

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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：二〇二五年八月二十九日

§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 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56

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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§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	3,486,953,770.56 份				
基金合同存续期	不定期				
下属分级基金的基金简称	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
下属分级基金的交易代码	050002	002385	960022	022922	024186
报告期末下属分级基金的份额总额	2,815,897,776.76 份	667,186,350.97 份	-份	3,837,768.30 份	31,874.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95% 以上，并保持年跟踪误差在 4% 以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。即调整其股票资产比例为 95% 以内，现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于 5%。 1. 资产配置原则 本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨，采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，再进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例，以完全复制的方法进行组合构建。 2. 资产配置策略 本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。 3. 股票资产配置策略 本基金股票资产投资以沪深 300 指数为标的指数，原则上采用完全复制标的指数的方法，首先按照标的指数中的行业权重为基准权重，确定行业配置比例；再进一步根据各行业中的个股基准权重，确定行业内的个股配置比例。本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 4. 投资组合调整原则 本基金的股票投资为完全复制的被动式指数投资，债券投资为流动性风险约束下的被动式投资，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比

	例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	95%的沪深 300 指数加 5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	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（2025 年 1 月 1 日至 2025 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	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
本期已实现收益	230,968,781.05	55,221,239.17	-	247,806.00	882.15

本期利润	155,997,105.51	38,342,061.29	-	283,623.76	1,307.00
加权平均基金份额本期利润	0.0529	0.0499	-	0.1025	0.0528
本期加权平均净值利润率	3.24%	3.13%	-	6.27%	3.19%
本期基金份额净值增长率	3.32%	3.11%	-	3.62%	5.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 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	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
期末可供分配利润	1,938,260,110.90	411,773,942.33	-	2,657,942.73	21,895.42
期末可供分配基金份额利润	0.6883	0.6172	-	0.6926	0.6869
期末基金资产净值	4,754,157,887.66	1,100,238,718.10	-	6,495,711.03	53,769.95
期末基金份额净值	1.6883	1.6491	-	1.6926	1.6869
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 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	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
基金份额累计净值增长率	458.91%	74.06%	1.76%	3.69%	5.43%

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	3.29%	0.57%	2.37%	0.55%	0.92%	0.02%
过去三个月	2.61%	1.10%	1.21%	1.04%	1.40%	0.06%
过去六个月	3.32%	1.00%	0.07%	0.97%	3.25%	0.03%
过去一年	16.57%	1.33%	13.12%	1.32%	3.45%	0.01%
过去三年	-4.17%	1.04%	-11.43%	1.05%	7.26%	-0.01%
自基金合同生效起至今	458.91%	1.48%	211.00%	1.48%	247.91%	0.00%

博时沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.26%	0.57%	2.37%	0.55%	0.89%	0.02%

过去三个月	2.51%	1.10%	1.21%	1.04%	1.30%	0.06%
过去六个月	3.11%	1.00%	0.07%	0.97%	3.04%	0.03%
过去一年	16.11%	1.33%	13.12%	1.32%	2.99%	0.01%
过去三年	-5.31%	1.04%	-11.43%	1.05%	6.12%	-0.01%
自基金合同生效起至今	74.06%	1.12%	33.25%	1.11%	40.81%	0.01%

注：自 2016 年 1 月 27 日起，本基金新增 C 类份额。

博时沪深 300 指数 R

阶段	份额净值增长率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。

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
过去一个月	3.35%	0.57%	2.37%	0.55%	0.98%	0.02%
过去三个月	2.76%	1.10%	1.21%	1.04%	1.55%	0.06%
过去六个月	3.62%	1.00%	0.07%	0.97%	3.55%	0.03%
自基金合同生效起至今	3.69%	0.97%	0.11%	0.94%	3.58%	0.03%

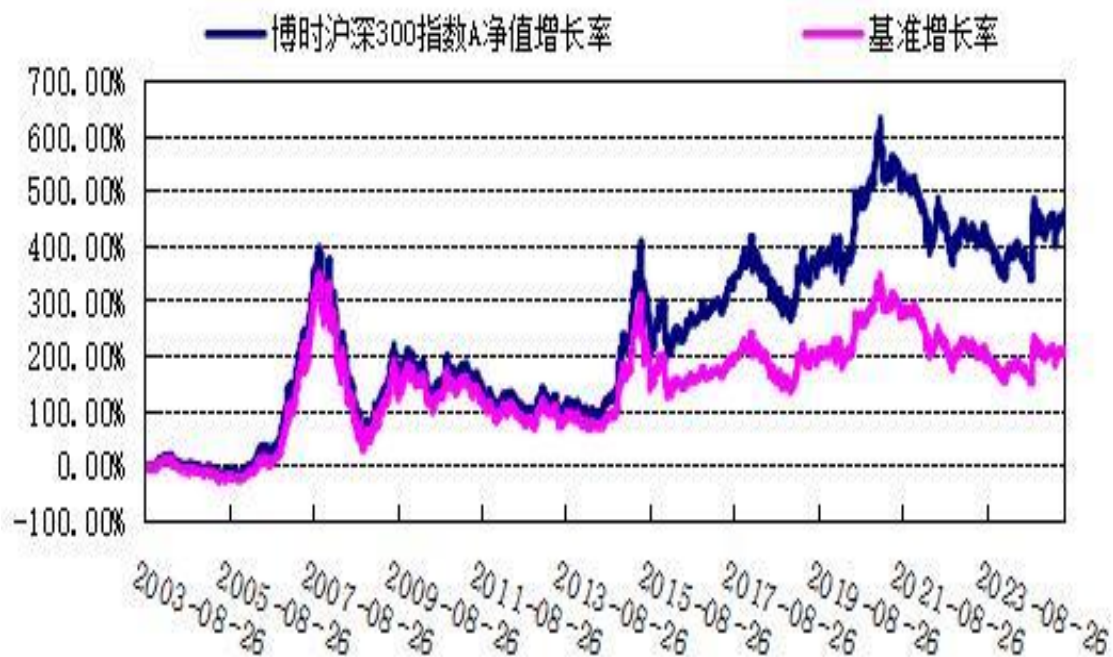
博时沪深 300 指数 I

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	3.29%	0.57%	2.37%	0.55%	0.92%	0.02%
自基金合同生效起至今	5.43%	0.59%	4.05%	0.58%	1.38%	0.01%

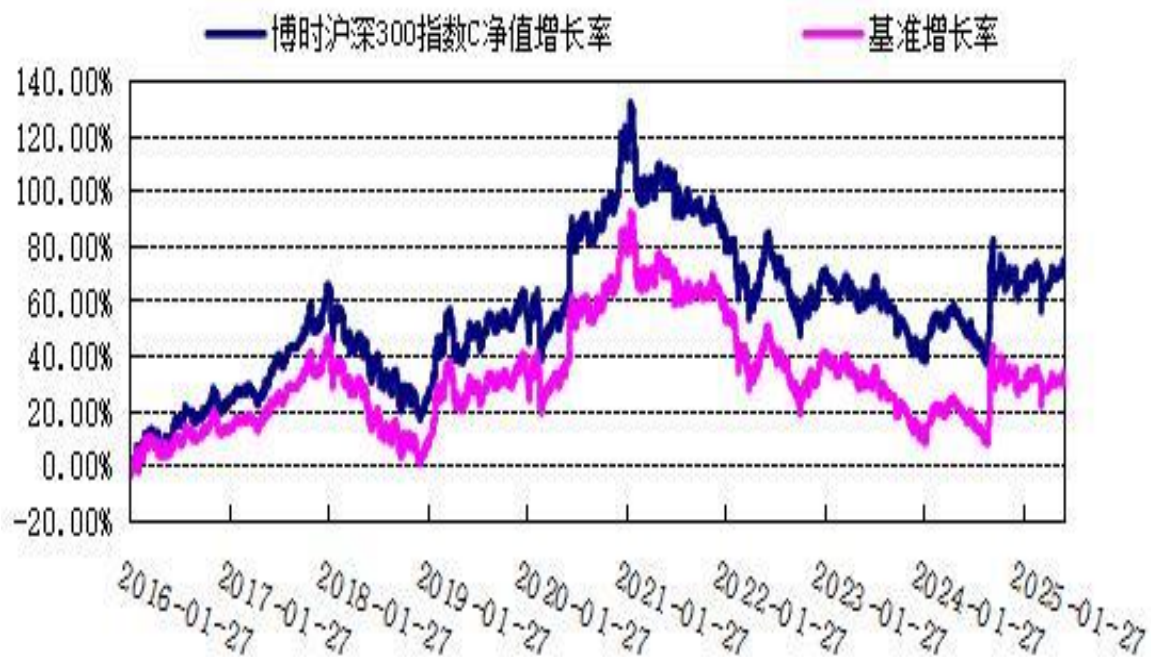
注：自基金成立至 2004 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为新华富时 A200 复合指数；自 2005 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为 95% 的新华富时中国 A200 指数 + 5% 的银行同业存款利率；自 2008 年 1 月 1 日起，本基金业绩比较基准为 95% 的沪深 300 指数 + 5% 的银行同业存款利率。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

