

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2016 年第 2 季度报告

2016 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：二〇一六年七月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	博时沪深 300 指数	
基金主代码	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	
报告期末基金份额总额	4,150,025,955.14 份	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	博时裕富沪深 300A	博时裕富沪深 300C
下属分级基金的交易代码	050002	002385
报告期末下属分级基金的份额总额	4,144,794,935.75 份	5,231,019.39 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2016 年 4 月 1 日-2016 年 6 月 30 日)	
	博时裕富沪深 300A	博时裕富沪深 300C
1. 本期已实现收益	-24,906,969.41	-29,112.88
2. 本期利润	15,472,570.62	-101,225.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0037	-0.0274
4. 期末基金资产净值	4,461,940,412.36	5,620,447.87
5. 期末基金份额净值	1.0765	1.0744

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。

所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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、博时裕富沪深 300A：

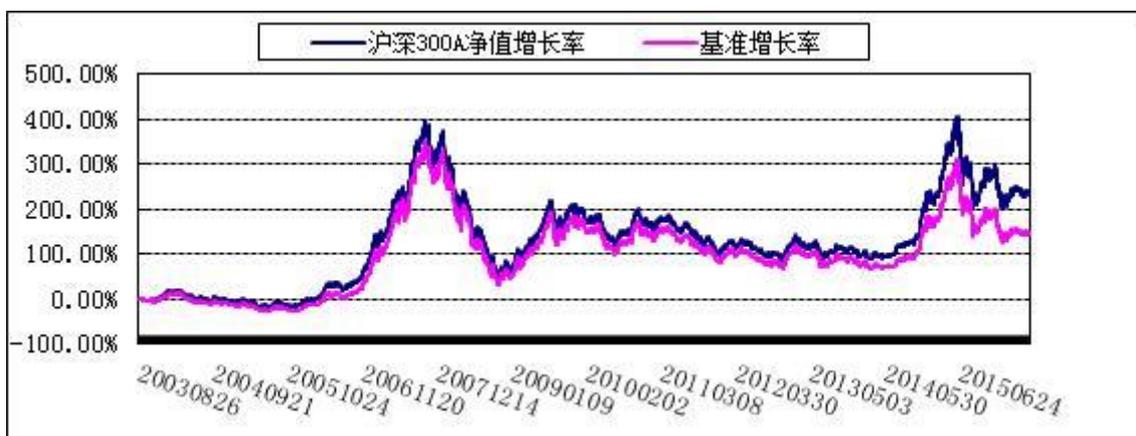
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.33%	1.00%	-1.87%	0.96%	2.20%	0.04%

2、博时裕富沪深 300C：

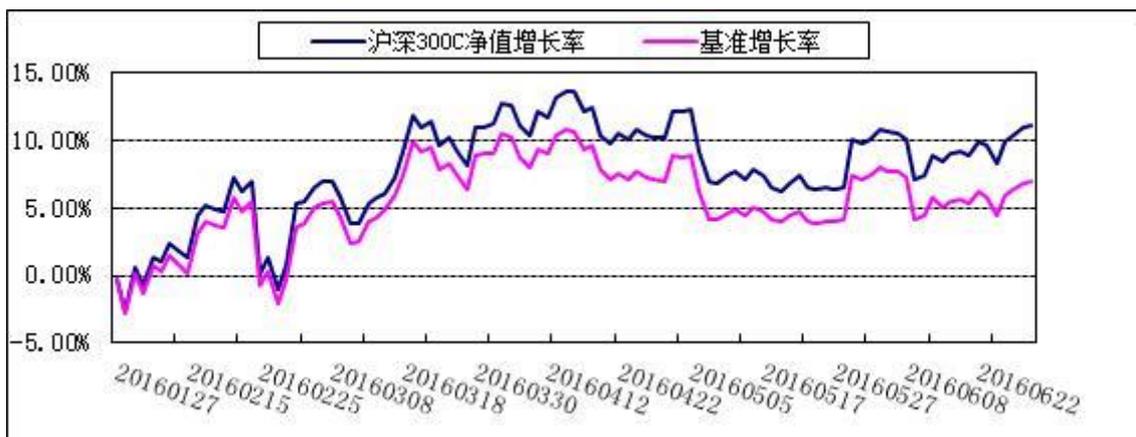
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.23%	1.00%	-1.87%	0.96%	2.10%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

1. 博时裕富沪深 300A：



2. 博时裕富沪深 300C:



