

# 博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

## 2025 年年度报告

### 2025 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇二六年三月三十一日

## §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 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	16
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>17</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	17
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	20
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 .....	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	23
4.9 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 .....	23
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	23
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 .....	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	24
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>24</b>
6.1 审计意见 .....	24
6.2 形成审计意见的基础 .....	24
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任 .....	24
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任 .....	25
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>26</b>
7.1 资产负债表 .....	26
7.2 利润表 .....	27
7.3 净资产变动表 .....	28
7.4 报表附注 .....	30
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>65</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	65
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	65
8.3 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 .....	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	75

8.6 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 .....	75
8.7 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 .....	75
8.8 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 .....	75
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	75
8.12 投资组合报告附注 .....	75
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
9.3 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 .....	77
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>78</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
11.2 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 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	79
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8 其他重大事件 .....	82
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>85</b>
12.1 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 .....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>85</b>
13.1 备查文件目录 .....	85
13.2 存放地点 .....	85
13.3 查阅方式 .....	85

## §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	2,825,333,344.32 份				
基金合同存续期	不定期				
下属分级基金的基金简称	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
下属分级基金的交易代码	050002	002385	960022	022922	024186
报告期末下属分级基金的份额总额	2,406,524,883.99 份	409,498,837.25 份	-份	9,212,559.89 份	97,063.19 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合。即调整其股票资产比例为 95% 以内，现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于 5%。</p> <p><b>1. 资产配置原则</b></p> <p>本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨，采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，再进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例，以完全复制的方法进行组合构建。</p> <p><b>2. 资产配置策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>3. 股票资产配置策略</b></p> <p>本基金股票资产投资以沪深 300 指数为标的指数，原则上采用完全复制标的指数的方法，首先按照标的指数中的行业权重为基准权重，确定行业配置比例；再进一步根据各行业中的个股基准权重，确定行业内的个股配置比例。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p><b>4. 投资组合调整原则</b></p>

	本基金的股票投资为完全复制的被动式指数投资，债券投资为流动性风险约束下的被动式投资，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	95%的沪深 300 指数加 5%的银行同业存款利率。
风险收益特征	由于本基金采用复制的指数化投资方法，基金净值增长率与标的指数增长率间相偏离的风险尤为突出。本基金将严格执行风险管理程序，最大程度地运用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	王小飞
	联系电话	0755-83169999	021-60637103
	电子邮箱	service@bosera.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	021-60637228
传真		0755-83195140	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		张东	张金良

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.bosera.com">https://www.bosera.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### 1. 博时沪深 300 指数 A:

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数</b>	<b>2025 年</b>	<b>2024 年</b>	<b>2023 年</b>
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A
本期已实现收益	743,389,374.16	106,567,158.08	-202,116,554.20
本期利润	912,378,023.76	693,498,517.00	-351,777,677.66
加权平均基金份额本期利润	0.3317	0.2278	-0.1184
本期加权平均净值利润率	18.95%	15.13%	-7.62%
本期基金份额净值增长率	20.77%	15.67%	-7.72%
<b>3.1.2 期末数</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A
期末可供分配利润	2,343,034,958.03	1,956,561,970.31	1,280,712,347.66
期末可供分配基金份额利润	0.9736	0.6519	0.4281
期末基金资产净值	4,749,559,842.02	4,957,761,395.99	4,272,483,379.71
期末基金份额净值	1.9736	1.6519	1.4281
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 A
基金份额累计净值增长率	553.36%	440.97%	367.68%

## 2. 博时沪深 300 指数 C:

金额单位: 人民币元

<b>3.1.1 期间数</b>	<b>2025 年</b>	<b>2024 年</b>	<b>2023 年</b>
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C
本期已实现收益	148,454,111.84	14,194,308.95	-81,034,721.71
本期利润	191,560,692.94	262,696,324.45	-128,728,398.66
加权平均基金份额本期利润	0.3067	0.2490	-0.1520
本期加权平均净值利润率	18.18%	16.98%	-10.03%

本期基金份额净值增长率	20.29%	15.21%	-8.09%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C
期末可供分配利润	330,945,205.05	444,097,322.31	438,067,654.70
期末可供分配基金份额利润	0.8082	0.5576	0.4013
期末基金资产净值	787,792,572.59	1,285,879,750.47	1,529,617,432.16
期末基金份额净值	1.9238	1.6145	1.4013
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 C
基金份额累计净值增长率	103.05%	68.81%	46.52%

## 3. 博时沪深 300 指数 R:

金额单位: 人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	<b>2025 年</b>	<b>2024 年</b>	<b>2023 年</b>
	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R
本期已实现收益	-	-	-
本期利润	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	-	-	-
本期加权平均净值利润率	-	-	-
本期基金份额净值增长率	-	-	-
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R
期末可供分配利润	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	-	-	-
期末基金	-	-	-

资产净值			
期末基金份额净值	-	-	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 R
基金份额累计净值增长率	1.76%	1.76%	1.76%

## 4. 博时沪深 300 指数 Y:

金额单位: 人民币元

<b>3.1.1 期间数</b>	<b>2025 年</b>	<b>2024 年</b>	<b>2023 年</b>
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y
本期已实现收益	1,292,434.08	4,717.53	-
本期利润	1,681,630.30	-9,827.31	-
加权平均基金份额本期利润	0.4163	-0.0525	-
本期加权平均净值利润率	22.92%	-3.15%	-
本期基金份额净值增长率	21.49%	0.07%	-
<b>3.1.2 期末数</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y
期末可供分配利润	9,069,969.00	466,260.73	-
期末可供分配基金份额利润	0.9845	0.6512	-
期末基金资产净值	18,282,528.89	1,182,302.84	-
期末基金份额净值	1.9845	1.6512	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2025 年末</b>	<b>2024 年末</b>	<b>2023 年末</b>
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 Y
基金份额累计净值增长率	21.57%	0.07%	-

## 5. 博时沪深 300 指数 I:

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数	2025 年	2024 年	2023 年
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 I	博时沪深 300 指数 I	博时沪深 300 指数 I
本期已实现收益	20,126.64	-	-
本期利润	34,396.91	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.3518	-	-
本期加权平均净值利润率	18.55%	-	-
本期基金份额净值增长率	23.17%	-	-
3.1.2 期末数	2025 年末	2024 年末	2023 年末
<b>据和指标</b>	博时沪深 300 指数 I	博时沪深 300 指数 I	博时沪深 300 指数 I
期末可供分配利润	94,223.78	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.9707	-	-
期末基金资产净值	191,286.97	-	-
期末基金份额净值	1.9707	-	-
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
<b>末指标</b>	博时沪深 300 指数 I	博时沪深 300 指数 I	博时沪深 300 指数 I
基金份额累计净值增长率	23.17%	-	-

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 1. 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
过去三个月	0.39%	0.90%	-0.20%	0.90%	0.59%	0.00%
过去六个月	16.90%	0.85%	16.72%	0.86%	0.18%	-0.01%
过去一年	20.77%	0.93%	16.79%	0.91%	3.98%	0.02%

过去三年	28.91%	1.02%	18.82%	1.02%	10.09%	0.00%
过去五年	0.90%	1.08%	-10.22%	1.08%	11.12%	0.00%
自基金合同生效起至今	553.36%	1.47%	262.99%	1.47%	290.37%	0.00%

## 2. 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
过去三个月	0.29%	0.90%	-0.20%	0.90%	0.49%	0.00%
过去六个月	16.66%	0.85%	16.72%	0.86%	-0.06%	-0.01%
过去一年	20.29%	0.93%	16.79%	0.91%	3.50%	0.02%
过去三年	27.38%	1.02%	18.82%	1.02%	8.56%	0.00%
过去五年	-1.10%	1.08%	-10.22%	1.08%	9.12%	0.00%
自基金合同生效起至今	103.05%	1.11%	55.52%	1.10%	47.53%	0.01%

注：自 2016 年 1 月 27 日起,本基金新增 C 类份额,相关数据按实际存续期计算。

## 3. 博时沪深 300 指数 R:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	1.76%	0.97%	-3.67%	0.95%	5.43%	0.02%

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

## 4. 博时沪深 300 指数 Y:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.54%	0.90%	-0.20%	0.90%	0.74%	0.00%
过去六个月	17.25%	0.85%	16.72%	0.86%	0.53%	-0.01%
过去一年	21.49%	0.93%	16.79%	0.91%	4.70%	0.02%
自基金合同生效起至今	21.57%	0.92%	16.85%	0.90%	4.72%	0.02%

注：自 2024 年 12 月 13 日起,本基金增设 Y 类份额类别,份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日,相关数据按实际存续期计算。

## 5. 博时沪深 300 指数 I:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.38%	0.90%	-0.20%	0.90%	0.58%	0.00%
过去六个月	16.82%	0.85%	16.72%	0.86%	0.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	23.17%	0.80%	21.45%	0.80%	1.72%	0.00%

注：自 2025 年 04 月 29 日起,本基金增设 I 类份额类别,份额首次确认日为 2025 年 04 月 30 日,

相关数据按实际存续期计算。

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

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

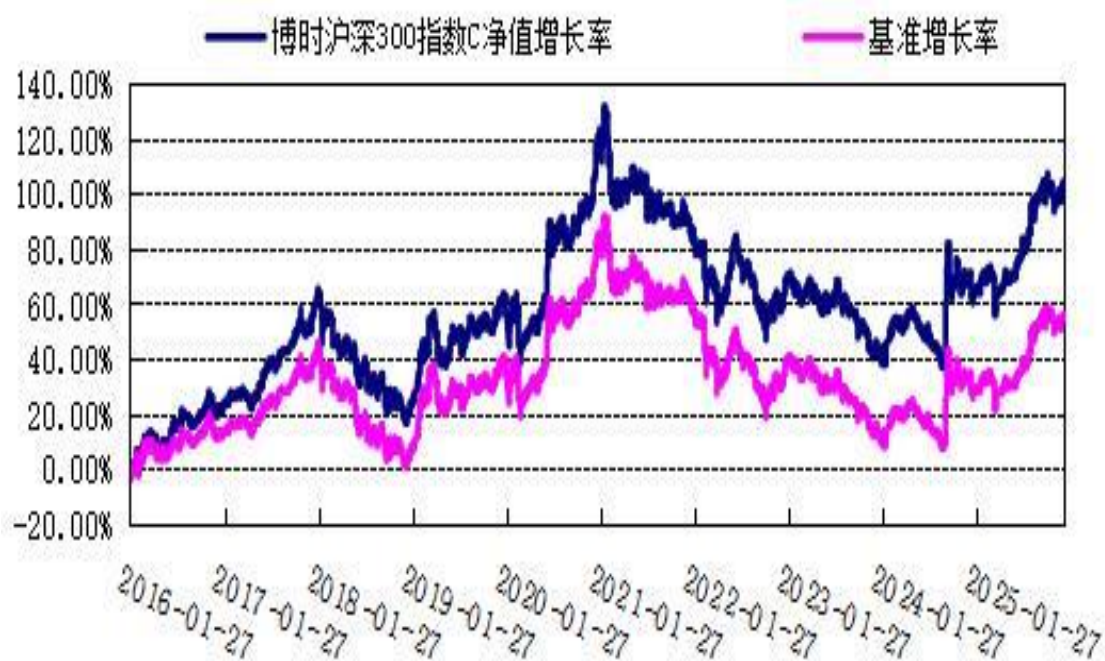
博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2003 年 8 月 26 日至 2025 年 12 月 31 日)