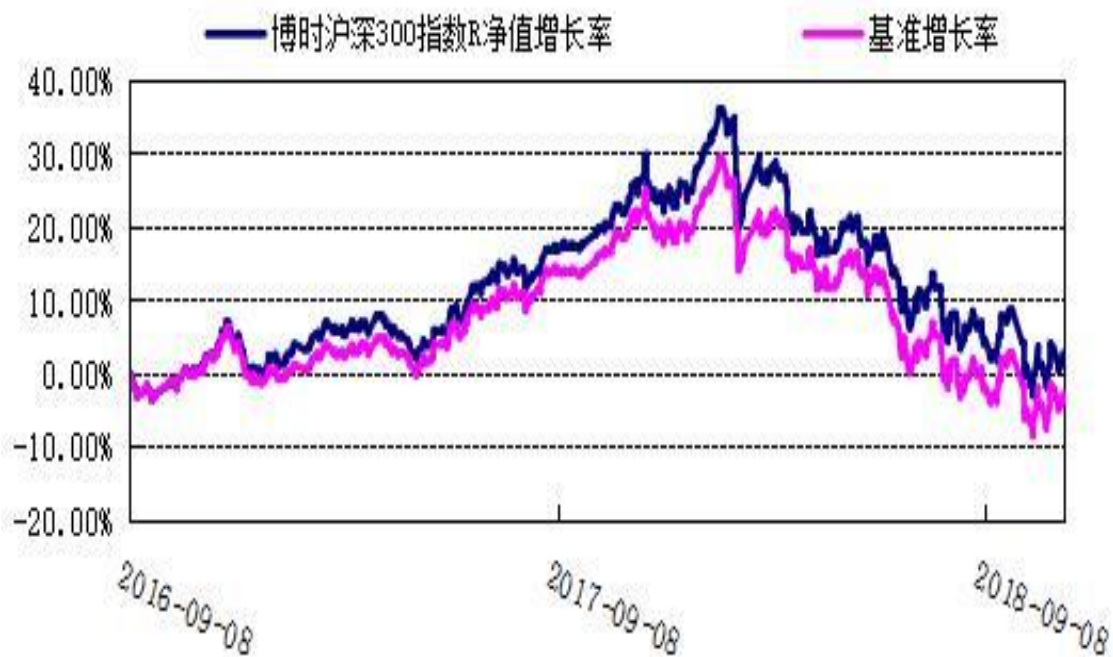
博时沪深 300 指数 A



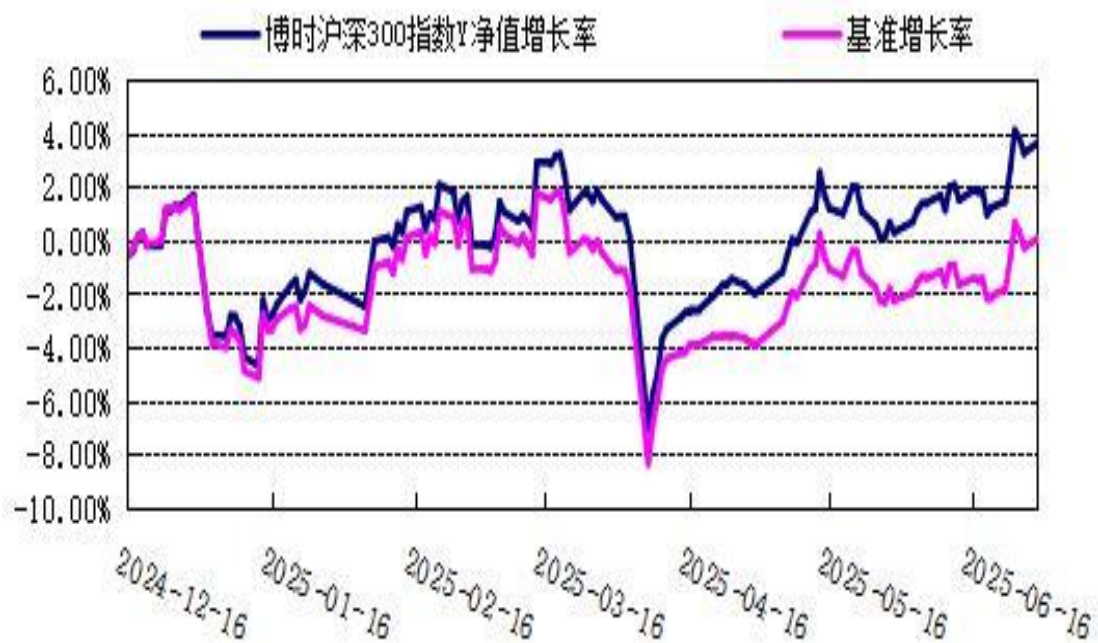
博时沪深 300 指数 C



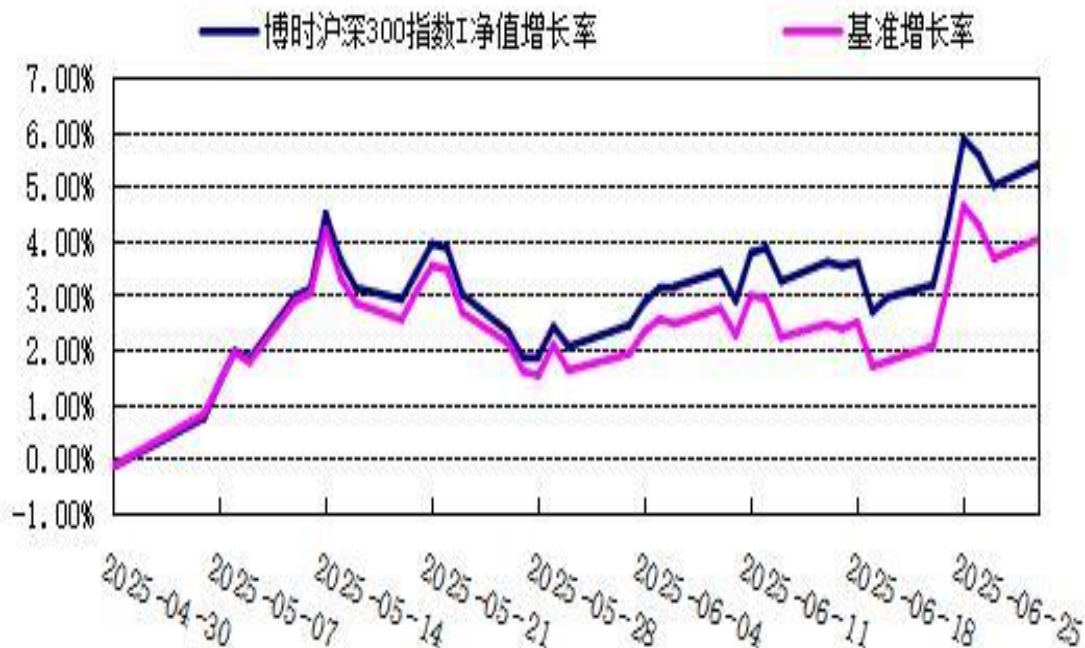
博时沪深 300 指数 R



博时沪深 300 指数 Y



博时沪深 300 指数 I



§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”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 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。

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	-	11.8	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、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)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 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	-	15.8	桂征辉先生，硕士。2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理、博时富

				时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2020 年 12 月 23 日)、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)、博时中证 A50 指数型发起式证券投资基金(2024 年 8 月 27 日-2025 年 5 月 29 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—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 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2025 年 5 月 30 日—至今)的基金经理，兼任投资经理。
--	--	--	--	---

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
桂征辉	公募基金	6	7,132,621,287.02	2015-07-21
	私募资产管理计划	2	1,909,997,765.84	2025-02-28
	其他组合	-	-	-
	合计	8	9,042,619,052.86	

