

# 博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年年度报告 2019 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年三月二十七日

## §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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 25 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。

本报告期自 2019 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 .....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
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 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
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 .....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	19
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 .....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计意见 .....	19
6.2 形成审计意见的基础 .....	19
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任 .....	20
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任 .....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	24
7.4 报表附注 .....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
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 .....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	72

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 .....	72
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 .....	72
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 .....	73
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 .....	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	74
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 .....	74
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>75</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	75
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 .....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4 基金投资策略的改变 .....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>79</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 .....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	80
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>80</b>
13.1 备查文件目录 .....	80
13.2 存放地点 .....	80
13.3 查阅方式 .....	80

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化价值股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化价值股票	
基金主代码	005960	
交易代码	005960	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	429,295,435.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
下属分级基金的交易代码	005960	005961
报告期末下属分级基金的份额总额	25,404,457.13 份	403,890,977.96 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。</p>
投资策略	<p>1、A 股投资策略：本基金运用量化方法进行价值型投资，本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础，对其中的价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。</p> <p>2、港股投资策略：本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。</p> <p>3、债券投资策略：由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略：本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，在力争本金安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。</p> <p>5、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金现阶段主要通过股指期货合约调节整体组合的市场风险。</p>

	7、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于中高风险/收益的基金。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	贺倩
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张光华	周慕冰

## 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="http://www.bosera.com">http://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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

## §3 主要财务指标、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至
---------------	--------	---------------------------

	2018 年 12 月 31 日			
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
本期已实现收益	16,827,220.28	11,509,590.93	-10,809,797.98	-970,463.20
本期利润	20,550,542.61	28,875,140.37	-12,913,536.95	-1,269,037.05
加权平均基金份额本期利润	0.3963	0.1704	-0.1142	-0.0452
本期加权平均净值利润率	39.79%	16.81%	-11.83%	-4.58%
本期基金份额净值增长率	24.07%	23.08%	-13.26%	-13.62%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期末可供分配利润	1,934,808.63	25,507,069.98	-12,436,991.25	-1,405,043.67
期末可供分配基金份额利润	0.0762	0.0632	-0.1326	-0.1362
期末基金资产净值	27,339,265.76	429,398,047.94	81,388,761.90	8,909,790.58
期末基金份额净值	1.0762	1.0632	0.8674	0.8638
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金份额累计净值增长率	7.62%	6.32%	-13.26%	-13.62%

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. 博时量化价值股票 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	7.34%	0.76%	7.16%	0.64%	0.18%	0.12%
过去六个月	5.35%	0.90%	5.50%	0.73%	-0.15%	0.17%
过去一年	24.07%	1.21%	27.63%	1.01%	-3.56%	0.20%
自基金合同生效起至今	7.62%	1.22%	10.88%	1.12%	-3.26%	0.10%

#### 2. 博时量化价值股票 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	7.12%	0.76%	7.16%	0.64%	-0.04%	0.12%
过去六个月	4.93%	0.90%	5.50%	0.73%	-0.57%	0.17%



过去一年	23.08%	1.21%	27.63%	1.01%	-4.55%	0.20%
自基金合同生效起至今	6.32%	1.22%	10.88%	1.12%	-4.56%	0.10%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。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 70%、20%、10%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。

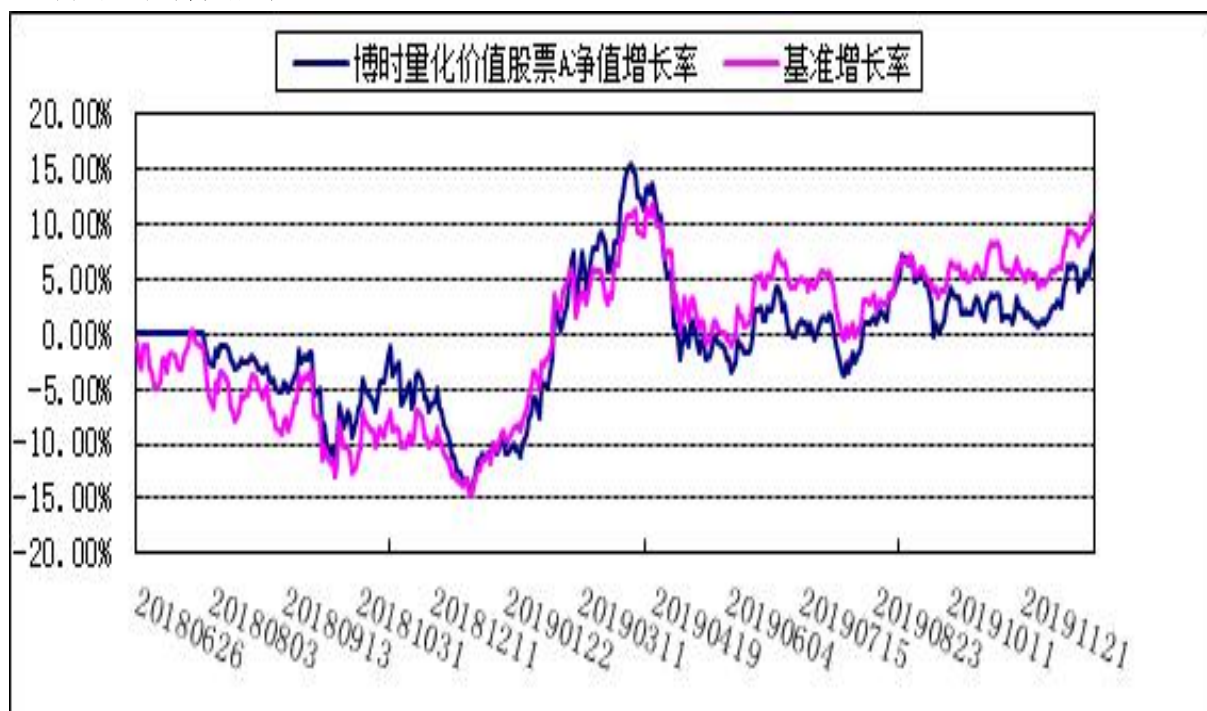
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 博时量化价值股票型证券投资基金

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

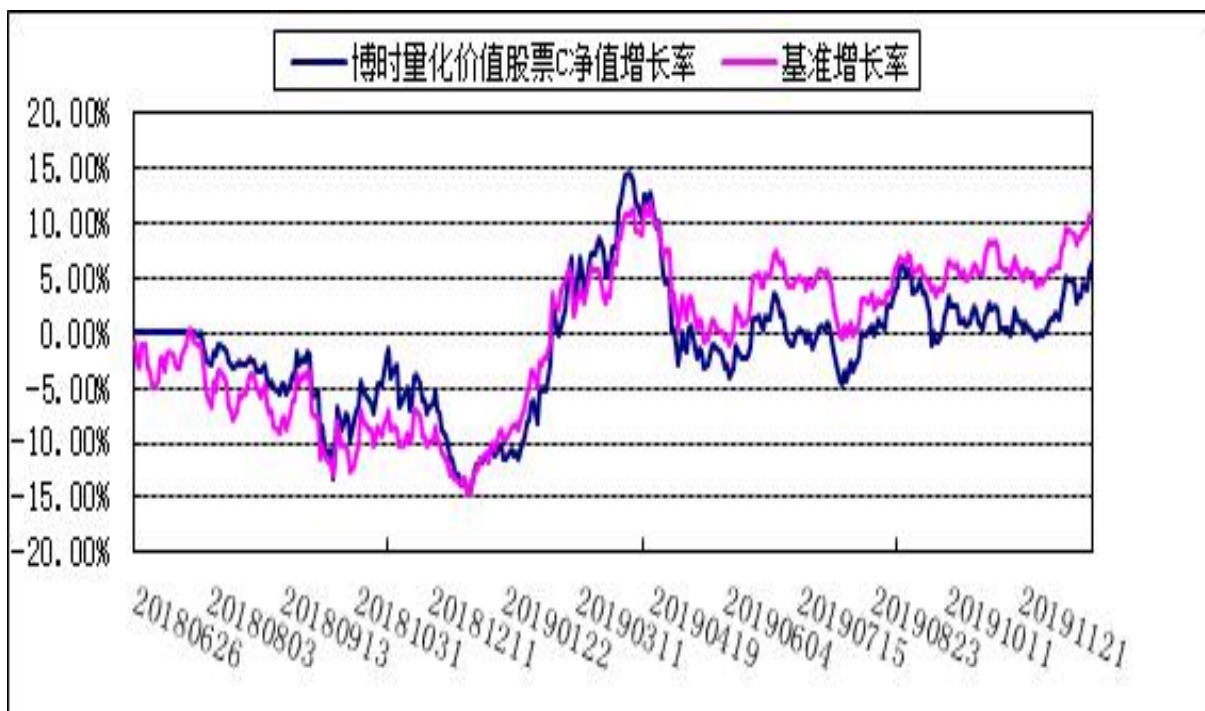
(2018 年 6 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日)

#### 1、博时量化价值股票 A



#### 2、博时量化价值股票 C



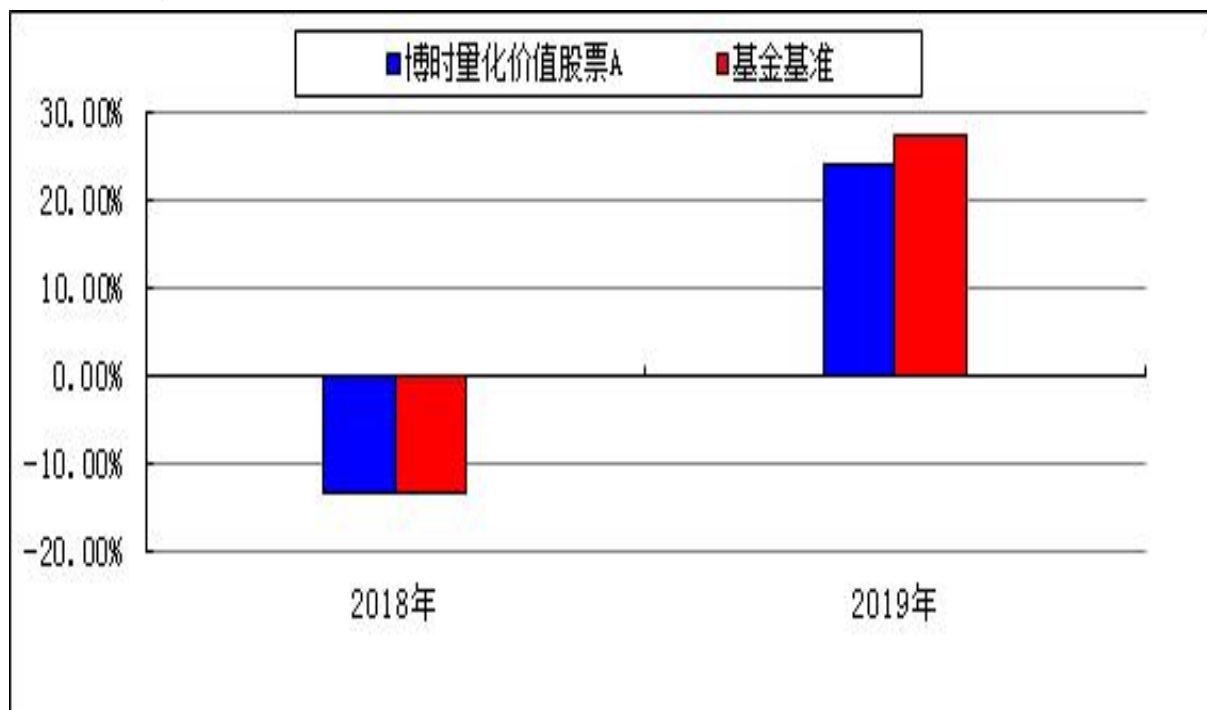


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

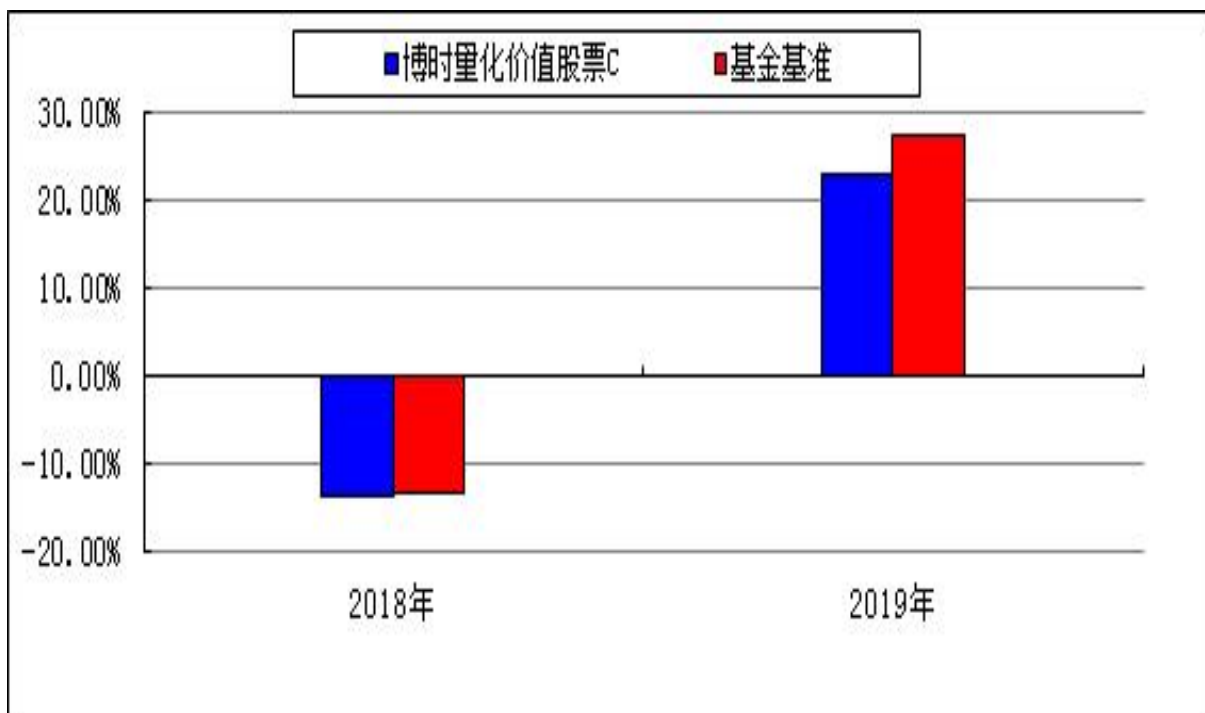
#### 博时量化价值股票型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

