

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金
2023 年中期报告
2023 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：二〇二三年八月三十一日

§ 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 2023 年 8 月 29 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 2023 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.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56

7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	3,714,800,434.82 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	2,968,721,885.70 份	746,078,549.12 份	-份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>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%。</p> <p>1. 资产配置原则</p> <p>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。</p> <p>2. 资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>3. 股票资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价</p>

	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
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.com
客户服务电话	95105568	021-60637228
传真	0755-83195140	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 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	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§ 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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	42,352,050.19	8,498,241.51	-
本期利润	27,464,991.18	4,485,576.42	-
加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0063	-
本期加权平均净值利润率	0.58%	0.40%	-
本期基金份额净值增长率	0.57%	0.37%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 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	1,651,857,996.73	395,673,830.14	-
期末可供分配基金份额利润	0.5564	0.5303	-
期末基金资产净值	4,620,579,882.43	1,141,752,379.26	-
期末基金份额净值	1.5564	1.5303	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 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	409.70%	60.00%	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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.88%	0.79%	1.10%	0.83%	0.78%	-0.04%
过去三个月	-2.78%	0.75%	-4.88%	0.79%	2.10%	-0.04%
过去六个月	0.57%	0.76%	-0.69%	0.80%	1.26%	-0.04%
过去一年	-12.61%	0.90%	-13.60%	0.94%	0.99%	-0.04%
过去三年	-1.18%	1.13%	-7.07%	1.14%	5.89%	-0.01%
自基金合同生效起至今	409.70%	1.51%	203.40%	1.52%	206.30%	-0.01%

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	1.84%	0.79%	1.10%	0.83%	0.74%	-0.04%
过去三个月	-2.88%	0.75%	-4.88%	0.79%	2.00%	-0.04%
过去六个月	0.37%	0.76%	-0.69%	0.80%	1.06%	-0.04%
过去一年	-12.96%	0.90%	-13.60%	0.94%	0.64%	-0.04%
过去三年	-2.35%	1.13%	-7.07%	1.14%	4.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	60.00%	1.12%	29.99%	1.12%	30.01%	0.00%

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

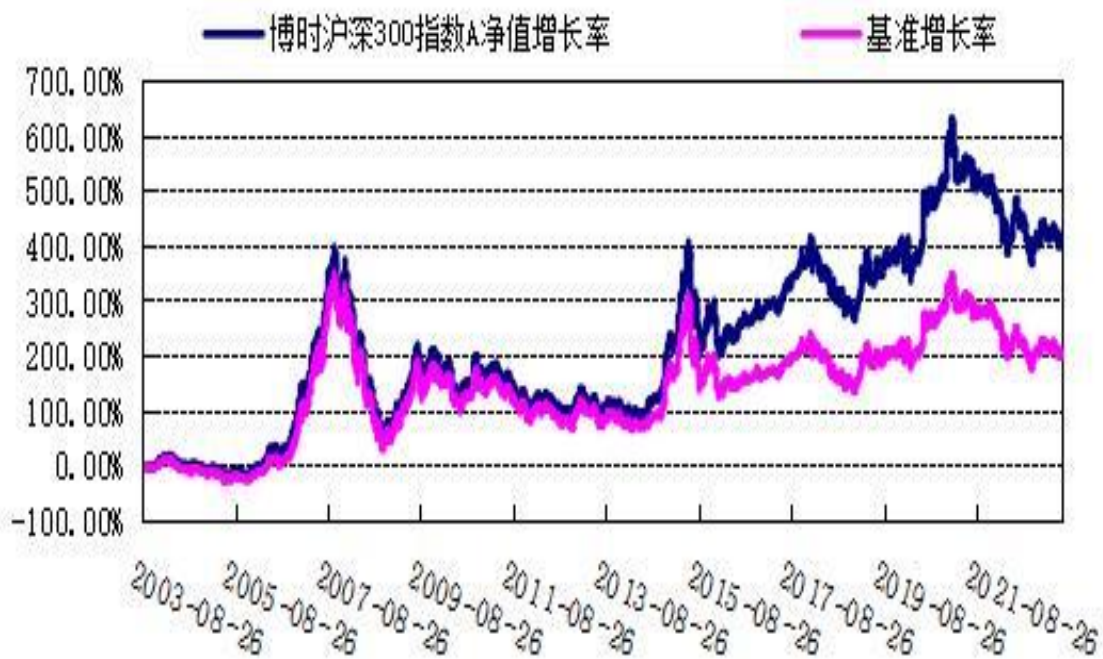
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	1.76%	0.97%	-3.67%	0.95%	5.43%	0.02%

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，本基金份额全部赎回，故沪深 300R 类份额数据截止日为 2018 年 11 月 14 日。

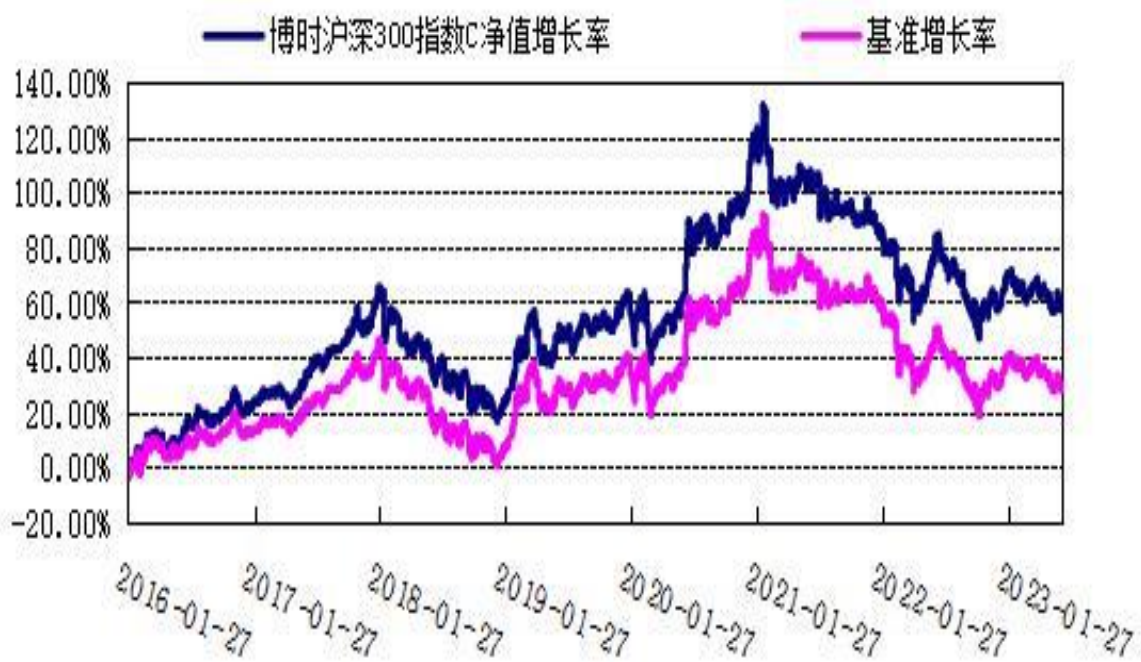
自基金成立至 2004 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为新华富时 A200 复合指数；自 2005 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为 95% 的新华富时中国 A200 指数 + 5% 的银行同业存款利率；自 2008 年 1 月 1 日起，本基金业绩比较基准为 95% 的沪深 300 指数 + 5% 的银行同业存款利率。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

