

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 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：二〇一八年八月二十九日

§ 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 2018 年 8 月 28 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 2018 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	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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41

§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 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	4,342,167,741.23 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
下属分级基金的交易代码	050002	002385	960022
报告期末下属分级基金的份额总额	4,170,126,302.46 份	172,040,438.77 份	1,000.00 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
	联系电话	0755-83169999
	电子邮箱	service@bosera.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	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）		
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
本期已实现收益	68,941,157.71	2,442,250.80	2.88
本期利润	-657,304,010.84	-32,071,234.18	-135.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1597	-0.2203	-0.1358
本期加权平均净值利润率	-10.97%	-15.20%	-11.04%
本期基金份额净值增长率	-9.94%	-10.12%	-10.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 6 月 30 日）		
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
期末可供分配利润	1,383,924,836.64	33,093,382.46	113.71
期末可供分配基金份额利润	0.3319	0.1924	0.1137
期末基金资产净值	5,554,051,139.10	227,278,342.85	1,113.71
期末基金份额净值	1.3319	1.3211	1.1137
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018 年 6 月 30 日）		
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
基金份额累计净值增长率	327.45%	36.89%	11.51%

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

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	-4.24%	1.25%	-7.28%	1.22%	3.04%	0.03%
过去三个月	-6.95%	1.09%	-9.44%	1.08%	2.49%	0.01%
过去六个月	-9.94%	1.16%	-12.24%	1.10%	2.30%	0.06%
过去一年	1.65%	0.96%	-3.95%	0.90%	5.60%	0.06%
过去三年	-1.60%	1.49%	-20.15%	1.41%	18.55%	0.08%
自基金合同生效起至今	327.45%	1.61%	176.82%	1.61%	150.63%	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	-4.28%	1.25%	-7.28%	1.22%	3.00%	0.03%
过去三个月	-7.04%	1.09%	-9.44%	1.08%	2.40%	0.01%
过去六个月	-10.12%	1.16%	-12.24%	1.10%	2.12%	0.06%
过去一年	1.25%	0.96%	-3.96%	0.90%	5.21%	0.06%
自基金合同生效起至今	36.89%	0.95%	18.60%	0.90%	18.29%	0.05%

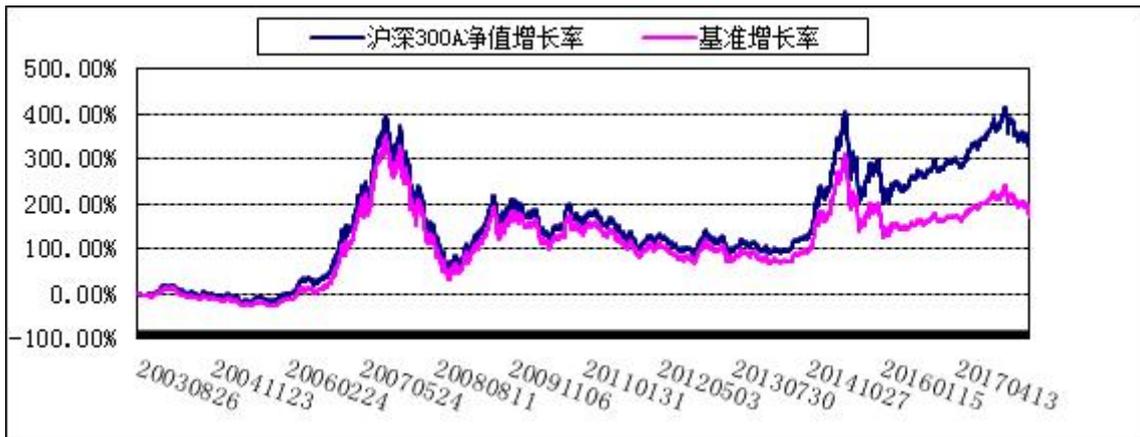
博时沪深 300 指数 R

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
过去一个月	-4.91%	1.23%	-7.28%	1.22%	2.37%	0.01%
过去三个月	-7.90%	1.09%	-9.44%	1.08%	1.54%	0.01%
过去六个月	-10.87%	1.16%	-12.24%	1.10%	1.37%	0.06%
过去一年	-0.58%	0.96%	-3.96%	0.90%	3.38%	0.06%
自基金合同生效起至今	11.51%	0.83%	4.98%	0.78%	6.53%	0.05%

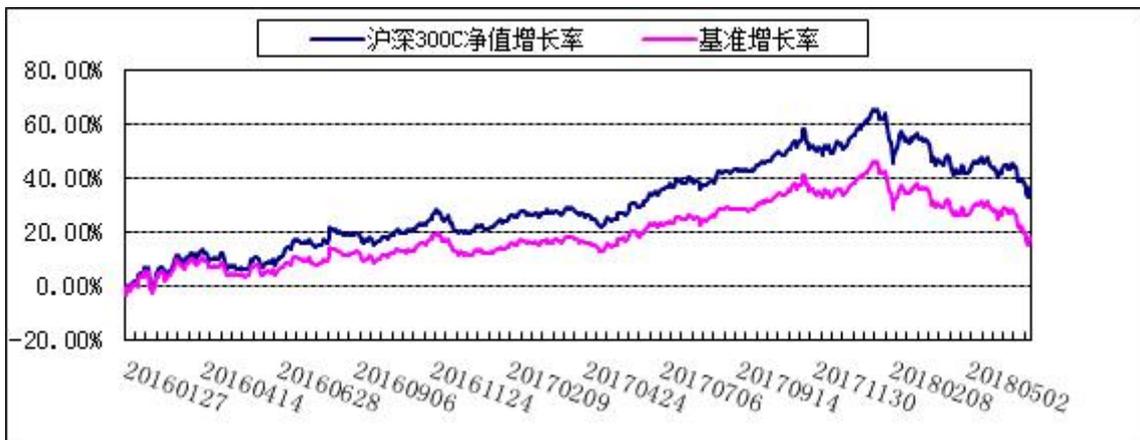
注：自基金成立至 2004 年 12 月 31 日，本基金业绩比较基准为新华富时 A200 复合指数；自 2005 年 1 月 1 日起，本基金业绩比较基准为 95% 的沪深 300 指数+5% 的银行同业存款利率。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

