

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 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：二〇一六年八月二十五日

§ 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。本半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 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
§ 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 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	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	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
7.7 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	40
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	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	46
§ 11 备查文件目录	47
11.1 备查文件目录	47
11.2 存放地点	48
11.3 查阅方式	48

§ 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	4,150,025,955.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时裕富沪深 300A	博时裕富沪深 300C
下属分级基金的交易代码	050002	002385
报告期末下属分级基金的份额总额	4,144,794,935.75 份	5,231,019.39 份

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	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	95105568	010-67595096
传真	0755-83195140	010-66275853
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088号招商银行大厦29层	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	张光华	王洪章

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	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(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 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（2016年1月1日至2016年6月30日）	
	博时裕富沪深 300A	博时裕富沪深 300C
本期已实现收益	-278,159,679.20	-124,834.65
本期利润	-528,448,737.81	88,276.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1298	0.0278
本期加权平均净值利润率	-12.39%	2.64%
本期基金份额净值增长率	-11.24%	11.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
	博时裕富沪深 300A	博时裕富沪深 300C
期末可供分配利润	317,145,476.61	-429,665.16
期末可供分配基金份额利润	0.0765	-0.0821
期末基金资产净值	4,461,940,412.36	5,620,447.87
期末基金份额净值	1.0765	1.0744

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
	博时裕富沪深 300A	博时裕富沪深 300C
基金份额累计净值增长率	244.40%	11.20%

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。

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

博时裕富沪深 300A

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	1.02%	0.90%	-0.46%	0.93%	1.48%	-0.03%
过去三个月	0.33%	1.00%	-1.87%	0.96%	2.20%	0.04%
过去六个月	-11.24%	1.84%	-14.65%	1.75%	3.41%	0.09%
过去一年	-20.72%	2.30%	-27.99%	2.19%	7.27%	0.11%
过去三年	77.64%	1.81%	41.77%	1.75%	35.87%	0.06%
自基金合同生效起至今	244.40%	1.70%	149.63%	1.70%	94.77%	0.00%

博时裕富沪深 300C

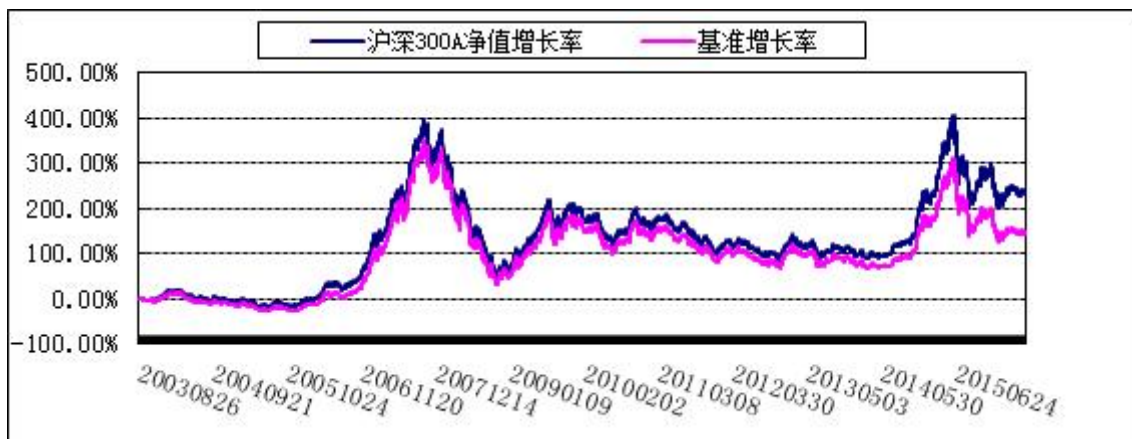
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.99%	0.90%	-0.46%	0.93%	1.45%	-0.03%
过去三个月	0.23%	1.00%	-1.87%	0.96%	2.10%	0.04%
自基金合同生效起至今	11.20%	1.41%	6.95%	1.33%	4.25%	0.08%

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%。

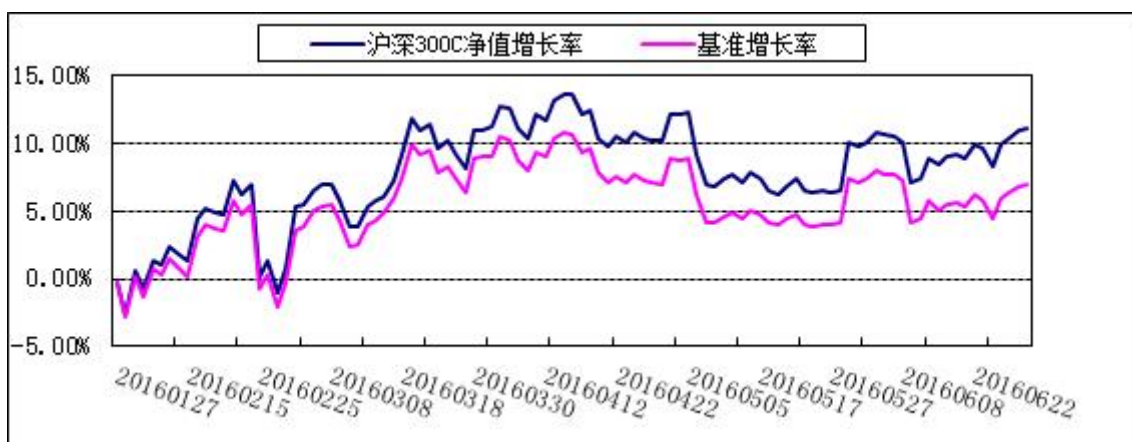
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