#### 1、博时量化价值股票 A



#### 2、博时量化价值股票 C



注：本基金的基金合同于 2018 年 6 月 26 日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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”是博时的使命，“做投资价值的发现者”是博时的理念。截至 2019 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 199 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 10668 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 3270 亿元人民币，累计分红逾 1206 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2019 年 4 季末：

博时旗下权益类基金业绩表现优异，70 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 30%，38 只产品净值增长率超过 40%，10 只产品净值增长率超过 60%，4 只产品净值增长率超过 80%，2 只产品净值增长率超过 90%；从相对排名来看，62 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，32 只产品同类排名在前 1/4，13 只产品同类排名在前 10，2 只产品同类排名第 1。

其中，博时回报混合、博时医疗保健混合 2019 年净值增长率均同类排名第 1，博时弘泰定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(C 类) 同类排名第 2，博时文体娱乐主题混合、博时丝路主题股票(C 类)、博时乐臻定期开放混合、博时荣享回报灵活配置定期开放混合(A 类)、博时弘盈定期开放混合(C 类)、博时特许价值混合(A 类)、博时中证银联智慧大数据 100 指数(C 类)、博时量化平衡混合、博时中证淘金大数据 100 指数(I 类)同类排名分别为第 4、第 4、第 7、第 7、第 7、第 8、第 8、第 10、第 10，博时睿利事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时鑫泽灵活配置混合(C 类)、博时裕益灵活配置混合同类排名均在前 1/10，博时鑫源灵活配置混合(C 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(C 类)、博时互联网主题灵活配置混合、博时新兴消费主题混合、博时沪港深优质企业灵活配置混合(C 类)、博时鑫泽灵活配置混合(A 类)、博时鑫源灵活配置混合(A 类)、博时创新驱动灵活配置混合(C 类)、博时颐泰混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)、博时新兴成长混合、博时颐泰混合(C 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时厚泽回报灵活配置混合(A 类)、博时鑫瑞灵活配置混合(C 类)、博时战略新兴产业混合、博时睿远事件驱动灵活配置混合(LOF)、博时沪港深优质企业灵活配置混合(A 类)、博时策略灵活配置混合等产品 2019 年来净值增长率同类排名均在前 1/4。此外，博时裕隆灵活配置混合、博时主题行业混合(LOF)、博时汇智回报灵活配置混合、博时外延增长主题灵活配置混合、博时产业新动力灵活配置混合(A 类)等产品不仅 2019 年业绩表现较好，成立以来年化回报亦可观，长期投资价值凸显。

博时固定收益类基金表现同样可圈可点，67 只产品（各类份额分开计算，不含 QDII，下同）2019 年净值增长率超过 4%，19 只产品净值增长率超过 6%，8 只产品净值增长率超过 10%，2 只产品净值增长率超过 30%；从相对排名来看，68 只产品 2019 年净值增长率银河证券同类排名在前 1/2，40 只产品同类排名在前 1/4，18 只产品同类排名在前 1/10，6 只产品同类排名前 5，1 只产品同类排名第 1。

其中，博时安康 18 个月定期开放债券(LOF)2019 年净值增长率同类排名第 1，博时安盈债券(A 类)、博时安盈债券(C 类)、博时月月薪定期支付债券、博时转债增强债券(C 类)、博时安心收益定期开放债券(C 类)同类排名分别在第 2、第 3、第 4、第 4、第 5，博时富瑞纯债债券(A 类)、博时转债增强债券(A 类)、博时信用债券(C 类)、博时安心收益定期开放债券(A 类)、博时裕顺纯债债券、

博时合惠货币(B类)、博时信用债券(A/B类) 同类排名分别在第 6、第 6、第 7、第 8、第 9、第 9、第 9, 博时裕腾纯债债券、博时裕泰纯债债券、博时岁岁增利一年定期开放债券、博时裕创纯债债券、博时裕盈纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时富祥纯债债券、博时富兴纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时信用债纯债债券(A类)、博时信用债纯债债券(C类)同类排名均在前 1/10, 博时稳健回报债券(LOF)(C类)、博时合惠货币(A类)、博时裕安纯债债券、博时稳健回报债券(LOF)(A类)、博时合鑫货币、博时聚瑞纯债 6 个月定期开放债券发起式、博时现金宝货币(B类)、博时现金宝货币(A类)、博时外服货币、博时富业纯债 3 个月定期开放债券发起式、博时安丰 18 个月定期开放债券(A类-LOF)、博时裕盛纯债债券、博时富腾纯债债券、博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时安瑞 18 个月定期开放债券(A类)、博时天颐债券(C类)、博时安泰 18 个月定期开放债券(A类)、博时宏观回报债券(C类)、博时景兴纯债债券、博时裕达纯债债券等产品同类排名均在前 1/4。

博时旗下 QDII 基金继续表现突出, 博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接(C类)、博时标普 500ETF 联接(A类) 2019 年净值增长率分别超过或接近 30%, 同类排名分别为第 4、第 6、第 14; 博时亚洲票息收益债券(人民币) 2019 年净值增长率超过 10%, 同类排名第 7。

商品型基金当中, 博时黄金 ETF、博时黄金 ETF 联接(A类)、博时黄金 ETF 联接(C类) 2019 年均较好地跟上了黄金上涨行情, 净值增长率均超过 18%, 其中博时黄金 ETF 净值增长率同类排名第 3。

## 2、其他大事件

2019 年 12 月 26 日, 界面新闻在京举办“2019 中国优金融奖”颁奖盛典, 博时基金凭借“政策响应、行业领先、实体支持、创新赋能”等方面的综合卓越表现, 荣获“年度基金公司”大奖以及“2019 中国好品牌”。

2019 年 12 月 21 日, 和讯网“第十七届财经风云榜金融峰会”在上海举办, 博时基金荣获“年度卓越影响力基金公司”, 博时基金葛晨获“年度卓越公募基金经理”。

2019 年 12 月 20 日, 华夏时报“华夏机构投资者年会暨第十三届金蝉奖颁奖典礼”在北京举办。博时基金荣获“年度投研领先公募基金公司”。

2019 年 12 月 12 日, 投资者网“2019 中国投资年度排名颁奖典礼”在上海隆重举行。博时基金荣获“年度值得信任卓越基金公司”。

2019 年 12 月 10 日, 投资时报“见未来”——2019 第二届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典在京举办, 博时基金荣获投资时报颁发的 2019 年度金禧奖“2019 最佳公募基金公司奖”。

2019 年 12 月 5 日, 金融界“大变局·大视野·大未来”——第四届智能金融国际论坛暨 2019 金融

界“领航中国”年度盛典在北京举行，博时基金斩获四项大奖，博时基金荣获“杰出年度基金公司奖”，凭借在金融科技方面的杰出贡献，获得“杰出年度智能金融品牌奖”，博时基金总经理江向阳荣获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金王俊荣获“杰出年度基金经理奖”。

2019 年 12 月 5 日，21 世纪财经“金帆奖”颁奖典礼在广州举行，博时基金凭借在业内所取得的突出成就与贡献，获得“2019 年度基金管理公司金帆奖”。

2019 年 11 月 29 日，《经济观察报》在北京举办了“卓越金融企业”颁奖典礼，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”奖项。

2019 年 11 月 29 日，北京商报“寻路未来金融”——2019 年度北京金融论坛在京举办，博时基金凭借优秀的投研能力及全面的产品布局，荣获“北京金融业十大金融品牌——产品创新奖”。

2019 年 11 月 28 日，新浪财经 2019 新浪金麒麟论坛•ESG 峰会在北京举办，会上公布了 2019 中国企业 ESG“金责奖”评选名单，意在嘉奖那些对中国 ESG 事业做出卓越贡献的企业和机构，博时基金荣获 2019 中国企业 ESG 金责奖——“责任投资最佳基金公司奖”。

2019 年 11 月 22 日，2019 年度中国金融发展论坛暨金鼎奖颁奖典礼在北京举行，在资产管理领域甄选出了一批优质的标杆企业。群雄逐鹿百舸争流，博时基金跻身新资管时代的佼佼者，成功斩获“普惠金融奖”和“最佳海外固收产品奖”两项荣誉。

2019 年 11 月 15 日，中国经济网“2019 中国金融服务于创新论坛”在北京举办，博时基金荣获“金融服务 100 强”及“金融创新 100 强”称号。

2019 年 11 月 15 日，2019 年度第一财经金融价值榜（CFV）颁奖典礼在上海举行，博时基金凭借优秀的资产管理能力摘得“年度金融机构”奖项。

2019 年 11 月 9 日，人民日报社《国际金融报》和河南省商丘市人民政府共同主办的“第三届资本市场扶贫高峰论坛”在商丘市举办，博时基金荣获“年度扶贫企业奖”。

2019 年 10 月，由中国网主办的 2019 年度第二届“中国网之优秀金融扶贫先锋榜”评选活动圆满结束，经过多轮线上投票和业内专家、学者的专业评审，博时基金荣获“精准扶贫先锋机构”奖。

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

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

2019 年 7 月 5 日，2019 金牛基金高峰论坛暨第十六届中国基金金牛奖颁奖典礼在北京进行，



博时基金研究部总经理王俊和固定收益总部专户组投资总监张李陵分别获得“人气金牛”奖项，两位各自管理的绩优产品博时主题行业混合(LOF) (160505) 和博时信用债纯债债券 (050027) 分别荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖和“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2019 年 6 月 20 日，由中国基金报独家主办的第六届中国基金业“英华奖”评选隆重揭晓，博时基金在此次英华奖中揽获 6 项最佳基金经理大奖。其中，博时基金蔡滨拿下“三年期股票投资最佳基金经理”；陈凯杨荣膺“五年期纯债投资最佳基金经理”；何凯则一举揽获“三年期海外固收投资最佳基金经理”和“五年期海外固收投资最佳基金经理”两项桂冠；过钧则再度获得“三年期二级债投资最佳基金经理”和“五年期二级债投资最佳基金经理”称号。

2019 年 4 月 25 日，由上海证券报主办的第十六届“金基金”奖的评选结果如期揭晓，博时基金在评选中一举夺得最具份量的公司奖项“2018 年度金基金•TOP 公司”奖，博时主题行业 (160505) 继去年获得“三年期金基金分红”奖，后拿下“2018 年度金基金•十年期偏股混合型基金”奖，同时，博时裕瑞纯债债券 (001578) 获得“2018 年度金基金•一年期债券基金”奖。

2019 年 4 月 14 日，第十六届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，博时基金旗下绩优产品博时主题行业混合(LOF) (160505) 荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”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。

2019 年 3 月 21 日，由证券时报主办的第六届中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛在北京隆重举行，同时第十四届中国基金业明星基金奖和中国公募基金首届英华奖也随之揭晓。博时基金凭借出色的资产管理能力和优秀的业绩表现，一举摘得“2018 年度十大明星基金公司”称号。在英华奖的评选中，博时基金在获评“2018 年度最佳电商业务发展基金公司”奖的同时，还凭借博时基金 20 周年品牌传播项目拿下了“2018 年度最佳营销策划案例 (最佳综合)”奖。此外，博时慈善基金会公益助学项目获得了“2018 年度最佳社会公益实践案例”。在产品奖方面，助力央企结构转型和改革的博时央企结构调整 ETF 获评英华奖“2018 年度最佳创新基金产品”；博时裕瑞纯债债券获得“2018 年度普通债券型明星基金”奖；博时宏观回报债券则凭借同类可比基金第一的佳绩喜获“2018 年度积极债券型明星基金”奖；博时亚洲票息收益债券(QDII)、博时双月薪定期支付债券双双以过去五年稳居同类前列的好成绩分别拿下“五年持续回报 QDII 明星基金”、“五年持续回报普通债券型明星基金”称号；博时裕恒纯债债券则摘得“三年期持续回报普通债券型明星基金”奖。

