上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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
报告送出日期:2015年3月28日

§1重要提示

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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	博时上证超大盘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29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
报告期末基金份额总额	337,348,002份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年3月19日

2.2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。
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。

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
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

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	-28,556,049.77	-122,606,996.73	-89,103,377.25
本期利润	289,432,037.07	-204,958,400.98	198,371,189.90
加权平均基金份额本期利润	0.6836	-0.4010	0.0321
本期基金份额净值增长率	51.40%	-21.18%	17.28%
3.1.2期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.9918	-1.1777	-0.7656
期末基金资产净值	783,268,063.05	719,481,129.69	1,107,608,244.52
期末基金份额净值	2.3218	1.5336	1.9457

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交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

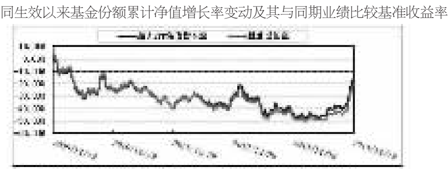
3.2基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	39.29%	1.72%	40.91%	1.73%	-1.62%	-0.01%
过去六个月	58.59%	1.37%	58.24%	1.38%	0.35%	-0.01%
过去一年	51.40%	1.25%	49.35%	1.26%	2.05%	-0.01%
过去三年	39.95%	1.35%	32.77%	1.36%	7.18%	-0.01%
过去五年	-14.88%	1.35%	-21.85%	1.36%	6.97%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-14.37%	1.35%	-19.22%	1.36%	4.85%	-0.01%

注:本基金的业绩比较基准为上证超级大盘指数。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额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



[illegible]

3.3过去三年基金的利润分配情况

无。

§4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。"为国民创造财富" 是博时的使命。博时的投资理念是"做投资价值的发现者"。截至2014年12月31日,博时基金公司共管理五十三只开放式基金,并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金,以及多个企业年金账户。博时基金资产管理净值总规模逾2363亿元人民币, 其中公募基金资产规模逾1124亿元人民币, 累计分红超过638亿元人民币,是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一,养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1)基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计,标准股票型基金中,截至12月31日,博时主题行业股票基金今年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名第6, 博时特许价值股票基金年以来净值增长率在355只标准型股票基金中排名第12;博时精选股票基金在7只同类普通股票型基金中排名前1/2;博时裕富沪深300指数基金在同类150只标准指数股票型基金中排名前1/5, 博时上证超大盘ETF及博时深证基本面200ETF在150只标准指数股票型基金中均排名前1/2; 博时上证超级大盘ETF联接及博时深证基本面200ETF联接在同类45只产品中排名前1/2。混合基金中,博时裕益灵活配置混合在34只灵活配置型基金中排名前1/4,博时价值增长混合及博时价值增长贰号混合在同类29只产品中排名前1/2; 博时平衡配置混合在同类16只产品中排名前1/2。

固定收益方面,博时信用债券(A/B类) 今年以来收益率在93只同类普通债券型基金中排名第1;博时信用债券(C类) 今年以来收益率在56只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(B类) 今年以来收益率在41只同类普通债券型基金中排名第1;博时稳定价值债券(A类)今年以来收益率在67只同类普通债券型基金中排名第2;博时转债增强债券(A类)今年以来收益率在13只可转换债券基金中排名第3;博时安丰18个月定期开放基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/3,博时信用债纯债债券基金、博时安心收益定期开放债券(A类)及博时月月薪定期支付债券基金在100只同类长期标准债券型基金中排名前1/2;博时宏观回报债券(A/B类)及博时天颐债券(A类)在93只同类普通债券型基金中分别排名第7、第8;博时现金收益货币(A类)在78只同类货币市场基金中排名前1/2。

海外投资方面业绩方面,截至12月31日,博时亚洲票息收益债券基金在同类可比7只QDII债券基金中排名第1,博时抗通胀在8只QDII商品基金中排名第1。

2)客户服务

2014年,博时基金共举办各类渠道培训及活动718场,参加人数18775人。

3)其他大事件

2014年12月18日,博时国际获得和讯海外财经风云榜"2014年度最佳中资基金公司奖";

