博时裕富沪深300指数证券投资基金 2018年年度报告摘要

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：二〇一九年三月二十九日

§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2019年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

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		
交易代码	050002		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2003年8月26日		
基金管理人	博时基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,897,084,267.35份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	博时沪深300指数A	博时沪深300指数C	博时沪深300指数R
下属分级基金的交易代码	050002	002385	960022
报告期末下属分级基金的份额总额	4,656,002,892.02份	241,081,375.33份	-份

2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国资本市场的长期增长，本基金将以对标的指数的长期投资为基本原则，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将持基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	95%×沪深300指数＋5%×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，最大程度抵出用数量化风险管理手段，以偏离度、跟踪误差等风险控制指标对基金资产风险进行实时跟踪控制与管理。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	田蓉
	联系电话	0755-83169999	010-67596096
	电子邮箱	service@bosera.com	tianqing.12@ccb.com
客户服务电话		95105568	010-67596096
传真		0755-83195140	010-66275853

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	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§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

3.1.1期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
	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	-317,288,080.06	709,202,079.62	96,201,772.23
本期利润	-1,419,496,613.79	1,273,683,185.357	-149,068,237.81
加权平均基金份额本期利润	-0.3014	0.3176	-0.0367
本期基金份额净值增长率	-21.46%	27.03%	-3.71%
3.1.2期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
	博时沪深300指数A	博时沪深300指数A	博时沪深300指数A
期末可供分配基金份额利润	0.1615	0.4826	0.1678
期末基金资产净值	5,408,102,991.40	5,666,519,728.91	4,621,542,481.65
期末基金份额净值	1.1615	1.4826	1.1678

2. 博时沪深300指数C：

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
	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	-15,696,174.14	8,650,468.29	1,893,275.57
本期利润	-65,882,040.34	13,244,531.40	816,902.87
加权平均基金份额本期利润	-0.3830	0.3002	0.0564
本期基金份额净值增长率	-21.77%	26.52%	20.38%
3.1.2期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
	博时沪深300指数C	博时沪深300指数C	博时沪深300指数C
期末可供分配基金份额利润	0.1043	0.1794	0.0079
期末基金资产净值	277,198,707.58	159,840,338.00	44,066,775.92
期末基金份额净值	1.1498	1.4715	1.1631

3. 博时沪深300指数R：

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
	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	-61.99	128.76	36.83
本期利润	-233.17	246.27	4.90
加权平均基金份额本期利润	-0.2332	0.2463	0.0049
本期基金份额净值增长率	-18.67%	24.51%	0.49%
3.1.2期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
	博时沪深300指数R	博时沪深300指数R	博时沪深300指数R
期末可供分配基金份额利润	-	0.1656	0.0049
期末基金资产净值	-	1,251.17	1,004.90
期末基金份额净值	-	1.2512	1.0049

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-11.55%	1.50%	-11.83%	1.56%	0.28%	-0.06%
过去六个月	-12.79%	1.28%	-13.51%	1.42%	0.72%	-0.04%
过去一年	-21.46%	1.28%	-24.10%	1.27%	2.64%	0.01%
过去三年	-3.93%	1.15%	-18.15%	1.12%	14.22%	0.03%
过去五年	79.91%	1.51%	28.69%	1.46%	51.22%	0.05%
自基金合同生效起至今	272.76%	1.60%	139.41%	1.60%	133.35%	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	-11.64%	1.50%	-11.83%	1.56%	0.19%	-0.06%
过去六个月	-12.97%	1.28%	-13.51%	1.42%	0.54%	-0.04%
过去一年	-21.77%	1.28%	-24.10%	1.27%	2.33%	0.01%
自基金合同生效起至今	19.14%	1.04%	2.57%	1.01%	16.57%	0.03%