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桂征辉	基金经理	2015-07-21	-	6.9	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。现任博时沪深 300 指数基金兼博时中证淘金大数据 100 指数基金、博时银智大数据 100 指数基金的基金经理。
赵云阳	基金经理	2015-05-06	2016-05-30	5.8	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、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、博时证券保险指数分级基金、博时黄金 ETF 基金、博时上证 50ETF 基金、博时上证 50ETF 联接基金、博时银行分级基金、博时黄金 ETF 联接基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 2 季度，上证指数围绕 2900 窄幅震荡，A 股市场整体为结构性行情。基本面支撑的电子、食品饮料、家用电器等板块受到市场追捧，传媒和交通运输等则表现相对落后。本基金利用量化增强手段对组合进行管理，对低估值行银行、家用电器等行业进行适当高配，同时基于多因子模型优选个股，在较小的跟踪误差下，相对基准获得了稳定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0765 元，份额累计净值为 3.0685 元；C 类基金份额净值为 1.0744 元，份额累计净值为 1.0744 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.33%，同期业绩基准增长率-1.87%，C 类基金份额净值增长率为 0.23%，同期业绩基准增长率-1.87%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 下半年，英国脱欧事件影响全球央行的货币政策，美国本年加息概率进一步降低，国外市场风险的加大将缓解国内热钱外流局面。A 股下半年将延续结构化行情，低估值食品饮料、家用电器、银行等行业的行情有望延续；基本面转好的电子、生物医药等行业也有进一步的上涨空间，低估值大盘蓝筹在目前点位仍然具备很好的投资价值。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,142,973,093.75	92.40
	其中：股票	4,142,973,093.75	92.40
2	固定收益投资	154,228,220.50	3.44
	其中：债券	154,228,220.50	3.44
	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	182,458,235.44	4.07
7	其他各项资产	4,109,401.59	0.09
8	合计	4,483,768,951.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	36,674,881.00	0.82
B	采矿业	214,285,529.56	4.80
C	制造业	1,231,473,129.13	27.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	160,009,296.95	3.58
E	建筑业	157,557,144.21	3.53
F	批发和零售业	191,072,844.09	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	123,887,210.09	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,449,602.36	3.21
J	金融业	1,516,722,578.82	33.95
K	房地产业	212,586,340.55	4.76
L	租赁和商务服务业	36,767,898.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	32,995,901.92	0.74
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	85,470,610.97	1.91
S	综合	-	-
	合计	4,142,973,093.75	92.73

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	5,582,434	178,861,185.36	4.00
2	601166	兴业银行	8,912,534	135,827,018.16	3.04
3	600000	浦发银行	6,880,344	107,126,956.08	2.40
4	600030	中信证券	5,215,935	84,654,625.05	1.89
5	600016	民生银行	8,711,130	77,790,390.90	1.74
6	601009	南京银行	7,818,890	73,419,377.10	1.64
7	000002	万科 A	4,014,804	73,069,432.80	1.64
8	000858	五粮液	2,194,000	71,370,820.00	1.60
9	601818	光大银行	18,795,186	70,669,899.36	1.58
10	601668	中国建筑	13,027,193	69,304,666.76	1.55

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	152,965,400.00	3.42
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）	1,262,820.50	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	154,228,220.50	3.45

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019533	16 国债 05	700,000	69,958,000.00	1.57
2	019520	15 国债 20	500,000	49,970,000.00	1.12
3	019527	15 国债 27	220,000	22,013,200.00	0.49
4	019419	14 国债 19	110,000	11,024,200.00	0.25
5	110031	航信转债	11,450	1,262,820.50	0.03

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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投资。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	488,911.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,209,961.82
5	应收申购款	1,410,527.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,109,401.59

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	1,262,820.50	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科 A	73,069,432.80	1.64	公布重大事项

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	博时裕富沪深300A	博时裕富沪深300C
本报告期期初基金份额总额	4,101,614,704.77	1,978,456.88
报告期基金总申购份额	200,142,252.97	7,200,304.20
减:报告期基金总赎回份额	156,962,021.99	3,947,741.69
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,144,794,935.75	5,231,019.39

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	博时裕富沪深300A	博时裕富沪深300C
报告期期初管理人持有的本基金份额	7,881,917.07	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,881,917.07	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.19	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

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 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 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。资产管理净值总规模为 4598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 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，2016 年一季度，博时旗下基金业绩依然领先。

截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

固定收益方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债基金今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；指数债券型基金里，博时上证企债 30ETF 今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第四，博时现金收益货币，今年以来净值增长率在同类 194 只基金中排名前 2/5；博时安丰 18 定期开放债券，今年以来净值增长率在同类 45 只中排名第四。

QDII 基金中，博时亚洲票息，今年以来至 6 月 30 日净值增长 7.12%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名第二。

2、其他大事件

•2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

•由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

•2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金凭借在固定收益投资领域的突出表现，荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 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

9.1.2 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》

9.1.3 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 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

二〇一六年七月二十日