2019 年 2 月 25 日，博时国际在“投资洞见与委托” (Insights&Mandate) 举办的第二届专业投资奖评选活动中荣获“2019 年度最佳机构法人投资经理”，并凭借博时国际于 2018 年 5 月 10 日共同成立的“博时—东方红大中华债券基金”获“最佳创新产品”大奖。

2019 年 1 月 23 日，由深圳市福田区金融发展事务署首届举办的“香蜜湖金融科技奖”颁奖

典礼在深圳福田隆重举行，《博时基金基于大数据技术升级量化投资技术》项目荣获优秀项目奖，博时基金采用金融科技为业务赋能的创新发展成果获得行业和地方政府高度认可。

2019 年 1 月 11 日，中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中债登”）公布了《2018 年度中债优秀成员评选结果》。凭借在债券市场上的深厚积淀和优异的投研业绩，博时基金获评年度“优秀资产管理人”称号，全行业获此殊荣的基金公司仅有 10 家。

#### 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		
林景艺	基金经理	2018-06-26	-	9.6	林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理。现任博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015 年 5 月 20 日—至今)、博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日—至今)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/基金经理	2018-06-26	-	17.6	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监、博时价值增长证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日)、博时价值增长贰号证券投资基金



					(2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2018 年 6 月 21 日)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日—至今)的基金经理。
周江	高级研究员兼基金经理助理	2018-07-27	-	4.7	2014 年 1 月至 2015 年 4 月在平安磐海资本工作。2015 年 4 月加入博时基金管理有限公司，曾任研究员，现任高级研究员兼基金经理助理。

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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

#### 4.3 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

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 144 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

2019 年，A 股市场整体震荡上行，主要指数皆取得两位数的涨幅，主要涨幅集中于 1-4 月，之后的时间则以震荡行情为主。风格结构方面，大小盘风格切换频繁，整体来说大盘相对占优；成长风格在上半年表现抢眼，价值风格全年回撤；科技和消费龙头持续估值扩张，金融和周期板块则涨幅落后。行业间分化显著，中信一级行业指数中食品饮料、电子、家电涨幅超过 60%，建筑、钢铁、电力及公用事业、商贸零售等行业涨幅低于 10%。全部 A 股逾 3700 只股票，中位数涨幅在 15% 左右，个股涨幅集中度较高，比如食品饮料指数涨幅超过 70%，但是其中 100 只成分股涨幅的中位数仅为 25%。

本基金是风格鲜明的运用量化方法进行价值型投资的产品。我们以自主研发的量化多策略体系为基础，从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格等多个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资。当前，市场整体估值依然在历史相对低位，在这个估值基础上我们对于未来中长期的市场经不悲观，历史数据也验证了在市场底部区域布局低估值投资是一个非常可行的投资策略。未来我们将持续对价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0762 元，份额累计净值为 1.0762 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0632 元，份额累计净值为 1.0632 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 24.07%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 23.08%，同期业绩基准增长率 27.63%。

## 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 2020 年，宏观经济方面，全球主要经济体边际宽松倾向将弱于 2019 年，中美贸易摩擦的不确定性也依然存在，国际环境暂无明显改善迹象。新冠疫情难免对国内一季度经济增长有一定扰

动，但是就现有的信息来看，我们认为疫情对于经济全年增长影响有限。政策方面，未来一年国内宏观货币政策及股市微观流动性预期仍然相对宽松，预计疫情过后政府的逆周期调节政策将迅速发力，A 股市场的政策红利将逐步释放。市场情绪方面，一季度新冠疫情仍在高峰期，市场恐慌情绪仍在蔓延，短期冲击和波动难以避免。但我们认为疫情平抑后，市场仍将回归自身逻辑。全年维度来看，当前市场整体估值并不高，再叠加政策持续宽松、逆周期调节强化、中长期资金持续入市等积极因素，我们对 A 股市场 2020 年的表现并不悲观。景气度提升、业绩增长超预期同时估值合理的板块和个股更容易有良好表现。

港股方面，当前港股的估值处于历史底部位置，随着新冠疫情逐步平稳和港府止暴制乱措施的有效深入，我们认为 2020 年港股市场或有较好的投资机会，我们也将适时通过港股通渠道增加对港股低估值板块和个股的配置。

#### 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，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。

2019 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《基金中基金投资管理办法》、《科创板投资管理制度》、《反洗钱政策手册》等制度文件。修订了《博时基金管理有限公司章程》、《法定信息披露制度及流程》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”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监控工作。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为：由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 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

本基金在本报告期内，曾于 2019 年 3 月 19 日至 2019 年 6 月 13 日出现了连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

## §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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—博时基金管理有限公

司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# §6 审计报告

安永华明（2020）审字第 60669135\_A09 号

博时量化价值股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了博时量化价值股票型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

我们认为，后附的博时量化价值股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

## 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，我们独立于博时量化价值股票型证券投资基金，并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 其他信息

博时量化价值股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估博时量化价值股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督博时量化价值股票型证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 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，就可能导致对博时量化价值股票型证券投资基金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量化价值股票型证券投资基金不能持续经营。

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

我们与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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师 王珊珊

中国 北京

中国注册会计师 贺 耀  
 2020 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	7.4.7.1	24,099,797.83	6,284,948.55
结算备付金		1,451,928.80	1,137,395.57
存出保证金		348,457.22	65,326.95



交易性金融资产	7.4.7.2	432,822,652.96	83,997,416.65
其中：股票投资		429,532,572.96	83,805,431.05
基金投资		-	-
债券投资		3,290,080.00	191,985.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	68,301.39	2,097.97
应收股利		-	-
应收申购款		46,696.76	23,518.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>458,837,834.96</b>	<b>91,510,704.62</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		67,635.53	260,343.99
应付管理人报酬		343,748.53	121,504.10
应付托管费		95,485.69	20,250.69
应付销售服务费		281,446.80	6,089.03
应付交易费用	7.4.7.7	1,147,672.40	613,960.81
应交税费		0.64	2.09
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	164,531.67	190,001.43
<b>负债合计</b>		<b>2,100,521.26</b>	<b>1,212,152.14</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	429,295,435.09	104,140,587.40
未分配利润	7.4.7.10	27,441,878.61	-13,842,034.92
<b>所有者权益合计</b>		<b>456,737,313.70</b>	<b>90,298,552.48</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>458,837,834.96</b>	<b>91,510,704.62</b>

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额为 429,295,435.09 份，其中 A 类基金份额净值为人民币 1.0762 元，份额总额为 25,404,457.13 份；C 类基金份额净值为人民币 1.0632 元，份额总额为 403,890,977.96 份。

## 7.2 利润表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基 金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>61,622,767.75</b>	<b>-11,292,828.59</b>
1.利息收入		172,497.70	544,151.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	160,971.03	204,263.52
债券利息收入		11,526.67	601.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	339,286.57
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,217,483.58	-10,355,717.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	38,109,282.77	-10,592,028.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	191,839.03	39,531.41
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,916,361.78	196,779.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	21,088,871.77	-2,402,312.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	143,914.70	921,050.51
<b>减：二、费用</b>		<b>12,197,084.77</b>	<b>2,889,745.41</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	3,090,357.35	1,019,479.75
2. 托管费	7.4.10.2	558,123.80	169,913.31
3. 销售服务费		1,372,673.88	101,139.00
4. 交易费用	7.4.7.18	6,980,523.14	1,398,949.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.50	0.31
7. 其他费用	7.4.7.19	195,406.10	200,263.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>49,425,682.98</b>	<b>-14,182,574.00</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>49,425,682.98</b>	<b>-14,182,574.00</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	104,140,587.40	-13,842,034.92	90,298,552.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	49,425,682.98	49,425,682.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	325,154,847.69	-8,141,769.45	317,013,078.24
其中：1.基金申购款	567,105,347.14	3,093,631.21	570,198,978.35
2.基金赎回款	-241,950,499.45	-11,235,400.66	-253,185,900.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	429,295,435.09	27,441,878.61	456,737,313.70
项目	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	341,191,900.59	-	341,191,900.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,182,574.00	-14,182,574.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-237,051,313.19	340,539.08	-236,710,774.11
其中：1.基金申购款	5,253,609.05	-233,057.71	5,020,551.34
2.基金赎回款	-242,304,922.24	573,596.79	-241,731,325.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-

五、期末所有者权益 (基金净值)	104,140,587.40	-13,842,034.92	90,298,552.48
---------------------	----------------	----------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 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：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：成江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

博时量化价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]344号《关于准予博时量化价值股票型证券投资基金注册的批复》的注册，由博时基金管理有限公司于2018年6月1日至2018年6月22日向社会公开募集。基金合同于2018年6月26日生效，首次设立募集规模为341,191,900.59份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的80%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-50%；权证投资比例为基金资产净值的0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算

业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本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于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### **(1) 金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

###### **(2) 金融负债分类**

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### **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**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套

期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；



#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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)不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个

人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	24,099,797.83	6,284,948.55
定期存款	-	-
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	-	-
合计	24,099,797.83	6,284,948.55

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	410,848,734.01	429,532,572.96	18,683,838.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,287,360.00	3,290,080.00
	银行间市场	-	-
	合计	3,287,360.00	3,290,080.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	414,136,094.01	432,822,652.96	18,686,558.95
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	86,211,729.47	83,805,431.05	-2,406,298.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	188,000.00	191,985.60
	银行间市场	-	-
	合计	188,000.00	191,985.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	86,399,729.47	83,997,416.65	-2,402,312.82

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,545.43	1,416.12
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	718.63	562.98
应收债券利息	61,864.85	86.53
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	172.48	32.34
合计	68,301.39	2,097.97

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------



	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,147,672.40	613,960.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,147,672.40	613,960.81

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	31.67	1.43
应付证券出借违约金	-	-
其他应付款	-	-
预提费用	164,500.00	190,000.00
合计	164,531.67	190,001.43

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 博时量化价值股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	93,825,753.15	93,825,753.15
本期申购	58,819,010.10	58,819,010.10
本期赎回（以“-”号填列）	-127,240,306.12	-127,240,306.12
本期末	25,404,457.13	25,404,457.13

##### 博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,314,834.25	10,314,834.25
本期申购	508,286,337.04	508,286,337.04
本期赎回（以“-”号填列）	-114,710,193.33	-114,710,193.33
本期末	403,890,977.96	403,890,977.96

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 博时量化价值股票 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	-10,583,674.24	-1,853,317.01	-12,436,991.25
本期利润	16,827,220.28	3,723,322.33	20,550,542.61

本期基金份额交易产生的变动数	-2,073,452.07	-4,105,290.66	-6,178,742.73
其中：基金申购款	8,000,479.52	-8,034,801.64	-34,322.12
基金赎回款	-10,073,931.59	3,929,510.98	-6,144,420.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,170,093.97	-2,235,285.34	1,934,808.63

**博时量化价值股票 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	-1,201,990.19	-203,053.48	-1,405,043.67
本期利润	11,509,590.93	17,365,549.44	28,875,140.37
本期基金份额交易产生的变动数	50,600,425.20	-52,563,451.92	-1,963,026.72
其中：基金申购款	65,629,357.70	-62,501,404.37	3,127,953.33
基金赎回款	-15,028,932.50	9,937,952.45	-5,090,980.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,908,025.94	-35,400,955.96	25,507,069.98

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	125,455.94	194,822.68
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	32,780.64	9,187.35
其他	2,734.45	253.49
合计	160,971.03	204,263.52

注：其他为结算保证金利息收入

**7.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,277,305,846.77	429,089,263.86
减：卖出股票成本总额	2,239,196,564.00	439,681,292.84
买卖股票差价收入	38,109,282.77	-10,592,028.98

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
----	-----------------------------------	---

	31 日	效日) 至 2018 年 12 月 31 日
卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成交总额	3,443,456.47	854,048.80
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	3,247,745.90	814,000.00
减: 应收利息总额	3,871.54	517.39
买卖债券差价收入	191,839.03	39,531.41

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日 (基金合同生 效日) 至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,916,361.78	196,779.80
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	1,916,361.78	196,779.80

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日 (基金合同生 效日) 至 2018 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	21,088,871.77	-2,402,312.82
——股票投资	21,090,137.37	-2,406,298.42
——债券投资	-1,265.60	3,985.60
——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	21,088,871.77	-2,402,312.82

#### 7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	138,642.95	920,847.35
基金转换费收入	5,271.75	203.16
合计	143,914.70	921,050.51

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	6,980,523.14	1,398,949.45
银行间市场交易费用	-	-
合计	6,980,523.14	1,398,949.45

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	150,000.00
证券出借违约金		
银行汇划费	12,906.10	6,863.59
中债登账户维护费	22,500.00	3,000.00
其他	-	400.00
合计	195,406.10	200,263.59

### 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

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

### 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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司(“招商证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人股东

广厦建设集团有限责任公司	基金管理人股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人股东
博时资本管理有限公司	基金管理人子公司
博时基金(国际)有限公司	基金管理人子公司

