

博时裕富沪深 300 指  
数证券投资基金 2010 年年度报告  
2010 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：2011 年 3 月 31 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 2011 年 3 月 30 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。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
§ 2 基金简介 .....	4
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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	5
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	6
§ 4 管理人报告 .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
§ 5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
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 .....	13
§ 6 审计报告 .....	13
§ 7 年度财务报表 .....	14
7.1 资产负债表 .....	14
7.2 利润表 .....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
7.4 报表附注 .....	17
§ 8 投资组合报告 .....	34
8.1 期末基金资产组合情况 .....	34
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	35
8.3 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 .....	35
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44
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 .....	44
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	44
8.8 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 .....	44
8.9 投资组合报告附注 .....	44
§ 9 基金份额持有人信息 .....	45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	45
§ 10 开放式基金份额变动 .....	45
§ 11 重大事件揭示 .....	46
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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.....	46
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
11.4 基金投资策略的改变 .....	46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
11.8 其他重大事件 .....	47
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
§ 13 备查文件目录 .....	52
13.1 备查文件目录 .....	52
13.2 存放地点 .....	52
13.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金
基金简称	博时沪深 300 指数
基金主代码	050002
交易代码	050002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 8 月 26 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	15,631,026,003.22 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4%以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用被动式投资的方法，按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为：股票资产为 95%以内，现金和短期债券资产比例不低于 5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95%的沪深 300 指数加 5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

### 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	孙麒麟	尹东
	联系电话	0755-83169999	010-67595003
	电子邮箱	service@bosera.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275865
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道70	北京市西城区金融大街25号

	88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70 88号招商银行大厦29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	杨鹤	郭树清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼 普华永道中心11楼
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街18号恒基中心1座23层

## § 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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	-315,071,894.13	-2,047,800,585.62	799,379,334.16
本期利润	-1,596,234,363.47	7,831,267,434.73	-15,103,519,043.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0998	0.4632	-0.8772
本期加权平均净值利润率	-11.97%	58.01%	-104.11%
本期基金份额净值增长率	-11.98%	88.61%	-63.88%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配利润	-2,429,912,526.01	-624,953,521.79	-9,170,613,381.96
期末可供分配基金份额利润	-0.1555	-0.0399	-0.4909
期末基金资产净值	13,201,113,477.21	15,028,300,963.94	9,510,958,832.52
期末基金份额净值	0.845	0.960	0.509
3.1.3 累计期末指标	2010年末	2009年末	2008年末
基金份额累计净值增长率	167.21%	203.57%	60.96%

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，计入费用后持有人的实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

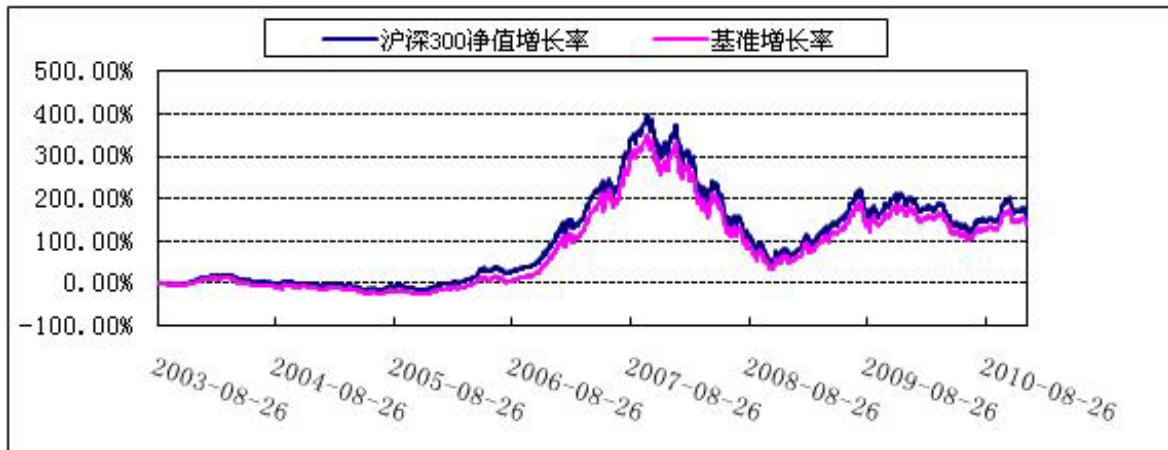
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.02%	1.68%	6.28%	1.68%	-0.26%	0.00%
过去六个月	20.89%	1.49%	20.95%	1.47%	-0.06%	0.02%
过去一年	-11.98%	1.52%	-11.77%	1.50%	-0.21%	0.02%
过去三年	-40.03%	2.19%	-39.16%	2.21%	-0.87%	-0.02%
过去五年	193.32%	2.02%	209.00%	2.06%	-15.68%	-0.04%
自基金合同生效起至今	167.21%	1.77%	145.09%	1.81%	22.12%	-0.04%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×95%+银行同业存款利率×5%。

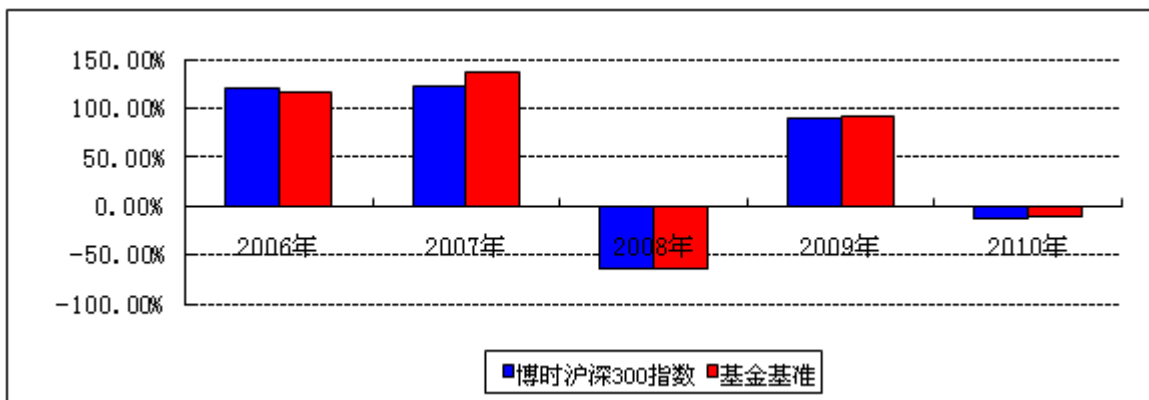
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 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



注：本基金合同于 2003 年 8 月 26 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 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十六条（五）投资对象、（九）投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况



过去三年无利润分配。

## § 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（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。注册资本为一亿元人民币，总部设在深圳，在北京、上海、郑州、沈阳设有分公司，此外，还设有海外子公司：博时基金（国际）有限公司。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%；璟安实业有限公司，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%。

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 2010 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理二十只开放式基金和三只封闭式基金，并且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、特定资产管理账户，资产管理总规模逾 1874 亿元，累计分红超过人民币 532 亿元。博时基金管理有限公司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、客户服务