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 23 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，市场经历了前期震荡后，后续持续稳健上行，市场风格表现分化较大，科技、小盘成长等主题风格相关资产占优，上证指数最终收于 3444 点左右。海外在关税争端逐渐落地之后，全球多数权益资产在前期调整后逐步回稳。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 2025 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.6883 元，份额累计净值为 3.7392 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.6491 元，份额累计净值为 1.6818 元，本基金 I 类基金份额净值为 1.6869 元，份额累计净值为 1.6869 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 1.6926 元，份额累计净值为 1.7096 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 3.32%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 3.11%，本基金 I 类基金份额净值增长率为 5.43%，本基金 Y 类基金份额净值增长率为 3.62%，本基金 A 类同期业绩基准增长率为 0.07%，本基金 C 类同期业绩基准增长率为 0.07%，本基金 I 类同期业绩基准增长率为 4.05%，本基金 Y 类同期业绩基准增长率为 0.07%。

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，出口保持了一定韧性；政策方面，宏观政策保持“实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策”，房地产在稳住楼市政策推动下逐渐企稳。在市场流动性整体充裕的环境下，小盘风格、高股息板块有望持续受益。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，在多重积极政策催化之下，宏观基本面有望逐渐触底回升，但同时仍然需要关注因为贸易冲突对于出口外需的影响。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

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2025 年 1 月 9 日发布公告，以 2024 年 12 月 31 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.1700 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.1450 元人民币，本基金 Y 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.1700 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	367,167,979.24	380,046,048.55
结算备付金		6,215,150.22	5,806,022.48
存出保证金		166,908.82	416,667.85
交易性金融资产	6.4.6.2	5,544,079,797.49	5,876,853,857.78
其中：股票投资		5,523,835,809.48	5,876,853,857.78
基金投资		-	-
债券投资		20,243,988.01	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		66,507,740.43	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,747,833.48	5,192,773.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		5,992,885,409.68	6,268,315,370.63

负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		32,312,815.38	368,739.23
应付赎回款		91,857,963.27	14,773,675.06
应付管理人报酬		4,798,616.05	5,218,207.57
应付托管费		979,309.45	1,064,940.31
应付销售服务费		390,002.96	437,304.04
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	6.4.6.6	1,600,615.83	1,629,055.12
负债合计		131,939,322.94	23,491,921.33
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	3,486,953,770.56	3,798,379,473.22
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	2,373,992,316.18	2,446,443,976.08
净资产合计		5,860,946,086.74	6,244,823,449.30
负债和净资产总计		5,992,885,409.68	6,268,315,370.63

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,486,953,770.56 份。其中 A 类基金份额净值 1.6883 元，基金份额总额 2,815,897,776.76 份；C 类基金份额净值 1.6491 元，基金份额总额 667,186,350.97 份；无 R 类基金份额；Y 类基金份额净值 1.6926 元，基金份额总额 3,837,768.30 份；I 类基金份额净值 1.6869 元，基金份额总额 31,874.53 份。

6.2 利润表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
一、营业总收入		232,505,399.52	191,059,979.14
1.利息收入		659,710.03	654,880.93
其中：存款利息收入	6.4.6.9	659,710.03	654,880.93
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		323,217,440.68	-83,543,553.35

其中：股票投资收益	6.4.6.10	248,800,886.29	-169,479,944.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	67,570.55	448,238.53
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	-	-
股利收益	6.4.6.14	74,348,983.84	85,488,152.54
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）	6.4.6.15	-91,814,610.81	273,678,652.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	442,859.62	269,998.69
减：二、营业总支出		37,881,301.96	38,724,109.50
1. 管理人报酬		29,340,531.69	29,418,452.20
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		5,987,863.64	6,003,765.79
3. 销售服务费		2,430,126.67	3,173,743.16
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	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		0.12	-
8. 其他费用	6.4.6.18	122,779.84	128,148.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		194,624,097.56	152,335,869.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		194,624,097.56	152,335,869.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		194,624,097.56	152,335,869.64

6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025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	3,798,379,473.22	-	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,798,379,473.22	-	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-311,425,702.66	-	-72,451,659.90	-383,877,362.56
（一）、综合收益总额	-	-	194,624,097.56	194,624,097.56
（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）	-311,425,702.66	-	-204,311,608.96	-515,737,311.62
其中：1.基金申购款	324,340,510.88	-	193,745,984.89	518,086,495.77
2.基金赎回款	-635,766,213.54	-	-398,057,593.85	-1,033,823,807.39
（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）	-	-	-62,764,148.50	-62,764,148.50
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,486,953,770.56	-	2,373,992,316.18	5,860,946,086.74
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	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）	34,847,282.62	-	159,427,092.94	194,274,375.56
（一）、综合收益总额	-	-	152,335,869.64	152,335,869.64
（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）	34,847,282.62	-	7,091,223.30	41,938,505.92
其中：1.基金申购款	565,389,010.47	-	249,614,153.26	815,003,163.73

2.基金赎回款	-530,541,727.85	-	-242,522,929.96	-773,064,657.81
(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	4,118,168,092.13	-	1,878,207,095.30	5,996,375,187.43

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：王德英，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 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”。

基金根据是否允许投资者通过个人养老金账户投资本基金、是否收取销售服务费、是否在中国内地市场销售将基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额、I 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；自 2025 年 4 月 29 日起增加 I 类基金份额。A 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；C 类/I 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；Y 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；R 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。

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： $95\% \times \text{沪深 300 指数} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 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。

6.4.4 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。

6.4.5 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	367,167,979.24
等于：本金	367,130,214.39
加：应计利息	37,764.85
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	367,167,979.24

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,221,974,302.28	-	5,523,835,809.48	301,861,507.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	19,991,959.70	253,988.01	20,243,988.01	-1,959.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	19,991,959.70	253,988.01	20,243,988.01	-1,959.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,241,966,261.98	253,988.01	5,544,079,797.49	301,859,547.50

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	199,201.74
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,041,290.33
其中：交易所市场	1,041,290.33
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	1,485.41
预提费用	108,638.35
合计	1,600,615.83

6.4.6.7 实收基金

博时沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	3,001,199,425.68	3,001,199,425.68
本期申购	151,990,452.41	151,990,452.41
本期赎回（以“-”号填列）	-337,292,101.33	-337,292,101.33
本期末	2,815,897,776.76	2,815,897,776.76

博时沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	796,464,005.43	796,464,005.43
本期申购	168,706,836.71	168,706,836.71
本期赎回（以“-”号填列）	-297,984,491.17	-297,984,491.17
本期末	667,186,350.97	667,186,350.97

博时沪深 300 指数 Y

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	716,042.11	716,042.11

本期申购	3,539,230.29	3,539,230.29
本期赎回（以“-”号填列）	-417,504.10	-417,504.10
本期末	3,837,768.30	3,837,768.30

博时沪深 300 指数 I

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
本期申购	103,991.47	103,991.47
本期赎回（以“-”号填列）	-72,116.94	-72,116.94
本期末	31,874.53	31,874.53

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)。

6.4.6.8 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	3,364,613,121.88	-1,408,051,151.57	1,956,561,970.31
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	3,364,613,121.88	-1,408,051,151.57	1,956,561,970.31
本期利润	230,968,781.05	-74,971,675.54	155,997,105.51
本期基金份额交易产生的变动数	-212,893,499.25	89,704,259.51	-123,189,239.74
其中：基金申购款	172,129,735.64	-79,105,365.62	93,024,370.02
基金赎回款	-385,023,234.89	168,809,625.13	-216,213,609.76
本期已分配利润	-51,109,725.18	-	-51,109,725.18
本期末	3,331,578,678.50	-1,393,318,567.60	1,938,260,110.90

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	444,097,322.31	45,318,422.73	489,415,745.04
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	444,097,322.31	45,318,422.73	489,415,745.04
本期利润	55,221,239.17	-16,879,177.88	38,342,061.29
本期基金份额交易产生的变动数	-75,914,075.22	-7,160,820.05	-83,074,895.27
其中：基金申购款	96,185,917.97	2,267,352.95	98,453,270.92
基金赎回款	-172,099,993.19	-9,428,173.00	-181,528,166.19
本期已分配利润	-11,630,543.93	-	-11,630,543.93
本期末	411,773,942.33	21,278,424.80	433,052,367.13