注：以下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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月26日(基金合同生效日)至 2018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	1,287,998,494.60	26.71%	55,570,713.48	5.82%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月26日(基金合同生效日)至 2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	272,346.07	4.36%	-	-

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	占期末应付佣金总额的比例

招商证券	1,199,524.59	28.28%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 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	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	51,755.18	5.85%	51,755.18	8.43%

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。

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同 生效日）至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,090,357.35	1,019,479.75
其中：支付销售机构的客户维护费	325,366.05	410,676.39

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提（自 2019 年 11 月 27 日起变更为 0.90%）。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数} \quad (\text{自 2019 年 11 月 27 日起变更为 } H = E \times 0.90\% / \text{当年天数})$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同 生效日）至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	558,123.80	169,913.31

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----



各关联方名称	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
博时基金	-	1,344,822.76	1,344,822.76
中国农业银行	-	2,703.26	2,703.26
招商证券	-	130.81	130.81
合计	-	1,347,656.83	1,347,656.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
博时基金	-	1,775.69	1,775.69
中国农业银行	-	7,545.87	7,545.87
招商证券	-	6,964.12	6,964.12
合计	-	16,285.68	16,285.68

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。。

#### 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

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日） 至 2018 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
中国农业银行	24,099,797.83	125,455.94	6,284,948.55	194,822.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率/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**

无。

**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**

无。

**7.4.12 期末（2019 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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601658	邮储银行	2019-12-02	2020-06-10	首次公开发行限售	5.50	5.71	796,578.00	4,381,179.00	4,548,460.38	-
003816	中国广核	2019-08-14	2020-02-27	首次公开发行限售	2.49	3.53	562,958.00	1,401,765.42	1,987,241.74	-
601916	浙商银行	2019-11-18	2020-05-26	首次公开发行限售	4.94	4.66	294,195.00	1,453,323.30	1,370,948.70	-
601077	渝农商行	2019-10-16	2020-04-29	首次公开发行限售	7.36	6.26	147,778.00	1,087,646.08	925,090.28	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	43.98	43.98	4,306.00	189,377.88	189,377.88	-
688037	芯源微	2019-12-06	2020-06-16	首次公开发行限售	26.97	58.98	3,028.00	81,665.16	178,591.44	-
688058	宝兰德	2019-10-25	2020-05-06	首次公开发行限售	79.30	90.65	1,450.00	114,985.00	131,442.50	-
688198	佰仁医疗	2019-11-29	2020-06-09	首次公开发行限售	23.68	37.58	3,213.00	76,083.84	120,744.54	-
688078	龙软科技	2019-12-20	2020-06-30	首次公开发行限售	21.59	41.95	2,811.00	60,689.49	117,921.45	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新股未上市	28.21	28.21	3,153.00	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	5.74	5.74	1,146.00	6,578.04	6,578.04	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

110065	淮矿转债	2019-12-23	2020-01-13	新债未上市	100.00	100.00	4,220.00	422,000.00	422,000.00	
128089	麦米转债	2019-12-26	2020-01-21	新债未上市	100.00	100.00	664.00	66,400.00	66,400.00	

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 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
603799	华友钴业	2019-12-31	重要事项未公告	39.39	2020-01-02	40.43	11,100.00	405,578.00	437,229.00	

注：本基金截至 2019 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，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，将风险控制在此可承受的范围内。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.11%。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,801,680.00	-
合计	2,801,680.00	-

注：未评级债券为国债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	422,000.00	-
AAA 以下	66,400.00	-
未评级	-	-
合计	488,400.00	-

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金主要投资于上市交易的证券除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券

资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,099,797.83	-	-	-	24,099,797.83
结算备付金	1,451,928.80	-	-	-	1,451,928.80



存出保证金	348,457.22	-	-	-	348,457.22
交易性金融资产	2,801,680.00	-	488,400.00	429,532,572.96	432,822,652.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	68,301.39	68,301.39
应收申购款	-	-	-	46,696.76	46,696.76
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>28,701,863.85</b>	-	<b>488,400.00</b>	<b>429,647,571.11</b>	<b>458,837,834.96</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	67,635.53	67,635.53
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	343,748.53	343,748.53
应付托管费	-	-	-	95,485.69	95,485.69
应付销售服务费	-	-	-	281,446.80	281,446.80
应交税费	-	-	-	0.64	0.64
应付交易费用	-	-	-	1,147,672.40	1,147,672.40
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,531.67	164,531.67
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>2,100,521.26</b>	<b>2,100,521.26</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>28,701,863.85</b>	-	<b>488,400.00</b>	<b>427,547,049.85</b>	<b>456,737,313.70</b>
<b>上年度末 2018 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>
<b>资产</b>					
银行存款	6,284,948.55	-	-	-	6,284,948.55
结算备付金	1,137,395.57	-	-	-	1,137,395.57
存出保证金	65,326.95	-	-	-	65,326.95
交易性金融资产	-	-	191,985.60	83,805,431.05	83,997,416.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,097.97	2,097.97
应收申购款	-	-	-	23,518.93	23,518.93
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>7,487,671.07</b>	-	<b>191,985.60</b>	<b>83,831,047.95</b>	<b>91,510,704.62</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	260,343.99	260,343.99
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	121,504.10	121,504.10
应付托管费	-	-	-	20,250.69	20,250.69
应付销售服务费	-	-	-	6,089.03	6,089.03

应交税费	-	-	-	2.09	2.09
应付交易费用	-	-	-	613,960.81	613,960.81
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	190,001.43	190,001.43
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,212,152.14</b>	<b>1,212,152.14</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>7,487,671.07</b>	-	-	<b>191,985.60</b>	<b>82,618,895.81</b>
					<b>90,298,552.48</b>

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

本基金本报告期末及上年度末持有交易性债券投资或持有的交易性债券投资占比并不重大，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 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 2019年12月31日		上年度末 2018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	429,532,572.96	94.04	83,805,431.05	92.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	488,400.00	0.11	191,985.60	0.21
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	430,020,972.96	94.15	83,997,416.65	93.02

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)增加 5%	增加约 2,299	-
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)减少 5%	减少约 2,299	-

注：于上年度末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 419,430,000.88 元，属于第二层次的余额为人民币 13,392,652.08 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：第一层次人民币 83,776,478.65 元，第二层次人民币 220,938.00 元，第三层次人民币 0.00 元）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期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，在第一层次和第二层次之间无重大转换（上年度：无）。本基金本报告期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未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

##### 7.4.14.2 承诺事项

无。

##### 7.4.14.3 其他事项

无。

##### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## §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	429,532,572.96	93.61
	其中：股票	429,532,572.96	93.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,290,080.00	0.72
	其中：债券	3,290,080.00	0.72
	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	25,551,726.63	5.57
8	其他各项资产	463,455.37	0.10
9	合计	458,837,834.96	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,511,844.00	2.30
B	采矿业	23,223,739.00	5.08
C	制造业	165,351,302.13	36.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,512,255.54	0.99
E	建筑业	9,477,288.14	2.07
F	批发和零售业	9,394,413.00	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	3,980,689.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,814,903.85	3.68
J	金融业	127,368,929.36	27.89
K	房地产业	54,700,500.90	11.98
L	租赁和商务服务业	2,103,300.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	179,400.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	215,715.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,691,715.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	429,532,572.96	94.04

### 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	601318	中国平安	174,400	14,904,224.00	3.26
2	601997	贵阳银行	1,345,400	12,862,024.00	2.82
3	600782	新钢股份	1,637,257	8,399,128.41	1.84
4	600015	华夏银行	1,009,900	7,745,933.00	1.70
5	600565	迪马股份	1,977,035	7,077,785.30	1.55
6	600746	江苏索普	979,100	7,059,311.00	1.55
7	600282	南钢股份	1,997,100	6,889,995.00	1.51
8	600466	蓝光发展	931,400	6,864,418.00	1.50
9	600340	华夏幸福	238,900	6,856,430.00	1.50
10	601328	交通银行	1,192,000	6,710,960.00	1.47
11	600622	光大嘉宝	1,711,098	6,673,282.20	1.46
12	600325	华发股份	823,900	6,451,137.00	1.41
13	600000	浦发银行	503,100	6,223,347.00	1.36
14	603160	汇顶科技	27,300	5,631,990.00	1.23
15	300498	温氏股份	157,900	5,305,440.00	1.16
16	600153	建发股份	561,000	5,043,390.00	1.10
17	601838	成都银行	543,400	4,928,638.00	1.08
18	601577	长沙银行	533,200	4,836,124.00	1.06
19	601988	中国银行	1,300,300	4,798,107.00	1.05
20	601658	邮储银行	796,578	4,548,460.38	1.00
21	000157	中联重科	668,500	4,465,580.00	0.98
22	000876	新希望	221,800	4,424,910.00	0.97
23	300059	东方财富	277,000	4,368,290.00	0.96
24	601857	中国石油	674,100	3,930,003.00	0.86
25	601628	中国人寿	110,400	3,849,648.00	0.84
26	000672	上峰水泥	202,800	3,709,212.00	0.81
27	002555	三七互娱	132,820	3,576,842.60	0.78
28	600019	宝钢股份	615,500	3,532,970.00	0.77
29	000858	五粮液	26,300	3,498,163.00	0.77
30	600276	恒瑞医药	39,900	3,492,048.00	0.76
31	600809	山西汾酒	38,900	3,489,330.00	0.76
32	000708	中信特钢	151,800	3,480,774.00	0.76
33	300316	晶盛机电	220,900	3,472,548.00	0.76
34	600708	光明地产	981,220	3,453,894.40	0.76

35	002714	牧原股份	38,800	3,445,052.00	0.75
36	002415	海康威视	104,400	3,418,056.00	0.75
37	601601	中国太保	90,200	3,413,168.00	0.75
38	002475	立讯精密	92,400	3,372,600.00	0.74
39	601633	长城汽车	377,700	3,342,645.00	0.73
40	603986	兆易创新	16,300	3,339,707.00	0.73
41	002698	博实股份	317,445	3,339,521.40	0.73
42	300628	亿联网络	46,100	3,338,101.00	0.73
43	000338	潍柴动力	209,300	3,323,684.00	0.73
44	600570	恒生电子	42,210	3,280,983.30	0.72
45	002690	美亚光电	83,600	3,268,760.00	0.72
46	300033	同花顺	29,800	3,251,478.00	0.71
47	002841	视源股份	37,300	3,196,610.00	0.70
48	002938	鹏鼎控股	70,600	3,169,940.00	0.69
49	601088	中国神华	173,200	3,160,900.00	0.69
50	603000	人民网	159,700	3,160,463.00	0.69
51	601808	中海油服	163,400	3,137,280.00	0.69
52	600030	中信证券	123,400	3,122,020.00	0.68
53	002463	沪电股份	140,300	3,116,063.00	0.68
54	002916	深南电路	21,900	3,111,990.00	0.68
55	000651	格力电器	47,000	3,082,260.00	0.67
56	600348	阳泉煤业	553,600	3,061,408.00	0.67
57	000401	冀东水泥	173,200	2,946,132.00	0.65
58	000926	福星股份	452,500	2,941,250.00	0.64
59	600657	信达地产	736,700	2,939,433.00	0.64
60	601668	中国建筑	503,500	2,829,670.00	0.62
61	600585	海螺水泥	46,100	2,526,280.00	0.55
62	600519	贵州茅台	2,000	2,366,000.00	0.52
63	600028	中国石化	459,600	2,348,556.00	0.51
64	300433	蓝思科技	155,700	2,151,774.00	0.47
65	600837	海通证券	138,900	2,147,394.00	0.47
66	000415	渤海租赁	553,500	2,103,300.00	0.46
67	600755	厦门国贸	283,800	2,083,092.00	0.46
68	600188	兖州煤业	192,900	2,037,024.00	0.45
69	003816	中国广核	563,026	1,987,486.54	0.44
70	600308	华泰股份	391,240	1,795,791.60	0.39
71	002353	杰瑞股份	47,100	1,740,816.00	0.38
72	600985	淮北矿业	167,800	1,676,322.00	0.37
73	000789	万年青	133,300	1,627,593.00	0.36
74	601003	柳钢股份	277,200	1,566,180.00	0.34
75	002110	三钢闽光	165,400	1,548,144.00	0.34
76	601211	国泰君安	83,600	1,545,764.00	0.34
77	600515	海航基础	343,100	1,530,226.00	0.34



