博时裕富沪深300指数证券投资基金
2021年中期报告
2021年6月30日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021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
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 5
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 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 14
6.4 报表附注 15
§7 投资组合报告 34
7.1 期末基金资产组合情况 34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 35
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 35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 44
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 44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 45
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
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的情况 46
§9 开放式基金份额变动 46

§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 52
§12 备查文件目录 52
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 52
12.3 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	3,092,845,434.56 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
下属分级基金的交易代码	050002	002385	960022
报告期末下属分级基金的份额总额	2,738,784,088.44 份	354,061,346.12 份	-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，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。即调整其股票资产比例为 95%以内，现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于 5%。 1.资产配置原则 本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨，采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，再进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例，以完全复制的方法进行组合构建。 2.资产配置策略 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。 3.股票资产配置策略 本基金股票资产投资以沪深 300 指数为标的指数，原则上采用完全复制标的指数的方法，首先按照标的指数中的行业权重为基准权重，确定行业配置比例；再进一步根据各行业中的个股基准权重，确定行业内的个股配置比例。 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 4、投资组合调整原则 本基金的股票投资为完全复制的被动式指数投资，债券投资为流动性风险约束下的被动式投资，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。
业绩比较基准	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	李申
	联系电话	0755-83169999	021-60637102
	电子邮箱	service@bosera.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	021-60637111
传真		0755-83195140	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 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益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		江向阳	田国立

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）		
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
本期已实现收益	576,477,781.28	56,192,037.09	-
本期利润	90,691,751.18	16,517,652.75	-

加权平均基金份额本期利润	0.0328	0.0578	-
本期加权平均净值利润率	1.64%	2.91%	-
本期基金份额净值增长率	1.35%	1.14%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)		
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
期末可供分配利润	2,749,720,571.82	230,042,949.28	-
期末可供分配基金份额利润	1.0040	0.6497	-
期末基金资产净值	5,488,504,660.26	703,238,338.58	-
期末基金份额净值	2.0040	1.9862	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)		
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
基金份额累计净值增长率	556.28%	107.67%	1.76%

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

博时沪深 300 指数 A

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	-0.79%	0.75%	-1.91%	0.76%	1.12%	-0.01%
过去三个月	3.78%	0.90%	3.32%	0.93%	0.46%	-0.03%
过去六个月	1.35%	1.29%	0.29%	1.25%	1.06%	0.04%
过去一年	27.24%	1.28%	24.19%	1.27%	3.05%	0.01%
过去三年	53.53%	1.29%	46.47%	1.30%	7.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	556.28%	1.56%	305.46%	1.56%	250.82%	0.00%

博时沪深 300 指数 C

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	-0.82%	0.75%	-1.91%	0.76%	1.09%	-0.01%
过去三个月	3.67%	0.90%	3.32%	0.93%	0.35%	-0.03%
过去六个月	1.14%	1.29%	0.29%	1.25%	0.85%	0.04%
过去一年	26.74%	1.28%	24.19%	1.27%	2.55%	0.01%
过去三年	51.71%	1.29%	46.47%	1.30%	5.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	107.67%	1.15%	73.72%	1.14%	33.95%	0.01%

注：自 2016 年 1 月 27 日起，本基金新增 C 类份额。

博时沪深 300 指数 R

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

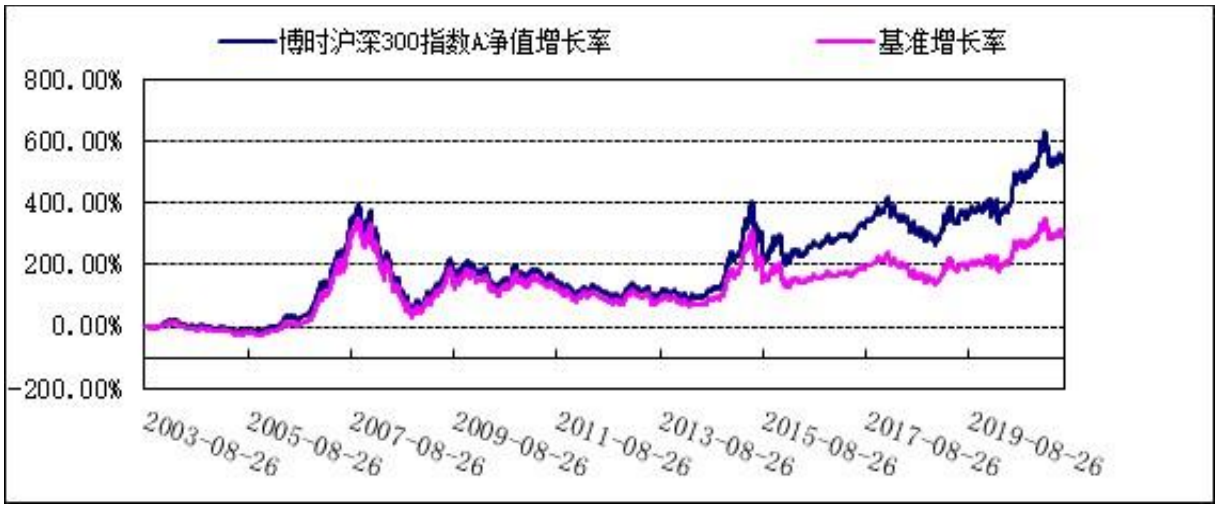
	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三年	-8.75%	1.48%	-8.23%	1.53%	-0.52%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.76%	0.97%	-3.67%	0.95%	5.43%	0.02%

注：自 2016 年 9 月 8 日起，本基金新增 R 类份额；自 2018 年 11 月 15 日起，本基金份额全部赎空，故沪深 300R 类份额数据截止日为 2018 年 11 月 14 日。