博时裕富沪深 300A



博时裕富沪深 300C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户。资产管理净值总规模达 4,598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，2016 年二季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

固定收益方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债基金今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；指数债券型基金里，博时上证企债 30ETF 今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第四，博时现金收益货币，今年以来净值增长率在同类 194 只基金中排名前 2/5；博时安丰 18 定期开放债券，今年以来净值增长率在同类 45 只中排名第四。

QDII 基金中，博时亚洲票息，今年以来至 6 月 30 日净值增长 7.12%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名第二。

2、其他大事件

- 2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

- 由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

- 2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金凭借在固定收益投资领域的突出表现，荣获“2015 年度金基金 · 债券投资回报基金管理公司”大奖。

- 2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。wind 数据显示，2015 年博时基金旗下 10 只纯债产品平均收益率达 12.65%，其中 6

只定期开放债基平均收益率更高达 15.17%，博时安丰 18 个月定期开放债券和博时双月薪双双夺得同类基金收益榜冠军。

•2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇” 315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。

•2016 年 1 月 18 日，大众证券报“2015 中国基金风云榜”上，博时创业成长(050014)荣获 2015 “最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰 18 个月定开债(160515)荣获 2015 “最佳固定收益型基金”奖。

•2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖盛典在京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

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		
桂征辉	基金经理	2015-07-21	-	6.9	2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理。现任博时沪深 300 指数基金兼博时中证淘金大数据 100 指数基金、博时银智大数据 100 指数基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2015-05-06	2016-05-30	5.8	2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时证券保险指数分级基金、博时

					黄金 ETF 基金、博时上证 50ETF 基金、博时上证 50ETF 联接基金、博时银行分级基金、博时黄金 ETF 联接基金的基金经理。
陈晓志	基金经理助理	2015-11-16	-	7.7	2007 年 7 月至 2008 年 10 月在华为技术有限公司工作。2008 年 11 月入职博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级开发经理。现任指数与量化投资部基金经理助理

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合规守信情况的说明

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

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

2016 年初，受人民币贬值预期和熔断机制影响，沪深 300 指数一月份指数下跌 21.04%。二月份之后，随着国内经济呈企稳态势，货币宽松政策的持续，A 股市场在大宗商品上涨和改革预期升温的带动下，逐步企稳反弹，沪深 300 指数上半年最终下跌 15.47%。从行业上看，食品饮料、家用电器等蓝筹受到市场热捧，而交通运输、国防军工、传媒等行业则相对表现落后。本组合采用量化增强方式管理，对低估值的银行、食品饮料等行业进行适当高配，在行业内通过多因子模型优选个股，相对业绩基准获取了

不错的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0765 元，份额累计净值为 3.0685 元；C 类基金份额净值为 1.0744 元，份额累计净值为 1.0744 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-11.24%，同期业绩基准增长率-14.65%，C 类基金份额净值增长率为 11.20%，同期业绩基准增长率 6.95%。

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 2016 下半年，英国脱欧事件影响全球央行的货币政策，美国本年加息概率进一步降低，国外市场风险的加大将缓解国内热钱外流局面，但国内经济下行和人民币贬值的压力仍在。市场层面，投资者结构依然以短期绝对收益投资者为主，存量博弈将继续存在，市场仍然以结构化行情为主。基建、医药和国防军工等行业会有进一步的上涨空间，看好国企改革、新能源等主题投资概念，低估值大盘蓝筹在下半年仍会是市场热点。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内共进行 1 次分红，以 2015 年 12 月 31 日可分配利润为基准，本基金 A 类份额每 10 份分红 0.12 元。

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，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，博时裕富沪深 300 指数 A 实施利润分配的金额为 47,359,408.26 元。

报告期内，博时裕富沪深 300 指数 C 未实施利润分配。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-

银行存款	6.4.3.1	175,169,495.98	278,467,602.02
结算备付金		7,288,739.46	13,061,447.99
存出保证金		488,911.85	1,297,610.42
交易性金融资产	6.4.3.2	4,297,201,314.25	4,512,879,064.21
其中：股票投资		4,142,973,093.75	4,511,392,396.21
基金投资		-	-
债券投资		154,228,220.50	1,486,668.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.3.5	2,209,961.82	73,988.24
应收股利		-	-
应收申购款		1,410,527.92	2,295,260.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		4,483,768,951.28	4,808,074,973.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		64,598.04	130,622.50
应付赎回款		4,425,952.99	4,663,274.08
应付管理人报酬		3,541,499.82	4,307,474.00
应付托管费		722,755.07	879,076.31
应付销售服务费		1,470.57	-
应付交易费用	6.4.3.7	6,875,773.70	6,981,792.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	576,040.86	487,401.29
负债合计		16,208,091.05	17,449,640.97
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	4,150,025,955.14	3,904,211,785.08
未分配利润	6.4.3.10	317,534,905.09	886,413,547.63
所有者权益合计		4,467,560,860.23	4,790,625,332.71
负债和所有者权益总计		4,483,768,951.28	4,808,074,973.68

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,150,025,955.14 份。其中 A 类基金份额