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	802,629.51	-336,368.78	466,260.73
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	802,629.51	-336,368.78	466,260.73
本期利润	247,806.00	35,817.76	283,623.76
本期基金份额交易产生的变动数	3,532,461.29	-1,600,523.66	1,931,937.63
其中：基金申购款	4,009,763.94	-1,808,781.29	2,200,982.65
基金赎回款	-477,302.65	208,257.63	-269,045.02
本期已分配利润	-23,879.39	-	-23,879.39
本期末	4,559,017.41	-1,901,074.68	2,657,942.73

博时沪深 300 指数 I

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	882.15	424.85	1,307.00
本期基金份额交易产生的变动数	36,783.05	-16,194.63	20,588.42
其中：基金申购款	119,611.67	-52,250.37	67,361.30
基金赎回款	-82,828.62	36,055.74	-46,772.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,665.20	-15,769.78	21,895.42

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	646,929.98
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	10,821.69
其他	1,958.36
合计	659,710.03

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	5,496,112,126.32
减：卖出股票成本总额	5,241,734,175.59
减：交易费用	5,577,064.44
买卖股票差价收入	248,800,886.29

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	34.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	67,536.05
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	67,570.55

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	363,386.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	295,800.00
减：应计利息总额	35.56
减：交易费用	14.51
买卖债券差价收入	67,536.05

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 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。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	74,348,983.84
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	74,348,983.84

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-91,814,610.81
——股票投资	-91,812,651.11
——债券投资	-1,959.70
——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	-91,814,610.81

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	349,333.83
基金转换费收入	93,525.79
合计	442,859.62

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	1,412.68
银行汇划费	8,228.81
中债登账户维护费	9,000.00

合计	122,779.84
----	------------

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	89,205,775.52	0.75%

6.4.9.1.2 权证交易

无。

6.4.9.1.3 债券交易

无。

6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	84,379.70	0.87%	84,379.70	1.61%

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。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	29,340,531.69	29,418,452.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,390,726.01	7,261,166.09
应支付基金管理人的净管理费	21,949,805.68	22,157,286.11

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、Y 类基金份额和 I 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、Y 类基金份额和 I 类基金份额约定的管理费年费率分别为 0.98%、0.98%、0.98%、0.49%和 0.98%。其计算公式为：

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

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,987,863.64	6,003,765.79

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、Y 类基金份额和 I 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、Y 类基金份额和 I 类基金份额约定的托管费年费率分别为 0.20%、0.20%、0.20%、0.10%和 0.20%。其计算公式为：

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

6.4.9.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I	合计
招商证券	-	995.28	-	-	-	995.28

博时基金	-	55,081.89	-	-	6.71	55,088.60
博时财富	-	195.54	-	-	-	195.54
合计	-	56,272.71	-	-	6.71	56,279.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间					
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I	合计
博时基金	-	433,488.38	-	-	-	433,488.38
招商证券	-	47.21	-	-	-	47.21
博时财富	-	26.97	-	-	-	26.97
合计	-	433,562.56	-	-	-	433,562.56

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额和 I 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，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额和 I 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40% 和 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C/I 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 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。

6.4.9.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	367,167,979.24	646,929.98	421,616,465.92	589,939.94

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。

6.4.9.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688692	达梦数据	网下发行	1,745.00	151,745.20

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

博时沪深 300 指数 A

单位：人民币元

序号	权益登记 日	除息日		每 10 份基 金份 额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合 计	备注
		场内	场外					
1	2025-01-13	-	2025-01-13	0.1700	31,351,516.27	19,758,208.91	51,109,725.18	-
合计				0.1700	31,351,516.27	19,758,208.91	51,109,725.18	-

博时沪深 300 指数 C

单位：人民币元

序号	权益登记 日	除息日		每 10 份基 金份 额分 红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合 计	备注
		场内	场外					
1	2025-01-13	-	2025-01-13	0.1450	8,196,353.97	3,434,189.96	11,630,543.93	-
合计				0.1450	8,196,353.97	3,434,189.96	11,630,543.93	-

博时沪深 300 指数 R

无。

博时沪深 300 指数 Y

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2025-01-13	-	2025-01-13	0.1700	-	23,879.39	23,879.39	-
合计				0.1700	-	23,879.39	23,879.39	-

博时沪深 300 指数 I

无。

6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券
6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	首次公开发行限售	47.27	124.16	573.00	27,085.71	71,143.68	-
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	首次公开发行限售	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	首次公开发行限售	46.50	42.85	724.00	33,666.00	31,023.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	首次公开发行限售	11.68	26.95	994.00	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崑电子	2025-01-02	6 个月	首次公开发行限售	10.40	34.11	701.00	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	首次公开发行限售	27.50	56.19	397.00	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	首次公开发行	25.80	79.68	227.00	5,855.50	18,087.36	-

				限售						
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	首次公开发行限售	12.80	44.54	382.00	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	首次公开发行限售	6.70	24.80	658.00	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	首次公开发行限售	27.49	45.22	350.00	9,620.72	15,827.00	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	首次公开发行限售	93.50	90.66	166.00	15,521.00	15,049.56	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	首次公开发行限售	29.93	77.87	182.00	5,447.00	14,172.34	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	首次公开发行限售	4.92	18.99	734.00	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	首次公开发行限售	9.08	25.94	536.00	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	5 个交易日	新股未上市	16.42	16.42	843.00	13,842.06	13,842.06	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	首次公开发行限售	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	首次公开发行限售	12.30	54.45	226.00	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	首次公开发行限售	26.60	82.50	143.00	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	首次公开发行限售	11.80	33.85	342.00	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	首次公开	5.30	14.44	709.00	3,757.70	10,237.96	-

				发行 限售						
301590	优优 绿能	2025-05-28	6 个 月	首次 公开 发行 限售	89.60	139.48	73.00	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航 新能	2025-03-26	6 个 月	首次 公开 发行 限售	11.80	22.98	437.00	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾 股份	2025-04-02	6 个 月	首次 公开 发行 限售	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦 科技	2025-05-09	6 个 月	首次 公开 发行 限售	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬 冠佳	2025-02-24	6 个 月	首次 公开 发行 限售	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚 电缆	2025-03-13	6 个 月	首次 公开 发行 限售	7.40	20.21	366.00	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高 血净	2025-05-12	6 个 月	首次 公开 发行 限售	26.50	32.68	205.00	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润 新能	2025-04-30	6 个 月	首次 公开 发行 限售	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力 科技	2025-05-12	6 个 月	首次 公开 发行 限售	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷 汽车	2025-04-17	6 个 月	首次 公开 发行 限售	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿 万立	2025-04-01	6 个 月	首次 公开 发行 限售	8.60	15.61	286.00	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰 新材	2025-03-04	6 个 月	首次 公开 发行 限售	20.60	35.08	126.00	2,595.60	4,420.08	-

603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	首次公开发行限售	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	首次公开发行限售	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	首次公开发行限售	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	首次公开发行限售	12.08	18.12	178.00	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	首次公开发行限售	20.52	37.47	78.00	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	首次公开发行限售	19.88	43.81	57.00	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	首次公开发行限售	11.50	22.39	105.00	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	首次公开发行限售	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	首次公开发行限售	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	首次公开发行限售	16.42	16.42	94.00	1,543.48	1,543.48	-

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。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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，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。

6.4.12.2.1 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 2025 年 6 月 30 日	上年末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,243,988.01	-
合计	20,243,988.01	-

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。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 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期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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	367,167,979.24	-	-	-	367,167,979.24
结算备付金	6,215,150.22	-	-	-	6,215,150.22
存出保证金	166,908.82	-	-	-	166,908.82
交易性金融资产	20,243,988.01	-	-	-5,523,835,809.48	5,544,079,797.49
应收清算款	-	-	-	66,507,740.43	66,507,740.43
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	8,747,833.48	8,747,833.48
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	393,794,026.29	-	-	-5,599,091,383.39	5,992,885,409.68
负债					
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	91,857,963.27	91,857,963.27
应付清算款	-	-	-	32,312,815.38	32,312,815.38
应付管理人报酬	-	-	-	4,798,616.05	4,798,616.05
应付托管费	-	-	-	979,309.45	979,309.45
应付销售服务费	-	-	-	390,002.96	390,002.96
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,600,615.83	1,600,615.83
负债总计	-	-	-	131,939,322.94	131,939,322.94
利率敏感度缺口	393,794,026.29	-	-	-5,467,152,060.45	5,860,946,086.74
上年度末 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