- 1) 为提供安全、高效的网上交易环境，博时公司不断升级网上交易系统的安全功能：2010 年 1 月，博时快 e 通系统增加了动态验证码的功能，对客户身份进行验证；2010 年 3 月，博时快 e 通直销交易系统在所有密码输入区域都设置了密码安全控件，大大提高了交易安全性。
- 2) 2010 年 4 月，博时基金客服中心推出了新版的在线客服系统，新系统能够支持更多新功能，例如，客户和坐席均能查到前面等待的客户数量，客户除了在线等待以外，还可以选择留言功能，留下自己的问题和联系方式，客服代表会及时给予回复。同时在线坐席可以根据等待客户的情况，合理控制在线交流节奏。
- 3) “博时 e 视界”于 9 月 18 日正式发布，这也是博时基金倾力为投资人打造的与投资专家面对面的全新视听网络平台。



- 4) 2010 年 10 月，博时基金与中国劳动保障报社联合举办“企业年金管理大家谈”有奖征文活动。向较早建立企业年金计划的企业征集管理经验与其他企业分享。
- 5) 2010 年，博时在全国各地举办各类客户活动、论坛、沙龙等共计 1252 场，并创新的采用网络会议室，扩大论坛的覆盖面，充分与投资者沟通当前市场的热点问题，受到了广大投资者的广泛欢迎。

## 2、社会责任

- 1) 为支援舟曲灾区的救灾善后工作，博时基金公司全体员工通过博时慈善基金会向甘肃省红十字会捐出赈灾款项人民币 30 万元。
- 2) 博时慈善基金会 2010 年关爱助学现场捐赠仪式于 2010 年 12 月 6 日在中山大学举办，博时以每人 5000 元的标准向中山大学的 21 位贫困学生资助善款 105000 元，至此博时基金第四届百万关爱助学活动圆满落幕。

## 3、公司荣誉

- 1) 博时在由证券时报社主办的 2009 年度中国明星基金奖评选中，荣获两个奖项，博时主题行业基金获得“2009 年度三年持续回报股票型明星基金奖”，博时平衡配置获得“2009 年度三年持续回报平衡混合型明星基金奖”。
- 2) 博时在由中国证券报社主办的第七届中国基金业金牛奖评选中连续第三次荣获中国基金业最具权威的“金牛基金公司奖”，并获得首次设立的“金牛特别贡献奖”，旗下基金博时裕隆封闭、博时主题行业股票、博时平衡配置混合和博时现金收益货币均蝉联金牛奖项，分别获得“三年期封闭式持续优胜金牛基金”、“三年期开放式股票型持续优胜金牛基金”、“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”和“2009 年度开放式货币市场金牛基金”奖项。
- 3) 2010 年 8 月 14 日博时基金网站在由证券时报主办的“第十一届中国优秀财经证券网站”评选中荣获“最佳基金网站奖”。

## 4、其他大事件

- 1) 博时创业成长股票型证券投资基金首募顺利结束并于 2010 年 6 月 1 日成立，首次募集资金超过 34 亿元。
- 2) 博时大中华亚太精选股票证券投资基金及博时宏观回报债券型证券投资基金首募顺

利结束并于 2010 年 7 月 27 日成立。

- 3) 博时转债增强债券型证券投资基金及博时行业轮动股票型证券投资基金首次募集顺利结束并分别于 2010 年 11 月 24 日和 2010 年 12 月 10 日成立。
- 4) 根据中国证券监督管理委员会的批复，博时基金已在香港完成博时基金（国际）有限公司(Bosera Asset Management (International) Co., Limited)的注册登记手续并获香港证券及期货事务监察委员会颁发的第 4 类（就证券提供意见）和第 9 类（提供资产管理）牌照；
- 5) 博时基金于 2010 年 8 月 25 日和 2010 年 11 月 11 日分别公告郑州分公司和沈阳分公司成立。至此，博时基金已有 4 家分公司分别落地北京、上海、郑州和沈阳。

#### 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		
汤义峰	基金经理	2010-3-12	-	4.5	2006 年毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，获得博士学位。2006 年 6 月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼任博时特许价值股票基金、基金裕泽的基金经理助理、投资经理兼数量化研究员，现任博时沪深 300 指数基金、博时特许价值基金基金经理。
张峰	股票投资部总经理/成长组投资总监/基金经理	2010-10-11	-	18	1988 年起先后在 Haugen Financial 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，现任股票投资部总经理、成长组投资总监、沪深 300 基金基金经理。
张晓军	基金经理	2008-7-2	2010-4-28	5	1992 年起在新疆水利电力物资总公司财务科工作。2005 年加入博时公司，历任数量化投资部金融工程师、股票投资部数量化研究员、数量化研究员兼裕富基金经理助理、博时沪深 300 指数基金、上证超级大盘基金、博时上证超大盘 ETF 联接基金的基金经理。

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、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》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，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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

##### 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

###### (1) 2010 年经济回顾

2010 年货币政策将真正回归“适度”，但流动性依然充裕，M1 的大量增加也契合了股市、房地产市场活跃、投资交易量明显上升的状况。给经济适度降温，抑制资产价格（特别是防止房地产价格过快上涨）并加大经济结构调整成为政府的调控目标。政策的主要目的在于实现经济增速由高位的“软着陆”，货币政策的 2 季度突然刹车，经济过热的势头得到了明显的抑制作用，2010 年 10 月份后内忧外患以及调整结构带来的资本格局变化都成为了加剧了中国通货膨胀的流动性因素。同时由于外部欧美日依旧维持较低利率水平，随着人民币开启新一轮升值之路，热钱呈现了加速流入新兴经济体的步伐，这也从外部环境加剧了国内流动性过剩的局面，由于政策并不能在第一时间做到有效的贯彻，这就导致了民间资本大量的短期投机行为，资本所到之处，也就出现了价格的暴涨，跷跷板效应非常明显。年末的通胀预期加剧，也进一步加剧了宏观经济的不确定性。

###### (2) 投资组合管理的回顾

本基金是遵循指数投资理念的指数型基金。在整个管理过程中，基金经理借助系统软件的支持严密控制跟踪误差，在最小化成本的前提下做出适当的行业或者个股调整，避免频繁

交易带来的损失。管理期间，本基金的跟踪误差主要来自基金申购赎回、基金净值精度计算两个方面，我们力图通过系统软件和精细化管理将本基金的跟踪误差控制在较低水平。此外，我们制定并实施了成份股调整策略，在年中、年底平稳实现了组合中沪深 300 指数成份股的调整。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.845 元，份额累计净值为 2.825 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-11.98%，同期业绩基准增长率为-11.77%。

#### 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 2011 年，全球经济再平衡继续。危机并未过去，发达国家经济复苏缓慢，美国经济二次探底的可能性很小，发达国家继续执行宽松的货币政策，导致资本流向包括中国在内的新兴市场；而新兴市场国家货币将维持走强格局，与发达市场脱钩，内需支撑增长，但通胀压力、资产泡沫现象严重，导致这些国家的宏观经济政策开始收紧。总体看，我国经济存在巨大的内需增长空间，城市化和工业化在快速推进，处在消费高速增长阶段。其次，政府、银行、企业、居民资产负债表表现良好，为投资和消费提供了较为坚实的基本面“后盾”，在连续两年宽松的货币政策之后，中国面临的是经济强劲增长和通胀压力较大，货币政策回归到正常化的轨道，2011 年的货币政策可能会从紧。但 2011 年是“十二五规划”的元年，是中国经济转型的关键之年，我们相信随着中国经济结构调整和转型的逐步成功，中国经济的长期增长态势能够支撑中国资本市场的走强，“十二五”展开的中国经济转型之旅或成为中国新一轮上涨的开始。本基金对中国经济中长期的前景持乐观的判断。期望博时裕富沪深 300 指数基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供更好的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2010 年，我公司根据法律、法规的规定，更新了《开放式基金业务规则》、《反洗钱工作手册》、《反洗钱工作细则》、《员工手册》等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。根据新业务发展情况制定了《博时

