

**上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金  
2025 年中期报告  
2025 年 6 月 30 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：二〇二五年八月二十九日

## § 1 重要提示及目录

---

### 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。本中期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 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
<b>§4 管理人报告</b>	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
<b>§5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>10</b>
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	14
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>28</b>
7.1 期末基金资产组合情况	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	31
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	31
7.8 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	31
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	31
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	31
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	32
7.12 投资组合报告附注	32
<b>§8 基金份额持有人信息</b>	<b>33</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	33
8.2 期末上市基金前十名持有人	33
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	34
8.4 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的情况	34
<b>§9 开放式基金份额变动</b>	<b>34</b>

<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>34</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	34
10.2 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 .....	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	34
10.4 基金投资策略的改变 .....	35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	35
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	35
10.8 其他重大事件 .....	36
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>37</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	37
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	38
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>38</b>
12.1 备查文件目录 .....	38
12.2 存放地点 .....	39
12.3 查阅方式 .....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时上证超大盘 ETF
场内简称	超大盘 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	44,948,002.00 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的最小化。
投资策略	<p>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。</p> <p>本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%。</p> <p>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。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
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。
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代表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	吴曼
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	021-60637228
传真	0755-83195140	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社	北京市西城区金融大街25号

	区益田路5999号基金大厦21层	
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999号基金大厦21层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	江向阳	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期 (2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	8,452,541.38
本期利润	5,969,203.68
加权平均基金份额本期利润	0.1372
本期加权平均净值利润率	4.40%
本期基金份额净值增长率	4.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,109,369.57
期末可供分配基金份额利润	0.5586
期末基金资产净值	146,977,568.76
期末基金份额净值	3.2699
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.60%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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。

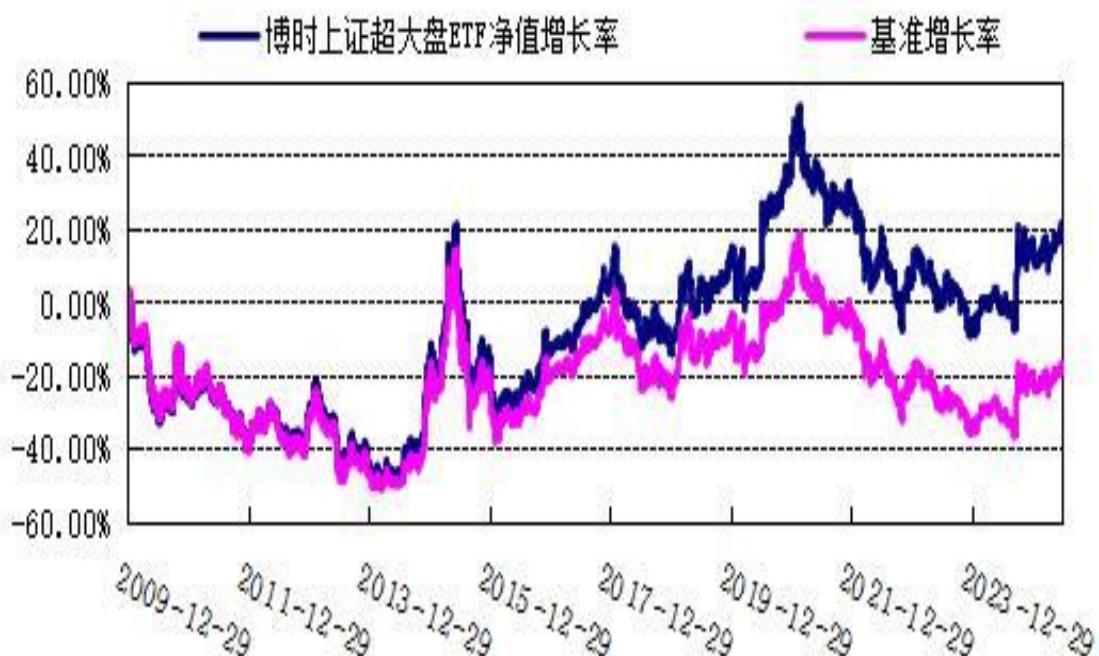
### 3.2 基金净值表现

#### 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

过去一个月	3.41%	0.55%	2.60%	0.55%	0.81%	0.00%
过去三个月	4.16%	0.91%	3.28%	0.92%	0.88%	-0.01%
过去六个月	4.04%	0.88%	3.00%	0.89%	1.04%	-0.01%
过去一年	23.15%	1.22%	20.22%	1.23%	2.93%	-0.01%
过去三年	0.15%	1.06%	-7.66%	1.08%	7.81%	-0.02%
自基金合同生效起至今	20.60%	1.34%	-17.48%	1.35%	38.08%	-0.01%