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。

6.4.12.4.1.2 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 0	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0	-

注：1.上年度末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债和可交换债)、资产支持证券投资 and 国债期货投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

2.以上金额为四舍五入的结果。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	5,523,835,809.48	94.25	5,876,853,857.78	94.11
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	5,523,835,809.48	94.25	5,876,853,857.78	94.11

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。

6.4.12.4.3.2 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 27,959	增加约 30,024
	业绩比较基准下降 5%	减少约 27,959	减少约 30,024

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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 2025年6月30日
第一层次	5,523,303,716.38
第二层次	20,259,373.55
第三层次	516,707.56
合计	5,544,079,797.49

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	5,523,835,809.48	92.17
	其中：股票	5,523,835,809.48	92.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,243,988.01	0.34
	其中：债券	20,243,988.01	0.34
	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	373,383,129.46	6.23
8	其他各项资产	75,422,482.73	1.26
9	合计	5,992,885,409.68	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	99,588,333.80	1.70
B	采矿业	223,988,738.47	3.82
C	制造业	2,788,627,944.81	47.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	144,101,209.48	2.46
E	建筑业	97,702,700.38	1.67
F	批发和零售业	25,762,955.36	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	158,319,898.90	2.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	267,005,594.84	4.56
J	金融业	1,488,815,374.65	25.40
K	房地产业	63,557,008.60	1.08
L	租赁和商务服务业	7,533,071.45	0.13
M	科学研究和技术服务业	85,323,609.90	1.46
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	45,288,771.84	0.77
R	文化、体育和娱乐业	28,220,597.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	5,523,835,809.48	94.25

7.2.2 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。

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	162,025	228,377,478.00	3.90
2	300750	宁德时代	731,392	184,471,690.24	3.15
3	600036	招商银行	3,295,400	151,423,630.00	2.58
4	000333	美的集团	1,552,173	112,066,890.60	1.91
5	601318	中国平安	1,978,392	109,761,188.16	1.87
6	000858	五粮液	778,100	92,516,090.00	1.58
7	600900	长江电力	2,979,990	89,816,898.60	1.53
8	002594	比亚迪	255,637	84,848,476.67	1.45
9	601288	农业银行	13,598,100	79,956,828.00	1.36
10	601328	交通银行	9,338,600	74,708,800.00	1.27
11	601211	国泰海通	3,838,994	73,555,125.04	1.26
12	603259	药明康德	1,036,338	72,077,307.90	1.23
13	000725	京东方 A	17,647,660	70,414,163.40	1.20
14	600031	三一重工	3,324,300	59,671,185.00	1.02
15	688041	海光信息	406,710	57,464,055.90	0.98
16	601766	中国中车	7,639,555	53,782,467.20	0.92
17	600690	海尔智家	2,156,600	53,440,548.00	0.91
18	601899	紫金矿业	2,735,816	53,348,412.00	0.91
19	601169	北京银行	7,744,900	52,897,667.00	0.90
20	002230	科大讯飞	1,092,600	52,313,688.00	0.89
21	601818	光大银行	12,479,169	51,788,551.35	0.88
22	300498	温氏股份	2,968,460	50,701,296.80	0.87
23	601166	兴业银行	2,153,618	50,265,444.12	0.86
24	002714	牧原股份	1,163,700	48,887,037.00	0.83
25	601988	中国银行	8,606,200	48,366,844.00	0.83
26	600030	中信证券	1,701,788	47,003,384.56	0.80
27	002475	立讯精密	1,325,000	45,964,250.00	0.78
28	601398	工商银行	6,025,800	45,735,822.00	0.78
29	300274	阳光电源	674,500	45,710,865.00	0.78
30	300033	同花顺	166,622	45,489,472.22	0.78
31	000977	浪潮信息	892,800	45,425,664.00	0.78
32	605499	东鹏饮料	144,570	45,402,208.50	0.77
33	300015	爱尔眼科	3,628,908	45,288,771.84	0.77
34	000538	云南白药	797,740	44,505,914.60	0.76
35	688012	中微公司	241,500	44,025,450.00	0.75

36	600887	伊利股份	1,568,554	43,731,285.52	0.75
37	600926	杭州银行	2,582,800	43,442,696.00	0.74
38	601919	中远海控	2,851,041	42,879,656.64	0.73
39	601628	中国人寿	1,002,600	41,297,094.00	0.70
40	002001	新和成	1,863,484	39,636,304.68	0.68
41	600482	中国动力	1,682,300	38,810,661.00	0.66
42	600050	中国联通	7,266,000	38,800,440.00	0.66
43	601319	中国人保	4,429,070	38,577,199.70	0.66
44	600406	国电南瑞	1,718,300	38,507,103.00	0.66
45	600219	南山铝业	9,980,300	38,224,549.00	0.65
46	000938	紫光股份	1,581,500	37,940,185.00	0.65
47	601989	中国重工	8,093,660	37,554,582.40	0.64
48	601600	中国铝业	5,121,800	36,057,472.00	0.62
49	601336	新华保险	595,800	34,854,300.00	0.59
50	000001	平安银行	2,877,900	34,736,253.00	0.59
51	000568	泸州老窖	305,840	34,682,256.00	0.59
52	601668	中国建筑	5,798,894	33,459,618.38	0.57
53	002624	完美世界	2,175,400	33,000,818.00	0.56
54	601601	中国太保	868,330	32,571,058.30	0.56
55	002028	思源电气	440,605	32,124,510.55	0.55
56	002202	金风科技	3,066,376	31,430,354.00	0.54
57	600352	浙江龙盛	3,072,400	31,215,584.00	0.53
58	601456	国联民生	3,007,600	31,128,660.00	0.53
59	601868	中国能建	13,908,700	31,016,401.00	0.53
60	601138	工业富联	1,448,108	30,960,549.04	0.53
61	600663	陆家嘴	3,474,400	30,783,184.00	0.53
62	601901	方正证券	3,850,800	30,459,828.00	0.52
63	600338	西藏珠峰	2,716,200	30,122,658.00	0.51
64	600276	恒瑞医药	562,072	29,171,536.80	0.50
65	000100	TCL 科技	6,678,200	28,916,606.00	0.49
66	300059	东方财富	1,219,918	28,216,703.34	0.48
67	688008	澜起科技	343,760	28,188,320.00	0.48
68	601088	中国神华	691,900	28,049,626.00	0.48
69	000783	长江证券	3,961,800	27,455,274.00	0.47
70	601816	京沪高铁	4,769,700	27,425,775.00	0.47
71	600919	江苏银行	2,287,875	27,317,227.50	0.47
72	603288	海天味业	672,140	26,152,967.40	0.45
73	000902	新洋丰	1,874,800	25,928,484.00	0.44
74	601995	中金公司	730,200	25,819,872.00	0.44
75	000975	山金国际	1,349,500	25,559,530.00	0.44
76	300408	三环集团	756,700	25,273,780.00	0.43
77	601669	中国电建	5,183,200	25,242,184.00	0.43
78	688256	寒武纪	41,900	25,202,850.00	0.43
79	000166	申万宏源	4,944,200	24,819,884.00	0.42
80	600585	海螺水泥	1,127,900	24,216,013.00	0.41
81	689009	九号公司	408,701	24,182,838.17	0.41
82	000651	格力电器	538,155	24,173,922.60	0.41
83	300251	光线传媒	1,187,000	24,060,490.00	0.41
84	002352	顺丰控股	489,523	23,869,141.48	0.41