2014年12月25日,博时基金获得金融界评选的"最佳品牌奖"。

2014年1月9日,金融界网站在北京举办"第二届领航中国2013金融行业年度颁奖典礼",博时基金荣获"2013金融界领航中国年度评选基金公司最佳品牌奖"。

2014年1月11日,在和讯网主办的2013年第十一届财经风云榜基金行业评选中,博时基金荣获"2013年度基金业最佳投资者关系奖"。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
方维玲	基金经理	2012-11-13	-	22.5	曾先后在云南大学、海南省信托投资公司证券部、湘财证券有限责任公司海口营业部、北京玖方量子软件技术公司任职。2001年3月入博时基金管理有限公司, 历任金融工程小组金融工程师、数量化投资部副总经理、产品规划部总经理、股票投资部ETF及量化投资组投资经理、博时上证超大盘ETF基金及其联接基金和博时上证自然资源ETF基金及其联接基金的基金经理助理。现任博时上证超大盘ETF基金及其联接基金、博时上证自然资源ETF基金及其联接基金、博时黄金ETF基金的基金经理。
万琼	基金经理助理	2013-09-01	-	7	2007年至2011年在华夏基金基金运作部担任基金会计,2011年3月加入博时基金管理有限公司,现任股票投资部基金经理助理。

注:上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程,按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求,公司进一步完善了《公平交易管理制度》,通过系统及人工相结合的方式,分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程,按照境内及境外业务进行了详细规范,同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.3异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为交易型开放式指数证券投资基金,为被动跟踪指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差,取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内我们严格按照基金合同要求,力求组合成份股紧密跟踪指数,利用量化的手段分析跟踪误差产生的原因,并在最小化交易成本的同时适时调仓,尽可能地减少跟踪误差。同时,在本报告期,我们严格按照基金合同要求,在指数权重及成份股变动时,尽量降低成本、减少市场冲击,逐步调整组合与目标指数的结构一致。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为2.3218元,累计净值为0.8563元。报告期内,本基金份额净值增长率为51.40%,同期业绩基准增长率为49.35%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年度,"习李新政"逐步改变了投资者对中国资本市场的传统认识,在反腐深度的大幅超预期,改革深度和广度以及执行力的超预期,以及"沪港通"的实施,市场资金的重新配置调整以及资金成本的逐步下降,多种综合因素主导2014年度中国资本市场呈现波澜壮阔的市场行情,不管是股票市场还是债券市场,市场表现均大幅超过年初各大机构的市场预期。股票市场方面,2014年最后两月彻底实现了久违的风格转换,主题投资各放异彩;从沪深300相对中证500的强弱全年走势来看,小盘风格在2014年前10个月表现较强,最后两月大盘风格实现大逆转。2014年度沪深300指数上涨51.66%,中证500指数上涨39.01%,创业板指数上涨12.83%。从行业来看,非银、建筑、钢铁、地产、交运和银行涨幅靠前,医药、食品饮料、农业、传媒、电子和家电涨幅靠后。债券方面,受股票市场的火爆,转债市场表现优异。总之,2014年度股债市场实现了双牛行情,大盘蓝筹最后时刻实现大幅逆转,在资金配置调整以及杠杆资金的快速推升下,实现了被动产品扬眉吐气的市场效应,在牛市背景下,被动跟踪市场也是市场资金最优的投资选择。

2015年中国资本市场在投资品种的逐步丰富的大背景下, 机构投资者以其专业性优势的显性体现,期货期权等产品的深度参与,资本市场的有效性逐步提升。在中国政府的积极引导下,中国资本市场将会逐步回归合理的慢性行情,将会打破历史的快牛魔咒的认知。随着基础工具的丰富和完善,以及衍生品市场的积极拓展,中国的资产配置时代将会悄悄来临。大类资产配置迎来权益类投资的英雄时代:国人最爱加杠杆争取财富"中国梦",以前是楼市,现在是股市。

我们认为2015年中国经济增速将继续下台阶, 股市受政策的支撑以及资金的关注而继续有所表现。遵循经济下、改革上的逻辑,我们认为改革依然将是资本市场的重要主题,国企改革总体方案、"一带一路"规划有可能正式发布,注册制改革也将稳步推进等,这些改革措施,都将对资本市场产生深远影响。

在投资策略上,超大盘ETF作为一只被动的指数基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,紧密跟踪上证超大盘指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过超大盘ETF基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定, 确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益,设立了博时基金管理有限公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成,基金经理原则上不参与估值委员会的工作,其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有5年以上专业工作经历,具备良好的专业经验和专业胜任能力,具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有:保证基金估值的公平、合理;制订健全、有效的估值政策和程序;确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性;定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则:基金收益评价日核定的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率达到1%以上,方可进行收益分配;在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配2次,每次基金收益分配比例不低于可供分配利润的5%, 基金的收益分配比例应当以收益分配基准日可供分配利润为基准计算;若自基金合同生效日起不满3个月,可不进行收益分配;期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况,报告期末本基金未满足收益分配条件,故不进行收益分配。

