

博时量化价值股票型证券投资基金
2020 年中期报告
2020 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49

7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 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	409,402,049.44 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	5,883,325.31 份	403,518,724.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
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> <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。</p>

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		江向阳	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）	
	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	716,303.71	27,340,331.53

本期利润	1,187,972.01	46,988,187.50
加权平均基金份额本期利润	0.1349	0.1163
本期加权平均净值利润率	12.36%	10.79%
本期基金份额净值增长率	11.39%	10.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	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	1,169,643.49	72,457,148.26
期末可供分配基金份额利润	0.1988	0.1796
期末基金资产净值	7,052,968.80	475,975,872.39
期末基金份额净值	1.1988	1.1796
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
	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	19.88%	17.96%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时量化价值股票 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
过去一个月	10.32%	0.82%	6.74%	0.87%	3.58%	-0.05%
过去三个月	15.24%	0.86%	10.91%	0.88%	4.33%	-0.02%
过去六个月	11.39%	1.51%	0.16%	1.39%	11.23%	0.12%
过去一年	17.36%	1.23%	5.67%	1.09%	11.69%	0.14%
自基金合同生效起至今	19.88%	1.29%	11.06%	1.18%	8.82%	0.11%

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
过去一个月	10.24%	0.82%	6.74%	0.87%	3.50%	-0.05%
过去三个月	15.00%	0.86%	10.91%	0.88%	4.09%	-0.02%
过去六个月	10.95%	1.51%	0.16%	1.39%	10.79%	0.12%

过去一年	16.42%	1.23%	5.67%	1.09%	10.75%	0.14%
自基金合同生效起至今	17.96%	1.29%	11.06%	1.18%	6.90%	0.11%

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%和 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

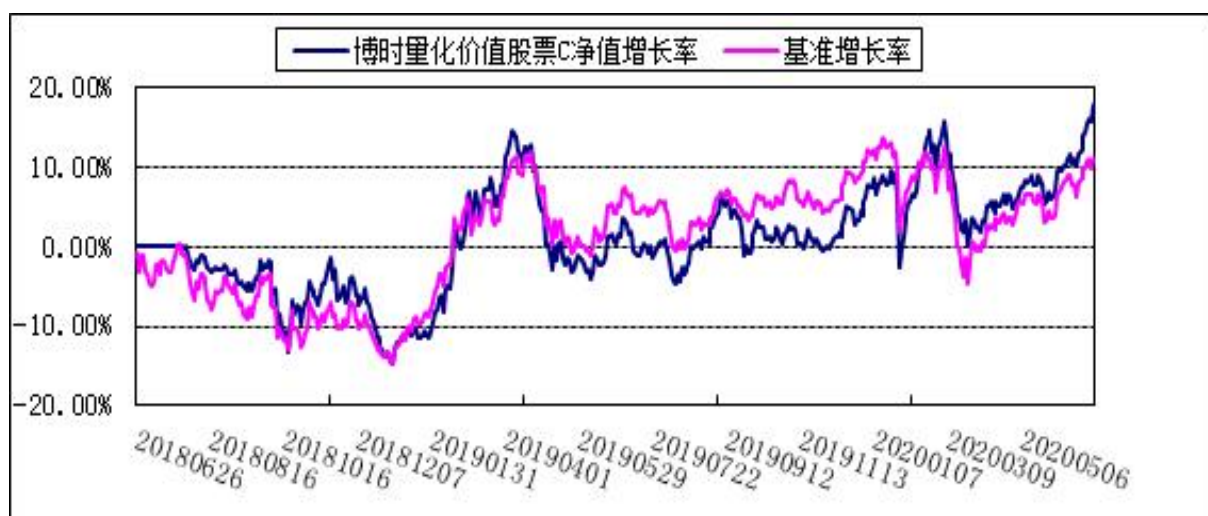
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 6 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日)

博时量化价值股票 A



博时量化价值股票 C



§ 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 2020 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 224 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 12150 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 3882 亿元人民币，累计分红逾 1296 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。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020 “Best of the Best Awards” 三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang Xiangyang），博时基金（国际）有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”（Winner, Hong Kong Best China Fund House），博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩（5 年）”（Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund）。

2020 年 3 月 31 日，《中国证券报》第十七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信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020 年 3 月 26 日，Morningstar 晨星（中国）2020 年度基金评选结果揭晓，博时信用债券在参选的同类 428 只基金中脱颖而出，摘得晨星“2020 年度激进债券型基金奖”。

2020 年 1 月 10 日，新京报“开放 普惠 科技”2019 金融行业评选颁奖典礼在北京举办，博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果，荣获“2019 年度杰出社会责任影响力企业”。

2020 年 1 月 4 日，2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青奖典礼在北京举办，博时基金凭借在 ESG 投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果，荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

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		
林景艺	基金经理	2018-06-26	-	10.0	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 日一至今)、博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日一至今)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	-	18.0	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总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、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日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日一至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	10.0	2010年7月加入博时基金管理有限公司, 历任程序员、系统运维经理。2016年1月调任博时资本, 任投资经理。2018年2月再次加入博时基金管理有限公司, 现任基金经理助理。
周江	高级研究员兼基金经理助理	2018-07-27	-	5.2	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 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 93 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

2020 年上半年，在新冠疫情的冲击下，全球资本市场的波动都非常剧烈，A 股市场也经历了较大的震荡，在全球政府不断出台刺激经济的政策背景下，最终大部分指数都在上半年获得正收益。风格方面，成长风格在一季度表现抢眼，盈利稳定的高质量个股则在整个上半年显著跑出超额收益，低估值股票在 3 月份有脉冲式反弹但是整体上持续低迷，规模上中盘股和小盘股整体跑赢大盘股，主题板块上创业板表现格外抢眼。行业层面，行业波动性显著增加，且轮动速度加快，中信一级行业指数中，医药、消费者服务、食品饮料、电子、计算机涨幅明显，非银行金融、银行、煤炭和石油石化行业指数跌幅居前。