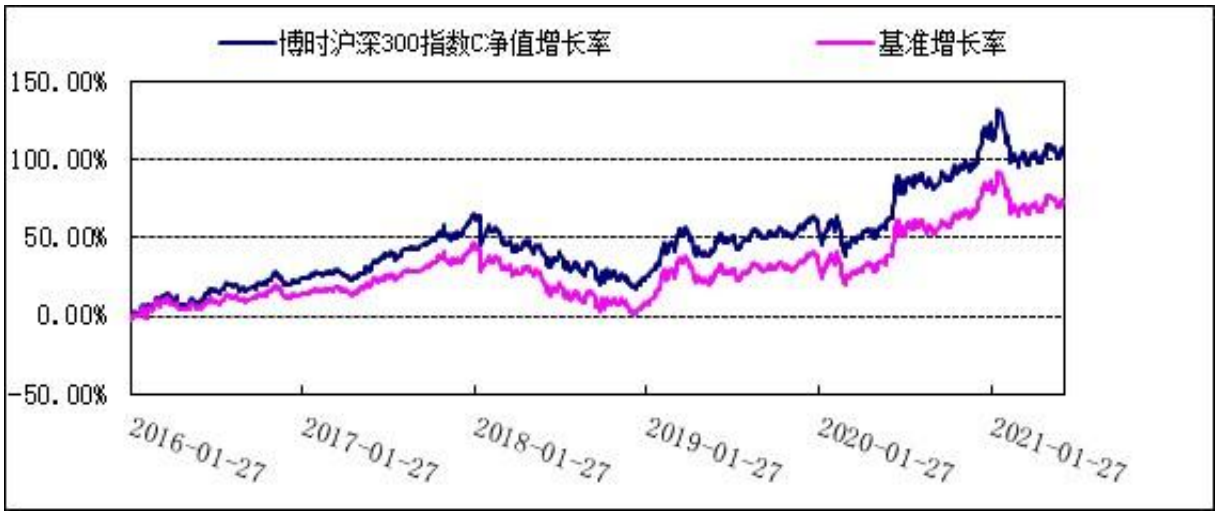
自基金成立至 2004 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为新华富时 A200 复合指数；自 2005 年 1 月 1 日起，本基金业绩比较基准为 95%的沪深 300 指数+5%的银行同业存款利率。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

博时沪深 300 指数 A



博时沪深 300 指数 C



博时沪深 300 指数 R

§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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12150 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020“Best of the Best Awards”三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获 “中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

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		
杨振建	基金经理	2020-12-23	-	7.8	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理。现任博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)的基金经理。
桂征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2015-07-21	-	11.8	桂征辉先生，硕士。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、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2020 年 12 月 23 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日—至

					今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)的基金经理。
刘玉强	基金经理助理	2020-02-21	-	6.0	2015 年 7 月硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任指数与量化投资部研究员，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遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 24 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，A 股市场整体震荡上行，最终收于 3591 点左右。风格方面整体延续结构性行情，医药、科技股、光伏新能源整体较为强势，周期股一季度有所表现，后续随着大宗价格调整，整体有所回落。本基金利用数量化手段对组合进行管理，严格控制与指数跟踪偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 2.0040 元，份额累计净值为 4.0379 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.9862 元，份额累计净值为 2.0044 元，本基金 R 类基金期末无份额，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.35%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.14%，同期业绩基准增长率为 0.29%。

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 2021 年下半年，宏观层面，随着新冠疫苗在欧美主要经济体全面普及，欧美疫情有望较快控制，全球经济复苏将更加全面和均衡，当前供需不均衡的局面有望逐步修复。国内经济方面，整体经济延续良好的复苏态势，同时受益于较为完善的供应链和良好的要素效率，经济整体景气复苏趋势良好。货币政策方面，目前流动性还是延续整体充裕性，不急转弯，当前由于全球经济复苏使得大宗品价格大幅上涨，PPI 持续走高，未来随着产能未来逐渐释放，该矛盾点有望逐渐得到解决，后续需要紧密跟踪相关原材料价格的趋势变化。总体上，货币流动性无需过度担忧，仍然处在逐步回归常态的过程中，市场机会需要更加紧扣上市公司的盈利预期变化。

今年以来龙头公司整体有所调整，当前正处在一个比较合理的位置，而沪深 300 作为 A 股核心资产的重要标的，值得长期配置。当前我们需要持续关注结构性信用出清压力和微观流动性变化趋势的影响，适当保持仓位的灵活性，把握结构性机会。在具体板块上，要以业绩确定性和稳定性的行业和板块为主要配置方向，重视消费、医药、科技的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、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债金融估值中心有限公司签署服务协议，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

本基金管理人于 2021 年 1 月 13 日发布公告，以 2020 年 12 月 31 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.2110 元人民币，

本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0960 元人民币。

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，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，博时沪深 300 指数 A 实施利润分配的金额为 58,596,870.06 元；

报告期内，博时沪深 300 指数 C 实施利润分配的金额为 2,292,299.92 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

资产：		**-**	**-**
银行存款	6.4.3.1	196,978,347.71	158,543,261.26
结算备付金		3,369,087.26	9,243,395.28
存出保证金		355,022.21	476,435.47
交易性金融资产	6.4.3.2	6,000,552,742.25	6,238,858,311.89
其中：股票投资		5,788,528,742.25	6,019,824,072.87
基金投资		-	-
债券投资		212,024,000.00	219,034,239.02
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		356,727.80	12,739,535.93
应收利息	6.4.3.5	4,192,327.14	1,385,402.73
应收股利		-	-
应收申购款		8,263,813.91	6,165,403.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		**6,214,068,068.28**	**6,427,411,746.16**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021年6月30日**	**上年度末 2020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		-	12,819,105.98
应付赎回款		11,707,621.48	27,588,730.44
应付管理人报酬		4,925,297.66	5,139,366.60
应付托管费		1,005,162.77	1,048,850.33
应付销售服务费		218,527.28	212,197.00
应付交易费用	6.4.3.7	4,072,347.66	4,898,474.71
应交税费		1.88	22.21
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	396,110.71	547,841.26
负债合计		22,325,069.44	52,254,588.53
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	3,092,845,434.56	3,195,463,180.41
未分配利润	6.4.3.10	3,098,897,564.28	3,179,693,977.22
所有者权益合计		6,191,742,998.84	6,375,157,157.63
负债和所有者权益总计		**6,214,068,068.28**	**6,427,411,746.16**

