

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
§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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	14
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 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	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计意见	20
6.2 形成审计意见的基础	21
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	21
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	21
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 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	67

8.7 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	68
8.8 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	68
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 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	69
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§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	3,798,379,473.22 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	博时沪深 300 指数 Y
下属分级基金的交易代码	050002	002385	960022	022922
报告期末下属分级基金的份额总额	3,001,199,425.68 份	796,464,005.43 份	-份	716,042.11 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	吴曼	王小飞
	联系电话	0755-83169999	021-60637103
	电子邮箱	service@bosera.com	wangxiaofei.zh@ccb.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	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

1. 博时沪深 300 指数 A:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	2024 年	2023 年	2022 年
据和指标	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A
本期已实现收益	106,567,158.08	-202,116,554.20	-338,353,544.43
本期利润	693,498,517.00	-351,777,677.66	-835,729,359.45
加权平均基金份额本期利润	0.2278	-0.1184	-0.2985
本期加权平均净值利润率	15.13%	-7.62%	-18.25%
本期基金份额净值增长率	15.67%	-7.72%	-16.51%
3.1.2 期末数	2024 年末	2023 年末	2022 年末
据和指标	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A
期末可供分配利润	1,956,561,970.31	1,280,712,347.66	1,635,009,328.48
期末可供分配基金份额利润	0.6519	0.4281	0.5476
期末基金资产净值	4,957,761,395.99	4,272,483,379.71	4,621,005,872.13
期末基金份额净值	1.6519	1.4281	1.5476
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A
基金份额累计净值增长率	440.97%	367.68%	406.81%

2. 博时沪深 300 指数 C:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	2024 年	2023 年	2022 年
据和指标	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C
本期已实现收益	14,194,308.95	-81,034,721.71	-77,158,902.66
本期利润	262,696,324.45	-128,728,398.66	-167,441,791.94
加权平均基金份额本期利润	0.2490	-0.1520	-0.2765
本期加权平均净值利润率	16.98%	-10.03%	-17.17%

本期基金份额净值增长率	15.21%	-8.09%	-16.85%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C
期末可供分配利润	444,097,322.31	438,067,654.70	372,066,728.37
期末可供分配基金份额利润	0.5576	0.4013	0.5246
期末基金资产净值	1,285,879,750.47	1,529,617,432.16	1,081,243,940.18
期末基金份额净值	1.6145	1.4013	1.5246
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C
基金份额累计净值增长率	68.81%	46.52%	59.41%

3. 博时沪深 300 指数 R:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R
本期已实现收益	-	-	-
本期利润	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	-	-	-
本期加权平均净值利润率	-	-	-
本期基金份额净值增长率	-	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R
期末可供分配利润	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	-	-	-
期末基金	-	-	-

资产净值			
期末基金份额净值	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R
基金份额累计净值增长率	1.76%	1.76%	1.76%

4. 博时沪深 300 指数 Y:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据	2024 年	2023 年	2022 年
据和指标	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y
本期已实现收益	4,717.53	-	-
本期利润	-9,827.31	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0525	-	-
本期加权平均净值利润率	-3.15%	-	-
本期基金份额净值增长率	0.07%	-	-
3.1.2 期末数据	2024 年末	2023 年末	2022 年末
据和指标	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y
期末可供分配利润	466,260.73	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.6512	-	-
期末基金资产净值	1,182,302.84	-	-
期末基金份额净值	1.6512	-	-
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y
基金份额累计净值增长率	0.07%	-	-

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

1. 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
过去三个月	-2.42%	1.65%	-1.92%	1.65%	-0.50%	0.00%
过去六个月	12.83%	1.58%	13.05%	1.58%	-0.22%	0.00%
过去一年	15.67%	1.28%	14.04%	1.27%	1.63%	0.01%
过去三年	-10.88%	1.11%	-19.20%	1.12%	8.32%	-0.01%
过去五年	7.84%	1.16%	-3.24%	1.17%	11.08%	-0.01%
自基金合同生效起至今	440.97%	1.49%	210.79%	1.49%	230.18%	0.00%

2. 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
过去三个月	-2.52%	1.65%	-1.92%	1.65%	-0.60%	0.00%
过去六个月	12.60%	1.58%	13.05%	1.58%	-0.45%	0.00%
过去一年	15.21%	1.28%	14.04%	1.27%	1.17%	0.01%
过去三年	-11.94%	1.11%	-19.20%	1.12%	7.26%	-0.01%
过去五年	5.71%	1.16%	-3.24%	1.17%	8.95%	-0.01%
自基金合同生效起至今	68.81%	1.12%	33.16%	1.12%	35.65%	0.00%

注：自 2016 年 1 月 27 日起，本基金新增 C 类份额。

3. 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。

4. 博时沪深 300 指数 Y:

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	0.07%	0.69%	0.04%	0.66%	0.03%	0.03%

注：自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日，相关数据按实际存续期计算。

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。

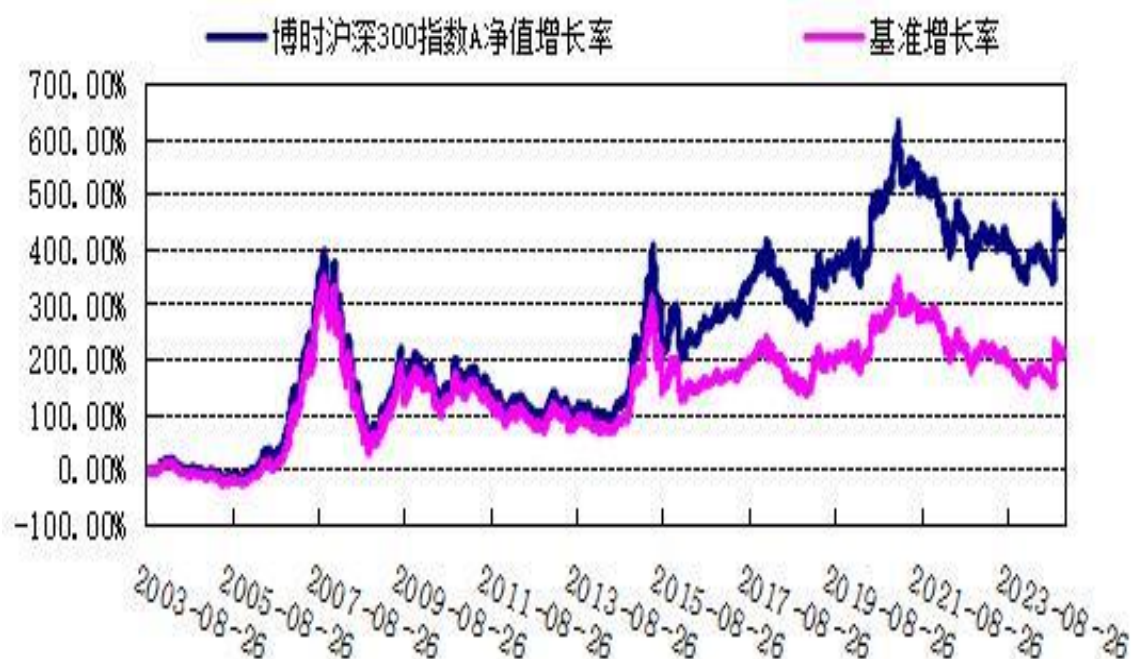
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 8 月 26 日至 2024 年 12 月 31 日)