### 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



## § 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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 只公募基金，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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
李庆阳	基金经理	2024-02-02	-	14.9	<p>李庆阳先生，硕士。2010 年从华南理工大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级系统运维经理。2016 年调任博时资本，任投资经理。2018 年再次加入博时基金管理有限公司。现任博时创业板指数证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、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(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 2 月 8 日—至今)、博时中证传媒指数组型发起式证券投资基金(2024 年 3 月 5 日—至今)、博时国证消费电子主题指数组型发起式证券投资基金(2024 年 4 月 23 日—至今)、博时中证全指通信设备指数组型发起式证券投资基金(2024 年 5 月 7 日—至今)、博时中证汽车零部件主题指数组型发起式证券投资基金(2024 年 5 月 21 日—至今)、博时中证信息技术应用创新产业指数组型发起式证券投资基金(2024 年 6 月 4 日—至今)、博时上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 8 月 8 日—至今)、博时上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 12 月 31 日—至今)、博时上证科创板芯片交易型开放式指数组型证券投资基金发起式联接基金(2025 年 1 月 21 日—至今)、博时上证科创板人工智能交易型开放式指数组型证券投资基金发起式联接基金(2025 年 3 月 11 日—至今)的基金经理。</p>
王萌	基金经理助理	2023-03-06	2025-04-15	8.9	<p>王萌先生，博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数组型证券投资基金(2025 年 4 月 16 日—至今)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数组型证券投资基金(2025 年 6 月 30 日—至今)的基金经理，博时纳斯达克 100 交易型开放式指数组型证券投资基金发起式联接基金 (QDII)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数组型证券投资基金发起式联接基金、博时中证软件服务</p>

					指数型发起式证券投资基金、博时中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、博时上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时中证传媒指数量发起式证券投资基金、博时创业板指数量证券投资基金、博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、博时中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金、博时上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 23 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

25 年上半年中国经济在外部扰动加剧和内部转型深化的背景下展现出韧性，GDP 增速保持在合理区间，消费对经济增长贡献率超过 50%，成为主要驱动力。新消费亮点不断出现，新业态快速扩容，社会消费品零售总额以及规模以上高技术制造业均有不同程度增长，显示经济“含新量”持续提升。此外，央行通过降准降息、结构性工具等组合拳稳定市场流动性，财政加码新基建和新消费政策扩大内需，发行了超长期

特别国债和专项债以支撑基建投资。

在复杂的内外部环境中，A 股市场呈现出显著的结构性特征，整体呈现 W 型走势，行业分化与风格切换频繁。行业上有色、银行、传媒表现突出，煤炭、房地产、食品饮料受到需求疲软拖累表现相对较弱。风格上，市场呈现小盘成长占优，大盘价值补涨的特征，早期小盘占优，微盘股策略表现较好，二季度后大盘价值股在政策催化下迅速追赶，风格趋于均衡。而科技和医药成为上半年主线，细分领域有不错的涨幅。

本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，为投资人取得与标的指数基本一致的投资回报。本基金主要采用完全复制指数的被动跟踪策略，期间内本基金保持平稳运行，实现对指数的紧密跟踪。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 3.2699 元，份额累计净值为 1.2060 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 4.04%，同期业绩基准增长率 3.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，需要关注两大核心矛盾，分别是企业盈利能否持续改善以及国际经贸环境是否实质性缓和。政策上，财政加码和资本市场改革深化有望为市场提供有力支撑。科技突破也会催化各种产业机会，如果国内消费复苏好于预期叠加关税谈判取得进展，市场可能呈现积极走势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金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，本基金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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	1,684,520.94	1,499,283.14
结算备付金		8,797.51	4,055.85