净值 1.0765 元，基金份额总额 4,144,794,935.75 份；C 类基金份额净值 1.0744 元，基金份额总额 5,231,019.39 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-490,391,120.32	3,308,602,866.67
1. 利息收入		1,876,232.18	3,229,528.48
其中：存款利息收入	6.4.3.11	830,184.27	1,903,410.85
债券利息收入		1,016,914.89	1,326,117.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,133.02	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-242,487,277.43	4,515,334,676.34
其中：股票投资收益	6.4.3.12	-283,059,095.97	4,432,226,079.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	16,095.80	17,586,774.90
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	40,555,722.74	65,521,821.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-250,075,947.96	-1,217,807,799.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	295,872.89	7,846,461.64
减：二、费用		37,969,341.49	102,741,084.67
1. 管理人报酬		20,782,847.91	52,310,372.89
2. 托管费		4,241,397.56	10,675,586.23
3. 销售服务费		5,521.35	-
4. 交易费用	6.4.3.18	12,706,621.03	39,507,793.18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.19	232,953.64	247,332.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-528,360,461.81	3,205,861,782.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-528,360,461.81	3,205,861,782.00

6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	3,904,211,785.08	886,413,547.63	4,790,625,332.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-528,360,461.81	-528,360,461.81
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）	245,814,170.06	6,841,227.53	252,655,397.59
其中：1. 基金申购款	571,570,607.43	24,459,123.41	596,029,730.84
2. 基金赎回款	-325,756,437.37	-17,617,895.88	-343,374,333.25
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）	-	-47,359,408.26	-47,359,408.26
五、期末所有者权益（基金净值）	4,150,025,955.14	317,534,905.09	4,467,560,860.23
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	11,836,975,021.49	399,250,654.78	12,236,225,676.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,205,861,782.00	3,205,861,782.00
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）	-6,428,252,737.26	-1,583,649,361.19	-8,011,902,098.45
其中：1. 基金申购款	4,596,301,993.80	1,078,724,915.56	5,675,026,909.36
2. 基金赎回款	-11,024,554,731.06	-2,662,374,276.75	-13,686,929,007.81
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）	5,408,722,284.23	2,021,463,075.59	7,430,185,359.82

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 主管会计工作的负责人：王德英 会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

(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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
活期存款	175,169,495.98
定期存款	-
其他存款	-
合计	175,169,495.98

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,001,953,835.71	4,142,973,093.75	141,019,258.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	154,428,000.00	154,228,220.50
	银行间市场	-	-
	合计	154,428,000.00	154,228,220.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,156,381,835.71	4,297,201,314.25	140,819,478.54

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	32,913.64
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	3,279.90
应收债券利息	2,173,548.28
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	220.00
合计	2,209,961.82

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,875,773.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,875,773.70

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	12,151.01
其他应付款	67.15
预提费用	313,822.70
合计	576,040.86

6.4.3.9 实收基金

博时裕富沪深 300A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,904,211,785.08	3,904,211,785.08
本期申购	558,455,043.70	558,455,043.70
本期赎回 (以“-”号填列)	-317,871,893.03	-317,871,893.03
本期末	4,144,794,935.75	4,144,794,935.75

博时裕富沪深 300C

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
本期申购	13,115,563.73	13,115,563.73
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,884,544.34	-7,884,544.34
本期末	5,231,019.39	5,231,019.39

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

博时裕富沪深 300A

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	2,066,629,877.77	-1,180,216,330.14	886,413,547.63
本期利润	-278,159,679.20	-250,289,058.61	-528,448,737.81
本期基金份额交易产生的变动数	116,064,448.84	-109,524,373.79	6,540,075.05
其中：基金申购款	264,590,989.58	-240,768,327.17	23,822,662.41
基金赎回款	-148,526,540.74	131,243,953.38	-17,282,587.36
本期已分配利润	-47,359,408.26	-	-47,359,408.26
本期末	1,857,175,239.15	-1,540,029,762.54	317,145,476.61

博时裕富沪深 300C

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
本期利润	-124,834.65	213,110.65	88,276.00
本期基金份额交易产生的变动数	-304,830.51	605,982.99	301,152.48
其中：基金申购款	-885,667.56	1,522,128.56	636,461.00
基金赎回款	580,837.05	-916,145.57	-335,308.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-429,665.16	819,093.64	389,428.48

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	751,894.36
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	68,040.31
其他	10,249.60
合计	830,184.27

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,418,825,654.63
减：卖出股票成本总额	4,701,884,750.60
买卖股票差价收入	-283,059,095.97

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	100,102.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	84,000.00
减：应收利息总额	7.00
买卖债券差价收入	16,095.80

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	40,555,722.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	40,555,722.74

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-250,075,947.96
——股票投资	-249,534,500.46
——债券投资	-541,447.50
——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	-
合计	-250,075,947.96

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	243,982.66
转换费收入	51,890.23
合计	295,872.89

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。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	12,706,621.03
银行间市场交易费用	-
合计	12,706,621.03

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	64,644.58
信息披露费	149,178.12
银行汇划费	10,130.94
银行间帐户服务费	9,000.00
合计	232,953.64

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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、基金注册登记机构、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

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
招商证券	1,769,935,036.76	19.68%	1,829,336,512.87	7.38%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
招商证券	1,559,556.54	20.82%	2,226,932.05	32.39%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
招商证券	1,481,034.63	7.26%	942,082.13	8.25%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,782,847.91	52,310,372.89
其中：支付销售机构的客户维护费	2,129,973.73	4,208,745.86

注：支付基金管理人博时基金管理有限公司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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.98% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,241,397.56	10,675,586.23

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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	175,169,495.98	751,894.36	256,332,067.84	1,657,740.33

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。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