注：自2016年1月27日起，本基金新增C类份额。

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
过去三个月	-6.48%	1.92%	-6.44%	1.99%	-0.04%	-0.07%
过去六个月	-8.75%	1.48%	-8.23%	1.53%	-0.52%	-0.05%
过去一年	-18.67%	1.31%	-19.47%	1.30%	0.80%	0.01%
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，本基金份额全部融空，故沪深300R类份额数据截止日为2018年11月14日。

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

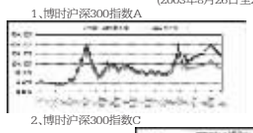
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时裕富沪深300指数证券投资基金

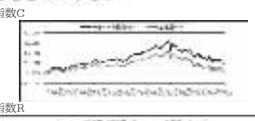
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年8月26日至2018年12月31日)

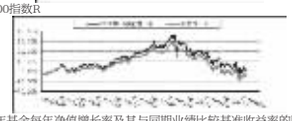
1、博时沪深300指数A



2、博时沪深300指数C



3、博时沪深300指数R

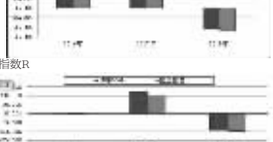


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

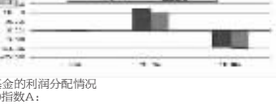
博时裕富沪深300指数证券投资基金

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

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
2018年	0.049	10,740,105.67	7,680,224.04	18,420,329.71	-
2016年	0.120	28,128,266.70	19,231,141.56	47,359,408.26	-
合计	0.169	38,868,372.37	26,911,365.60	65,779,737.97	-

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
2018年	0.018	149,814.36	103,308.16	253,122.52	-
合计	0.018	149,814.36	103,308.16	253,122.52	-

3、博时沪深300指数R：

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
2018年	0.017	1.70	-	1.70	-
合计	0.017	1.70	-	1.70	-

§4管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至2018年12月31日，博时基金公司共管理181只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾8638亿元人民币，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2439亿元人民币，累计分红逾916亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至2018年4季末：

博时固定收益类基金业绩表现亮眼。在参与银河排名的107只固收产品（各类份额分开计算）中，有54只产品银河同类排名前1/2。债券型基金中，博时宏观回报债券A/B类、博时宏观回报债券C类2018年全年净值增长率均分别在200只、142只同类基金中排名第1，博时天顺债券A类2018年全年净值增长率在200只同类基金中排名第4，博时天顺债券C类2018年全年净值增长率在142只同类基金中排名第5，博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕康纯债债券、博时双月新定期支付债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/10，博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时裕利纯债债券2018年全年净值增长率排名均在银河同类前1/8；货币型基金中，博时合惠货币B类、博时现金宝货币B类2018年全年净值增长率分别在291只同类基金中排名第8、第29，博时合惠货币A类2018年全年净值增长率在311只同类基金中排名第11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018年A股市场震荡下行，博时旗下参与银河排名的83只权益产品（各类份额分开计算）中，56只银河同类排名在前1/2。其中，股票型基金里，博时工业4.0主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前1/4；混合型基金中，博时乐臻定开混合2018年全年净值增长率在44只同类基金中均排名第4，博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略A类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前1/10，博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰A类等基金业绩排名在银河同类前1/4；指数基金中，博时上证超大盘ETF及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前1/10，博时上证50ETF及其联接基金A类业绩排名在银河同类前1/6，博时沪深300指数业绩排名在银河同类前1/3。

商品型基金当中，博时黄金ETF联接A类2018年全年净值增长率同类排名第1。

QDII基金方面，博时标普500ETF、博时标普500ETF联接A类2018年全年净值增长率银河同类排名均位于前1/3。

2、其他大事件

2018年12月28日，由新华网主办的第十一届“中国企业社会责任峰会”暨2018中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的始终倡导和企业公民义务的切实履行，老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获“2018中国社会责任杰出企业奖”。