基金股指期货投资管理流程手册》、《对外信息发布审核流程手册》等制度和手册，不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 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、运作部负责人共五名成员组成，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。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配原则：基金投资当期亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；基金当期收益应先弥补以前亏损后，才可进行当期收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配。

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。



## § 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，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。

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

普华永道中天审字(2011)第 20586 号

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(原名为博时裕富证券投资基金)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(原名为博时裕富证券投资基金，以下简称“博时裕富沪深 300 指数基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是博时裕富沪深 300 指数基金的基金管理人博时基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

## 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了博时裕富沪深 300 指数基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

注册会计师

汪 棣

中国·上海市

注册会计师

2011 年 3 月 24 日

张 鸿

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日



单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	683,516,647.91	736,763,331.56
结算备付金		1,601,265.54	598,129.19
存出保证金		1,279,453.17	2,377,445.71
交易性金融资产	7.4.7.2	12,526,668,462.51	14,227,203,198.36
其中：股票投资		12,526,668,462.51	14,227,203,198.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	73,775,614.49
应收利息	7.4.7.5	148,683.29	163,312.87
应收股利		-	-
应收申购款		6,919,280.76	26,430,723.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		13,220,133,793.18	15,067,311,755.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,097,110.24	22,533,770.32
应付管理人报酬		11,245,825.21	12,388,118.96
应付托管费		2,295,066.36	2,528,187.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,239,447.52	423,035.71
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,142,866.64	1,137,678.87
负债合计		19,020,315.97	39,010,791.42
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	15,631,026,003.22	15,653,254,485.73
未分配利润	7.4.7.10	-2,429,912,526.01	-624,953,521.79

所有者权益合计		13,201,113,477.21	15,028,300,963.94
负债和所有者权益总计		13,220,133,793.18	15,067,311,755.36

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.845 元，基金份额总额 15,631,026,003.22 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年 12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
<b>一、收入</b>		<b>-1,427,940,914.26</b>	<b>8,014,974,011.85</b>
1. 利息收入		5,720,741.06	5,544,734.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,627,115.16	5,543,216.83
债券利息收入		93,625.90	1,517.74
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）		-156,647,641.23	-1,879,243,882.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-296,659,215.53	-2,002,789,578.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,312,457.62	1,482,013.76
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	127,699,116.68	122,063,682.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,281,162,469.34	9,879,068,020.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,148,455.25	9,605,139.36
<b>减：二、费用</b>		<b>168,293,449.21</b>	<b>183,706,577.12</b>
1. 管理人报酬		130,694,021.45	131,192,111.60
2. 托管费		26,672,249.26	26,773,900.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	10,453,349.70	25,289,322.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	473,828.80	451,243.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,596,234,363.47</b>	<b>7,831,267,434.73</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,596,234,363.47</b>	<b>7,831,267,434.73</b>

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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）	15,653,254,485.73	-624,953,521.79	15,028,300,963.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,596,234,363.47	-1,596,234,363.47
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）	-22,228,482.51	-208,724,640.75	-230,953,123.26
其中：1. 基金申购款	4,877,346,475.54	-887,070,930.23	3,990,275,545.31
2. 基金赎回款	-4,899,574,958.05	678,346,289.48	-4,221,228,668.57
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）	15,631,026,003.22	-2,429,912,526.01	13,201,113,477.21
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	18,681,572,214.48	-9,170,613,381.96	9,510,958,832.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,831,267,434.73	7,831,267,434.73
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）	-3,028,317,728.75	714,392,425.44	-2,313,925,303.31
其中：1. 基金申购款	8,100,204,763.47	-1,472,346,122.42	6,627,858,641.05
2. 基金赎回款	-11,128,522,492.22	2,186,738,547.86	-8,941,783,944.36
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）	15,653,254,485.73	-624,953,521.79	15,028,300,963.94

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：

基金管理公司负责人：肖风      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 基金基本情况

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(原名为博时裕富证券投资基金,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”)证监基金字[2003]第 83 号《关于同意博时裕富沪深 300 指数证券投资基金设立的批复》核准,由博时基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金契约》(后更名为《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 8 月 26 日募集成立。本基金为契约型开放式,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 5,122,784,859.66 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 107 号验资报告予以验证。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。

根据本基金的基金管理人于 2010 年 1 月 29 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时裕富证券投资基金更名的公告》,为使本基金名称能够充分体现本基金作为指数型基金的产品特征,本基金即日起更名为“博时裕富沪深 300 指数证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书》的有关规定,本基金为指数基金,标的指数为沪深 300 指数。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数、新股(IPO 或增发)以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金各类资产的目标比例为股票资产占基金资产总值的 95%以内,现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 95% X 沪深 300 指数 + 5% X 银行同业存款利率。

本基金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。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2011 年 3 月 24 日批准报出。

#### 7.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度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 2010

年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险



和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。



#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自2009年6月15日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (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派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。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、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%

代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
活期存款	683,516,647.91	736,763,331.56
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	683,516,647.91	736,763,331.56

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,219,039,858.53	12,526,668,462.51	-692,371,396.02
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	13,219,039,858.53	12,526,668,462.51	-692,371,396.02
项目	上年度末 2009年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,638,412,125.04	14,227,203,198.36	588,791,073.32
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	13,638,412,125.04	14,227,203,198.36	588,791,073.32

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

##### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	148,012.73	163,028.52
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	616.44	230.23
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	54.12	54.12
合计	148,683.29	163,312.87

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,239,447.52	423,035.71
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,239,447.52	423,035.71

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00	1,000,000.00
应付赎回费	2,849.34	67,661.57
预提费用	140,000.00	70,000.00
其他	17.30	17.30
合计	1,142,866.64	1,137,678.87

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,653,254,485.73	15,653,254,485.73

本期申购	4,877,346,475.54	4,877,346,475.54
本期赎回(以“-”号填列)	-4,899,574,958.05	-4,899,574,958.05
本期末	15,631,026,003.22	15,631,026,003.22

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	594,938,341.84	-1,219,891,863.63	-624,953,521.79
本期利润	-315,071,894.13	-1,281,162,469.34	-1,596,234,363.47
本期基金份额交易产生的变动数	2,721,785.25	-211,446,426.00	-208,724,640.75
其中：基金申购款	140,485,987.67	-1,027,556,917.90	-887,070,930.23
基金赎回款	-137,764,202.42	816,110,491.90	678,346,289.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,588,232.96	-2,712,500,758.97	-2,429,912,526.01

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	5,312,828.98	5,235,748.76
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	31,542.88	69,565.89
其他	282,743.30	237,902.18
合计	5,627,115.16	5,543,216.83

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	3,563,724,294.63	9,087,304,691.55
减：卖出股票成本总额	3,860,383,510.16	11,090,094,270.47
买卖股票差价收入	-296,659,215.53	-2,002,789,578.92

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	90,375,183.52	5,397,031.50
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	77,969,100.00	3,913,500.00

减：应收利息总额	93,625.90	1,517.74
债券投资收益	12,312,457.62	1,482,013.76

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	127,699,116.68	122,063,682.73
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	127,699,116.68	122,063,682.73

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,281,162,469.34	9,879,068,020.35
——股票投资	-1,281,162,469.34	9,879,068,020.35
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,281,162,469.34	9,879,068,020.35

