

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金
2019 年第 3 季度报告
2019 年 9 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：二〇一九年十月二十三日

§ 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 2019 年 10 月 22 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 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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	4,386,938,743.78 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	4,239,118,885.12 份	147,819,858.66 份	-份

基金的份额总额			
---------	--	--	--

§ 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 (2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 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
1.本期已实现收益	107,278,671.70	3,544,771.11	-
2.本期利润	69,736,245.15	2,707,040.64	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0157	0.0173	-
4.期末基金资产净值	6,184,625,914.63	212,841,782.34	-
5.期末基金份额净值	1.4589	1.4399	-

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. 博时沪深300指数A:

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	0.92%	0.91%	-0.25%	0.91%	1.17%	0.00%

2. 博时沪深300指数C:

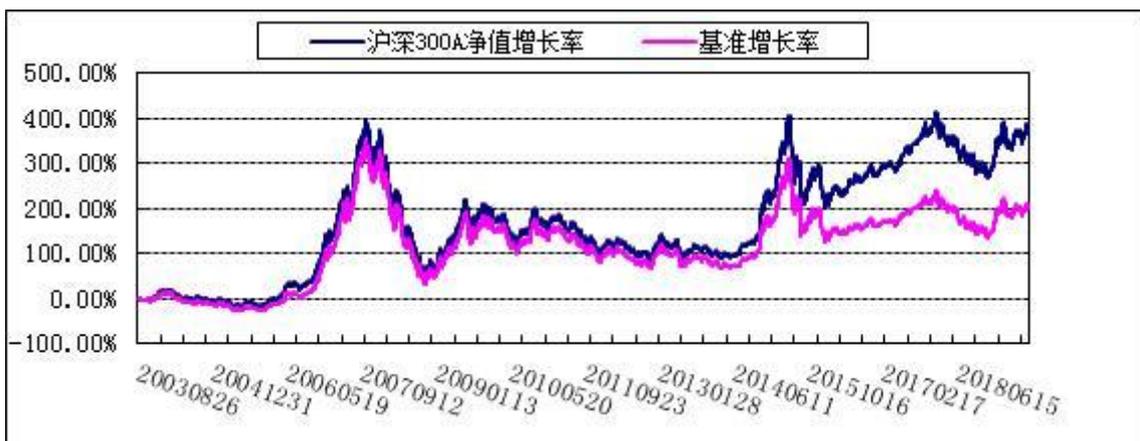
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三 个月	0.83%	0.91%	-0.25%	0.91%	1.08%	0.00%

3. 博时沪深300指数R:

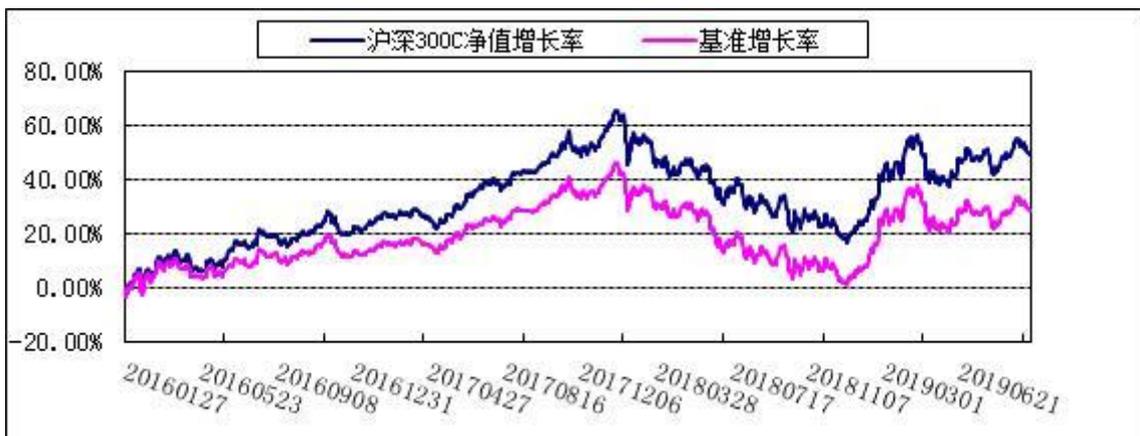
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三 个月	-	-	-	-	-	-