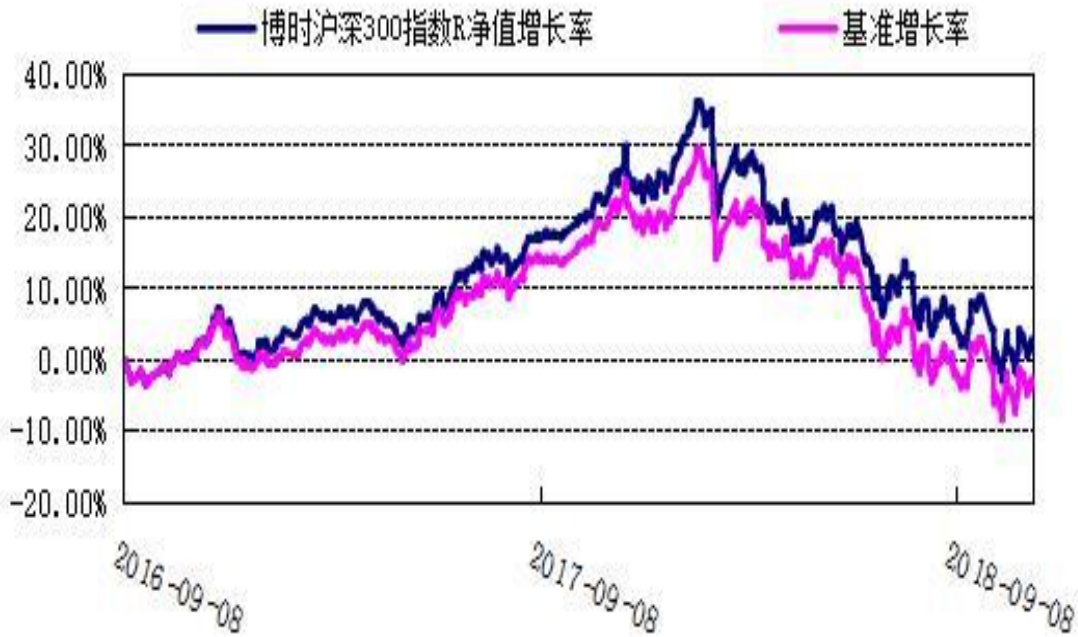
博时沪深 300 指数 A



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 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 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。

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	-	9.8	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

					<p>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、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-2021 年 7 月 16 日)基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日一至今)、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 日一至今)、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 日一至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日一至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 3 月 3 日一至今)的基金经理。</p>
桂征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2015-07-21	-	13.8	<p>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)、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-2021 年 7 月 16 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日一至今)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日一至今)、博时沪深</p>

					300 指数增强发起式证券投资基金(2020年12月30日一至今)、博时中证 1000 指数增强型证券投资基金(2023年4月13日一至今)的基金经理。
刘玉强	基金经理助理	2020-02-2 1	2023-02-0 6	7.9	刘玉强先生，硕士。2015 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。曾任研究员、基金经理助理。现任博时专精特新主题混合型证券投资基金(2023年2月1日一至今)的基金经理。

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，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 89 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 股市场总体震荡，市场总体分化较大，小盘价值风格、央企类资产、数字经济相关资产占优，上证指数最终收于 3202 点左右。海外通胀预期有所回落，加息步伐减缓，全球多数权益资产上涨显著。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 2023 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.5564 元，份额累计净值为 3.5903 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.5303 元，份额累计净值为 1.5485 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 0.57%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.37%，同期业绩基准增长率为-0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，经济整体稳中向好，报告期内央企类、信创类和小盘风格主题资产表现突出，市场呈现结构性行情。流动性方面，国内持续保持相对积极的货币政策。当前市场整体估值水平处于历史上相对性价比比较好的位置，当前 A 股具备长期配置价值。从盈利预期角度看，随着相关经济政策落地，经济将稳步复苏向好。目前稳增长的信心在稳步提升，沪深 300 成分股中顺周期占比相对较高，而且沪深 300 作为 A 股核心资产的重要标的，当前成份股的估值水平处于历史相对较低的位置，叠加相对较高的股息率水平，值得长期配置。当前我们需要持续关注不同板块景气趋势的变化，把握结构性机会。

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

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	175,094,456.37	152,812,419.86
结算备付金		7,163,788.04	8,760,976.40
存出保证金		205,291.11	320,722.87
交易性金融资产	6.4.3.2	5,588,163,286.07	5,547,762,902.32
其中：股票投资		5,387,646,892.63	5,347,986,189.99
基金投资		-	-
债券投资		200,516,393.44	199,776,712.33
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		18,363,588.25	10,989,506.27
应收股利		-	-
应收申购款		3,476,393.04	6,187,048.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		5,792,466,802.88	5,726,833,576.65
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付清算款		18,464,678.47	11,669,644.31
应付赎回款		2,020,779.62	2,067,974.19
应付管理人报酬		4,627,630.83	4,767,206.76
应付托管费		944,414.45	972,899.34

应付销售服务费		372,245.28	366,532.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	3,704,792.54	4,739,505.94
负债合计		30,134,541.19	24,583,764.34
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	3,714,800,434.82	3,695,173,755.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	2,047,531,826.87	2,007,076,056.85
净资产合计		5,762,332,261.69	5,702,249,812.31
负债和净资产总计		5,792,466,802.88	5,726,833,576.65

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,714,800,434.82 份。其中 A 类基金份额净值 1.5564 元，基金份额总额 2,968,721,885.70 份；C 类基金份额净值 1.5303 元，基金份额总额 746,078,549.12 份。无 R 类基金份额。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		68,686,116.85	-169,955,233.81
1. 利息收入		327,651.16	651,336.74
其中：存款利息收入	6.4.3.10	327,651.16	651,336.74
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		86,970,334.44	-181,834,762.72
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-13,030,573.68	-244,222,802.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	2,244,408.86	3,822,288.57
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
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	97,756,499.26	58,565,751.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-18,899,724.10	10,846,698.03
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	287,855.35	381,494.14
减：二、营业总支出		36,735,549.25	33,794,500.22
1. 管理人报酬		28,550,106.03	26,452,337.70
2. 托管费		5,826,552.24	5,398,436.27
3. 销售服务费		2,228,210.04	1,814,318.61
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		1.98	2.76
8. 其他费用	6.4.3.19	130,678.96	129,404.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,950,567.60	-203,749,734.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,950,567.60	-203,749,734.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,950,567.60	-203,749,734.03

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	3,695,173,755.46	-	2,007,076,056.85	5,702,249,812.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,695,173,755.46	-	2,007,076,056.85	5,702,249,812.31
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	19,626,679.36	-	40,455,770.02	60,082,449.38
(一)、综合收益总额	-	-	31,950,567.60	31,950,567.60
(二)、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)	19,626,679.36	-	8,505,202.42	28,131,881.78
其中: 1. 基金申购款	389,421,377.82	-	225,922,175.97	615,343,553.79
2. 基金赎回款	-369,794,698.46	-	-217,416,973.55	-587,211,672.01
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	3,714,800,434.82	-	2,047,531,826.87	5,762,332,261.69
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	3,148,342,760.89	-	2,677,691,390.88	5,826,034,151.77
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,148,342,760.89	-	2,677,691,390.88	5,826,034,151.77
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	182,755,765.62	-	-89,903,877.68	92,851,887.94
(一)、综合收益总额	-	-	-203,749,734.03	-203,749,734.03
(二)、本期基金份	182,755,765.62	-	113,845,856.35	296,601,621.