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额3,092,845,434.56份。其中一类基金份额净值2.0040元，基金份额总额2,738,784,088.44份；二类基金份额净值1.9862元，基金份额总额354,061,346.12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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		**158,525,716.56**	**225,772,366.18**
1.利息收入		3,161,680.96	1,474,691.65
其中：存款利息收入	6.4.3.11	356,308.92	1,422,030.52
债券利息收入		2,805,372.04	52,661.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		679,058,892.74	342,396,195.82
其中：股票投资收益	6.4.3.12	630,021,379.39	277,073,810.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	2,364,165.81	1,627,523.03
资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
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	46,673,347.54	63,694,862.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-525,460,414.44	-120,862,570.27
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	1,765,557.30	2,764,048.98
减：二、费用		**51,316,312.63**	**47,443,624.76**
1．管理人报酬		29,768,800.33	29,619,380.97
2．托管费		6,075,265.39	6,044,771.59
3．销售服务费		1,129,308.49	534,723.01
4．交易费用	6.4.3.18	14,205,184.40	11,102,496.43
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		5.58	6.95
7．其他费用	6.4.3.19	137,748.44	142,245.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**107,209,403.93**	**178,328,741.42**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**107,209,403.93**	**178,328,741.42**

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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）	3,195,463,180.41	3,179,693,977.22	6,375,157,157.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	107,209,403.93	107,209,403.93
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）	-102,617,745.85	-127,116,646.89	-229,734,392.74
其中：1.基金申购款	1,031,761,169.93	1,050,831,355.48	2,082,592,525.41
2.基金赎回款	-1,134,378,915.78	-1,177,948,002.37	-2,312,326,918.15
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）	-	-60,889,169.98	-60,889,169.98
五、期末所有者权益（基金净值）	3,092,845,434.56	3,098,897,564.28	6,191,742,998.84
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	4,189,136,673.58	2,355,798,169.37	6,544,934,842.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	178,328,741.42	178,328,741.42
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）	-628,745,651.96	-368,809,727.80	-997,555,379.76
其中：1.基金申购款	1,244,971,727.39	591,352,083.44	1,836,323,810.83
2.基金赎回款	-1,873,717,379.35	-960,161,811.24	-2,833,879,190.59
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）	-	-64,309,845.79	-64,309,845.79
五、期末所有者权益（基金净值）	3,560,391,021.62	2,101,007,337.20	5,661,398,358.82

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，　主管会计工作负责人：孙献，　会计机构负责人：侣方方

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[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》、财税[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。

(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。

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

适用比例计算缴纳。

6.4.3 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 2021年6月30日
活期存款	196,978,347.71
定期存款	-
其他存款	-
合计	196,978,347.71

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,731,226,918.73	5,788,528,742.25	1,057,301,823.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,651,000.00	1,651,000.00	-
	银行间市场	209,912,450.00	210,373,000.00	460,550.00
	合计	211,563,450.00	212,024,000.00	460,550.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,942,790,368.73	6,000,552,742.25	1,057,762,373.52

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

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	21,952.92
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	1,516.10
应收债券利息	4,168,698.32
应收资产支持证券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	159.80
合计	4,192,327.14

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,072,347.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,072,347.66

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	22,155.66
应付证券出借违约金	-
其他应付款	440.31
预提费用	123,514.74
合计	396,110.71

6.4.3.9 实收基金

博时沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,877,320,794.13	2,877,320,794.13
本期申购	655,706,611.62	655,706,611.62
本期赎回（以“-”号填列）	-794,243,317.31	-794,243,317.31
本期末	2,738,784,088.44	2,738,784,088.44

博时沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	318,142,386.28	318,142,386.28
本期申购	376,054,558.31	376,054,558.31
本期赎回（以“-”号填列）	-340,135,598.47	-340,135,598.47
本期末	354,061,346.12	354,061,346.12

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

6.4.3.10 未分配利润

博时沪深 300 指数 A

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	2,888,352,409.44	-18,175,737.22	2,870,176,672.22
本期利润	576,477,781.28	-485,786,030.10	90,691,751.18
本期基金份额交易产生的变动数	-141,207,879.34	-11,343,102.18	-152,550,981.52
其中：基金申购款	710,329,559.54	-35,195,306.31	675,134,253.23
基金赎回款	-851,537,438.88	23,852,204.13	-827,685,234.75
本期已分配利润	-58,596,870.06	-	-58,596,870.06
本期末	3,265,025,441.32	-515,304,869.50	2,749,720,571.82

博时沪深 300 指数 C

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	144,936,145.61	164,581,159.39	309,517,305.00
本期利润	56,192,037.09	-39,674,384.34	16,517,652.75
本期基金份额交易产生的变动数	31,207,066.50	-5,772,731.87	25,434,334.63
其中：基金申购款	207,280,482.40	168,416,619.85	375,697,102.25
基金赎回款	-176,073,415.90	-174,189,351.72	-350,262,767.62
本期已分配利润	-2,292,299.92	-	-2,292,299.92
本期末	230,042,949.28	119,134,043.18	349,176,992.46

博时沪深 300 指数 R

无余额。

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	290,739.81
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	59,725.93
其他	5,843.18
合计	356,308.92

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,243,645,207.51
减：卖出股票成本总额	4,613,623,828.12
买卖股票差价收入	630,021,379.39

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,786,768.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,420,400.00
减：应收利息总额	2,202.74
买卖债券差价收入	2,364,165.81

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	46,673,347.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	46,673,347.54

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-525,460,414.44
——股票投资	-525,579,575.42
——债券投资	119,160.98
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-525,460,414.44

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	1,721,174.22
转换费收入	44,383.08
合计	1,765,557.30

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	14,205,184.40
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
基金交易费用	-
合计	14,205,184.40

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	9,733.70
中债登账户维护费	9,000.00
合计	137,748.44

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

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	105,960,104.20	1.05%	552,700,398.58	7.35%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	98,682.35	1.23%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	404,225.31	6.61%	379,017.69	10.46%

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,768,800.33	29,619,380.97
其中：支付销售机构的客户维护费	6,224,638.96	4,782,985.65

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：

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年

	6月30日	6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,075,265.39	6,044,771.59

注：支付基金托管人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。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博时沪深300指数A	博时沪深300指数C	博时沪深300指数R	**合计**
博时基金	-	208,586.76	-	208,586.76
合计	-	208,586.76	-	208,586.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博时沪深300指数A	博时沪深300指数C	博时沪深300指数R	**合计**
博时基金	-	112,242.19	-	112,242.19
合计	-	112,242.19	-	112,242.19

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日C类基金资产净值 × 0.40%/ 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	196,978,347.71	290,739.81	354,907,225.77	1,371,775.65

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

博时沪深 300 指数 A

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
		场内	场外					
1	2021-01-15	-	2021-01-15	0.2110	34,394,206.97	24,202,663.09	58,596,870.06	-
合计				0.2110	34,394,206.97	24,202,663.09	58,596,870.06	-