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

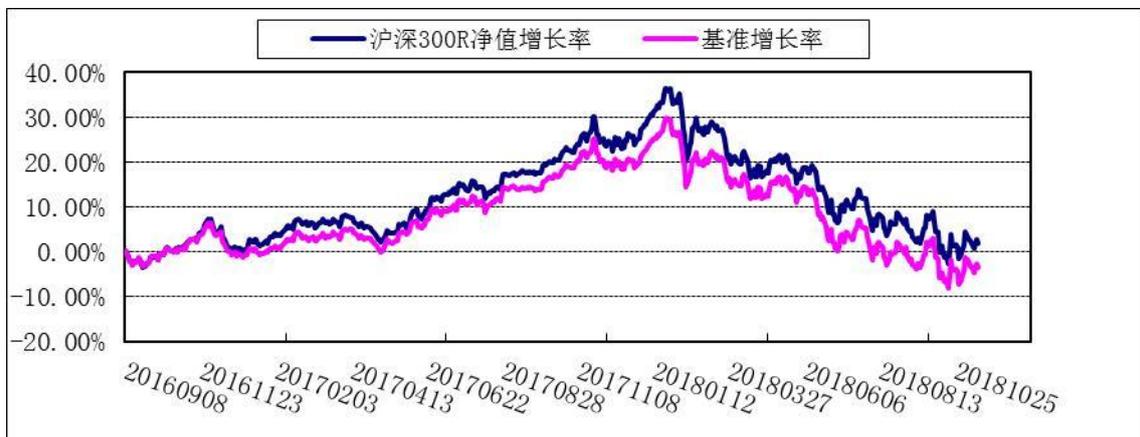
1. 博时沪深300指数A:



2. 博时沪深300指数C:



3. 博时沪深300指数R:



注：自 2016 年 9 月 8 日起，本基金新增 R 类份额；自 2018 年 11 月 15 日起，本基金份额全部赎回，故沪深 300R 类份额数据截止日为 2018 年 11 月 14 日。

§ 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	指数与量化	2015-07-21	-	10.2	桂征辉先生，硕士。

	投资部投资 副总监/基 金经理			2006 年起先后在松下电 器、美国在线公司、百度 公司工作。2009 年加入博 时基金管理有限公司。历 任高级程序员、高级研究 员、基金经理助理、博时 富时中国 A 股指数证券投 资基金(2018 年 6 月 12 日 -2019 年 9 月 5 日)基金经 理。现任指数与量化投资 部投资副总监兼博时裕富 沪深 300 指数证券投资基 金(2015 年 7 月 21 日—至 今)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金 (2015 年 7 月 21 日—至 今)、博时中证银联智惠大 数据 100 指数型证券投资 基金(2016 年 5 月 20 日— 至今)、博时中证 500 指数 增强型证券投资基金 (2017 年 9 月 26 日—至今) 的基金经理。
--	-----------------------	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 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

2019 年三季度，A 股市场先抑后扬，近期进入震荡期，最终收于 2905 点左右。风格方面，前期调整中，大盘相对抗跌；而后期上涨中小盘及创业板涨幅更加明显，反转效应明显。行业方面电子

元器件、医药、计算机等行业大幅跑赢市场，钢铁及有色行业表现落后。本基金利用数量化手段对组合进行管理，严格控制与指数跟踪偏离。

展望 2019 年四季度，我国经济下行的压力依旧存在，中美经贸关逐渐回归经济理性，但中长期风险仍在。虽然工业增加值增速跌至历史新低，制造业投资转弱，汽车销售疲弱，但是先前出台的刺激政策将逐步生效，包括货币政策（LPR 改革、降准等）、财政政策（地方政府专项债扩容等）以及更为重要的产业支持政策。货币方面，货币政策将继续维持事实上的宽松，降准将会显著降低资金成本，带动短端利率下行，同时随着利率市场化改革，资金价格将会呈现稳步回落态势；但是四季度通胀将会大幅上行，货币宽松的空间将会受到制约。国庆后 A 股市场尚有一定回调风险，应密切关注政策走向及贸易战情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 09 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.4589 元，份额累计净值为 3.4558 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.4399 元，份额累计净值为 1.4417 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.92%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.83%，同期业绩基准增长率-0.25%。本基金 R 类基金暂无份额。