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	3,427,223.80	9,003,894.79
基金转出费收入	655,314.27	591,859.76
印花税手续费返还	65,917.18	9,384.81
合计	4,148,455.25	9,605,139.36

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
交易所市场交易费用	10,453,349.70	25,289,322.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	10,453,349.70	25,289,322.10

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	140,000.00	140,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	33,728.80	11,243.09
其他	100.00	-
合计	473,828.80	451,243.09

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
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(自 2009 年 11 月 16 日起)
璟安实业有限公司	基金管理人的股东(自 2009 年 11 月 16 日起)
上海盛业资产管理有限公司	基金管理人的股东(自 2009 年 11 月 16 日起)
丰益实业发展有限公司	基金管理人的股东(自 2009 年 11 月 16 日起)

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	130,694,021.45	131,192,111.60
其中：支付销售机构的客户维护费	11,423,141.63	11,527,177.44

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 0.98% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.98\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	26,672,249.26	26,773,900.33

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 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数。}$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日		2009年1月1日至2009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	683,516,647.91	5,312,828.98	736,763,331.56	5,235,748.76

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2010年1月1日至2010年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额



招商证券	600036	招商银行	老股东配股	3,680,655	32,573,796.75
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券	601668	中国建筑	新股网上申购	141,000	589,380.00

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末(2010 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600518	康美药业	10/12/28	配股停牌	19.71	11/01/06	17.29	2,762,798	26,539,387.51	54,454,748.58	-
600664	哈药股份	10/12/29	资产重组	22.57	11/02/16	24.83	1,747,200	24,462,946.13	39,434,304.00	-
600816	安信信托	10/06/02	重大事项未公告	13.60	未知	未知	786,365	14,275,886.44	10,694,564.00	-
000059	辽通化工	10/12/02	资产重组	11.59	未知	未知	1,444,973	16,674,299.37	16,747,237.07	-
000652	泰达股份	10/11/22	公告重大事项	7.78	未知	未知	2,528,640	40,822,131.48	19,672,819.20	-
000959	首钢股份	10/10/29	资产重组	4.42	未知	未知	3,066,481	22,851,588.53	13,553,846.02	-

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属被动式股票指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管

理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4%以下的投资目标。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由执行总裁和风险控制委员会、督察长、监察法律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的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，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；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察法律部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察法律部对公司执行总裁负责。

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。

#### 7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该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均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，违约风险可能性很小。

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。于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2009 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市

场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	683,516,647.91	-	-	-	683,516,647.91
结算备付金	1,601,265.54	-	-	-	1,601,265.54
存出保证金	140,741.00	-	-	1,138,712.17	1,279,453.17
交易性金融资产	-	-	-	12,526,668,462.51	12,526,668,462.51
应收利息	-	-	-	148,683.29	148,683.29
应收申购款	-	-	-	6,919,280.76	6,919,280.76
<b>资产总计</b>	685,258,654.45	-	-	12,534,875,138.73	13,220,133,793.18
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	2,097,110.24	2,097,110.24
应付管理人报酬	-	-	-	11,245,825.21	11,245,825.21
应付托管费	-	-	-	2,295,066.36	2,295,066.36
应付交易费用	-	-	-	2,239,447.52	2,239,447.52
其他负债	-	-	-	1,142,866.64	1,142,866.64
<b>负债总计</b>	-	-	-	19,020,315.97	19,020,315.97
<b>利率敏感度缺口</b>	685,258,654.45	-	-	12,515,854,822.76	13,201,113,477.21
<b>上年度末 2009 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>
银行存款	736,763,331.56	-	-	-	736,763,331.56
结算备付金	598,129.19	-	-	-	598,129.19
存出保证金	140,741.00	-	-	2,236,704.71	2,377,445.71
交易性金融资产	-	-	-	14,227,203,198.36	14,227,203,198.36
应收利息	-	-	-	163,312.87	163,312.87
应收申购款	-	-	-	26,430,723.18	26,430,723.18
应收证券清算款	-	-	-	73,775,614.49	73,775,614.49
<b>资产总计</b>	737,502,201.75	-	-	14,329,809,553.61	15,067,311,755.36
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	12,388,118.96	12,388,118.96
应付托管费	-	-	-	2,528,187.56	2,528,187.56
应付交易费用	-	-	-	423,035.71	423,035.71
其他负债	-	-	-	1,137,678.87	1,137,678.87
应付赎回款	-	-	-	22,533,770.32	22,533,770.32
<b>负债总计</b>	-	-	-	39,010,791.42	39,010,791.42
<b>利率敏感度缺口</b>	737,502,201.75	-	-	14,290,798,762.19	15,028,300,963.94

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2009 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2009 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产总值的 95%以内。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 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	12,526,668,462.51	94.89	14,227,203,198.36	94.67
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,526,668,462.51	94.89	14,227,203,198.36	94.67

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 65,082	增加约 73,357
2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 65,082	下降约 73,357	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。本基金持有属于第一层级的金融工具主要包括存在活跃市场的股票(包括网下申购处于限售期的股票)、交易所市场债券等，于 2010 年 12 月 31 日的余额为 12,372,110,943.64 元(2009 年 12 月 31 日：13,919,991,880.92 元)。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。本基金持有属于第二层级的金融工具主要包括参与非公开发行取得并在锁定期内的股票、因重大事项停牌的股票、银行间市场债券等，于 2010 年 12 月 31 日的余额为 154,557,518.87 元(2009 年 12 月 31 日：307,211,317.44 元)。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有属于第三层级的以公允价值计量的金融工具(2009 年 12 月 31 日：同)。

(2) 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,526,668,462.51	94.75

	其中：股票	12, 526, 668, 462. 51	94. 75
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	685, 117, 913. 45	5. 18
6	其他各项资产	8, 347, 417. 22	0. 06
7	合计	13, 220, 133, 793. 18	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	52, 390, 648. 54	0. 40
B	采掘业	1, 575, 485, 040. 24	11. 93
C	制造业	4, 378, 998, 726. 62	33. 17
C0	食品、饮料	699, 110, 152. 49	5. 30
C1	纺织、服装、皮毛	46, 333, 788. 62	0. 35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	9, 544, 301. 04	0. 07
C4	石油、化学、塑胶、塑料	307, 819, 266. 44	2. 33
C5	电子	65, 147, 734. 32	0. 49
C6	金属、非金属	1, 156, 213, 489. 39	8. 76
C7	机械、设备、仪表	1, 559, 639, 112. 34	11. 81
C8	医药、生物制品	492, 032, 621. 36	3. 73
C99	其他制造业	43, 158, 260. 62	0. 33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	344, 213, 856. 54	2. 61
E	建筑业	398, 300, 273. 06	3. 02
F	交通运输、仓储业	562, 676, 926. 36	4. 26
G	信息技术业	380, 020, 071. 18	2. 88
H	批发和零售贸易	388, 800, 259. 10	2. 95
I	金融、保险业	3, 358, 001, 814. 21	25. 44
J	房地产业	659, 488, 166. 72	5. 00
K	社会服务业	117, 512, 170. 17	0. 89
L	传播与文化产业	21, 456, 716. 00	0. 16
M	综合类	289, 323, 793. 77	2. 19
	合计	12, 526, 668, 462. 51	94. 89