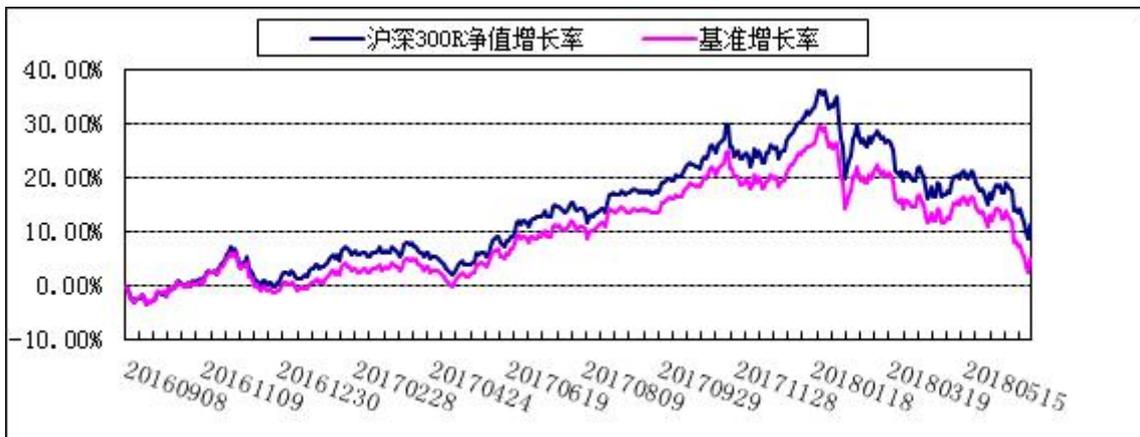
博时沪深 300 指数 A



博时沪深 300 指数 C



博时沪深 300 指数 R



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2018 年 06 月 30 日，博时基金公

司共管理 185 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，管理资产总规模逾 8461 亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾 1947 亿元人民币，累计分红逾 872 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，截至 2018 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时中证银联智惠大数据 100 指数(A 类)、博时裕富沪深 300 指数(A 类)等今年以来净值增长率同类排名为前 1/4；股票型分级子基金里，博时中证银行分级指数(B 级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前 1/3；混合偏股型基金中，博时创业成长混合(C 类)今年以来净值增长率同类基金排名第一，博时创业成长混合(A 类)今年以来净值增长率同类基金排名位居前 1/10，博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前 1/3；混合灵活配置型基金中，博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 3.14%，在 166 只同类基金排名第 6，博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 4.38%，同类基金排名位居前 1/10，博时新价值灵活配置混合(A 类)、博时新策略灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率分别为 2.12%、1.93%、1.65%、1.60%，同类基金排名均位居前 1/8，博时新价值灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率为 2.07%，同类基金中排名位于前 1/6。

黄金基金类，博时黄金 ETF 联接(A 类)、博时黄金 ETF 联接(C 类)今年以来净值增长率同类排名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时天颐债券(A 类)、博时宏观回报债券(A/B 类)、博时信用债券(A/B 类)今年以来净值增长率为 5.11%、4.56%、4.54%，同类 219 只基金中分别排名第 3、第 8、第 9 位，博时天颐债券(C 类)、博时信用债券(R 类)、博时信用债券(C 类)、博时宏观回报债券(C 类)今年以来净值增长率分别为 4.88%、4.56%、4.34%、4.23%，同类 153 只基金中分别排名第 2、第 4、第 7、第 8 位，博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为 4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%，同类排名前 1/10；货币基金类，博时兴荣货币、博时合惠货币(A 类)今年以来净值增长率分别为 2.21%、2.18%，在 315 只同类基金排名中位列第 15 位与第 24 位。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF(QDII)、博时标普 500ETF 联接(QDII)(A 类)，今年以来净值增长率同类排名分别位于前 1/5、1/4。

2、其他大事件

2018 年 6 月 8 日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017 年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018 年 5 月 24 日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业 20 年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾 23 年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业 20 年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有 20 人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继 2016 年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018 年 5 月 23 日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募 20 年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金（000277）获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券（QDII）（人民币 050030：，美元现汇：050202，美元现钞：050203）获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018 年 5 月 17 日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖（DevOps 统一研发平台）、三等奖（证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试）以及优秀奖（新一代基金理财综合业务接入平台）三项大奖，成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018 年 5 月 10 日，由《上海证券报》主办的“2018 中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上，博时基金揽获“金基金 TOP 基金公司”这一最具份量的公司大奖；博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报基金经理奖”。在第 15 届金基金奖评选中，旗下价值投资典范产品博时主题行业（160505）获得“三年期金基金分红奖”。

2018 年 3 月 26 日，第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业 20 年卓越贡献公司”大奖。同时，旗下绩优产品博时主题行业混合（LOF）（160505）荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018 年 3 月 22 日，由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金 20 周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼”在北京举办，本次评选中，博时基金一举斩获本届“20 周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金 20 年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖，同时，旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金（二级债）”奖双双收入囊中，博时聚润纯债债券则获得“2017 年度普通债券型明星基金”奖。

2018 年 2 月 2 日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”

年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018 年 1 月 11 日，由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业 20 年最佳创新产品奖颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”，旗下产品博时主题行业混合基金（160505）和博时黄金 ETF 分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”，成为当天最大赢家之一。

2018 年 1 月 9 日，由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017 年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

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		
桂征辉	基金经理	2015-07-21	-	8.9	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（2015.7.21-至今）兼博时中证淘金大数据 100 指数基金（2015.7.21-至今）、博时银智大数据 100 指数基金（2016.5.20-至今）、博时中证 500 指数增强基金（2017.9.26-至今）、博时富时中国 A 股指数基金（2018.6.12-至今）的基金经理。
陈晓志	基金经理助理	2015-11-16	2018-02-08	9.7	2007 年至 2008 年在华为技术有限公司工作。2008 年加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级开发经理、基金经理助理。现任投资经理。

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。

4.2 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

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

2018 年上半年，A 股市场短暂上涨后进入下跌通道，上证综指累计跌幅达 13.90%，一度下探到 2800 点以下，最终收于 2847 点。风格方面，市场在下跌中，小盘跌幅更大。行业方面医药、餐饮旅游行业大幅跑赢市场，综合、地产行业表现落后。本基金在严格控制与指数跟踪偏离的基础上，利用数量化手段对组合进行管理，相对基准获得了稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.3319 元，份额累计净值为 1.3368 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.3211 元，份额累计净值为 1.3229 元，本基金 R 类基金份额净值为 1.1137 元，份额累计净值为 1.1154 元。报告期内，本基金 A 基金份额净值增长率为-9.94%，本基金 C 基金份额净值增长率为-10.12%，本基金 R 基金份额净值增长率为-10.87%，同期业绩基准增长率-12.24%。