2018年12月22日，东方财富在南京举办的“2018东方财富风云榜暨基情20年”颁奖典礼上，博时基金喜获两项大奖，博时基金江向阳总经理获得“基情20周年最受尊敬行业领袖”奖；博时主题行业混合（LOF）荣登“天天基金年度产品热销榜”。

2018年12月21日，由华夏时报社主办的“华夏机构投资者年会暨第十二届金蝉奖颁奖盛典”在北京召开，本次年会的主题是“金融业2019年：突破与回归”，博时基金荣获“2018年度基金管理公司”。

2018年12月21日，由北京商报社、北京品牌协会主办的“科技赋能与金融生态再造”——2018年度（第四届）北京金融论坛在京成功举办，博时基金荣获“技术领先价值奖”。

2018年12月15日，第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单，其中博时安盈债券基金（A类：000084，C类：000085）凭借年内出色的业绩表现以及在60天以用户中的超高人气，一举斩获“最受90后用户喜爱的产品奖”。

2018年11月16日，由《每日经济新闻》主办的“2018公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼”在成都举行，凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守，博时基金一举摘得“公募20年特别贡献奖——创造收益”这一重磅奖项，同时，旗下专户板块获“专户业务最具竞争力基金公司”奖。

2018年11月1日，博时基金正式加入联合国责任投资原则组织（简称UN PRI），成为中国较早加入UN PRI国际组织的资产管理机构之一。

2018年10月17日，由南方财经全媒体集团和21世纪传媒举办的21世纪国际财经峰会暨“金帆奖”评选在深圳举行，凭借对价值投资理念的坚守和出色的综合资管能力，博时基金一举斩获“2018年度基金管理公司金帆奖”这一重磅奖项。

2018年9月7日，由证券时报主办的“2018中国A1金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行，凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维，博时基金副总裁王德英获得了“2018中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018年9月6-9日，在阿拉善生态基金会主办，深圳证券信息、全景网协办，深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的“2018第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛”中，由4名博时员工朱盟（信息技术部）、过钧（固定收益总部）、王飞（信息技术部）、王盼（信息技术部）组成的代表队，成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠，率先全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018年8月，全国社会保障基金境内委托投资管理人2017年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获A档，三个社保委托组合获评“综合考评A档”，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获3项个人奖项。博时基金副总裁谢高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10年长期贡献社保表彰”，用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合、会金最极高。同时，董良泓本人还摘得“10年贡献社保表彰”的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予2人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3年贡献社保表彰”。

2018年7月19日，由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业20周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得“优秀基金管理人”大奖；副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

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

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

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

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

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

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

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

2018年2月2日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桂冠辉	指数与量化投资部投资副总/基金经理	2015-07-21	-	9.4	桂冠辉先生，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，历任战略程序员、高级研究员、基金经理助理，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日一至今）、博时中证淘金大数据100指数型证券投资基金（2015年7月21日一至今）、博时中证银联智通大数据100指数型证券投资基金（2016年5月20日一至今）、博时中证500指数增强型证券投资基金（2017年9月26日一至今）、博时富时中国A股投资证券投资基金（2018年6月20日一至今）、博时中证500指数增强型证券投资基金（2017年9月26日一至今）、博时富时中国A股投资证券投资基金（2018年6月20日一至今）。
陈晓志	基金经理助理	2015-11-16	2018-02-08	10.2	2007年至2008年在华为技术有限公司工作，2009年加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级开发经理、基金经理助理，现任投资经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 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《公平交易管理制度》，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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年全年，A股市场震荡下行。仅1月出现连续上涨，之后全年进入熊市，最终收于2494点。风格方面，下跌中，小盘及创业板跌幅更大，大盘防御性更好，高股息股票表现抢眼。行业方面餐饮旅游、银行等行业大幅跑赢市场，综合及电子元器件行业表现落后。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日，本基金A类基金份额净值为1.1615元，份额累计净值为3.1584元，本基金C类基金份额净值为1.1498元，份额累计净值为1.1516元，本基金R类基金期末无份额。报告期内，本基金A基金份额净值增长率为-21.46%，本基金C基金份额净值增长率为-21.77%，同期业绩基准增长率-24.10%；本基金R基金份额净值增长率为-18.67%，同期业绩基准增长率-19.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年，美股和原油反弹，对海外股市共振的担忧有望减弱。中美贸易谈判也有可能往好的方向发展，我们预期会达成部分协议，后续继续谈判。目前市场主要焦点是企业盈利状况。18年市场大幅下行，估值显著压缩，目前看是对19年经济增速下行，上市公司盈利持续走弱的状况的提前反应。 展望19年，我们认为有可能会出现3个季度的盈利下滑，但是宽松的货币政策和积极的财政政策在持续出台，能够部分对冲负面效应的冲击，虽然不排除短期极端情绪造成超调的可能，但是我们认为全年市场应该是走平甚至略向上。因为股市往往是领先于基本面的，虽然目前没有基本面明确改善的信息，但是已经较低的估值和市场情绪给我们提供了一定的安全边际。