博时沪深 300 指数 C

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
		场内	场外					
1	2021-01-15	-	2021-01-15	0.0960	1,127,428.14	1,164,871.78	2,292,299.92	-
合计				0.0960	1,127,428.14	1,164,871.78	2,292,299.92	-

博时沪深 300 指数 R

无。

6.4.8 期末（2021 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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	首次公开发行限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	853.00	40,372.49	214,921.88	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发行限售	24.60	163.00	610.00	15,006.00	99,430.00	-
688109	品茗股份	2021-03-22	2021-09-30	首次公开发行限售	50.05	72.10	1,301.00	65,115.05	93,802.10	-
688499	利元亨	2021-06-23	2022-01-03	首次公开发行限售	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
688633	星球石墨	2021-03-17	2021-09-24	首次公开发行限售	33.62	53.14	1,558.00	52,379.96	82,792.12	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	首次公开发行限售	18.42	58.40	1,040.00	19,156.80	60,736.00	-
688359	三孚新科	2021-05-14	2021-11-22	首次公开发行限售	11.03	26.35	2,213.00	24,409.39	58,312.55	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
688367	工大高科	2021-06-21	2021-12-28	首次公开发行限售	11.53	17.94	1,717.00	19,797.01	30,802.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	首次公开发行限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	首次公开发行限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-

300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	首次公开发行限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	首次公开发行限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	首次公开发行限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	首次公开发行限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	首次公开发行限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	首次公开发行限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	首次公开发行限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	首次公开发行限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	首次公开发行限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	首次公开发行限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	首次公开发行限售	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	首次公开发行限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	首次公开发行限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	首次公开发行限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	首次公开发行限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	首次公开发行限售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	首次公开发行限售	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行限售	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	首次公开发行限售	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	首次公开发行限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	首次公开发行限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-

301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	首次公开发行限售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	首次公开发行限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	首次公开发行限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	首次公开发行限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	首次公开发行限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发行限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发行限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发行限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发行限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	8,720.00	872,000.00	872,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新债未上市	100.00	100.00	3,898.00	389,800.00	389,800.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债未上市	100.00	100.00	3,522.00	352,200.00	352,200.00	-
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	新债未上市	100.00	100.00	370.00	37,000.00	37,000.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起12个月内不得转让；所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%(根据中国证监会《<关于修改上市公司证券发行管理办法的决定><关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定><关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定>的立法说明》，基金持有的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定)；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上

市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

6.4.8.2 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重要公告	56.35	2021-07-01	59.49	34,400.00	1,385,531.74	1,938,440.00	-
601015	陕西黑猫	2021-06-30	配股	8.95	2021-07-08	7.68	519,100.00	4,460,691.60	4,645,945.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易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，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，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。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	210,373,000.00	210,253,000.00
合计	210,373,000.00	210,253,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 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 2021 年 6 月 30 日	上年末 2020 年 12 月 31 日
AAA	909,000.00	8,326,000.00
AAA 以下	742,000.00	455,239.02

未评级	-	-
合计	1,651,000.00	8,781,239.02

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内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于开放期内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。此外，本基金还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。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动

性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	196,978,347.71	-	-	-	196,978,347.71
结算备付金	3,369,087.26	-	-	-	3,369,087.26
存出保证金	355,022.21	-	-	-	355,022.21
交易性金融资产	210,373,000.00	-	1,651,000.00	5,788,528,742.25	6,000,552,742.25
应收证券清算款	-	-	-	356,727.80	356,727.80
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,192,327.14	4,192,327.14
应收申购款	-	-	-	8,263,813.91	8,263,813.91
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**411,075,457.18**	**-**	**1,651,000.00**	**5,801,341,611.10**	**6,214,068,068.28**
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,707,621.48	11,707,621.48
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,925,297.66	4,925,297.66
应付托管费	-	-	-	1,005,162.77	1,005,162.77
应付销售服务费	-	-	-	218,527.28	218,527.28
应交税费	-	-	-	1.88	1.88
应付交易费用	-	-	-	4,072,347.66	4,072,347.66
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	396,110.71	396,110.71
负债总计	**-**	**-**	**-**	**22,325,069.44**	**22,325,069.44**

利率敏感度缺口	**411,075,457.18**	**-**	**1,651,000.00**	**5,779,016,541.66**	**6,191,742,998.84**
上年度末 2020 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	158,543,261.26	-	-	-	158,543,261.26
结算备付金	9,243,395.28	-	-	-	9,243,395.28
存出保证金	476,435.47	-	-	-	476,435.47
交易性金融资产	210,253,000.00	-	8,781,239.02	6,019,824,072.87	6,238,858,311.89
应收证券清算款	-	-	-	12,739,535.93	12,739,535.93
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,385,402.73	1,385,402.73
应收申购款	-	-	-	6,165,403.60	6,165,403.60
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	**378,516,092.01**	**-**	**8,781,239.02**	**6,040,114,415.13**	**6,427,411,746.16**
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	27,588,730.44	27,588,730.44
应付证券清算款	-	-	-	12,819,105.98	12,819,105.98
应付管理人报酬	-	-	-	5,139,366.60	5,139,366.60
应付托管费	-	-	-	1,048,850.33	1,048,850.33
应付销售服务费	-	-	-	212,197.00	212,197.00
应交税费	-	-	-	22.21	22.21
应付交易费用	-	-	-	4,898,474.71	4,898,474.71
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	547,841.26	547,841.26
负债总计	**-**	**-**	**-**	**52,254,588.53**	**52,254,588.53**
利率敏感度缺口	**378,516,092.01**	**-**	**8,781,239.02**	**5,987,859,826.60**	**6,375,157,157.63**

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 14	增加约 39
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 14	减少约 39

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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影

响。

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	5,788,528,742.25	93.49	6,019,824,072.87	94.43
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,651,000.00	0.03	8,781,239.02	0.14
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	5,790,179,742.25	93.51	6,028,605,311.89	94.56

注：1.债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 30,123	增加约 31,335
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 30,123	减少约 31,335

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

于本期末，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 5,775,299,654.89 元，属于第二层次的余额为 225,253,087.36 元，属于第三层次的余额为