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 2018 年三季度，经济下行压力势头开始加大，中美利率政策脱钩，推动利率下行，十年期国债收益率跌破 3.5%，而且仍处下行势头；人民币汇率跌破 6.6，贬值的势头也并没有释放完毕。资管新规和贸易战是内外主要风险点。二季度 A 股市场持续调整之下，A 股市场估值整体处于合理甚至偏低的区间，三季度已经处于提升 A 股配置非常好的时间窗口。从估值水平来看，沪深 300 处于历史上 30% 低位，而中证 500 处于 10% 的相对估值低位。行业方面，随着利率下行，重点关注成长板块和低估的银行地产行业，注意捕捉市场的结构性行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了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、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

本基金报告期内共进行 1 次分红，以 2017 年 12 月 29 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 0.0490 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0180 元人民币，本基金 R 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0170 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，博时沪深 300 指数 A 实施利润分配的金额为 253,122.52 元

报告期内，博时沪深 300 指数 C 实施利润分配的金额为 18,420,329.71 元

报告期内，博时沪深 300 指数 R 实施利润分配的金额为 1.70 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	475,062,679.46	167,534,589.60
结算备付金		16,334,594.46	12,686,751.33
存出保证金		978,417.32	563,718.96
交易性金融资产	6.4.3.2	5,300,948,884.59	5,629,044,900.46
其中：股票投资		5,260,414,680.79	5,459,165,089.06
基金投资		-	-
债券投资		40,534,203.80	169,879,811.40
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		-	24,999,992.93
应收利息	6.4.3.5	189,519.23	3,190,960.72
应收股利		-	-
应收申购款		11,043,411.86	9,861,459.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		5,804,557,506.92	5,847,882,373.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		144,523.73	-
应付赎回款		7,249,424.50	8,755,442.02
应付管理人报酬		4,750,646.39	4,805,101.56
应付托管费		969,519.66	980,632.97

应付销售服务费		65,127.58	42,562.80
应付交易费用	6.4.3.7	9,571,751.16	7,352,461.63
应交税费		382.03	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	475,536.21	584,857.30
负债合计		23,226,911.26	22,521,058.28
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	4,342,167,741.23	3,927,737,497.80
未分配利润	6.4.3.10	1,439,162,854.43	1,897,623,817.28
所有者权益合计		5,781,330,595.66	5,825,361,315.08
负债和所有者权益总计		5,804,557,506.92	5,847,882,373.36

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额总额 4,342,167,741.23 份。其中 A 类基金份额净值 1.3319 元，基金份额总额 4,170,126,302.46 份；C 类基金份额净值 1.3211 元，基金份额总额 172,040,438.77 份；R 类基金份额净值 1.1137 元，基金份额总额 1,000.00 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-629,657,539.64	650,347,510.48
1. 利息收入		2,861,834.01	2,247,284.45
其中：存款利息收入	6.4.3.11	1,388,158.28	664,751.21
债券利息收入		1,419,556.28	1,494,205.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		54,119.45	88,327.48
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		126,821,434.62	228,677,832.92
其中：股票投资收益	6.4.3.12	63,948,022.28	186,114,472.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	1,186,264.51	-52,719.40
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	61,687,147.83	42,616,079.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-760,758,792.17	418,854,219.15
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	1,417,983.90	568,173.96
减：二、费用		59,717,841.14	50,674,856.93
1. 管理人报酬		30,143,287.21	24,460,501.82

2. 托管费		6,151,691.27	4,991,939.05
3. 销售服务费		416,077.61	78,533.74
4. 交易费用	6.4.3.18	22,778,154.55	20,916,227.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		239.89	-
7. 其他费用	6.4.3.19	228,390.61	227,654.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-689,375,380.78	599,672,653.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-689,375,380.78	599,672,653.55

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	3,927,737,497.80	1,897,623,817.28	5,825,361,315.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-689,375,380.78	-689,375,380.78
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）	414,430,243.43	249,587,871.86	664,018,115.29
其中：1. 基金申购款	1,651,209,683.01	842,052,651.75	2,493,262,334.76
2. 基金赎回款	-1,236,779,439.58	-592,464,779.89	-1,829,244,219.47
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）	-	-18,673,453.93	-18,673,453.93
五、期末所有者权益（基金净值）	4,342,167,741.23	1,439,162,854.43	5,781,330,595.66
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	3,995,187,462.98	670,412,799.49	4,665,600,262.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	599,672,653.55	599,672,653.55
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）	145,986,425.72	31,531,510.28	177,517,936.00
其中：1. 基金申购款	747,929,936.77	173,866,301.82	921,796,238.59

2. 基金赎回款	-601,943,511.05	-142,334,791.54	-744,278,302.59
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）	4,141,173,888.70	1,301,616,963.32	5,442,790,852.02

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 主管会计工作的负责人：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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》、深府办[2011]60号《深圳市地方教育附加征收管理暂行办法》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。

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

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

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

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	475,062,679.46
定期存款	-
其他存款	-
合计	475,062,679.46

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,308,601,309.23	5,260,414,680.79	-48,186,628.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	40,534,203.80	1,082,805.68
	银行间市场	-	-
	合计	40,534,203.80	1,082,805.68
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,348,052,707.35	5,300,948,884.59	-47,103,822.76

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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	94,286.55
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	7,350.60
应收债券利息	87,441.78
应收资产支持证券利息	-
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	440.30
合计	189,519.23

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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	9,571,751.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,571,751.16

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	17,106.24
其他应付款	156.89
预提费用	208,273.08
合计	475,536.21

6.4.3.9 实收基金
博时沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	3,819,114,828.01	3,819,114,828.01
本期申购	1,290,380,141.89	1,290,380,141.89

本期赎回（以“-”号填列）	-939,368,667.44	-939,368,667.44
本期末	4,170,126,302.46	4,170,126,302.46

