

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十七日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	4
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	5
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§ 7 投资组合报告	28
7.1 期末基金资产组合情况	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	28
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	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	38
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	38
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	38
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	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38
§ 8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	39
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40

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.....	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4	基金投资策略的改变.....	40
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
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.....	41
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
§ 11	备查文件目录	45
11.1	备查文件目录.....	45
11.2	存放地点.....	45
11.3	查阅方式.....	46

§ 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	5,408,722,284.23 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长。本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95% 以上，并保持年跟踪误差在 4% 以下。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用被动式投资的方法，按照证券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。本基金投资组合的目标比例为：股票资产为 95% 以内，现金和短期债券资产比例不低于 5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为 95% 的沪深 300 指数加 5% 的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	田青
	联系电话	0755-83169999	010-67595096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67595096
传真		0755-83195140	010-66275853
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		张光华	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com

基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处
-------------	--------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	4,423,669,581.79
本期利润	3,205,861,782.00
加权平均基金份额本期利润	0.3593
本期加权平均净值利润率	29.82%
本期基金份额净值增长率	32.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,021,463,075.59
期末可供分配基金份额利润	0.3737
期末基金资产净值	7,430,185,359.82
期末基金份额净值	1.3737
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	334.40%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

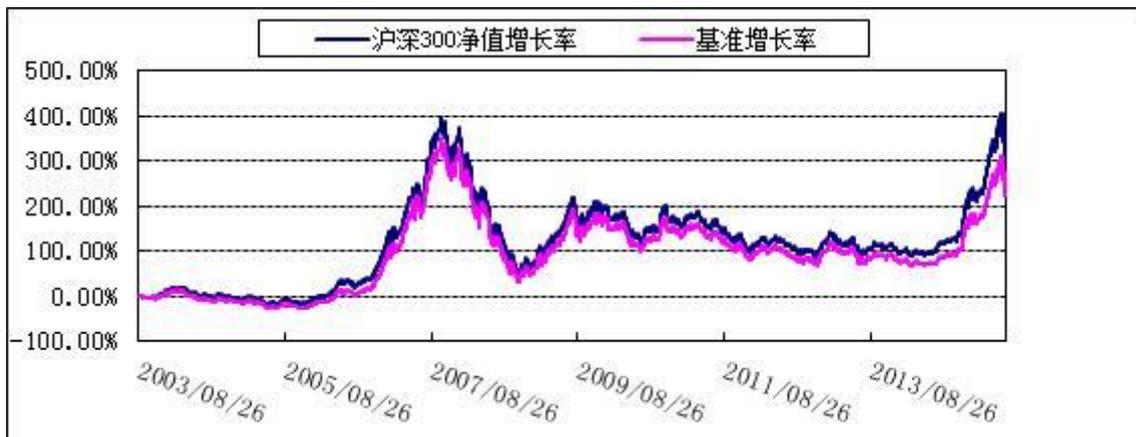
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.51%	3.29%	-7.17%	3.32%	1.66%	-0.03%
过去三个月	13.91%	2.50%	9.99%	2.48%	3.92%	0.02%
过去六个月	32.89%	2.17%	25.31%	2.15%	7.58%	0.02%
过去一年	119.44%	1.78%	99.71%	1.75%	19.73%	0.03%
过去三年	101.33%	1.44%	77.25%	1.42%	24.08%	0.02%
自基金合同生效起至今	334.40%	1.64%	246.67%	1.65%	87.73%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×95%+银行同业存款利率×5%。

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

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



§ 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 2015 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理七十只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户。博时基金资产管理净值总规模逾 3027.86 亿元人民币，其中公募基金资产规模逾 1317.35 亿元人民币，累计分红超过 664.83 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，标准股票型基金中，截至 6 月 30 日，博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在 379 只标准型股票基金中分别排名前 1/3 和前 1/2；博时深证基本面 200ETF 及联接基金今年以来的净值增长率在 175 只指数股票型基金-标准指数股票基金及 46 只 ETF 联接基金中分别排名前 1/2 和前 1/3；混合基金-偏股型基金中，博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型 36 只产品中排名前 1/3；混合基金-灵活配置型基金中，博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在 126 只同类型基金中分别排名前 1/3 和前 1/2。

固定收益方面，博时安丰 18 个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债券今年以来收益率在 71 只同类长期标准债券型基金中分别排名前 1/10、前 1/2 和前

1/2；博时上证企债 30ETF 今年以来的收益率在 18 只指数债券型基金-指数债券型基金(A 类)排名前 1/3。

2、其他大事件

2015 年 1 月 7 日，博时基金在 2014 年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

2015 年 1 月 15 日，在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中，博时基金获评第十二届中国财经风云榜“年度十大品牌基金公司”奖。

2015 年 1 月 18 日，博时基金（香港）在和讯财经风云榜海外评选中荣获“最佳中资基金公司”奖。

2015 年 1 月 21 日，在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中，博时转债增强荣获第八届金蝉奖“2014 最佳年度债基品牌奖”。

2015 年 3 月 28 日，在第十二届中国基金业金牛奖评选中，博时主题行业（LOF）基金、博时信用债券基金分别获得“2014 年度开放式股票型金牛基金”奖、“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2015 年 3 月 28 日，在中金在线主办的“2014 年度财经排行榜”评选中，邓欣雨获评“2014 年度中金在线财经排行榜最佳基金经理”。

2015 年 4 月 22 日，由上海证券报社主办的第十二届中国“金基金”奖的评选揭晓，博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得 5 年期股票型金基金奖。

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		
赵云阳	基金经理	2015/5/6	-	5	2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金、博时证券保险指数分级基金基金经理
王红欣	指数投资部	2013/1/9	-	21	1994 年起先后在 RXR 期货公司、

	总经理 / 基金经理				Aeltus 投资公司、Putnam 投资公司、Acadian 资产管理公司、易方达资产管理（香港）公司工作。2012 年 10 月加入博时基金管理有限公司。曾任股票投资部 ETF 及量化组投资总监。现任指数投资部总经理兼博时裕富沪深 300 指数证券投资基金、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
林景艺	基金经理助理	2014/1/13	2015/5/20	5	2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理，现任博时国企改革股票基金的基金经理。
桂征辉	基金经理助理	2014/10/27	-	6	2006 年起先后在松下电器北京研究所、美国在线公司工作。2009 年加入博时基金，现任指数投资部基金经理助理

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

博时基金管理有限公司于 2015 年 7 月 9 日发布公告称，赵云阳先生担任博时沪深 300 指数基金的基金经理，王红欣先生不再担任博时沪深 300 指数基金的基金经理；2015 年 7 月 23 日发布公告称，桂征辉先生担任博时沪深 300 指数基金的基金经理，与赵云阳先生共同管理本基金。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2015 年上半年，货币政策全面转为宽松，央行多次降准降息，股市资金充裕。在赚钱效应的示范下，住户部门资金蜂拥入市，各股指屡创新高。尤其是在经济转型预期下，以创业板为代表的新兴成长股票，互联网，电子，计算机等行业股票涨幅较大。而以沪深 300 为代表的大盘蓝筹股涨幅较小。在二季度末，受监管规范场外配资融资等政策影响，主要股指大幅下跌，小盘股跌幅更深。市场的悲观情绪再度攀升。整个上半年市场走势呈现出先扬后抑，加速下跌的势态。

