

办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：张鸿

经办注册会计师：汪律、张鸿

四、基金的名称

上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

交易型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

八、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成份股组成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。但因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

在法律法规允许的情况下，基金管理人在履行相应程序后可以使用相关金融衍生工具，以更好地实现基金的投资目标。但基金管理人使用相关金融衍生工具必须是以提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差等为目的，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

（一）股资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

（二）股资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策，以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整及基金每日申购赎回清单的编制等决策。

（三）股资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合，构成了本基金的投资管理程序。

1.研究。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台，整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果，开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

2.投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告，定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会议，对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策。

3.组合构建。结合研究报告，基金经理主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成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。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险。

4.交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行，交易部同时履行一线监控的职责。

5.投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，并撰写相关的绩效评估报告，确认基金组合是否实现了投资预期，投资策略是否成功，并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结成检讨以往的投资策略，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。

6.组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况，结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，根据环境的变化和基金实际投资的需要，有权对上述投资程序做出调整，并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数，即上证超级大盘指数。该指数属于价格指数。

如果中证指数有限公司变更或停止上证超级大盘指数的编制及发布，或者上证超级大盘指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致上证超级大盘指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于本基金投资的指数推出，基金管理人依据维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，有权变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

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，属于高风险高收益的开放式基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证超级大盘指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

十一、基金的投资组合报告

博时基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至2011年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	1,330,711,625.63	99.35
	其中：股票	1,330,711,625.63	99.35
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	7,386,118.05	0.55
6	其他各项资产	1,300,109.03	0.10
7	合计	1,339,397,852.71	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

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