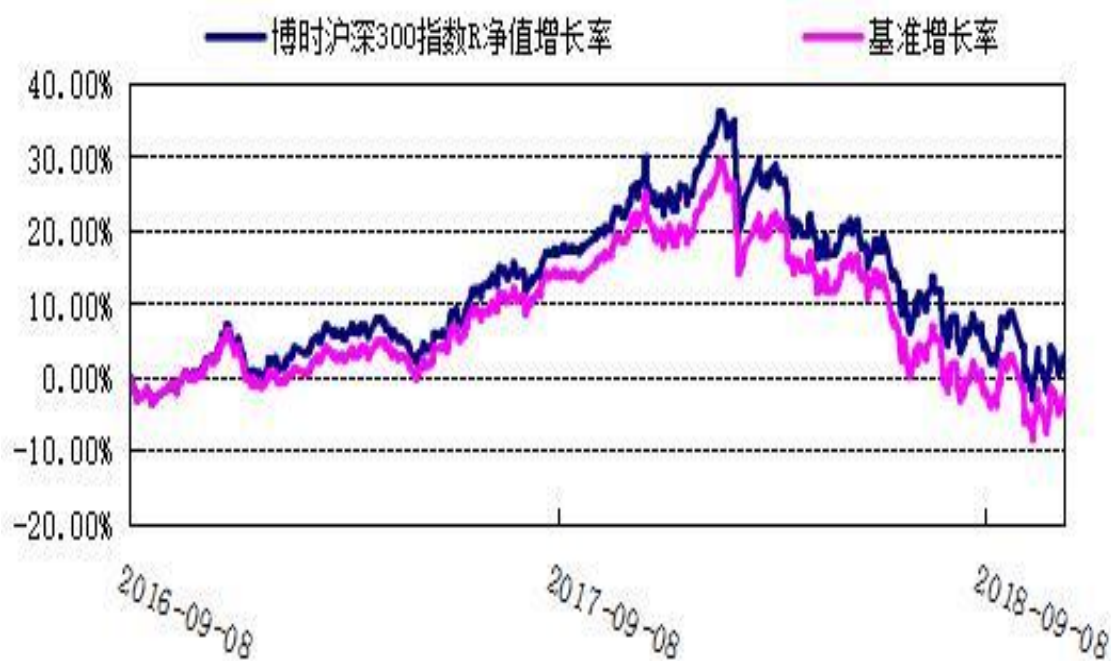
#### 1、博时沪深 300 指数 A



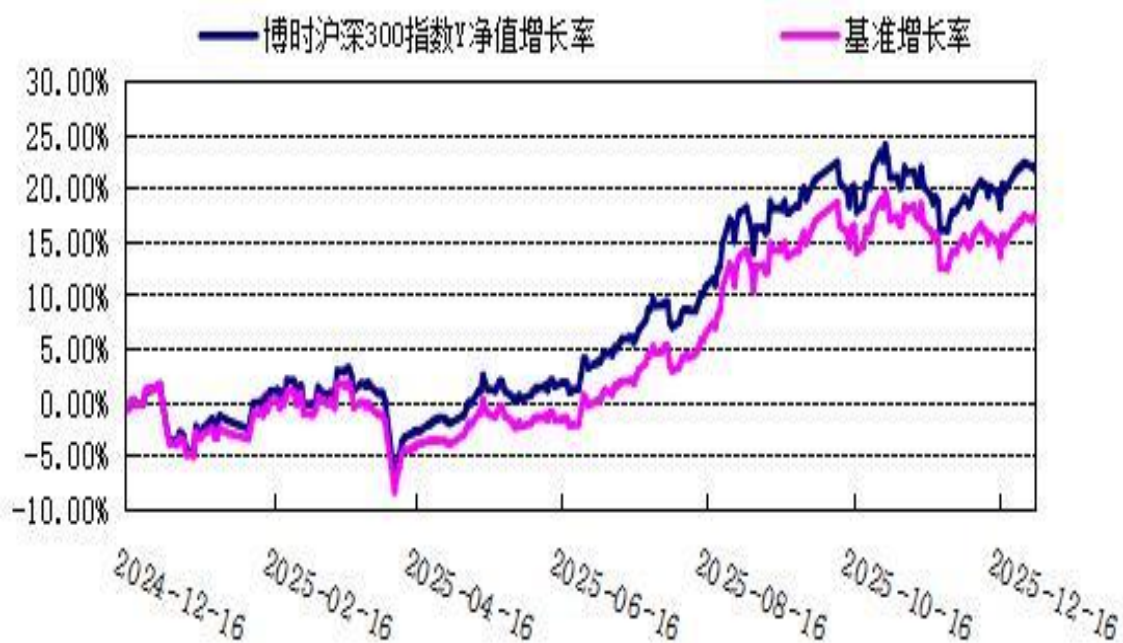
2、博时沪深 300 指数 C



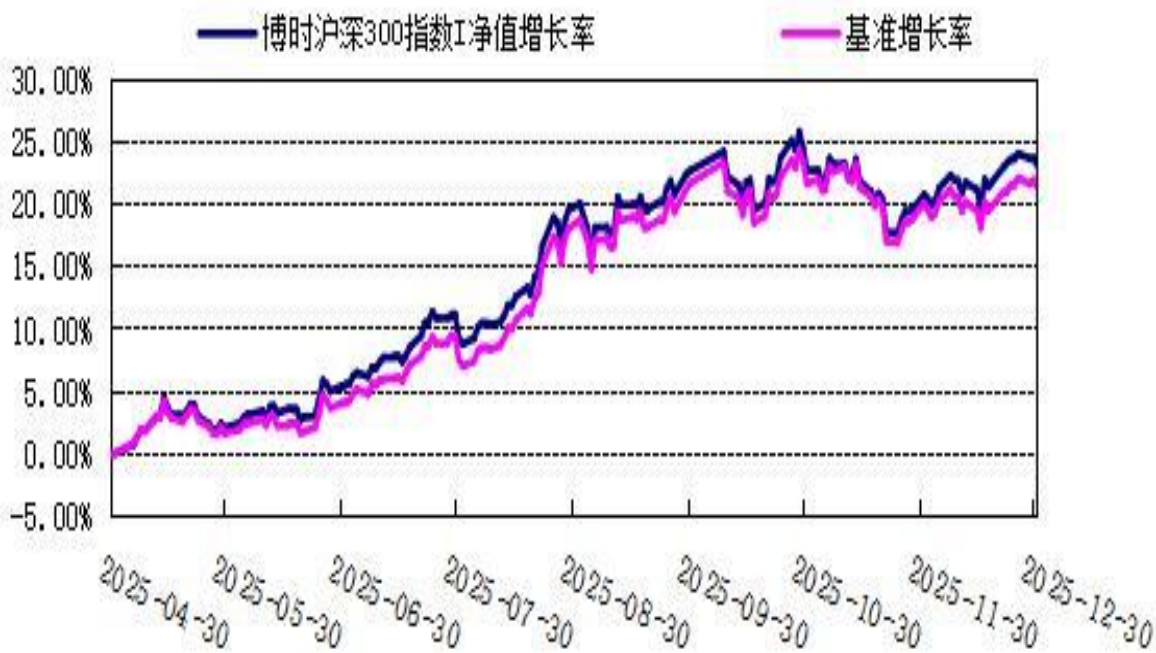
3、博时沪深 300 指数 R



4、博时沪深 300 指数 Y



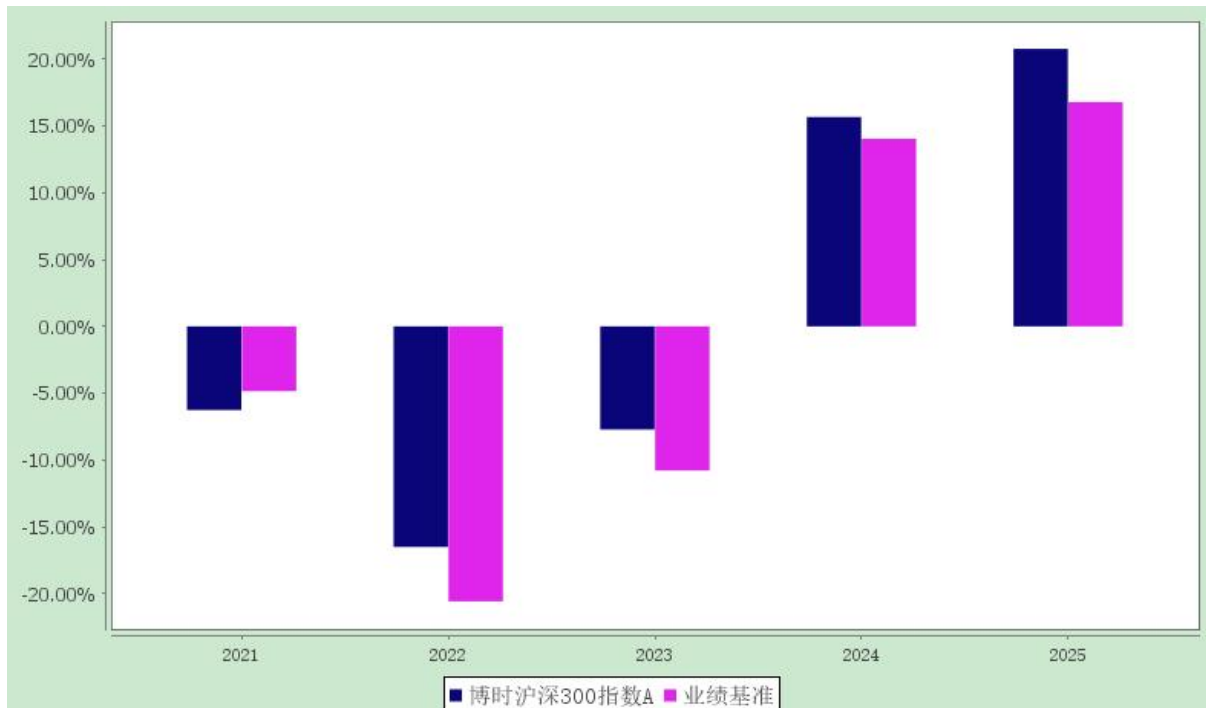
5、博时沪深 300 指数 I



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金  
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