在本报告期内，本基金在投资中遇到了较大赎回，增加了本基金的交易成本，增加了管理操作的难度。值得欣慰的是本基金采取的量化增强策略获得了较好的效果，在种种不利的因素下，本基金在报告期内仍然获得了较为显著的超额收益，并且基金与基准的主动跟踪误差较小，收益风险比较高。从稳定性来看，上半年的 6 个月中，全部都战胜了基准，而且日胜率，周胜率较高，量化增强策略的整体效果符合我们预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.3737 元，份额累计净值为 3.3537 元，报告期内净值增长率为 32.89%，同期业绩基准涨幅为 25.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年下半年，货币政策可能进一步放松，财政政策有望继续发力。宏观经济已有企稳回升态势。市场大部分的悲观预期已经充分反映，目前市场点位下具有较大的安全边际，部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值。综合来看，下半年市场可能呈现震荡上行走势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

和程序进行评价等。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	
银行存款	6.4.3.1	256,332,067.84	582,075,396.78
结算备付金		8,107,050.51	11,393,071.30
存出保证金		2,938,740.07	683,453.99
交易性金融资产	6.4.3.2	7,173,036,823.31	11,710,302,156.59
其中：股票投资		7,038,513,933.11	11,585,767,292.32
基金投资		-	-
债券投资		134,522,890.20	124,534,864.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		16,044,775.00	12,623,399.14
应收利息	6.4.3.5	3,963,591.93	1,505,777.61
应收股利		-	-
应收申购款		136,434,779.43	40,856,467.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		7,596,857,828.09	12,359,439,723.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		18,370,640.02	75,249,807.65
应付赎回款		127,697,404.40	25,719,832.88
应付管理人报酬		7,050,209.67	8,766,021.67
应付托管费		1,438,818.31	1,788,984.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	11,424,958.02	11,037,113.26
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	690,437.85	652,287.31
负债合计		166,672,468.27	123,214,046.78
所有者权益：		-	
实收基金	6.4.3.9	5,408,722,284.23	11,836,975,021.49
未分配利润	6.4.3.10	2,021,463,075.59	399,250,654.78
所有者权益合计		7,430,185,359.82	12,236,225,676.27
负债和所有者权益总计		7,596,857,828.09	12,359,439,723.05

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3737 元，基金份额总额 5,408,722,284.23 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		3,308,602,866.67	-288,802,104.87
1. 利息收入		3,229,528.48	2,030,639.41
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,903,410.85	1,494,593.30
债券利息收入		1,326,117.63	532,398.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,647.65
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,515,334,676.34	-286,361,374.43
其中：股票投资收益	6.4.3.12	4,432,226,079.48	-365,676,322.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	17,586,774.90	-11,476,933.42
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	65,521,821.96	90,791,881.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-1,217,807,799.79	-5,390,979.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	7,846,461.64	919,609.33
减：二、费用		102,741,084.67	67,209,025.20
1. 管理人报酬		52,310,372.89	36,397,870.15
2. 托管费		10,675,586.23	7,428,136.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	39,507,793.18	23,146,190.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.3.19	247,332.37	236,827.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,205,861,782.00	-356,011,130.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,205,861,782.00	-356,011,130.07

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	11,836,975,021.49	399,250,654.78	12,236,225,676.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,205,861,782.00	3,205,861,782.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,428,252,737.26	-1,583,649,361.19	-8,011,902,098.45
其中：1. 基金申购款	4,596,301,993.80	1,078,724,915.56	5,675,026,909.36
2. 基金赎回款	-11,024,554,731.06	-2,662,374,276.75	-13,686,929,007.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,408,722,284.23	2,021,463,075.59	7,430,185,359.82
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,942,911,234.67	-4,462,539,622.64	8,480,371,612.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-356,011,130.07	-356,011,130.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,458,903,150.93	524,035,585.43	-934,867,565.50
其中：1. 基金申购款	402,378,937.79	-150,163,348.10	252,215,589.69
2. 基金赎回款	-1,861,282,088.72	674,198,933.53	-1,187,083,155.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	11,484,008,083.74	-4,294,515,167.28	7,189,492,916.46

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：成江

6.4 报表附注

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

除以下会计估计变更外，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：

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、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.2 税项

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

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

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

(3) 对基金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。自 2013 年 1 月 1 日起,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,暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	256,332,067.84
定期存款	-
其他存款	-
合计	256,332,067.84

6.4.3.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,482,704,412.32	7,038,513,933.11	1,555,809,520.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	104,223,036.80	104,447,890.20	224,853.40
	银行间市场	30,080,280.00	30,075,000.00	-5,280.00
	合计	134,303,316.80	134,522,890.20	219,573.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,617,007,729.12	7,173,036,823.31	1,556,029,094.19

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	71,726.87
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,648.20
应收债券利息	3,886,894.46
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,322.40
合计	3,963,591.93

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	11,424,733.02
银行间市场应付交易费用	225.00
合计	11,424,958.02

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日

应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	227,140.03
其他应付款	67.15
预提费用	213,230.67
合计	690,437.85

6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,836,975,021.49	11,836,975,021.49
本期申购	4,596,301,993.80	4,596,301,993.80
本期赎回（以“-”号填列）	-11,024,554,731.06	-11,024,554,731.06
本期末	5,408,722,284.23	5,408,722,284.23

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.3.10 未分配利润

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	-1,197,555,065.31	1,596,805,720.09	399,250,654.78
本期利润	4,423,669,581.79	-1,217,807,799.79	3,205,861,782.00
本期基金份额交易产生的变动数	-740,891,793.81	-842,757,567.38	-1,583,649,361.19
其中：基金申购款	299,868,852.60	778,856,062.96	1,078,724,915.56
基金赎回款	-1,040,760,646.41	-1,621,613,630.34	-2,662,374,276.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,485,222,722.67	-463,759,647.08	2,021,463,075.59

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	1,657,740.33
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	152,041.32	
其他	93,629.20	
合计	1,903,410.85	

6.4.3.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	卖出股票成交总额	16,461,210,242.00
减：卖出股票成本总额	12,028,984,162.52	
买卖股票差价收入	4,432,226,079.48	

6.4.3.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	58,715,902.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,809,478.23
减：应收利息总额	319,649.43
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	17,586,774.90

6.4.3.14 衍生工具收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	65,521,821.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	65,521,821.96

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,217,807,799.79
——股票投资	-1,207,171,025.45
——债券投资	-10,636,774.34
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,217,807,799.79