78	601336	新华保险	31,100	1,528,565.00	0.33
79	601688	华泰证券	74,900	1,521,219.00	0.33
80	000932	华菱钢铁	317,700	1,518,606.00	0.33
81	600502	安徽建工	372,719	1,513,239.14	0.33
82	600569	安阳钢铁	588,500	1,500,675.00	0.33
83	600997	开滦股份	275,800	1,500,352.00	0.33
84	600736	苏州高新	257,200	1,499,476.00	0.33
85	601717	郑煤机	230,500	1,491,335.00	0.33
86	000521	长虹美菱	432,800	1,484,504.00	0.33
87	600346	恒力石化	92,100	1,480,968.00	0.32
88	600926	杭州银行	160,400	1,469,264.00	0.32
89	600269	赣粤高速	353,400	1,459,542.00	0.32
90	600221	海航控股	840,400	1,453,892.00	0.32
91	000717	韶钢松山	305,600	1,448,544.00	0.32
92	000040	东旭蓝天	346,400	1,447,952.00	0.32
93	600322	天房发展	480,800	1,442,400.00	0.32
94	002936	郑州银行	308,700	1,435,455.00	0.31
95	600266	城建发展	176,700	1,431,270.00	0.31
96	000732	泰禾集团	229,900	1,413,885.00	0.31
97	600376	首开股份	174,200	1,388,374.00	0.30
98	000980	众泰汽车	471,100	1,380,323.00	0.30
99	601186	中国铁建	135,900	1,378,026.00	0.30
100	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.30
101	603606	东方电缆	122,500	1,345,050.00	0.29
102	601390	中国中铁	218,300	1,296,702.00	0.28
103	000961	中南建设	116,700	1,231,185.00	0.27
104	603360	百傲化学	35,200	1,230,944.00	0.27
105	601360	三六零	51,100	1,201,361.00	0.26
106	000661	长春高新	2,600	1,162,200.00	0.25
107	601901	方正证券	131,300	1,138,371.00	0.25
108	300251	光线传媒	95,500	1,126,900.00	0.25
109	600104	上汽集团	46,600	1,111,410.00	0.24
110	000166	申万宏源	213,000	1,090,560.00	0.24
111	002869	金溢科技	16,500	1,077,945.00	0.24
112	002299	圣农发展	43,800	1,054,704.00	0.23
113	600061	国投资本	67,500	1,021,950.00	0.22
114	600958	东方证券	94,900	1,021,124.00	0.22
115	600010	包钢股份	729,800	963,336.00	0.21
116	601377	兴业证券	134,700	953,676.00	0.21
117	601225	陕西煤业	106,000	952,940.00	0.21
118	002195	二三四五	293,100	946,713.00	0.21
119	601766	中国中车	130,000	928,200.00	0.20
120	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.20

121	002736	国信证券	73,600	923,680.00	0.20
122	601108	财通证券	81,400	923,076.00	0.20
123	000783	长江证券	128,000	913,920.00	0.20
124	601788	光大证券	67,900	889,490.00	0.19
125	600919	江苏银行	121,600	880,384.00	0.19
126	601899	紫金矿业	190,800	875,772.00	0.19
127	601066	中信建投	28,700	872,480.00	0.19
128	601555	东吴证券	87,000	869,130.00	0.19
129	600705	中航资本	179,000	868,150.00	0.19
130	601198	东兴证券	64,900	852,786.00	0.19
131	600109	国金证券	90,600	842,580.00	0.18
132	600309	万华化学	15,000	842,550.00	0.18
133	601878	浙商证券	72,200	803,586.00	0.18
134	603993	洛阳钼业	183,500	800,060.00	0.18
135	002673	西部证券	81,300	796,740.00	0.17
136	600369	西南证券	153,400	796,146.00	0.17
137	000750	国海证券	148,900	795,126.00	0.17
138	000728	国元证券	85,300	790,731.00	0.17
139	300118	东方日升	56,400	781,140.00	0.17
140	600739	辽宁成大	51,100	778,253.00	0.17
141	002926	华西证券	69,300	762,993.00	0.17
142	002797	第一创业	91,200	755,136.00	0.17
143	600547	山东黄金	23,100	753,522.00	0.16
144	600909	华安证券	103,200	753,360.00	0.16
145	000686	东北证券	80,200	745,860.00	0.16
146	601881	中国银河	64,000	743,040.00	0.16
147	000100	TCL 集团	166,100	742,467.00	0.16
148	000830	鲁西化工	69,500	730,445.00	0.16
149	600260	凯乐科技	53,500	725,995.00	0.16
150	000623	吉林敖东	43,800	724,014.00	0.16
151	002500	山西证券	87,100	722,059.00	0.16
152	000627	天茂集团	101,700	715,968.00	0.16
153	601162	天风证券	96,800	712,448.00	0.16
154	600053	九鼎投资	28,000	712,040.00	0.16
155	600816	安信信托	159,800	709,512.00	0.16
156	002092	中泰化学	104,300	708,197.00	0.16
157	002670	国盛金控	54,200	688,882.00	0.15
158	600064	南京高科	70,200	684,450.00	0.15
159	000563	陕国投 A	152,800	676,904.00	0.15
160	600643	爱建集团	69,900	671,040.00	0.15
161	600155	华创阳安	47,800	670,634.00	0.15
162	600720	祁连山	52,800	662,640.00	0.15
163	601319	中国人保	87,200	661,848.00	0.14

164	600050	中国联通	111,000	653,790.00	0.14
165	000712	锦龙股份	42,800	650,560.00	0.14
166	002939	长城证券	46,400	643,104.00	0.14
167	601800	中国交建	70,100	642,116.00	0.14
168	601006	大秦铁路	78,200	642,022.00	0.14
169	600390	五矿资本	76,700	633,542.00	0.14
170	600901	江苏租赁	98,900	625,048.00	0.14
171	002945	华林证券	41,500	620,010.00	0.14
172	601058	赛轮轮胎	138,400	618,648.00	0.14
173	600873	梅花生物	138,900	618,105.00	0.14
174	000898	鞍钢股份	182,000	609,700.00	0.13
175	000987	越秀金控	62,200	601,474.00	0.13
176	600291	西水股份	66,200	595,138.00	0.13
177	600362	江西铜业	34,200	579,006.00	0.13
178	600373	中文传媒	41,500	564,815.00	0.12
179	000027	深圳能源	90,100	559,521.00	0.12
180	002028	思源电气	39,800	548,046.00	0.12
181	603368	柳药股份	16,200	544,968.00	0.12
182	002244	滨江集团	109,500	538,740.00	0.12
183	002589	瑞康医药	69,300	532,917.00	0.12
184	000786	北新建材	20,400	519,180.00	0.11
185	600578	京能电力	165,800	517,296.00	0.11
186	300502	新易盛	12,600	505,764.00	0.11
187	600352	浙江龙盛	34,600	500,662.00	0.11
188	601898	中煤能源	97,600	489,952.00	0.11
189	002531	天顺风能	75,600	477,792.00	0.10
190	600984	建设机械	45,300	467,949.00	0.10
191	002851	麦格米特	22,400	464,128.00	0.10
192	600176	中国巨石	41,600	453,440.00	0.10
193	002466	天齐锂业	15,000	452,700.00	0.10
194	002291	星期六	22,500	442,575.00	0.10
195	603799	华友钴业	11,100	437,229.00	0.10
196	002234	民和股份	13,600	432,616.00	0.09
197	002601	龙麟佰利	27,100	417,069.00	0.09
198	600111	北方稀土	38,300	415,172.00	0.09
199	601600	中国铝业	113,300	401,082.00	0.09
200	600801	华新水泥	14,900	393,807.00	0.09
201	600516	方大炭素	32,300	392,768.00	0.09
202	601138	工业富联	21,200	387,324.00	0.08
203	000810	创维数字	32,300	387,277.00	0.08
204	002850	科达利	7,700	350,350.00	0.08
205	601163	三角轮胎	22,700	347,310.00	0.08
206	600426	华鲁恒升	16,700	331,829.00	0.07

207	000425	徐工机械	59,300	324,371.00	0.07
208	601117	中国化学	50,100	322,644.00	0.07
209	600271	航天信息	13,900	322,063.00	0.07
210	600170	上海建工	89,500	316,830.00	0.07
211	601618	中国中冶	112,900	316,120.00	0.07
212	002271	东方雨虹	11,900	313,089.00	0.07
213	300737	科顺股份	27,500	311,300.00	0.07
214	600496	精工钢构	106,300	307,207.00	0.07
215	601669	中国电建	70,100	304,234.00	0.07
216	600487	亨通光电	18,600	302,436.00	0.07
217	600606	绿地控股	40,700	282,865.00	0.06
218	600089	特变电工	42,400	281,960.00	0.06
219	002746	仙坛股份	17,600	274,032.00	0.06
220	603690	至纯科技	8,400	273,756.00	0.06
221	300487	蓝晓科技	7,400	270,100.00	0.06
222	300043	星辉娱乐	52,300	268,299.00	0.06
223	600522	中天科技	32,100	266,430.00	0.06
224	300114	中航电测	23,000	261,740.00	0.06
225	600449	宁夏建材	23,200	258,912.00	0.06
226	600794	保税科技	67,300	257,086.00	0.06
227	601607	上海医药	13,900	255,343.00	0.06
228	600219	南山铝业	113,900	255,136.00	0.06
229	300699	光威复材	5,600	254,800.00	0.06
230	600068	葛洲坝	37,500	250,500.00	0.05
231	300559	佳发教育	7,700	225,610.00	0.05
232	300129	泰胜风能	45,100	219,186.00	0.05
233	002621	美吉姆	19,700	215,715.00	0.05
234	603218	日月股份	9,900	205,623.00	0.05
235	603699	纽威股份	14,000	193,480.00	0.04
236	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.04
237	000413	东旭光电	53,800	180,768.00	0.04
238	603859	能科股份	6,500	179,400.00	0.04
239	688037	芯源微	3,028	178,591.44	0.04
240	000885	城发环境	15,300	168,147.00	0.04
241	300569	天能重工	10,600	158,152.00	0.03
242	600704	物产中大	29,800	156,450.00	0.03
243	002084	海鸥住工	23,700	153,813.00	0.03
244	002606	大连电瓷	25,100	144,576.00	0.03
245	603208	江山欧派	2,700	137,592.00	0.03
246	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.03
247	002732	燕塘乳业	5,700	125,286.00	0.03
248	603365	水星家纺	8,000	122,560.00	0.03
249	688198	佰仁医疗	3,213	120,744.54	0.03

250	688078	龙软科技	2,811	117,921.45	0.03
251	002895	川恒股份	8,200	101,516.00	0.02
252	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
253	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
254	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
255	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	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	601318	中国平安	65,491,386.15	72.53
2	601166	兴业银行	34,108,121.74	37.77
3	600519	贵州茅台	32,766,656.83	36.29
4	601997	贵阳银行	22,810,971.93	25.26
5	601398	工商银行	22,422,412.00	24.83
6	600000	浦发银行	22,376,098.04	24.78
7	601328	交通银行	22,107,384.82	24.48
8	300498	温氏股份	21,479,454.59	23.79
9	600340	华夏幸福	20,966,006.74	23.22
10	000858	五粮液	18,927,842.97	20.96
11	002475	立讯精密	18,561,568.10	20.56
12	600015	华夏银行	18,125,932.03	20.07
13	600031	三一重工	17,243,267.13	19.10
14	600383	金地集团	17,085,537.09	18.92
15	000001	平安银行	16,786,671.47	18.59
16	601988	中国银行	16,507,804.00	18.28
17	601601	中国太保	16,259,749.73	18.01
18	600276	恒瑞医药	16,035,088.70	17.76
19	000651	格力电器	15,824,935.85	17.53
20	600782	新钢股份	15,394,481.63	17.05
21	300059	东方财富	14,983,330.69	16.59
22	600153	建发股份	14,800,091.09	16.39
23	000333	美的集团	14,623,368.14	16.19
24	601012	隆基股份	13,731,324.83	15.21
25	600282	南钢股份	13,579,345.00	15.04
26	600622	光大嘉宝	13,539,335.82	14.99
27	002415	海康威视	13,339,004.57	14.77
28	600565	迪马股份	13,224,730.24	14.65
29	002555	三七互娱	13,195,323.40	14.61
30	601668	中国建筑	12,841,214.00	14.22
31	600466	蓝光发展	12,750,250.08	14.12

32	300559	佳发教育	12,517,732.80	13.86
33	600030	中信证券	12,227,124.71	13.54
34	600325	华发股份	12,069,614.23	13.37
35	000876	新希望	12,031,302.83	13.32
36	601628	中国人寿	11,807,704.20	13.08
37	600746	江苏索普	11,703,244.23	12.96
38	601003	柳钢股份	11,507,328.00	12.74
39	601336	新华保险	11,461,506.65	12.69
40	603505	金石资源	11,301,864.00	12.52
41	000338	潍柴动力	11,244,767.92	12.45
42	600570	恒生电子	11,182,919.94	12.38
43	300122	智飞生物	10,681,195.79	11.83
44	603160	汇顶科技	10,646,465.01	11.79
45	600585	海螺水泥	10,520,168.30	11.65
46	000661	长春高新	10,418,228.98	11.54
47	000157	中联重科	10,416,705.96	11.54
48	000401	冀东水泥	9,615,378.69	10.65
49	600919	江苏银行	9,606,692.77	10.64
50	601888	中国国旅	9,545,656.41	10.57
51	300750	宁德时代	9,482,109.95	10.50
52	600755	厦门国贸	9,293,280.82	10.29
53	600019	宝钢股份	9,286,013.16	10.28
54	002916	深南电路	9,239,623.12	10.23
55	601818	光大银行	9,042,551.00	10.01
56	600837	海通证券	8,929,667.76	9.89
57	600823	世茂股份	8,828,384.25	9.78
58	600657	信达地产	8,803,205.82	9.75
59	601857	中国石油	8,747,947.00	9.69
60	600048	保利地产	8,706,808.91	9.64
61	600352	浙江龙盛	8,656,609.00	9.59
62	002458	益生股份	8,652,218.00	9.58
63	600028	中国石化	8,517,760.00	9.43
64	600438	通威股份	8,500,754.21	9.41
65	600011	华能国际	8,481,124.49	9.39
66	601088	中国神华	8,323,623.73	9.22
67	600708	光明地产	8,312,335.09	9.21
68	300715	凯伦股份	8,010,898.04	8.87
69	600547	山东黄金	7,922,700.56	8.77
70	300015	爱尔眼科	7,864,264.65	8.71
71	002234	民和股份	7,685,677.53	8.51
72	601838	成都银行	7,659,604.22	8.48
73	600801	华新水泥	7,648,174.00	8.47
74	002605	姚记科技	7,643,350.00	8.46