0.00元（上年度末：第一层次5,999,665,026.91元，第二层次239,193,284.98元，第三层次0.00元）。

（ii）公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：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	5,788,528,742.25	93.15
	其中：股票	5,788,528,742.25	93.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	212,024,000.00	3.41
	其中：债券	212,024,000.00	3.41
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	200,347,434.97	3.22
8	其他各项资产	13,167,891.06	0.21
9	合计	6,214,068,068.28	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	57,398,731.12	0.93
B	采矿业	130,210,836.00	2.10
C	制造业	3,151,584,677.86	50.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	86,776,534.76	1.40
E	建筑业	97,497,996.37	1.57
F	批发和零售业	548,813.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	171,634,570.90	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	213,608,105.42	3.45
J	金融业	1,362,600,961.37	22.01
K	房地产业	98,828,886.57	1.60
L	租赁和商务服务业	157,867,238.00	2.55
M	科学研究和技术服务业	96,612,324.12	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	4,184,722.33	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,549,123.75	0.12
Q	卫生和社会工作	117,189,831.30	1.89
R	文化、体育和娱乐业	34,435,388.80	0.56
S	综合	-	-
	合计	5,788,528,742.25	93.49

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	600519	贵州茅台	158,059	325,079,945.30	5.25
2	600036	招商银行	3,703,401	200,687,300.19	3.24
3	601318	中国平安	3,070,706	197,384,981.68	3.19
4	000858	五粮液	525,500	156,541,195.00	2.53
5	601166	兴业银行	5,091,800	104,636,490.00	1.69
6	601888	中国中免	341,900	102,604,190.00	1.66
7	300059	东方财富	3,118,495	102,255,451.05	1.65
8	601012	隆基股份	1,041,398	92,517,798.32	1.49
9	000333	美的集团	1,271,823	90,770,007.51	1.47
10	600887	伊利股份	2,413,400	88,885,522.00	1.44
11	002415	海康威视	1,374,287	88,641,511.50	1.43
12	600030	中信证券	3,451,200	86,072,928.00	1.39
13	603259	药明康德	526,468	82,439,624.12	1.33
14	600276	恒瑞医药	1,150,638	78,208,864.86	1.26
15	000725	京东方A	12,415,400	77,472,096.00	1.25
16	600031	三一重工	2,603,842	75,693,686.94	1.22
17	000651	格力电器	1,417,892	73,872,173.20	1.19
18	600809	山西汾酒	158,500	71,008,000.00	1.15

19	600309	万华化学	621,200	67,598,984.00	1.09
20	601398	工商银行	12,899,857	66,692,260.69	1.08
21	603501	韦尔股份	198,100	63,788,200.00	1.03
22	300015	爱尔眼科	893,735	63,437,310.30	1.02
23	600900	长江电力	2,975,294	61,410,068.16	0.99
24	601328	交通银行	11,936,400	58,488,360.00	0.94
25	601919	中远海控	1,905,885	58,205,727.90	0.94
26	002714	牧原股份	943,562	57,387,440.84	0.93
27	300124	汇川技术	770,500	57,217,330.00	0.92
28	002027	分众传媒	5,872,800	55,263,048.00	0.89
29	603288	海天味业	428,359	55,236,893.05	0.89
30	000001	平安银行	2,391,700	54,100,254.00	0.87
31	000661	长春高新	139,000	53,793,000.00	0.87
32	000063	中兴通讯	1,538,700	51,131,001.00	0.83
33	601688	华泰证券	3,206,358	50,660,456.40	0.82
34	601211	国泰君安	2,904,036	49,775,177.04	0.80
35	600104	上汽集团	2,260,247	49,657,626.59	0.80
36	600919	江苏银行	6,903,640	49,015,844.00	0.79
37	688111	金山办公	119,871	47,325,070.80	0.76
38	000100	TCL科技	6,157,800	47,107,170.00	0.76
39	300122	智飞生物	243,100	45,394,063.00	0.73
40	601668	中国建筑	9,556,300	44,436,795.00	0.72
41	600050	中国联通	10,238,973	44,232,363.36	0.71
42	000568	泸州老窖	187,423	44,220,582.62	0.71
43	601857	中国石油	8,134,100	43,029,389.00	0.69
44	002142	宁波银行	1,069,924	41,694,938.28	0.67
45	603986	兆易创新	214,100	40,229,390.00	0.65
46	601006	大秦铁路	6,029,000	39,670,820.00	0.64
47	600426	华鲁恒升	1,229,100	38,040,645.00	0.61
48	600028	中国石化	8,663,600	37,773,296.00	0.61
49	601336	新华保险	790,889	36,309,713.99	0.59
50	600570	恒生电子	375,533	35,018,452.25	0.57
51	601100	恒立液压	405,976	34,881,457.92	0.56
52	603369	今世缘	630,398	34,142,355.68	0.55
53	002475	立讯精密	729,031	33,535,426.00	0.54
54	603882	金域医学	207,300	33,120,321.00	0.53
55	601390	中国中铁	6,267,100	32,839,604.00	0.53
56	600000	浦发银行	3,262,600	32,626,000.00	0.53
57	002812	恩捷股份	135,600	31,743,960.00	0.51
58	000338	潍柴动力	1,758,600	31,426,182.00	0.51
59	002304	洋河股份	150,200	31,121,440.00	0.50
60	002410	广联达	455,200	31,044,640.00	0.50
61	601988	中国银行	9,775,400	30,108,232.00	0.49
62	600018	上港集团	6,128,100	29,231,037.00	0.47
63	603799	华友钴业	247,700	28,287,340.00	0.46
64	300529	健帆生物	323,400	27,928,824.00	0.45
65	300003	乐普医疗	857,300	27,536,476.00	0.44
66	300413	芒果超媒	392,348	26,915,072.80	0.43
67	600111	北方稀土	1,297,915	26,866,840.50	0.43