博时裕富沪深 300A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分 配合计	备注
1	2016-01-19	2016-01-19	0.012	28,128,266 .70	19,231,141 .56	47,359, 408.26	-
合计			0.012	28,128,266 .70	19,231,141 .56	47,359, 408.26	-

6.4.8 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下 中签	5.80	5.80	971.0 0	5,631 .80	5,631 .80	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下 中签	12.98	12.98	15,34 1.00	199,1 26.18	199,1 26.18	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下 中签	10.05	10.05	926.0 0	9,306 .30	9,306 .30	
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-04	网下 中签	8.49	8.49	1,602 .00	13,60 0.98	13,60 0.98	-

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600019	宝钢股份	20160627	重大事项	4.90	未复牌	-	11,325,431	59,249,798.29	55,494,611.90	
600139	西部资源	20160411	重大事项	12.31	20160815	12.99	45,300	412,301.10	557,643.00	
600654	中安消	20160519	重大事项	18.54	20160808	20.39	54,200	1,282,069.00	1,004,868.00	
601611	中国核建	20160630	重大事项	20.92	20160701	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	
000002	万科 A	20151221	重大事项	18.20	20160704	21.99	4,014,804	46,044,055.75	73,069,432.80	
000409	山东地矿	20160314	重大事项	10.19	未复牌	-	334,300	3,846,247.88	3,406,517.00	
000415	渤海金控	20160201	重大事项	6.82	20160811	7.50	552,900	4,715,883.58	3,770,778.00	
000651	格力电器	20160222	重大事项	22.07	未复牌	-	2,406,292	38,889,901.38	53,106,864.44	
002314	南山控股	20160307	重大事项	6.83	20160719	7.51	123,900	856,488.11	846,237.00	
002319	乐通股份	20160602	重大事项	17.28	未复牌	-	134,200	2,218,339.00	2,318,976.00	

002555	三七互娱	20160310	重大事项	18.10	20160816	19.91	837,000	15,126,500.22	15,149,700.00	
300242	明家联合	20160509	重大事项	34.99	20160812	36.69	89,300	3,083,701.21	3,124,607.00	
合计								175,853,880.25	212,625,509.42	

本基金截至 2016 年 6 月 30 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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 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和债券投资等。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董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、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的建设，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系统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；监察法律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和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。

6.4.9.2 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；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。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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	141,941,200.00	-
合计	141,941,200.00	-

注：未评级债券为国债。

6.4.9.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	1,262,820.50	1,486,668.00

AAA 以下	-	-
AA+	-	-
AA	-	-
AA-	-	-
未评级	11,024,200.00	-
合计	12,287,020.50	1,486,668.00

注：未评级债券为国债。

6.4.9.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 6 月 30 日，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，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。

6.4.9.4 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。

6.4.9.4.1 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。

本基金持有及承担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、债券投资及资产支持证券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	175,169,495.98	-	-	-	175,169,495.98
结算备付金	7,288,739.46	-	-	-	7,288,739.46
存出保证金	488,911.85	-	-	-	488,911.85
交易性金融资产	152,965,400.00	1,262,820.50	-	4,142,973,093.75	4,297,201,314.25
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,209,961.82	2,209,961.82
应收申购款	-	-	-	1,410,527.92	1,410,527.92
资产总计	335,912,547.29	1,262,820.50	-	4,146,593,583.49	4,483,768,951.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	64,598.04	64,598.04
应付赎回款	-	-	-	4,425,952.99	4,425,952.99
应付管理人报酬	-	-	-	3,541,499.82	3,541,499.82

应付托管费	-	-	-	722,755.07	722,755.07
应付销售服务费	-	-	-	1,470.57	1,470.57
应付交易费用	-	-	-	6,875,773.70	6,875,773.70
其他负债	-	-	-	576,040.86	576,040.86
负债总计	-	-	-	16,208,091.05	16,208,091.05
利率敏感度缺口	335,912,547.29	1,262,820.50	-	4,130,385,492.44	4,467,560,860.23
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	278,467,602.02	-	-	-	278,467,602.02
结算备付金	13,061,447.99	-	-	-	13,061,447.99
存出保证金	1,297,610.42	-	-	-	1,297,610.42
交易性金融资产	-	-	1,486,668.00	4,511,392,396.21	4,512,879,064.21
应收利息	-	-	-	73,988.24	73,988.24
应收申购款	-	-	-	2,295,260.80	2,295,260.80
资产总计	292,826,660.43	-	1,486,668.00	4,513,761,645.25	4,808,074,973.68
负债					
应付证券清算款	-	-	-	130,622.50	130,622.50
应付赎回款	-	-	-	4,663,274.08	4,663,274.08
应付管理人报酬	-	-	-	4,307,474.00	4,307,474.00
应付托管费	-	-	-	879,076.31	879,076.31
应付交易费用	-	-	-	6,981,792.79	6,981,792.79
其他负债	-	-	-	487,401.29	487,401.29
负债总计	-	-	-	17,449,640.97	17,449,640.97
利率敏感度缺口	292,826,660.43	-	1,486,668.00	4,496,312,004.28	4,790,625,332.71

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予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比

例为 3.45% (2015 年 12 月 31 日: 0.03 %), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2015 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.4.3 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, 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%。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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	4,142,973,093.75	92.73	4,511,392,396.21	94.17
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

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	4,142,973,0	92.73	4,511,392,3	94.17
	93.75		96.21	

6.4.9.4.3.2 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 22,132	增加约 24,258
	2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 22,132	减少约 24,258

6.4.10 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) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 4,084,348,139.57 元，属于第二层次的余额为 212,853,174.68 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次 4,251,039,466.79 元，第二层次 261,839,597.42 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采