存出保证金		517.61	933.07
交易性金融资产	6.4.6.2	145,877,705.91	132,747,396.23
其中：股票投资		145,877,705.91	132,747,396.23
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.5	—	—
资产总计		147,571,541.97	134,251,668.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> 2025年6月30日	<b>上年度末</b> 2024年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.6.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		445,844.48	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		59,289.86	55,267.24
应付托管费		11,857.98	11,053.47
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.6	76,980.89	145,235.88
负债合计		593,973.21	211,556.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.6.7	121,868,199.19	115,632,174.28
其他综合收益		—	—
未分配利润	6.4.6.8	25,109,369.57	18,407,937.42
净资产合计		146,977,568.76	134,040,111.70
<b>负债和净资产总计</b>		<b>147,571,541.97</b>	<b>134,251,668.29</b>

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.2699 元，基金份额总额 44,948,002.00 份。

## 6.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30 日
<b>一、营业收入</b>		6,439,006.40	3,518,905.82
1. 利息收入		2,243.11	2,637.89
其中：存款利息收入	6.4.6.9	2,243.11	2,637.89
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）		8,914,443.14	-5,835,343.56
其中：股票投资收益	6.4.6.10	6,875,009.33	-7,325,404.83
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.11	—	—
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.6.13	—	—
股利收益	6.4.6.14	2,039,433.81	1,490,061.27
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.15	-2,483,337.70	9,346,641.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	5,657.85	4,970.25
<b>减：二、营业总支出</b>		469,802.72	396,551.73
1. 管理人报酬		335,692.70	264,964.44
其中：暂估管理人报酬（若有）		—	—
2. 托管费		67,138.55	52,992.89
3. 销售服务费		—	—
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失	6.4.6.17	—	—
7. 税金及附加		—	—
8. 其他费用	6.4.6.18	66,971.47	78,594.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,969,203.68	3,122,354.09
<b>减：所得税费用</b>		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,969,203.68	3,122,354.09

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,969,203.68	3,122,354.09

### 6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	115,632,174.28	-	18,407,937.42	134,040,111.70
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	115,632,174.28	-	18,407,937.42	134,040,111.70
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	6,236,024.91	-	6,701,432.15	12,937,457.06
(一)、综合收益总额	-	-	5,969,203.68	5,969,203.68
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	6,236,024.91	-	732,228.47	6,968,253.38
其中：1. 基金申购款	75,103,429.85	-	10,686,037.35	85,789,467.20
2. 基金赎回款	-68,867,404.94	-	-9,953,808.88	-78,821,213.82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	121,868,199.19	-	25,109,369.57	146,977,568.76
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	109,938,412.33	-	-5,045,209.68	104,893,202.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	109,938,412.33	-	-5,045,209.68	104,893,202.65
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-6,236,024.80	-	2,897,942.58	-3,338,082.22

(一)、综合收益总额	-	-	3,122,354.09	3,122,354.09
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-6,236,024.80	-	-224,411.51	-6,460,436.31
其中: 1. 基金申购款	42,567,648.00	-	-967,620.70	41,600,027.30
2. 基金赎回款	-48,803,672.80	-	743,209.19	-48,060,463.61
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	103,702,387.53	-	-2,147,267.10	101,555,120.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 江向阳, 主管会计工作负责人: 王德英, 会计机构负责人: 陈子成

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]1258号《关于核准上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,406,708,966.00元(含所募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第299号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2009年12月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,406,754,806.00份,其中认购资金利息折合45,840.00份。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人博时基金管理有限公司确定2010年1月26日为本基金的基金份额折算日。当日上证超级大盘指数收盘值为2,477.05点,本基金的基金资产净值为1,285,207,695.58元,折算前基金份额总额为1,406,754,806.00份,折算前基金份额净值为0.914元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为3.68824818,折算后基金份额总额为5,188,459,159.00份,折算后基金份额净值为0.248元。本基金的基金管理人博时基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2010年1月27日完成了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2010]第37号文

审核同意，本基金于 2010 年 3 月 19 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的业绩比较基准为上证超级大盘指数。

本基金的标的指数使用费由基金管理人博时基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金管理信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

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。

#### 6.4.5 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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳

增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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，应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，暂免征收个人所得税。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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	1,684,520.94
等于： 本金	1,684,377.78
加： 应计利息	143.16
减： 坏账准备	—
定期存款	—
等于： 本金	—
加： 应计利息	—

减：坏账准备	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	1,684,520.94

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	135,923,999.10	—	145,877,705.91	9,953,706.81
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易 所市 场	—	—	—
	银行 间市 场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	135,923,999.10	—	145,877,705.91	9,953,706.81