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，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；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、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律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，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2018年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《合规管理制度》、《养老目标证券投资基金子基金选择标准与制度》等制度。修订了《合规考核管理制度》、《投资决策委员会制度》、《债券型基金投资股票管理流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险控工作。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《证券投资基金销售管理办法》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，并努力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

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

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

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：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份额净值不能低于面值；基金当期收益先弥补以前亏损后，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。

本基金管理人于2018年1月11日发布公告，以2017年12月29日已实现的可供分配收益为基准，本基金A类基金份额每10份基金份额发放红利0.049元人民币，本基金C类基金份额每10份基金份额发放红利0.018元人民币，本基金R类基金份额每10份基金份额发放红利0.017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损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，博时沪深300指数C实施利润分配的金额为253,122.52元

报告期内，博时沪深300指数R实施利润分配的金额为1.70元。

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

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§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：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	354,561,537.36	167,534,589.60
结算备付金	13,699,373.15	12,686,751.33
存出保证金	762,191.06	563,718.96
交易性金融资产	5,374,468,497.06	5,629,044,900.46
其中：股票投资	5,353,918,545.66	5,459,165,089.06
基金投资	-	-
债券投资	20,549,951.40	169,879,811.40
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	24,999,992.93
应收利息	221,885.19	3,190,960.72
应收股利	-	-
应收申购款	17,338,343.65	9,861,459.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,761,051,828.27	5,847,882,373.36
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	62,219,781.49	-
应付赎回款	1,742,898.55	8,755,442.02
应付管理人报酬	4,777,046.49	4,805,101.56
应付托管费	974,907.46	980,632.97
应付销售服务费	89,297.36	42,562.80
应付交易费用	5,270,614.16	7,352,461.63
应交税费	381.92	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	675,201.36	584,857.30
负债合计	75,750,129.29	22,521,058.28
所有者权益：		
实收基金	4,897,084,267.35	3,927,737,497.80
未分配利润	788,217,431.63	1,897,623,817.28
所有者权益合计	5,685,301,698.98	5,825,361,315.08
负债和所有者权益总计	5,761,051,828.27	5,847,882,373.36

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额总额4,897,084,267.35份，其中A类基金份额净值1.1615元，基金份额总额4,656,002,892.02份；C类基金份额净值1.1498元，基金份额总额241,081,375.33份；无R类基金份额。

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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-1,371,425,890.80	1,390,115,368.08
1.利息收入	4,562,157.10	5,229,863.64
其中：存款利息收入	2,987,029.48	1,368,494.08
债券利息收入	1,511,008.17	3,769,014.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	54,119.45	92,354.88
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-225,912,760.08	814,260,987.24
其中：股票投资收益	-354,562,806.27	706,606,715.41
基金