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				97
其中：1. 基金申购款	518,950,862.48	-	340,670,013.57	859,620,876.05
2. 基金赎回款	-336,195,096.86	-	-226,824,157.22	-563,019,254.08
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	3,331,098,526.51	-	2,587,787,513.20	5,918,886,039.71

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：徐卫，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[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》、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 2023年6月30日
活期存款	175,094,456.37
等于：本金	175,079,933.27
加：应计利息	14,523.10

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	175,094,456.37

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	5,650,720,887.59	-	5,387,646,892.63	-263,073,994.96	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	200,215,600.00	516,393.44	200,516,393.44	-215,600.00
	合计	200,215,600.00	516,393.44	200,516,393.44	-215,600.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	5,850,936,487.59	516,393.44	5,588,163,286.07	-263,289,594.96	

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	2,277.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,328,268.90
其中：交易所市场	3,326,668.90
银行间市场	1,600.00
应付利息	-
其他应付款	731.69
预提费用	123,514.74
合计	3,704,792.54

6.4.3.8 实收基金

博时沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,985,996,543.65	2,985,996,543.65
本期申购	190,558,853.05	190,558,853.05
本期赎回（以“-”号填列）	-207,833,511.00	-207,833,511.00
本期末	2,968,721,885.70	2,968,721,885.70

博时沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	709,177,211.81	709,177,211.81
本期申购	198,862,524.77	198,862,524.77
本期赎回（以“-”号填列）	-161,961,187.46	-161,961,187.46
本期末	746,078,549.12	746,078,549.12

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)。

6.4.3.9 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	3,447,455,268.32	-1,812,445,939.84	1,635,009,328.48
本期利润	42,352,050.19	-14,887,059.01	27,464,991.18
本期基金份额交易产生的变动数	-19,872,038.56	9,255,715.63	-10,616,322.93
其中：基金申购款	219,750,403.07	-105,957,779.69	113,792,623.38
基金赎回款	-239,622,441.63	115,213,495.32	-124,408,946.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,469,935,279.95	-1,818,077,283.22	1,651,857,996.73

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	427,414,666.62	-55,347,938.25	372,066,728.37
本期利润	8,498,241.51	-4,012,665.09	4,485,576.42
本期基金份额交易产生的变动数	21,898,649.26	-2,777,123.91	19,121,525.35
其中：基金申购款	119,120,137.56	-6,990,584.97	112,129,552.59
基金赎回款	-97,221,488.30	4,213,461.06	-93,008,027.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	457,811,557.39	-62,137,727.25	395,673,830.14

博时沪深 300 指数 R

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	0.00	0.00	0.00
本期利润	-	-	-
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	0.00	0.00	0.00

注：无余额

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	272,628.53	
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	52,232.14	
其他	2,790.49	
合计	327,651.16	

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	4,553,645,475.96	
减：卖出股票成本总额	4,554,429,576.09	
减：交易费用	12,246,473.55	
买卖股票差价收入	-13,030,573.68	

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
债券投资收益——利息收入	1,602,906.97	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	641,501.89	
债券投资收益——赎回差价收入	-	
债券投资收益——申购差价收入	-	
合计	2,244,408.86	

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	205,291,966.34	

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	202,586,800.00
减：应计利息总额	2,061,930.85
减：交易费用	1,733.60
买卖债券差价收入	641,501.89

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	97,756,499.26
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	97,756,499.26

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-18,899,724.10
——股票投资	-19,302,924.10
——债券投资	403,200.00
——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	-18,899,724.10

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	280,753.58
基金转换费收入	7,101.77
合计	287,855.35

6.4.3.18 信用减值损失

无。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-
中债登账户维护费	9,000.00
银行汇划费	2,664.22
合计	130,678.96

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、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	274,572,063.42	3.00%	-	-

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

无。

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	200,796.04	2.88%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
-	-	-	-	-

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年	2022 年 1 月 1 日至 2022 年

	6 月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	28,550,106.03	26,452,337.70
其中：支付销售机构的客户维护费	6,850,142.76	6,139,771.44

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.98% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,826,552.24	5,398,436.27

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：

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

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			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	111,768.71	-	111,768.71
博时财富	-	30.69	-	30.69
招商证券	-	5.25	-	5.25
合计	-	111,804.65	-	111,804.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	169,192.48	-	169,192.48
合计	-	169,192.48	-	169,192.48

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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自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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	175,094,456 .37	272,628.53	342,687,644 .87	590,188.21

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

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	7,523.00	189,955.75
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	6,551.00	243,893.73
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	547,553.00	7,901,189.79
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2023 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	受限期	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
601916	浙商银行	2023-06-27	7 个交易日	配股未上市	2.02	2.64	3,538,560.00	7,147,891.20	9,341,798.40	-
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	4,338.00	250,129.08	250,129.08	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	7,405.00	147,063.30	133,734.30	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,676.00	124,755.68	124,755.68	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	6,261.00	69,497.10	106,687.44	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241.00	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	首次公开发行限售	37.88	29.49	3,033.00	114,890.04	89,443.17	-

301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	首次公开发行限售	23.77	42.89	2,023.00	48,086.71	86,766.47	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	首次公开发行限售	5.69	5.41	13,800.00	78,522.00	74,658.00	-
301202	朗威股份	2023-06-28	5 个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,754.00	71,108.28	71,108.28	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7 个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	23.60	64.67	831.00	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	首次公开发行限售	152.38	135.97	346.00	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	首次公开发行限售	76.80	107.95	364.00	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	首次公开发行限售	36.15	38.13	1,011.00	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	38.13	31.03	1,206.00	45,984.78	37,422.18	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	首次公开发行限售	39.99	36.71	1,008.00	40,309.92	37,003.68	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	首次公开发行限售	5.00	8.96	3,574.00	17,870.00	32,023.04	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	首次公开	6.58	7.58	4,016.00	26,425.28	30,441.28	-