## 8.3 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	601318	中国平安	8,065,538	452,960,614.08	3.43
2	600036	招商银行	29,769,044	381,341,453.64	2.89
3	601328	交通银行	50,107,044	274,586,601.12	2.08
4	600016	民生银行	51,861,040	260,342,420.80	1.97
5	600000	浦发银行	19,467,913	241,207,442.07	1.83
6	601166	兴业银行	9,636,430	231,756,141.50	1.76
7	600030	中信证券	17,266,379	217,383,711.61	1.65
8	601398	工商银行	46,825,310	198,539,314.40	1.50
9	601088	中国神华	7,908,000	195,406,680.00	1.48
10	000002	万科 A	23,120,000	190,046,400.00	1.44
11	600519	贵州茅台	940,000	172,884,800.00	1.31
12	000858	五粮液	4,850,000	167,955,500.00	1.27
13	601601	中国太保	7,234,103	165,660,958.70	1.25
14	002024	苏宁电器	10,200,000	133,620,000.00	1.01
15	601169	北京银行	10,061,510	115,103,674.40	0.87
16	600031	三一重工	5,240,000	113,341,200.00	0.86
17	600900	长江电力	14,074,400	106,543,208.00	0.81
18	600837	海通证券	11,018,968	106,222,851.52	0.80
19	600050	中国联通	19,573,505	104,718,251.75	0.79
20	601006	大秦铁路	13,261,844	103,707,620.08	0.79
21	000001	深发展 A	6,441,574	101,712,453.46	0.77
22	000983	西山煤电	3,792,899	101,232,474.31	0.77
23	601899	紫金矿业	12,171,764	99,930,182.44	0.76
24	601857	中国石油	8,352,991	93,720,559.02	0.71
25	601668	中国建筑	26,663,608	91,189,539.36	0.69
26	600111	包钢稀土	1,271,809	90,858,034.96	0.69
27	000063	中兴通讯	3,251,700	88,771,410.00	0.67
28	600585	海螺水泥	2,953,922	87,672,404.96	0.66
29	600547	山东黄金	1,646,291	86,775,998.61	0.66
30	000338	潍柴动力	1,650,000	86,410,500.00	0.65
31	000651	格力电器	4,748,405	86,088,582.65	0.65
32	600089	特变电工	4,497,432	83,922,081.12	0.64
33	600348	国阳新能	2,884,000	82,713,120.00	0.63
34	600362	江西铜业	1,830,834	82,698,771.78	0.63
35	600019	宝钢股份	12,176,893	77,810,346.27	0.59
36	600028	中国石化	9,653,882	77,810,288.92	0.59
37	000157	中联重科	5,446,157	77,008,659.98	0.58
38	601009	南京银行	7,694,327	76,481,610.38	0.58
39	600015	华夏银行	6,945,300	75,703,770.00	0.57
40	601168	西部矿业	4,015,577	75,653,470.68	0.57
41	000527	美的电器	4,342,403	75,557,812.20	0.57
42	601628	中国人寿	3,478,413	74,090,196.90	0.56

43	601766	中国南车	9,756,000	73,657,800.00	0.56
44	000792	盐湖钾肥	1,108,621	73,435,055.04	0.56
45	600068	葛洲坝	6,266,104	72,686,806.40	0.55
46	000568	泸州老窖	1,756,893	71,856,923.70	0.54
47	600256	广汇股份	1,676,635	70,301,305.55	0.53
48	600048	保利地产	5,507,406	69,944,056.20	0.53
49	000423	东阿阿胶	1,343,414	68,648,455.40	0.52
50	002202	金风科技	3,000,000	66,900,000.00	0.51
51	600489	中金黄金	1,653,128	66,687,183.52	0.51
52	601288	农业银行	24,820,098	66,517,862.64	0.50
53	601699	潞安环能	1,104,000	65,842,560.00	0.50
54	600104	上海汽车	4,441,551	65,201,968.68	0.49
55	600739	辽宁成大	2,112,877	63,639,855.24	0.48
56	000895	双汇发展	729,000	63,423,000.00	0.48
57	000060	中金岭南	2,730,373	61,433,392.50	0.47
58	600383	金地集团	9,762,720	60,333,609.60	0.46
59	601958	金钼股份	2,475,461	60,005,174.64	0.45
60	601299	中国北车	8,200,000	58,138,000.00	0.44
61	600875	东方电气	1,632,976	56,990,862.40	0.43
62	000425	徐工机械	993,125	56,806,750.00	0.43
63	601111	中国国航	4,081,091	55,829,324.88	0.42
64	600415	小商品城	1,564,383	54,815,980.32	0.42
65	000630	铜陵有色	1,557,943	54,605,902.15	0.41
66	600690	青岛海尔	1,933,308	54,538,618.68	0.41
67	600518	康美药业	2,762,798	54,454,748.58	0.41
68	601988	中国银行	16,782,167	54,206,399.41	0.41
69	601390	中国中铁	11,970,300	51,831,399.00	0.39
70	601989	中国重工	4,349,553	51,281,229.87	0.39
71	601919	中国远洋	5,349,897	50,289,031.80	0.38
72	601186	中国铁建	7,195,500	48,785,490.00	0.37
73	000039	中集集团	2,100,000	48,279,000.00	0.37
74	601898	中煤能源	4,390,000	47,675,400.00	0.36
75	601666	平煤股份	2,178,000	45,934,020.00	0.35
76	601600	中国铝业	4,486,886	45,497,024.04	0.34
77	600100	同方股份	1,700,000	45,067,000.00	0.34
78	000069	华侨城 A	3,640,674	44,234,189.10	0.34
79	600029	南方航空	4,521,368	44,038,124.32	0.33
80	600795	国电电力	14,198,828	43,448,413.68	0.33
81	000009	中国宝安	2,555,335	42,852,967.95	0.32
82	000878	云南铜业	1,545,262	42,494,705.00	0.32
83	601618	中国中冶	10,455,375	40,880,516.25	0.31
84	601607	上海医药	1,869,432	40,828,394.88	0.31

85	000538	云南白药	674,760	40,755,504.00	0.31
86	600188	兖州煤业	1,420,000	40,313,800.00	0.31
87	000528	柳工	1,067,781	39,507,897.00	0.30
88	600664	哈药股份	1,747,200	39,434,304.00	0.30
89	601808	中海油服	1,532,710	39,145,413.40	0.30
90	000012	南玻A	1,975,931	39,024,637.25	0.30
91	600123	兰花科创	807,223	38,004,058.84	0.29
92	600018	上港集团	9,931,730	37,839,891.30	0.29
93	600132	重庆啤酒	682,552	37,833,857.36	0.29
94	000402	金融街	5,697,809	37,662,517.49	0.29
95	600309	烟台万华	1,959,900	37,610,481.00	0.28
96	000768	西飞国际	3,070,000	37,269,800.00	0.28
97	000933	神火股份	1,484,582	37,188,779.10	0.28
98	600655	豫园商城	2,705,700	36,391,665.00	0.28
99	000709	河北钢铁	9,714,076	36,233,503.48	0.27
100	600166	福田汽车	1,489,200	36,157,776.00	0.27
101	000825	太钢不锈	6,712,418	35,844,312.12	0.27
102	000401	冀东水泥	1,500,000	35,445,000.00	0.27
103	000783	长江证券	3,067,237	34,659,778.10	0.26
104	002007	华兰生物	711,771	34,442,598.69	0.26
105	600497	驰宏锌锗	1,332,141	34,222,702.29	0.26
106	000623	吉林敖东	1,000,000	34,040,000.00	0.26
107	601001	大同煤业	1,611,619	33,860,115.19	0.26
108	600058	五矿发展	1,032,152	33,751,370.40	0.26
109	000898	鞍钢股份	4,355,308	33,666,530.84	0.26
110	000937	冀中能源	835,164	33,448,318.20	0.25
111	601788	光大证券	2,237,206	33,446,229.70	0.25
112	600583	海油工程	4,115,895	33,338,749.50	0.25
113	600694	大商股份	692,900	32,836,531.00	0.25
114	000960	锡业股份	994,848	32,531,529.60	0.25
115	600832	东方明珠	3,757,899	31,979,720.49	0.24
116	600550	天威保变	1,380,109	31,866,716.81	0.24
117	600005	武钢股份	7,410,900	31,718,652.00	0.24
118	600881	亚泰集团	4,700,000	31,490,000.00	0.24
119	600271	航天信息	1,142,959	31,442,802.09	0.24
120	000800	一汽轿车	1,924,000	30,880,200.00	0.23
121	600660	福耀玻璃	3,005,724	30,838,728.24	0.23
122	600549	厦门钨业	647,000	30,790,730.00	0.23
123	600177	雅戈尔	2,817,530	30,767,427.60	0.23
124	601688	华泰证券	2,231,794	30,620,213.68	0.23
125	600812	华北制药	1,946,900	30,585,799.00	0.23
126	600970	中材国际	750,000	30,532,500.00	0.23