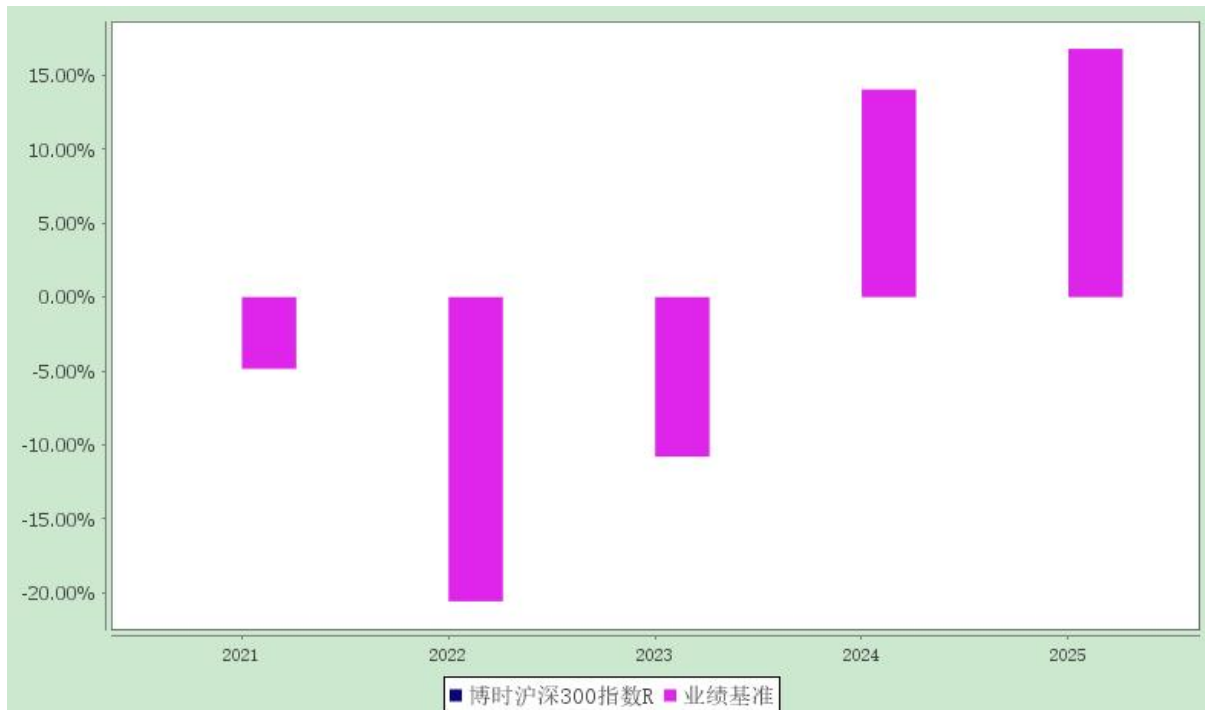
1、博时沪深 300 指数 A



2、博时沪深 300 指数 C

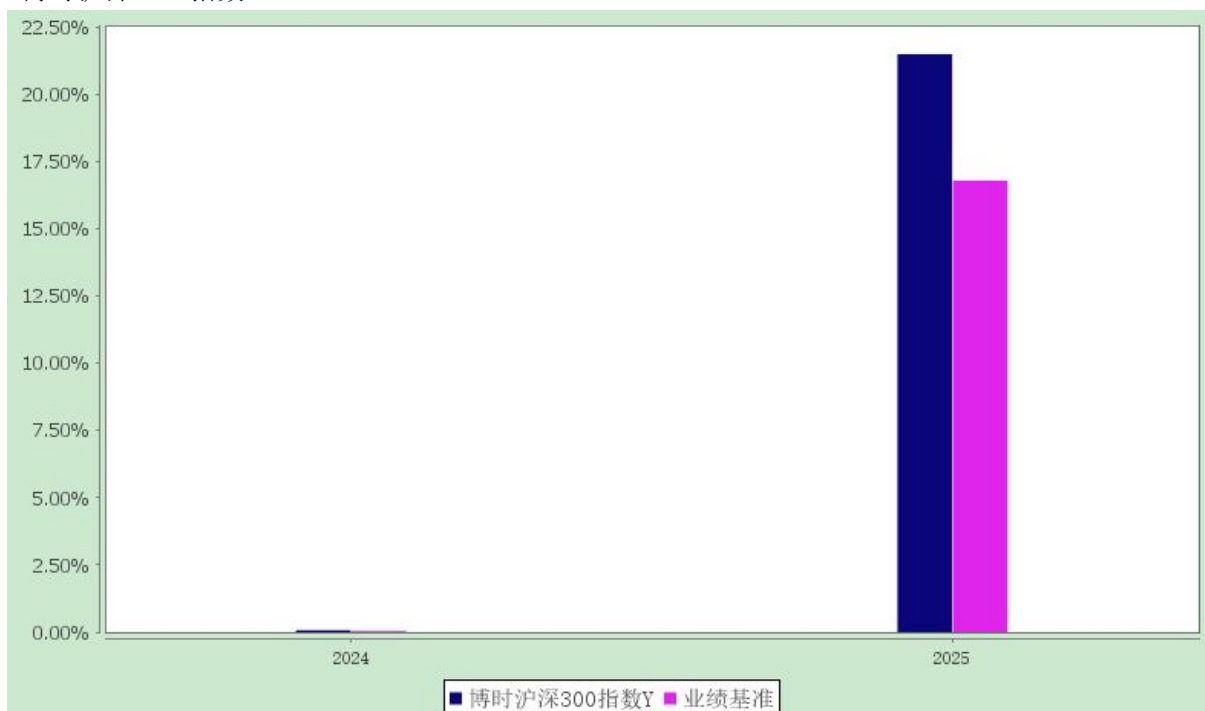


### 3、博时沪深 300 指数 R

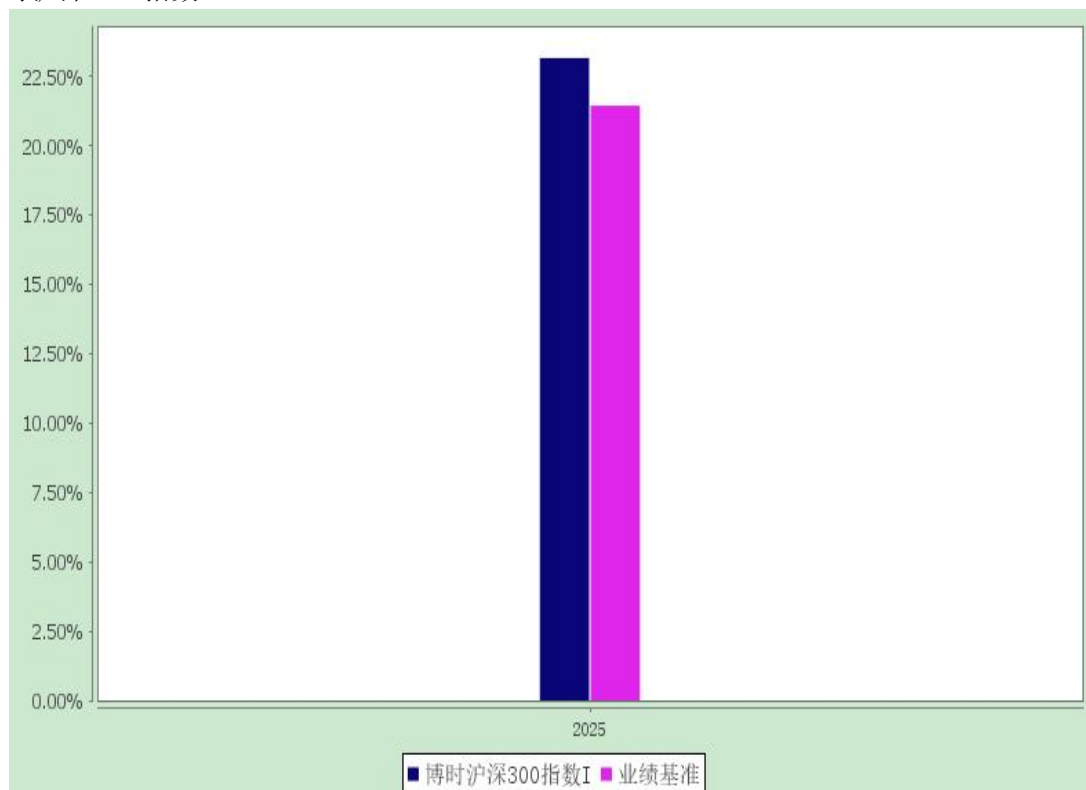


注：自 2016 年 9 月 8 日起，本基金新增 R 类份额；自 2018 年 11 月 15 日起，本基金份额全部赎回。

### 4、博时沪深 300 指数 Y



### 5、博时沪深 300 指数 I



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、博时沪深 300 指数 A:

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.1700	31,351,516.27	19,758,208.91	51,109,725.18	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.1700	31,351,516.27	19,758,208.91	51,109,725.18	-

#### 2、博时沪深 300 指数 C:

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.1450	8,196,353.97	3,434,189.96	11,630,543.93	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.1450	8,196,353.97	3,434,189.96	11,630,543.93	-

#### 3、博时沪深 300 指数 R:

无。

#### 4、博时沪深 300 指数 Y:

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注

2025 年	0.1700	-	23,879.39	23,879.39	-
2024 年	-	-	-	-	-
合计	0.1700	-	23,879.39	23,879.39	-

5、博时沪深 300 指数 I:  
无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 403 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16746 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6938 亿元人民币，累计分红逾 2258 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

9 月，深圳市证券业协会召开深圳资本市场投教讲师工作交流会，举行投教讲师聘任仪式，博时基金 16 位员工获颁“深圳资本市场投资者教育讲师”聘书。

12 月，深圳市证券业协会授予博时基金“突出贡献单位”荣誉证书，授予博时基金投教基地“优秀投资者教育基地”荣誉证书，表彰公司在 2025 年度投资者教育工作中积极有为，表现优异。2025 年度，博时基金共四位员工获得“优秀投教讲师”荣誉证书。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨振建	基金经理	2020-12-23	-	12.3	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金 (2018 年 12 月 3 日-2021 年 7

				<p>月 16 日)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)的基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月 13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 3 月 3 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日—至今)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 日—至今)、博时中证 800 指数</p>
--	--	--	--	--

					增强型证券投资基金(2025 年 9 月 2 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2025 年 11 月 3 日—至今)的基金经理。
桂征辉	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2015-07-21	-	16.3	桂征辉先生，硕士。2006 年起先后在松下电器、美国在线公司、百度公司工作。2009 年加入博时基金管理有限公司。历任高级程序员、高级研究员、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2018 年 6 月 12 日-2019 年 9 月 5 日)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2017 年 9 月 26 日-2020 年 12 月 23 日)、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2016 年 5 月 20 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 7 月 21 日-2024 年 7 月 5 日)、博时中证 A50 指数型发起式证券投资基金(2024 年 8 月 27 日-2025 年 5 月 29 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时恒享债券型证券投资基金(2023 年 9 月 26 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 7 月 21 日—至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日—至今)、博时中证 1000 指数增强型证券投资基金(2023 年 4 月 13 日—至今)、博时恒鑫稳健一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2025 年 5 月 30 日—至今)、博时中证 A500 指数增强型证券投资基金