				发行 限售							
00128 7	中电 港	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.88	21.02	1,386 .00	16,46 5.68	29,13 3.72	-	
68857 6	西山 科技	2023- 05-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	135.8 0	120.4 1	240.0 0	32,59 2.00	28,89 8.40	-	
30124 6	宏源 药业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	50.00	30.71	931.0 0	46,55 0.00	28,59 1.01	-	
68835 2	颀中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	12.10	12.07	2,361 .00	28,56 8.10	28,49 7.27	-	
30148 6	致尚 科技	2023- 06-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	57.66	57.66	482.0 0	27,79 2.12	27,79 2.12	-	
68858 2	芯动 联科	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.74	40.68	648.0 0	17,32 7.52	26,36 0.64	-	
30129 3	三博 脑科	2023- 04-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	29.60	71.42	333.0 0	9,856 .80	23,78 2.86	-	
30130 3	真兰 仪表	2023- 02-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.80	22.32	1,058 .00	28,35 4.40	23,61 4.56	-	
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.17	23.50	956.0 0	20,23 8.52	22,46 6.00	-	
30130 7	美利 信	2023- 04-14	6 个月	首次 公开 发行 限售	32.34	31.86	687.0 0	22,21 7.58	21,88 7.82	-	
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次 公开	43.67	53.05	410.0 0	17,90 4.70	21,75 0.50	-	

				发行 限售							
30132 2	绿通 科技	2023- 02-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	87.30	53.24	392.0 0	34,21 9.71	20,87 0.08	-	
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	75.00	90.76	221.0 0	16,57 5.00	20,05 7.96	-	
68858 1	安杰 思	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	125.8 0	118.0 3	163.0 0	20,50 5.40	19,23 8.89	-	
30138 3	天键 股份	2023- 05-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	46.16	35.72	493.0 0	22,75 6.88	17,60 9.96	-	
68847 8	晶升 股份	2023- 04-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	32.52	42.37	402.0 0	13,07 3.04	17,03 2.74	-	
68856 2	航天 软件	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	12.68	22.31	726.0 0	9,205 .68	16,19 7.06	-	
30143 9	泓淋 电力	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	16.90	949.0 0	18,97 0.51	16,03 8.10	-	
30133 2	德尔 玛	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.81	13.73	1,122 .00	16,61 6.82	15,40 5.06	-	
30140 8	华人 健康	2023- 02-22	6 个月	首次 公开 发行 限售	16.24	16.95	879.0 0	14,27 4.96	14,89 9.05	-	
30130 5	朗坤 环境	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.25	19.69	753.0 0	19,01 3.25	14,82 6.57	-	
30141 9	阿莱 德	2023- 02-02	6 个月	首次 公开	24.80	43.85	330.0 0	8,184 .00	14,47 0.50	-	

				发行 限售							
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.16	16.21	888.0 0	12,57 4.08	14,39 4.48	-	
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.18	14.59	959.0 0	10,72 1.62	13,99 1.81	-	
30138 7	光大 同创	2023- 04-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	58.32	45.36	307.0 0	17,90 4.24	13,92 5.52	-	
30139 5	仁信 新材	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.68	26.68	520.0 0	13,87 3.60	13,87 3.60	-	
30121 0	金杨 股份	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	57.88	49.17	281.0 0	16,26 4.28	13,81 6.77	-	
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	20.92	19.16	721.0 0	15,08 3.32	13,81 4.36	-	
30138 2	蜂助 手	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.80	32.84	408.0 0	9,710 .40	13,39 8.72	-	
30132 0	豪江 智能	2023- 06-01	6 个月	首次 公开 发行 限售	13.06	20.62	642.0 0	8,384 .52	13,23 8.04	-	
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.66	31.50	418.0 0	11,14 3.88	13,16 7.00	-	
68862 9	华丰 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	9.26	18.59	708.0 0	6,556 .08	13,16 1.72	-	
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次 公开	10.68	12.34	1,016 .00	10,85 0.88	12,53 7.44	-	

				发行 限售							
30136 0	荣旗 科技	2023- 04-17	6 个月	首次 公开 发行 限售	71.88	92.60	134.0 0	9,631 .92	12,40 8.40	-	
30134 5	涛涛 车业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	73.45	46.64	266.0 0	19,53 7.70	12,40 6.24	-	
30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	19.99	583.0 0	11,65 4.17	11,65 4.17	-	
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.86	23.85	472.0 0	10,31 7.92	11,25 7.20	-	
60313 5	中重 科技	2023- 03-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.80	17.89	628.0 0	11,17 8.40	11,23 4.92	-	
30114 1	中科 磁业	2023- 03-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	41.20	42.69	262.0 0	10,79 4.40	11,18 4.78	-	
30148 8	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.78	39.78	262.0 0	10,42 2.36	10,42 2.36	-	
60106 5	江盐 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	10.36	11.84	875.0 0	9,065 .00	10,36 0.00	-	
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.28	29.87	336.0 0	8,494 .08	10,03 6.32	-	
68847 9	友车 科技	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限售	33.99	29.49	332.0 0	11,28 4.68	9,790 .68	-	
30123 2	飞沃 科技	2023- 06-08	6 个月	首次 公开	72.50	58.42	165.0 0	11,96 2.50	9,639 .30	-	

				发行 限售							
30135 5	南王 科技	2023- 06-02	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.55	16.75	563.0 0	9,880 .65	9,430 .25	-	
30135 7	北方 长龙	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	50.00	48.39	190.0 0	9,500 .00	9,194 .10	-	
30138 6	未来 电器	2023- 03-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	29.99	23.79	378.0 0	11,33 6.22	8,992 .62	-	
30132 3	新莱 福	2023- 05-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.06	39.36	228.0 0	8,905 .68	8,974 .08	-	
30137 3	凌玮 科技	2023- 01-20	6 个月	首次 公开 发行 限售	33.73	31.85	277.0 0	9,343 .21	8,822 .45	-	
30117 0	锡南 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	34.00	34.93	250.0 0	8,500 .00	8,732 .50	-	
68853 5	华海 诚科	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	35.00	51.23	161.0 0	5,635 .00	8,248 .03	-	
60113 3	柏诚 股份	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.66	12.26	664.0 0	7,742 .24	8,140 .64	-	
30120 2	朗威 股份	2023- 06-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.82	25.82	306.0 0	7,900 .92	7,900 .92	-	
30129 5	美硕 科技	2023- 06-19	6 个月	首次 公开 发行 限售	37.40	36.07	215.0 0	8,041 .00	7,755 .05	-	
30120 3	国泰 环保	2023- 03-28	6 个月	首次 公开	46.13	34.40	225.0 0	10,37 9.25	7,740 .00	-	