博时沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	108,621,669.79	108,621,669.79
本期申购	360,829,541.12	360,829,541.12
本期赎回（以“-”号填列）	-297,410,772.14	-297,410,772.14
本期末	172,040,438.77	172,040,438.77

博时沪深 300 指数 R

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,000.00	1,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,000.00	1,000.00

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
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	2,745,162,111.66	-898,757,210.76	1,846,404,900.90
本期利润	68,941,157.71	-726,245,168.55	-657,304,010.84
本期基金份额交易产生的变动数	255,543,956.46	-42,299,680.17	213,244,276.29
其中：基金申购款	941,118,569.36	-276,228,735.05	664,889,834.31
基金赎回款	-685,574,612.90	233,929,054.88	-451,645,558.02
本期已分配利润	-18,420,329.71	-	-18,420,329.71
本期末	3,051,226,896.12	-1,667,302,059.48	1,383,924,836.64

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	19,489,667.31	31,728,997.90	51,218,665.21
本期利润	2,442,250.80	-34,513,484.98	-32,071,234.18
本期基金份额交易产生的变动数	11,414,586.87	24,929,008.70	36,343,595.57
其中：基金申购款	69,282,813.19	107,880,004.25	177,162,817.44
基金赎回款	-57,868,226.32	-82,950,995.55	-140,819,221.87
本期已分配利润	-253,122.52	-	-253,122.52
本期末	33,093,382.46	22,144,521.62	55,237,904.08

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	165.58	85.59	251.17
本期利润	2.88	-138.64	-135.76
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	-1.70	-	-1.70
本期末	166.76	-53.05	113.71

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,244,890.75
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	114,248.11
其他	29,019.42
合计	1,388,158.28

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,375,207,183.20
减：卖出股票成本总额	8,311,259,160.92
买卖股票差价收入	63,948,022.28

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	188,281,751.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	182,586,214.40
减：应收利息总额	4,509,272.96
买卖债券差价收入	1,186,264.51

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	61,687,147.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	61,687,147.83

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-760,758,792.17
——股票投资	-761,546,936.45
——债券投资	788,144.28
——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	-760,758,792.17

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	1,346,772.82
基金转换费收入	71,211.08
合计	1,417,983.90

注：1. 本基金 A 类份额赎回费的 25% 归入基金资产，R 类基金份额的赎回费率为固定值 0.125%，赎回费用全部归入基金资产，C 类基金份额不收取赎回费。

2. 基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中 A 类转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产，R 类转出基金的赎回费的 100% 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 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	22,778,154.55
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	22,778,154.55

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	11,117.53
中债登帐户维护费	9,000.00

合计	228,390.61
----	------------

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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	3,502,257,325.02	20.36%	1,776,102,774.99	11.81%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

无。

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	2,561,532.87	19.89%	1,528,115.09	15.96%
关联方名称	上年度可比期间			

	2017 年 1 月 1 日至 2017 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	1,654,094.98	13.63%	1,654,094.98	16.08%

注：1. 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。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	30,143,287.21	24,460,501.82
其中：支付销售机构的客户维护费	3,574,694.51	2,635,820.49

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,151,691.27	4,991,939.05

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。

6.4.6.2.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	合计
博时基金	-	270,010.50	-	270,010.50
合计	-	270,010.50	-	270,010.50
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	合计
博时基金	-	32,841.65	-	32,841.65
合计	-	32,841.65	-	32,841.65

注：本基金 A 类和 R 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.40% / 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

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
期初持有的基金份额	-	-	-	7,881,917.07	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-	7,881,917.07	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	0.19%	-	-

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 2018年1月1日至2018年6月 30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	475,062,679.46	1,244,890.75	262,014,430.43	547,999.42

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

6.4.6.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 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
1	2018-01-16	2018-01-16	0.049	10,740,105.67	7,680,224.04	18,420,329.71	-
合计			0.049	10,740,105.67	7,680,224.04	18,420,329.71	-

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
1	2018-01-16	2018-01-16	0.018	149,814.36	103,308.16	253,122.52	-
合计			0.018	149,814.36	103,308.16	253,122.52	-

博时沪深 300 指数 R

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
1	2018-01-16	2018-01-16	0.017	1.70	-	1.70	-
合计			0.017	1.70	-	1.70	-

6.4.8 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股未上市	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股未上市	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85	-
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	首次公开发行限售	13.77	16.40	843,680.00	11,617,473.60	13,836,352.00	-
603993	洛阳钼业	2017-07-26	2018-07-24	非公开发行限售	3.82	6.12	3,920,628.00	14,976,798.96	23,994,243.36	-
603993	洛阳钼业	2017-07-26	2019-07-24	非公开发行限售	3.82	5.50	3,920,629.00	14,976,802.78	21,563,459.50	-
601233	桐昆股份	2017-12-01	2018-11-29	非公开发行限售	14.40	15.88	347,222.00	4,999,996.80	5,513,885.36	-
601233	桐昆股份	2017-12-01	2018-11-29	非公开发行限售送股	-	15.88	138,889.00	-	2,205,557.32	-
601233	桐昆股份	2017-12-01	2019-11-29	非公开发行限售	14.40	15.07	347,222.00	4,999,996.80	5,232,635.54	-
601233	桐昆股份	2017-12-01	2019-11-29	非公开发行限售送股	-	15.07	138,889.00	-	2,093,057.23	-
002798	帝欧家居	2018-01-19	2019-01-22	非公开发行限售	47.18	27.38	105,977.00	4,999,994.86	2,901,650.26	-
002798	帝欧家居	2018-01-19	2019-01-22	非公开发行限售送股	-	27.38	74,184.00	-	2,031,157.92	-
002798	帝欧家居	2018-01-19	2020-01-22	非公开发行限售	47.18	25.82	105,977.00	4,999,994.86	2,736,326.14	-
002798	帝欧家居	2018-01-19	2020-01-22	非公开发行限售送股	-	25.82	74,184.00	-	1,915,430.88	-
600446	金证股份	2018-01-09	2019-01-07	非公开发行限售	14.23	10.07	351,370.00	4,999,995.10	3,538,295.90	-
600446	金证股份	2018-01-09	2020-01-06	非公开发行限售	14.23	9.70	351,371.00	5,000,009.33	3,408,298.70	-
603599	广信股份	2018-01-12	2019-01-09	非公开发行限售	16.27	13.47	153,657.00	2,499,999.39	2,069,759.79	-
603599	广信股份	2018-01-12	2020-01-09	非公开发行限售	16.27	13.18	153,657.00	2,499,999.39	2,025,199.26	-
601225	陕西煤业	2018-05-09	2018-11-09	大宗交易限售	7.48	7.86	4,100,000.00	30,668,000.00	32,226,000.00	-
002680	长生生物	2018-06-26	2018-12-26	大宗交易限售	18.70	20.47	800,000.00	14,960,000.00	16,376,000.00	-
300567	精测电子	2018-04-26	2018-10-26	大宗交易限售	151.11	74.55	65,000.00	9,822,150.00	4,845,750.00	-
300567	精测电子	2018-04-26	2018-10-26	大宗交易限售送股	-	74.55	65,000.00	-	4,845,750.00	-
300567	精测电子	2018-05-10	2018-11-12	大宗交易限售	144.54	74.33	80,000.00	11,563,200.00	5,946,400.00	-
300567	精测电子	2018-05-10	2018-11-12	大宗交易限售送股	-	74.33	80,000.00	-	5,946,400.00	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	5,029,300.00	37,670,411.07	37,568,871.00	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项停牌	6.00	-	-	4,024,200.00	22,331,276.68	24,145,200.00	-
002359	北讯集团	2018-05-21	重大事项停牌	19.58	2018-08-21	17.62	488,650.00	13,077,634.56	9,567,767.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事	5.84	2018-07-17	5.26	946,980.00	6,602,461.62	5,530,363.20	-