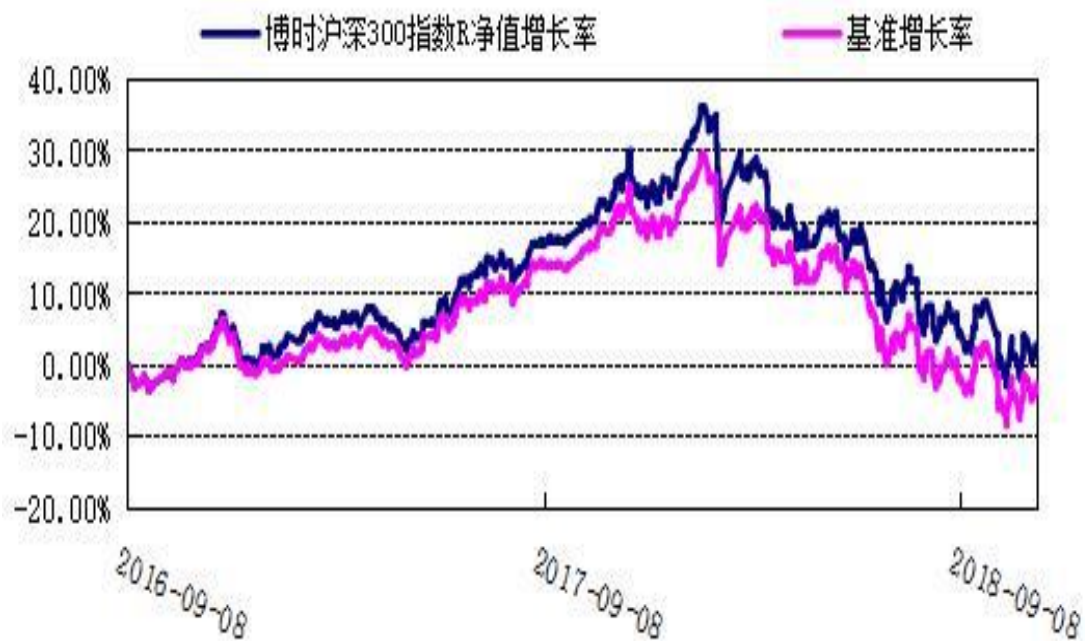
1、博时沪深 300 指数 A



2、博时沪深 300 指数 C



3、博时沪深 300 指数 R



4、博时沪深 300 指数 Y

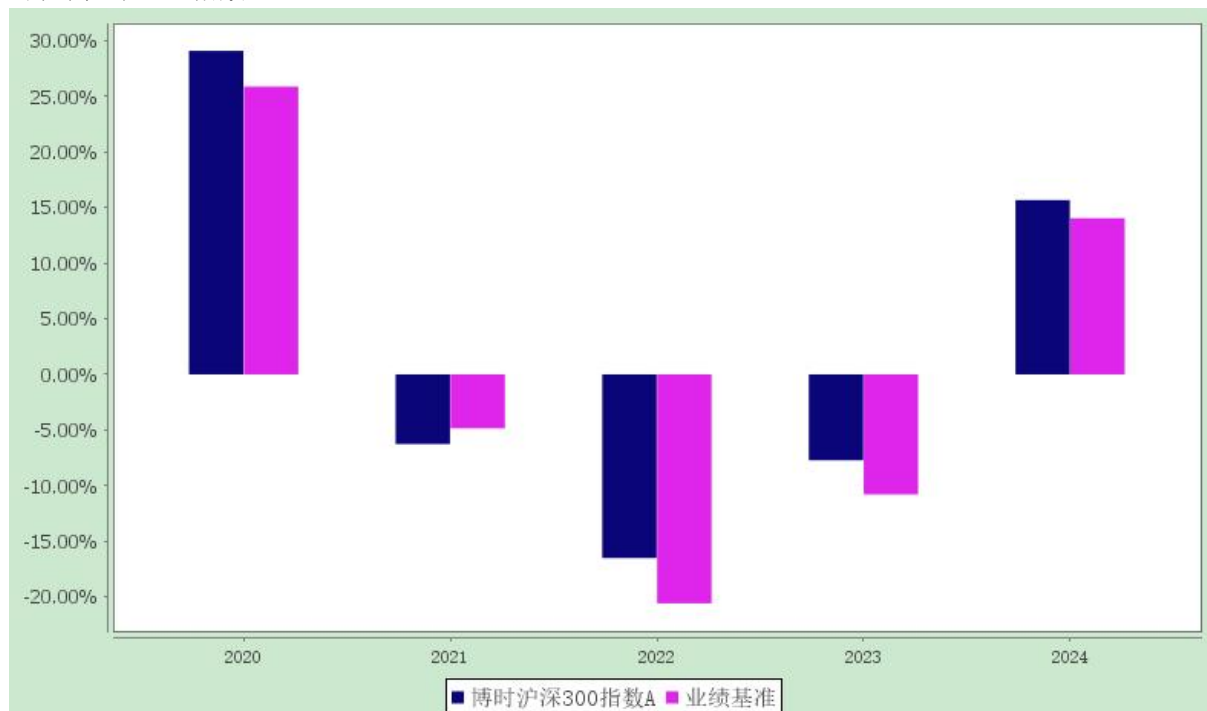


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

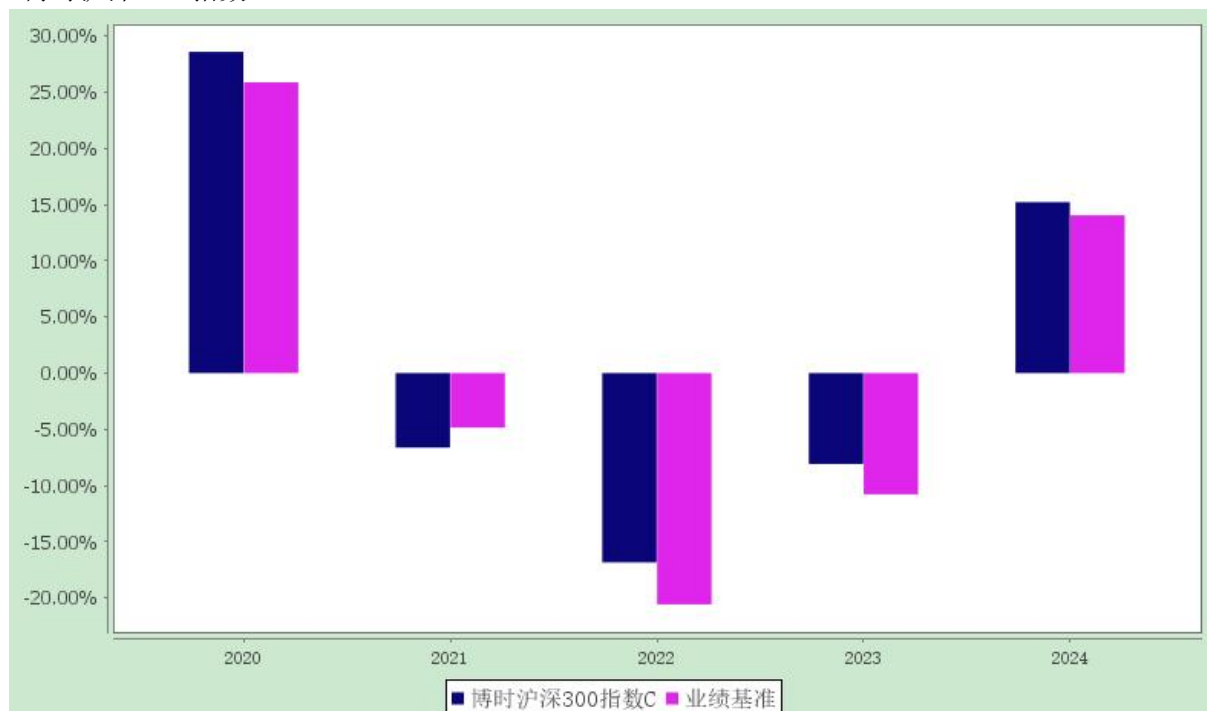
博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