4.6 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	5,993,460,770.46	93.45
	其中：股票	5,993,460,770.46	93.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,908,730.00	1.50
	其中：债券	95,908,730.00	1.50
	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	309,168,569.34	4.82
8	其他各项资产	14,790,464.70	0.23
9	合计	6,413,328,534.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	109,658,748.00	1.71
B	采矿业	169,322,817.52	2.65
C	制造业	2,421,702,490.04	37.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,310,077.12	2.21
E	建筑业	170,637,629.84	2.67
F	批发和零售业	159,998,182.18	2.50
G	交通运输、仓储和邮政业	135,427,298.76	2.12
H	住宿和餐饮业	334,121.00	0.01
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	288,826,278.24	4.51
J	金融业	2,037,364,885.32	31.85
K	房地产业	259,734,686.66	4.06
L	租赁和商务服务业	86,674,247.78	1.35
M	科学研究和技术服务 业	1,122,715.00	0.02
N	水利、环境和公共设施 管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,731,952.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	5,614,641.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	5,993,460,770.46	93.68

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	5,338,806	464,689,674.24	7.26
2	600519	贵州茅台	257,157	295,730,550.00	4.62
3	600036	招商银行	4,302,600	149,515,350.00	2.34
4	600276	恒瑞医药	1,833,512	147,927,748.16	2.31
5	000333	美的集团	2,796,614	142,906,975.40	2.23
6	000858	五粮液	1,099,000	142,650,200.00	2.23
7	000651	格力电器	2,158,792	123,698,781.60	1.93
8	601166	兴业银行	5,654,600	99,125,138.00	1.55
9	600000	浦发银行	8,201,500	97,105,760.00	1.52
10	601398	工商银行	15,871,857	87,771,369.21	1.37

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	95,908,730.00	1.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,908,730.00	1.50

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	019611	19 国债 01	501,000	50,094,990.00	0.78
2	019608	18 国债 26	458,000	45,813,740.00	0.72

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 本报告期内,本基金投资的前十名证券中除工商银行(601398)、浦发银行(600000)、兴业银行(601166)、招商银行(600036)的发行主体外,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。

2018 年 12 月 18 日,因存在信贷资金被挪用等违规行为,中国银行保险监督管理委员会衢州监管分局对中国工商银行龙游支行处以罚款的行政处罚。

2019 年 8 月 6 日,因存在违规办理经营性物业贷款等违规行为,中国银行保险监督管理委员会湖南监管局对上海浦东发展银行股份有限公司长沙分行处以罚款的行政处罚。

2018 年 12 月 21 日,因存在违规办理同业投资票据资产业务等违规行为,中国银行保险监督管理委员会莆田监管分局对兴业银行股份有限公司莆田分行处以罚款的行政处罚。

2019 年 5 月 23 日,因存在表内并购贷款等违规行为,中国银行保险监督管理委员会厦门监管局对招商银行厦门分行处以罚款的行政处罚。

对该证券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。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	706,485.66
2	应收证券清算款	1,781,615.31
3	应收股利	-
4	应收利息	1,821,257.81
5	应收申购款	10,481,105.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,790,464.70

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R
本报告期期初基金份额总额	4,660,689,764.23	190,208,121.50	-
报告期基金总申	427,850,386.20	94,352,049.09	-

购份额			
减：报告期基金总赎回份额	849,421,265.31	136,740,311.93	-
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	4,239,118,885.12	147,819,858.66	-

§ 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

基金管理人未持有本基金。

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

8.1 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。

8.2 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 2019 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理 191 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、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 10059 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 2976 亿元人民币，累计分红逾 1154 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。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 3 季末：

博时旗下权益类基金业绩持续优异，73 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）今年来净值增长率超过 20%，33 只产品净值增长率超过 30%，4 只产品净值增长率超过 60%，1 只产品净值增长率超过 80%；61 只产品今年来净值增长率银河同类排名在前 1/2，25 只产品银河同类排名在前 1/4，11 只产品银河同类排名在前 10，2 只产品银河同类排名第 1。其中，博时医疗保健行业混合、博时回报灵活配置混合双双同类排名第 1，博时弘泰定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类)双双同类排名第 2，博时文体娱乐主题混合、博时乐臻定期开放混合、博时特许价值混