					(2025 年 8 月 25 日—至今)的 基金经理，兼任投资经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
桂征辉	公募基金	7	6,861,716,372.97	2015-07-21
	私募资产管理计划	3	1,951,340,940.21	2025-02-28
	其他组合	-	-	-
	合计	10	8,813,057,313.18	

注：报告期内，桂征辉于 2025 年 12 月 29 日离任其原管理的 1 只私募资产管理计划。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由固定工资与绩效奖金组成，绩效奖金根据年度投资业绩、投研团队贡献等综合绩效评定。对于基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

### 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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理，公司根据相关法律法规及监管规定，进一步加强了公平交易管理的内部控制措施，强化了投资指令下达、同反向交易控制、组合收益率分析、同向交易价差监测分析。本报告期内，相关措施执行情况良好，未发现违反公平交易制度的异常交

易行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 37 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，2025 年 A 股市场呈现“震荡上行、结构分化”的态势，主要指数全年收涨，市场活力显著增强，行情主线明确，科技成长与有色金属板块领涨，人工智能、机器人等新质生产力领域表现强劲，市场“含科量”显著提升，上证指数最终收于 3968 点左右。海外在关税争端逐渐落地之后，全球多数权益资产在年初调整后逐步回稳。本基金利用数量化手段对组合进行管理，严格控制与指数跟踪偏离。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.9736 元，份额累计净值为 4.0245 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.9238 元，份额累计净值为 1.9565 元，本基金 I 类基金份额净值为 1.9707 元，份额累计净值为 1.9707 元，本基金 R 类基金期末无份额，本基金 Y 类基金份额净值为 1.9845 元，份额累计净值为 2.0015 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 20.77%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 20.29%，本基金 I 类基金份额净值增长率为 23.17%，本基金 Y 类基金份额净值增长率为 21.49%，本基金 A 类同期业绩基准增长率为 16.79%，本基金 C 类同期业绩基准增长率为 16.79%，本基金 I 类同期业绩基准增长率为 21.45%，本基金 Y 类同期业绩基准增长率为 16.79%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年在更加积极有为的宏观政策刺激下，中国经济整体企稳，出口保持了韧性。宏观政策明确实施“更加积极的财政政策”和“适度宽松的货币政策”，为经济回升向好提供了有力支撑。财政政策通过提高赤字率、增发国债持续发力，货币政策保持流动性合理充裕，推动社会综合融资成本稳中有降。在此背景下，市场流动性整体充裕，科技、上游周期品、小盘股等板块表现突出。展望 2026 年，从盈利预期角度看，A 股市场预计将在盈利驱动与政策支持下，市场驱动力将从估值扩张转向企业盈利改善预期。宏观基本面预计在“十五五”开局之年的产业政策与流动性宽松环境中逐步企稳。配置上建议关注上市公司业绩兑现能力与结构性机会的平衡。沪深 300 作为 A 股核心资产的重要标的，当前成份股的估值水平处于历史相对均衡的位置，值得长期配置。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，持续健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时提示有关业务人员并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出独立客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《博时基金风险管理与内部控制管理制度》《博时基金合规管理制度》《博时基金问责管理制度》《博时基金关联交易管理制度》《博时基金洗钱风险管理制度》《博时基金销售管理制度》《博时基金私募资产管理业务基本制度》《博时基金信息技术管理制度》《博时基金管理有限公司交易管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，探索完善“合规管理平台”中应用模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并积极做好投资者教育工作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人根据法律法规要求对

基金估值及净值计算履行复核责任，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；基金收益分配比例按有关规定制定；R 类份额的分红方式仅为现金分红；Y 类基金份额的收益分配方式仅为红利再投资；其余三类份额类别的投资者可以选择现金分红方式或红利再投资的分红方式,基金默认的分红方式为现金分红；若投资者要修改分红方式，请自行到销售网点柜台或销售机构规定的其他方式进行修改；基金投资当期亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金各类份额净值不能低于面值；基金当期收益应先弥补以前亏损后，才可进行当期收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

#### 4.9 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本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 审计报告

容诚审字[2026]200Z1664 号

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“博时沪深 300 指数”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时沪深 300 指数 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于博时沪深 300 指数，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时沪深 300 指数的基金管理人博时基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博时沪深 300 指数的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时沪深 300

指数、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时沪深 300 指数的财务报告过程。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时沪深 300 指数持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时沪深 300 指数不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

张振波 吴琳杰

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2026 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	345,808,405.24	380,046,048.55
结算备付金		3,322,994.26	5,806,022.48
存出保证金		390,642.62	416,667.85
交易性金融资产	7.4.7.2	5,234,073,806.72	5,876,853,857.78
其中：股票投资		5,234,073,806.72	5,876,853,857.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		36,261,457.04	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,997,712.10	5,192,773.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		5,623,855,017.98	6,268,315,370.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		36,285,569.69	368,739.23
应付赎回款		24,381,907.58	14,773,675.06

应付管理人报酬		4,620,997.01	5,218,207.57
应付托管费		943,060.65	1,064,940.31
应付销售服务费		269,196.80	437,304.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,528,055.78	1,629,055.12
负债合计		68,028,787.51	23,491,921.33
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	2,825,333,344.32	3,798,379,473.22
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	2,730,492,886.15	2,446,443,976.08
净资产合计		5,555,826,230.47	6,244,823,449.30
负债和净资产总计		5,623,855,017.98	6,268,315,370.63

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,825,333,344.32 份。其中 A 类基金份额净值 1.9736 元，基金份额总额 2,406,524,883.99 份；C 类基金份额净值 1.9238 元，基金份额总额 409,498,837.25 份；无 R 类基金份额；Y 类基金份额净值 1.9845 元，基金份额总额 9,212,559.89 份；I 类基金份额净值 1.9707 元，基金份额总额 97,063.19 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>1,179,496,618.06</b>	<b>1,035,101,398.00</b>
1.利息收入		1,280,544.34	1,420,998.61
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,280,544.34	1,420,998.61
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		964,611,446.59	197,076,524.74
其中：股票投资收益	7.4.7.10	818,261,879.34	-442,803.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	249,455.93	448,238.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	146,100,111.32	197,071,089.75
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	212,498,697.19	835,418,829.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,105,929.94	1,185,045.07
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>73,841,874.15</b>	<b>78,916,383.86</b>
1. 管理人报酬		57,601,796.89	60,176,715.56
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		11,755,468.67	12,280,962.37
3. 销售服务费		4,228,670.67	6,220,395.83
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.21	-
8. 其他费用	7.4.7.18	255,937.71	238,310.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,105,654,743.91</b>	<b>956,185,014.14</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,105,654,743.91</b>	<b>956,185,014.14</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>1,105,654,743.91</b>	<b>956,185,014.14</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：博时裕富沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,798,379,473.22	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	3,798,379,473.22	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-973,046,128.90	284,048,910.07	-688,997,218.83
（一）、综合收益总额	-	1,105,654,743.91	1,105,654,743.91

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-973,046,128.90	-758,841,685.34	-1,731,887,814.24
其中：1.基金申购款	756,224,229.17	572,792,807.58	1,329,017,036.75
2.基金赎回款	-1,729,270,358.07	-1,331,634,492.92	-3,060,904,850.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-62,764,148.50	-62,764,148.50
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	2,825,333,344.32	2,730,492,886.15	5,555,826,230.47
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,083,320,809.51	1,718,780,002.36	5,802,100,811.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	4,083,320,809.51	1,718,780,002.36	5,802,100,811.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-284,941,336.29	727,663,973.72	442,722,637.43
（一）、综合收益总额	-	956,185,014.14	956,185,014.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-284,941,336.29	-228,521,040.42	-513,462,376.71
其中：1.基金申购款	1,387,868,337.43	730,251,900.44	2,118,120,237.87
2.基金赎回款	-1,672,809,673.72	-958,772,940.86	-2,631,582,614.58
（三）、本期向	-	-	-

基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	3,798,379,473.22	2,446,443,976.08	6,244,823,449.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（原名为博时裕富证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]第 83 号《关于同意博时裕富证券投资基金设立的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《博时裕富证券投资基金基金契约》（后更名为《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》）发起，并于 2003 年 8 月 26 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,122,784,859.66 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字（2003）第 107 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2010 年 1 月 29 日发布的《博时基金管理有限公司关于博时裕富证券投资基金更名的公告》，为使本基金名称能够充分体现本基金作为指数型基金的产品特征，本基金于 2010 年 1 月 29 日起更名为“博时裕富沪深 300 指数证券投资基金”。

基金根据是否允许投资者通过个人养老金账户投资本基金、是否收取销售服务费、是否在中国内地市场销售将基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额、I 类基金份额、Y 类基金份额和 R 类基金份额。本基金自 2016 年 1 月 26 日起增加 C 类基金份额和 R 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额；自 2024 年 12 月 13 日起增加 Y 类基金份额；自 2025 年 4 月 29 日起增加 I 类基金份额。A 类基金份额在中国内地市场销售，投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用，在赎回时根据

持有期限收取赎回费用；C 类/I 类基金份额在中国内地市场销售，从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用和赎回费用；Y 类基金份额通过个人养老金账户投资，不从本类别基金资产中计提销售服务费；R 类基金份额在中国香港市场销售，在赎回时依据固定赎回费率收取赎回费用。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金将主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）、新股及存托凭证（IPO 或增发）以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于股票（含存托凭证）的比例在基金资产总值的 95% 以内；现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

本基金标的指数使用费由基金管理人博时基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2026 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成

为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### （1）金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：（i）以摊余成本计量：本基金管理以摊余成本计量的金融资产的的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。（ii）以公允价值计量且其变动计入当期损益：本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### （2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### （3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应

收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价

值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分/合并/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/合并/折算日根据拆分/合并/折算前的基金份额数及确定的拆分/合并/折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资

产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，A/C/Y/I 类基金份额的基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；R 类基金份额的收益分配仅采用现金方式。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于流通受限股票、出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	345,808,405.24	380,046,048.55
等于：本金	345,771,426.11	380,006,345.31
加：应计利息	36,979.13	39,703.24
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-

其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	345,808,405.24	380,046,048.55

**7.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,627,900,951.22	-	5,234,073,806.72	606,172,855.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,627,900,951.22	-	5,234,073,806.72	606,172,855.50
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,483,179,699.47	-	5,876,853,857.78	393,674,158.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,483,179,699.47	-	5,876,853,857.78	393,674,158.31

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

无余额。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**
**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**7.4.7.5 其他资产**