75	601377	兴业证券	7,595,501.69	8.41
76	600926	杭州银行	7,531,122.00	8.34
77	000568	泸州老窖	7,502,803.71	8.31
78	603288	海天味业	7,477,628.00	8.28
79	000926	福星股份	7,278,195.00	8.06
80	601229	上海银行	7,251,378.10	8.03
81	600809	山西汾酒	7,177,015.05	7.95
82	000166	申万宏源	7,089,358.50	7.85
83	300552	万集科技	7,050,191.40	7.81
84	002841	视源股份	7,028,958.60	7.78
85	002382	蓝帆医疗	7,024,380.26	7.78
86	600533	栖霞建设	6,995,671.00	7.75
87	600188	兖州煤业	6,920,790.40	7.66
88	300638	广和通	6,867,114.00	7.60
89	601058	赛轮轮胎	6,838,844.00	7.57
90	300033	同花顺	6,820,124.35	7.55
91	000063	中兴通讯	6,805,666.01	7.54
92	300602	飞荣达	6,706,035.00	7.43
93	600887	伊利股份	6,705,081.01	7.43
94	300628	亿联网络	6,693,259.32	7.41
95	002738	中矿资源	6,647,287.50	7.36
96	002851	麦格米特	6,633,518.46	7.35
97	601577	长沙银行	6,438,623.00	7.13
98	000672	上峰水泥	6,423,167.00	7.11
99	600348	阳泉煤业	6,394,112.99	7.08
100	000002	万科 A	6,374,069.91	7.06
101	002463	沪电股份	6,363,862.00	7.05
102	300709	精研科技	6,313,479.00	6.99
103	002698	博实股份	6,308,936.80	6.99
104	601658	邮储银行	6,258,824.00	6.93
105	600009	上海机场	6,228,284.06	6.90
106	300595	欧普康视	6,157,359.60	6.82
107	300014	亿纬锂能	6,147,322.00	6.81
108	300569	天能重工	6,068,178.00	6.72
109	300233	金城医药	6,032,666.02	6.68
110	300114	中航电测	6,023,599.66	6.67
111	600376	首开股份	5,980,772.04	6.62
112	600104	上汽集团	5,967,087.10	6.61
113	300417	南华仪器	5,903,781.00	6.54
114	300737	科顺股份	5,888,954.43	6.52
115	600050	中国联通	5,861,295.00	6.49
116	300433	蓝思科技	5,854,049.64	6.48
117	300443	金雷股份	5,850,010.00	6.48

118	601555	东吴证券	5,839,184.30	6.47
119	000789	万年青	5,806,176.33	6.43
120	600308	华泰股份	5,805,955.60	6.43
121	300632	光莆股份	5,769,058.22	6.39
122	600985	淮北矿业	5,700,606.00	6.31
123	300223	北京君正	5,671,241.94	6.28
124	300661	圣邦股份	5,662,744.00	6.27
125	000656	金科股份	5,633,492.06	6.24
126	601717	郑煤机	5,608,489.20	6.21
127	601808	中海油服	5,579,312.00	6.18
128	002299	圣农发展	5,579,265.52	6.18
129	300035	中科电气	5,570,757.00	6.17
130	000725	京东方 A	5,562,162.00	6.16
131	600751	海航科技	5,525,506.00	6.12
132	000069	华侨城 A	5,509,748.00	6.10
133	600720	祁连山	5,499,173.82	6.09
134	600606	绿地控股	5,467,847.01	6.06
135	600997	开滦股份	5,466,273.00	6.05
136	000961	中南建设	5,461,210.00	6.05
137	600515	海航基础	5,436,628.00	6.02
138	600266	城建发展	5,436,574.40	6.02
139	300572	安车检测	5,435,763.24	6.02
140	600150	中国船舶	5,411,489.00	5.99
141	300236	上海新阳	5,393,841.00	5.97
142	300529	健帆生物	5,384,354.00	5.96
143	300613	富瀚微	5,322,400.97	5.89
144	600269	赣粤高速	5,298,377.00	5.87
145	601688	华泰证券	5,254,424.70	5.82
146	300385	雪浪环境	5,241,483.00	5.80
147	300225	金力泰	5,211,370.00	5.77
148	600690	海尔智家	5,177,180.67	5.73
149	300117	嘉寓股份	5,155,643.00	5.71
150	601186	中国铁建	4,972,350.00	5.51
151	600743	华远地产	4,944,266.57	5.48
152	002353	杰瑞股份	4,761,377.00	5.27
153	600170	上海建工	4,724,404.40	5.23
154	002736	国信证券	4,717,648.00	5.22
155	600309	万华化学	4,709,762.54	5.22
156	002110	三钢闽光	4,702,152.00	5.21
157	300316	晶盛机电	4,654,475.44	5.15
158	601360	三六零	4,651,330.65	5.15
159	000932	华菱钢铁	4,598,189.00	5.09
160	000980	众泰汽车	4,596,951.00	5.09

161	000027	深圳能源	4,554,758.00	5.04
162	600053	九鼎投资	4,548,455.97	5.04
163	600346	恒力石化	4,546,886.00	5.04
164	300003	乐普医疗	4,538,551.81	5.03
165	000963	华东医药	4,535,431.72	5.02
166	600221	海航控股	4,508,781.00	4.99
167	603986	兆易创新	4,488,482.74	4.97
168	601390	中国中铁	4,475,076.00	4.96
169	601788	光大证券	4,459,471.06	4.94
170	601939	建设银行	4,444,404.00	4.92
171	600406	国电南瑞	4,425,814.93	4.90
172	600763	通策医疗	4,375,400.00	4.85
173	601009	南京银行	4,354,171.00	4.82
174	601211	国泰君安	4,350,135.00	4.82
175	601600	中国铝业	4,313,611.00	4.78
176	601669	中国电建	4,299,890.00	4.76
177	000521	长虹美菱	4,287,757.00	4.75
178	600844	丹化科技	4,259,296.00	4.72
179	603236	移远通信	4,224,849.24	4.68
180	300347	泰格医药	4,214,782.68	4.67
181	002304	洋河股份	4,187,926.61	4.64
182	000708	中信特钢	4,151,563.42	4.60
183	002607	中公教育	4,122,408.64	4.57
184	600332	白云山	4,108,395.00	4.55
185	002714	牧原股份	4,035,605.05	4.47
186	600875	东方电气	4,025,512.00	4.46
187	300487	蓝晓科技	3,985,270.84	4.41
188	000732	泰禾集团	3,966,088.00	4.39
189	300408	三环集团	3,958,533.20	4.38
190	000425	徐工机械	3,947,889.00	4.37
191	601998	中信银行	3,914,083.00	4.33
192	601006	大秦铁路	3,784,529.00	4.19
193	002008	大族激光	3,748,539.34	4.15
194	603000	人民网	3,682,211.00	4.08
195	300251	光线传媒	3,679,256.80	4.07
196	002179	中航光电	3,677,508.85	4.07
197	600569	安阳钢铁	3,674,911.00	4.07
198	601898	中煤能源	3,629,787.00	4.02
199	600971	恒源煤电	3,613,357.00	4.00
200	600958	东方证券	3,577,268.79	3.96
201	300144	宋城演艺	3,576,581.50	3.96
202	601899	紫金矿业	3,571,305.00	3.95
203	002938	鹏鼎控股	3,546,831.00	3.93

204	601666	平煤股份	3,534,375.00	3.91
205	603508	思维列控	3,523,802.00	3.90
206	002244	滨江集团	3,511,847.00	3.89
207	000895	双汇发展	3,500,240.64	3.88
208	603606	东方电缆	3,466,698.57	3.84
209	601766	中国中车	3,466,229.80	3.84
210	603444	吉比特	3,425,783.00	3.79
211	601633	长城汽车	3,380,594.00	3.74
212	601811	新华文轩	3,333,950.57	3.69
213	002690	美亚光电	3,281,824.78	3.63
214	300017	网宿科技	3,244,979.00	3.59
215	000671	阳光城	3,226,246.50	3.57
216	603368	柳药股份	3,214,183.48	3.56
217	300142	沃森生物	3,211,210.61	3.56
218	002318	久立特材	3,208,636.11	3.55
219	002846	英联股份	3,207,100.00	3.55
220	600699	均胜电子	3,171,106.91	3.51
221	000415	渤海租赁	3,148,515.00	3.49
222	000860	顺鑫农业	3,146,108.21	3.48
223	601881	中国银河	3,135,089.00	3.47
224	300450	先导智能	3,111,279.90	3.45
225	002803	吉宏股份	3,106,264.00	3.44
226	600026	中远海能	3,100,172.00	3.43
227	300136	信维通信	3,096,729.99	3.43
228	601138	工业富联	3,090,873.00	3.42
229	603993	洛阳钼业	3,079,144.00	3.41
230	600398	海澜之家	3,071,285.88	3.40
231	000807	云铝股份	3,046,311.08	3.37
232	600583	海油工程	3,044,055.00	3.37
233	600808	马钢股份	3,038,705.00	3.37
234	600655	豫园股份	3,017,236.63	3.34
235	601111	中国国航	2,996,431.00	3.32
236	600703	三安光电	2,990,681.00	3.31
237	601928	凤凰传媒	2,964,141.20	3.28
238	000717	韶钢松山	2,952,939.00	3.27
239	002065	东华软件	2,952,351.30	3.27
240	002027	分众传媒	2,892,257.00	3.20
241	300502	新易盛	2,891,326.86	3.20
242	600115	东方航空	2,890,260.00	3.20
243	600025	华能水电	2,870,056.00	3.18
244	300012	华测检测	2,859,405.00	3.17
245	000999	华润三九	2,852,218.64	3.16
246	600900	长江电力	2,834,082.00	3.14

247	600673	东阳光	2,801,361.00	3.10
248	601800	中国交建	2,782,232.00	3.08
249	603360	百傲化学	2,756,882.00	3.05
250	000783	长江证券	2,745,548.00	3.04
251	300118	东方日升	2,741,012.00	3.04
252	601118	海南橡胶	2,738,653.00	3.03
253	300383	光环新网	2,728,110.00	3.02
254	300253	卫宁健康	2,698,831.02	2.99
255	000543	皖能电力	2,698,320.00	2.99
256	300130	新国都	2,672,775.20	2.96
257	600588	用友网络	2,661,463.10	2.95
258	300682	朗新科技	2,653,559.00	2.94
259	600029	南方航空	2,651,653.00	2.94
260	002541	鸿路钢构	2,643,123.74	2.93
261	002936	郑州银行	2,619,829.00	2.90
262	002182	云海金属	2,611,039.00	2.89
263	600061	国投资本	2,607,936.14	2.89
264	601225	陕西煤业	2,601,616.00	2.88
265	002146	荣盛发展	2,582,428.92	2.86
266	300702	天宇股份	2,576,430.68	2.85
267	300124	汇川技术	2,564,455.00	2.84
268	600510	黑牡丹	2,561,601.07	2.84
269	002399	海普瑞	2,557,189.40	2.83
270	002049	紫光国微	2,529,491.00	2.80
271	000878	云南铜业	2,488,180.00	2.76
272	600522	中天科技	2,487,689.00	2.75
273	600166	福田汽车	2,455,694.00	2.72
274	002236	大华股份	2,454,656.68	2.72
275	000977	浪潮信息	2,453,034.74	2.72
276	002195	二三四五	2,443,232.00	2.71
277	600502	安徽建工	2,405,191.86	2.66
278	600109	国金证券	2,404,140.00	2.66
279	601615	明阳智能	2,403,868.00	2.66
280	600362	江西铜业	2,401,507.81	2.66
281	600426	华鲁恒升	2,397,134.84	2.65
282	600862	中航高科	2,390,545.00	2.65
283	600845	宝信软件	2,390,035.91	2.65
284	600010	宝钢股份	2,362,605.00	2.62
285	601933	永辉超市	2,322,691.78	2.57
286	600587	新华医疗	2,316,056.76	2.56
287	601718	际华集团	2,313,042.00	2.56
288	300182	捷成股份	2,293,178.00	2.54
289	601611	中国核建	2,291,635.00	2.54