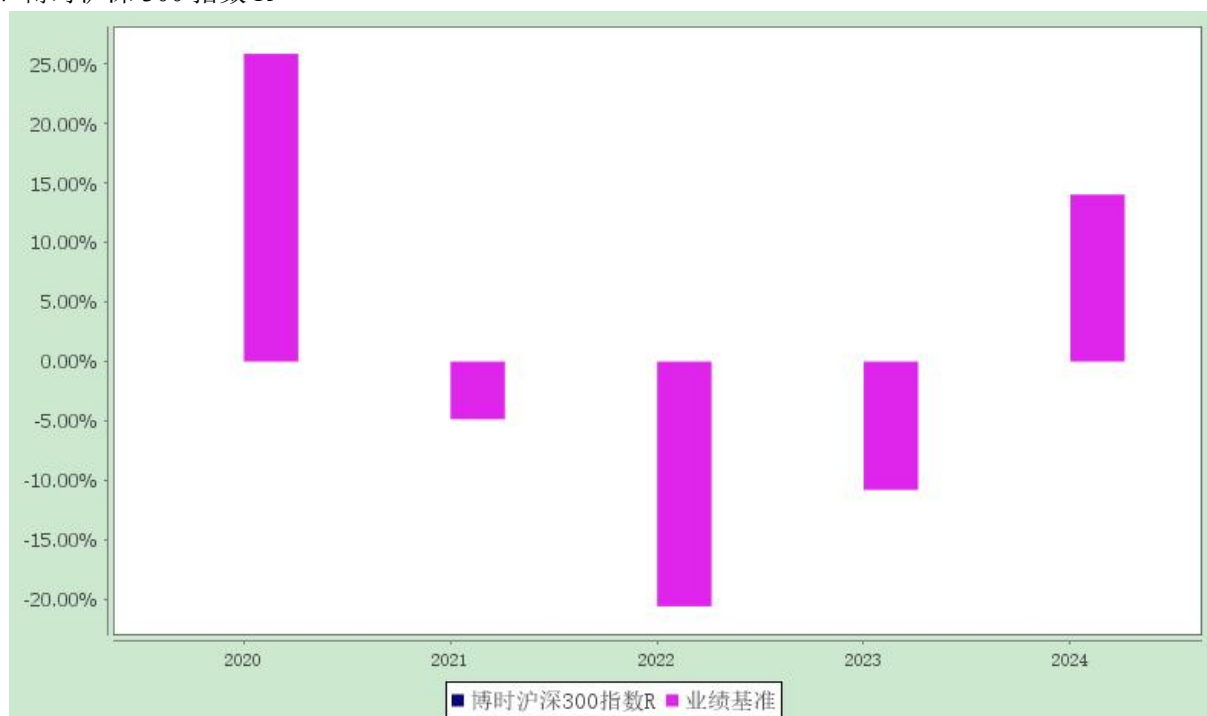
1、博时沪深 300 指数 A



2、博时沪深 300 指数 C

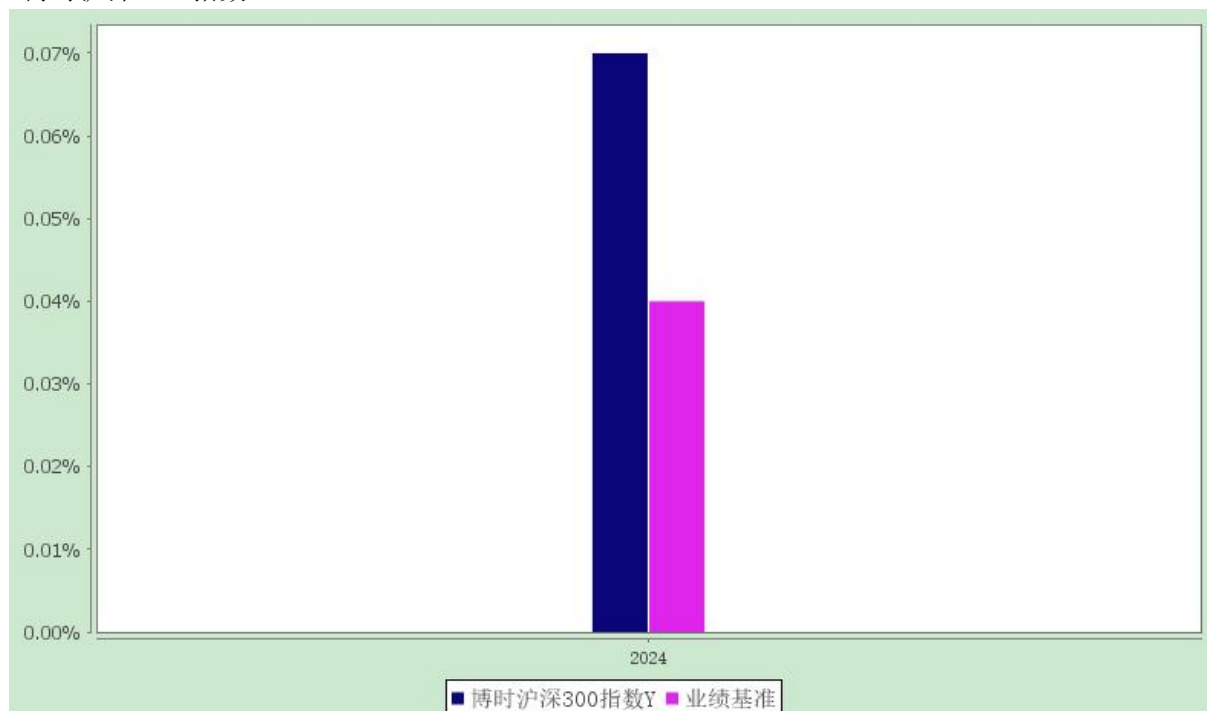


3、博时沪深 300 指数 R



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。

4、博时沪深 300 指数 Y



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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 2024 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 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 16089 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 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

12 月，国家开发银行授予博时基金“优秀投资机构合作奖”，表彰公司在国家开发银行 2024 年银行间市场金融债券投资工作中表现突出。

11 月，深证投资者服务中心联合全景投教基地召开《股东来了》（2024）投资者权益知识竞赛深圳片区总结交流会，授予博时基金《股东来了》（2024）深圳片区突出贡献团体奖。

10 月，中国人民银行 2023 年度金融科技发展奖获奖项目名单出炉，博时基金“新一代资管业务资金清算系统”荣获三等奖。

4 月，深圳市人工智能学会公布 2023 年度第三届“深圳人工智能奖”获奖名单，博时基金“智能量化因子投研系统”荣获人工智能行业应用奖。

1 月，中国人民银行公布 2022 年度金融科技发展奖获奖项目名单，博时基金“陪伴服务平台项目”荣获三等奖。

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	-	11.3	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、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)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)的基金经理。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—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)、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—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日

					—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 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	-	15.3	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)、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-2024 年 7 月 5 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—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

					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—至今)、博时恒享债券型证券投资基金(2023 年 9 月 26 日—至今)、博时恒鑫稳健一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时中证 A50 指数型发起式证券投资基金(2024 年 8 月 27 日—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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 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 132 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，市场呈现“V 型”反转，市场风格表现分化较大，大盘、价值风格相关资产占优，上证指数最终收于 3352 点左右。海外通胀持续回落开启的降息周期，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 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.6519 元，份额累计净值为 3.6858 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.6145 元，份额累计净值为 1.6327 元，本基金 R 类基金期末无份额，本基金 Y 类基金份额净值为 1.6512 元，份额累计净值为 1.6512 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 15.67%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 15.21%，本基金 Y 类基金份额净值增长率为 0.07%，本基金 A 类同期业绩基准增长率为 14.04%，本基金 C 类同期业绩基准增长率为 14.04%，本基金 Y 类同期业绩基准增长率为 0.04%。

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，在积极政策刺激下，经济整体企稳向好；政策方面，宏观政策将采取“实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策”，对房地产市场政策预期也在持续积极推进，房地产市场对于经济的拖累有望在 2025 年得到明显改善。国内持续保持相对积极的货币财政政策，国债收益率下行。当前市场整体估值水平处于历史上相对较低的位置，看好 A 股长期配置价值。从盈利预期角度看，随着相关宏观逆周期调节力度逐渐较大，经济基本面有望逐渐见底回升。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《制度管理规范》、《合规管理制度》、《全面风险管理制度》、《内部稽核审

计制度》、《投资者适当性管理制度》、《公募基金证券交易佣金分配管理办法》、《货币市场基金投资管理制度》、《对外信息发布管理制度》、《公募基金法定信息披露管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，完善“博时合规管理及审计系统”中制度库应用、合规报告生成等模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金收益分配原则：本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；基金收益分配比例按有关规定制定；R 类份额的分红方式仅为现金分红；Y 类基金份额的收益分配方式仅为红利再投资；其余两类份额类别的投资者可以选择现金分红方式或红利再投资的分红方式，基金默认的分红方式为现金分红；若投资者要修改分红方式，请自行到销售网点柜台或销售机构规定的其他方式进行修改；基金投资当期亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；基金当

期收益应先弥补以前亏损后，才可进行当期收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

容诚审字[2025]200Z0921 号

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“博时沪深 300 指数”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时沪深 300 指数 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时沪深 300 指数，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时沪深 300 指数的基金管理人博时基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时沪深 300 指数的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时沪深 300 指数、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时沪深 300 指数的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时沪深 300 指数持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时沪深 300 指数不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

薛竞 吴琳杰

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	380,046,048.55	141,196,832.14
结算备付金		5,806,022.48	6,369,956.47
存出保证金		416,667.85	275,822.28
交易性金融资产	7.4.7.2	5,876,853,857.78	5,661,982,843.17
其中：股票投资		5,876,853,857.78	5,460,835,411.48
基金投资		-	-
债券投资		-	201,147,431.69
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	12,645,403.72
应收股利		-	-
应收申购款		5,192,773.97	7,936,316.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		6,268,315,370.63	5,830,407,173.98
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		368,739.23	12,907,602.05
应付赎回款		14,773,675.06	3,777,190.38
应付管理人报酬		5,218,207.57	4,737,759.14
应付托管费		1,064,940.31	966,889.64
应付销售服务费		437,304.04	508,570.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,629,055.12	5,408,350.55
负债合计		23,491,921.33	28,306,362.11
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	3,798,379,473.22	4,083,320,809.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	2,446,443,976.08	1,718,780,002.36
净资产合计		6,244,823,449.30	5,802,100,811.87
负债和净资产总计		6,268,315,370.63	5,830,407,173.98

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 3,798,379,473.22 份。其中 A 类基金份额净值 1.6519 元，基金份额总额 3,001,199,425.68 份；C 类基金份额净值 1.6145 元，基金份额总额 796,464,005.43 份；无 R 类基金份额；Y 类基金份额净值 1.6512 元，基金份额总额 716,042.11 份。

7.2 利润表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,035,101,398.00	-405,455,147.12
1.利息收入		1,420,998.61	683,674.45
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,420,998.61	681,569.38
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		-	2,105.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		197,076,524.74	-209,310,123.97
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-442,803.54	-386,698,095.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	448,238.53	3,911,311.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	197,071,089.75	173,476,659.74
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）	7.4.7.15	835,418,829.58	-197,354,800.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,185,045.07	526,102.81
减：二、营业总支出		78,916,383.86	75,050,929.20
1. 管理人报酬		60,176,715.56	57,860,517.75
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		12,280,962.37	11,808,268.96
3. 销售服务费		6,220,395.83	5,129,862.44
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	2.27
8. 其他费用	7.4.7.18	238,310.10	252,277.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		956,185,014.14	-480,506,076.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		956,185,014.14	-480,506,076.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		956,185,014.14	-480,506,076.32