				发行 限售							
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	36.90	36.90	198.0 0	7,306 .20	7,306 .20	-	
30142 8	世纪 恒通	2023- 05-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.35	30.60	229.0 0	6,034 .15	7,007 .40	-	
00138 0	华纬 科技	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	28.84	30.78	170.0 0	4,902 .80	5,232 .60	-	
60312 5	常青 科技	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.98	24.53	160.0 0	4,156 .80	3,924 .80	-	
00132 8	登康 口腔	2023- 03-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	20.68	25.49	145.0 0	2,998 .60	3,696 .05	-	
00128 2	三联 锻造	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	27.93	33.03	105.0 0	2,932 .65	3,468 .15	-	
00136 0	南矿 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	15.38	14.87	177.0 0	2,722 .26	2,631 .99	-	
60313 7	恒尚 节能	2023- 04-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	15.90	17.09	139.0 0	2,210 .10	2,375 .51	-	
00132 4	长青 科技	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	18.88	19.60	114.0 0	2,152 .32	2,234 .40	-	
00136 7	海森 药业	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	44.48	39.48	55.00	2,446 .40	2,171 .40	-	
60317 2	万丰 股份	2023- 04-28	6 个月	首次 公开	14.58	16.13	122.0 0	1,778 .76	1,967 .86	-	

				发行 限售						
--	--	--	--	----------	--	--	--	--	--	--

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、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。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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及绩效分析工作，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主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 2023 年 6 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	200,516,393.44	199,776,712.33
合计	200,516,393.44	199,776,712.33

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

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

无。

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(净资产)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 2023 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	175,094,456.37	-	-	-	175,094,456.37
结算备付金	7,163,788.04	-	-	-	7,163,788.04
存出保证金	205,291.11	-	-	-	205,291.11
交易性金融资产	200,516,393.44	-	-	5,387,646,892.63	5,588,163,286.07
应收清算款	-	-	-	18,363,588.25	18,363,588.25

					88.25
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,476,393.04	3,476,393.04
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	382,979,928.96	-	-	5,409,486,873.57	5,792,469,268.88
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,020,779.62	2,020,779.62
应付清算款	-	-	-	18,464,678.47	18,464,678.47
应付管理人报酬	-	-	-	4,627,630.83	4,627,630.83
应付托管费	-	-	-	944,414.45	944,414.45
应付销售服务费	-	-	-	372,245.28	372,245.28
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,704,792.54	3,704,792.54
负债总计	-	-	-	30,134,541.19	30,134,541.19
利率敏感度缺口	382,979,928.96	-	-	5,379,352,332.57	5,762,332,732.69
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	152,812,419.86	-	-	-	152,812,419.86
结算备付金	8,760,976.40	-	-	-	8,760,976.40
存出保证金	320,722.87	-	-	-	320,722.87
交易性金融资产	199,776,712.33	-	-	5,347,986,189.99	5,547,762,902.32
应收证券清算款	-	-	-	10,989,506.27	10,989,506.27
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	6,187,048.93	6,187,048.93

					8.93
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	361,670,831.46	-	-	5,365,162,745.5	5,726,831,935.76
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,067,974.19	2,067,974.19
应付清算款	-	-	-	11,669,644.31	11,669,644.31
应付管理人报酬	-	-	-	4,767,206.76	4,767,206.76
应付托管费	-	-	-	972,899.34	972,899.34
应付销售服务费	-	-	-	366,532.72	366,532.72
应交税费	-	-	-	1.08	1.08
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,739,505.94	4,739,505.94
负债总计				24,583,764.34	24,583,764.34
利率敏感度缺口	361,670,831.46	-	-	5,340,578,980.85	5,702,249,812.31

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 43	减少约 40
市场利率下降 25 个基点	增加约 43	增加约 41	

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	5,387,646,892.63	93.50	5,347,986,189.99	93.79
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	5,387,646,892.63	93.50	5,347,986,189.99	93.79

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 26,587	增加约 26,831
	业绩比较基准下降 5%	减少约 26,587	减少约 26,831

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	5,375,913,223.54
第二层次	210,647,121.02
第三层次	1,602,941.51
合计	5,588,163,286.07

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,387,646,892.63	93.01
	其中：股票	5,387,646,892.63	93.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	200,516,393.44	3.46
	其中：债券	200,516,393.44	3.46

	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	182,258,244.41	3.15
8	其他各项资产	22,045,272.40	0.38
9	合计	5,792,466,802.88	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	59,505,975.00	1.03
B	采矿业	247,025,120.37	4.29
C	制造业	3,200,763,322.05	55.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	92,958,807.30	1.61
E	建筑业	133,098,161.72	2.31
F	批发和零售业	69,564,261.95	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	102,317,622.47	1.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	219,002,425.99	3.80
J	金融业	1,069,378,072.97	18.56
K	房地产业	34,691,892.48	0.60
L	租赁和商务服务业	64,960,799.59	1.13
M	科学研究和技术服务业	71,172,606.96	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,185,257.21	0.40
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,387,646,892.63	93.50

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	193,909	327,900,119.00	5.69

2	300750	宁德时代	878,792	201,058,821.68	3.49
3	601318	中国平安	3,753,446	174,159,894.40	3.02
4	000858	五粮液	739,100	120,894,587.00	2.10
5	002594	比亚迪	373,137	96,370,092.99	1.67
6	000333	美的集团	1,617,323	95,292,671.16	1.65
7	601166	兴业银行	5,230,378	81,855,415.70	1.42
8	601012	隆基绿能	2,848,260	81,659,614.20	1.42
9	000651	格力电器	2,148,755	78,451,045.05	1.36
10	600887	伊利股份	2,600,954	73,659,017.28	1.28
11	600036	招商银行	2,210,000	72,399,600.00	1.26
12	000725	京东方 A	17,500,660	71,577,699.40	1.24
13	002415	海康威视	2,044,300	67,686,773.00	1.17
14	601668	中国建筑	11,730,369	67,332,318.06	1.17
15	600030	中信证券	3,281,972	64,917,406.16	1.13
16	300760	迈瑞医疗	215,000	64,457,000.00	1.12
17	601328	交通银行	10,264,600	59,534,680.00	1.03
18	600438	通威股份	1,734,900	59,524,419.00	1.03
19	600919	江苏银行	7,990,140	58,727,529.00	1.02
20	600089	特变电工	2,526,900	56,324,601.00	0.98
21	000568	泸州老窖	266,423	55,834,268.11	0.97
22	600050	中国联通	11,537,400	55,379,520.00	0.96
23	601766	中国中车	8,362,420	54,355,730.00	0.94
24	601688	华泰证券	3,780,579	52,058,572.83	0.90
25	601899	紫金矿业	4,562,901	51,880,184.37	0.90
26	600028	中国石化	8,043,300	51,155,388.00	0.89
27	601601	中国太保	1,952,930	50,737,121.40	0.88
28	002049	紫光国微	543,870	50,715,877.50	0.88
29	601857	中国石油	6,755,100	50,460,597.00	0.88
30	002027	分众传媒	7,216,000	49,140,960.00	0.85
31	002371	北方华创	154,020	48,924,453.00	0.85
32	601211	国泰君安	3,442,222	48,156,685.78	0.84
33	600660	福耀玻璃	1,326,344	47,549,432.40	0.83
34	600585	海螺水泥	1,975,500	46,898,370.00	0.81
35	601169	北京银行	10,076,700	46,655,121.00	0.81
36	000768	中航西飞	1,741,100	46,574,425.00	0.81
37	603259	药明康德	739,798	46,096,813.38	0.80
38	601006	大秦铁路	6,074,900	45,136,507.00	0.78
39	600276	恒瑞医药	937,300	44,896,670.00	0.78
40	300450	先导智能	1,220,698	44,152,646.66	0.77
41	000538	云南白药	839,123	44,037,175.04	0.76
42	601728	中国电信	7,813,000	43,987,190.00	0.76
43	600019	宝钢股份	7,711,400	43,338,068.00	0.75
44	002475	立讯精密	1,284,100	41,669,045.00	0.72