合(A类)、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A类)、博时丝路主题股票(C类)、博时中证银联智惠大数据 100 指数(C类)、博时上证 50ETF 联接(C类)分别在银河数据同类排名前十。博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时鑫泽灵活配置混合(C类)今年来净值增长率同类排名在前 1/10, 博时量化平衡混合、博时新兴消费主题混合、博时互联网主题灵活配置混合、博时上证 50ETF 联接(A类)、博时新兴成长混合、博时裕益灵活配置混合、博时鑫源灵活配置混合(C类)、博时鑫泽灵活配置混合(A类)、博时厚泽回报灵活配置混合(C类)、博时创新驱动灵活配置混合(C类)、博时鑫源灵活配置混合(A类)、博时鑫瑞灵活配置混合(C类)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C类)、博时颐泰混合(C类)、博时新起点灵活配置混合(C类)等产品今年来净值增长率同类排名均在前 1/4。

博时固定收益类基金同样表现突出, 29 只产品(各类份额分开计算, 不含 QDII, 下同)今年来净值增长率超过 4%, 8 只产品净值增长率超过 6%, 4 只产品净值增长率超过 10%, 2 只产品净值增长率超过 20%; 57 只产品今年来净值增长率银河同类排名在前 1/2, 34 只产品银河同类排名在前 1/4, 16 只产品银河同类排名在前 1/10, 13 只产品银河同类排名在前 10, 4 只产品银河同类排名第 3。其中, 博时安盈债券(A类)今年来净值增长率同类排名第 2, 博时转债增强债券(C类)、博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)、博时安弘一年定期开放债券(C类)今年来净值增长率同类排名均在第 3, 博时转债增强债券(A类)、博时安盈债券(C类)、博时安弘一年定期开放债券(A类)今年来净值增长率同类排名均在第 4, 博时裕腾纯债债券、博时富瑞纯债债券今年来净值增长率在 344 只同类产品中分别排名第 5、第 7, 博时合惠货币(B类)、博时安心收益定期开放债券(C类)、博时裕顺纯债债券、博时信用债纯债债券(C类)今年来净值增长率分别再在 294 只、58 只、344 只、151 只同类产品中排名第 8、第 9、第 10、第 10。博时信用债纯债债券(A类)、博时信用债券(A/B类)、博时信用债券(C类)、博时安心收益定期开放债券(A类)、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时裕创纯债债券、博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时裕安纯债债券、博时合惠货币(A类)等产品今年来净值增长率同类排名在前 1/10, 博时月月薪定期支付债券、博时双月薪定期支付债券、博时现金宝货币(A类)、博时现金宝货币(B类)、博时安丰 18 个月定期开放债券(A类-LOF)、博时富祥纯债债券、博时裕泰纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时富腾纯债债券、博时合鑫货币、博时聚瑞纯债 6 个月定期开放债券发起式、博时兴荣货币、博时裕恒纯债债券、博时外服货币等产品今年来净值增长率同类排名在前 1/4。

博时旗下 QDII 基金继续表现突出, 博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接(C类)、博时标普 500ETF 联接(A类)今年来净值增长率均超过 20%, 同类排名分别为第 2、第 5、第 11; 博时亚洲票息收益债券(人民币)今年来净值增长率超过 10%, 同类排名第 6。

商品型基金当中, 博时黄金 ETF 今年来较好跟上黄金上涨行情, 净值增长率超过 20%, 同类排名第 3。

2、其他大事件

2019 年 9 月 27 日, 《证券时报》主办的“2019 中国 AI 金融探路者峰会暨第三届中国金融科技先锋榜”颁奖典礼在深圳举行, 博时基金凭借“新一代投资决策支持平台”项目, 获登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2019 年 8 月 17 日，第二届济安五星基金“群星汇”暨颁奖典礼在京举行，博时基金斩获基金公司综合奖“群星奖”、“众星奖”、“五星奖”，基金产品单项奖“货币型基金管理奖”、“QDII 基金管理奖”以及 2 项“五星基金明星奖”等 7 项大奖，彰显出老牌基金公司强大的实力底蕴。

2019 年 7 月 5 日，2019 金牛基金高峰论坛暨第十六届中国基金金牛奖颁奖典礼在北京进行，博时基金研究部总经理王俊和固定收益总部专户组投资总监张李陵分别获得“人气金牛”奖项，两位各自管理的绩优产品博时主题行业混合(LOF) (160505) 和博时信用债纯债债券(050027) 分别荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖和“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”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
二〇一九年十月二十三日