7.3 净资产变动表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,083,320,809.51	1,718,780,002.36	5,802,100,811.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	4,083,320,809.51	1,718,780,002.36	5,802,100,811.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-284,941,336.29	727,663,973.72	442,722,637.43
（一）、综合收益总额	-	956,185,014.14	956,185,014.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-284,941,336.29	-228,521,040.42	-513,462,376.71
其中：1.基金申购款	1,387,868,337.43	730,251,900.44	2,118,120,237.87
2.基金赎回款	-1,672,809,673.72	-958,772,940.86	-2,631,582,614.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	3,798,379,473.22	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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	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）	388,147,054.05	-288,296,054.49	99,850,999.56
（一）、综合收益总额	-	-480,506,076.32	-480,506,076.32
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	388,147,054.05	192,210,021.83	580,357,075.88
其中：1.基金申购款	1,119,236,087.90	592,726,790.63	1,711,962,878.53
2.基金赎回款	-731,089,033.85	-400,516,768.80	-1,131,605,802.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	4,083,320,809.51	1,718,780,002.36	5,802,100,811.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（原名为博时裕富证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]第 83 号《关于同意博时裕富证券投资基金设立的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《博时裕富证券投资基金基金契约》（后更名为《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》）发起，并于 2003 年 8 月 26 日募集成立。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,122,784,859.66 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字（2003）第 107 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

本基金根据申购费用与销售服务费收取方式、销售市场区域、申购资金账户等不同，将基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额、Y 类基金份额和 R 类基金份额。本基金自 2016 年 1 月 26 日起增加 C 类基金份额和 R 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额；自 2024 年 12 月 13 日起增加 Y 类基金份额。在中国内地市场销售，投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；在中国内地市场销售，从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用和赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额；通过个人养老金账户投资，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 Y 类基金份额；在中国香港市场销售，在赎回时依据固定赎回费率收取赎回费用的基金份额，称为 R 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金将主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）、新股及存托凭证（IPO 或增发）以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票（含存托凭证）的比例在基金资产总值的 95% 以内；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数+5%×银行同业存款利率。

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

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

（3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本

和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购

和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；（2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；（3）该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；（4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，A/C/Y 类基金份额的基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；R 类基金份额的收益分配仅采用现金方式。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票

投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	380,046,048.55	141,196,832.14
等于：本金	380,006,345.31	141,181,377.24
加：应计利息	39,703.24	15,454.90
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	380,046,048.55	141,196,832.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,483,179,699.47	-	5,876,853,857.78	393,674,158.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,483,179,699.47	-	5,876,853,857.78	393,674,158.31
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,902,936,482.75	-	5,460,835,411.48	-442,101,071.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	199,623,600.00	1,167,431.69	201,147,431.69	356,400.00

	合计	199,623,600.00	1,167,431.69	201,147,431.69	356,400.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,102,560,082.75	1,167,431.69	5,661,982,843.17	-441,744,671.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	12,065.14	3,289.37
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,151,210.18	4,919,829.49
其中：交易所市场	1,151,210.18	4,918,379.49
银行间市场	-	1,450.00
应付利息	-	-
其他应付款	1,279.80	731.69
预提费用	214,500.00	234,500.00
合计	1,629,055.12	5,408,350.55

7.4.7.7 实收基金

博时沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,991,771,032.05	2,991,771,032.05
本期申购	615,679,841.64	615,679,841.64
本期赎回（以“-”号填列）	-606,251,448.01	-606,251,448.01
本期末	3,001,199,425.68	3,001,199,425.68

博时沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,091,549,777.46	1,091,549,777.46

本期申购	771,472,453.68	771,472,453.68
本期赎回（以“-”号填列）	-1,066,558,225.71	-1,066,558,225.71
本期末	796,464,005.43	796,464,005.43

博时沪深 300 指数 R

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	-	-

博时沪深 300 指数 Y

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	716,042.11	716,042.11
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	716,042.11	716,042.11

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)。

7.4.7.8 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	3,250,898,995.08	-1,970,186,647.42	1,280,712,347.66
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	3,250,898,995.08	-1,970,186,647.42	1,280,712,347.66
本期利润	106,567,158.08	586,931,358.92	693,498,517.00
本期基金份额交易产生的变动数	7,146,968.72	-24,795,863.07	-17,648,894.35
其中：基金申购款	651,643,948.89	-318,876,774.02	332,767,174.87
基金赎回款	-644,496,980.17	294,080,910.95	-350,416,069.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,364,613,121.88	-1,408,051,151.57	1,956,561,970.31

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	578,422,257.93	-140,354,603.23	438,067,654.70
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-

其他（若有）	-	-	-
本期期初	578,422,257.93	-140,354,603.23	438,067,654.70
本期利润	14,194,308.95	248,502,015.50	262,696,324.45
本期基金份额交易产生的变动数	-148,519,244.57	-62,828,989.54	-211,348,234.11
其中：基金申购款	387,383,956.98	9,624,680.55	397,008,637.53
基金赎回款	-535,903,201.55	-72,453,670.09	-608,356,871.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	444,097,322.31	45,318,422.73	489,415,745.04

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
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-	-	-
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

博时沪深 300 指数 Y

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	-	-	-
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,717.53	-14,544.84	-9,827.31
本期基金份额交易产生的变动数	797,911.98	-321,823.94	476,088.04
其中：基金申购款	797,911.98	-321,823.94	476,088.04
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	802,629.51	-336,368.78	466,260.73

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,301,727.61	564,943.00
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	113,898.82	110,764.24
其他	5,372.18	5,862.14
合计	1,420,998.61	681,569.38

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,330,542,862.65	9,983,917,714.69
减：卖出股票成本总额	11,312,066,323.07	10,344,973,055.69
减：交易费用	18,919,343.12	25,642,754.24
买卖股票差价收入	-442,803.54	-386,698,095.24

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	178,688.53	3,678,069.12
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	269,550.00	233,242.41
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	448,238.53	3,911,311.53

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	201,239,920.22	408,144,158.39
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	199,623,600.00	403,826,000.00
减：应计利息总额	1,346,120.22	4,081,685.51
减：交易费用	650.00	3,230.47

买卖债券差价收入	269,550.00	233,242.41
----------	------------	------------

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	197,071,089.75	173,476,659.74
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	197,071,089.75	173,476,659.74

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	835,418,829.58	-197,354,800.41
——股票投资	835,775,229.58	-198,330,000.41
——债券投资	-356,400.00	975,200.00
——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	835,418,829.58	-197,354,800.41

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	1,020,219.37	513,378.40
基金转换费收入	164,825.70	12,724.41

合计	1,185,045.07	526,102.81
----	--------------	------------

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	90,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	1,801.40	-
银行汇划费	8,508.70	4,277.78
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	238,310.10	252,277.78

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2025 年 1 月 9 日宣告 2024 年度的第 1 次分红，向截至 2025 年 1 月 13 日止在本基金注册登记人博时基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类基金份额按每 10 份基金份额发放红利 0.1700 元，C 类基金份额按每 10 份基金份额发放红利 0.1450 元，Y 类基金份额按每 10 份基金份额发放红利 0.1700 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

注：1. 经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海

南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记, 变更为基金管理人的全资子公司。

2. 经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议, 股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议, 股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。于 2024 年 12 月 24 日, 基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记, 上述股东变更完成后, 基金管理人股权结构为: 招商证券股份有限公司 49%, 中国长城资产管理股份有限公司 25%, 上海汇华实业有限公司 12%, 天津港(集团)有限公司 6%, 上海盛业股权投资基金有限公司 6% 和浙江省国际贸易集团有限公司 2%。

3. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	89,205,775.52	0.40%	1,675,666,066.97	8.13%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	84,379.70	0.71%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	1,446,911.69	8.96%	1,053,227.87	21.41%

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。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》, 自 2024 年 7 月 1 日起, 针对被动股票型基金, 不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用; 针对

其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	60,176,715.56	57,860,517.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,916,072.52	13,915,306.91
应支付基金管理人的净管理费	45,260,643.04	43,945,210.84

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日 A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额和 Y 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额和 Y 类基金份额约定的管理费年费率分别为 0.98%、0.98%、0.98% 和 0.49%。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日 A/C/R/Y 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,280,962.37	11,808,268.96

注：支付基金托管人的托管费按前一日 A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额和 Y 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额和 Y 类基金份额约定的托管费年费率分别为 0.20%、0.20%、0.20% 和 0.10%。其计算公式为：

日托管费 = 前一日 A/C/R/Y 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2024年1月1日至2024年12月31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	博时沪深 300 指数 Y	合计
招商证券	-	543.09	-	-	543.09
博时基金	-	763,381.34	-	-	763,381.34
博时财富	-	457.11	-	-	457.11
合计	-	764,381.54	-	-	764,381.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	博时沪深300指数Y	合计
博时基金	-	463,409.58	-	-	463,409.58
博时财富	-	67.69	-	-	67.69

招商证券	-	43.09	-	-	43.09
合计	-	463,520.36	-	-	463,520.36

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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	380,046,048.55	1,301,727.61	141,196,832.14	564,943.00