85	000776	广发证券	1,402,900	23,582,749.00	0.40
86	600011	华能国际	3,237,500	23,115,750.00	0.39
87	601658	邮储银行	4,102,000	22,437,940.00	0.38
88	002179	中航光电	553,758	22,349,672.88	0.38
89	688297	中无人机	414,300	22,123,620.00	0.38
90	601229	上海银行	2,004,713	21,270,004.93	0.36
91	600000	浦发银行	1,524,086	21,154,313.68	0.36
92	601009	南京银行	1,819,798	21,146,052.76	0.36
93	601728	中国电信	2,687,652	20,829,303.00	0.36
94	601857	中国石油	2,393,600	20,465,280.00	0.35
95	688082	盛美上海	179,582	20,461,573.08	0.35
96	600958	东方证券	2,111,900	20,443,192.00	0.35
97	600809	山西汾酒	115,080	20,298,961.20	0.35
98	002487	大金重工	614,940	20,231,526.00	0.35
99	600660	福耀玻璃	349,400	19,919,294.00	0.34
100	000895	双汇发展	801,000	19,552,410.00	0.33
101	600875	东方电气	1,161,000	19,435,140.00	0.33
102	603529	爱玛科技	558,100	19,198,640.00	0.33
103	603766	隆鑫通用	1,484,700	18,944,772.00	0.32
104	603893	瑞芯微	122,800	18,648,408.00	0.32
105	600016	民生银行	3,822,709	18,157,867.75	0.31
106	600038	中直股份	462,400	17,945,744.00	0.31
107	600941	中国移动	156,800	17,647,840.00	0.30
108	603501	豪威集团	137,445	17,544,854.25	0.30
109	688111	金山办公	62,419	17,480,440.95	0.30
110	600522	中天科技	1,189,000	17,192,940.00	0.29
111	300502	新易盛	134,400	17,071,488.00	0.29
112	600938	中国海油	651,800	17,018,498.00	0.29
113	600459	贵研铂业	1,079,600	16,744,596.00	0.29
114	000063	中兴通讯	508,000	16,504,920.00	0.28
115	600015	华夏银行	2,075,200	16,414,832.00	0.28
116	601555	东吴证券	1,807,800	15,818,250.00	0.27
117	002648	卫星化学	892,000	15,458,360.00	0.26
118	002414	高德红外	1,486,050	15,232,012.50	0.26
119	600377	宁沪高速	945,300	14,500,902.00	0.25
120	000893	亚钾国际	480,400	14,479,256.00	0.25
121	603296	华勤技术	176,900	14,272,292.00	0.24
122	300604	长川科技	309,100	13,881,681.00	0.24
123	002736	国信证券	1,202,000	13,847,040.00	0.24
124	300777	中简科技	378,500	13,720,625.00	0.23
125	688981	中芯国际	150,800	13,296,036.00	0.23
126	000425	徐工机械	1,702,900	13,231,533.00	0.23
127	603833	欧派家居	232,400	13,118,980.00	0.22
128	600064	南京高科	1,701,060	13,115,172.60	0.22
129	600703	三安光电	1,045,600	12,986,352.00	0.22
130	600012	皖通高速	754,700	12,814,806.00	0.22
131	600436	片仔癀	63,251	12,650,832.51	0.22
132	688120	华海清科	73,792	12,448,710.40	0.21
133	300124	汇川技术	189,126	12,211,865.82	0.21

134	001914	招商积余	982,900	12,158,473.00	0.21
135	601127	赛力斯	86,800	11,658,976.00	0.20
136	688235	百济神州	49,300	11,518,452.00	0.20
137	601991	大唐发电	3,622,400	11,483,008.00	0.20
138	603799	华友钴业	307,000	11,365,140.00	0.19
139	300628	亿联网络	325,000	11,297,000.00	0.19
140	300492	华图山鼎	165,860	11,258,576.80	0.19
141	002938	鹏鼎控股	343,100	10,989,493.00	0.19
142	601225	陕西煤业	553,000	10,639,720.00	0.18
143	300573	兴齐眼药	191,580	9,921,928.20	0.17
144	600460	士兰微	398,400	9,888,288.00	0.17
145	002142	宁波银行	332,470	9,096,379.20	0.16
146	601633	长城汽车	404,340	8,685,223.20	0.15
147	002758	浙农股份	968,600	8,649,598.00	0.15
148	603939	益丰药房	336,688	8,238,755.36	0.14
149	605117	德业股份	152,060	8,007,479.60	0.14
150	600166	福田汽车	2,884,000	7,815,640.00	0.13
151	600583	海油工程	1,361,700	7,434,882.00	0.13
152	600111	北方稀土	290,300	7,228,470.00	0.12
153	600196	复星医药	277,300	6,957,457.00	0.12
154	600998	九州通	1,336,700	6,870,638.00	0.12
155	688522	纳睿雷达	133,800	6,853,236.00	0.12
156	601298	青岛港	787,800	6,845,982.00	0.12
157	002056	横店东磁	482,800	6,831,620.00	0.12
158	600728	佳都科技	1,227,000	6,687,150.00	0.11
159	001965	招商公路	539,900	6,478,800.00	0.11
160	600299	安迪苏	666,900	6,435,585.00	0.11
161	603986	兆易创新	50,210	6,353,071.30	0.11
162	601998	中信银行	724,100	6,154,850.00	0.11
163	601168	西部矿业	363,900	6,051,657.00	0.10
164	603267	鸿远电子	117,700	5,916,779.00	0.10
165	600428	中远海特	940,900	5,880,625.00	0.10
166	600487	亨通光电	371,900	5,690,070.00	0.10
167	002371	北方华创	12,720	5,624,911.20	0.10
168	600547	山东黄金	174,000	5,555,820.00	0.09
169	300760	迈瑞医疗	24,000	5,394,000.00	0.09
170	300308	中际旭创	35,680	5,204,284.80	0.09
171	002155	湖南黄金	281,670	5,027,809.50	0.09
172	300812	易天股份	216,900	5,012,559.00	0.09
173	000338	潍柴动力	298,904	4,597,143.52	0.08
174	600019	宝钢股份	696,700	4,591,253.00	0.08
175	000792	盐湖股份	268,300	4,582,564.00	0.08
176	002138	顺络电子	157,600	4,431,712.00	0.08
177	603466	风语筑	412,300	4,160,107.00	0.07
178	603019	中科曙光	58,000	4,083,200.00	0.07
179	002415	海康威视	146,408	4,059,893.84	0.07
180	600309	万华化学	74,700	4,053,222.00	0.07
181	600025	华能水电	407,000	3,886,850.00	0.07
182	000807	云铝股份	227,800	3,640,244.00	0.06

183	601688	华泰证券	202,864	3,613,007.84	0.06
184	601012	隆基绿能	240,400	3,610,808.00	0.06
185	600061	国投资本	460,200	3,460,704.00	0.06
186	603636	南威软件	271,293	3,429,143.52	0.06
187	000423	东阿阿胶	62,700	3,279,210.00	0.06
188	600028	中国石化	578,200	3,261,048.00	0.06
189	603713	密尔克卫	60,500	3,225,860.00	0.06
190	601126	四方股份	196,900	3,203,563.00	0.05
191	601006	大秦铁路	478,900	3,160,740.00	0.05
192	601985	中国核电	325,700	3,035,524.00	0.05
193	600339	中油工程	922,000	3,014,940.00	0.05
194	600104	上汽集团	183,500	2,945,175.00	0.05
195	002027	分众传媒	400,800	2,925,840.00	0.05
196	600496	精工钢构	904,700	2,895,040.00	0.05
197	600150	中国船舶	88,600	2,883,044.00	0.05
198	600760	中航沈飞	43,800	2,567,556.00	0.04
199	000625	长安汽车	196,800	2,511,168.00	0.04
200	688271	联影医疗	19,600	2,503,704.00	0.04
201	600176	中国巨石	212,500	2,422,500.00	0.04
202	600905	三峡能源	567,500	2,417,550.00	0.04
203	600089	特变电工	199,999	2,385,988.07	0.04
204	000959	首钢股份	696,000	2,366,400.00	0.04
205	601888	中国中免	38,677	2,358,136.69	0.04
206	600578	京能电力	524,500	2,355,005.00	0.04
207	603993	洛阳钼业	278,400	2,344,128.00	0.04
208	002050	三花智控	88,700	2,339,906.00	0.04
209	600048	保利发展	285,000	2,308,500.00	0.04
210	601390	中国中铁	406,700	2,281,587.00	0.04
211	002463	沪电股份	53,400	2,273,772.00	0.04
212	002241	歌尔股份	97,000	2,262,040.00	0.04
213	600415	小商品城	108,757	2,249,094.76	0.04
214	300014	亿纬锂能	48,719	2,231,817.39	0.04
215	601825	沪农商行	229,000	2,221,300.00	0.04
216	002236	大华股份	136,900	2,173,972.00	0.04
217	600893	航发动力	52,900	2,038,766.00	0.03
218	601916	浙商银行	597,950	2,027,050.50	0.03
219	601838	成都银行	100,700	2,024,070.00	0.03
220	600570	恒生电子	60,000	2,012,400.00	0.03
221	601898	中煤能源	182,301	1,994,372.94	0.03
222	300199	翰宇药业	117,300	1,941,315.00	0.03
223	002311	海大集团	32,900	1,927,611.00	0.03
224	600584	长电科技	56,800	1,913,592.00	0.03
225	300803	指南针	23,695	1,911,238.70	0.03
226	601066	中信建投	78,700	1,892,735.00	0.03
227	688198	佰仁医疗	17,700	1,817,613.00	0.03
228	600438	通威股份	107,200	1,795,600.00	0.03
229	600989	宝丰能源	110,900	1,789,926.00	0.03
230	002049	紫光国微	26,900	1,771,634.00	0.03
231	300433	蓝思科技	79,000	1,761,700.00	0.03