4.8基金持有人数或资产净值预警情形的说明

无。

§5托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	1,548,165.55	1,149,647.97
结算备付金	415,135.19	9,244.00
存出保证金	19,154.94	13,602.44
交易性金融资产	781,949,962.72	719,078,387.72
其中:股票投资	781,949,962.72	719,078,387.72
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	589.07	255.07
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	783,933,007.47	720,251,137.20
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	7,494.02	3,705.28
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	315,048.50	317,877.58
应付托管费	63,009.70	63,575.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	213,392.20	184,849.13
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	66,000.00	200,000.00
负债合计	664,944.42	770,007.51
所有者权益:		
实收基金	914,656,746.57	1,272,008,084.28
未分配利润	-131,388,683.52	-552,526,954.59
所有者权益合计	783,268,063.05	719,481,129.69
负债和所有者权益总计	783,933,007.47	720,251,137.20

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值2.3218元,基金份额总额337,348,002.00份。

7.2利润表

会计主体:上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
一、收入	294,502,571.50	-198,070,953.62
1.利息收入	106,696.90	16,298.06
其中:存款利息收入	106,696.90	16,298.06
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-23,604,663.48	-115,745,743.22
其中:股票投资收益	-43,559,936.97	-139,634,477.41
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	19,955,273.49	23,888,734.19
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	317,988,086.84	-82,351,404.25
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	12,451.24	9,895.79
减:二、费用	5,070,534.43	6,887,447.36
1. 管理人报酬	3,331,415.14	4,471,470.06
2. 托管费	666,283.03	894,294.00
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	646,055.26	1,060,823.30
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	426,781.00	460,860.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	289,432,037.07	-204,958,400.98
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	289,432,037.07	-204,958,400.98

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,272,008,084.28	-552,526,954.59	719,481,129.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	289,432,037.07	289,432,037.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-357,351,337.71	131,706,234.00	-225,645,103.71
其中:1.基金申购款	109,537,131.71	-37,068,423.44	72,468,708.27
2.基金赎回款	-466,888,469.42	168,774,657.44	-298,113,811.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	914,656,746.57	-131,388,683.52	783,268,063.05
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,543,410,732.14	-435,802,487.62	1,107,608,244.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-204,958,400.98	-204,958,400.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-271,402,647.86	88,233,934.01	-183,168,713.85
其中:1.基金申购款	216,091,817.62	-76,835,032.36	139,256,785.26
2.基金赎回款	-487,494,465.48	165,068,966.37	-322,425,499.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,272,008,084.28	-552,526,954.59	719,481,129.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:吴姚东　　主管会计工作负责人:王德英　　会计机构负责人:成江

7.4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相一致的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2税项

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(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。基金买卖股票的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股权的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,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	与本基金的关系
博时基金管理有限公司("博时基金")	基金管理人
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人
招商证券股份有限公司	基金管理人的股东、一级交易商
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
璟安股权投资有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
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("上证超大盘ETF联接基金")	基金管理人管理的其他基金

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

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

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,331,415.14	4,471,470.06
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

7.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	666,283.03	894,294.00

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

7.4.4.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.4.4各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.4.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,548,165.55	102,720.99	1,149,647.97	11,479.89

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.4.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.6有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于2014年度,本基金申购基金份额的对价总额为72,468,708.27元(2013年度:139,256,785.26元),其中包括以股票支付的申购款69,621,683.00元 (2013年度:137,236,833.00元) 和以现金支付的申购款2,847,025.27元(2013年度:2,019,952.26元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为781,949,962.72元,无属于第二层次和第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次的余额为685,054,573.97元,属于第二层次的余额为34,023,813.75元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票的公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(3)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	781,949,962.72	99.75
	其中:股票	781,949,962.72	99.75
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,963,300.74	0.25
7	其他资产	19,744.01	0.00
8	合计	783,933,007.47	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	71,102,364.19	9.08
C	制造业	300,651,317.03	38.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	51,043,967.52	6.52
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	34,770,321.96	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,614,046.01	9.02
J	金融业	253,767,946.01	32.40
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	-	-
	合计	781,949,962.72	99.83