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	7,007,891.24
转换费收入	838,570.40
合计	7,846,461.64

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	交易所市场交易费用	39,507,568.18
银行间市场交易费用	225.00	
合计	39,507,793.18	

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	审计费用	64,464.96
信息披露费	148,765.71	
银行汇划费	25,101.70	
银行间帐户服务费	9,000.00	
合计	247,332.37	

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股票成交总

		票成交总 额的比例		额的比例
招商证券	1,829,336,512.87	7.38%	2,680,005,824.71	16.91%

6.4.6.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额 的比例
招商证券	1,481,034.63	7.26%	942,082.13	8.25%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	2,286,248.25	17.82%	1,740,438.96	23.91%

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	52,310,372.89	36,397,870.15
其中：支付销售机构的客户维护费	4,208,745.86	3,174,276.45

注：支付基金管理人博时基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.98% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.98% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,675,586.23	7,428,136.79

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	256,332,067.84	1,657,740.33	388,589,456.52	1,371,364.31

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000024	招商地产	20150403	重大事项停牌	31.64	尚未复牌	尚未复牌	49,159.00	1,029,202.50	1,555,390.76	
000429	粤高速 A	20150408	重大事项停牌	6.42	20150722	7.06	1,636,857.00	7,964,281.84	10,508,621.94	
000630	铜陵有色	20150309	重大事项停牌	10.32	尚未复牌	尚未复牌	6,235,290.00	29,870,755.51	64,348,192.80	
000732	泰禾集团	20150625	重大事项停牌	34.20	20150702	30.78	15,300.00	523,035.34	523,260.00	
000839	中信国安	20150629	重大事项停牌	23.57	尚未复牌	尚未复牌	109,800.00	3,037,418.82	2,587,986.00	
000878	云南铜业	20150608	重大事项停牌	24.50	尚未复牌	尚未复牌	935,920.00	10,903,501.56	22,930,040.00	

000963	华东医药	20150626	重大事 项停牌	62.50	20150805	69.20		888,942.00	49,620,613.57	55,558,875.00
002292	奥飞动漫	20150518	重大事 项停牌	37.29	尚未复牌	尚未复牌		967,964.00	15,351,621.90	36,095,377.56
002309	中利科技	20150602	重大事 项停牌	33.39	20150721	30.05		35,000.00	983,223.30	1,168,650.00
002329	皇氏集团	20150612	重大事 项停牌	69.48	20150813	62.53		482.00	15,379.77	33,489.36
002374	丽鹏股份	20150630	重大事 项停牌	23.34	20150713	22.50		168,489.00	4,924,934.27	3,932,533.26
002375	亚厦股份	20150617	重大事 项停牌	23.96	20150720	26.29		262,499.00	7,772,006.96	6,289,476.04
002639	雪人股份	20150630	重大事 项停牌	38.30	20150820	34.47		241,700.00	8,088,372.28	9,257,110.00
002662	京威股份	20150515	重大事 项停牌	17.84	20150813	16.06		1,385,545.00	26,100,245.87	24,718,122.80
002668	奥马电器	20150629	重大事 项停牌	29.04	20150721	26.14		2,100.00	78,326.00	60,984.00
300007	汉威电子	20150629	重大事 项停牌	74.72	20150824	67.25		103,100.00	7,808,690.45	7,703,632.00
300008	上海佳豪	20150324	重大事 项停牌	17.24	尚未复牌	尚未复牌		952,221.00	13,479,686.69	16,416,290.04
300084	海默科技	20150603	重大事 项停牌	21.43	20150720	19.29		55,660.00	875,557.34	1,192,793.80
300144	宋城演艺	20150618	重大事 项停牌	76.47	20150720	68.82		14,100.00	1,040,920.83	1,078,227.00
300195	长荣股份	20150623	重大事 项停牌	28.35	20150824	28.76		46,700.00	1,741,551.00	1,323,945.00
300269	联建光电	20150630	重大事 项停牌	28.81	尚未复牌	尚未复牌		7,200.00	122,350.97	207,432.00
300291	华录百纳	20150630	重大事 项停牌	37.76	20150713	34.65		86,300.00	3,533,891.72	3,258,688.00
300310	宜通世纪	20150616	重大事 项停牌	33.99	尚未复牌	尚未复牌		3,000.00	118,259.03	101,970.00
300316	晶盛机电	20150624	重大事 项停牌	25.90	尚未复牌	尚未复牌		435,500.00	9,108,456.87	11,279,450.00
600153	建发股份	20150629	重大事 项停牌	17.51	尚未复牌	尚未复牌		866,200.00	8,729,374.50	15,167,162.00
600277	亿利能源	20150601	重大事 项停牌	14.62	尚未复牌	尚未复牌		145,948.00	1,168,383.18	2,133,759.76
600395	盘江股份	20150609	重大事 项停牌	15.71	20150819	14.00		1,040,929.00	10,339,335.70	16,352,994.59
600416	湘电股份	20150522	重大事 项停牌	22.64	20150720	20.35		1,048,000.00	19,228,574.30	23,726,720.00
600886	国投电力	20150624	重大事	14.87	尚未复牌	尚未复牌				

			项停牌				4,550,694.00	38,678,854.92	67,668,819.78
600900	长江电力	20150615	重大事 项停牌	14.35	尚未复牌	尚未复牌	4,495,500.00	48,399,861.96	64,510,425.00
601111	中国国航	20150630	重大事 项停牌	15.36	20150729	13.78	854,700.00	10,757,977.30	13,128,192.00
601216	内蒙君正	20150629	重大事 项停牌	24.07	20150702	24.20	88,900.00	1,738,545.21	2,139,823.00
601633	长城汽车	20150619	重大事 项停牌	36.69	20150713	38.50	815,190.00	43,488,527.34	29,909,321.10
合计				-		-	-	386,621,718.80	516,867,754.59

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属被动式股票指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4%以下的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完

善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.02%（2014 年 12 月 31 日，0.40%）。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短

时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.8 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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	256,332,067.84	-	-	-	256,332,067.84
结算备付金	8,107,050.51	-	-	-	8,107,050.51
存出保证金	2,938,740.07	-	-	-	2,938,740.07
交易性金融资产	132,859,090.70	-	1,663,799.50	7,038,513,933.11	7,173,036,823.31
应收证券清算款	-	-	-	16,044,775.00	16,044,775.00
应收利息	-	-	-	3,963,591.93	3,963,591.93
应收申购款	-	-	-	136,434,779.43	136,434,779.43