			项停牌							
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事 项停牌	8.37	-	-	654,501.00	7,781,749.68	5,478,173.37	-
600745	闻泰科技	2018-04-17	重大事 项停牌	30.48	-	-	178,800.00	4,634,150.17	5,449,824.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事 项停牌	16.60	2018-07-31	16.50	247,200.00	3,832,067.00	4,103,520.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大事 项停牌	18.08	-	-	73,200.00	1,257,619.00	1,323,456.00	-

注：本基金截至 2018 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

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。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行建设银行，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 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.7% (2017 年 12 月 31 日：0.55%)。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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。

于 2018 年 06 月 30 日，本基金未持有卖出回购金融资产，本基金所承担的全部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(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。

6.4.9.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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。

本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的

开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.8。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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%。

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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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，债券投资，结算备付金，存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	475,062,679.46	-	-	-	475,062,679.46
结算备付金	16,334,594.46	-	-	-	16,334,594.46
存出保证金	978,417.32	-	-	-	978,417.32

交易性金融资产	21,156,693.80	16,014,558.80	3,362,951.20	5,260,414,680.79	5,300,948,884.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	189,519.23	189,519.23
应收申购款	-	-	-	11,043,411.86	11,043,411.86
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	513,532,385.04	16,014,558.80	3,362,951.20	5,271,647,611.88	5,804,557,506.92
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,249,424.50	7,249,424.50
应付证券清算款	-	-	-	144,523.73	144,523.73
应付管理人报酬	-	-	-	4,750,646.39	4,750,646.39
应付托管费	-	-	-	969,519.66	969,519.66
应付销售服务费	-	-	-	65,127.58	65,127.58
应交税费	-	-	-	382.03	382.03
应付交易费用	-	-	-	9,571,751.16	9,571,751.16
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	475,536.21	475,536.21
负债总计	-	-	-	23,226,911.26	23,226,911.26
利率敏感度缺口	513,532,385.04	16,014,558.80	3,362,951.20	5,248,420,700.62	5,781,330,595.66
上年度末 2017 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	167,534,589.60	-	-	-	167,534,589.60
结算备付金	12,686,751.33	-	-	-	12,686,751.33
存出保证金	563,718.96	-	-	-	563,718.96
交易性金融资产	137,795,700.00	14,693,185.90	17,390,925.50	5,459,165,089.06	5,629,044,900.46
应收证券清算款	-	-	-	24,999,992.93	24,999,992.93
应收利息	-	-	-	3,190,960.72	3,190,960.72
应收申购款	-	-	-	9,861,459.36	9,861,459.36
资产总计	318,580,759.89	14,693,185.90	17,390,925.50	5,497,217,502.07	5,847,882,373.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,755,442.02	8,755,442.02
应付管理人报酬	-	-	-	4,805,101.56	4,805,101.56
应付托管费	-	-	-	980,632.97	980,632.97
应付销售服务费	-	-	-	42,562.80	42,562.80
应付交易费用	-	-	-	7,352,461.63	7,352,461.63
其他负债	-	-	-	584,857.30	584,857.30
负债总计	-	-	-	22,521,058.28	22,521,058.28
利率敏感度缺口	318,580,759.89	14,693,185.90	17,390,925.50	5,474,696,443.79	5,825,361,315.08

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予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 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 0.70% (2017 年 12 月 31 日：2.92%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 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币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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	5,260,414,680.79	90.99	5,459,165,089.06	93.71
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	5,260,414,680.79	90.99	5,459,165,089.06	93.71

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 29,150	增加约 29,352
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 29,150	减少约 29,352

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 2018 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 5,042,458,541.01 元，属于第二层次的余额为 258,490,343.58 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 5,265,857,686.14 元，第二层次 363,187,214.32 元，无属于第三层次的余额)。

(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和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产
	权益工具投资
2018 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	38,797,076.00
转出第三层次	-35,181,960.00
当期利得或损失总额	-3,615,116.00
—计入损益的利得或损失	-3,615,116.00
2018 年 6 月 30 日	-
2018 年 6 月 30 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益(从年初起算)	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

于 2017 年度，本基金无第三层次资产变动。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 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	5,260,414,680.79	90.63
	其中：股票	5,260,414,680.79	90.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,534,203.80	0.70
	其中：债券	40,534,203.80	0.70
	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	491,397,273.92	8.47
8	其他各项资产	12,211,348.41	0.21
9	合计	5,804,557,506.92	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	6,278,097.00	0.11
B	采矿业	207,958,969.72	3.60
C	制造业	2,179,124,916.38	37.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	135,411,467.05	2.34
E	建筑业	188,691,741.50	3.26
F	批发和零售业	148,427,580.40	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	131,541,794.27	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	179,022,241.37	3.10
J	金融业	1,620,339,180.57	28.03