无余额。

**7.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	23,350.43	12,065.14
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,038,585.90	1,151,210.18
其中：交易所市场	1,038,585.90	1,151,210.18
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
其他应付款	1,619.45	1,279.80
预提费用	214,500.00	214,500.00
合计	1,528,055.78	1,629,055.12

#### 7.4.7.7 实收基金

博时沪深 300 指数 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,001,199,425.68	3,001,199,425.68
本期申购	392,818,624.27	392,818,624.27
本期赎回（以“-”号填列）	-987,493,165.96	-987,493,165.96
本期末	2,406,524,883.99	2,406,524,883.99

博时沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	796,464,005.43	796,464,005.43
本期申购	352,472,695.55	352,472,695.55
本期赎回（以“-”号填列）	-739,437,863.73	-739,437,863.73
本期末	409,498,837.25	409,498,837.25

博时沪深 300 指数 R

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	-	-

博时沪深 300 指数 Y

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

	基金份额(份)	账面金额
上年度末	716,042.11	716,042.11
本期申购	10,319,353.77	10,319,353.77
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,822,835.99	-1,822,835.99
本期末	9,212,559.89	9,212,559.89

博时沪深 300 指数 I

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	613,555.58	613,555.58
本期赎回 (以“-”号填列)	-516,492.39	-516,492.39
本期末	97,063.19	97,063.19

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

#### 7.4.7.8 未分配利润

博时沪深 300 指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,364,613,121.88	-1,408,051,151.57	1,956,561,970.31
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他 (若有)	-	-	-
本期期初	3,364,613,121.88	-1,408,051,151.57	1,956,561,970.31
本期利润	743,389,374.16	168,988,649.60	912,378,023.76
本期基金份额交易产生的变动数	-729,371,966.31	254,576,655.45	-474,795,310.86
其中：基金申购款	482,765,480.26	-171,909,686.52	310,855,793.74
基金赎回款	-1,212,137,446.57	426,486,341.97	-785,651,104.60
本期已分配利润	-51,109,725.18	-	-51,109,725.18
本期末	3,327,520,804.55	-984,485,846.52	2,343,034,958.03

博时沪深 300 指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	444,097,322.31	45,318,422.73	489,415,745.04
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他 (若有)	-	-	-
本期期初	444,097,322.31	45,318,422.73	489,415,745.04
本期利润	148,454,111.84	43,106,581.10	191,560,692.94
本期基金份额交易产生的变动数	-249,975,685.17	-41,076,473.54	-291,052,158.71
其中：基金申购款	227,710,915.85	25,227,882.29	252,938,798.14
基金赎回款	-477,686,601.02	-66,304,355.83	-543,990,956.85

本期已分配利润	-11,630,543.93	-	-11,630,543.93
本期末	330,945,205.05	47,348,530.29	378,293,735.34

博时沪深 300 指数 R

无余额

博时沪深 300 指数 Y

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	802,629.51	-336,368.78	466,260.73
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	802,629.51	-336,368.78	466,260.73
本期利润	1,292,434.08	389,196.22	1,681,630.30
本期基金份额交易产生的变动数	10,770,826.77	-3,824,869.41	6,945,957.36
其中：基金申购款	13,063,716.59	-4,592,436.20	8,471,280.39
基金赎回款	-2,292,889.82	767,566.79	-1,525,323.03
本期已分配利润	-23,879.39	-	-23,879.39
本期末	12,842,010.97	-3,772,041.97	9,069,969.00

博时沪深 300 指数 I

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	20,126.64	14,270.27	34,396.91
本期基金份额交易产生的变动数	113,805.88	-53,979.01	59,826.87
其中：基金申购款	784,820.49	-257,885.18	526,935.31
基金赎回款	-671,014.61	203,906.17	-467,108.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,932.52	-39,708.74	94,223.78

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,255,894.15	1,301,727.61
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	20,881.99	113,898.82
其他	3,768.20	5,372.18

合计	1,280,544.34	1,420,998.61
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,405,684,854.84	11,330,542,862.65
减：卖出股票成本总额	10,576,070,076.64	11,312,066,323.07
减：交易费用	11,352,898.86	18,919,343.12
买卖股票差价收入	818,261,879.34	-442,803.54

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	17,933.35	178,688.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	231,522.58	269,550.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	249,455.93	448,238.53

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	21,110,539.43	201,239,920.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,607,059.70	199,623,600.00
减：应计利息总额	271,923.24	1,346,120.22
减：交易费用	33.91	650.00
买卖债券差价收入	231,522.58	269,550.00

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

**7.4.7.13 衍生工具收益**
**7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无发生额。

**7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无发生额。

**7.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	146,100,111.32	197,071,089.75
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	146,100,111.32	197,071,089.75

**7.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	212,498,697.19	835,418,829.58
——股票投资	212,498,697.19	835,775,229.58
——债券投资	-	-356,400.00
——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	212,498,697.19	835,418,829.58

**7.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	953,100.83	1,020,219.37
基金转换费收入	152,829.11	164,825.70
合计	1,105,929.94	1,185,045.07

**7.4.7.17 信用减值损失**

无发生额。

**7.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	3,385.64	1,801.40
银行汇划费	24,552.07	8,508.70
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	255,937.71	238,310.10

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2026 年 1 月 9 日宣告 2025 年度第 1 次分红，向截至 2026 年 1 月 13 日止在本基金注册登记人博时基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.0980 元，C 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.0810 元，I 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.0980 元，Y 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.0990 元。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，基金管理人原股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的 2%股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。上述股东变更事项已于 2024 年 12 月 24 日完成工商变更登记。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	-	-	89,205,775.52	0.40%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 基金交易

无。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31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 总量的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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 总量的比例
招商证券	84,379.70	0.71%	-	-

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	57,601,796.89	60,176,715.56

其中：应支付销售机构的客户维护费	14,406,791.26	14,916,072.52
应支付基金管理人的净管理费	43,195,005.63	45,260,643.04

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日 A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额约定的管理费年费率分别为 0.98%、0.98%、0.98%、0.49% 和 0.98%。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,755,468.67	12,280,962.37

注：支付基金托管人的托管费按前一日 A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额、C 类基金份额、R 类基金份额、Y 类基金份额和 I 类基金份额约定的托管费年费率分别为 0.20%、0.20%、0.20%、0.10% 和 0.20%。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期					
	2025年1月1日至2025年12月31日					
	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	博时沪深300指数A	博时沪深300指数C	博时沪深300指数R	博时沪深300指数Y	博时沪深300指数I	合计
招商证券	-	1,362.45	-	-	-	1,362.45
博时基金	-	104,811.34	-	-	118.99	104,930.33
博时财富	-	320.38	-	-	-	320.38
合计	-	106,494.17	-	-	118.99	106,613.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间					
	2024年1月1日至2024年12月31日					
	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	博时沪深300指数A	博时沪深300指数C	博时沪深300指数R	博时沪深300指数Y	博时沪深300指数I	合计
招商证券	-	543.09	-	-	-	543.09
博时基金	-	763,381.34	-	-	-	763,381.34
博时财富	-	457.11	-	-	-	457.11
合计	-	764,381.54	-	-	-	764,381.54

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额和 I 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额和 I 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.40% 和 0.10%。其计算公式为：

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

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**
**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**
**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	345,808,405.24	1,255,894.15	380,046,048.55	1,301,727.61

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54
招商证券股份有限公司	301632	广东建科	网下发行	6,557.00	43,013.92
招商证券股份有限公司	001386	马可波罗	网下发行	5,419.00	74,511.25
招商证券股份有限公司	301638	南网数字	网下发行	23,213.00	132,081.97
招商证券股份有限公司	301449	天溯计量	网下发行	1,118.00	41,142.40
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	1,745.00	151,745.20

招商证券股份 有限公司	301631	壹连科技	网下发行	1,525.00	111,309.75
----------------	--------	------	------	----------	------------

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

博时沪深 300 指数 A

单位：人民币元

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

博时沪深 300 指数 C

单位：人民币元

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

博时沪深 300 指数 R

无。

博时沪深 300 指数 Y

单位：人民币元

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

博时沪深 300 指数 I

无。

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购日	受 限 期	流 通 受	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

				限类型						
688256	寒武纪	2025-10-21	6个月	非公开发行限售	1,195.02	1,270.07	20,083.00	23,999,586.66	25,506,815.81	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	首次公开发行限售	104.66	399.40	3,994.00	418,012.04	1,595,203.60	-
301656	联合动力	2025-09-17	6个月	首次公开发行限售	12.48	25.46	7,395.00	92,289.60	188,276.70	-
001280	中国铝业	2025-11-25	6个月	首次公开发行限售	17.89	45.36	2,277.00	40,735.53	103,284.72	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6个月	首次公开发行限售	8.45	24.28	3,505.00	29,617.25	85,101.40	-
688809	强一	2025-12-23	6个月	首次	85.09	203.31	259.00	22,038.31	52,657.29	-

	股份		月	公 开 发 行 限 售						
30163 8	南 网 数 字	2025-11-1 1	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	5.69	14.21	2,322.00	13,212.18	32,995.62	-
00138 6	马 可 波 罗	2025-10-1 5	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	13.75	18.53	1,626.00	22,357.50	30,129.78	-
68872 7	恒 坤 新 材	2025-11-1 1	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	14.99	34.87	563.00	8,439.37	19,631.81	-
00123 3	海 安 集 团	2025-11-1 8	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	48.00	51.88	370.00	17,760.00	19,195.60	-
68879 6	百 奥 赛 图	2025-12-0 2	6 个 月	首 次 公 开 发 行	26.68	42.25	423.00	11,285.64	17,871.75	-

				限售						
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	首次公开发行限售	51.66	135.56	131.00	6,767.46	17,758.36	-
301632	广东建科	2025-08-05	6个月	首次公开发行限售	6.56	23.68	656.00	4,303.36	15,534.08	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6个月	首次公开发行限售	27.00	133.69	110.00	2,970.00	14,705.90	-
301491	汉桑科技	2025-07-29	6个月	首次公开发行限售	28.91	55.11	245.00	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025-09-18	6个月	首次公开发行限售	7.05	26.82	447.00	3,151.35	11,988.54	-
001369	双欣	2025-12-23	6个月	首次	6.85	12.89	897.00	6,144.45	11,562.33	-

	环保		月	公开发 行限 售							
30160 9	山大 电力	2025-07-1 6	6 个月	首次公 开发 行限 售	14.66	40.99	277.00	4,060.82	11,354.23	-	
30168 7	新广 益	2025-12-2 4	6 个月	首次公 开发 行限 售	21.93	54.39	195.00	4,276.35	10,606.05	-	
00122 1	悍高 集团	2025-07-2 3	6 个月	首次公 开发 行限 售	15.43	56.94	160.00	2,468.80	9,110.40	-	
30166 7	纳百 川	2025-12-1 0	6 个月	首次公 开发 行限 售	22.63	57.07	151.00	3,417.13	8,617.57	-	
68880 5	健信 超导	2025-12-1 7	6 个月	首次公 开发 行	18.58	32.37	265.00	4,923.70	8,578.05	-	