资产总计	400,236,949.12	-	1,663,799.50	7,194,957,079.47	7,596,857,828.09
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,370,640.02	18,370,640.02
应付赎回款	-	-	-	127,697,404.40	127,697,404.40
应付管理人报酬	-	-	-	7,050,209.67	7,050,209.67
应付托管费	-	-	-	1,438,818.31	1,438,818.31
应付交易费用	-	-	-	11,424,958.02	11,424,958.02
其他负债	-	-	-	690,437.85	690,437.85
负债总计	-	-	-	166,672,468.27	166,672,468.27
利率敏感度缺口	400,236,949.12	-	1,663,799.50	7,028,284,611.20	7,430,185,359.82
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	582,075,396.78	-	-	-	582,075,396.78
结算备付金	11,393,071.30	-	-	-	11,393,071.30
存出保证金	683,453.99	-	-	-	683,453.99
交易性金融资产	75,867,289.00	34,063,175.67	14,604,399.60	11,585,767,292.32	11,710,302,156.59
应收证券清算款	-	-	-	12,623,399.14	12,623,399.14
应收利息	-	-	-	1,505,777.61	1,505,777.61
应收申购款	-	-	-	40,856,467.64	40,856,467.64
资产总计	670,019,211.07	34,063,175.67	14,604,399.60	11,640,752,936.71	12,359,439,723.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	75,249,807.65	75,249,807.65
应付赎回款	-	-	-	25,719,832.88	25,719,832.88
应付管理人报酬	-	-	-	8,766,021.67	8,766,021.67
应付托管费	-	-	-	1,788,984.01	1,788,984.01
应付交易费用	-	-	-	11,037,113.26	11,037,113.26
其他负债	-	-	-	652,287.31	652,287.31
负债总计	-	-	-	123,214,046.78	123,214,046.78
利率敏感度缺口	670,019,211.07	34,063,175.67	14,604,399.60	11,517,538,889.93	12,236,225,676.27

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.81% (2014 年 12 月 31 日为 1.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产总值的 95% 以内，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	7,038,513,933.11	94.73	11,585,767,292.32	94.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,038,513,933.11	94.73	11,585,767,292.32	94.68

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	沪深300指数上升5%	增加约36,436	增加约 62,425
沪深300指数下降5%	减少约36,436	减少约 62,425	

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 6,523,309,978.02 元，属于第二层次的余额为 649,726,845.29 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 11,581,795,251.06 元，第二层次 128,506,905.53 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。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、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,038,513,933.11	92.65
	其中：股票	7,038,513,933.11	92.65
2	固定收益投资	134,522,890.20	1.77
	其中：债券	134,522,890.20	1.77
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	264,439,118.35	3.48
7	其他各项资产	159,381,886.43	2.10
8	合计	7,596,857,828.09	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	20,223,110.07	0.27
B	采矿业	293,182,735.33	3.95
C	制造业	2,413,223,558.26	32.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	340,732,093.12	4.59
E	建筑业	328,970,908.58	4.43
F	批发和零售业	247,068,435.63	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	288,550,548.41	3.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	283,978,538.59	3.82
J	金融业	2,328,658,282.34	31.34

K	房地产业	306,874,355.88	4.13
L	租赁和商务服务业	25,481,349.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	16,922,380.04	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	4,933,446.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	134,913,457.86	1.82
S	综合	4,800,734.00	0.06
	合计	7,038,513,933.11	94.73

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	4,067,939	333,326,921.66	4.49
2	600000	浦发银行	11,537,749	195,680,223.04	2.63
3	601166	兴业银行	10,911,567	188,224,530.75	2.53
4	600036	招商银行	9,992,100	187,052,112.00	2.52
5	600030	中信证券	5,865,135	157,830,782.85	2.12
6	600016	民生银行	15,775,630	156,809,762.20	2.11
7	600837	海通证券	6,266,266	136,604,598.80	1.84
8	000651	格力电器	1,799,246	114,971,819.40	1.55
9	000002	万科 A	7,545,825	109,565,379.00	1.47
10	601668	中国建筑	12,738,193	105,854,383.83	1.42
11	601766	中国中车	5,678,248	104,252,633.28	1.40
12	600011	华能国际	7,404,262	103,881,795.86	1.40
13	600519	贵州茅台	386,220	99,509,583.00	1.34
14	000333	美的集团	2,466,974	91,968,790.72	1.24
15	600028	中国石化	12,671,894	89,463,571.64	1.20
16	000623	吉林敖东	2,491,000	83,697,600.00	1.13
17	601009	南京银行	3,574,598	81,500,834.40	1.10
18	000776	广发证券	3,555,497	80,532,007.05	1.08
19	600887	伊利股份	3,922,000	74,125,800.00	1.00
20	000001	平安银行	5,000,464	72,706,746.56	0.98
21	601818	光大银行	13,217,986	70,848,404.96	0.95
22	601006	大秦铁路	4,909,432	68,928,425.28	0.93
23	600029	南方航空	4,737,906	68,889,153.24	0.93
24	600019	宝钢股份	7,768,531	67,896,960.94	0.91
25	600115	东方航空	5,505,251	67,824,692.32	0.91
26	600886	国投电力	4,550,694	67,668,819.78	0.91
27	600104	上汽集团	2,946,474	66,590,312.40	0.90
28	601601	中国太保	2,203,676	66,506,941.68	0.90
29	600900	长江电力	4,495,500	64,510,425.00	0.87
30	000630	铜陵有色	6,235,290	64,348,192.80	0.87
31	002202	金风科技	3,297,547	64,203,240.09	0.86

32	600276	恒瑞医药	1,416,013	63,069,219.02	0.85
33	601988	中国银行	12,880,242	62,984,383.38	0.85
34	600048	保利地产	5,328,925	60,856,323.50	0.82
35	600050	中国联通	7,873,475	57,712,571.75	0.78
36	601390	中国中铁	4,204,200	57,555,498.00	0.77
37	600741	华域汽车	2,615,812	55,847,586.20	0.75
38	000625	长安汽车	2,634,467	55,718,977.05	0.75
39	000963	华东医药	888,942	55,558,875.00	0.75
40	601169	北京银行	4,149,096	55,265,958.72	0.74
41	601688	华泰证券	2,335,234	54,013,962.42	0.73
42	601989	中国重工	3,613,100	53,473,880.00	0.72
43	000063	中兴通讯	2,222,300	52,912,963.00	0.71
44	300059	东方财富	833,800	52,604,442.00	0.71
45	601800	中国交建	2,950,700	51,814,292.00	0.70
46	601398	工商银行	9,679,400	51,107,232.00	0.69
47	002415	海康威视	1,044,665	46,800,992.00	0.63
48	002304	洋河股份	667,335	46,286,355.60	0.62
49	601788	光大证券	1,686,407	45,448,668.65	0.61
50	600348	阳泉煤业	4,397,026	45,069,516.50	0.61
51	600570	恒生电子	389,861	43,683,925.05	0.59
52	600188	兖州煤业	3,056,516	42,027,095.00	0.57
53	002024	苏宁云商	2,712,400	41,499,720.00	0.56
54	600369	西南证券	2,033,580	39,959,847.00	0.54
55	000039	中集集团	1,187,704	38,362,839.20	0.52
56	601328	交通银行	4,509,966	37,162,119.84	0.50
57	601555	东吴证券	1,813,125	37,114,668.75	0.50
58	000876	新希望	1,904,294	36,962,346.54	0.50
59	600177	雅戈尔	2,001,700	36,551,042.00	0.49
60	002292	奥飞动漫	967,964	36,095,377.56	0.49
61	600827	百联股份	1,728,247	35,964,820.07	0.48
62	601377	兴业证券	2,588,139	35,431,622.91	0.48
63	601098	中南传媒	1,543,782	35,368,045.62	0.48
64	000768	中航飞机	783,800	34,158,004.00	0.46
65	600597	光明乳业	1,376,885	31,668,355.00	0.43
66	600637	东方明珠	744,820	31,342,025.60	0.42
67	600873	梅花生物	2,937,826	30,670,903.44	0.41
68	600150	中国船舶	589,800	30,374,700.00	0.41
69	002039	黔源电力	1,457,587	30,142,899.16	0.41
70	601633	长城汽车	815,190	29,909,321.10	0.40
71	601186	中国铁建	1,909,800	29,850,174.00	0.40
72	600271	航天信息	442,690	28,646,469.90	0.39
73	600674	川投能源	2,204,852	27,582,698.52	0.37
74	600690	青岛海尔	899,949	27,295,453.17	0.37
75	600015	华夏银行	1,786,472	27,172,239.12	0.37
76	600221	海南航空	4,252,100	27,170,919.00	0.37
77	601677	明泰铝业	1,649,938	27,009,485.06	0.36
78	000728	国元证券	706,479	26,832,072.42	0.36
79	600352	浙江龙盛	1,879,838	26,637,304.46	0.36
80	600648	外高桥	726,428	25,483,094.24	0.34
81	600027	华电国际	2,288,365	25,446,618.80	0.34