K	房地产业	280,185,512.31	4.85
L	租赁和商务服务业	115,968,508.08	2.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	67,383,446.00	1.17
S	综合	-	-
	合计	5,260,414,680.79	90.99

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	5,267,134	308,548,709.72	5.34
2	600519	贵州茅台	180,009	131,669,383.14	2.28
3	601288	农业银行	36,728,322	126,345,427.68	2.19
4	002415	海康威视	3,319,387	123,248,839.31	2.13
5	000651	格力电器	2,597,792	122,485,892.80	2.12
6	600030	中信证券	6,540,028	108,368,263.96	1.87
7	000333	美的集团	2,073,611	108,283,966.42	1.87
8	002304	洋河股份	816,700	107,477,720.00	1.86
9	601398	工商银行	17,569,100	93,467,612.00	1.62
10	600028	中国石化	14,029,894	91,054,012.06	1.57
11	601009	南京银行	11,753,200	90,852,236.00	1.57
12	601186	中国铁建	10,265,700	88,490,334.00	1.53
13	002008	大族激光	1,656,500	88,109,235.00	1.52
14	000858	五粮液	1,148,800	87,308,800.00	1.51
15	600104	上汽集团	2,485,347	86,962,291.53	1.50
16	601006	大秦铁路	10,480,000	86,040,800.00	1.49
17	600015	华夏银行	11,311,800	84,272,910.00	1.46
18	601601	中国太保	2,533,004	80,676,177.40	1.40
19	601988	中国银行	22,305,600	80,523,216.00	1.39
20	600016	民生银行	11,315,830	79,210,810.00	1.37
21	601998	中信银行	12,466,300	77,415,723.00	1.34
22	600900	长江电力	4,721,232	76,200,684.48	1.32
23	002146	荣盛发展	8,268,957	72,187,994.61	1.25
24	000338	潍柴动力	8,173,000	71,513,750.00	1.24
25	601888	中国国旅	1,025,800	66,071,778.00	1.14
26	600050	中国联通	13,280,000	65,337,600.00	1.13
27	601688	华泰证券	4,360,000	65,269,200.00	1.13
28	601628	中国人寿	2,887,544	65,027,490.88	1.12
29	600406	国电南瑞	3,947,200	62,365,760.00	1.08
30	600585	海螺水泥	1,859,600	62,259,408.00	1.08
31	601328	交通银行	10,660,400	61,190,696.00	1.06
32	002422	科伦药业	1,890,400	60,681,840.00	1.05
33	600887	伊利股份	2,170,500	60,556,950.00	1.05

34	002001	新和成	3,157,560	59,867,337.60	1.04
35	600741	华域汽车	2,454,700	58,225,484.00	1.01
36	000002	万科 A	2,259,705	55,588,743.00	0.96
37	000001	平安银行	5,864,100	53,304,669.00	0.92
38	300251	光线传媒	5,073,800	51,651,284.00	0.89
39	600216	浙江医药	3,894,400	49,731,488.00	0.86
40	600566	济川药业	1,003,023	48,335,678.37	0.84
41	603993	洛阳钼业	7,841,257	45,557,702.86	0.79
42	002027	分众传媒	4,635,984	44,366,366.88	0.77
43	600426	华鲁恒升	2,492,100	43,836,039.00	0.76
44	000425	徐工机械	10,271,800	43,552,432.00	0.75
45	600837	海通证券	4,565,400	43,234,338.00	0.75
46	603799	华友钴业	438,500	42,740,595.00	0.74
47	600690	青岛海尔	2,123,328	40,895,297.28	0.71
48	600309	万华化学	895,160	40,658,167.20	0.70
49	601155	新城控股	1,237,950	38,339,311.50	0.66
50	601003	柳钢股份	4,768,400	37,765,728.00	0.65
51	601390	中国中铁	5,029,300	37,568,871.00	0.65
52	600729	重庆百货	1,090,000	35,915,500.00	0.62
53	601618	中国中冶	10,060,470	33,501,365.10	0.58
54	600031	三一重工	3,639,700	32,648,109.00	0.56
55	601225	陕西煤业	4,100,000	32,226,000.00	0.56
56	002142	宁波银行	1,922,100	31,311,009.00	0.54
57	601997	贵阳银行	2,530,800	31,280,688.00	0.54
58	601899	紫金矿业	8,430,600	30,434,466.00	0.53
59	600567	山鹰纸业	7,587,356	29,287,194.16	0.51
60	601877	正泰电器	1,276,600	28,493,712.00	0.49
61	601211	国泰君安	1,870,598	27,572,614.52	0.48
62	000069	华侨城 A	3,798,050	27,459,901.50	0.47
63	000717	韶钢松山	4,024,700	26,402,032.00	0.46
64	600681	百川能源	1,923,087	24,923,207.52	0.43
65	000895	双汇发展	930,900	24,585,069.00	0.43
66	000825	太钢不锈	4,024,200	24,145,200.00	0.42
67	600859	王府井	1,132,300	24,084,021.00	0.42
68	000963	华东医药	496,550	23,958,537.50	0.41
69	600009	上海机场	428,804	23,790,045.92	0.41
70	600708	光明地产	5,416,849	23,292,450.70	0.40
71	600276	恒瑞医药	299,434	22,685,119.84	0.39
72	000537	广宇发展	2,343,400	22,590,376.00	0.39
73	600029	南方航空	2,569,343	21,710,948.35	0.38
74	300567	精测电子	290,000	21,584,300.00	0.37
75	600332	白云山	559,199	21,277,521.95	0.37
76	600655	豫园股份	2,181,364	20,613,889.80	0.36
77	002013	中航机电	2,641,500	19,996,155.00	0.35
78	002311	海大集团	940,500	19,844,550.00	0.34
79	600438	通威股份	2,793,300	19,273,770.00	0.33
80	000876	新希望	2,980,500	18,896,370.00	0.33
81	000999	华润三九	644,800	17,944,784.00	0.31
82	600705	中航资本	3,840,400	17,934,668.00	0.31

