

上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

2012 年度报告摘要

2012年12月31日

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

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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法律责任。

2.1 基金基本情况
基金名称:博时上证大盘ETF
基金代码:510200

2.2 基金产品说明
投资目标:跟踪标的的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
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成份股及其权重构建基金股票投资组合。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金年度报告的全文在基金管理人网站http://www.bosera.com.cn
基金年度报告备置地点:基金管理人、基金托管人处

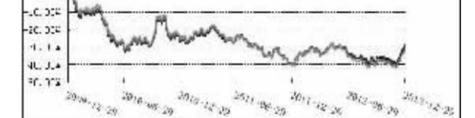
3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标

Table with 4 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 2012年, 2011年, 2010年. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 本期基金份额净值增长率, etc.

3.2 基金净值表现
3.2.1 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

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 份额净值增长率-业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, etc.

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金的基金合同于2009年12月29日生效,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内,本基金的投资组合比例符合基金合同第十一部分“(三)投资范围”、“(九)投资限制”的有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2009年12月29日生效,合同生效当年按实际存续期间计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况
无。

4.1 基金管理人及基金经理简介
4.1.1 基金管理人及基金经理的经验

4.1.2 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.3 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.4 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.5 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.6 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.7 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.8 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.9 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.10 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.11 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.12 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.13 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.1.14 基金管理人及基金经理的经验
王政,1965年5月出生于广东省广州市,1987年8月毕业于美国南加州大学,获工商管理硕士学位。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明
在本报告期内,本基金严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律法规的规定。

4.3 管理人报告期内本基金投资情况的专项说明
4.3.1 公允价值计量和公允价值情况的专项说明
在本报告期内,本基金严格按照《证券投资基金公允价值估值指导意见》及《证券投资基金公允价值估值指引》,通过系统和人工相结合的方式,分别对一级市场和二级市场的权益类及固定收益类资产的公允价值原则、流程、按照境内及境外业务进行了详细规范。

4.3.2 公允价值计量的专项说明
4.3.3 公允价值计量的专项说明
4.3.4 公允价值计量的专项说明

4.4 管理人报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明
2012年国内经济增速有所放缓,通胀下行,处于经济调整期的中期,一季度市场在资源和有色带动下,一路上涨行情,第二季度国内经济企稳,在低估值下,A股市场的估值性价比水平不断下降,市场情绪较为悲观。

4.4 管理人报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明
截至2012年12月31日,本基金份额净值为1.9457元,份额累计净值为0.7176元,报告期内,本基金份额增长率为17.28%,同期业绩比较基准为15.26%。

Table with 4 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益), etc.

Table with 4 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购减少以“-”号填列), 四、本期基金份额持有人分配股利和支付费用减少(或增加)总额, etc.

Table with 4 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 五、期末所有者权益(基金净值), 六、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益), etc.

Table with 4 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 七、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购减少以“-”号填列), 八、本期基金份额持有人分配股利和支付费用减少(或增加)总额, etc.

Table with 4 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 九、期末所有者权益(基金净值), 十、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净收益), etc.

根据财务报表附注的说明,本期资产由下列负责人签署:
基金管理人何人,何人,主管会计工作的负责人,王瑞英,会计机构负责人,或江
7.4.1 报表附注
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
7.4.1 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 关联交易
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》,财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》,财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关法规和税务操作,本报告期如下:
(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
(2) 对基金从证券市场取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂按减持50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计征20%代扣代缴个人所得税。
(4) 基金买卖股票按照0.1%的税率缴纳印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.3 关联方关系
关联方名称: 基金管理人
基金管理人: 博时基金管理有限公司(“博时基金”)
基金托管人: 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)
招商证券股份有限公司
中国长城资产管理公司
广东证券股份有限公司
天津法信(集团)有限公司
上海浦东发展银行股份有限公司
上海海证股权投资管理有限公司
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(“联接基金”)
注:下述关联交易均符合正常业务范围内一般商业条款订立。
7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.4.2 关联方报酬
7.4.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with 4 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付给基金管理人的机构户管理费, etc.

Table with 4 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年12月31日, 2011年1月1日至2011年12月31日, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 其中:支付给基金管理人的机构户托管费, etc.