290	002128	露天煤业	2,289,981.00	2.54
291	603658	安图生物	2,278,883.00	2.52
292	600063	皖维高新	2,257,045.00	2.50
293	600369	西南证券	2,256,044.00	2.50
294	002429	兆驰股份	2,249,668.00	2.49
295	000040	东旭蓝天	2,246,722.00	2.49
296	600512	腾达建设	2,242,029.50	2.48
297	603309	维力医疗	2,233,169.00	2.47
298	600322	天房发展	2,222,222.00	2.46
299	002189	中光学	2,211,580.00	2.45
300	600863	内蒙华电	2,187,077.00	2.42
301	600271	航天信息	2,178,557.18	2.41
302	300115	长盈精密	2,167,953.00	2.40
303	000031	大悦城	2,167,016.00	2.40
304	600909	华安证券	2,158,895.00	2.39
305	600580	卧龙电驱	2,147,511.00	2.38
306	600736	苏州高新	2,134,341.20	2.36
307	000655	金岭矿业	2,129,611.00	2.36
308	600643	爱建集团	2,116,642.70	2.34
309	300058	蓝色光标	2,111,817.00	2.34
310	600064	南京高科	2,110,981.52	2.34
311	603369	今世缘	2,109,282.03	2.34
312	600022	山东钢铁	2,105,246.00	2.33
313	300146	汤臣倍健	2,080,423.00	2.30
314	601916	浙商银行	2,076,173.32	2.30
315	600705	中航资本	2,052,987.00	2.27
316	000100	TCL 集团	2,039,401.00	2.26
317	601155	新城控股	2,024,162.10	2.24
318	600846	同济科技	2,012,825.00	2.23
319	003816	中国广核	2,002,522.74	2.22
320	002230	科大讯飞	1,990,783.00	2.20
321	601108	财通证券	1,970,674.00	2.18
322	603711	香飘飘	1,965,663.00	2.18
323	600312	平高电气	1,961,222.83	2.17
324	002734	利民股份	1,959,113.00	2.17
325	601878	浙商证券	1,956,444.00	2.17
326	601319	中国人保	1,952,317.00	2.16
327	601369	陕鼓动力	1,935,846.00	2.14
328	002563	森马服饰	1,922,049.00	2.13
329	600739	辽宁成大	1,921,852.00	2.13
330	002746	仙坛股份	1,915,635.72	2.12
331	002028	思源电气	1,905,371.00	2.11
332	601958	金钼股份	1,894,742.91	2.10

333	000898	鞍钢股份	1,849,702.00	2.05
334	601198	东兴证券	1,843,060.27	2.04
335	002797	第一创业	1,825,753.28	2.02
336	601117	中国化学	1,816,476.00	2.01
337	000627	天茂集团	1,809,998.00	2.00
338	300322	硕贝德	1,809,022.00	2.00
339	300024	机器人	1,808,296.00	2.00
340	002064	华峰氨纶	1,806,496.00	2.00

注：本项的“买入金额”均按成交金额（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	601318	中国平安	53,386,714.17	59.12
2	601166	兴业银行	34,847,847.67	38.59
3	600519	贵州茅台	34,129,577.49	37.80
4	601398	工商银行	22,720,500.00	25.16
5	600031	三一重工	18,271,382.23	20.23
6	002475	立讯精密	18,138,549.10	20.09
7	000001	平安银行	17,428,302.45	19.30
8	600383	金地集团	17,041,494.43	18.87
9	000858	五粮液	16,667,261.25	18.46
10	600000	浦发银行	16,483,782.08	18.25
11	601328	交通银行	15,632,611.00	17.31
12	000333	美的集团	15,212,536.31	16.85
13	300498	温氏股份	14,885,879.34	16.49
14	000651	格力电器	14,575,540.80	16.14
15	600340	华夏幸福	14,349,811.64	15.89
16	601012	隆基股份	14,275,260.62	15.81
17	600276	恒瑞医药	13,838,532.84	15.33
18	601601	中国太保	13,189,682.52	14.61
19	300559	佳发教育	12,876,485.61	14.26
20	300059	东方财富	11,906,117.90	13.19
21	601988	中国银行	11,779,540.00	13.05
22	601003	柳钢股份	11,642,423.21	12.89
23	002555	三七互娱	11,447,507.00	12.68
24	601997	贵阳银行	11,430,783.81	12.66
25	600015	华夏银行	10,755,350.72	11.91
26	300122	智飞生物	10,534,194.87	11.67
27	002415	海康威视	10,509,796.79	11.64
28	601668	中国建筑	10,436,586.20	11.56
29	600782	新钢股份	10,170,902.87	11.26
30	600153	建发股份	10,132,420.98	11.22



31	601336	新华保险	9,998,828.86	11.07
32	603505	金石资源	9,910,818.00	10.98
33	600030	中信证券	9,810,879.11	10.86
34	002458	益生股份	9,801,842.68	10.85
35	000661	长春高新	9,710,771.67	10.75
36	601888	中国国旅	9,683,041.30	10.72
37	002605	姚记科技	9,498,087.00	10.52
38	300750	宁德时代	9,433,980.93	10.45
39	601818	光大银行	9,286,191.00	10.28
40	600585	海螺水泥	9,128,950.50	10.11
41	600823	世茂股份	9,101,037.63	10.08
42	600919	江苏银行	8,907,176.00	9.86
43	600801	华新水泥	8,893,198.40	9.85
44	600048	保利地产	8,753,454.54	9.69
45	600282	南钢股份	8,593,707.00	9.52
46	600570	恒生电子	8,504,265.40	9.42
47	600438	通威股份	8,503,786.12	9.42
48	600755	厦门国贸	8,497,685.31	9.41
49	000338	潍柴动力	8,443,195.40	9.35
50	300015	爱尔眼科	8,391,664.53	9.29
51	600011	华能国际	8,373,132.31	9.27
52	000568	泸州老窖	8,212,131.79	9.09
53	300715	凯伦股份	8,212,060.00	9.09
54	601628	中国人寿	8,211,008.09	9.09
55	600352	浙江龙盛	7,852,908.00	8.70
56	603288	海天味业	7,837,432.19	8.68
57	600547	山东黄金	7,823,458.66	8.66
58	601229	上海银行	7,143,280.40	7.91
59	002234	民和股份	7,124,208.83	7.89
60	600837	海通证券	7,043,102.00	7.80
61	600466	蓝光发展	6,941,952.23	7.69
62	000063	中兴通讯	6,894,827.22	7.64
63	000876	新希望	6,863,117.52	7.60
64	000157	中联重科	6,854,009.00	7.59
65	000401	冀东水泥	6,811,255.94	7.54
66	000002	万科 A	6,790,166.52	7.52
67	600887	伊利股份	6,744,455.03	7.47
68	601377	兴业证券	6,736,529.88	7.46
69	600533	栖霞建设	6,717,722.00	7.44
70	600565	迪马股份	6,610,752.12	7.32
71	600009	上海机场	6,610,320.20	7.32
72	300602	飞荣达	6,604,867.00	7.31
73	002382	蓝帆医疗	6,572,563.00	7.28

74	600019	宝钢股份	6,492,602.84	7.19
75	300014	亿纬锂能	6,432,897.00	7.12
76	600028	中国石化	6,349,862.40	7.03
77	601058	赛轮轮胎	6,335,319.00	7.02
78	300552	万集科技	6,333,454.00	7.01
79	600926	杭州银行	6,320,090.36	7.00
80	600622	光大嘉宝	6,307,851.00	6.99
81	000166	申万宏源	6,277,965.31	6.95
82	300595	欧普康视	6,260,728.20	6.93
83	600708	光明地产	6,222,460.89	6.89
84	300632	光莆股份	6,196,730.70	6.86
85	600657	信达地产	6,193,519.80	6.86
86	000789	万年青	6,072,218.51	6.72
87	300529	健帆生物	6,044,030.78	6.69
88	603160	汇顶科技	5,992,044.38	6.64
89	300638	广和通	5,970,159.16	6.61
90	300709	精研科技	5,968,993.00	6.61
91	300417	南华仪器	5,942,763.66	6.58
92	600325	华发股份	5,893,707.40	6.53
93	600606	绿地控股	5,872,857.00	6.50
94	002738	中矿资源	5,860,403.92	6.49
95	002851	麦格米特	5,787,041.50	6.41
96	000725	京东方 A	5,765,187.00	6.38
97	300233	金城医药	5,723,496.00	6.34
98	002916	深南电路	5,721,735.60	6.34
99	000656	金科股份	5,669,727.49	6.28
100	600751	海航科技	5,648,966.00	6.26
101	000069	华侨城 A	5,583,899.00	6.18
102	600188	兖州煤业	5,481,391.56	6.07
103	600050	中国联通	5,409,206.00	5.99
104	300035	中科电气	5,401,840.00	5.98
105	300737	科顺股份	5,386,185.00	5.96
106	300114	中航电测	5,368,342.50	5.95
107	600150	中国船舶	5,353,383.94	5.93
108	600690	海尔智家	5,347,517.56	5.92
109	601088	中国神华	5,339,057.05	5.91
110	600376	首开股份	5,285,559.76	5.85
111	600104	上汽集团	5,249,618.00	5.81
112	300613	富瀚微	5,217,757.00	5.78
113	300572	安车检测	5,199,783.58	5.76
114	300661	圣邦股份	5,199,571.97	5.76
115	601717	郑煤机	5,179,434.80	5.74
116	300569	天能重工	5,151,190.20	5.70

117	600720	祁连山	5,150,158.00	5.70
118	300236	上海新阳	5,075,988.00	5.62
119	300385	雪浪环境	5,062,787.40	5.61
120	601857	中国石油	4,976,681.00	5.51
121	601555	东吴证券	4,974,260.48	5.51
122	600743	华远地产	4,939,933.10	5.47
123	300225	金力泰	4,921,371.00	5.45
124	300117	嘉寓股份	4,920,220.44	5.45
125	300003	乐普医疗	4,902,772.28	5.43
126	300223	北京君正	4,859,989.81	5.38
127	002607	中公教育	4,788,220.10	5.30
128	600308	华泰股份	4,737,535.00	5.25
129	300443	金雷股份	4,690,228.00	5.19
130	000961	中南建设	4,649,830.00	5.15
131	600808	马钢股份	4,637,152.00	5.14
132	600746	江苏索普	4,611,848.00	5.11
133	600763	通策医疗	4,601,977.00	5.10
134	600844	丹化科技	4,564,546.10	5.05
135	000926	福星股份	4,549,020.09	5.04
136	600997	开滦股份	4,494,523.00	4.98
137	000963	华东医药	4,485,309.51	4.97
138	600406	国电南瑞	4,461,585.39	4.94
139	002008	大族激光	4,450,624.75	4.93
140	300347	泰格医药	4,443,351.21	4.92
141	002110	三钢闽光	4,393,932.00	4.87
142	600809	山西汾酒	4,372,097.00	4.84
143	600170	上海建工	4,359,672.30	4.83
144	002304	洋河股份	4,344,794.00	4.81
145	002841	视源股份	4,343,414.60	4.81
146	601939	建设银行	4,339,726.00	4.81
147	600515	海航基础	4,326,676.00	4.79
148	600309	万华化学	4,272,741.73	4.73
149	601009	南京银行	4,248,662.00	4.71
150	600332	白云山	4,153,888.00	4.60
151	000027	深圳能源	4,113,849.99	4.56
152	600266	城建发展	4,057,667.00	4.49
153	300433	蓝思科技	4,042,372.65	4.48
154	002179	中航光电	4,025,347.60	4.46
155	002299	圣农发展	4,023,436.00	4.46
156	600269	赣粤高速	4,019,883.00	4.45
157	601669	中国电建	3,973,239.00	4.40
158	002736	国信证券	3,972,775.28	4.40
159	600053	九鼎投资	3,932,495.48	4.35

160	600875	东方电气	3,924,840.00	4.35
161	600985	淮北矿业	3,922,667.08	4.34
162	300408	三环集团	3,920,134.35	4.34
163	601688	华泰证券	3,894,801.48	4.31
164	601600	中国铝业	3,872,902.60	4.29
165	603236	移远通信	3,838,042.00	4.25
166	000425	徐工机械	3,819,658.00	4.23
167	601998	中信银行	3,807,654.00	4.22
168	601811	新华文轩	3,791,294.42	4.20
169	601788	光大证券	3,777,114.26	4.18
170	000932	华菱钢铁	3,772,778.00	4.18
171	601360	三六零	3,764,721.97	4.17
172	600569	安阳钢铁	3,737,773.39	4.14
173	300033	同花顺	3,732,601.90	4.13
174	300628	亿联网络	3,725,157.32	4.13
175	000672	上峰水泥	3,694,181.00	4.09
176	603444	吉比特	3,658,692.00	4.05
177	600346	恒力石化	3,630,627.00	4.02
178	000671	阳光城	3,629,646.00	4.02
179	300144	宋城演艺	3,629,448.00	4.02
180	600971	恒源煤电	3,593,083.80	3.98
181	000895	双汇发展	3,565,188.68	3.95
182	300487	蓝晓科技	3,557,909.00	3.94
183	002803	吉宏股份	3,520,428.40	3.90
184	601186	中国铁建	3,478,945.00	3.85
185	300017	网宿科技	3,455,901.00	3.83
186	002318	久立特材	3,451,180.00	3.82
187	603508	思维列控	3,433,298.38	3.80
188	002353	杰瑞股份	3,425,774.33	3.79
189	000860	顺鑫农业	3,416,624.90	3.78
190	600348	阳泉煤业	3,413,361.96	3.78
191	601666	平煤股份	3,395,821.98	3.76
192	601898	中煤能源	3,376,263.49	3.74
193	300136	信维通信	3,332,861.00	3.69
194	601006	大秦铁路	3,324,985.74	3.68
195	002463	沪电股份	3,315,030.54	3.67
196	002698	博实股份	3,293,894.90	3.65
197	600703	三安光电	3,284,758.00	3.64
198	002846	英联股份	3,280,240.30	3.63
199	000980	众泰汽车	3,253,985.90	3.60
200	601808	中海油服	3,228,034.00	3.57
201	600655	豫园股份	3,218,057.47	3.56
202	600699	均胜电子	3,201,902.20	3.55