83	002680	长生生物	800,000	16,376,000.00	0.28
84	600511	国药股份	607,558	16,373,688.10	0.28
85	600398	海澜之家	1,270,700	16,188,718.00	0.28
86	600153	建发股份	1,701,800	15,299,182.00	0.26
87	002736	国信证券	1,654,100	15,052,310.00	0.26
88	601233	桐昆股份	972,222	15,045,135.45	0.26
89	002078	太阳纸业	1,538,500	14,908,065.00	0.26
90	600000	浦发银行	1,547,900	14,797,924.00	0.26
91	600208	新湖中宝	3,848,900	14,702,798.00	0.25
92	600023	浙能电力	3,093,700	14,416,642.00	0.25
93	000883	湖北能源	3,394,400	13,950,984.00	0.24
94	600048	保利地产	1,143,025	13,944,905.00	0.24
95	601138	工业富联	843,680	13,836,352.00	0.24
96	000830	鲁西化工	785,853	13,422,369.24	0.23
97	002597	金禾实业	644,900	13,078,572.00	0.23
98	601901	方正证券	1,902,100	12,725,049.00	0.22
99	002236	大华股份	549,200	12,384,460.00	0.21
100	600516	方大炭素	500,500	12,202,190.00	0.21
101	600704	物产中大	2,329,400	12,182,762.00	0.21
102	002440	闰土股份	1,041,950	12,180,395.50	0.21
103	600170	上海建工	3,965,800	12,056,032.00	0.21
104	600383	金地集团	1,177,800	12,001,782.00	0.21
105	600535	天士力	460,000	11,877,200.00	0.21
106	300182	捷成股份	1,511,900	11,460,202.00	0.20
107	600588	用友网络	458,030	11,226,315.30	0.19
108	600486	扬农化工	200,100	11,191,593.00	0.19
109	002518	科士达	1,117,490	11,141,375.30	0.19
110	000776	广发证券	838,597	11,128,182.19	0.19
111	601800	中国交建	894,800	10,191,772.00	0.18
112	002626	金达威	575,704	9,988,464.40	0.17
113	002798	帝欧家居	360,322	9,584,565.20	0.17
114	002359	北讯集团	488,650	9,567,767.00	0.17
115	600760	中航沈飞	251,000	9,046,040.00	0.16
116	601788	光大证券	748,700	8,220,726.00	0.14
117	600271	航天信息	292,700	7,396,529.00	0.13
118	601166	兴业银行	488,500	7,034,400.00	0.12
119	600446	金证股份	702,741	6,946,594.60	0.12
120	600801	华新水泥	458,100	6,885,243.00	0.12
121	601668	中国建筑	1,260,690	6,883,367.40	0.12
122	002299	圣农发展	405,300	6,278,097.00	0.11
123	600584	长电科技	364,000	6,166,160.00	0.11
124	600487	亨通光电	278,040	6,130,782.00	0.11
125	600390	五矿资本	788,133	6,108,030.75	0.11
126	002373	千方科技	434,800	5,674,140.00	0.10
127	601229	上海银行	354,000	5,579,040.00	0.10
128	000415	渤海金控	946,980	5,530,363.20	0.10
129	300324	旋极信息	654,501	5,478,173.37	0.09
130	600745	闻泰科技	178,800	5,449,824.00	0.09
131	601336	新华保险	125,300	5,372,864.00	0.09

132	600703	三安光电	275,300	5,291,266.00	0.09
133	601168	西部矿业	810,600	5,090,568.00	0.09
134	000538	云南白药	47,000	5,027,120.00	0.09
135	300098	高新兴	623,500	4,975,530.00	0.09
136	000519	中兵红箭	607,700	4,721,829.00	0.08
137	002230	科大讯飞	141,800	4,547,526.00	0.08
138	300003	乐普医疗	119,200	4,372,256.00	0.08
139	300027	华谊兄弟	693,500	4,271,960.00	0.07
140	300146	汤臣倍健	247,200	4,103,520.00	0.07
141	603599	广信股份	307,314	4,094,959.05	0.07
142	600236	桂冠电力	644,120	3,677,925.20	0.06
143	300467	迅游科技	90,431	2,902,835.10	0.05
144	000975	银泰资源	251,520	2,550,412.80	0.04
145	601908	京运通	533,800	2,444,804.00	0.04
146	300274	阳光电源	260,000	2,332,200.00	0.04
147	600260	凯乐科技	80,900	2,171,356.00	0.04
148	601169	北京银行	348,900	2,103,867.00	0.04
149	000686	东北证券	296,013	1,897,443.33	0.03
150	601818	光大银行	514,579	1,883,359.14	0.03
151	600352	浙江龙盛	129,800	1,551,110.00	0.03
152	000617	中油资本	134,600	1,512,904.00	0.03
153	000666	经纬纺机	73,200	1,323,456.00	0.02
154	603288	海天味业	17,200	1,266,608.00	0.02
155	600886	国投电力	173,600	1,262,072.00	0.02
156	600919	江苏银行	174,200	1,116,622.00	0.02
157	600188	兖州煤业	80,200	1,045,808.00	0.02
158	603833	欧派家居	7,300	930,969.00	0.02
159	601158	重庆水务	167,600	908,392.00	0.02
160	000060	中金岭南	150,200	729,972.00	0.01
161	600184	光电股份	41,180	510,220.20	0.01
162	601989	中国重工	91,100	368,044.00	0.01
163	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.00
164	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.00
165	600340	华夏幸福	3,000	77,250.00	0.00
166	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
167	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
168	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	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	601628	中国人寿	162,521,564.04	2.79
2	601006	大秦铁路	156,871,776.38	2.69
3	601998	中信银行	145,327,314.04	2.49
4	000338	潍柴动力	128,052,633.63	2.20

5	600030	中信证券	117,903,131.46	2.02
6	600015	华夏银行	117,733,925.98	2.02
7	601899	紫金矿业	108,244,293.92	1.86
8	002304	洋河股份	107,899,914.33	1.85
9	600028	中国石化	105,359,092.92	1.81
10	002001	新和成	102,982,904.56	1.77
11	002415	海康威视	100,036,793.38	1.72
12	601186	中国铁建	96,340,590.65	1.65
13	002146	荣盛发展	89,853,205.78	1.54
14	601009	南京银行	83,994,812.92	1.44
15	600050	中国联通	82,001,777.19	1.41
16	601111	中国国航	80,773,767.76	1.39
17	601318	中国平安	79,364,169.03	1.36
18	601225	陕西煤业	77,638,913.58	1.33
19	002422	科伦药业	74,463,790.23	1.28
20	600585	海螺水泥	70,881,988.55	1.22