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。

7.4.10.7 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	1,745.00	151,745.20
招商证券股份有限公司	301631	壹连科技	网下发行	1,525.00	111,309.75
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	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
招商证券股份有限公司	001378	德冠新材	网下发行	2,044.00	64,753.92
招商证券股份有限公司	688653	康希通信	网下发行	6,478.00	68,019.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	首次公开发行限售	21.23	65.78	957.00	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6 个月	首次公开发行限售	55.18	165.78	289.00	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6 个月	首次公开发行限售	8.00	56.10	804.00	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6 个月	首次公开发行限售	11.25	29.44	1,406.00	15,817.50	41,392.64	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	首次公开发行限售	27.08	48.95	780.00	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6 个月	首次公开发行限售	17.58	33.06	979.00	17,210.82	32,365.74	-
001391	国	2024-12-23	6 个	首次	2.30	6.80	4,686.00	10,777.80	31,864.80	-

	货航		月	公开发 行限售						
301551	无线传媒	2024-09-19	6 个月	首次公开发 行限售	9.40	43.23	652.00	6,128.80	28,185.96	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6 个月	首次公开发 行限售	7.16	15.44	1,685.00	12,064.60	26,016.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	7 个交易 日	新股未上 市	12.30	12.30	2,029.00	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	首次公开发 行限售	6.88	24.84	816.00	5,614.08	20,269.44	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6 个月	首次公开发 行限售	18.50	56.85	279.00	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024-10-10	6 个月	首次公开发 行限售	14.50	59.05	267.00	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连科技	2024-11-12	6 个月	首次公开发 行限售	72.99	101.96	153.00	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	首次公开发 行限售	21.21	36.49	396.00	8,399.16	14,450.04	-
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	首次公开发 行限售	11.14	40.83	350.00	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	首次公开发 行限售	22.36	44.92	306.00	6,842.16	13,745.52	-
301608	博	2024-07-25	6 个	首次	44.50	65.38	184.00	8,188.00	12,029.92	-

	实 结		月	公 开 发 行 限 售						
301586	佳 力 奇	2024-08-21	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	18.09	53.14	215.00	3,889.35	11,425.10	-
688710	益 诺 思	2024-08-27	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	19.06	33.58	332.00	6,327.92	11,148.56	-
301617	博 苑 股 份	2024-12-03	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	27.76	39.79	253.00	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔 锋 智 能	2024-07-03	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	26.50	41.98	233.00	6,174.50	9,781.34	-
301607	富 特 科 技	2024-08-28	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	14.00	36.14	257.00	3,598.00	9,287.98	-
603194	中 力 股 份	2024-12-17	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	20.32	28.13	291.00	5,913.12	8,185.83	-
301552	科 力 装 备	2024-07-15	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	30.00	56.87	143.00	4,290.00	8,132.41	-
001279	强 邦 新 材	2024-09-27	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	9.68	27.91	265.00	2,565.20	7,396.15	-
603395	红 四 方	2024-11-19	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	7.98	35.77	154.00	1,228.92	5,508.58	-
603310	巍 华 新 材	2024-08-07	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	17.39	17.95	254.00	4,417.06	4,559.30	-
603091	众	2024-09-10	6 个	首 次	26.50	44.43	94.00	2,491.00	4,176.42	-

	鑫股份		月	公开发 行限售						
603391	力聚热能	2024-07-24	6 个月	首次公开发 行限售	40.00	41.35	100.00	4,000.00	4,135.00	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	首次公开发 行限售	20.56	36.17	106.00	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	6 个月	首次公开发 行限售	14.65	27.35	128.00	1,875.20	3,500.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	首次公开发 行限售	18.65	22.61	129.00	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	首次公开发 行限售	12.30	12.30	226.00	2,779.80	2,779.80	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属被动式股票指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金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、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

7.4.13.2.1 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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	201,147,431.69
合计	-	201,147,431.69

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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	380,046,048.55	-	-	-	380,046,048.55
结算备付金	5,806,022.48	-	-	-	5,806,022.48
存出保证金	416,667.85	-	-	-	416,667.85
交易性金融资产	-	-	-	5,876,853,857.78	5,876,853,857.78
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,192,773.97	5,192,773.97
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	386,268,738.88	-	-	5,882,046,631.75	6,268,315,370.63
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,773,675.06	14,773,675.06
应付清算款	-	-	-	368,739.23	368,739.23
应付管理人报酬	-	-	-	5,218,207.57	5,218,207.57
应付托管费	-	-	-	1,064,940.31	1,064,940.31
应付销售服务费	-	-	-	437,304.04	437,304.04
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,629,055.12	1,629,055.12
负债总计	-	-	-	23,491,921.33	23,491,921.33
利率敏感度缺口	386,268,738.88	-	-	5,858,554,710.42	6,244,823,449.30
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	141,196,832.14	-	-	-	141,196,832.14

结算备付金	6,369,956.47	-	-	-	6,369,956.47
存出保证金	275,822.28	-	-	-	275,822.28
交易性金融资产	201,147,431.69	-	-	5,460,835,411.48	5,661,982,843.17
应收清算款	-	-	-	12,645,403.72	12,645,403.72
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,936,316.20	7,936,316.20
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	348,990,042.58	-	-	5,481,417,131.40	5,830,407,173.98
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,777,190.38	3,777,190.38
应付清算款	-	-	-	12,907,602.05	12,907,602.05
应付管理人报酬	-	-	-	4,737,759.14	4,737,759.14
应付托管费	-	-	-	966,889.64	966,889.64
应付销售服务费	-	-	-	508,570.35	508,570.35
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,408,350.55	5,408,350.55
负债总计	-	-	-	28,306,362.11	28,306,362.11
利率敏感度缺口	348,990,042.58	-	-	5,453,110,769.29	5,802,100,811.87

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。

7.4.13.4.1.2 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	减少约 37
	市场利率下降 25 个基点	-	增加约 37

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	5,876,853,857.78	94.11	5,460,835,411.48	94.12
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,876,853,857.78	94.11	5,460,835,411.48	94.12

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

7.4.13.4.3.2 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 30,024	增加约 26,961
	业绩比较基准下降 5%	减少约 30,024	减少约 26,961

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	5,876,246,080.61	5,459,567,865.25
第二层次	27,736.50	201,147,431.69
第三层次	580,040.67	1,267,546.23
合计	5,876,853,857.78	5,661,982,843.17

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,267,546.23	1,267,546.23
当期购买	-	507,006.67	507,006.67
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,578,000.88	1,578,000.88
当期利得或损失总额	-	383,488.65	383,488.65
其中：计入损益的利得或损失	-	383,488.65	383,488.65
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	580,040.67	580,040.67
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	342,700.99	342,700.99
项目	上年度可比期间		

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,507,570.31	1,507,570.31
当期购买	-	2,549,350.84	2,549,350.84
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,696,105.35	3,696,105.35
当期利得或损失总额	-	906,730.43	906,730.43
其中：计入损益的利得或损失	-	906,730.43	906,730.43
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,267,546.23	1,267,546.23
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	122,764.41	122,764.41

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	580,040.67	平均价格亚式期权模型	预期波动率	26.65%-574.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,267,546.23	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.55%-217.75%	负相关

7.4.14.3 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（上年度末：同）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,876,853,857.78	93.75
	其中：股票	5,876,853,857.78	93.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	385,852,071.03	6.16
8	其他各项资产	5,609,441.82	0.09
9	合计	6,268,315,370.63	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	118,782,199.08	1.90
B	采矿业	282,234,614.40	4.52
C	制造业	3,111,748,830.08	49.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	154,437,598.06	2.47
E	建筑业	107,050,629.12	1.71
F	批发和零售业	3,635,445.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	216,247,062.20	3.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	259,200,102.58	4.15
J	金融业	1,468,963,537.01	23.52
K	房地产业	57,652,756.00	0.92
L	租赁和商务服务业	53,059,114.77	0.85
M	科学研究和技术服务业	39,649,275.48	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,117,445.00	0.07

R	文化、体育和娱乐业	75,249.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,876,853,857.78	94.11

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	177470	270,464,280.00	4.33
2	300750	宁德时代	801792	213,276,672.00	3.42
3	601318	中国平安	3308592	174,197,368.80	2.79
4	000333	美的集团	1859373	139,862,037.06	2.24
5	601166	兴业银行	5862218	112,320,096.88	1.80
6	000858	五粮液	791300	110,813,652.00	1.77
7	002594	比亚迪	366337	103,548,816.42	1.66
8	600276	恒瑞医药	2007272	92,133,784.80	1.48
9	600036	招商银行	2278400	89,541,120.00	1.43
10	601328	交通银行	11201900	87,038,763.00	1.39
11	600900	长江电力	2853690	84,326,539.50	1.35
12	000725	京东方 A	18972860	83,290,855.40	1.33
13	601899	紫金矿业	5269716	79,678,105.92	1.28
14	300059	东方财富	3072918	79,342,742.76	1.27
15	600000	浦发银行	6897604	70,976,345.16	1.14
16	002714	牧原股份	1668600	64,140,984.00	1.03
17	601919	中远海控	4054761	62,848,795.50	1.01
18	002475	立讯精密	1524500	62,138,620.00	1.00
19	002352	顺丰控股	1541223	62,111,286.90	0.99
20	601688	华泰证券	3477864	61,175,627.76	0.98
21	601601	中国太保	1793630	61,126,910.40	0.98
22	603501	韦尔股份	577745	60,322,355.45	0.97
23	600031	三一重工	3625800	59,753,184.00	0.96
24	601169	北京银行	9199100	56,574,465.00	0.91
25	600050	中国联通	10420000	55,330,200.00	0.89
26	601818	光大银行	14189269	54,912,471.03	0.88
27	600030	中信证券	1767888	51,569,292.96	0.83
28	605499	东鹏饮料	203670	50,616,068.40	0.81
29	600585	海螺水泥	2107800	50,123,484.00	0.80
30	600015	华夏银行	6091500	48,792,915.00	0.78
31	600958	东方证券	4586600	48,434,496.00	0.78
32	300498	温氏股份	2914108	48,111,923.08	0.77
33	601127	赛力斯	358600	47,833,654.00	0.77
34	000538	云南白药	761940	45,678,303.00	0.73