603418	友升股份	2025-09-16	6个月	限售首次公开发行限售	46.36	59.06	139.00	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月	限售首次公开发行限售	17.08	48.56	169.00	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025-10-30	6个月	限售首次公开发行限售	46.68	55.66	146.00	6,815.28	8,126.36	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月	限售首次公开发行限售	42.28	56.08	137.00	5,792.36	7,682.96	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月	限售首次公开发行限售	21.00	44.80	165.00	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯	2025-12-16	6个月	限售首次	36.80	65.23	112.00	4,121.60	7,305.76	-

	计 量		月	公 开 发 行 限 售						
60102 6	道 生 天 合	2025-10-0 9	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	5.98	14.28	451.00	2,696.98	6,440.28	-
30157 5	艾 芬 达	2025-09-0 3	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	27.69	49.55	126.00	3,488.94	6,243.30	-
60340 6	天 富 龙	2025-07-3 0	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	23.60	40.16	153.00	3,610.80	6,144.48	-
60326 2	技 源 集 团	2025-07-1 6	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	10.88	28.10	155.00	1,686.40	4,355.50	-
60324 8	锡 华 科 技	2025-12-1 6	6 个 月	首 次 公 开 发 行	10.10	16.30	260.00	2,626.00	4,238.00	-

				限售						
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	首次公开发行限售	16.42	42.94	94.00	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025-08-27	6个月	首次公开发行限售	18.60	46.35	82.00	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	首次公开发行限售	12.55	26.21	111.00	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月	首次公开发行限售	24.49	32.82	88.00	2,155.12	2,888.16	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6个月	首次公开发行限售	22.29	35.39	69.00	1,538.01	2,441.91	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》,基金通过询价转让受让的股份,在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金参与网上申购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 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
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项停牌	272.72	2026-01-05	278.00	73,609.00	14,038,379.76	20,074,646.48	-
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项停牌	78.81	2026-01-15	86.69	173,800.00	14,021,931.93	13,697,178.00	-

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 日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证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属被动式股票指数基金，原则上采用复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括

信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制限定在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的正相关度在 95%以上，并保持年跟踪误差在 4%以下的投资目标。本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	345,808,405.24	-	-	-	345,808,405.24
结算备付金	3,322,994.26	-	-	-	3,322,994.26
存出保证金	390,642.62	-	-	-	390,642.62
交易性金融资产	-	-	-	5,234,073,806.72	5,234,073,806.72
应收清算款	-	-	-	36,261,457.04	36,261,457.04
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,997,712.10	3,997,712.10

应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	349,522,042.12	-	-	5,274,332,975.86	5,623,855,017.98
负债					
卖出回购金融 资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,381,907.58	24,381,907.58
应付清算款	-	-	-	36,285,569.69	36,285,569.69
应付管理人报 酬	-	-	-	4,620,997.01	4,620,997.01
应付托管费	-	-	-	943,060.65	943,060.65
应付销售服务 费	-	-	-	269,196.80	269,196.80
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,528,055.78	1,528,055.78
负债总计	-	-	-	68,028,787.51	68,028,787.51
利率敏感度缺 口	349,522,042.12	-	-	5,206,304,188.35	5,555,826,230.47
<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	380,046,048.55	-	-	-	380,046,048.55
结算备付金	5,806,022.48	-	-	-	5,806,022.48
存出保证金	416,667.85	-	-	-	416,667.85
交易性金融资 产	-	-	-	5,876,853,857.78	5,876,853,857.78
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融 资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,192,773.97	5,192,773.97
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	386,268,738.88	-	-	5,882,046,631.75	6,268,315,370.63
负债					
卖出回购金融 资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,773,675.06	14,773,675.06
应付清算款	-	-	-	368,739.23	368,739.23
应付管理人报 酬	-	-	-	5,218,207.57	5,218,207.57
应付托管费	-	-	-	1,064,940.31	1,064,940.31

应付销售服务费	-	-	-	437,304.04	437,304.04
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,629,055.12	1,629,055.12
负债总计	-	-	-	23,491,921.33	23,491,921.33
利率敏感度缺口	386,268,738.88	-	-	5,858,554,710.42	6,244,823,449.30

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(不包括可转债和可交换债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上期：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,234,073,806.72	94.21	5,876,853,857.78	94.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,234,073,806.72	94.21	5,876,853,857.78	94.11

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 30,926	增加约 30,024
	业绩比较基准下降 5%	减少约 30,926	减少约 30,024

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	5,172,427,079.64	5,876,246,080.61
第二层次	33,771,824.48	27,736.50
第三层次	27,874,902.60	580,040.67
合计	5,234,073,806.72	5,876,853,857.78

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	580,040.67	580,040.67
当期购买	-	25,012,189.55	25,012,189.55
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,338,078.15	1,338,078.15
当期利得或损失总额	-	3,620,750.53	3,620,750.53
其中：计入损益的利得或损失	-	3,620,750.53	3,620,750.53
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	27,874,902.60	27,874,902.60
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	3,098,213.37	3,098,213.37
项目	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	1,267,546.23	1,267,546.23
当期购买	-	507,006.67	507,006.67
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,578,000.88	1,578,000.88
当期利得或损失总额	-	383,488.65	383,488.65
其中：计入损益的利得或损失	-	383,488.65	383,488.65
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	580,040.67	580,040.67
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	342,700.99	342,700.99

注：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。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

股票投资	27,874,902.60	平均价格亚式 期权模型	预期波动率	18.00%-307.91%	负相关
项目	上年度末公允价 值	采用的估值技 术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价值之间 的关系
股票投资	580,040.67	平均价格亚式 期权模型	预期波动率	26.65%-574.44%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	5,234,073,806.72	93.07
	其中：股票	5,234,073,806.72	93.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	349,131,399.50	6.21
8	其他各项资产	40,649,811.76	0.72
9	合计	5,623,855,017.98	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	675.20	0.00
B	采矿业	380,156,284.24	6.84
C	制造业	2,870,480,899.41	51.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	107,999,904.18	1.94
E	建筑业	82,640,042.62	1.49
F	批发和零售业	10,446,409.13	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	87,193,888.16	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	242,689,946.87	4.37
J	金融业	1,215,501,651.96	21.88
K	房地产业	73,072,323.53	1.32
L	租赁和商务服务业	94,080,870.60	1.69
M	科学研究和技术服务业	66,750,190.82	1.20
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	2,877,264.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	183,456.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,234,073,806.72	94.21

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 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	300750	宁德时代	575,392	211,318,465.92	3.80
2	600519	贵州茅台	113,325	156,068,923.50	2.81
3	300308	中际旭创	251,580	153,463,800.00	2.76
4	601899	紫金矿业	3,770,716	129,976,580.52	2.34
5	601318	中国平安	1,892,592	129,453,292.80	2.33
6	000333	美的集团	1,397,273	109,196,884.95	1.97
7	300502	新易盛	249,800	107,633,824.00	1.94
8	601166	兴业银行	4,704,915	99,085,509.90	1.78
9	600036	招商银行	2,165,500	91,167,550.00	1.64
10	688256	寒武纪	54,083	71,595,515.81	1.29
11	601211	国泰海通	3,481,636	71,547,619.80	1.29
12	601138	工业富联	1,113,008	69,062,146.40	1.24
13	600919	江苏银行	6,549,175	68,111,420.00	1.23
14	002475	立讯精密	1,160,153	65,792,276.63	1.18
15	600887	伊利股份	2,297,754	65,715,764.40	1.18

16	603259	药明康德	721,638	65,409,268.32	1.18
17	601328	交通银行	8,891,100	64,460,475.00	1.16
18	600150	中国船舶	1,930,122	64,195,857.72	1.16
19	601857	中国石油	5,385,300	56,060,973.00	1.01
20	300274	阳光电源	327,200	55,964,288.00	1.01
21	002415	海康威视	1,742,808	52,005,390.72	0.94
22	601628	中国人寿	1,141,123	51,921,096.50	0.93
23	601398	工商银行	6,347,100	50,332,503.00	0.91
24	600690	海尔智家	1,889,200	49,289,228.00	0.89
25	600030	中信证券	1,704,488	48,935,850.48	0.88
26	601088	中国神华	1,177,500	47,688,750.00	0.86
27	300033	同花顺	145,122	46,755,405.96	0.84
28	688041	海光信息	199,710	44,816,921.10	0.81
29	601336	新华保险	635,200	44,273,440.00	0.80
30	600406	国电南瑞	1,967,100	44,220,408.00	0.80
31	600989	宝丰能源	2,250,400	44,175,352.00	0.80
32	605499	东鹏饮料	164,770	44,057,850.30	0.79
33	601601	中国太保	1,043,830	43,746,915.30	0.79
34	600415	小商品城	2,649,228	42,255,186.60	0.76
35	000938	紫光股份	1,686,900	41,497,740.00	0.75
36	000166	申万宏源	7,820,600	41,214,562.00	0.74
37	601901	方正证券	5,249,200	40,943,760.00	0.74
38	601117	中国化学	5,286,000	39,803,580.00	0.72
39	300476	胜宏科技	136,900	39,369,702.00	0.71
40	600276	恒瑞医药	657,872	39,189,435.04	0.71
41	600011	华能国际	5,205,700	38,834,522.00	0.70
42	002142	宁波银行	1,346,470	37,822,342.30	0.68
43	000895	双汇发展	1,418,800	37,555,636.00	0.68
44	601878	浙商证券	3,457,659	37,377,293.79	0.67
45	600183	生益科技	507,850	36,265,568.50	0.65
46	600029	南方航空	4,499,200	36,038,592.00	0.65
47	600019	宝钢股份	4,788,100	35,671,345.00	0.64
48	600938	中国海油	1,135,600	34,272,408.00	0.62
49	600016	民生银行	8,935,309	34,222,233.47	0.62
50	688981	中芯国际	275,700	33,864,231.00	0.61
51	002074	国轩高科	856,700	33,505,537.00	0.60
52	000001	平安银行	2,905,800	33,155,178.00	0.60
53	600663	陆家嘴	4,068,164	32,179,177.24	0.58
54	000800	一汽解放	4,745,400	32,173,812.00	0.58
55	600600	青岛啤酒	518,200	31,713,840.00	0.57
56	300442	润泽科技	593,965	31,361,352.00	0.56
57	002414	高德红外	2,131,442	31,268,254.14	0.56
58	600867	通化东宝	3,807,800	31,109,726.00	0.56