127	600642	申能股份	3,983,814	30,396,500.82	0.23
128	600196	复星医药	2,252,398	30,339,801.06	0.23
129	600600	青岛啤酒	870,000	30,171,600.00	0.23
130	600997	开滦股份	1,490,000	29,993,700.00	0.23
131	002142	宁波银行	2,411,300	29,900,120.00	0.23
132	601998	中信银行	5,466,655	28,699,938.75	0.22
133	000758	中色股份	909,863	28,697,079.02	0.22
134	600352	浙江龙盛	2,438,526	28,603,909.98	0.22
135	600009	上海机场	2,290,710	28,381,896.90	0.21
136	600143	金发科技	1,757,624	28,315,322.64	0.21
137	002155	辰州矿业	779,741	28,008,296.72	0.21
138	600150	中国船舶	412,800	27,967,200.00	0.21
139	000839	中信国安	2,297,955	27,529,500.90	0.21
140	600320	振华重工	4,192,100	27,374,413.00	0.21
141	000969	安泰科技	1,174,409	27,222,800.62	0.21
142	000725	京东方 A	8,485,802	26,815,134.32	0.20
143	002304	洋河股份	118,922	26,638,528.00	0.20
144	000680	山推股份	1,448,600	26,350,034.00	0.20
145	600395	盘江股份	800,000	26,040,000.00	0.20
146	000024	招商地产	1,624,638	25,912,976.10	0.20
147	601866	中海集运	5,706,978	25,567,261.44	0.19
148	000778	新兴铸管	2,852,233	25,470,440.69	0.19
149	600221	海南航空	2,815,500	25,255,035.00	0.19
150	601333	广深铁路	7,315,770	25,239,406.50	0.19
151	600741	华域汽车	2,456,500	25,080,865.00	0.19
152	600011	华能国际	4,333,334	24,960,003.84	0.19
153	000422	湖北宜化	1,295,456	24,419,345.60	0.18
154	600125	铁龙物流	1,683,715	24,279,170.30	0.18
155	600631	百联股份	1,579,631	24,089,372.75	0.18
156	000729	燕京啤酒	1,268,261	24,084,276.39	0.18
157	000999	华润三九	938,315	23,973,948.25	0.18
158	600331	宏达股份	1,522,642	23,616,177.42	0.18
159	600062	双鹤药业	820,000	23,361,800.00	0.18
160	600010	包钢股份	6,140,396	23,272,100.84	0.18
161	000061	农产品	1,295,006	22,805,055.66	0.17
162	000562	宏源证券	1,359,356	22,755,619.44	0.17
163	000728	国元证券	1,843,770	22,604,620.20	0.17
164	600219	南山铝业	2,328,024	22,581,832.80	0.17
165	600879	航天电子	1,675,208	22,514,795.52	0.17
166	600598	北大荒	1,684,251	22,282,640.73	0.17
167	600169	太原重工	1,030,300	21,965,996.00	0.17
168	600649	城投控股	2,758,772	21,932,237.40	0.17

169	600208	新潮中宝	3,654,626	21,927,756.00	0.17
170	600108	亚盛集团	3,300,228	21,715,500.24	0.16
171	600601	方正科技	5,272,200	21,563,298.00	0.16
172	600085	同仁堂	625,541	21,443,545.48	0.16
173	600809	山西汾酒	312,876	21,441,392.28	0.16
174	600811	东方集团	2,730,501	21,407,127.84	0.16
175	600516	方大炭素	1,525,000	21,365,250.00	0.16
176	600153	建发股份	3,230,825	21,161,903.75	0.16
177	600635	大众公用	3,164,101	21,104,553.67	0.16
178	600216	浙江医药	645,000	21,007,650.00	0.16
179	601179	中国西电	2,658,015	20,998,318.50	0.16
180	000876	新希望	1,001,871	20,989,197.45	0.16
181	601888	中国国旅	671,529	20,797,253.13	0.16
182	000100	TCL 集团	6,000,000	20,580,000.00	0.16
183	600500	中化国际	1,730,338	20,504,505.30	0.16
184	002128	露天煤业	793,743	20,256,321.36	0.15
185	600432	吉恩镍业	781,035	19,978,875.30	0.15
186	600779	水井坊	892,244	19,807,816.80	0.15
187	600418	江淮汽车	1,862,700	19,800,501.00	0.15
188	000652	泰达股份	2,528,640	19,672,819.20	0.15
189	600588	用友软件	845,231	19,660,073.06	0.15
190	600595	中孚实业	1,423,971	19,650,799.80	0.15
191	600808	马钢股份	5,762,626	19,650,554.66	0.15
192	600508	上海能源	693,000	19,604,970.00	0.15
193	600037	歌华有线	1,537,156	19,214,450.00	0.15
194	600737	中粮屯河	1,210,385	19,184,602.25	0.15
195	000968	煤气化	731,730	19,003,028.10	0.14
196	600096	云天化	710,292	18,971,899.32	0.14
197	600118	中国卫星	762,704	18,930,313.28	0.14
198	000021	长城开发	1,587,931	18,642,309.94	0.14
199	600316	洪都航空	691,862	18,514,227.12	0.14
200	600066	宇通客车	880,300	18,512,709.00	0.14
201	600312	平高电气	1,318,237	17,967,570.31	0.14
202	002001	新和成	704,611	17,791,427.75	0.13
203	600839	四川长虹	4,798,000	17,752,600.00	0.13
204	600596	新安股份	1,140,008	17,350,921.76	0.13
205	600717	天津港	2,042,297	17,032,756.98	0.13
206	000807	云铝股份	1,425,081	17,015,467.14	0.13
207	601117	中国化学	2,939,873	16,992,465.94	0.13
208	002028	思源电气	645,215	16,949,798.05	0.13
209	000059	辽通化工	1,444,973	16,747,237.07	0.13
210	600663	陆家嘴	992,847	16,679,829.60	0.13