35	002001	新和成	2075884	45,607,171.48	0.73
36	601658	邮储银行	7992700	45,398,536.00	0.73
37	688041	海光信息	289110	43,305,786.90	0.69
38	601728	中国电信	5953600	42,984,992.00	0.69
39	300308	中际旭创	343540	42,430,625.40	0.68
40	601225	陕西煤业	1813200	42,175,032.00	0.68
41	000166	申万宏源	7851200	42,003,920.00	0.67
42	601857	中国石油	4690300	41,931,282.00	0.67
43	600809	山西汾酒	225280	41,498,828.80	0.66
44	600795	国电电力	8869432	40,621,998.56	0.65
45	002241	歌尔股份	1560100	40,266,181.00	0.64
46	600219	南山铝业	10132100	39,616,511.00	0.63
47	600887	伊利股份	1312554	39,612,879.72	0.63
48	300433	蓝思科技	1785100	39,093,690.00	0.63
49	600690	海尔智家	1343100	38,238,057.00	0.61
50	601633	长城汽车	1445938	38,071,547.54	0.61
51	603259	药明康德	643798	35,434,641.92	0.57
52	002028	思源电气	486205	35,347,103.50	0.57
53	601600	中国铝业	4795700	35,248,395.00	0.56
54	689009	九号公司	733200	34,827,000.00	0.56
55	601668	中国建筑	5786969	34,721,814.00	0.56
56	601288	农业银行	6469900	34,549,266.00	0.55
57	601816	京沪高铁	5505800	33,915,728.00	0.54
58	600038	中直股份	872200	33,632,032.00	0.54
59	688111	金山办公	115119	32,968,930.41	0.53
60	601555	东吴证券	4219307	32,910,594.60	0.53
61	688012	中微公司	173600	32,838,176.00	0.53
62	000001	平安银行	2804000	32,806,800.00	0.53
63	601319	中国人保	4301370	32,776,439.40	0.52
64	300274	阳光电源	440500	32,522,115.00	0.52
65	601138	工业富联	1500008	32,250,172.00	0.52
66	300502	新易盛	274200	31,692,036.00	0.51
67	603993	洛阳钼业	4665100	31,022,915.00	0.50
68	600406	国电南瑞	1226700	30,937,374.00	0.50
69	600089	特变电工	2372630	30,227,306.20	0.48
70	600482	中国动力	1222400	29,912,128.00	0.48
71	601211	国泰君安	1596322	29,771,405.30	0.48
72	002027	分众传媒	4181000	29,392,430.00	0.47
73	688981	中芯国际	309300	29,265,966.00	0.47
74	300002	神州泰岳	2468700	28,612,233.00	0.46
75	603986	兆易创新	267110	28,527,348.00	0.46
76	605117	德业股份	328500	27,856,800.00	0.45
77	300760	迈瑞医疗	109100	27,820,500.00	0.45

78	000050	深天马 A	3008100	27,163,143.00	0.43
79	002180	纳思达	938389	26,434,418.13	0.42
80	600016	民生银行	6260409	25,855,489.17	0.41
81	601229	上海银行	2785093	25,483,600.95	0.41
82	600938	中国海油	821500	24,242,465.00	0.39
83	002273	水晶光电	1068000	23,730,960.00	0.38
84	688008	澜起科技	347800	23,615,620.00	0.38
85	601398	工商银行	3389000	23,451,880.00	0.38
86	601006	大秦铁路	3386000	22,957,080.00	0.37
87	000975	山金国际	1445000	22,209,650.00	0.36
88	000776	广发证券	1327500	21,518,775.00	0.34
89	600941	中国移动	181200	21,410,592.00	0.34
90	000568	泸州老窖	170040	21,289,008.00	0.34
91	300394	天孚通信	230820	21,087,715.20	0.34
92	600339	中油工程	5628100	20,148,598.00	0.32
93	688506	百利天恒	104951	20,122,255.23	0.32
94	300529	健帆生物	685800	20,121,372.00	0.32
95	601766	中国中车	2356745	19,749,523.10	0.32
96	600150	中国船舶	542000	19,490,320.00	0.31
97	603893	瑞芯微	176500	19,425,590.00	0.31
98	601881	中国银河	1245300	18,965,919.00	0.30
99	600875	东方电气	1168856	18,573,121.84	0.30
100	000977	浪潮信息	357900	18,567,852.00	0.30
101	601989	中国重工	3688000	17,739,280.00	0.28
102	600048	保利发展	1973000	17,480,780.00	0.28
103	600011	华能国际	2571600	17,409,732.00	0.28
104	600096	云天化	778900	17,369,470.00	0.28
105	002916	深南电路	137800	17,225,000.00	0.28
106	600299	安迪苏	1367200	17,158,360.00	0.27
107	601916	浙商银行	5748160	16,727,145.60	0.27
108	603799	华友钴业	570900	16,704,534.00	0.27
109	000651	格力电器	359055	16,319,049.75	0.26
110	600436	片仔癀	75351	16,162,789.50	0.26
111	000895	双汇发展	604900	15,703,204.00	0.25
112	000938	紫光股份	561500	15,626,545.00	0.25
113	002736	国信证券	1389980	15,567,776.00	0.25
114	001979	招商蛇口	1493000	15,288,320.00	0.24
115	300628	亿联网络	392800	15,162,080.00	0.24
116	300033	同花顺	52022	14,956,325.00	0.24
117	601117	中国化学	1788800	14,829,152.00	0.24
118	002468	申通快递	1432700	14,513,251.00	0.23
119	600018	上港集团	2365600	14,477,472.00	0.23
120	002463	沪电股份	363500	14,412,775.00	0.23

121	600066	宇通客车	543900	14,348,082.00	0.23
122	300674	宇信科技	726400	14,179,328.00	0.23
123	300661	圣邦股份	172100	14,074,338.00	0.23
124	600583	海油工程	2534300	13,862,621.00	0.22
125	000090	天健集团	3272092	13,448,298.12	0.22
126	002707	众信旅游	1795300	13,267,267.00	0.21
127	601336	新华保险	265300	13,185,410.00	0.21
128	601628	中国人寿	307800	12,902,976.00	0.21
129	601868	中国能建	5567900	12,750,491.00	0.20
130	601168	西部矿业	770200	12,377,114.00	0.20
131	300896	爱美客	66649	12,163,442.50	0.19
132	002179	中航光电	290440	11,414,292.00	0.18
133	603806	福斯特	756100	11,190,280.00	0.18
134	002920	德赛西威	100900	11,110,099.00	0.18
135	600061	国投资本	1471200	11,063,424.00	0.18
136	600266	城建发展	2166000	11,046,600.00	0.18
137	300724	捷佳伟创	172900	10,929,009.00	0.18
138	600663	陆家嘴	1110400	10,926,336.00	0.17
139	002414	高德红外	1445500	10,740,065.00	0.17
140	600196	复星医药	422400	10,496,640.00	0.17
141	601126	四方股份	589500	9,997,920.00	0.16
142	600309	万华化学	139100	9,924,785.00	0.16
143	002340	格林美	1497800	9,780,634.00	0.16
144	688120	华海清科	59900	9,763,101.00	0.16
145	300124	汇川技术	163426	9,573,495.08	0.15
146	600216	浙江医药	574100	9,105,226.00	0.15
147	000039	中集集团	1116200	8,672,874.00	0.14
148	002142	宁波银行	353420	8,591,640.20	0.14
149	688099	晶晨股份	123360	8,472,364.80	0.14
150	000957	中通客车	763500	8,398,500.00	0.13
151	002311	海大集团	171100	8,392,455.00	0.13
152	601399	国机重装	2662300	8,199,884.00	0.13
153	688256	寒武纪	12100	7,961,800.00	0.13
154	688538	和辉光电	3332200	7,730,704.00	0.12
155	601567	三星医疗	240200	7,388,552.00	0.12
156	601088	中国神华	169700	7,378,556.00	0.12
157	600660	福耀玻璃	118000	7,363,200.00	0.12
158	601888	中国中免	105477	7,068,013.77	0.11
159	688578	艾力斯	117072	7,012,612.80	0.11
160	688798	艾为电子	98020	6,843,756.40	0.11
161	001339	智微智能	186000	6,805,740.00	0.11
162	688019	安集科技	48700	6,786,832.00	0.11
163	600021	上海电力	724800	6,646,416.00	0.11