82	600066	宇通客车	1,233,245	25,343,184.75	0.34
83	601600	中国铝业	2,702,700	25,216,191.00	0.34
84	601088	中国神华	1,203,612	25,095,310.20	0.34
85	002252	上海莱士	383,000	25,063,520.00	0.34
86	601607	上海医药	1,113,520	24,798,090.40	0.33
87	002662	京威股份	1,385,545	24,718,122.80	0.33
88	600683	京投银泰	2,097,924	24,692,565.48	0.33
89	600383	金地集团	1,944,200	24,594,130.00	0.33
90	600416	湘电股份	1,048,000	23,726,720.00	0.32
91	000878	云南铜业	935,920	22,930,040.00	0.31
92	603993	洛阳钼业	1,788,763	22,109,110.68	0.30
93	601857	中国石油	1,947,500	22,065,175.00	0.30
94	000402	金融街	1,534,400	21,681,072.00	0.29
95	300027	华谊兄弟	567,100	21,629,194.00	0.29
96	600782	新钢股份	2,715,368	20,555,335.76	0.28
97	600804	鹏博士	676,900	20,212,234.00	0.27
98	601998	中信银行	2,498,300	19,261,893.00	0.26
99	600373	中文传媒	801,809	19,211,343.64	0.26
100	600118	中国卫星	334,100	19,030,336.00	0.26
101	000100	TCL 集团	3,350,000	18,927,500.00	0.25
102	000048	康达尔	731,776	18,513,932.80	0.25
103	000046	泛海控股	1,256,700	18,410,655.00	0.25
104	601231	环旭电子	1,073,100	18,253,431.00	0.25
105	000686	东北证券	927,300	18,054,531.00	0.24
106	000999	华润三九	582,800	17,711,292.00	0.24
107	002673	西部证券	611,052	17,335,545.24	0.23
108	600518	康美药业	976,600	17,315,118.00	0.23
109	600170	上海建工	1,792,340	16,812,149.20	0.23
110	601336	新华保险	275,175	16,802,185.50	0.23
111	600089	特变电工	1,129,050	16,721,230.50	0.23
112	600068	葛洲坝	1,423,700	16,643,053.00	0.22
113	600340	华夏幸福	546,046	16,627,100.70	0.22
114	300008	上海佳豪	952,221	16,416,290.04	0.22
115	600395	盘江股份	1,040,929	16,352,994.59	0.22
116	002324	普利特	461,537	16,015,333.90	0.22
117	600893	中航动力	299,722	15,930,224.30	0.21
118	601669	中国电建	1,371,649	15,554,499.66	0.21
119	601899	紫金矿业	2,996,700	15,343,104.00	0.21
120	300104	乐视网	294,500	15,243,320.00	0.21
121	601618	中国中冶	2,107,593	15,237,897.39	0.21
122	600153	建发股份	866,200	15,167,162.00	0.20
123	002470	金正大	677,996	14,719,293.16	0.20
124	000725	京东方 A	2,798,500	14,524,215.00	0.20
125	600060	海信电器	587,997	14,458,846.23	0.19
126	600236	桂冠电力	1,291,900	14,417,604.00	0.19
127	002099	海翔药业	551,900	14,360,438.00	0.19
128	600316	洪都航空	408,007	14,108,882.06	0.19
129	002321	华英农业	1,144,400	14,053,232.00	0.19
130	601727	上海电气	929,400	13,875,942.00	0.19
131	000423	东阿阿胶	245,000	13,352,500.00	0.18

132	600705	中航资本	571,800	13,237,170.00	0.18
133	601111	中国国航	854,700	13,128,192.00	0.18
134	601233	桐昆股份	653,700	13,047,852.00	0.18
135	002230	科大讯飞	372,200	13,004,668.00	0.18
136	600010	包钢股份	2,449,700	12,713,943.00	0.17
137	002475	立讯精密	370,084	12,512,540.04	0.17
138	600415	小商品城	807,400	12,337,072.00	0.17
139	600588	用友网络	268,460	12,316,944.80	0.17
140	000783	长江证券	865,800	12,077,910.00	0.16
141	002423	中原特钢	725,990	11,724,738.50	0.16
142	600096	云天化	752,400	11,617,056.00	0.16
143	600823	世茂股份	888,670	11,579,370.10	0.16
144	002399	海普瑞	334,375	11,365,406.25	0.15
145	600458	时代新材	451,720	11,338,172.00	0.15
146	300032	金龙机电	328,804	11,284,553.28	0.15
147	300316	晶盛机电	435,500	11,279,450.00	0.15
148	600970	中材国际	768,800	11,239,856.00	0.15
149	600829	人民同泰	553,818	10,987,749.12	0.15
150	601929	吉视传媒	724,382	10,952,655.84	0.15
151	300033	同花顺	125,100	10,757,349.00	0.14
152	000429	粤高速 A	1,636,857	10,508,621.94	0.14
153	600717	天津港	665,637	9,977,898.63	0.13
154	600005	武钢股份	1,413,300	9,935,499.00	0.13
155	600018	上港集团	1,202,100	9,508,611.00	0.13
156	002639	雪人股份	241,700	9,257,110.00	0.12
157	002500	山西证券	493,800	8,932,842.00	0.12
158	600361	华联综超	828,051	8,884,987.23	0.12
159	600176	中国巨石	317,100	8,580,726.00	0.12
160	300133	华策影视	307,502	8,302,554.00	0.11
161	002129	中环股份	413,800	8,189,102.00	0.11
162	600826	兰生股份	206,339	7,970,875.57	0.11
163	600038	中直股份	127,636	7,907,050.20	0.11
164	601901	方正证券	654,272	7,779,294.08	0.10
165	300007	汉威电子	103,100	7,703,632.00	0.10
166	002153	石基信息	57,660	7,495,223.40	0.10
167	601106	中国一重	612,600	7,418,586.00	0.10
168	601179	中国西电	721,031	7,390,567.75	0.10
169	601628	中国人寿	233,098	7,300,629.36	0.10
170	600315	上海家化	164,400	7,134,960.00	0.10
171	601888	中国国旅	106,700	7,074,210.00	0.10
172	300289	利德曼	135,182	7,029,464.00	0.09
173	300307	慈星股份	421,561	6,858,797.47	0.09
174	000418	小天鹅 A	284,144	6,791,041.60	0.09
175	600399	抚顺特钢	548,250	6,491,280.00	0.09
176	002375	亚厦股份	262,499	6,289,476.04	0.08
177	300017	网宿科技	132,672	6,158,634.24	0.08
178	000869	张裕 A	124,706	6,084,405.74	0.08
179	000966	长源电力	285,700	5,654,003.00	0.08
180	600723	首商股份	451,500	5,566,995.00	0.07
181	601388	怡球资源	285,200	5,478,692.00	0.07