用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(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。

§ 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	4,142,973,093.75	92.40
	其中：股票	4,142,973,093.75	92.40
2	固定收益投资	154,228,220.50	3.44
	其中：债券	154,228,220.50	3.44
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	182,458,235.44	4.07
7	其他各项资产	4,109,401.59	0.09
8	合计	4,483,768,951.28	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	36,674,881.00	0.82
B	采矿业	214,285,529.56	4.80
C	制造业	1,231,473,129.13	27.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	160,009,296.95	3.58
E	建筑业	157,557,144.21	3.53
F	批发和零售业	191,072,844.09	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	123,887,210.09	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,449,602.36	3.21
J	金融业	1,516,722,578.82	33.95
K	房地产业	212,586,340.55	4.76
L	租赁和商务服务业	36,767,898.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	32,995,901.92	0.74
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	85,470,610.97	1.91
S	综合	-	-
	合计	4,142,973,093.75	92.73

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	601318	中国平安	5,582,434	178,861,185.36	4.00
2	601166	兴业银行	8,912,534	135,827,018.16	3.04
3	600000	浦发银行	6,880,344	107,126,956.08	2.40
4	600030	中信证券	5,215,935	84,654,625.05	1.89
5	600016	民生银行	8,711,130	77,790,390.90	1.74
6	601009	南京银行	7,818,890	73,419,377.10	1.64
7	000002	万科 A	4,014,804	73,069,432.80	1.64
8	000858	五粮液	2,194,000	71,370,820.00	1.60
9	601818	光大银行	18,795,186	70,669,899.36	1.58
10	601668	中国建筑	13,027,193	69,304,666.76	1.55

11	600519	贵州茅台	225,522	65,834,382.24	1.47
12	000776	广发证券	3,882,597	65,072,325.72	1.46
13	000333	美的集团	2,707,811	64,229,276.92	1.44
14	601328	交通银行	11,009,100	61,981,233.00	1.39
15	600028	中国石化	13,115,194	61,903,715.68	1.39
16	000166	申万宏源	7,150,000	60,131,500.00	1.35
17	601688	华泰证券	3,102,734	58,703,727.28	1.31
18	002142	宁波银行	3,789,600	56,010,288.00	1.25
19	600019	宝钢股份	11,325,431	55,494,611.90	1.24
20	601211	国泰君安	3,115,598	55,426,488.42	1.24
21	600104	上汽集团	2,678,274	54,342,179.46	1.22
22	600271	航天信息	2,253,004	53,621,495.20	1.20
23	600036	招商银行	3,046,000	53,305,000.00	1.19
24	600048	保利地产	6,172,825	53,271,479.75	1.19
25	000651	格力电器	2,406,292	53,106,864.44	1.19
26	000768	中航飞机	2,681,700	52,802,673.00	1.18
27	600109	国金证券	3,885,800	52,380,584.00	1.17
28	601899	紫金矿业	15,421,600	51,970,792.00	1.16
29	601607	上海医药	2,854,126	51,516,974.30	1.15
30	000895	双汇发展	2,450,700	51,170,616.00	1.15
31	300315	掌趣科技	4,864,600	51,029,654.00	1.14
32	601601	中国太保	1,849,504	50,010,588.16	1.12
33	601111	XD 中国国	6,962,500	47,066,500.00	1.05
34	000001	平安银行	5,140,729	44,724,342.30	1.00
35	601288	农业银行	13,629,000	43,612,800.00	0.98
36	600755	厦门国贸	5,257,400	41,796,330.00	0.94
37	600998	九州通	2,353,800	41,215,038.00	0.92
38	600015	华夏银行	4,001,466	39,574,498.74	0.89
39	600100	同方股份	2,602,000	38,925,920.00	0.87
40	300251	光线传媒	3,325,200	38,439,312.00	0.86
41	600688	上海石化	6,227,600	37,988,360.00	0.85
42	601186	中国铁建	3,793,700	37,785,252.00	0.85
43	600547	山东黄金	950,800	36,995,628.00	0.83
44	000036	华联控股	4,364,200	35,830,082.00	0.80
45	600027	华电国际	7,210,565	35,692,296.75	0.80
46	600837	海通证券	2,251,366	34,716,063.72	0.78
47	000063	中兴通讯	2,308,200	33,099,588.00	0.74
48	601012	隆基股份	2,358,300	30,775,815.00	0.69
49	000425	徐工机械	9,271,700	28,371,402.00	0.64
50	600031	三一重工	5,595,600	28,089,912.00	0.63
51	600757	长江传媒	3,237,003	27,158,455.17	0.61
52	600415	小商品城	4,394,400	27,157,392.00	0.61
53	600644	乐山电力	3,302,722	27,016,265.96	0.60