211	600675	中华企业	2,409,381	16,672,916.52	0.13
212	600895	张江高科	1,883,700	16,538,886.00	0.13
213	000612	焦作万方	753,197	16,419,694.60	0.12
214	000951	中国重汽	592,347	16,384,318.02	0.12
215	000690	宝新能源	2,947,059	16,297,236.27	0.12
216	600325	华发股份	1,600,000	16,224,000.00	0.12
217	600528	中铁二局	1,781,100	16,172,388.00	0.12
218	600239	云南城投	867,690	16,113,003.30	0.12
219	000027	深圳能源	1,590,604	16,049,194.36	0.12
220	000625	长安汽车	1,684,200	16,016,742.00	0.12
221	600183	生益科技	1,403,706	15,988,211.34	0.12
222	600210	紫江企业	2,757,000	15,935,460.00	0.12
223	600269	赣粤高速	2,860,083	15,930,662.31	0.12
224	600008	首创股份	2,313,860	15,572,277.80	0.12
225	600220	江苏阳光	3,005,089	15,566,361.02	0.12
226	601918	国投新集	1,075,047	15,104,410.35	0.11
227	600517	置信电气	908,894	15,069,462.52	0.11
228	600456	宝钛股份	554,895	15,037,654.50	0.11
229	000780	平庄能源	976,686	14,972,596.38	0.11
230	600026	中海发展	1,552,590	14,904,864.00	0.11
231	600380	健康元	1,299,036	14,380,328.52	0.11
232	600161	天坛生物	626,015	14,335,743.50	0.11
233	000900	现代投资	688,014	14,138,687.70	0.11
234	000686	东北证券	631,385	14,073,571.65	0.11
235	600863	内蒙华电	1,475,949	13,991,996.52	0.11
236	600170	上海建工	942,111	13,745,399.49	0.10
237	600428	中远航运	1,633,664	13,624,757.76	0.10
238	600674	川投能源	923,455	13,611,726.70	0.10
239	000031	中粮地产	2,183,072	13,600,538.56	0.10
240	000959	首钢股份	3,066,481	13,553,846.02	0.10
241	600804	鹏博士	1,554,070	13,473,786.90	0.10
242	600688	S 上石化	1,563,120	13,255,257.60	0.10
243	000667	名流置业	4,400,000	13,244,000.00	0.10
244	600266	北京城建	1,070,279	13,068,106.59	0.10
245	000718	苏宁环球	1,389,837	12,994,975.95	0.10
246	600643	爱建股份	1,340,625	12,762,750.00	0.10
247	601727	上海电气	1,468,742	12,454,932.16	0.09
248	600151	航天机电	946,991	12,452,931.65	0.09
249	002122	天马股份	935,638	12,406,559.88	0.09
250	600300	维维股份	2,084,500	12,298,550.00	0.09
251	600033	福建高速	3,433,506	12,188,946.30	0.09
252	600087	长航油运	2,412,603	11,725,250.58	0.09

253	600611	大众交通	1,533,850	11,703,275.50	0.09
254	000046	泛海建设	1,260,700	11,321,086.00	0.09
255	002244	滨江集团	1,000,000	11,280,000.00	0.09
256	600718	东软集团	686,654	11,013,930.16	0.08
257	000897	津滨发展	2,076,384	10,817,960.64	0.08
258	600816	安信信托	786,365	10,694,564.00	0.08
259	600597	光明乳业	1,027,301	10,540,108.26	0.08
260	600369	西南证券	901,508	10,484,538.04	0.08
261	600004	白云机场	1,175,521	10,368,095.22	0.08
262	600109	国金证券	707,742	10,347,188.04	0.08
263	600017	日照港	2,461,472	10,042,805.76	0.08
264	600820	隧道股份	890,448	9,768,214.56	0.07
265	000961	中南建设	843,387	9,639,913.41	0.07
266	000927	一汽夏利	1,180,000	9,617,000.00	0.07
267	600376	首开股份	570,000	9,604,500.00	0.07
268	000488	晨鸣纸业	1,351,884	9,544,301.04	0.07
269	600006	东风汽车	1,970,000	9,534,800.00	0.07
270	600307	酒钢宏兴	1,007,386	9,519,797.70	0.07
271	601588	北辰实业	2,561,338	8,964,683.00	0.07
272	601872	招商轮船	2,081,508	8,554,997.88	0.06
273	600748	上实发展	1,043,191	8,418,551.37	0.06
274	600251	冠农股份	295,199	8,392,507.57	0.06
275	600350	山东高速	1,758,610	8,212,708.70	0.06
276	002242	九阳股份	539,455	8,129,586.85	0.06
277	000685	中山公用	465,379	8,125,517.34	0.06
278	600823	世茂股份	599,920	8,104,919.20	0.06
279	601139	深圳燃气	621,515	7,713,001.15	0.06
280	600426	华鲁恒升	556,922	7,702,231.26	0.06
281	600886	国投电力	1,035,974	7,427,933.58	0.06
282	600022	济南钢铁	2,061,300	7,317,615.00	0.06
283	601991	大唐发电	1,196,919	7,289,236.71	0.06
284	601107	四川成渝	1,095,865	7,265,584.95	0.06
285	000717	韶钢松山	1,923,429	7,232,093.04	0.05
286	600835	上海机电	666,667	7,060,003.53	0.05
287	600657	信达地产	1,100,800	6,736,896.00	0.05
288	000932	华菱钢铁	1,815,238	6,661,923.46	0.05
289	000089	深圳机场	1,170,480	6,472,754.40	0.05
290	600236	桂冠电力	1,441,937	6,344,522.80	0.05
291	600027	华电国际	1,813,692	5,912,635.92	0.04
292	600246	万通地产	1,000,000	5,790,000.00	0.04
293	600569	安阳钢铁	1,557,692	5,264,998.96	0.04
294	601003	柳钢股份	941,430	4,650,664.20	0.04



295	600282	南钢股份	1,070,928	3,673,283.04	0.03
296	000631	顺发恒业	503,364	3,528,581.64	0.03
297	601099	太平洋	288,693	3,135,205.98	0.02
298	601801	皖新传媒	148,200	2,242,266.00	0.02
299	600102	莱钢股份	57,757	453,392.45	0.00

#### 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	601009	南京银行	133,026,911.77	0.89
2	601668	中国建筑	116,530,571.47	0.78
3	601328	交通银行	95,686,144.67	0.64
4	600000	浦发银行	95,132,933.63	0.63
5	601318	中国平安	94,056,702.61	0.63
6	601398	工商银行	88,970,737.70	0.59
7	601899	紫金矿业	81,747,540.25	0.54
8	601288	农业银行	81,564,688.23	0.54
9	601166	兴业银行	76,991,640.25	0.51
10	600016	民生银行	64,456,946.88	0.43
11	600015	华夏银行	59,049,663.94	0.39
12	601618	中国中冶	54,716,406.00	0.36
13	601988	中国银行	54,197,026.38	0.36
14	000709	河北钢铁	47,868,063.99	0.32
15	600030	中信证券	42,582,382.28	0.28
16	601299	中国北车	41,332,080.16	0.28
17	601006	大秦铁路	41,058,510.00	0.27
18	601989	中国重工	40,546,560.21	0.27
19	601088	中国神华	38,085,479.50	0.25
20	000002	万科A	37,864,094.08	0.25

注：本项的“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	600016	民生银行	113,592,571.81	0.76
2	601328	交通银行	103,215,771.73	0.69
3	601009	南京银行	98,826,886.19	0.66
4	601166	兴业银行	89,966,680.51	0.60
5	600000	浦发银行	84,922,530.09	0.57
6	600030	中信证券	75,151,018.23	0.50