182	600203	福日电子	344,050	5,435,990.00	0.07
183	600888	新疆众和	444,800	5,359,840.00	0.07
184	300183	东软载波	179,600	5,118,600.00	0.07
185	600126	杭钢股份	536,600	5,092,334.00	0.07
186	002537	海立美达	314,100	4,903,101.00	0.07
187	300070	碧水源	100,000	4,879,000.00	0.07
188	000703	恒逸石化	380,000	4,848,800.00	0.07
189	600199	金种子酒	344,700	4,825,800.00	0.06
190	600184	光电股份	163,271	4,597,711.36	0.06
191	000009	中国宝安	280,900	4,581,479.00	0.06
192	600559	老白干酒	54,164	4,523,777.28	0.06
193	300148	天舟文化	207,615	4,459,570.20	0.06
194	000503	海虹控股	90,712	4,444,888.00	0.06
195	002400	省广股份	175,100	4,423,026.00	0.06
196	002065	东华软件	152,600	4,387,250.00	0.06
197	600350	山东高速	506,300	4,333,928.00	0.06
198	002482	广田股份	157,100	4,288,830.00	0.06
199	000042	中洲控股	172,100	4,200,961.00	0.06
200	000798	中水渔业	259,201	4,165,360.07	0.06
201	601919	中国远洋	331,200	4,133,376.00	0.06
202	000750	国海证券	237,000	3,981,600.00	0.05
203	002514	宝馨科技	158,359	3,966,892.95	0.05
204	002374	丽鹏股份	168,489	3,932,533.26	0.05
205	000910	大亚科技	228,470	3,888,559.40	0.05
206	300002	神州泰岳	254,026	3,871,356.24	0.05
207	000939	凯迪电力	260,800	3,820,720.00	0.05
208	601168	西部矿业	345,900	3,777,228.00	0.05
209	002641	永高股份	388,200	3,711,192.00	0.05
210	002152	广电运通	114,000	3,686,760.00	0.05
211	000156	华数传媒	100,100	3,581,578.00	0.05
212	002241	歌尔声学	97,000	3,482,300.00	0.05
213	002056	横店东磁	105,700	3,306,296.00	0.04
214	300291	华录百纳	86,300	3,258,688.00	0.04
215	600686	金龙汽车	125,300	3,225,222.00	0.04
216	002102	冠福股份	229,700	3,133,108.00	0.04
217	600123	兰花科创	266,042	3,128,653.92	0.04
218	002640	跨境通	45,050	3,128,272.00	0.04
219	600305	恒顺醋业	101,500	3,064,285.00	0.04
220	000563	陕国投 A	217,600	3,061,632.00	0.04
221	300379	东方通	38,000	3,054,060.00	0.04
222	600185	格力地产	94,000	3,031,500.00	0.04
223	300222	科大智能	70,494	2,999,519.70	0.04
224	600811	东方集团	233,700	2,881,521.00	0.04
225	300219	鸿利光电	74,800	2,840,904.00	0.04
226	002157	正邦科技	153,800	2,745,330.00	0.04
227	601117	中国化学	279,096	2,729,558.88	0.04
228	600088	中视传媒	84,300	2,720,361.00	0.04
229	000933	神火股份	282,100	2,657,382.00	0.04
230	000413	东旭光电	267,300	2,614,194.00	0.04
231	000839	中信国安	109,800	2,587,986.00	0.03

232	000928	中钢国际	103,057	2,556,844.17	0.03
233	600649	城投控股	264,900	2,476,815.00	0.03
234	601188	龙江交通	365,100	2,449,821.00	0.03
235	600466	蓝光发展	183,100	2,437,061.00	0.03
236	300050	世纪鼎利	79,000	2,253,080.00	0.03
237	002135	东南网架	179,800	2,193,560.00	0.03
238	601216	内蒙君正	88,900	2,139,823.00	0.03
239	600277	亿利能源	145,948	2,133,759.76	0.03
240	600468	百利电气	91,500	2,132,865.00	0.03
241	600973	宝胜股份	138,800	2,113,924.00	0.03
242	300207	欣旺达	86,463	2,094,133.86	0.03
243	600398	海澜之家	113,900	2,065,007.00	0.03
244	600566	济川药业	69,795	2,057,556.60	0.03
245	000555	神州信息	25,806	1,930,288.80	0.03
246	002493	荣盛石化	90,800	1,928,592.00	0.03
247	300003	乐普医疗	46,500	1,886,505.00	0.03
248	600750	江中药业	57,086	1,837,598.34	0.02
249	600551	时代出版	82,200	1,784,562.00	0.02
250	002358	森源电气	78,700	1,690,476.00	0.02
251	002458	益生股份	64,100	1,675,574.00	0.02
252	002207	准油股份	80,100	1,674,891.00	0.02
253	300283	温州宏丰	120,100	1,665,787.00	0.02
254	601028	玉龙股份	136,700	1,643,134.00	0.02
255	002008	大族激光	56,350	1,618,372.00	0.02
256	300302	同有科技	44,200	1,566,890.00	0.02
257	000024	招商地产	49,159	1,555,390.76	0.02
258	601801	皖新传媒	52,800	1,540,176.00	0.02
259	600647	同达创业	50,100	1,506,507.00	0.02
260	300292	吴通通讯	44,300	1,498,669.00	0.02
261	600867	通化东宝	68,100	1,493,433.00	0.02
262	300208	恒顺众昇	18,600	1,478,514.00	0.02
263	002446	盛路通信	60,100	1,476,056.00	0.02
264	000789	万年青	138,000	1,428,300.00	0.02
265	300256	星星科技	59,400	1,359,072.00	0.02
266	000415	渤海租赁	142,800	1,350,888.00	0.02
267	600657	信达地产	163,700	1,348,888.00	0.02
268	300195	长荣股份	46,700	1,323,945.00	0.02
269	300226	上海钢联	16,300	1,320,300.00	0.02
270	600771	广誉远	31,000	1,306,340.00	0.02
271	002221	东华能源	42,900	1,279,707.00	0.02
272	600548	深高速	145,200	1,241,460.00	0.02
273	000883	湖北能源	139,800	1,219,056.00	0.02
274	600547	山东黄金	49,100	1,212,770.00	0.02
275	300084	海默科技	55,660	1,192,793.80	0.02
276	002309	中利科技	35,000	1,168,650.00	0.02
277	600894	广日股份	55,900	1,115,764.00	0.02
278	002555	顺荣三七	24,600	1,102,080.00	0.01
279	300124	汇川技术	22,800	1,094,400.00	0.01
280	300144	宋城演艺	14,100	1,078,227.00	0.01
281	000006	深振业 A	75,800	1,028,606.00	0.01