54	002006	精工科技	1,976,800	26,746,104.00	0.60
55	600221	海南航空	8,426,500	26,712,005.00	0.60
56	600651	飞乐音响	2,097,500	26,554,350.00	0.59
57	600216	浙江医药	1,872,200	24,694,318.00	0.55
58	600816	安信信托	1,454,725	24,541,210.75	0.55
59	600276	恒瑞医药	601,496	24,126,004.56	0.54
60	000069	华侨城 A	3,641,200	23,303,680.00	0.52
61	600900	长江电力	1,823,300	22,773,017.00	0.51
62	600795	国电电力	7,622,700	22,334,511.00	0.50
63	600741	华域汽车	1,587,812	22,245,246.12	0.50
64	002594	比亚迪	356,100	21,725,661.00	0.49
65	600196	复星医药	1,080,000	20,541,600.00	0.46
66	600029	南方航空	2,833,043	20,001,283.58	0.45
67	601390	中国中铁	2,821,700	19,667,249.00	0.44
68	002236	大华股份	1,454,950	19,059,845.00	0.43
69	002399	海普瑞	1,078,584	18,832,076.64	0.42
70	002714	牧原股份	353,700	17,872,461.00	0.40
71	600188	XD 兖州煤	1,616,100	17,680,134.00	0.40
72	600153	建发股份	1,469,400	17,632,800.00	0.39
73	601238	广汽集团	750,300	17,624,547.00	0.39
74	600074	保千里	1,178,200	17,578,744.00	0.39
75	002001	新和成	817,900	17,282,227.00	0.39
76	002426	胜利精密	1,689,250	16,639,112.50	0.37
77	000338	潍柴动力	2,123,800	16,586,878.00	0.37
78	601098	中南传媒	905,091	16,391,198.01	0.37
79	601618	中国中冶	4,389,193	16,196,122.17	0.36
80	300313	天山生物	986,600	16,180,240.00	0.36
81	000686	东北证券	1,249,500	16,131,045.00	0.36
82	600718	东软集团	862,700	15,804,664.00	0.35
83	601898	中煤能源	3,011,901	15,541,409.16	0.35
84	600377	宁沪高速	1,847,000	15,403,980.00	0.34
85	600340	华夏幸福	631,200	15,388,656.00	0.34
86	002503	搜于特	1,234,941	15,337,967.22	0.34
87	002555	三七互娱	837,000	15,149,700.00	0.34
88	601901	方正证券	1,961,000	15,021,260.00	0.34
89	603003	龙宇燃油	778,372	14,913,607.52	0.33
90	601169	北京银行	1,406,375	14,584,108.75	0.33
91	600240	华业资本	1,366,000	13,687,320.00	0.31
92	000600	建投能源	1,563,100	13,645,863.00	0.31
93	600038	中直股份	320,347	13,287,993.56	0.30
94	600406	国电南瑞	978,991	13,089,109.67	0.29
95	600050	XD 中国联	3,388,176	12,908,950.56	0.29
96	601225	陕西煤业	2,206,761	11,408,954.37	0.26

97	600383	金地集团	1,097,000	11,364,920.00	0.25
98	300104	乐视网	212,800	11,259,248.00	0.25
99	600023	浙能电力	2,189,900	11,146,591.00	0.25
100	600703	三安光电	517,700	10,338,469.00	0.23
101	000650	仁和药业	1,261,100	10,290,576.00	0.23
102	000698	沈阳化工	1,538,700	10,063,098.00	0.23
103	300003	乐普医疗	536,600	9,787,584.00	0.22
104	300070	碧水源	651,359	9,692,221.92	0.22
105	002195	二三四五	777,300	9,553,017.00	0.21
106	000521	美菱电器	1,528,400	9,216,252.00	0.21
107	600026	中海发展	1,559,866	9,203,209.40	0.21
108	000783	长江证券	780,655	9,055,598.00	0.20
109	600595	中孚实业	1,534,500	8,654,580.00	0.19
110	002202	金风科技	548,777	8,302,996.01	0.19
111	000413	东旭光电	961,800	8,261,862.00	0.18
112	002660	茂硕电源	540,900	8,151,363.00	0.18
113	600327	大东方	873,400	7,790,728.00	0.17
114	601139	深圳燃气	973,600	7,788,800.00	0.17
115	601088	中国神华	544,905	7,666,813.35	0.17
116	601998	中信银行	1,351,100	7,660,737.00	0.17
117	000876	新希望	866,788	7,211,676.16	0.16
118	600583	海油工程	1,035,300	7,153,923.00	0.16
119	002366	台海核电	129,800	6,919,638.00	0.15
120	002466	天齐锂业	157,300	6,715,137.00	0.15
121	601800	XD 中国交	629,500	6,628,635.00	0.15
122	000538	云南白药	101,412	6,520,791.60	0.15
123	601766	中国中车	701,548	6,433,195.16	0.14
124	002463	沪电股份	1,190,500	6,285,840.00	0.14
125	601788	光大证券	370,500	6,276,270.00	0.14
126	601179	中国西电	1,225,450	6,213,031.50	0.14
127	300113	顺网科技	159,900	6,069,804.00	0.14
128	600705	中航资本	1,021,186	6,004,573.68	0.13
129	600066	宇通客车	287,145	5,685,471.00	0.13
130	600398	海澜之家	486,700	5,499,710.00	0.12
131	000540	中天城投	877,300	5,465,579.00	0.12
132	601991	大唐发电	1,391,100	5,411,379.00	0.12
133	600068	XD 葛洲坝	919,100	5,349,162.00	0.12
134	600115	东方航空	763,751	5,048,394.11	0.11
135	002460	赣锋锂业	149,300	4,994,085.00	0.11
136	000709	河钢股份	1,780,661	4,932,430.97	0.11
137	600518	康美药业	322,000	4,891,180.00	0.11
138	601377	兴业证券	650,911	4,810,232.29	0.11
139	600060	海信电器	263,200	4,653,376.00	0.10