45	601916	浙商银行	15,345,160	40,511,222.40	0.70
46	601818	光大银行	12,911,969	39,639,744.83	0.69
47	000895	双汇发展	1,593,500	39,024,815.00	0.68
48	300433	蓝思科技	3,143,300	36,965,208.00	0.64
49	601225	陕西煤业	2,028,800	36,903,872.00	0.64
50	600016	民生银行	9,355,600	35,083,500.00	0.61
51	600900	长江电力	1,582,290	34,905,317.40	0.61
52	002938	鹏鼎控股	1,433,192	34,812,233.68	0.60
53	002410	广联达	1,062,343	34,515,524.07	0.60
54	601229	上海银行	5,990,893	34,447,634.75	0.60
55	688981	中芯国际	669,548	33,825,564.96	0.59
56	002600	领益智造	4,848,000	33,499,680.00	0.58
57	002714	牧原股份	790,800	33,332,220.00	0.58
58	000157	中联重科	4,936,281	33,319,896.75	0.58
59	601919	中远海控	3,522,061	33,107,373.40	0.57
60	600809	山西汾酒	176,861	32,731,665.27	0.57
61	000938	紫光股份	1,012,220	32,239,207.00	0.56
62	600000	浦发银行	4,405,283	31,894,248.92	0.55
63	688599	天合光能	738,915	31,485,168.15	0.55
64	600153	建发股份	2,757,700	30,086,507.00	0.52
65	688012	中微公司	191,301	29,929,041.45	0.52
66	601377	兴业证券	4,814,950	29,467,494.00	0.51
67	000338	潍柴动力	2,297,700	28,629,342.00	0.50
68	002422	科伦药业	938,500	27,854,680.00	0.48
69	002152	广电运通	2,354,100	27,590,052.00	0.48
70	601877	正泰电器	988,400	27,329,260.00	0.47
71	300316	晶盛机电	385,300	27,317,770.00	0.47
72	600741	华域汽车	1,453,582	26,833,123.72	0.47
73	601717	郑煤机	2,047,700	25,493,865.00	0.44
74	300059	东方财富	1,723,549	24,474,395.80	0.42
75	600837	海通证券	2,610,400	24,067,888.00	0.42
76	601669	中国电建	4,159,900	23,877,826.00	0.41
77	300015	爱尔眼科	1,248,597	23,161,474.35	0.40
78	601186	中国铁建	2,351,401	23,161,299.85	0.40
79	002756	永兴材料	366,605	22,953,139.05	0.40
80	002466	天齐锂业	311,200	21,755,992.00	0.38
81	000063	中兴通讯	464,800	21,166,992.00	0.37
82	002601	龙佰集团	1,281,100	21,138,150.00	0.37
83	000776	广发证券	1,424,000	20,947,040.00	0.36
84	688111	金山办公	42,700	20,163,794.00	0.35
85	600031	三一重工	1,208,800	20,102,344.00	0.35
86	000625	长安汽车	1,540,600	19,919,958.00	0.35
87	600309	万华化学	226,200	19,869,408.00	0.34

88	600183	生益科技	1,389,800	19,735,160.00	0.34
89	603659	璞泰来	479,686	18,333,598.92	0.32
90	600803	新奥股份	957,300	18,169,554.00	0.32
91	002179	中航光电	399,762	18,129,206.70	0.31
92	601336	新华保险	484,900	17,829,773.00	0.31
93	002236	大华股份	887,700	17,532,075.00	0.30
94	600941	中国移动	187,900	17,531,070.00	0.30
95	300363	博腾股份	591,100	17,490,649.00	0.30
96	688006	杭可科技	564,000	17,185,080.00	0.30
97	300896	爱美客	38,600	17,175,070.00	0.30
98	002821	凯莱英	145,700	17,172,202.00	0.30
99	002352	顺丰控股	375,923	16,950,368.07	0.29
100	601231	环旭电子	1,071,700	16,032,632.00	0.28
101	601168	西部矿业	1,523,900	16,016,189.00	0.28
102	300274	阳光电源	135,600	15,815,028.00	0.27
103	600989	宝丰能源	1,241,600	15,656,576.00	0.27
104	002459	晶澳科技	373,336	15,568,111.20	0.27
105	601600	中国铝业	2,829,700	15,535,053.00	0.27
106	603127	昭衍新药	373,659	15,282,653.10	0.27
107	300014	亿纬锂能	251,300	15,203,650.00	0.26
108	600039	四川路桥	1,517,086	14,882,613.66	0.26
109	601888	中国中免	133,603	14,767,139.59	0.26
110	601288	农业银行	4,176,722	14,743,828.66	0.26
111	600598	北大荒	1,041,700	13,885,861.00	0.24
112	600436	片仔癀	48,002	13,745,852.72	0.24
113	688223	晶科能源	975,600	13,716,936.00	0.24
114	600655	豫园股份	1,999,300	13,715,198.00	0.24
115	600704	物产中大	2,771,000	13,688,740.00	0.24
116	002603	以岭药业	532,800	13,687,632.00	0.24
117	000878	云南铜业	1,231,400	13,606,970.00	0.24
118	600015	华夏银行	2,506,200	13,558,542.00	0.24
119	002736	国信证券	1,527,660	13,336,471.80	0.23
120	002244	滨江集团	1,450,400	12,792,528.00	0.22
121	300498	温氏股份	669,640	12,287,894.00	0.21
122	601138	工业富联	475,108	11,972,721.60	0.21
123	000739	普洛药业	624,900	11,085,726.00	0.19
124	600256	广汇能源	1,605,800	11,015,788.00	0.19
125	300142	沃森生物	416,200	11,008,490.00	0.19
126	603993	洛阳钼业	2,054,600	10,951,018.00	0.19
127	000591	太阳能	1,611,200	10,923,936.00	0.19
128	601319	中国人保	1,852,420	10,818,132.80	0.19
129	002373	千方科技	784,000	10,693,760.00	0.19
130	601137	博威合金	665,100	10,348,956.00	0.18