68	002049	紫光国微	173,477	26,748,418.63	0.43
69	000002	万科A	1,122,500	26,726,725.00	0.43
70	600660	福耀玻璃	451,600	25,221,860.00	0.41
71	600438	通威股份	574,500	24,858,615.00	0.40
72	601899	紫金矿业	2,564,700	24,851,943.00	0.40
73	601319	中国人保	4,164,820	24,697,382.60	0.40
74	603659	璞泰来	178,340	24,361,244.00	0.39
75	002241	歌尔股份	550,400	23,524,096.00	0.38
76	601601	中国太保	773,381	22,404,847.57	0.36
77	002460	赣锋锂业	182,966	22,155,352.94	0.36
78	300463	迈克生物	506,700	21,327,003.00	0.34
79	600048	保利地产	1,752,400	21,098,896.00	0.34
80	601865	福莱特	531,900	21,026,007.00	0.34
81	600763	通策医疗	50,200	20,632,200.00	0.33
82	002179	中航光电	259,700	20,521,494.00	0.33
83	300760	迈瑞医疗	42,700	20,498,135.00	0.33
84	300408	三环集团	483,100	20,493,102.00	0.33
85	688036	传音控股	97,600	20,447,200.00	0.33
86	601628	中国人寿	603,100	20,439,059.00	0.33
87	601186	中国铁建	2,718,200	20,196,226.00	0.33
88	300782	卓胜微	37,560	20,188,500.00	0.33
89	601377	兴业证券	2,076,000	20,054,160.00	0.32
90	603806	福斯特	184,900	19,438,537.00	0.31
91	600176	中国巨石	1,244,425	19,301,031.75	0.31
92	603606	东方电缆	950,227	19,137,571.78	0.31
93	601678	滨化股份	2,274,700	17,992,877.00	0.29
94	600867	通化东宝	1,481,000	17,683,140.00	0.29
95	002382	蓝帆医疗	839,700	17,507,745.00	0.28
96	601636	旗滨集团	940,500	17,455,680.00	0.28
97	600606	绿地控股	3,194,173	17,408,242.85	0.28
98	002594	比亚迪	67,464	16,933,464.00	0.27
99	002311	海大集团	201,700	16,458,720.00	0.27
100	601233	桐昆股份	681,500	16,417,335.00	0.27
101	600183	生益科技	700,600	16,401,046.00	0.26
102	300014	亿纬锂能	156,400	16,254,652.00	0.26
103	600837	海通证券	1,411,600	16,233,400.00	0.26
104	601658	邮储银行	3,223,000	16,179,460.00	0.26
105	600895	张江高科	882,900	16,130,583.00	0.26
106	002230	科大讯飞	232,700	15,725,866.00	0.25
107	601169	北京银行	3,155,300	15,366,311.00	0.25
108	600958	东方证券	1,519,900	15,183,801.00	0.25
109	600845	宝信软件	297,270	15,131,043.00	0.24
110	603260	合盛硅业	195,100	15,005,141.00	0.24
111	600038	中直股份	279,900	14,761,926.00	0.24
112	600019	宝钢股份	1,928,996	14,737,529.44	0.24
113	000776	广发证券	969,100	14,672,174.00	0.24
114	002064	华峰化学	1,024,100	14,542,220.00	0.23
115	300639	凯普生物	437,124	14,429,463.24	0.23
116	300676	华大基因	119,500	14,172,700.00	0.23

117	603444	吉比特	26,700	14,151,000.00	0.23
118	603678	火炬电子	204,870	13,828,725.00	0.22
119	603267	鸿远电子	107,700	13,776,984.00	0.22
120	600741	华域汽车	514,100	13,505,407.00	0.22
121	600690	海尔智家	517,028	13,396,195.48	0.22
122	002603	以岭药业	448,500	13,078,260.00	0.21
123	002202	金风科技	1,051,600	12,787,456.00	0.21
124	688016	心脉医疗	26,887	12,223,099.07	0.20
125	600585	海螺水泥	294,600	12,093,330.00	0.20
126	600377	宁沪高速	1,217,500	11,882,800.00	0.19
127	000157	中联重科	1,280,420	11,831,080.80	0.19
128	688012	中微公司	69,928	11,602,453.76	0.19
129	601288	农业银行	3,733,222	11,311,662.66	0.18
130	603486	科沃斯	48,600	11,084,688.00	0.18
131	000581	威孚高科	524,900	10,933,667.00	0.18
132	300677	英科医疗	87,250	10,888,800.00	0.18
133	603195	公牛集团	52,400	10,584,800.00	0.17
134	300274	阳光电源	91,500	10,527,990.00	0.17
135	601985	中国核电	2,048,300	10,364,398.00	0.17
136	300726	宏达电子	144,800	10,206,952.00	0.16
137	002601	龙蟒佰利	286,800	9,917,544.00	0.16
138	300394	天孚通信	388,103	9,826,767.96	0.16
139	000425	徐工机械	1,536,100	9,784,957.00	0.16
140	600132	重庆啤酒	47,900	9,481,805.00	0.15
141	600779	水井坊	74,400	9,400,440.00	0.15
142	002978	安宁股份	155,500	9,395,310.00	0.15
143	601138	工业富联	752,900	9,343,489.00	0.15
144	000656	金科股份	1,575,500	9,122,145.00	0.15
145	600548	深高速	1,032,200	9,000,784.00	0.15
146	002032	苏泊尔	136,099	8,681,755.21	0.14
147	601918	新集能源	1,774,900	8,679,261.00	0.14
148	000932	华菱钢铁	1,274,700	8,413,020.00	0.14
149	300696	爱乐达	191,440	7,967,732.80	0.13
150	688396	华润微	87,129	7,930,481.58	0.13
151	002008	大族激光	187,700	7,581,203.00	0.12
152	688298	东方生物	34,695	7,549,632.00	0.12
153	002607	中公教育	361,375	7,549,123.75	0.12
154	002078	太阳纸业	541,900	7,234,365.00	0.12
155	000625	长安汽车	272,300	7,156,044.00	0.12
156	300142	沃森生物	114,400	7,058,480.00	0.11
157	300223	北京君正	68,900	6,953,388.00	0.11
158	300395	菲利华	142,900	6,890,638.00	0.11
159	002001	新和成	235,200	6,745,536.00	0.11
160	300699	光威复材	84,500	6,417,775.00	0.10
161	688188	柏楚电子	14,323	6,244,828.00	0.10
162	000429	粤高速 A	826,200	5,923,854.00	0.10
163	600989	宝丰能源	402,900	5,511,672.00	0.09
164	601598	中国外运	1,054,900	5,327,245.00	0.09
165	000507	珠海港	870,800	5,268,340.00	0.09