140	600177	雅戈尔	326,900	4,507,951.00	0.10
141	601628	中国人寿	214,600	4,467,972.00	0.10
142	601258	庞大集团	1,593,865	4,383,128.75	0.10
143	002024	苏宁云商	400,600	4,350,516.00	0.10
144	002008	大族激光	176,600	4,033,544.00	0.09
145	601336	新华保险	97,300	3,930,920.00	0.09
146	000415	渤海金控	552,900	3,770,778.00	0.08
147	300194	福安药业	165,855	3,590,760.75	0.08
148	600073	上海梅林	306,700	3,511,715.00	0.08
149	300144	宋城演艺	139,769	3,481,645.79	0.08
150	300017	网宿科技	51,500	3,460,800.00	0.08
151	000409	山东地矿	334,300	3,406,517.00	0.08
152	601985	中国核电	478,700	3,269,521.00	0.07
153	600578	京能电力	750,100	3,210,428.00	0.07
154	002640	跨境通	178,536	3,145,804.32	0.07
155	300242	明家联合	89,300	3,124,607.00	0.07
156	300062	中能电气	122,297	2,963,256.31	0.07
157	600485	信威集团	156,700	2,795,528.00	0.06
158	601989	中国重工	426,500	2,699,745.00	0.06
159	002696	百洋股份	137,000	2,622,180.00	0.06
160	600875	东方电气	258,100	2,534,542.00	0.06
161	600505	西昌电力	270,700	2,414,644.00	0.05
162	300002	神州泰岳	218,200	2,321,648.00	0.05
163	002319	乐通股份	134,200	2,318,976.00	0.05
164	000411	英特集团	118,100	2,183,669.00	0.05
165	000625	长安汽车	154,500	2,112,015.00	0.05
166	000963	华东医药	29,018	1,955,813.20	0.04
167	600642	申能股份	327,200	1,878,128.00	0.04
168	002475	立讯精密	91,400	1,796,010.00	0.04
169	300063	天龙集团	52,600	1,566,428.00	0.04
170	002193	山东如意	89,100	1,462,131.00	0.03
171	600011	华能国际	194,162	1,460,098.24	0.03
172	002368	太极股份	38,100	1,353,693.00	0.03
173	300058	蓝色光标	118,300	1,148,693.00	0.03
174	600886	国投电力	167,300	1,104,180.00	0.02
175	000066	长城电脑	85,900	1,095,225.00	0.02
176	600654	中安消	54,200	1,004,868.00	0.02
177	002310	东方园林	41,900	1,002,248.00	0.02
178	600022	山东钢铁	380,500	901,785.00	0.02
179	000993	闽东电力	97,800	863,574.00	0.02
180	002314	南山控股	123,900	846,237.00	0.02
181	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
182	600139	西部资源	45,300	557,643.00	0.01

183	300280	南通锻压	17,100	485,298.00	0.01
184	600009	上海机场	17,300	450,665.00	0.01
185	300287	飞利信	23,000	308,200.00	0.01
186	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
187	601398	工商银行	54,000	239,760.00	0.01
188	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
189	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
190	000785	武汉中商	16,900	188,435.00	0.00
191	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
192	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
193	300182	捷成股份	3,843	65,753.73	0.00
194	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
195	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
196	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
197	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
198	002007	华兰生物	700	21,980.00	0.00
199	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
200	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
201	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
202	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
203	002110	三钢闽光	600	3,624.00	0.00
204	600170	上海建工	600	2,298.00	0.00
205	601333	广深铁路	300	1,173.00	0.00
206	600356	恒丰纸业	100	1,070.00	0.00
207	000863	三湘股份	100	920.00	0.00
208	000807	云铝股份	100	655.00	0.00
209	600715	文投控股	1	19.17	0.00

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	601211	国泰君安	77,714,252.87	1.62
2	601328	交通银行	73,801,977.86	1.54
3	601009	南京银行	65,971,088.12	1.38
4	000166	申万宏源	59,654,258.26	1.25
5	300315	掌趣科技	54,419,847.60	1.14
6	002142	宁波银行	53,927,443.43	1.13
7	600048	保利地产	51,696,986.40	1.08
8	600026	中海发展	51,325,561.84	1.07
9	601818	光大银行	51,218,987.27	1.07
10	601288	农业银行	50,074,970.97	1.05

11	600015	华夏银行	48,092,947.42	1.00
12	601169	北京银行	45,401,671.30	0.95
13	600276	恒瑞医药	44,755,075.51	0.93
14	000783	长江证券	44,525,023.46	0.93
15	600998	九州通	42,245,976.00	0.88
16	000768	中航飞机	41,623,896.35	0.87
17	600019	宝钢股份	40,450,486.08	0.84
18	600415	小商品城	39,787,429.02	0.83
19	002594	比亚迪	38,936,873.24	0.81
20	600755	厦门国贸	38,904,299.06	0.81

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。

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	600016	民生银行	90,874,644.05	1.90
2	601169	北京银行	74,899,668.27	1.56
3	601328	交通银行	71,538,532.60	1.49
4	000783	长江证券	68,106,530.28	1.42
5	300059	东方财富	58,634,786.14	1.22
6	600066	宇通客车	54,173,952.81	1.13
7	601009	南京银行	50,961,925.11	1.06
8	000983	西山煤电	50,826,949.86	1.06
9	600011	华能国际	50,285,304.53	1.05
10	601788	光大证券	45,298,415.15	0.95
11	000963	华东医药	42,252,784.18	0.88
12	000046	泛海控股	42,038,323.16	0.88
13	600894	广日股份	41,799,463.41	0.87
14	002202	金风科技	41,797,043.05	0.87
15	600519	贵州茅台	40,056,539.61	0.84
16	000999	华润三九	39,784,091.18	0.83
17	600026	中海发展	39,141,741.31	0.82
18	600373	中文传媒	38,855,671.39	0.81
19	000413	东旭光电	38,378,426.63	0.80
20	601088	中国神华	37,543,871.05	0.78