131	605499	东鹏饮料	58,400	10,097,360.00	0.18
132	601216	君正集团	2,415,400	9,903,140.00	0.17
133	600690	海尔智家	413,700	9,713,676.00	0.17
134	001979	招商蛇口	720,200	9,384,206.00	0.16
135	600048	保利发展	720,000	9,381,600.00	0.16
136	600570	恒生电子	207,230	9,178,216.70	0.16
137	600583	海油工程	1,530,300	8,952,255.00	0.16
138	300122	智飞生物	195,150	8,625,630.00	0.15
139	600236	桂冠电力	1,514,010	8,433,035.70	0.15
140	688002	睿创微纳	184,900	8,283,520.00	0.14
141	300347	泰格医药	126,900	8,190,126.00	0.14
142	688036	传音控股	55,463	8,153,061.00	0.14
143	688072	拓荆科技	19,000	8,093,430.00	0.14
144	605368	蓝天燃气	832,360	7,965,685.20	0.14
145	688819	天能股份	215,250	7,929,810.00	0.14
146	600718	东软集团	727,700	7,757,282.00	0.13
147	600600	青岛啤酒	74,664	7,737,430.32	0.13
148	688126	沪硅产业	367,700	7,684,930.00	0.13
149	300523	辰安科技	316,700	7,556,462.00	0.13
150	300751	迈为股份	44,366	7,514,713.08	0.13
151	000027	深圳能源	1,089,900	7,182,441.00	0.12
152	002056	横店东磁	371,700	6,768,657.00	0.12
153	301039	中集车辆	509,500	6,740,685.00	0.12
154	688082	盛美上海	59,553	6,574,651.20	0.11
155	603529	爱玛科技	204,000	6,572,880.00	0.11
156	600938	中国海油	362,700	6,572,124.00	0.11
157	000039	中集集团	910,400	6,272,656.00	0.11
158	603858	步长制药	297,400	6,123,466.00	0.11
159	600332	白云山	187,100	5,964,748.00	0.10
160	600662	外服控股	988,700	5,655,364.00	0.10
161	300124	汇川技术	83,800	5,380,798.00	0.09
162	002230	科大讯飞	76,300	5,185,348.00	0.09
163	600875	东方电气	274,600	5,121,290.00	0.09
164	002129	TCL 中环	149,704	4,970,172.80	0.09
165	601126	四方股份	282,500	4,291,175.00	0.07
166	000906	浙商中拓	477,900	4,262,868.00	0.07
167	300672	国科微	50,300	4,192,505.00	0.07
168	601992	金隅集团	1,795,100	3,913,318.00	0.07
169	601985	中国核电	540,800	3,812,640.00	0.07
170	601618	中国中冶	913,700	3,627,389.00	0.06
171	601077	渝农商行	955,100	3,428,809.00	0.06
172	688128	中国电研	132,500	3,378,750.00	0.06
173	600362	江西铜业	172,700	3,277,846.00	0.06

174	002001	新和成	209,900	3,232,460.00	0.06
175	600710	苏美达	377,600	3,232,256.00	0.06
176	601567	三星医疗	238,000	3,005,940.00	0.05
177	601958	金铂股份	266,700	2,973,705.00	0.05
178	688418	震有科技	115,800	2,441,064.00	0.04
179	002004	华邦健康	486,200	2,431,000.00	0.04
180	300033	同花顺	13,600	2,383,808.00	0.04
181	600958	东方证券	245,700	2,383,290.00	0.04
182	600998	九州通	224,614	2,331,493.32	0.04
183	300496	中科创达	23,700	2,283,495.00	0.04
184	000517	荣安地产	746,300	2,276,215.00	0.04
185	002017	东信和平	162,500	2,130,375.00	0.04
186	600588	用友网络	103,900	2,129,950.00	0.04
187	300628	亿联网络	58,920	2,066,324.40	0.04
188	603611	诺力股份	77,700	2,046,618.00	0.04
189	002091	江苏国泰	270,327	2,038,265.58	0.04
190	300999	金龙鱼	45,100	1,803,549.00	0.03
191	002022	科华生物	170,100	1,803,060.00	0.03
192	000048	京基智农	91,700	1,789,984.00	0.03
193	603639	海利尔	95,200	1,705,984.00	0.03
194	300390	天华新能	47,430	1,697,994.00	0.03
195	603678	火炬电子	47,400	1,633,404.00	0.03
196	300759	康龙化成	41,500	1,588,620.00	0.03
197	002249	大洋电机	214,300	1,221,510.00	0.02
198	600728	佳都科技	170,900	1,184,337.00	0.02
199	601816	京沪高铁	218,200	1,147,732.00	0.02
200	600623	华谊集团	178,900	1,114,547.00	0.02
201	000596	古井贡酒	4,500	1,113,210.00	0.02
202	603799	华友钴业	23,863	1,095,550.33	0.02
203	300487	蓝晓科技	16,950	1,058,019.00	0.02
204	600057	厦门象屿	121,000	1,052,700.00	0.02
205	600674	川投能源	69,800	1,050,490.00	0.02
206	000877	天山股份	128,001	1,041,928.14	0.02
207	002304	洋河股份	7,552	991,955.20	0.02
208	002737	葵花药业	39,400	958,996.00	0.02
209	688510	航亚科技	48,200	958,698.00	0.02
210	603986	兆易创新	7,600	807,500.00	0.01
211	000822	山东海化	116,400	792,684.00	0.01
212	000002	万科 A	56,374	790,363.48	0.01
213	002414	高德红外	90,870	706,059.90	0.01
214	000728	国元证券	105,400	687,208.00	0.01
215	300638	广和通	27,340	620,071.20	0.01
216	300866	安克创新	6,500	568,750.00	0.01

217	603290	斯达半导	2,600	559,520.00	0.01
218	300724	捷佳伟创	4,600	516,810.00	0.01
219	601163	三角轮胎	31,400	498,318.00	0.01
220	600481	双良节能	34,850	487,203.00	0.01
221	688173	希荻微	20,800	475,904.00	0.01
222	688390	固德威	2,780	463,870.80	0.01
223	603688	石英股份	3,900	443,976.00	0.01
224	603283	赛腾股份	9,900	440,550.00	0.01
225	600745	闻泰科技	8,800	430,320.00	0.01
226	605117	德业股份	2,820	421,731.00	0.01
227	300532	今天国际	19,300	396,808.00	0.01
228	688162	巨一科技	9,493	393,769.64	0.01
229	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
230	600884	杉杉股份	25,100	380,014.00	0.01
231	688630	芯碁微装	4,395	369,267.90	0.01
232	300951	博硕科技	6,600	360,558.00	0.01
233	002483	润邦股份	50,500	292,900.00	0.01
234	600350	山东高速	45,100	287,287.00	0.00
235	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
236	688626	翔宇医疗	5,900	268,509.00	0.00
237	002555	三七互娱	7,000	244,160.00	0.00
238	601519	大智慧	33,800	242,008.00	0.00
239	300454	深信服	2,100	237,825.00	0.00
240	688722	同益中	12,600	233,604.00	0.00
241	600886	国投电力	18,000	227,700.00	0.00
242	600582	天地科技	37,000	215,710.00	0.00
243	601800	中国交建	18,900	206,199.00	0.00
244	600008	首创环保	69,800	201,024.00	0.00
245	601998	中信银行	32,700	195,546.00	0.00
246	600060	海信视像	7,200	178,200.00	0.00
247	300146	汤臣倍健	7,400	177,452.00	0.00
248	688208	道通科技	5,400	163,674.00	0.00
249	002625	光启技术	9,900	151,074.00	0.00
250	688711	宏微科技	2,500	145,850.00	0.00
251	600985	淮北矿业	12,500	144,000.00	0.00
252	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.00
253	300957	贝泰妮	1,600	142,208.00	0.00
254	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
255	300777	中简科技	2,900	137,054.00	0.00
256	600328	中盐化工	15,210	136,890.00	0.00
257	601607	上海医药	6,000	134,460.00	0.00
258	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
259	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00