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	156,007,781.64	2.68
2	600048	保利地产	150,625,137.58	2.59
3	000338	潍柴动力	114,890,858.03	1.97
4	601628	中国人寿	113,634,941.50	1.95
5	601111	中国国航	109,598,956.98	1.88
6	600519	贵州茅台	104,688,375.67	1.80
7	000651	格力电器	102,940,978.66	1.77
8	002027	分众传媒	97,898,913.51	1.68
9	601006	大秦铁路	97,452,196.24	1.67
10	600019	宝钢股份	95,617,234.87	1.64
11	601318	中国平安	95,275,552.94	1.64
12	000001	平安银行	93,212,988.87	1.60
13	002310	东方园林	82,894,403.70	1.42
14	601899	紫金矿业	81,984,608.63	1.41
15	600028	中国石化	81,755,045.69	1.40
16	601012	隆基股份	81,544,552.31	1.40
17	600362	江西铜业	79,526,089.50	1.37
18	000513	丽珠集团	72,434,398.42	1.24
19	601668	中国建筑	68,386,689.08	1.17
20	300070	碧水源	68,218,123.76	1.17

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	8,874,055,689.10
卖出股票的收入（成交）总额	8,375,207,183.20

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	40,534,203.80	0.70
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,534,203.80	0.70

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	110032	三一转债	172,370	21,156,693.80	0.37
2	113011	光大转债	157,810	16,014,558.80	0.28
3	128035	大族转债	29,294	3,362,951.20	0.06

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

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 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。

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	978,417.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	189,519.23
5	应收申购款	11,043,411.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,211,348.41

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110032	三一转债	21,156,693.80	0.37
2	113011	光大转债	16,014,558.80	0.28

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	284,126	14,677.03	535,674,838.03	12.85%	3,634,451,464.43	87.15%

数 A						
博时沪深 300 指数 C	15,842	10,859.77	91,825,167.23	53.37%	80,215,271.54	46.63%
博时沪深 300 指数 R	1	1,000.00	-	-	1,000.00	100.00%
合计	299,969	14,475.39	627,500,005.26	14.45%	3,714,667,735.97	85.55%

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	-	-
	博时沪深 300 指数 C	496,787.54	0.29%
	博时沪深 300 指数 R	-	-
	合计	496,787.54	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	-
	博时沪深 300 指数 C	10~50
	博时沪深 300 指数 R	-
	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	-
	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
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	3,819,114,828.01	108,621,669.79	1,000.00
本报告期基金总申购 份额	1,290,380,141.89	360,829,541.12	-
减：本报告期基金总 赎回份额	939,368,667.44	297,410,772.14	-
本报告期基金拆分变 动份额	-	-	-
本报告期期末基金份 额总额	4,170,126,302.46	172,040,438.77	1,000.00

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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	
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	3,502,257,325.02	20.36%	2,561,532.87	19.89%	-
安信证券	2	1,439,485,758.59	8.37%	1,052,706.41	8.18%	-
长江证券	2	1,270,095,860.87	7.38%	1,182,841.68	9.19%	-
兴业证券	2	1,217,901,145.01	7.08%	890,650.55	6.92%	-
中信证券	6	1,200,669,112.88	6.98%	878,032.22	6.82%	新增 1 个
财富里昂证券	1	1,191,902,383.99	6.93%	871,079.80	6.76%	-
华创证券	4	1,154,496,089.97	6.71%	843,800.02	6.55%	-
天风证券	2	1,139,069,186.19	6.62%	833,010.02	6.47%	新增 1 个
上海证券	1	948,548,012.89	5.51%	693,667.34	5.39%	-
平安证券	2	772,327,351.01	4.49%	564,802.81	4.39%	-
信达证券	1	751,343,241.25	4.37%	549,447.96	4.27%	-
东兴证券	1	650,626,768.76	3.78%	475,788.18	3.70%	-
万联证券	1	601,473,800.46	3.50%	439,869.57	3.42%	-
东北证券	1	391,574,153.81	2.28%	286,358.04	2.22%	-
太平洋证券	1	371,991,238.07	2.16%	272,019.12	2.11%	新增 1 个
爱建证券	1	217,842,793.96	1.27%	159,308.96	1.24%	新增 1 个
华福证券	1	184,256,988.46	1.07%	134,745.16	1.05%	-
银河证券	1	154,063,824.97	0.90%	143,456.04	1.11%	-
国泰君安	4	45,628,000.00	0.27%	43,159.98	0.34%	-

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，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	124,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	4,427,586.65	4.64%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂证券	14,115,260.06	14.81%	-	-	-	-
华创证券	12,772,921.68	13.40%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	8,779,359.91	9.21%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	33,503,407.79	35.14%	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	21,738,665.66	22.80%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	20180629 关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投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	2018-06-29
2	关于博时旗下部分开放式基金增加国金证券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	2018-06-20
3	关于博时旗下部分开放式基金增加上海天天基金销售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	2018-06-15
4	关于博时旗下部分开放式基金增加华泰期货有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-28
5	关于博时旗下部分开放式基金增加北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-26
6	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-20
7	关于博时旗下部分开放式基金增加浙江乐清农村商业银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-17
8	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 1 号（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-12
9	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书 2018 年第 1 号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-04-12
10	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2017 年年度报告（正文）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
11	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2017 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-31
12	20180330 关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投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	2018-03-30
13	关于博时旗下部分开放式基金增加申万宏源及申万宏源西部证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-26
14	流动性风险管理规定：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同、托管协议和招募说明书修改前后文对照表	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-24
15	关于博时基金管理有限公司根据《公开募集	中国证券报、上海证券	2018-03-24

	开放式证券投资基金流动性风险管理规定》 变更旗下部分基金法律文件的公告	报、证券时报	
16	关于博时旗下部分开放式基金增加上海挖财金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-20
17	关于博时旗下部分开放式基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-15
18	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-03-02
19	20180201 关于博时旗下部分开放式基金增加广州银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-02-01
20	20180131 关于博时旗下部分基金增加华融湘江银行为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-31
21	关于博时旗下部分开放式基金增加成都华羿恒信财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-29
22	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-23
23	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-20
24	关于博时旗下部分开放式基金增加宁夏银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-19
25	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-16
26	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-12
27	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-01-11
28	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、上海证券报、证券时报	2018-01-06

§ 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

- 12.1.1 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
- 12.1.2 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 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

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
二〇一八年八月二十九日