232	601077	渝农商行	245,200	1,750,728.00	0.03
233	000002	万科 A	270,200	1,734,684.00	0.03
234	600795	国电电力	352,632	1,706,738.88	0.03
235	601377	兴业证券	273,600	1,693,584.00	0.03
236	600489	中金黄金	115,400	1,688,302.00	0.03
237	688685	迈信林	29,700	1,658,745.00	0.03
238	601689	拓普集团	34,500	1,630,125.00	0.03
239	600010	包钢股份	896,600	1,604,914.00	0.03
240	002422	科伦药业	44,300	1,591,256.00	0.03
241	600009	上海机场	49,400	1,569,438.00	0.03
242	000682	东方电子	152,400	1,560,576.00	0.03
243	002304	洋河股份	23,900	1,542,745.00	0.03
244	600160	巨化股份	53,600	1,537,248.00	0.03
245	601100	恒立液压	21,300	1,533,600.00	0.03
246	000768	中航西飞	55,100	1,506,434.00	0.03
247	300394	天孚通信	18,568	1,482,469.12	0.03
248	601881	中国银河	86,000	1,474,900.00	0.03
249	601186	中国铁建	182,700	1,463,427.00	0.02
250	600183	生益科技	48,350	1,457,752.50	0.02
251	002252	上海莱士	210,000	1,442,700.00	0.02
252	688036	传音控股	18,100	1,442,570.00	0.02
253	000157	中联重科	197,000	1,424,310.00	0.02
254	601360	三六零	138,700	1,414,740.00	0.02
255	000963	华东医药	34,800	1,404,528.00	0.02
256	600886	国投电力	95,100	1,401,774.00	0.02
257	600007	中国国贸	67,900	1,397,382.00	0.02
258	002074	国轩高科	43,000	1,395,780.00	0.02
259	601788	光大证券	77,400	1,391,652.00	0.02
260	601058	赛轮轮胎	104,200	1,367,104.00	0.02
261	600115	中国东航	338,900	1,365,767.00	0.02
262	300442	润泽科技	27,200	1,347,216.00	0.02
263	000408	藏格矿业	31,200	1,331,304.00	0.02
264	002466	天齐锂业	41,000	1,313,640.00	0.02
265	600674	川投能源	81,800	1,312,072.00	0.02
266	600066	宇通客车	52,600	1,307,636.00	0.02
267	688169	石头科技	8,220	1,286,841.00	0.02
268	000661	长春高新	12,900	1,279,422.00	0.02
269	600426	华鲁恒升	58,800	1,274,196.00	0.02
270	600029	南方航空	213,200	1,257,880.00	0.02
271	001979	招商蛇口	143,300	1,256,741.00	0.02
272	601800	中国交建	140,900	1,252,601.00	0.02
273	000429	粤高速 A	93,700	1,249,021.00	0.02
274	300661	圣邦股份	17,140	1,247,277.80	0.02
275	301236	软通动力	22,600	1,234,864.00	0.02
276	688126	沪硅产业	65,400	1,224,288.00	0.02
277	600346	恒力石化	83,500	1,190,710.00	0.02
278	601878	浙商证券	109,000	1,189,190.00	0.02
279	601111	中国国航	148,900	1,174,821.00	0.02
280	300418	昆仑万维	34,700	1,166,961.00	0.02

281	600372	中航机载	96,200	1,160,172.00	0.02
282	603369	今世缘	29,800	1,160,114.00	0.02
283	002916	深南电路	10,560	1,138,473.60	0.02
284	003816	中国广核	310,900	1,131,676.00	0.02
285	002920	德赛西威	10,993	1,122,715.09	0.02
286	601117	中国化学	145,800	1,118,286.00	0.02
287	600741	华域汽车	62,600	1,104,890.00	0.02
288	300347	泰格医药	20,500	1,093,060.00	0.02
289	600588	用友网络	81,000	1,082,970.00	0.02
290	601021	春秋航空	19,400	1,079,610.00	0.02
291	300699	光威复材	34,000	1,076,780.00	0.02
292	002601	龙佰集团	66,400	1,076,344.00	0.02
293	301269	华大九天	8,600	1,065,368.00	0.02
294	000786	北新建材	40,000	1,059,200.00	0.02
295	300782	卓胜微	14,800	1,056,276.00	0.02
296	300896	爱美客	5,969	1,043,440.89	0.02
297	302132	中航成飞	11,700	1,028,898.00	0.02
298	600039	四川路桥	103,200	1,021,680.00	0.02
299	000630	铜陵有色	303,700	1,014,358.00	0.02
300	002493	荣盛石化	120,400	996,912.00	0.02
301	688396	华润微	21,100	995,076.00	0.02
302	000988	华工科技	21,100	991,911.00	0.02
303	002129	TCL 中环	127,900	982,272.00	0.02
304	600085	同仁堂	27,100	977,226.00	0.02
305	600600	青岛啤酒	14,000	972,440.00	0.02
306	600362	江西铜业	41,200	965,316.00	0.02
307	002709	天赐材料	53,200	963,984.00	0.02
308	601877	正泰电器	42,500	963,475.00	0.02
309	002600	领益智造	111,100	954,349.00	0.02
310	688506	百利天恒	3,200	947,584.00	0.02
311	300122	智飞生物	47,400	928,566.00	0.02
312	603392	万泰生物	15,004	915,244.00	0.02
313	002180	纳思达	39,489	905,877.66	0.02
314	600161	天坛生物	47,200	905,768.00	0.02
315	300832	新产业	15,600	884,832.00	0.02
316	600233	圆通速递	68,200	879,098.00	0.01
317	000301	东方盛虹	105,000	874,650.00	0.01
318	688608	恒玄科技	2,500	869,950.00	0.01
319	300759	康龙化成	35,300	866,262.00	0.01
320	600188	兖矿能源	70,859	862,354.03	0.01
321	000596	古井贡酒	6,450	858,817.50	0.01
322	600023	浙能电力	159,800	846,940.00	0.01
323	601618	中国中冶	284,200	846,916.00	0.01
324	000876	新希望	90,000	844,200.00	0.01
325	688047	龙芯中科	6,300	840,357.00	0.01
326	000999	华润三九	26,620	832,673.60	0.01
327	688223	晶科能源	159,200	826,248.00	0.01
328	600845	宝信软件	34,100	805,442.00	0.01
329	600515	海南机场	226,800	802,872.00	0.01

330	601872	招商轮船	127,600	798,776.00	0.01
331	600027	华电国际	145,100	793,697.00	0.01
332	002459	晶澳科技	78,600	784,428.00	0.01
333	688599	天合光能	52,100	757,013.00	0.01
334	600332	白云山	27,800	732,808.00	0.01
335	000617	中油资本	99,700	727,810.00	0.01
336	000983	山西焦煤	113,100	723,840.00	0.01
337	600918	中泰证券	110,000	707,300.00	0.01
338	300316	晶盛机电	25,900	703,185.00	0.01
339	601799	星宇股份	5,600	700,000.00	0.01
340	600803	新奥股份	36,900	697,410.00	0.01
341	300999	金龙鱼	23,600	696,908.00	0.01
342	601698	中国卫通	33,500	685,745.00	0.01
343	603260	合盛硅业	14,100	668,340.00	0.01
344	601238	广汽集团	87,900	658,371.00	0.01
345	601059	信达证券	38,400	656,640.00	0.01
346	300413	芒果超媒	29,800	650,236.00	0.01
347	600018	上港集团	110,100	628,671.00	0.01
348	601607	上海医药	33,400	597,192.00	0.01
349	600026	中远海能	55,100	569,183.00	0.01
350	688303	大全能源	25,600	545,792.00	0.01
351	603806	福斯特	41,500	537,840.00	0.01
352	688472	阿特斯	58,700	537,105.00	0.01
353	688009	中国通号	102,600	527,364.00	0.01
354	603195	公牛集团	10,840	523,030.00	0.01
355	603678	火炬电子	13,600	517,208.00	0.01
356	601699	潞安环能	47,500	501,125.00	0.01
357	000708	中信特钢	40,170	472,399.20	0.01
358	601236	红塔证券	55,700	471,779.00	0.01
359	601865	福莱特	30,200	459,342.00	0.01
360	688187	时代电气	10,300	439,295.00	0.01
361	601136	首创证券	21,600	429,408.00	0.01
362	002468	申通快递	34,800	372,012.00	0.01
363	300994	久祺股份	22,100	345,644.00	0.01
364	601808	中海油服	23,600	324,736.00	0.01
365	300979	华利集团	6,100	320,677.00	0.01
366	300207	欣旺达	15,300	306,918.00	0.01
367	001391	国货航	43,586	293,333.78	0.01
368	000800	一汽解放	38,500	264,110.00	0.00
369	002209	达意隆	15,600	195,780.00	0.00
370	001289	龙源电力	6,200	100,316.00	0.00
371	002315	焦点科技	1,700	77,673.00	0.00
372	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
373	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
374	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
375	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
376	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
377	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
378	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00