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

##### 6.4.6.4 买入返售金融资产

###### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

###### 6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

##### 6.4.6.5 其他资产

无余额。

##### 6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	成本	公允价值

应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	10,034.42
其中：交易所市场	10,034.42
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	66,946.47
合计	76,980.89

#### 6.4.6.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	42,648,002.00	115,632,174.28
本期申购	27,700,000.00	75,103,429.85
本期赎回(以“-”号填列)	-25,400,000.00	-68,867,404.94
本期末	44,948,002.00	121,868,199.19

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

#### 6.4.6.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	61,362,194.29	-42,954,256.87	18,407,937.42
加：会计政策变更(若有)	-	-	-
前期差错更正(若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	61,362,194.29	-42,954,256.87	18,407,937.42
本期利润	8,452,541.38	-2,483,337.70	5,969,203.68
本期基金份额交易产生的变动数	3,516,555.82	-2,784,327.35	732,228.47
其中：基金申购款	41,794,007.31	-31,107,969.96	10,686,037.35
基金赎回款	-38,277,451.49	28,323,642.61	-9,953,808.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,331,291.49	-48,221,921.92	25,109,369.57

#### 6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	2,175.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	66.48
其他	1.13
合计	2,243.11

**6.4.6.10 股票投资收益**
**6.4.6.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,382,048.80
股票投资收益——赎回差价收入	4,492,960.53
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	6,875,009.33

**6.4.6.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	25,954,961.47
减：卖出股票成本总额	23,545,092.97
减：交易费用	27,819.70
买卖股票差价收入	2,382,048.80

**6.4.6.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	78,821,213.82
减：现金支付赎回款总额	269,551.82
减：赎回股票成本总额	74,058,701.47
减：交易费用	-
赎回差价收入	4,492,960.53

**6.4.6.11 债券投资收益**
**6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

无发生额。

**6.4.6.12 资产支持证券投资收益**
**6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无发生额。

**6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无发生额。

**6.4.6.13 衍生工具收益**
**6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无发生额。

#### 6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,039,433.81
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,039,433.81

#### 6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	−2,483,337.70
——股票投资	−2,483,337.70
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	−2,483,337.70

#### 6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	—
替代损益	5,657.85
合计	5,657.85

#### 6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

#### 6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	25.00
合计	66,971.47

## 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》(财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号)，规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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(“招商证券”)	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司(“博时财富”)	基金管理人的子公司
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(“博时上证超大盘 ETF 联接”)	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。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	335,692.70	264,964.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,338.48	-
应支付基金管理人的净管理费	330,354.22	264,964.44

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 0.50% 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×0.50%/当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,138.55	52,992.89

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}.$$

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.9.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.9.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.9.5.2 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

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日		份额单位：份
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	
博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金 基金联接基金	32,951,209.00	73.31%	31,495,409.00	73.85%	
招商证券	1,580,242.00	3.52%	1,189,501.00	2.79%	

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 6.4.9.6 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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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-活期存款	1,684,520.94	2,175.50	1,338,596.68	2,473.03

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

#### 6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

### 6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.10 利润分配情况

无。

## 6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.12 金融工具风险及管理

### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪上证超级大盘指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证超级大盘指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致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，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理与控制的环境中实现业务目标；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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

##### 6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募

集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	1,684,520.94	-	-	-	1,684,520.94
结算备付金	8,797.51	-	-	-	8,797.51
存出保证金	517.61	-	-	-	517.61
交易性金融资产	-	-	-	145,877,705.91	145,877,705.91
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,693,836.06</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>145,877,705.91</b>	<b>147,571,541.97</b>

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	445,844.48	445,844.48
应付管理人报酬	-	-	-	59,289.86	59,289.86
应付托管费	-	-	-	11,857.98	11,857.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	76,980.89	76,980.89
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>593,973.21</b>	<b>593,973.21</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,693,836.06</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>145,283,732.70</b>	<b>146,977,568.76</b>
<b>上年度末 2024年12月31 日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	1,499,283.14	-	-	-	1,499,283.14
结算备付金	4,055.85	-	-	-	4,055.85
存出保证金	933.07	-	-	-	933.07
交易性金融资产	-	-	-	132,747,396.23	132,747,396.23
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,504,272.06</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>132,747,396.23</b>	<b>134,251,668.29</b>
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	55,267.24	55,267.24
应付托管费	-	-	-	11,053.47	11,053.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	145,235.88	145,235.88
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>211,556.59</b>	<b>211,556.59</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,504,272.06</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>132,535,839.64</b>	<b>134,040,111.70</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债和可交换债)、资产支持证券投资和国债期货投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上期：同)。