260	688187	时代电气	2,600	108,836.00	0.00
261	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
262	688032	禾迈股份	298	105,834.70	0.00
263	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
264	688063	派能科技	500	99,125.00	0.00
265	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
266	600635	大众公用	26,200	86,984.00	0.00
267	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
268	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
269	002895	川恒股份	3,900	76,830.00	0.00
270	688120	华海清科	300	75,615.00	0.00
271	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
272	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
273	688037	芯源微	400	68,380.00	0.00
274	600325	华发股份	6,800	66,980.00	0.00
275	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
276	605077	华康股份	2,000	52,960.00	0.00
277	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
278	603613	国联股份	1,228	45,350.04	0.00
279	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
280	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
281	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
282	601398	工商银行	7,357	35,460.74	0.00
283	603871	嘉友国际	2,100	32,991.00	0.00
284	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
285	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
286	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
287	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
288	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
289	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
290	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
291	603019	中科曙光	500	25,450.00	0.00
292	688029	南微医学	300	24,468.00	0.00
293	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
294	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
295	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
296	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
297	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
298	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
299	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
300	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
301	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
302	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00

303	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
304	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
305	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
306	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
307	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
308	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
309	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
310	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
311	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
312	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
313	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
314	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
315	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
316	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
317	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
318	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
319	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
320	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
321	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
322	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
323	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
324	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
325	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
326	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
327	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
328	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
329	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
330	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
331	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
332	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
333	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
334	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
335	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
336	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
337	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
338	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
339	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
340	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
341	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
342	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
343	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
344	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
345	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

346	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	002415	海康威视	87,128,590.57	1.53
2	000858	五粮液	86,530,260.00	1.52
3	000725	京东方 A	84,328,868.80	1.48
4	000333	美的集团	63,395,968.00	1.11
5	600050	中国联通	60,787,459.38	1.07
6	002027	分众传媒	54,352,919.00	0.95
7	601728	中国电信	49,854,631.00	0.87
8	600383	金地集团	49,168,834.64	0.86
9	601166	兴业银行	45,536,208.00	0.80
10	601225	陕西煤业	45,116,653.00	0.79
11	002049	紫光国微	45,104,724.39	0.79
12	002371	北方华创	44,684,004.82	0.78
13	601766	中国中车	44,630,283.60	0.78
14	002756	永兴材料	43,994,454.76	0.77
15	300760	迈瑞医疗	41,499,185.00	0.73
16	601668	中国建筑	41,417,769.77	0.73
17	600438	通威股份	41,107,426.29	0.72
18	300750	宁德时代	40,836,850.10	0.72
19	688561	奇安信	39,236,345.54	0.69
20	600919	江苏银行	38,904,420.56	0.68

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	002304	洋河股份	76,792,794.48	1.35
2	601138	工业富联	70,652,720.67	1.24
3	000333	美的集团	67,429,737.56	1.18
4	601390	中国中铁	59,073,851.00	1.04
5	000661	长春高新	56,022,304.00	0.98
6	600383	金地集团	55,443,219.40	0.97
7	002709	天赐材料	51,542,935.24	0.90

8	002050	三花智控	49,460,085.98	0.87
9	002352	顺丰控股	48,789,808.68	0.86
10	000725	京东方 A	45,928,412.88	0.81
11	002920	德赛西威	45,273,400.89	0.79
12	002475	立讯精密	44,698,612.26	0.78
13	002460	赣锋锂业	44,426,569.23	0.78
14	600436	片仔癀	44,181,789.37	0.77
15	002371	北方华创	42,840,393.30	0.75
16	000792	盐湖股份	42,764,425.98	0.75
17	600481	双良节能	42,449,370.62	0.74
18	600845	宝信软件	42,178,769.35	0.74
19	300207	欣旺达	40,681,805.40	0.71
20	600438	通威股份	40,279,955.81	0.71

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	4,613,393,202.83
卖出股票的收入（成交）总额	4,553,645,475.96

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	200,516,393.44	3.48
	其中：政策性金融债	200,516,393.44	3.48
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,516,393.44	3.48

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	230206	23 国开 06	2,000,000	200,516,393.44	3.48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会江西监管局、宁夏监管局和广东监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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

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	205,291.11
2	应收清算款	18,363,588.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,476,393.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,045,272.40

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	265,842	11,167.24	167,153,276.90	5.63%	2,801,568,608.80	94.37%
博时沪深 300 指数 C	100,181	7,447.31	31,653,528.08	4.24%	714,425,021.04	95.76%
博时沪深 300 指数 R	-	-	-	-	-	-
合计	362,523	10,247.08	198,806,804.98	5.35%	3,515,993,629.84	94.65%

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	259,368.81	0.01%
	博时沪深 300 指数 C	113,081.17	0.02%
	博时沪深 300 指数 R	—	—
	合计	372,449.98	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的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	2,985,996,543.65	709,177,211.81	—
本报告期基金总申购份额	190,558,853.05	198,862,524.77	—
减：本报告期基金总赎回份额	207,833,511.00	161,961,187.46	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,968,721,885.70	746,078,549.12	—

§ 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

基金管理人于 2023 年 2 月 18 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》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 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》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	24,320.08	-	22.65	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	519,080,813.70	5.68%	379,602.72	5.45%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
民生证券	1	24,448,553.95	0.27%	17,879.93	0.26%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	212,699,547.93	2.33%	198,089.25	2.84%	-
财达证券	1	409,848,075.76	4.48%	299,725.11	4.30%	-
中信建投	3	3,092,901,442.51	33.83%	2,418,805.61	34.70%	-
中信证券	5	1,347,601,114.53	14.74%	985,510.16	14.14%	-
国泰君安	3	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	274,572,063.42	3.00%	200,796.04	2.88%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	857,458,711.98	9.38%	627,057.53	9.00%	-
东方财富证券	4	357,524,093.46	3.91%	261,463.70	3.75%	-
兴业证券	3	420,915,404.88	4.60%	392,002.66	5.62%	-
平安证券	3	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	2	765,784,771.49	8.38%	560,020.69	8.03%	-
东吴证券	2	178,558,859.44	1.95%	130,580.30	1.87%	-
天风证券	2	681,994,705.55	7.46%	498,766.04	7.16%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

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，本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；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
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	179,276.87	5.37%	-	-	-	-
中信证券	3,158,319.61	94.63%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
2	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	2023-05-27
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12

5	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2023 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	2023-04-22
6	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2022 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	2023-03-30
7	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	2023-02-18
8	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业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	2023-02-13
9	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2022 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	2023-01-20
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§ 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

- 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
- 2、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 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
二〇二三年八月三十一日