282	600051	宁波联合	70,200	1,020,006.00	0.01
283	600655	豫园商城	63,300	1,015,965.00	0.01
284	300042	朗科科技	37,800	991,872.00	0.01
285	002051	中工国际	32,018	953,496.04	0.01
286	603333	明星电缆	98,700	952,455.00	0.01
287	300290	荣科科技	22,700	907,546.00	0.01
288	002053	云南盐化	26,400	757,944.00	0.01
289	600687	刚泰控股	18,100	710,425.00	0.01
290	600885	宏发股份	22,373	701,169.82	0.01
291	002554	惠博普	46,500	668,205.00	0.01
292	300324	旋极信息	22,973	652,203.47	0.01
293	300156	神雾环保	14,900	648,001.00	0.01
294	002150	通润装备	45,400	642,864.00	0.01
295	002081	金螳螂	22,223	626,466.37	0.01
296	600606	金丰投资	25,400	620,522.00	0.01
297	300115	长盈精密	16,400	546,284.00	0.01
298	002410	广联达	23,250	544,050.00	0.01
299	000732	泰禾集团	15,300	523,260.00	0.01
300	002469	三维工程	22,900	506,090.00	0.01
301	300024	机器人	6,500	502,190.00	0.01
302	603000	人民网	9,400	490,022.00	0.01
303	300251	光线传媒	18,392	457,960.80	0.01
304	002618	丹邦科技	9,300	394,599.00	0.01
305	002279	久其软件	7,200	385,200.00	0.01
306	600201	金宇集团	5,400	384,048.00	0.01
307	601288	农业银行	102,900	381,759.00	0.01
308	300081	恒信移动	7,600	355,680.00	0.00
309	600498	烽火通信	13,000	343,980.00	0.00
310	600629	棱光实业	12,200	340,746.00	0.00
311	002714	牧原股份	5,600	328,944.00	0.00
312	601099	太平洋	24,000	310,080.00	0.00
313	000572	海马汽车	36,700	307,913.00	0.00
314	002600	江粉磁材	32,000	303,680.00	0.00
315	300152	燃控科技	6,500	297,375.00	0.00
316	601866	中海集运	31,300	297,350.00	0.00
317	600057	象屿股份	20,900	296,153.00	0.00
318	002450	康得新	8,900	272,340.00	0.00
319	600839	四川长虹	26,000	255,840.00	0.00
320	300248	新开普	5,500	220,880.00	0.00
321	600620	天宸股份	14,100	219,255.00	0.00
322	600332	白云山	6,100	210,206.00	0.00
323	300269	联建光电	7,200	207,432.00	0.00
324	600685	中船防务	3,600	193,464.00	0.00
325	601225	陕西煤业	22,200	181,596.00	0.00
326	601999	出版传媒	12,600	179,172.00	0.00
327	002594	比亚迪	3,000	165,690.00	0.00
328	002465	海格通信	5,000	160,950.00	0.00
329	000905	厦门港务	10,200	158,100.00	0.00
330	002236	大华股份	4,600	146,832.00	0.00
331	000671	阳光城	6,653	138,249.34	0.00

332	002089	新海宜	5,878	137,662.76	0.00
333	600864	哈投股份	7,400	119,880.00	0.00
334	000960	锡业股份	5,600	112,840.00	0.00
335	000538	云南白药	1,212	104,559.24	0.00
336	300310	宜通世纪	3,000	101,970.00	0.00
337	002267	陕天然气	5,700	88,293.00	0.00
338	002090	金智科技	2,100	61,950.00	0.00
339	002668	奥马电器	2,100	60,984.00	0.00
340	000792	盐湖股份	2,030	57,611.40	0.00
341	000626	如意集团	700	55,790.00	0.00
342	000826	桑德环境	1,400	54,446.00	0.00
343	002282	博深工具	3,300	48,840.00	0.00
344	000858	五粮液	1,300	41,210.00	0.00
345	300216	千山药机	800	39,056.00	0.00
346	002329	皇氏集团	482	33,489.36	0.00
347	000712	锦龙股份	700	24,570.00	0.00
348	601222	林洋电子	600	21,054.00	0.00
349	002563	森马服饰	700	16,912.00	0.00
350	300046	台基股份	700	16,457.00	0.00
351	600774	汉商集团	400	13,136.00	0.00
352	300262	巴安水务	580	10,730.00	0.00
353	600990	四创电子	100	9,632.00	0.00
354	300252	金信诺	45	1,785.15	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	600016	民生银行	211,866,620.42	1.73
2	002024	苏宁云商	157,368,623.52	1.29
3	601766	中国中车	139,735,564.76	1.14
4	601989	中国重工	129,190,293.13	1.06
5	002202	金风科技	123,726,317.14	1.01
6	601988	中国银行	114,887,714.56	0.94
7	600683	京投银泰	110,423,051.54	0.90
8	600637	东方明珠	108,258,914.10	0.88
9	600252	中恒集团	108,194,215.27	0.88
10	601677	明泰铝业	103,370,786.33	0.84
11	601788	光大证券	101,614,841.04	0.83
12	002039	黔源电力	96,164,132.54	0.79
13	000623	吉林敖东	91,926,672.33	0.75
14	601231	环旭电子	89,972,382.54	0.74
15	000338	潍柴动力	86,269,511.47	0.71
16	601336	新华保险	78,742,999.77	0.64
17	600115	东方航空	78,605,823.90	0.64
18	603993	洛阳钼业	78,402,413.85	0.64
19	601009	南京银行	77,455,909.35	0.63
20	601328	交通银行	74,929,299.79	0.61