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	145,877,705.91	99.25	132,747,396.23	99.04
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	145,877,705.91	99.25	132,747,396.23	99.04

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为0。

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 742	增加约 643
	业绩比较基准下降 5%	减少约 742	减少约 643

### 6.4.13 公允价值

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日
第一层次	145,877,705.91
第二层次	—
第三层次	—
合计	145,877,705.91

##### 6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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证券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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### 6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

##### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	145,877,705.91	98.85
	其中：股票	145,877,705.91	98.85
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金	1,693,318.45	1.15

	合计		
8	其他各项资产	517.61	0.00
9	合计	147,571,541.97	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	22,363,845.00	15.22
C	制造业	57,436,074.78	39.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,206,474.00	4.90
E	建筑业	7,347,679.56	5.00
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	6,987,024.00	4.75
J	金融业	44,536,608.57	30.30
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	145,877,705.91	99.25

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601899	紫金矿业	405,300	7,903,350.00	5.38
2	601398	工商银行	1,012,600	7,685,634.00	5.23
3	600150	中国船舶	231,900	7,546,026.00	5.13
4	601288	农业银行	1,282,500	7,541,100.00	5.13
5	600030	中信证券	271,213	7,490,903.06	5.10
6	688981	中芯国际	84,913	7,486,779.21	5.09
7	688041	海光信息	52,725	7,449,515.25	5.07
8	601318	中国平安	133,416	7,401,919.68	5.04
9	600036	招商银行	160,721	7,385,129.95	5.02
10	601088	中国神华	181,500	7,358,010.00	5.01
11	601668	中国建筑	1,273,428	7,347,679.56	5.00
12	600900	长江电力	239,100	7,206,474.00	4.90

13	601127	赛力斯	53,500	7,186,120.00	4.89
14	600809	山西汾酒	40,300	7,108,517.00	4.84
15	601857	中国石油	830,700	7,102,485.00	4.83
16	600309	万华化学	129,900	7,048,374.00	4.80
17	601166	兴业银行	301,282	7,031,921.88	4.78
18	688256	寒武纪	11,616	6,987,024.00	4.75
19	600276	恒瑞医药	131,862	6,843,637.80	4.66
20	600519	贵州茅台	4,801	6,767,105.52	4.60

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	688256	寒武纪	7,201,157.80	5.37
2	688981	中芯国际	7,062,898.03	5.27
3	600309	万华化学	2,032,991.97	1.52
4	600519	贵州茅台	1,805,751.00	1.35
5	600809	山西汾酒	1,371,802.00	1.02
6	600030	中信证券	1,360,008.00	1.01
7	600150	中国船舶	1,255,388.00	0.94
8	600036	招商银行	1,137,994.00	0.85
9	688041	海光信息	1,035,510.13	0.77
10	601127	赛力斯	978,162.00	0.73
11	601668	中国建筑	865,669.00	0.65
12	601088	中国神华	820,604.00	0.61
13	601318	中国平安	455,708.00	0.34
14	600900	长江电力	210,075.00	0.16
15	601288	农业银行	207,820.00	0.16
16	603259	药明康德	189,258.00	0.14
17	600276	恒瑞医药	186,535.00	0.14
18	601857	中国石油	185,015.00	0.14
19	601899	紫金矿业	170,307.00	0.13
20	601398	工商银行	165,621.00	0.12

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

### 7.4.2 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	603259	药明康德	8,207,710.00	6.12
2	600887	伊利股份	7,010,964.41	5.23
3	601166	兴业银行	2,019,145.00	1.51
4	688041	海光信息	1,336,949.06	1.00
5	600036	招商银行	1,145,734.00	0.85
6	600519	贵州茅台	1,053,200.00	0.79
7	601899	紫金矿业	816,387.00	0.61
8	601398	工商银行	810,568.00	0.60