203	300142	沃森生物	3,147,710.00	3.49
204	600900	长江电力	3,136,500.00	3.47
205	600026	中远海能	3,089,617.00	3.42
206	000807	云铝股份	3,078,677.00	3.41
207	601838	成都银行	3,056,886.31	3.39
208	600583	海油工程	3,056,337.00	3.38
209	601390	中国中铁	3,053,442.57	3.38
210	300450	先导智能	3,049,877.21	3.38
211	000521	长虹美菱	3,045,765.14	3.37
212	000999	华润三九	3,003,845.00	3.33
213	601211	国泰君安	3,003,411.34	3.33
214	002244	滨江集团	2,999,329.00	3.32
215	600398	海澜之家	2,983,339.38	3.30
216	601928	凤凰传媒	2,980,419.00	3.30
217	002065	东华软件	2,977,342.00	3.30
218	300012	华测检测	2,939,429.00	3.26
219	600221	海航控股	2,908,204.00	3.22
220	601899	紫金矿业	2,905,072.00	3.22
221	300682	朗新科技	2,878,339.00	3.19
222	601111	中国国航	2,874,156.00	3.18
223	300130	新国都	2,851,425.38	3.16
224	002027	分众传媒	2,820,970.00	3.12
225	600426	华鲁恒升	2,799,859.64	3.10
226	300383	光环新网	2,783,521.00	3.08
227	002541	鸿路钢构	2,779,657.00	3.08
228	600025	华能水电	2,758,153.00	3.05
229	300253	卫宁健康	2,754,705.00	3.05
230	300702	天宇股份	2,747,457.70	3.04
231	601615	明阳智能	2,726,639.00	3.02
232	600958	东方证券	2,726,500.00	3.02
233	603368	柳药股份	2,712,788.00	3.00
234	601881	中国银河	2,703,115.72	2.99
235	600673	东阳光	2,689,301.80	2.98
236	000543	皖能电力	2,674,568.00	2.96
237	601138	工业富联	2,661,301.30	2.95
238	600588	用友网络	2,634,750.60	2.92
239	300251	光线传媒	2,631,472.00	2.91
240	300502	新易盛	2,621,679.00	2.90
241	002189	中光学	2,616,289.67	2.90
242	601766	中国中车	2,611,379.00	2.89
243	002399	海普瑞	2,609,576.71	2.89
244	300182	捷成股份	2,607,751.00	2.89
245	300124	汇川技术	2,596,444.60	2.88

246	600115	东方航空	2,591,510.28	2.87
247	002182	云海金属	2,566,246.90	2.84
248	601118	海南橡胶	2,565,666.00	2.84
249	300115	长盈精密	2,556,779.00	2.83
250	600510	黑牡丹	2,534,182.00	2.81
251	600029	南方航空	2,522,387.00	2.79
252	000878	云南铜业	2,520,735.00	2.79
253	002146	荣盛发展	2,505,723.00	2.77
254	603606	东方电缆	2,479,805.99	2.75
255	002049	紫光国微	2,440,477.00	2.70
256	600845	宝信软件	2,438,039.80	2.70
257	002236	大华股份	2,433,905.94	2.70
258	000977	浪潮信息	2,407,216.80	2.67
259	603993	洛阳钼业	2,402,118.00	2.66
260	600063	皖维高新	2,371,012.35	2.63
261	000732	泰禾集团	2,369,309.00	2.62
262	600166	福田汽车	2,365,167.00	2.62
263	601718	际华集团	2,356,297.00	2.61
264	002429	兆驰股份	2,339,864.00	2.59
265	600587	新华医疗	2,322,006.98	2.57
266	300058	蓝色光标	2,314,622.42	2.56
267	600507	方大特钢	2,310,369.00	2.56
268	002230	科大讯飞	2,303,418.13	2.55
269	002128	露天煤业	2,297,884.26	2.54
270	600512	腾达建设	2,291,038.00	2.54
271	603658	安图生物	2,253,554.00	2.50
272	600862	中航高科	2,251,486.10	2.49
273	002367	康力电梯	2,247,333.00	2.49
274	601933	永辉超市	2,245,685.00	2.49
275	601611	中国核建	2,221,211.60	2.46
276	300118	东方日升	2,193,872.17	2.43
277	000655	金岭矿业	2,190,922.00	2.43
278	600863	内蒙华电	2,184,447.00	2.42
279	600522	中天科技	2,181,186.00	2.42
280	600580	卧龙电驱	2,159,337.00	2.39
281	603309	维力医疗	2,153,968.27	2.39
282	300322	硕贝德	2,118,180.30	2.35
283	000031	大悦城	2,110,585.00	2.34
284	300146	汤臣倍健	2,101,634.00	2.33
285	601800	中国交建	2,093,636.00	2.32
286	600745	闻泰科技	2,077,691.50	2.30
287	603520	司太立	2,071,987.60	2.29
288	600022	山东钢铁	2,061,080.00	2.28

289	603369	今世缘	2,040,233.75	2.26
290	000538	云南白药	2,018,419.00	2.24
291	603355	莱克电气	1,993,412.68	2.21
292	600846	同济科技	1,987,929.00	2.20
293	000783	长江证券	1,982,231.00	2.20
294	601369	陕鼓动力	1,977,459.93	2.19
295	000625	长安汽车	1,969,516.79	2.18
296	600623	华谊集团	1,967,261.00	2.18
297	002734	利民股份	1,965,188.00	2.18
298	002563	森马服饰	1,963,434.42	2.17
299	688111	金山办公	1,946,601.27	2.16
300	601958	金钼股份	1,937,326.00	2.15
301	601658	邮储银行	1,907,985.30	2.11
302	300601	康泰生物	1,901,989.63	2.11
303	600312	平高电气	1,897,660.96	2.10
304	603711	香飘飘	1,852,047.00	2.05
305	601989	中国重工	1,849,524.00	2.05
306	000898	鞍钢股份	1,833,649.00	2.03
307	600061	国投资本	1,831,574.24	2.03
308	600660	福耀玻璃	1,828,483.00	2.02
309	300024	机器人	1,819,942.68	2.02
310	600271	航天信息	1,818,471.00	2.01
311	600362	江西铜业	1,816,949.00	2.01

注：本项的“卖出金额”均按成交金额（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	2,563,833,568.54
卖出股票的收入（成交）总额	2,277,305,846.77

注：本项“买入股票成本”“卖出股票成本”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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,801,680.00	0.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-



7	可转债（可交换债）	488,400.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,290,080.00	0.72

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019611	19 国债 01	28,000	2,801,680.00	0.61
2	110065	淮矿转债	4,220	422,000.00	0.09
3	128089	麦米转债	664	66,400.00	0.01

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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** 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除华夏银行(600015)、交通银行(601328)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2019年7月5日，因存在流动资金额度测算存在数据编造等违规行为，中国银行业监督管理委员会宁波监管局对华夏银行股份有限公司宁波分行处以罚款的行政处罚。

2019年8月23日，因存在高管及员工监督管理不到位等违规行为，中国银行业监督管理委员会

会四川监管局对交通银行股份有限公司四川省分行处以罚款的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

### 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	348,457.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	68,301.39
5	应收申购款	46,696.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	463,455.37

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
博时量化价 值股票 A	909	27,947.70	14,309,654.89	56.33%	11,094,802.24	43.67%
博时量化价	357	1,131,347.28	402,045,264.98	99.54%	1,845,712.98	0.46%

值股票 C						
合计	1,266	339,095.92	416,354,919.87	96.99%	12,940,515.22	3.01%

## 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	博时量化价值股票 A	164,044.55	0.65%
	博时量化价值股票 C	50.00	0.00%
	合计	164,094.55	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	博时量化价值股票 A	0
	博时量化价值股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	10~50
	博时量化价值股票 C	0
	合计	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本开放式基金。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 26 日）基金份额总额	177,981,219.30	163,210,681.29
本报告期期初基金份额总额	93,825,753.15	10,314,834.25
本报告期基金总申购份额	58,819,010.10	508,286,337.04
减：本报告期基金总赎回份额	127,240,306.12	114,710,193.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,404,457.13	403,890,977.96

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

## 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

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2019 年 8 月 24 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》，董良泓先生不再担任博时基金管理有限公司副总经理职务。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 40,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 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	
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	1,479,945,339.88	30.69%	1,378,264.90	32.50%	新增 1 个
招商证券	2	1,287,998,494.60	26.71%	1,199,524.59	28.28%	新增 1 个
中信证券	2	934,278,212.15	19.38%	683,240.13	16.11%	新增 1 个
国信证券	1	432,351,464.56	8.97%	402,649.88	9.49%	-
华泰证券	1	311,122,210.68	6.45%	227,524.35	5.36%	-
国金证券	1	260,429,037.46	5.40%	242,538.19	5.72%	新增 1 个

高华证券	1	85,037,005.32	1.76%	79,188.57	1.87%	新增 1 个
中金公司	1	30,455,644.21	0.63%	28,363.19	0.67%	
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 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
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	152,588.20	2.45%	-	-	-	-
招商证券	272,346.07	4.36%	-	-	-	-
中信证券	5,588,144.40	89.56%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	226,370.50	3.63%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书（摘要）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
2	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书（正文）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31

3	博时量化价值股票型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	2019-12-31
4	博时基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下博时量化价值股票型证券投资基金法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-31
5	博时量化价值股票型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	2019-12-31
6	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书（正文）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-26
7	关于博时量化价值股票型证券投资基金降低管理费率及相应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	2019-11-26
8	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书（摘要）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-26
9	博时量化价值股票型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	2019-11-26
10	博时量化价值股票型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	2019-11-26
11	博时量化价值股票型证券投资基金 2019 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	2019-10-23
12	关于博时旗下部分开放式基金增加华瑞保险销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-08-30
13	博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年半年度报告（正文）	中国证券报、基金管理人网站	2019-08-27
14	博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）	中国证券报、基金管理人网站	2019-08-27
15	关于博时旗下部分开放式基金增加西藏东方财富证券股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公	中国证券报、基金管理人网站	2019-08-16



	告		
16	20190812 关于博时旗下部分开放式基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-08-12
17	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 2 号（正文）	中国证券报、基金管理人网站	2019-08-10
18	20190810 博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 2 号（摘要）	中国证券报、基金管理人网站	2019-08-10
19	博时量化价值股票型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	2019-08-07
20	关于博时旗下部分开放式基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-07-25
21	博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019-07-18
22	关于博时旗下部分开放式基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-07-18
23	关于博时基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加上海长量基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-07-12
24	关于博时旗下部分开放式基金增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-07-10
25	关于博时旗下部分开放式基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-05-22
26	关于博时旗下部分开放式基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-05-16
27	关于博时量化价值股票增加华泰证券渠道为代销机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-05-15
28	博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019-04-22
29	博时量化价值股票型证券投资基金 2018 年年度报告（正文）	中国证券报、基金管理人网站	2019-03-29
30	博时量化价值股票型证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	中国证券报、基金管理人网站	2019-03-29
31	关于博时旗下部分开放式基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-03-25
32	关于博时旗下部分开放式基金参加泉州银行费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-02-28
33	关于博时旗下部分开放式基金增加广发银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-02-26
34	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金	2019-02-01



	2019 年第 1 号（摘要）	管理人网站	
35	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书 2019 年第 1 号（正文）	中国证券报、基金管理人网站	2019-02-01
36	博时量化价值股票型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站	2019-01-19
37	关于博时旗下部分开放式基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019-01-09

## §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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-07-31~2019-12-31	-	200,878,839.88	-	200,878,839.88	46.79%
	2	2019-06-10~2019-07-30	-	17,219,654.89	2,910,000.00	14,309,654.89	3.33%
	3	2019-12-19~2019-12-31	-	100,727,585.22	-	100,727,585.22	23.46%
	4	2019-07-31~2019-12-31	-	200,878,839.88	100,440,000.00	100,438,839.88	23.40%
	5	2019-06-19~2019-07-30	-	17,137,636.56	17,137,636.56	-	-
个人	1	2019-05-30~2019-06-13	-	10,041,172.93	10,041,172.93	-	-

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 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

- 13.1.1 中国证监会批准博时量化价值股票型证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时量化价值股票型证券投资基金托管协议》
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 13.1.5 博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 13.1.6 报告期内博时量化价值股票型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阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

客户服务中心电话：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二〇年三月二十七日