164	603129	春风动力	41903	6,581,704.21	0.11
165	603606	东方电缆	124300	6,531,965.00	0.10
166	300972	万辰集团	81200	6,529,292.00	0.10
167	002938	鹏鼎控股	177500	6,475,200.00	0.10
168	002371	北方华创	16120	6,302,920.00	0.10
169	601988	中国银行	1134700	6,252,197.00	0.10
170	688187	时代电气	120900	5,793,528.00	0.09
171	000423	东阿阿胶	91700	5,751,424.00	0.09
172	603195	公牛集团	81800	5,745,632.00	0.09
173	002550	千红制药	923100	5,723,220.00	0.09
174	688122	西部超导	131300	5,622,266.00	0.09
175	000338	潍柴动力	401100	5,495,070.00	0.09
176	600268	国电南自	815772	5,481,987.84	0.09
177	603288	海天味业	119200	5,471,280.00	0.09
178	601618	中国中冶	1528500	5,044,050.00	0.08
179	000683	远兴能源	882200	4,931,498.00	0.08
180	603595	东尼电子	285200	4,874,068.00	0.08
181	002415	海康威视	152108	4,669,715.60	0.07
182	601877	正泰电器	192700	4,511,107.00	0.07
183	300408	三环集团	116200	4,474,862.00	0.07
184	600919	江苏银行	452937	4,447,841.34	0.07
185	002230	科大讯飞	91300	4,411,616.00	0.07
186	688095	福昕软件	64500	4,331,820.00	0.07
187	603392	万泰生物	60900	4,291,014.00	0.07
188	300015	爱尔眼科	300300	3,978,975.00	0.06
189	603929	亚翔集成	142300	3,945,979.00	0.06
190	600233	圆通速递	271700	3,855,423.00	0.06
191	300014	亿纬锂能	79919	3,735,414.06	0.06
192	601179	中国西电	474800	3,603,732.00	0.06
193	001286	陕西能源	367400	3,409,472.00	0.05
194	002881	美格智能	110900	3,322,564.00	0.05
195	600861	北京人力	160800	3,111,480.00	0.05
196	300604	长川科技	69000	3,044,970.00	0.05
197	601998	中信银行	423600	2,956,728.00	0.05
198	600489	中金黄金	242200	2,913,666.00	0.05
199	688082	盛美上海	29000	2,900,000.00	0.05
200	600487	亨通光电	160400	2,762,088.00	0.04
201	300366	创意信息	294200	2,736,060.00	0.04
202	000708	中信特钢	238370	2,719,801.70	0.04
203	600916	中国黄金	301100	2,595,482.00	0.04
204	688321	微芯生物	133200	2,474,856.00	0.04
205	300866	安克创新	25000	2,441,000.00	0.04
206	688469	芯联集成	465421	2,387,609.73	0.04

207	002128	电投能源	115900	2,269,322.00	0.04
208	688336	三生国健	105800	2,266,236.00	0.04
209	688234	天岳先进	41408	2,120,089.60	0.03
210	002271	东方雨虹	163000	2,115,740.00	0.03
211	688131	皓元医药	59200	2,113,440.00	0.03
212	600649	城投控股	472200	2,101,290.00	0.03
213	688658	悦康药业	143200	2,063,512.00	0.03
214	002410	广联达	157900	1,856,904.00	0.03
215	000400	许继电气	66800	1,839,004.00	0.03
216	301327	华宝新能	23600	1,810,356.00	0.03
217	300759	康龙化成	64100	1,647,370.00	0.03
218	688200	华峰测控	15500	1,619,750.00	0.03
219	300726	宏达电子	46800	1,455,480.00	0.02
220	601390	中国中铁	209100	1,336,149.00	0.02
221	688362	甬矽电子	39000	1,313,520.00	0.02
222	600578	京能电力	325300	1,145,056.00	0.02
223	601012	隆基绿能	71500	1,123,265.00	0.02
224	601111	中国国航	137100	1,084,461.00	0.02
225	600210	紫江企业	148200	979,602.00	0.02
226	600183	生益科技	39550	951,177.50	0.02
227	000063	中兴通讯	22600	913,040.00	0.01
228	600600	青岛啤酒	10800	873,936.00	0.01
229	601669	中国电建	151300	826,098.00	0.01
230	002167	东方锆业	111900	821,346.00	0.01
231	601009	南京银行	76698	816,833.70	0.01
232	603296	华勤技术	10600	752,070.00	0.01
233	600256	广汇能源	108100	727,513.00	0.01
234	600988	赤峰黄金	44600	696,206.00	0.01
235	600438	通威股份	31100	687,621.00	0.01
236	300684	中石科技	30600	686,358.00	0.01
237	000807	云铝股份	48100	650,793.00	0.01
238	601607	上海医药	30700	644,700.00	0.01
239	600023	浙能电力	98600	558,076.00	0.01
240	300001	特锐德	25000	548,750.00	0.01
241	002459	晶澳科技	39300	540,375.00	0.01
242	000100	TCL 科技	101000	508,030.00	0.01
243	603019	中科曙光	6700	484,544.00	0.01
244	002050	三花智控	20600	484,306.00	0.01
245	000425	徐工机械	60900	482,937.00	0.01
246	600845	宝信软件	15300	447,678.00	0.01
247	688515	裕太微	4500	445,500.00	0.01
248	688372	伟测科技	7400	433,048.00	0.01
249	000596	古井贡酒	2450	424,585.00	0.01

250	601898	中煤能源	34401	419,004.18	0.01
251	600521	华海药业	20700	369,909.00	0.01
252	600989	宝丰能源	20800	350,272.00	0.01
253	002648	卫星化学	18200	341,978.00	0.01
254	603596	伯特利	7500	334,425.00	0.01
255	601689	拓普集团	6800	333,200.00	0.01
256	688223	晶科能源	45800	325,638.00	0.01
257	300475	香农芯创	11300	321,937.00	0.01
258	688348	昱能科技	6500	317,200.00	0.01
259	600007	中国国贸	12900	315,534.00	0.01
260	688591	泰凌微	10000	314,000.00	0.01
261	002517	恺英网络	22600	307,586.00	0.00
262	000877	天山股份	54300	307,338.00	0.00
263	600104	上汽集团	14200	294,792.00	0.00
264	603162	海通发展	31800	292,560.00	0.00
265	002236	大华股份	17800	284,800.00	0.00
266	300763	锦浪科技	4600	280,922.00	0.00
267	600745	闻泰科技	7100	275,338.00	0.00
268	600665	天地源	87700	274,501.00	0.00
269	301050	雷电微力	4900	252,742.00	0.00
270	603236	移远通信	3500	239,540.00	0.00
271	300476	胜宏科技	5600	235,704.00	0.00
272	300454	深信服	4000	229,600.00	0.00
273	300496	中科创达	3800	226,328.00	0.00
274	600415	小商品城	16400	219,924.00	0.00
275	301236	软通动力	3700	217,227.00	0.00
276	603173	福斯达	8800	202,840.00	0.00
277	300054	鼎龙股份	7300	189,946.00	0.00
278	688066	航天宏图	9300	189,720.00	0.00
279	688343	云天励飞	3800	188,480.00	0.00
280	300573	兴齐眼药	2600	181,428.00	0.00
281	688088	虹软科技	4700	181,232.00	0.00
282	002384	东山精密	6100	178,120.00	0.00
283	000560	我爱我家	58300	177,815.00	0.00
284	002625	光启技术	3700	176,860.00	0.00
285	600968	海油发展	40000	170,800.00	0.00
286	600642	申能股份	17200	163,228.00	0.00
287	688009	中国通号	25800	161,508.00	0.00
288	600428	中远海特	21800	159,140.00	0.00
289	600027	华电国际	28000	157,080.00	0.00
290	002138	顺络电子	4900	154,252.00	0.00
291	601360	三六零	14000	144,900.00	0.00
292	301165	锐捷网络	2000	144,400.00	0.00

293	688668	鼎通科技	3000	140,580.00	0.00
294	300244	迪安诊断	12200	138,470.00	0.00
295	688588	凌志软件	9800	135,240.00	0.00
296	000625	长安汽车	9930	132,664.80	0.00
297	600380	健康元	10600	119,462.00	0.00
298	688007	光峰科技	7900	116,841.00	0.00
299	000792	盐湖股份	7050	116,043.00	0.00
300	688233	神工股份	4800	112,560.00	0.00
301	603341	龙旗科技	2400	112,200.00	0.00
302	000768	中航西飞	3200	90,368.00	0.00
303	300705	九典制药	4900	87,955.00	0.00
304	002970	锐明技术	1800	85,734.00	0.00
305	600188	兖矿能源	5990	84,878.30	0.00
306	300777	中简科技	3000	84,870.00	0.00
307	600584	长电科技	2000	81,720.00	0.00
308	600028	中国石化	11300	75,484.00	0.00
309	300144	宋城演艺	8100	75,249.00	0.00
310	601061	中信金属	10100	73,326.00	0.00
311	688195	腾景科技	1800	72,324.00	0.00
312	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
313	600420	国药现代	5200	62,088.00	0.00
314	688158	优刻得	4300	60,114.00	0.00
315	688392	骄成超声	1200	48,960.00	0.00
316	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
317	688005	容百科技	1500	47,325.00	0.00
318	600079	人福医药	2000	46,760.00	0.00
319	301205	联特科技	600	45,414.00	0.00
320	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
321	688516	奥特维	1000	43,310.00	0.00
322	600684	珠江股份	12600	41,580.00	0.00
323	688449	联芸科技	1406	41,392.64	0.00
324	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
325	000729	燕京啤酒	2900	34,916.00	0.00
326	300976	达瑞电子	500	34,250.00	0.00
327	300136	信维通信	1300	33,072.00	0.00
328	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
329	001391	国货航	4686	31,864.80	0.00
330	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
331	603072	天和磁材	2255	27,736.50	0.00
332	603766	隆鑫通用	2900	26,390.00	0.00
333	688750	金天钛业	1685	26,016.40	0.00
334	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
335	300232	洲明科技	2700	18,549.00	0.00