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	436,911,528.43	3.57
2	002202	金风科技	352,205,517.28	2.88
3	601607	上海医药	344,329,894.34	2.81
4	601318	中国平安	314,938,176.39	2.57
5	601169	DR 北京银	260,979,685.17	2.13
6	000002	万科 A	238,265,873.46	1.95
7	600000	浦发银行	233,587,039.40	1.91
8	600028	中国石化	206,418,080.25	1.69
9	600104	上汽集团	205,287,644.48	1.68
10	000878	云南铜业	201,803,553.84	1.65
11	002024	苏宁云商	191,153,563.57	1.56
12	601766	中国中车	189,015,240.35	1.54
13	601336	新华保险	180,636,055.89	1.48
14	600030	中信证券	175,484,968.51	1.43
15	601006	大秦铁路	167,370,414.89	1.37
16	601677	明泰铝业	166,350,612.74	1.36
17	600150	中国船舶	165,769,954.39	1.35
18	600016	民生银行	165,127,720.90	1.35
19	601818	光大银行	164,907,815.81	1.35
20	600050	中国联通	164,324,704.97	1.34

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	8,685,149,648.98
卖出股票的收入（成交）总额	16,461,210,242.00

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	132,859,090.70	1.79
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	1,663,799.50	0.02
8	其他	-	-
9	合计	134,522,890.20	1.81

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	019414	14 国债 14	510,000	51,020,400.00	0.69
2	019321	13 国债 21	300,000	30,171,000.00	0.41
3	120017	12 付息国债 17	300,000	30,075,000.00	0.40
4	019418	14 国债 18	100,000	10,024,000.00	0.13
5	019028	10 国债 28	65,370	6,544,190.70	0.09

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持仓国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券（600030）、海通证券（600837）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中信证券股份有限公司 2015 年 1 月 18 日发布公告称，因存在违规为到期融资融券合约展期问题，公司被中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

海通证券股份有限公司 2015 年 1 月 18 日发布公告称，因存在违规为到期融资融券合约展期问题，公司被中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

对上述两支股票投资决策程序的说明：

根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,938,740.07
2	应收证券清算款	16,044,775.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,963,591.93
5	应收申购款	136,434,779.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,381,886.43

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

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
262,090	20,636.89	1,049,063,947.27	19.40%	4,359,658,336.96	80.60%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,306,539.75	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研部	-

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	-

- 注： 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
 2、本基金的基金经理持有本基金的区间为：0.00 份（含）。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	11,836,975,021.49
本报告期基金总申购份额	4,596,301,993.80
减：本报告期基金总赎回份额	11,024,554,731.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	5,408,722,284.23

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

涉及基金管理人的重大人事变动：1、基金管理人于 2015 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》，吴姚东不再担任博时基金管理有限公司总经理职务，由王德英代任总经理职务。2、基金管理人于 2015 年 6 月 20 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》，徐卫担任博时基金管理有限公司副总经理职务。3、基金管理人于 2015 年 7 月 10 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》，江向阳担任博时基金管理有限公司总经理职务。4、基金管理人于 2015 年 8 月 8 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》，张光华任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人，洪小源不再任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

本报告期内无涉及基金托管人的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提

供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月，我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求公司对后台权限设置等问题进行改正，我司立即进行了改正并已经完成了验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	3	8,429,272,101.58	34.00%	7,673,979.73	37.61%	-
财富里昂	1	4,024,848,819.50	16.23%	2,859,273.23	14.01%	-
新时代	2	2,384,315,114.57	9.62%	1,693,820.63	8.30%	-
招商证券	3	1,829,336,512.87	7.38%	1,481,034.63	7.26%	-
高华证券	1	1,387,883,737.76	5.60%	1,263,534.89	6.19%	-
华创证券	1	1,240,058,005.47	5.00%	880,925.40	4.32%	-
银河证券	1	1,236,272,356.13	4.99%	1,125,477.13	5.52%	-
瑞银证券	1	985,967,528.73	3.98%	897,623.79	4.40%	-
中金公司	1	977,954,072.49	3.94%	890,332.94	4.36%	-
万联证券	1	858,196,443.94	3.46%	609,659.31	2.99%	新增
民生证券	1	546,568,923.73	2.20%	388,243.25	1.90%	-
国金证券	1	492,759,678.70	1.99%	350,056.41	1.72%	新增
华福证券	1	366,209,018.69	1.48%	260,138.33	1.27%	新增
国泰君安	4	34,059,124.64	0.14%	31,007.49	0.15%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/30
2	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/27
3	博时基金管理有限公司关于参加数米基金销售有限公司认申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/27
4	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/26
5	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/25
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
7	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加上海好买基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/20
8	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、上海证券报、证券时报	2015/6/20
9	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/19
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/17
11	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/16
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/12
13	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/11

14	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/6
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/4
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/3
17	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/2
18	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/6/1
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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/28
20	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/27
21	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/22
22	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/21
23	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/20
24	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/15
25	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/14
26	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/13
27	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/12
28	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/11
29	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/7
30	博时基金管理有限公司关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/5/7
31	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/30
32	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/30
33	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司认、申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/25
34	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/23
35	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/14
36	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、上海证券报、证券时报	2015/4/13
37	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/11
38	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期	中国证券报、上海证券	2015/4/9

	停牌股票调整估值方法的公告	报、证券时报	
39	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/3
40	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/2
41	关于博时旗下部分开放式基金增加深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并参加其网上交易申购业务及定期定额申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/2
42	关于博时旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
43	关于博时旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
44	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/4/1
45	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/31
46	关于博时旗下部分开放式基金增加北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参加其网上交易和手机交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/30
47	关于博时旗下部分开放式基金增加苏州银行股份有限公司为代销机构并参加其网上银行、手机银行和柜面申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/27
48	博时基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/26
49	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/26
50	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/24
51	关于博时沪深 300 指数基金新增渣打中国为代销机构并参加其定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/20
52	关于博时旗下部分开放式基金增加泉州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/20
53	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/19
54	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/18
55	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/17
56	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/14
57	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/11
58	关于中国工商银行股份有限公司开通办理博时旗下部分开放式基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/6
59	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/3/3
60	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/27
61	关于博时基金管理有限公司旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/26

62	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/17
63	博时基金管理有限公司关于暂停货币基金快速赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/14
64	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/12
65	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/10
66	关于博时旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司定期定额交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/9
67	关于厦门市鑫鼎盛控股有限公司暂停代理博时旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/2/7
68	关于博时旗下部分基金参加东莞银行股份有限公司网上银行、手机银行申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/31
69	关于博时旗下部分开放式基金参加江苏张家港农村商业银行股份有限公司柜面、网上银行、手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/31
70	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/23
71	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/20
72	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为代销机构并参加其网上交易申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/19
73	公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17
74	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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/17
75	关于博时旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015/1/6

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时裕富沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- 11.1.2 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 11.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 11.1.6 报告期内博时裕富沪深 300 指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一五年八月二十七日