8.3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

金额单位:人民币元

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(%)
1	601668	中国建筑	7,011,534	51,043,967.52	6.52
2	600030	中信证券	1,388,616	47,074,082.40	6.01
3	600036	招商银行	2,538,266	42,109,832.94	5.38
4	601166	兴业银行	2,537,382	41,866,803.00	5.35
5	600016	民生银行	3,834,402	41,718,293.76	5.33
6	600585	海螺水泥	1,873,093	41,357,893.44	5.28
7	601989	中国重工	4,476,563	41,229,145.23	5.26
8	601318	中国平安	546,008	40,792,257.68	5.21
9	600000	浦发银行	2,562,567	40,206,676.23	5.13
10	600887	伊利股份	1,352,111	38,710,937.93	4.94

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600637	百视通	40,968,917.70	5.69
2	600010	包钢股份	40,178,098.66	5.58
3	600196	复星医药	37,268,744.46	5.18
4	600018	上港集团	33,102,341.66	4.60
5	600519	贵州茅台	16,201,603.78	2.25
6	600256	广汇能源	13,371,920.85	1.86
7	601989	中国重工	11,037,983.14	1.53
8	600111	包钢稀土	10,274,618.71	1.43
9	600887	伊利股份	9,507,181.90	1.32
10	600585	海螺水泥	6,900,615.73	0.96
11	600028	中国石化	5,651,184.95	0.79
12	601668	中国建筑	2,376,683.00	0.33
13	601318	中国平安	2,310,459.81	0.32
14	600036	招商银行	2,233,759.24	0.31
15	601088	中国神华	2,190,619.95	0.30
16	600030	中信证券	2,091,184.67	0.29
17	600050	中国联通	2,023,393.00	0.28
18	601006	大秦铁路	1,629,305.97	0.23
19	601166	兴业银行	1,544,567.00	0.21
20	600016	民生银行	1,520,590.00	0.21

注:本项 "买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	40,770,700.74	5.67
2	601088	中国神华	32,511,702.47	4.52
3	600547	山东黄金	29,889,904.31	4.15
4	600031	三一重工	26,136,183.08	3.63
5	600030	中信证券	23,674,618.38	3.29
6	601989	中国重工	15,356,862.54	2.13
7	600519	贵州茅台	9,988,236.07	1.39
8	601668	中国建筑	9,185,538.33	1.28
9	600028	中国石化	7,385,764.54	1.03
10	601318	中国平安	7,197,869.35	1.00
11	600050	中国联通	6,457,713.72	0.90
12	600104	上汽集团	6,427,043.61	0.89
13	600000	浦发银行	4,422,433.45	0.61
14	600018	上港集团	3,786,992.92	0.53
15	601166	兴业银行	3,142,110.66	0.44
16	600016	民生银行	3,111,173.23	0.43
17	600036	招商银行	3,070,308.92	0.43
18	600887	伊利股份	2,129,507.84	0.30
19	600585	海螺水泥	2,019,605.34	0.28
20	600111	包钢稀土	1,425,269.18	0.20

注:本项 "卖出金额"均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	246,614,705.24
卖出股票的收入(成交)总额	240,513,949.11

注:本项 "买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12投资组合报告附注

8.12.1报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2报告期内基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,154.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	589.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,744.01

8.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9基金份额持有人信息

9.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
12,813	26,328.57	281,819,981.00	83.54%	55,528,021.00	16.46%

9.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	海通证券股份有限公司	5,228,781.00	1.55%
2	谢曼琪	1,060,000.00	0.31%
3	刘自敏	1,000,000.00	0.30%
4	江珊	899,275.00	0.27%
5	国都证券-工商银行-国都安心得利集合资产管理计划	891,333.00	0.26%
6	马亮	737,650.00	0.22%
7	深圳市大鹏大坑上村股份合作公司	737,650.00	0.22%
8	北京金座投资管理有限公司劳务服务分公司	664,051.00	0.20%
9	李丽嫦	655,248.00	0.19%
10	关建平	513,642.00	0.15%
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		272,530,000.00	80.79%

注:前十名持有人为除博时超级大盘ETF联接基金之外的前十名持有人。

9.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	-	-

9.4期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;

2、本基金的基金经理未持有本基金。

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年12月29日)基金份额总额	1,406,754,806.00
本报告期期初基金份额总额	469,148,002.00
本报告期基金总申购份额	40,400,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	172,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	337,348,002.00

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况:1)基金管理人于2014年4月19日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,李志惠不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务;2)基金管理人于2014年11月7日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,聘任洪小源先生担任博时基金管理有限公司董事长及法定代表人职务,杨鶤女士不再担任博时基金管理有限公司董事长职务。

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知, 解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月3日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费66,000元。

11.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	3	487,128,654.35	100.00%	346,057.14	100.00%	-

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

博时基金管理有限公司
2015年3月28日