166	300595	欧普康视	50,500	5,229,275.00	0.08
167	603658	安图生物	68,800	5,212,976.00	0.08
168	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.08
169	002636	金安国纪	311,100	5,046,042.00	0.08
170	601995	中金公司	78,239	4,811,698.50	0.08
171	002371	北方华创	17,300	4,798,674.00	0.08
172	601015	陕西黑猫	519,100	4,645,945.00	0.08
173	600966	博汇纸业	342,800	4,473,540.00	0.07
174	601229	上海银行	545,200	4,470,640.00	0.07
175	600167	联美控股	465,900	4,160,487.00	0.07
176	601827	三峰环境	437,200	4,140,284.00	0.07
177	002736	国信证券	380,400	4,089,300.00	0.07
178	300144	宋城演艺	237,800	3,995,040.00	0.06
179	688399	硕世生物	23,673	3,991,267.80	0.06
180	300451	创业慧康	443,700	3,922,308.00	0.06
181	600649	城投控股	801,900	3,817,044.00	0.06
182	603566	普莱柯	167,000	3,807,600.00	0.06
183	002129	中环股份	96,500	3,724,900.00	0.06
184	601901	方正证券	393,700	3,685,032.00	0.06
185	601799	星宇股份	16,000	3,611,520.00	0.06
186	603103	横店影视	238,800	3,515,136.00	0.06
187	601512	中新集团	341,800	3,404,328.00	0.05
188	300033	同花顺	30,110	3,395,805.80	0.05
189	300724	捷佳伟创	28,200	3,271,482.00	0.05
190	601998	中信银行	629,000	3,207,900.00	0.05
191	600483	福能股份	275,300	2,887,897.00	0.05
192	000733	振华科技	46,500	2,839,755.00	0.05
193	600201	生物股份	161,900	2,825,155.00	0.05
194	600461	洪城环境	384,800	2,793,648.00	0.05
195	000885	城发环境	287,700	2,750,412.00	0.04
196	600012	皖通高速	410,500	2,651,830.00	0.04
197	601699	潞安环能	209,300	2,471,833.00	0.04
198	300661	圣邦股份	9,700	2,451,481.00	0.04
199	603517	绝味食品	28,800	2,427,552.00	0.04
200	603337	杰克股份	83,700	2,237,301.00	0.04
201	600338	西藏珠峰	153,300	2,172,261.00	0.04
202	601633	长城汽车	46,500	2,026,935.00	0.03
203	300775	三角防务	52,900	2,020,780.00	0.03
204	600460	士兰微	34,400	1,938,440.00	0.03
205	600711	盛屯矿业	241,100	1,719,043.00	0.03
206	001965	招商公路	234,800	1,695,256.00	0.03
207	002022	科华生物	89,000	1,593,990.00	0.03
208	601818	光大银行	369,769	1,397,726.82	0.02
209	601238	广汽集团	97,700	1,265,215.00	0.02
210	002508	老板电器	23,700	1,102,050.00	0.02
211	002985	北摩高科	8,580	836,550.00	0.01
212	002645	华宏科技	51,000	814,980.00	0.01
213	002920	德赛西威	7,200	792,576.00	0.01
214	688208	道通科技	8,800	765,512.00	0.01

215	603392	万泰生物	2,700	699,786.00	0.01
216	002007	华兰生物	19,062	699,194.16	0.01
217	000961	中南建设	113,541	672,162.72	0.01
218	000933	神火股份	68,800	650,160.00	0.01
219	002833	弘亚数控	15,800	612,250.00	0.01
220	600588	用友网络	17,990	598,347.40	0.01
221	600522	中天科技	56,000	560,000.00	0.01
222	300748	金力永磁	17,540	554,790.20	0.01
223	603738	泰晶科技	15,700	541,964.00	0.01
224	600436	片仔癀	1,200	537,960.00	0.01
225	002531	天顺风能	59,000	510,350.00	0.01
226	000671	阳光城	86,300	448,760.00	0.01
227	603290	斯达半导	1,400	448,000.00	0.01
228	601600	中国铝业	83,400	442,020.00	0.01
229	300803	指南针	9,500	366,700.00	0.01
230	300783	三只松鼠	6,700	317,312.00	0.01
231	000807	云铝股份	24,400	290,360.00	0.00
232	000830	鲁西化工	15,500	290,315.00	0.00
233	000799	酒鬼酒	918	234,640.80	0.00
234	600584	长电科技	6,200	233,616.00	0.00
235	002414	高德红外	8,400	231,672.00	0.00
236	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
237	002677	浙江美大	11,600	212,048.00	0.00
238	000039	中集集团	10,600	192,708.00	0.00
239	603939	益丰药房	3,300	185,097.00	0.00
240	300450	先导智能	2,800	168,392.00	0.00
241	688388	嘉元科技	1,485	135,075.60	0.00
242	600346	恒力石化	4,591	120,467.84	0.00
243	601225	陕西煤业	10,000	118,500.00	0.00
244	600196	复星医药	1,600	115,408.00	0.00
245	002025	航天电器	2,300	115,391.00	0.00
246	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
247	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.00
248	000166	申万宏源	19,400	90,792.00	0.00
249	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
250	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00
251	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
252	300773	拉卡拉	2,764	78,027.72	0.00
253	002345	潮宏基	13,300	69,692.00	0.00
254	603010	万盛股份	3,120	65,426.40	0.00
255	300653	正海生物	800	62,640.00	0.00
256	002138	顺络电子	1,604	62,187.08	0.00
257	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
258	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.00
259	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
260	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
261	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
262	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
263	002020	京新药业	5,065	43,052.50	0.00

264	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
265	002567	唐人神	5,800	38,338.00	0.00
266	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
267	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
268	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
269	601018	宁波港	6,700	26,465.00	0.00
270	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
271	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
272	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
273	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
274	002932	明德生物	200	19,514.00	0.00
275	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
276	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
277	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
278	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
279	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
280	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
281	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
282	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
283	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
284	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
285	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
286	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
287	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
288	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
289	601900	南方传媒	1,300	10,140.00	0.00
290	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
291	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
292	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
293	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
294	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
295	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
296	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
297	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
298	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
299	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
300	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
301	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
302	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
303	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
304	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
305	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
306	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
307	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
308	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
309	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
310	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
311	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
312	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