7	000002	万 科 A	69,424,151.41	0.46
8	601318	中国平安	62,147,346.28	0.41
9	601988	中国银行	61,013,420.86	0.41
10	601398	工商银行	58,094,134.39	0.39
11	601088	中国神华	56,125,174.96	0.37
12	601169	北京银行	55,118,307.22	0.37
13	601601	中国太保	54,683,176.47	0.36
14	000001	深发展 A	50,138,983.62	0.33
15	600276	恒瑞医药	39,225,273.89	0.26
16	002142	宁波银行	37,925,283.81	0.25
17	600015	华夏银行	37,622,643.95	0.25
18	600001	邯郸钢铁	36,181,221.56	0.24
19	600900	长江电力	34,108,518.25	0.23
20	600357	承德钒钛	20,390,010.68	0.14

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	3,441,011,243.65
卖出股票的收入（成交）总额	3,563,724,294.63

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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

#### 8.9.3 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	1,279,453.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	148,683.29
5	应收申购款	6,919,280.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,347,417.22

#### 8.9.4 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。

#### 8.9.5 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。

#### 8.9.6 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
780,137	20,036.26	1,727,196,262.97	11.05%	13,903,829,740.25	88.95%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	739,786.73	0.005%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003年8月26日)基金份额总额	5,126,401,391.87
本报告期期初基金份额总额	15,653,254,485.73
本报告期基金总申购份额	4,877,346,475.54

减：本报告期基金总赎回份额	4,899,574,958.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,631,026,003.22

## § 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

(1) 基金管理人于 2010 年 4 月 3 日发布了《博时基金管理有限公司关于副总经理离任的公告》，李全先生辞去博时基金管理有限公司副总经理职务；

(2) 基金管理人于 2010 年 8 月 7 日发布了《博时基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，经博时基金管理有限公司董事会会议决议，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1053 号文核准，博时基金管理有限公司聘任杨锐、董良泓、李志惠、李雪松、邵凯担任博时基金管理有限公司副总经理；

(3) 基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务；

(4) 基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作)，其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

### 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 140,000 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

基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的任何情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	1	957,031,931.79	14.15%	813,475.95	14.55%	
中信建投	1	1,055,071,080.60	15.59%	896,813.03	16.05%	
国泰君安	2	2,079,889,506.55	30.74%	1,765,007.99	31.58%	
平安证券	1	52,037,773.46	0.77%	42,279.57	0.76%	
广发证券	1	650,795,412.56	9.62%	528,777.62	9.46%	
长江证券	1	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	1	866,135,984.37	12.80%	736,212.38	13.17%	
中信证券	1	217,417,209.61	3.21%	184,804.47	3.31%	
高华证券	1	392,074,886.95	5.79%	318,562.71	5.70%	
东方证券	1	495,349,689.59	7.32%	303,403.51	5.43%	新增

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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据本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。

### 11.8 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	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加南京银行股份有限公司定期定额投资业务与网上银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31

2	关于博时基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行股份有限公司网上及手机银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
3	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司“2011 倾心回馈”基金定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
4	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加杭州银行股份有限公司定期定额投资业务与网上银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
5	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
6	关于博时基金管理有限公司旗下开放式基金参加深圳发展银行股份有限公司定期定额投资业务与网上及电话银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-29
7	关于博时基金管理有限公司旗下开放式基金参加浙商银行股份有限公司网上银行申购业务与定期定额申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-23
8	博时基金管理有限公司增加深圳农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-20
9	博时基金管理有限公司关于开通汇付天天盈直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-13
10	博时基金管理有限公司增加洛阳银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-9
11	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金增加上海农村商业银行股份有限公司为代销机构并参加上海农村商业银行股份有限公司网上银行申购业务与定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-23
12	关于博时基金管理有限公司与招商银行合作进行直销网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-12
13	博时基金管理有限公司沈阳分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-11
14	博时基金管理有限公司增加烟台银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-9
15	博时基金管理有限公司关于设立博时基金（国际）有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-9

16	博时基金管理有限公司增加齐商银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-8
17	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加杭州银行股份有限公司网上银行申购费率和定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-4
18	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加华夏银行股份有限公司为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-10-15
19	博时基金管理有限公司关于增聘博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-10-12
20	关于博时旗下开放式基金参加渤海银行股份有限公司个人网上银行申购业务及定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-9-16
21	博时基金管理有限公司增加东兴证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-9-3
22	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-31
23	博时基金管理有限公司郑州分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-25
24	博时基金管理有限公司增加渤海银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-24
25	博时基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汉口银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-20
26	博时基金管理有限公司增加日信证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-19
27	关于德邦证券有限责任公司增加代销博时基金管理有限公司旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-17
28	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-12
29	关于方正证券有限责任公司增加代销博时基金管理有限公司旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-3
30	关于天源证券经纪有限公司增加代销博时基金管理有限公司旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、	2010-7-14



		证券时报	
31	关于博时基金管理有限公司参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-30
32	关于博时旗下开放式基金参加浦发银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-29
33	关于博时基金管理有限公司在申银万国证券股份有限公司推出定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-7
34	博时基金管理有限公司关于开通直销网上交易赎回转认/申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-7
35	关于大通证券股份有限公司增加代销博时基金管理有限公司旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-2
36	关于博时旗下开放式基金参加中信银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-1
37	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-1
38	博时基金管理有限公司关于增加江苏张家港农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-14
39	博时基金管理有限公司关于直销网上个人投资者汇款申购基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-10
40	关于西南证券股份有限公司增加代销博时基金管理有限公司旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-7
41	博时基金管理有限公司关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金、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的基金经理离任的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-30
42	关于博时基金管理有限公司旗下开放式基金参加深圳发展银行股份有限公司定期定额投资业务与网上及电话银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-29
43	博时基金管理有限公司关于增加英大证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-27

44	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-1
45	关于博时旗下开放式基金参加华夏银行股份有限公司网上银行申购业务及定期定额投资业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-31
46	博时基金管理有限公司关于增加徽商银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-24
47	博时基金管理有限公司关于直销个人投资者汇款购买基金的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-19
48	博时基金管理有限公司关于增聘博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-17
49	博时基金管理有限公司关于暂停部分基金在深圳证券交易所净值揭示的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-2
50	博时基金管理有限公司关于博时裕富证券投资基金更名的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-29
51	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加深圳发展银行股份有限公司定期定额投资业务与网上及电话银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-19
52	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加南京银行股份有限公司定期定额投资业务与网上银行申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-19
53	博时基金管理有限公司参加中国建设银行股份有限公司网上银行等电子渠道申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-15
54	关于在招商银行股份有限公司开通博时价值增长证券投资基金和博时裕富证券投资基金的基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-7

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

2010 年 1 月 29 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任本行副行长。

2010 年 5 月 13 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010 年 6 月 21 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任

## 公司承诺认购配股股票的公告

2010 年 7 月 1 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告, 每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税)。

2010 年 9 月 15 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布公告, 张福荣先生担任本行监事长, 谢渡扬先生辞去本行监事、监事长职务。

2010 年 11 月 2 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时裕富沪深 300 指数证券投资基金设立的文件

13.1.2 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》

13.1.3 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本

13.1.6 报告期内博时裕富沪深 300 指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅, 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

客户服务中心电话: 95105568 (免长途话费)

博时基金管理有限公司

2011 年 3 月 31 日