7.4.4.2.2 基金托管费
单位:人民币元
项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日 上年度可比期间
当期发生的基金应支付的托管费 5,566,161.91 7,771,903.24

7.4.4.2.3 其他关联方交易
7.4.4.2.3.1 其他关联方交易
7.4.4.2.3.2 其他关联方交易
7.4.4.2.3.3 其他关联方交易

7.4.4.2.3.4 其他关联方交易
7.4.4.2.3.5 其他关联方交易
7.4.4.2.3.6 其他关联方交易

7.4.4.2.3.7 其他关联方交易
7.4.4.2.3.8 其他关联方交易
7.4.4.2.3.9 其他关联方交易

7.4.4.2.3.10 其他关联方交易
7.4.4.2.3.11 其他关联方交易
7.4.4.2.3.12 其他关联方交易

7.4.4.2.3.13 其他关联方交易
7.4.4.2.3.14 其他关联方交易
7.4.4.2.3.15 其他关联方交易

7.4.4.2.3.16 其他关联方交易
7.4.4.2.3.17 其他关联方交易
7.4.4.2.3.18 其他关联方交易

7.4.4.2.3.19 其他关联方交易
7.4.4.2.3.20 其他关联方交易
7.4.4.2.3.21 其他关联方交易

7.4.4.2.3.22 其他关联方交易
7.4.4.2.3.23 其他关联方交易
7.4.4.2.3.24 其他关联方交易

7.4.4.2.3.25 其他关联方交易
7.4.4.2.3.26 其他关联方交易
7.4.4.2.3.27 其他关联方交易

7.4.4.2.3.28 其他关联方交易
7.4.4.2.3.29 其他关联方交易
7.4.4.2.3.30 其他关联方交易

7.4.4.2.3.31 其他关联方交易
7.4.4.2.3.32 其他关联方交易
7.4.4.2.3.33 其他关联方交易

7.4.4.2.3.34 其他关联方交易
7.4.4.2.3.35 其他关联方交易
7.4.4.2.3.36 其他关联方交易

7.4.4.2.3.37 其他关联方交易
7.4.4.2.3.38 其他关联方交易
7.4.4.2.3.39 其他关联方交易

7.4.4.2.3.40 其他关联方交易
7.4.4.2.3.41 其他关联方交易
7.4.4.2.3.42 其他关联方交易

7.4.4.2.3.43 其他关联方交易
7.4.4.2.3.44 其他关联方交易
7.4.4.2.3.45 其他关联方交易

7.4.4.2.3.46 其他关联方交易
7.4.4.2.3.47 其他关联方交易
7.4.4.2.3.48 其他关联方交易

7.4.4.2.3.49 其他关联方交易
7.4.4.2.3.50 其他关联方交易
7.4.4.2.3.51 其他关联方交易

7.4.4.2.3.52 其他关联方交易
7.4.4.2.3.53 其他关联方交易
7.4.4.2.3.54 其他关联方交易

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include H 民生和零售贸易, J 金融-保险业, J 房地产业, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 601166 兴业银行, 2 600000 浦发银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 3 600014 上汽集团, 4 600885 海螺水泥, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 5 600168 中国铝业, 6 600547 山东黄金, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 7 601088 中国神华, 8 600208 中国石化, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 9 600030 三一重工, 10 601288 农业银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 11 600547 山东黄金, 12 601318 中国平安, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 13 600000 浦发银行, 14 601088 中国神华, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 15 600208 中国石化, 16 600030 三一重工, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 17 600030 三一重工, 18 601088 中国神华, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 19 601088 中国神华, 20 600519 华鲁恒泰, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 601398 工商银行, 2 600111 包钢稀土, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 3 601857 中国石化, 4 601288 农业银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 5 600519 华鲁恒泰, 6 600019 宝钢股份, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 7 600050 中国联通, 8 601668 中国铝业, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 9 601318 中国平安, 10 600000 浦发银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 11 600300 中信证券, 12 600208 中国石化, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 13 601006 大秦铁路, 14 601166 兴业银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 15 600547 山东黄金, 16 601668 中国铝业, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 17 601088 中国神华, 18 600885 海螺水泥, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 19 601014 上汽集团, 20 600031 三一重工, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 601398 工商银行, 2 600111 包钢稀土, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 3 601857 中国石化, 4 601288 农业银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 5 600519 华鲁恒泰, 6 600019 宝钢股份, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 7 600050 中国联通, 8 601668 中国铝业, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 9 601318 中国平安, 10 600000 浦发银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 11 600300 中信证券, 12 600208 中国石化, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 13 601006 大秦铁路, 14 601166 兴业银行, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 15 600547 山东黄金, 16 601668 中国铝业, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 17 601088 中国神华, 18 600885 海螺水泥, etc.

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 19 601014 上汽集团, 20 600031 三一重工, etc.