336	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
337	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
338	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
339	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
340	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
341	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
342	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
343	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
344	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
345	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
346	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
347	688248	南网科技	300	9,627.00	0.00
348	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
349	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
350	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
351	300418	昆仑万维	200	7,696.00	0.00
352	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
353	600570	恒生电子	200	5,598.00	0.00
354	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
355	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
356	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
357	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
358	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
359	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
360	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	177,985,207.44	3.07
2	600519	贵州茅台	127,210,522.80	2.19
3	002594	比亚迪	105,038,803.20	1.81
4	601919	中远海控	105,037,011.20	1.81
5	000725	京东方 A	101,967,943.50	1.76
6	601989	中国重工	101,147,189.28	1.74
7	300274	阳光电源	100,348,091.77	1.73
8	605499	东鹏饮料	93,843,007.32	1.62
9	000625	长安汽车	91,586,458.47	1.58
10	601899	紫金矿业	91,228,731.95	1.57
11	300059	东方财富	91,065,358.24	1.57
12	600089	特变电工	90,627,809.76	1.56
13	603259	药明康德	87,984,341.40	1.52

14	000001	平安银行	87,225,407.00	1.50
15	002475	立讯精密	84,749,745.00	1.46
16	600219	南山铝业	82,158,595.00	1.42
17	600150	中国船舶	79,252,530.04	1.37
18	002714	牧原股份	79,046,547.68	1.36
19	600030	中信证券	79,042,762.59	1.36
20	600795	国电电力	77,299,479.12	1.33

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	140,057,650.32	2.41
2	600309	万华化学	114,813,885.48	1.98
3	300059	东方财富	113,244,507.89	1.95
4	600519	贵州茅台	113,152,819.35	1.95
5	002371	北方华创	112,268,498.00	1.93
6	300274	阳光电源	111,683,943.20	1.92
7	002594	比亚迪	110,241,626.61	1.90
8	000725	京东方 A	107,759,588.00	1.86
9	601989	中国重工	100,750,836.80	1.74
10	300760	迈瑞医疗	100,721,937.21	1.74
11	300750	宁德时代	99,614,698.01	1.72
12	000625	长安汽车	95,905,946.78	1.65
13	600276	恒瑞医药	95,853,292.26	1.65
14	000651	格力电器	95,352,815.09	1.64
15	600028	中国石化	87,898,411.23	1.51
16	601919	中远海控	87,458,537.30	1.51
17	600919	江苏银行	86,876,732.16	1.50
18	601318	中国平安	85,753,047.11	1.48
19	002415	海康威视	85,550,517.95	1.47
20	600048	保利发展	83,576,962.41	1.44

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,892,309,539.79
卖出股票的收入（成交）总额	11,330,542,862.65

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绵阳市分局、国家金融监督管理总局福建监管局、天津市市场监督管理委员会的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绍兴市分局、国家外汇管理局贵州省分局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局河南监管局、惠州仲恺高新区市场监督管理局的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到大同市云冈区住房和城乡建设局、中国人民银行湖北省分行、国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局湖北监管局的处罚。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。

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

本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 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	416,667.85
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,192,773.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	5,609,441.82
---	----	--------------

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	233245	12,867.15	229,757,693.13	7.66%	2,771,441,732.55	92.34%
博时沪深 300 指数 C	88056	9,044.97	66,253,598.92	8.32%	730,210,406.51	91.68%
博时沪深 300 指数 R	-	-	-	-	-	-
博时沪深 300 指数 Y	194	3,690.94	-	-	716,042.11	100.00%
合计	318596	11,922.24	296,011,292.05	7.79%	3,502,368,181.17	92.21%

9.2 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	802,152.05	0.03%
	博时沪深 300 指数 C	325,804.75	0.04%
	博时沪深 300 指数 R	-	-
	博时沪深 300 指数 Y	6.62	0.00%
	合计	1,127,963.42	0.03%

9.3 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	10~50
	博时沪深 300 指数 C	-
	博时沪深 300 指数 R	-

本基金基金经理持有本开放式基金	博时沪深 300 指数 Y	-
	合计	10~50
	博时沪深 300 指数 A	-
	博时沪深 300 指数 C	-
	博时沪深 300 指数 R	-
	博时沪深 300 指数 Y	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§10 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	博时沪深 300 指数 Y
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	2,991,771,032.05	1,091,549,777.46	-	-
本报告期基金总申购份额	615,679,841.64	771,472,453.68	-	716,042.11
减：本报告期基金总赎回份额	606,251,448.01	1,066,558,225.71	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	3,001,199,425.68	796,464,005.43	-	716,042.11

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2024 年 4 月 13 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》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 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》，张东先生任公司总经理。

基金管理人于 2024 年 12 月 7 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》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 90000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信建投	5	5,022,846,128.90	22.61%	3,628,075.19	30.67%	增加 1 个
中信证券	5	2,000,376,410.74	9.00%	1,566,104.19	13.24%	-
东方证券	3	1,764,081,811.03	7.94%	626,683.15	5.30%	-
兴业证券	3	1,740,375,418.59	7.83%	913,238.01	7.72%	-
国金证券	1	1,043,128,776.20	4.69%	214,879.75	1.82%	-
天风证券	2	986,949,787.73	4.44%	353,146.15	2.99%	-
长江证券	2	907,984,387.09	4.09%	526,935.04	4.45%	-
方正证券	3	876,401,648.44	3.94%	180,452.26	1.53%	-

浙商证券	1	838,166,238.13	3.77%	172,564.37	1.46%	增加 1 个
中泰证券	3	834,811,189.17	3.76%	171,920.79	1.45%	-
国信证券	1	793,667,315.31	3.57%	163,695.14	1.38%	-
西部证券	2	789,411,278.40	3.55%	162,545.36	1.37%	-
财达证券	1	764,316,260.71	3.44%	570,101.46	4.82%	-
国盛证券	2	665,785,342.33	3.00%	496,613.62	4.20%	-
国泰君安	3	517,226,649.22	2.33%	309,837.90	2.62%	-
民生证券	1	513,857,533.44	2.31%	383,564.07	3.24%	-
东方财富证券	4	509,701,734.81	2.29%	380,185.97	3.21%	-
华创证券	4	337,997,294.00	1.52%	252,109.78	2.13%	-
华泰证券	2	332,707,302.68	1.50%	68,505.78	0.58%	-
银河证券	1	254,360,154.38	1.14%	240,602.53	2.03%	-
申万宏源	2	235,107,578.85	1.06%	48,399.64	0.41%	增加 1 个
广发证券	2	194,885,451.48	0.88%	145,366.41	1.23%	-
中金公司	1	173,085,912.98	0.78%	163,724.85	1.38%	-
招商证券	4	89,205,775.52	0.40%	84,379.70	0.71%	-
平安证券	2	32,160,075.36	0.14%	6,621.91	0.06%	减少 1 个
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	增加 1 个
东吴证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
诚通证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

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

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务;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。

11.7.2 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下 193 只基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-27
2	关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 Y 类基金份额开通直销网上交易定期投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-17
3	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 Y 类基金份额开放日常申购、赎回、转换和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	2024-12-13
4	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	2024-12-13
5	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 Y）基金产品资料概要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-13
6	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-12
7	博时基金管理有限公司关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金增加 Y 类基金份额以及相应修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-12
8	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	2024-12-12

9	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	2024-12-07
10	博时基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-18
11	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	2024-11-14
12	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-20241106	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-06
13	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 年第 3 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	2024-10-25
14	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	2024-09-30
15	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-20240925	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-25
16	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-21
17	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-30
18	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-23
19	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展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	2024-08-22
20	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换等业务费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-17
21	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收付服务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	2024-07-20
22	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 年第 2 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	2024-07-19
23	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	2024-06-26

		子披露网站	
24	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	2024-06-26
25	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	2024-06-06
26	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	2024-05-25
27	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
28	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京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	2024-04-29
29	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海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	2024-04-29
30	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 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	2024-04-22
31	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	2024-04-13
32	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2023 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	2024-03-29
33	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2023 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	2024-01-22

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日