59	600660	福耀玻璃	479,800	31,076,646.00	0.56
60	300999	金龙鱼	1,055,909	30,346,824.66	0.55
61	600132	重庆啤酒	571,600	29,860,384.00	0.54
62	600115	中国东航	4,955,200	29,731,200.00	0.54
63	601668	中国建筑	5,680,074	29,138,779.62	0.52
64	002027	分众传媒	3,923,400	28,915,458.00	0.52
65	000783	长江证券	3,514,700	28,644,805.00	0.52
66	600332	白云山	1,105,100	28,445,274.00	0.51
67	000792	盐湖股份	995,900	28,044,544.00	0.50
68	002039	黔源电力	1,526,040	27,728,146.80	0.50
69	600900	长江电力	1,016,790	27,646,520.10	0.50
70	603993	洛阳钼业	1,358,200	27,164,000.00	0.49
71	601168	西部矿业	952,700	26,332,628.00	0.47
72	300124	汇川技术	333,426	25,116,980.58	0.45
73	002916	深南电路	108,060	25,101,257.40	0.45
74	603296	华勤技术	258,300	23,438,142.00	0.42
75	689009	九号公司	412,601	22,936,489.59	0.41
76	002236	大华股份	1,199,700	22,722,318.00	0.41
77	300394	天孚通信	111,668	22,671,954.04	0.41
78	600057	厦门象屿	2,657,000	22,637,640.00	0.41
79	688072	拓荆科技	68,100	22,473,000.00	0.40
80	603379	三美股份	367,500	22,314,600.00	0.40
81	688271	联影医疗	177,500	22,276,250.00	0.40
82	002463	沪电股份	303,400	22,169,438.00	0.40
83	600873	梅花生物	2,137,900	21,656,927.00	0.39
84	001979	招商蛇口	2,413,800	20,855,232.00	0.38
85	603986	兆易创新	95,210	20,398,742.50	0.37
86	600104	上汽集团	1,322,200	20,123,884.00	0.36
87	688012	中微公司	73,609	20,074,646.48	0.36
88	601169	北京银行	3,656,500	20,037,620.00	0.36
89	600378	昊华科技	624,220	19,950,071.20	0.36
90	000338	潍柴动力	1,143,004	19,659,668.80	0.35
91	600064	南京高科	2,251,348	19,541,700.64	0.35
92	688111	金山办公	63,419	19,474,072.33	0.35
93	600066	宇通客车	593,800	19,417,260.00	0.35
94	603444	吉比特	45,200	19,158,020.00	0.34
95	600549	厦门钨业	463,450	19,029,257.00	0.34
96	688008	澜起科技	159,460	18,784,388.00	0.34
97	603799	华友钴业	267,900	18,286,854.00	0.33
98	002028	思源电气	118,154	18,265,426.86	0.33
99	688183	生益电子	190,277	18,207,606.13	0.33
100	302132	中航成飞	230,200	18,185,800.00	0.33
101	600000	浦发银行	1,431,786	17,811,417.84	0.32

102	600031	三一重工	834,100	17,624,533.00	0.32
103	601658	邮储银行	3,130,800	17,062,860.00	0.31
104	601766	中国中车	2,498,755	17,041,509.10	0.31
105	603019	中科曙光	198,700	17,016,668.00	0.31
106	300573	兴齐眼药	241,004	16,940,171.16	0.30
107	600166	福田汽车	5,765,000	16,833,800.00	0.30
108	000100	TCL 科技	3,648,600	16,564,644.00	0.30
109	002056	横店东磁	843,100	16,440,450.00	0.30
110	601009	南京银行	1,432,769	16,376,549.67	0.29
111	601633	长城汽车	705,940	15,975,422.20	0.29
112	001337	四川黄金	571,451	15,920,624.86	0.29
113	300604	长川科技	154,400	15,642,264.00	0.28
114	603501	豪威集团	118,745	14,949,995.50	0.27
115	002049	紫光国微	173,800	13,697,178.00	0.25
116	000408	藏格矿业	160,500	13,546,200.00	0.24
117	002612	朗姿股份	660,900	13,508,796.00	0.24
118	600941	中国移动	133,500	13,490,175.00	0.24
119	600039	四川路桥	1,343,040	13,363,248.00	0.24
120	002558	巨人网络	307,200	13,298,688.00	0.24
121	300059	东方财富	573,318	13,289,511.24	0.24
122	600176	中国巨石	773,164	13,221,104.40	0.24
123	600809	山西汾酒	77,000	13,220,900.00	0.24
124	000915	华特达因	396,530	13,101,351.20	0.24
125	600050	中国联通	2,523,800	12,896,618.00	0.23
126	000568	泸州老窖	102,340	11,893,954.80	0.21
127	002050	三花智控	215,000	11,891,650.00	0.21
128	300681	英搏尔	462,195	11,582,606.70	0.21
129	301308	江波龙	46,600	11,409,544.00	0.21
130	603288	海天味业	302,626	11,203,214.52	0.20
131	600160	巨化股份	290,100	11,145,642.00	0.20
132	601020	华钰矿业	414,300	11,128,098.00	0.20
133	000538	云南白药	193,140	10,962,626.40	0.20
134	601127	赛力斯	90,300	10,922,688.00	0.20
135	601225	陕西煤业	505,300	10,772,996.00	0.19
136	601988	中国银行	1,765,100	10,114,023.00	0.18
137	601995	中金公司	288,000	10,080,000.00	0.18
138	600188	兖矿能源	761,518	10,013,961.70	0.18
139	002625	光启技术	204,100	9,951,916.00	0.18
140	002736	国信证券	754,500	9,899,040.00	0.18
141	600089	特变电工	439,729	9,770,778.38	0.18
142	300972	万辰集团	48,101	9,671,668.07	0.17
143	000651	格力电器	239,200	9,620,624.00	0.17
144	600018	上港集团	1,752,947	9,500,972.74	0.17

145	002600	领益智造	605,800	9,414,132.00	0.17
146	600909	华安证券	1,362,310	9,236,461.80	0.17
147	600795	国电电力	1,732,432	8,731,457.28	0.16
148	300008	天海防务	1,093,000	8,623,770.00	0.16
149	600741	华域汽车	426,900	8,538,000.00	0.15
150	688235	百济神州	31,000	8,326,600.00	0.15
151	000987	越秀资本	1,005,400	8,183,956.00	0.15
152	600988	赤峰黄金	249,200	7,785,008.00	0.14
153	601288	农业银行	987,400	7,583,232.00	0.14
154	600372	中航机载	539,100	7,234,722.00	0.13
155	688213	思特威	74,100	7,046,169.00	0.13
156	002311	海大集团	125,500	6,950,190.00	0.13
157	002299	圣农发展	415,500	6,872,370.00	0.12
158	601881	中国银河	422,300	6,638,556.00	0.12
159	600111	北方稀土	133,500	6,157,020.00	0.11
160	688629	华丰科技	58,400	5,843,504.00	0.11
161	603236	移远通信	60,600	5,781,846.00	0.10
162	000977	浪潮信息	82,400	5,487,840.00	0.10
163	601865	福莱特	340,700	5,338,769.00	0.10
164	301031	中熔电气	47,300	5,306,587.00	0.10
165	300045	华力创通	181,700	5,252,947.00	0.09
166	300014	亿纬锂能	79,419	5,222,593.44	0.09
167	301607	富特科技	124,860	5,008,134.60	0.09
168	601919	中远海控	329,711	5,005,012.98	0.09
169	600269	赣粤高速	935,500	4,855,245.00	0.09
170	688636	智明达	105,900	4,536,756.00	0.08
171	688578	艾力斯	41,800	4,353,470.00	0.08
172	601818	光大银行	1,127,469	3,934,866.81	0.07
173	688506	百利天恒	12,100	3,909,510.00	0.07
174	688499	利元亨	65,600	3,786,432.00	0.07
175	000600	建投能源	426,200	3,635,486.00	0.07
176	002202	金风科技	177,545	3,621,918.00	0.07
177	601728	中国电信	566,152	3,566,757.60	0.06
178	300496	中科创达	50,500	3,408,750.00	0.06
179	002281	光迅科技	46,289	3,237,915.55	0.06
180	002594	比亚迪	30,711	3,001,078.92	0.05
181	605098	行动教育	68,900	2,877,264.00	0.05
182	603185	弘元绿能	92,800	2,830,400.00	0.05
183	002624	完美世界	157,400	2,579,786.00	0.05
184	002436	兴森科技	101,900	2,157,223.00	0.04
185	002487	大金重工	40,268	2,091,117.24	0.04
186	600547	山东黄金	45,700	1,769,047.00	0.03
187	688802	沐曦股份	3,994	1,595,203.60	0.03

188	301606	绿联科技	26,300	1,544,862.00	0.03
189	688498	源杰科技	2,000	1,283,980.00	0.02
190	601333	广深铁路	378,000	1,149,120.00	0.02
191	601877	正泰电器	40,000	1,115,600.00	0.02
192	601808	中海油服	77,700	1,090,908.00	0.02
193	600098	广州发展	163,400	1,068,636.00	0.02
194	601963	重庆银行	95,700	1,036,431.00	0.02
195	601128	常熟银行	139,000	978,560.00	0.02
196	600428	中远海特	128,200	910,220.00	0.02
197	300347	泰格医药	15,000	850,500.00	0.02
198	688002	睿创微纳	7,700	776,160.00	0.01
199	603486	科沃斯	9,400	758,392.00	0.01
200	603699	纽威股份	14,400	748,368.00	0.01
201	300926	博俊科技	22,000	721,160.00	0.01
202	605305	中际联合	17,300	720,718.00	0.01
203	002997	瑞鹄模具	18,300	684,420.00	0.01
204	688200	华峰测控	3,500	665,700.00	0.01
205	600262	北方股份	23,000	598,690.00	0.01
206	688677	海泰新光	12,000	517,920.00	0.01
207	301603	乔锋智能	6,300	476,910.00	0.01
208	000729	燕京啤酒	41,882	470,334.86	0.01
209	688372	伟测科技	4,100	447,269.00	0.01
210	000778	新兴铸管	100,700	420,926.00	0.01
211	688280	精进电动	46,800	407,160.00	0.01
212	603233	大参林	22,000	387,640.00	0.01
213	603629	利通电子	14,500	386,425.00	0.01
214	600649	城投控股	86,735	385,970.75	0.01
215	300850	新强联	8,800	364,056.00	0.01
216	600027	华电国际	71,600	355,136.00	0.01
217	002941	新疆交建	21,100	334,435.00	0.01
218	300628	亿联网络	9,300	331,545.00	0.01
219	002023	海特高新	23,600	319,544.00	0.01
220	605599	菜百股份	18,300	299,571.00	0.01
221	300735	光弘科技	12,000	298,320.00	0.01
222	002246	北化股份	15,300	275,706.00	0.00
223	600662	外服控股	54,300	272,586.00	0.00
224	002602	世纪华通	15,200	259,312.00	0.00
225	300098	高新兴	38,000	231,800.00	0.00
226	300389	艾比森	14,100	228,843.00	0.00
227	603529	爱玛科技	6,700	198,990.00	0.00
228	002384	东山精密	2,300	194,695.00	0.00
229	600198	大唐电信	19,800	191,070.00	0.00
230	301200	大族数控	1,600	190,032.00	0.00