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。

7.4.3 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	4,582,999,948.60
卖出股票的收入（成交）总额	4,418,825,654.63

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	152,965,400.00	3.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,262,820.50	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	154,228,220.50	3.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019533	16 国债 05	700,000	69,958,000.00	1.57
2	019520	15 国债 20	500,000	49,970,000.00	1.12
3	019527	15 国债 27	220,000	22,013,200.00	0.49
4	019419	14 国债 19	110,000	11,024,200.00	0.25
5	110031	航信转债	11,450	1,262,820.50	0.03

7.7 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。

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名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 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。

7.12.2 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。

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	488,911.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,209,961.82
5	应收申购款	1,410,527.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,109,401.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	1,262,820.50	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	73,069,432.80	1.64	公布重大事项

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

份额单位：份

份额级别	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
博时沪深 300A类	248,987.00	16,646.63	177,298,640.54	4.28%	3,967,496,295.21	95.72%
博时沪深 300C类	323.00	16,195.11	1,061,022.18	20.28%	4,169,997.21	79.72%
合计	249,310.00	16,646.05	178,359,662.72	4.30%	3,971,666,292.42	95.70%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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 持有本基金	博时沪深 300A 类	216,948.41	0.01%
	博时沪深 300C 类	-	-
	合计	216,948.41	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投 资和研究部门负责人持有本 开放式基金	博时沪深 300A 类	-
	博时沪深 300C 类	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式 基金	博时沪深 300A 类	0-10
	博时沪深 300C 类	-
	合计	0-10

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时裕富沪深 300A	博时裕富沪深 300C
基金合同生效日(2003年8月26日)	5,126,401,391.87	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	3,904,211,785.08	-
本报告期基金总申购份额	558,455,043.70	13,115,563.73
减：本报告期基金总赎回份额	317,871,893.03	7,884,544.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,144,794,935.75	5,231,019.39

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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（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

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

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	
华福证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	3	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	新增 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	1,769,935,036.76	19.68%	1,559,556.54	20.82%	-
中金公司	1	972,976,955.34	10.82%	906,142.81	12.10%	-
万联证券	1	936,466,361.29	10.41%	684,839.67	9.14%	-
华创证券	2	747,050,054.50	8.31%	546,314.76	7.29%	-
中信证券	5	694,584,106.95	7.72%	575,454.99	7.68%	-
银河证券	1	694,378,765.23	7.72%	646,604.74	8.63%	-
兴业证券	1	589,477,772.44	6.56%	548,955.41	7.33%	-
西南证券	1	562,232,648.69	6.25%	411,167.24	5.49%	新增 1 个
瑞银证券	1	422,608,592.65	4.70%	393,593.43	5.26%	-
国信证券	1	391,382,549.87	4.35%	286,160.77	3.82%	-
国开证券	1	314,447,179.60	3.50%	229,940.49	3.07%	-
东方证券	3	237,864,722.08	2.65%	173,959.51	2.32%	-
民生证券	1	225,224,595.61	2.50%	164,709.44	2.20%	-
财富里昂证券	1	210,005,655.40	2.34%	153,578.26	2.05%	-
中信建投	3	209,416,289.26	2.33%	195,032.06	2.60%	-
国泰君安	5	14,700,194.55	0.16%	13,690.10	0.18%	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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。

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
华福证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	10,000,000.00	3.85%	-	-
中信证券	-	-	120,000,000.00	46.15%	-	-
银河证券	61,138,000.00	39.86%	-	-	-	-
兴业证券	22,155,102.80	14.44%	-	-	-	-
西南证券	-	-	130,000,000.00	50.00%	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	70,090,000.00	45.70%	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

财富里昂证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	博时博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-15
2	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-20
3	关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 C 类份额开通直销网上交易定期投资业务和对直销网上投资者交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-01-23
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中信期货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	2016-03-09
5	关于博时旗下部分开放式基金增加海银基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-25
6	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2015 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
7	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2015 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-26
8	关于博时旗下部分开放式基金增加北京蕙次方资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-29
9	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-30
10	关于博时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	2016-04-01
11	关于博时旗下部分开放式基金参加江苏张家港农村商业银行股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-11
12	关于博时旗下部分开放式基金增加北京懒猫金融信息服务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	2016-04-20
13	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-22
14	关于博时旗下部分开放式基金增加北京植信基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-26

15	关于博时旗下部分开放式基金增加德州银行股份有限公司为代销机构并参加其申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-04-27
16	关于博时沪深 300 指数基金（C 类）新增国联证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-03
17	关于博时旗下部分开放式基金增加大连网金金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-06
18	关于博时旗下部分开放式基金增加星展银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-27
19	关于博时旗下部分开放式基金增加新增乾道金融信息服务（北京）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-27
20	博时基金管理有限公司关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-05-31
21	关于博时旗下部分开放式基金增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为代销机构公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-01
22	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳前海凯恩斯基金销售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	2016-06-06
23	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金的申购、定投、最低持有数量限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-08
24	关于博时旗下部分开放式基金参加东方证券申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-13
25	关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-16
26	关于博时旗下部分开放式基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-06-24

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

11.1.1 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

11.1.2 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》

11.1.3 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》

11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

11.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本

11.1.6 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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

11.3 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

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一六年八月二十五日