9	601288	农业银行	784,252.00	0.59
10	600276	恒瑞医药	682,500.00	0.51
11	600809	山西汾酒	455,144.00	0.34
12	600900	长江电力	430,863.00	0.32
13	688256	寒武纪	233,428.00	0.17
14	601127	赛力斯	167,003.00	0.12
15	601088	中国神华	157,780.00	0.12
16	601857	中国石油	140,188.00	0.10
17	601318	中国平安	126,197.00	0.09
18	600150	中国船舶	101,962.00	0.08
19	601668	中国建筑	98,068.00	0.07
20	600309	万华化学	91,836.00	0.07

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	29,013,117.93
卖出股票的收入（成交）总额	25,954,961.47

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

#### 7.5 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。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中信证券股份有限公司在报告编制前一年受到深圳证券交易所的通报批评。中国农业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、中国银保监会泰安监管分局、国家外汇管理局辽宁省分局、国家税务总局那曲市税务局稽查局、国家金融监督管理总局福建监管局、海东市消防救援支队、漳州市市场监督管理局、玉树藏族自治州消防救援支队的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行南阳市分行、国家外汇管理局泉州市分局、国家外汇管理局福建省分局、国家税务总局咸宁市税务局、国家金融监督管理总局上海监管局、宁夏回族自治区市场监督管理厅的处罚。中国神华能源股份有限公司在报告编制前一年受到榆林市生态环境局、榆林市能源局、鄂尔多斯市应急管理局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绍兴市分局、国家外汇管理局贵州省分局、国家金融监督管理总局四川监管局、国家金融监督管理总局山东监管局、深圳市市场监督管理局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制前一年受到上杭县住房和城乡建设局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 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。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 7.12.3 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	517.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	517.61

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构						份额单位：份	
		机构投资者		个人投资者		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			
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例		
6,449	6,969.76	6,404,589.00	14.25%	5,592,204.00	12.44%	32,951,209.00	73.31%		

### 8.2 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	中国工商银行股份有限公司—华夏优选配置股票型基金中基金(FOF—LOF)	2,198,900.00	4.89%
2	招商证券股份有限公司	1,580,242.00	3.52%
3	深圳市大鹏大坑上村股份合作公司	737,650.00	1.64%
4	中信证券股份有限公司	563,842.00	1.25%
5	北京金座投资管理有限公司劳务服务分公司	500,000.00	1.11%
6	何文良	419,723.00	0.93%
7	深圳市大鹏大坑下村股份合作公司	368,825.00	0.82%
8	岳韧锋	188,570.00	0.42%
9	中国平安人寿保险股份有限公司—分红一个险分红	169,400.00	0.38%
10	华泰证券股份有限公司	151,800.00	0.34%
-	中国建设银行股份有限公司—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	32,951,209.00	73.31%

注：1. 以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

2. 前十名持有人为除博时上证超大盘 ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

### 8.4 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的情况

- 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。

## § 9 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	42,648,002.00
本报告期基金总申购份额	27,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	25,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,948,002.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 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

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 10.3 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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
西南证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
东方财富 证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	—	—	—
第一创业	1	—	—	—	—	—
中金公司	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
天风证券	1	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	3	—	—	—	—	—
西部证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	3	54,968,079.40	100.00%	11,317.73	100.00%	增加 2 个
兴业证券	1	—	—	—	—	增加 1 个
华泰证券	1	—	—	—	—	增加 1 个
长江证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	1	—	—	—	—	—

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公

司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
东方财富证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
第一创业	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
西部证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
国泰海通	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
国盛证券	—	—	—	—	—	—

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基 金基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网 站、证监会基金电子披露 网站	2025-06-26
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的 长期停牌股票调整估值方法的公告-20250606	证券时报、基金管理人网 站、证监会基金电子披露 网站	2025-06-06
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的 长期停牌股票调整估值方法的公告-20250603	证券时报、基金管理人网 站、证监会基金电子披露 网站	2025-06-03
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新	证券时报、基金管理人网	2025-04-25

	增万和证券股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	站、证监会基金电子披露网站	
5	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-22
6	博时基金管理有限公司关于运用公司固有资金投资旗下公募基金的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
7	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250408	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
8	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年度)	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
9	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250325	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
11	上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-22
12	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增东北证券为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-02
13	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增联储证券为申购、赎回代办券商的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-02

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国建设银行股份有限公司	1	2025-01-01~2025-06-30	31,495,409.00	2,819,900.00	1,364,100.00	32,951,209.00	73.31%

司一 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						
--	--	--	--	--	--	--

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额和买入份额，赎回份额包含卖出份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二五年八月二十九日