231	688612	威迈斯	5,733	189,017.01	0.00
232	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.00
233	300251	光线传媒	11,200	183,456.00	0.00
234	300866	安克创新	1,600	183,024.00	0.00
235	300775	三角防务	5,900	179,360.00	0.00
236	300438	鹏辉能源	3,300	175,626.00	0.00
237	688321	微芯生物	5,900	172,398.00	0.00
238	002284	亚太股份	11,000	164,230.00	0.00
239	300357	我武生物	4,500	127,575.00	0.00
240	600801	华新建材	4,900	120,246.00	0.00
241	600736	苏州高新	16,300	110,188.00	0.00
242	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
243	300072	海新能科	22,400	103,040.00	0.00
244	688236	春立医疗	3,900	89,232.00	0.00
245	688557	兰剑智能	2,400	87,432.00	0.00
246	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
247	002690	美亚光电	4,100	84,337.00	0.00
248	600382	广东明珠	10,800	77,004.00	0.00
249	301396	宏景科技	1,000	66,300.00	0.00
250	600482	中国动力	3,100	64,170.00	0.00
251	002803	吉宏股份	3,700	60,532.00	0.00
252	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
253	300857	协创数据	300	50,604.00	0.00
254	000951	中国重汽	2,800	47,320.00	0.00
255	600120	浙江东方	6,700	41,339.00	0.00
256	002371	北方华创	72	33,053.76	0.00
257	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
258	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
259	600517	国网英大	4,300	25,843.00	0.00
260	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
261	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
262	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
263	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
264	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
265	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
266	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
267	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
268	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
269	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
270	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
271	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
272	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
273	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00

274	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
275	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
276	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
277	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
278	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
279	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
280	000596	古井贡酒	50	6,630.00	0.00
281	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
282	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
283	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
284	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
285	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
286	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
287	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
288	002352	顺丰控股	92	3,525.44	0.00
289	688099	晶晨股份	37	3,227.51	0.00
290	688169	石头科技	20	3,041.20	0.00
291	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
292	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
293	300661	圣邦股份	40	2,745.60	0.00
294	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
295	603195	公牛集团	40	1,633.20	0.00
296	688658	悦康药业	48	1,085.28	0.00
297	300498	温氏股份	40	675.20	0.00
298	000999	华润三九	20	569.20	0.00
299	601607	上海医药	17	303.62	0.00
300	000725	京东方 A	60	252.60	0.00
301	603392	万泰生物	4	179.76	0.00
302	601229	上海银行	13	131.30	0.00
303	002001	新和成	4	100.76	0.00
304	600048	保利发展	9	54.90	0.00
305	601898	中煤能源	1	12.44	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600150	中国船舶	121,433,167.77	1.94
2	601166	兴业银行	114,254,572.21	1.83
3	601628	中国人寿	109,041,950.40	1.75
4	688256	寒武纪	107,770,980.63	1.73
5	300308	中际旭创	103,621,608.16	1.66
6	600036	招商银行	92,979,202.00	1.49

7	002142	宁波银行	76,954,565.00	1.23
8	601288	农业银行	76,543,371.00	1.23
9	600919	江苏银行	74,149,638.62	1.19
10	600415	小商品城	73,581,008.32	1.18
11	601117	中国化学	73,536,601.21	1.18
12	601668	中国建筑	72,145,559.60	1.16
13	600519	贵州茅台	70,626,287.50	1.13
14	300015	爱尔眼科	69,402,155.22	1.11
15	002230	科大讯飞	68,369,189.00	1.09
16	002415	海康威视	67,847,729.00	1.09
17	601211	国泰海通	65,032,344.78	1.04
18	002202	金风科技	64,345,984.58	1.03
19	300033	同花顺	62,909,576.20	1.01
20	000783	长江证券	62,755,949.91	1.00

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

#### 8.4.2 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	600519	贵州茅台	162,786,938.90	2.61
2	002594	比亚迪	149,701,160.67	2.40
3	601166	兴业银行	128,816,274.45	2.06
4	601318	中国平安	124,648,878.81	2.00
5	601288	农业银行	119,032,370.00	1.91
6	002714	牧原股份	113,388,070.10	1.82
7	000858	五粮液	108,944,905.00	1.74
8	002352	顺丰控股	105,912,460.00	1.70
9	600276	恒瑞医药	105,467,321.04	1.69
10	601818	光大银行	101,328,254.00	1.62
11	300498	温氏股份	99,666,594.00	1.60
12	600036	招商银行	98,802,443.00	1.58
13	600000	浦发银行	93,954,188.92	1.50
14	600900	长江电力	88,239,261.00	1.41
15	600031	三一重工	87,200,091.00	1.40
16	300750	宁德时代	86,308,837.60	1.38
17	601919	中远海控	84,010,888.40	1.35
18	000776	广发证券	83,439,263.00	1.34
19	688256	寒武纪	81,900,981.33	1.31
20	000725	京东方 A	80,804,144.96	1.29

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。

#### 8.4.3 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	9,720,791,328.39
---------------	------------------

卖出股票的收入（成交）总额	11,405,684,854.84
---------------	-------------------

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行宁夏回族自治区分行、国家外汇管理局北京市分局、宁德市市场监督管理局、金融监管总局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行山东省分行、国家外汇管理局内蒙古自治区分局、浙江金融监管局、深圳市市场监督管理局、金融监管总局的处罚，在报告编制前一年受到中国人民银行山东省分行、福州市住房和城乡建设局的通报批评。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制前一年受到上杭县住房和城乡建设局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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

本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

**8.12.3 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	390,642.62
2	应收清算款	36,261,457.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,997,712.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,649,811.76

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688256	寒武纪	25,506,815.81	0.46	非公开发行限售

**8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时沪深 300 指数 A	199,188	12,081.68	165,048,390.36	6.86%	2,241,476,493.63	93.14%
博时沪深 300 指数 C	60,683	6,748.16	9,481,181.20	2.32%	400,017,656.05	97.68%
博时沪深 300 指数 R	-	-	-	-	-	-
博时沪深 300 指数 Y	2,534	3,635.58	-	-	9,212,559.89	100.00%

博时沪深 300 指数 I	8	12,132.90	-	-	97,063.19	100.00%
合计	260,433	10,848.60	174,529,571.56	6.18%	2,650,803,772.76	93.82%

### 9.2 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	958,820.97	0.04%
	博时沪深 300 指数 C	218,939.17	0.05%
	博时沪深 300 指数 R	-	-
	博时沪深 300 指数 Y	63,992.62	0.69%
	博时沪深 300 指数 I	62.50	0.06%
	合计	1,241,815.26	0.04%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：本基金的基金经理未持有本基金。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时沪深 300 指数 A	博时沪深 300 指数 C	博时沪深 300 指数 R	博时沪深 300 指数 Y	博时沪深 300 指数 I
基金合同生效日（2003 年 8 月 26 日）基金份额总额	5,126,401,391.87	-	-	-	-

本报告期期初基金份额总额	3,001,199,425.68	796,464,005.43	-	716,042.11	-
本报告期基金总申购份额	392,818,624.27	352,472,695.55	-	10,319,353.77	613,555.58
减：本报告期基金总赎回份额	987,493,165.96	739,437,863.73	-	1,822,835.99	516,492.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,406,524,883.99	409,498,837.25	-	9,212,559.89	97,063.19

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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

基金管理人于 2025 年 10 月 16 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》，张东先生任公司董事长（法定代表人）、代任公司总经理，离任公司总经理。江向阳先生离任公司董事长。

基金管理人于 2025 年 11 月 12 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》，陈宇先生任公司总经理。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 90000 元。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	博时基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 31 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正、暂停部分业务
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收
其他	-

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 28 日；2025 年 10 月 28 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局；中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控；合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》；《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收；公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收
其他	-； -

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到调查或处罚等情况。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到调查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
东方证券	3	2,830,955,201.29	13.48%	582,913.88	13.47%	-
国信证券	1	2,624,618,377.09	12.49%	540,870.79	12.50%	-
华泰证券	2	2,527,051,853.16	12.03%	520,328.84	12.03%	-
国金证券	2	2,425,910,546.40	11.55%	499,572.62	11.55%	增加 1 个
申万宏源	2	2,005,594,125.73	9.55%	413,163.03	9.55%	-
中泰证券	2	1,505,523,084.97	7.17%	310,341.44	7.17%	减少 1 个
浙商证券	1	1,385,894,305.41	6.60%	285,414.86	6.60%	-
兴业证券	3	1,327,979,287.49	6.32%	273,597.87	6.32%	-
东吴证券	2	1,101,805,393.53	5.25%	226,905.08	5.24%	-
广发证券	2	746,493,290.91	3.55%	153,702.90	3.55%	-
中信建投	4	614,140,736.34	2.92%	126,515.09	2.92%	减少 1 个
银河证券	1	613,959,825.45	2.92%	126,601.15	2.93%	-
方正证券	3	541,427,101.80	2.58%	111,478.47	2.58%	-
国泰海通	4	397,753,241.38	1.89%	81,901.88	1.89%	增加 1 个
长江证券	2	225,011,760.18	1.07%	46,334.26	1.07%	-
华安证券	1	111,349,932.66	0.53%	22,931.35	0.53%	增加 1 个
西部证券	2	20,100,701.98	0.10%	4,142.08	0.10%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	4	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-

万联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	减少 1 个
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

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

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

(3) 本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服务协议。

#### 11.7.2 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
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	227,099.34	1.09%	-	-	-	-
华泰证券	49,184.66	0.24%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	20,428,064.35	98.02%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
长江证券	136,286.78	0.65%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华福证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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暂停使用富友支付提供的快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-31
2	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-18
3	博时基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-06
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-11-13
5	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-11-12
6	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-10-28

7	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-10-23
8	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-10-17
9	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-10-16
10	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-09-30
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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-09-04
12	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2025 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-08-29
13	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-08-07
14	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-07-21
15	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 I）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-07-01
16	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-07-01
17	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 Y）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-07-01
18	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-07-01
19	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
20	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
21	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电	2025-06-26

		子披露网站	
22	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 Y）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
23	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 I）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
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-20250606	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
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-20250603	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
26	关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 I 类基金份额开通直销网上交易定期投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-05-09
27	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-29
28	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金（博时沪深 300 指数 I）基金产品资料概要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-29
29	博时基金管理有限公司关于博时裕富沪深 300 指数证券投资基金增加 I 类基金份额及修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-28
30	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-28
31	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-28
32	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-22
33	博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
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-20250408	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
35	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
36	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 年年	中国证券报、基金管理	2025-03-31

	度报告	人网站、证监会基金电 子披露网站	
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-20250325	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电 子披露网站	2025-03-25
38	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电 子披露网站	2025-01-22
39	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金分红公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电 子披露网站	2025-01-09
40	博时裕富沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电 子披露网站	2025-01-08

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二六年三月三十一日