379	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
380	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
381	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
382	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
383	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
384	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
385	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
386	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
387	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
388	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
389	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
390	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
391	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
392	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
393	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
394	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
395	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
396	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
397	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
398	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
399	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
400	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
401	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
402	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
403	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
404	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
405	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
406	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
407	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
408	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
409	688099	晶晨股份	37	2,627.37	0.00
410	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
411	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
412	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
413	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
414	688658	悦康药业	48	913.92	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	601288	农业银行	69,817,730.00	1.12
2	600036	招商银行	65,637,118.00	1.05
3	300015	爱尔眼科	65,303,977.22	1.05
4	002202	金风科技	61,970,227.68	0.99
5	002230	科大讯飞	61,538,647.00	0.99

6	601211	国泰海通	54,420,913.12	0.87
7	601988	中国银行	49,434,700.00	0.79
8	601818	光大银行	48,978,665.00	0.78
9	300498	温氏股份	48,557,034.70	0.78
10	002648	卫星化学	48,406,580.00	0.78
11	600926	杭州银行	47,121,424.00	0.75
12	601628	中国人寿	47,026,545.99	0.75
13	603288	海天味业	43,855,183.50	0.70
14	601989	中国重工	43,567,724.60	0.70
15	300033	同花顺	41,597,373.20	0.67
16	601766	中国中车	41,582,302.00	0.67
17	600519	贵州茅台	40,959,272.30	0.66
18	002142	宁波银行	40,846,754.00	0.65
19	000938	紫光股份	38,413,649.00	0.62
20	603259	药明康德	37,878,461.20	0.61

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	601166	兴业银行	106,752,316.00	1.71
2	601318	中国平安	90,836,250.00	1.45
3	600276	恒瑞医药	79,310,028.76	1.27
4	600000	浦发银行	64,065,345.92	1.03
5	600519	贵州茅台	60,982,320.90	0.98
6	603501	豪威集团	58,895,877.05	0.94
7	002594	比亚迪	57,181,422.93	0.92
8	601688	华泰证券	56,745,513.00	0.91
9	002352	顺丰控股	53,695,750.00	0.86
10	601127	赛力斯	53,669,104.00	0.86
11	601899	紫金矿业	51,424,731.00	0.82
12	601818	光大银行	51,271,742.00	0.82
13	300308	中际旭创	47,686,640.20	0.76
14	002027	分众传媒	47,010,611.00	0.75
15	600050	中国联通	45,782,903.00	0.73
16	300498	温氏股份	45,255,829.80	0.72
17	601601	中国太保	45,075,531.00	0.72
18	000039	中集集团	44,491,342.30	0.71
19	601117	中国化学	44,354,211.00	0.71
20	601225	陕西煤业	44,180,318.00	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	4,980,528,778.40
卖出股票的收入（成交）总额	5,496,112,126.32

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	20,243,988.01	0.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,243,988.01	0.35

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	019749	24 国债 15	199,900	20,243,988.01	0.35

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，中国农业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行、中国银保监会泰安监管分局、国家外汇管理局辽宁省分局、国家税务总局那曲市税务局稽查局、国家金融监督管理总局福建监管局、海东市消防救援支队、漳州市市场监督管理局、玉树藏族自治州消防救援支队的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行辽宁省分行、国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局湖北监管局、大同市云冈区住房和城乡建设局的处罚。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四川监管局、国家金融监督管理总局山东监管局、深圳市市场监督管理局的处罚。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。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。

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	166,908.82
2	应收清算款	66,507,740.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,747,833.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,422,482.73

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	221,329	12,722.68	186,638,855.46	6.63%	2,629,258,921.30	93.37%
博时沪深 300 指数 C	83,759	7,965.55	5,238,218.11	0.79%	661,948,132.86	99.21%
博时沪深 300 指数 R	-	-	-	-	-	-
博时沪深 300 指数 Y	988	3,884.38	-	-	3,837,768.30	100.00%
博时沪深 300 指数 I	3	10,624.84	-	-	31,874.53	100.00%
合计	303,383	11,493.57	191,877,073.57	5.50%	3,295,076,696.99	94.50%

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	846,202.65	0.03%
	博时沪深 300 指数 C	255,324.38	0.04%
	博时沪深 300 指数 R	-	-
	博时沪深 300 指数 Y	45,464.52	1.18%
	博时沪深 300 指数 I	62.50	0.20%
	合计	1,147,054.05	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时沪深 300 指数 A	10~50
	博时沪深 300 指数 C	-
	博时沪深 300 指数 R	-
	博时沪深 300 指数 Y	0~10
	博时沪深 300 指数 I	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	博时沪深 300 指数 A	-
	博时沪深 300 指数 C	-
	博时沪深 300 指数 R	-

	博时沪深 300 指数 Y	-
	博时沪深 300 指数 I	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
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	3,001,199,425.68	796,464,005.43	-	716,042.11	-
本报告期基金总申购份额	151,990,452.41	168,706,836.71	-	3,539,230.29	103,991.47
减：本报告期基金总赎回份额	337,292,101.33	297,984,491.17	-	417,504.10	72,116.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,815,897,776.76	667,186,350.97	-	3,837,768.30	31,874.53

§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

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

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，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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 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。

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	
财通证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	1,016,991,598.94	9.71%	209,842.09	9.72%	-
方正证券	3	368,793,375.94	3.52%	75,934.72	3.52%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	726,988,156.82	6.94%	149,687.15	6.94%	-
中信建投	4	614,140,736.34	5.86%	126,515.09	5.86%	减少 1 个
招商证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	3	991,976,864.58	9.47%	204,255.45	9.46%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	613,667,551.57	5.86%	126,541.01	5.86%	-
中泰证券	2	681,870,458.04	6.51%	140,671.50	6.52%	减少 1 个
万联证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	2	714,219,853.59	6.82%	147,060.65	6.81%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	4	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
东吴证券	2	1,042,528,865.83	9.95%	214,694.20	9.95%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	9,628,489.40	0.09%	1,983.18	0.09%	增加 1 个
国泰海通	4	251,894,405.82	2.40%	51,868.75	2.40%	增加 1 个
兴业证券	3	770,767,683.29	7.36%	158,801.01	7.36%	-
长江证券	2	225,011,760.18	2.15%	46,334.26	2.15%	-
国金证券	1	1,059,008,255.65	10.11%	218,097.51	10.11%	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	2	401,377,566.78	3.83%	82,814.97	3.84%	-
浙商证券	1	985,435,798.03	9.41%	202,949.97	9.40%	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

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
财通证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	227,099.34	1.12%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	19,991,959.70	98.21%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	136,286.78	0.67%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于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	2025-06-26
2	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
3	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	2025-06-26
4	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	2025-06-26

5	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 I）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	2025-06-26
6	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-20250606	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
7	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-20250603	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
8	关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 I 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	2025-05-09
9	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	2025-04-29
10	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 I）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	2025-04-29
11	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 I 类基金份额及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	2025-04-28
12	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	2025-04-28
13	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-28
14	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2025 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	2025-04-22
15	博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
16	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-20250408	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
17	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
18	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 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	2025-03-31
19	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-20250325	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
20	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 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	2025-01-22
21	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金分红公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-09

		露网站	
22	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-01-08

§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

二〇二五年八月二十九日