313	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
314	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
315	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
316	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
317	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
318	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
319	002148	北纬科技	5	22.90	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	600887	伊利股份	74,644,378.90	1.17
2	002142	宁波银行	67,829,626.91	1.06
3	002007	华兰生物	53,767,914.08	0.84
4	601857	中国石油	52,626,653.50	0.83
5	600000	浦发银行	51,118,407.26	0.80
6	600028	中国石化	50,556,882.30	0.79
7	601328	交通银行	50,439,190.41	0.79
8	600519	贵州茅台	50,014,246.78	0.78
9	688111	金山办公	46,791,646.55	0.73
10	601668	中国建筑	44,554,277.40	0.70
11	600588	用友网络	42,066,679.48	0.66
12	600050	中国联通	41,958,286.74	0.66
13	600919	江苏银行	41,812,965.11	0.66
14	603369	今世缘	41,487,885.02	0.65
15	300033	同花顺	40,952,855.75	0.64
16	601006	大秦铁路	40,210,748.94	0.63
17	601398	工商银行	39,605,766.00	0.62
18	600104	上汽集团	38,767,263.64	0.61
19	000001	平安银行	38,423,656.98	0.60
20	603259	药明康德	37,617,030.04	0.59

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

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	600519	贵州茅台	77,501,678.91	1.22
2	000001	平安银行	69,854,581.52	1.10
3	601318	中国平安	68,776,464.88	1.08
4	002142	宁波银行	68,771,705.36	1.08
5	002594	比亚迪	62,832,293.78	0.99
6	601601	中国太保	59,195,047.84	0.93
7	000002	万科A	56,930,750.78	0.89

8	002007	华兰生物	56,574,208.56	0.89
9	600887	伊利股份	54,265,671.35	0.85
10	000568	泸州老窖	52,493,677.68	0.82
11	002352	顺丰控股	52,050,449.87	0.82
12	000858	五粮液	49,903,497.65	0.78
13	600036	招商银行	49,285,982.85	0.77
14	603259	药明康德	45,024,628.88	0.71
15	601919	中远海控	43,198,176.55	0.68
16	600588	用友网络	42,931,820.20	0.67
17	601818	光大银行	42,859,713.00	0.67
18	603288	海天味业	42,429,549.10	0.67
19	601328	交通银行	41,964,631.97	0.66
20	601899	紫金矿业	40,316,694.97	0.63

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	4,907,908,072.92
卖出股票的收入（成交）总额	5,243,645,207.51

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,373,000.00	3.40
	其中：政策性金融债	210,373,000.00	3.40
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）	1,651,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	212,024,000.00	3.42

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	200216	20国开16	1,300,000	130,221,000.00	2.10
2	200409	20农发09	800,000	80,152,000.00	1.29
3	113050	南银转债	8,720	872,000.00	0.01

4	123117	健帆转债	3,898	389,800.00	0.01
5	127038	国微转债	3,522	352,200.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、20国开16(200216)、兴业银行(601166)的发行主体外，没有出现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、处罚的情形。

主要违规事实：2021年5月21日，因存在1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产。2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品。3、理财产品之间风险隔离不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对招商银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2021年1月15日，因存在项目融资业务管理严重违反审慎经营规则的违规行为，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对国家开发银行北京分行处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年9月11日，因存在1、为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2、为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3、违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4、违反银行卡收单外包管理规定；5、未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

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	355,022.21
2	应收证券清算款	356,727.80
3	应收股利	-
4	应收利息	4,192,327.14
5	应收申购款	8,263,813.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,167,891.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 300 指数 A	324,020	8,452.52	17,254,724.51	0.63%	2,721,529,363.93	99.37%
博时沪深 300 指数 C	120,404	2,940.61	34,624,304.69	9.78%	319,437,041.43	90.22%
博时沪深 300 指数 R	-	-	-	-	-	-
合计	440,106	7,027.50	51,879,029.20	1.68%	3,040,966,405.36	98.32%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时沪深 300 指数 A	398,870.37	0.01%
	博时沪深 300 指数 C	321,972.32	0.09%
	博时沪深 300 指数 R	-	-
	合计	720,842.69	0.02%

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的情况

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 300 指数 A	-
	博时沪深 300 指数 C	0~10
	博时沪深 300 指数 R	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	博时沪深 300 指数 A	-
	博时沪深 300 指数 C	-
	博时沪深 300 指数 R	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
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	2,877,320,794.13	318,142,386.28	-
本报告期基金总申购份额	655,706,611.62	376,054,558.31	-
减：本报告期基金总赎回份额	794,243,317.31	340,135,598.47	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,738,784,088.44	354,061,346.12	-

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生担任公司总经理职务。

本报告期内，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 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（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	
中金财富	1	-	-	-	-	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	264,347,221.37	2.61%	193,322.34	2.41%	新增1个
太平洋证券	2	452,030,007.52	4.46%	330,570.91	4.12%	新增1个
华福证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	1,557,161,418.70	15.36%	1,450,198.97	18.05%	-
国泰君安	3	18,372,994.86	0.18%	17,112.02	0.21%	-
国信证券	1	570,769,033.71	5.63%	417,406.09	5.20%	-
国元证券	1	285,148,108.80	2.81%	208,528.47	2.60%	新增1个、减少1个
中泰证券	3	1,486,214,018.42	14.66%	1,086,880.12	13.53%	-
华创证券	4	587,765,079.06	5.80%	429,826.75	5.35%	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	1	218,312,918.00	2.15%	159,652.80	1.99%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	285,087,695.46	2.81%	208,486.19	2.60%	-
招商证券	3	105,960,104.20	1.05%	98,682.35	1.23%	-
东方财富证券	2	724,936,674.31	7.15%	530,143.50	6.60%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	724,130,047.60	7.14%	529,540.57	6.59%	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	613,942,140.46	6.06%	448,977.44	5.59%	-
新时代	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	512,737.79	0.01%	477.50	0.01%	-
长江证券	2	410,288,586.74	4.05%	382,103.08	4.76%	-

高华证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	1,488,430,026.55	14.68%	1,288,571.96	16.04%	-
粤开证券	1	345,215,383.93	3.40%	252,459.04	3.14%	新增 1 个
西南证券	2	190,436.11	-	139.26	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

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

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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
中金财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	996,420.20	5.94%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	2,592.80	0.02%	-	-	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	6,442,245.05	38.38%	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	9,345,510.50	55.67%	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
2	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
3	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
4	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
5	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
6	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(博时沪深 300 指数 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-08
7	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(博时沪深 300 指数 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-08
8	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(博时沪深 300 指数 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披	2021-04-06

		露网站	
9	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(博时沪深 300 指数 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-06
10	关于博时旗下部分开放式基金增加贵州银行股份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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-02
11	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
12	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
13	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
14	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
15	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
16	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
17	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
19	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
20	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22
21	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金分红公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-13
22	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-12

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 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

12.1.2《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》

12.1.3《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日