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 2020 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1988 元，份额累计净值为 1.1988 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1796 元，份额累计净值为 1.1796 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 11.39%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 10.95%，同期业绩基准增长率 0.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年下半年，宏观经济方面，在疫苗出来之前，全球经济依然会受到新冠疫情反复的负面影响，而中国社会和经济大概率会比相当多国家和地区更加稳定、更加接近正常情况，相对优势明显。同时，逆全球化浪潮也在除中国外的主要经济国家显著抬升，国际环境暂无明显改善迹象。政策方面，稳增长政策将持续发力，流动性的投放将更加聚焦到实体经济层面。市场情绪方面，海

外疫情、国际地缘政治以及监管和政策大的变化可能会给市场带来短期扰动，尤其是市场累积涨幅较高时敏感性更高。当前市场结构性的估值差异已经达到历史高位，下半年风格差异可能有所缩小，看好基本面修复、政策推动以及低估值驱动下周期、金融板块的估值修复行情，同时业绩稳定性强且估值不高的公司也更加值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	56,721,812.31	24,099,797.83
结算备付金		7,294,739.12	1,451,928.80
存出保证金		3,980,207.61	348,457.22
交易性金融资产	6.4.3.2	417,468,505.22	432,822,652.96
其中：股票投资		417,308,554.22	429,532,572.96
基金投资		-	-
债券投资		159,951.00	3,290,080.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		113,036.70	-
应收利息	6.4.3.5	14,715.22	68,301.39
应收股利		-	-
应收申购款		33,144.38	46,696.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		485,626,160.56	458,837,834.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.3.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		305,291.92	67,635.53
应付管理人报酬		339,753.83	343,748.53
应付托管费		94,376.07	95,485.69
应付销售服务费	6.4.3.7	297,030.53	281,446.80
应付交易费用		1,431,657.00	1,147,672.40
应交税费		45,042.24	0.64
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	84,167.78	164,531.67
负债合计		2,597,319.37	2,100,521.26
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.3.9	409,402,049.44	429,295,435.09
未分配利润	6.4.3.10	73,626,791.75	27,441,878.61
所有者权益合计		483,028,841.19	456,737,313.70
负债和所有者权益总计		485,626,160.56	458,837,834.96

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 409,402,049.44 份。其中 A 类基金份额净值 1.1988 元，基金份额总额 5,883,325.31 份；C 类基金份额净值 1.1796 元，基金份额总额 403,518,724.13 份。

6.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		58,928,324.85	23,058,639.91
1. 利息收入		182,075.40	28,967.78
其中：存款利息收入	6.4.3.11	176,436.69	26,809.29
债券利息收入		5,638.71	2,158.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,615,080.69	19,294,370.27
其中：股票投资收益	6.4.3.12	32,010,483.66	18,720,098.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	148,162.58	71,329.90
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	1,752,485.44	-
股利收益	6.4.3.15	4,703,949.01	502,942.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	20,119,524.27	3,702,153.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	11,644.49	33,148.40
减：二、费用		10,752,165.34	2,214,639.10
1. 管理人报酬		1,991,123.53	432,217.00
2. 托管费		553,089.83	72,036.20
3. 销售服务费		1,731,324.68	20,035.74
4. 交易费用	6.4.3.18	6,373,521.22	1,608,663.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6,309.34	0.43
7. 其他费用	6.4.3.19	96,796.74	81,686.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		48,176,159.51	20,844,000.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,176,159.51	20,844,000.81

6.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	429,295,435.09	27,441,878.61	456,737,313.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,176,159.51	48,176,159.51
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）	-19,893,385.65	-1,991,246.37	-21,884,632.02
其中：1. 基金申购款	4,162,756.78	300,854.74	4,463,611.52
2. 基金赎回款	-24,056,142.43	-2,292,101.11	-26,348,243.54
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）	409,402,049.44	73,626,791.75	483,028,841.19
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	20,844,000.81	20,844,000.81
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）	-36,646,917.17	-5,568,797.15	-42,215,714.32
其中：1. 基金申购款	52,954,723.41	-196.13	52,954,527.28
2. 基金赎回款	-89,601,640.58	-5,568,601.02	-95,170,241.60
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）	67,493,670.23	1,433,168.74	68,926,838.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳

主管会计工作负责人：王德英

会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 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；

6.4.2.2 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费附加，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。

6.4.2.3 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。

6.4.2.4 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。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	56,721,812.31
定期存款	-
其他存款	-
合计	56,721,812.31

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	380,020,842.00	417,308,554.22	37,287,712.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	160,000.00	159,951.00
	银行间市场	-	-
	合计	160,000.00	159,951.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	380,180,842.00	417,468,505.22	37,287,663.22

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	31,533,500.00	-	-	-
股指期货	31,533,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	31,533,500.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2009	中证 500 期货 2009 合约	10	11,328,800.00	671,760.00
IC2012	中证 500 期货 2012 合约	2	2,198,640.00	90,000.00
IF2009	沪深 300 期货 2009 合约	16	19,524,480.00	756,660.00
减：可抵 销期货暂收款				1,518,420.00
股指期货 投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	11,296.85
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	3,168.53
应收债券利息	82.74
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	167.10
合计	14,715.22

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末

	2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,431,657.00
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,431,657.00

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	104.66
应付证券出借违约金	-
其他应付款	-
预提费用	84,063.12
合计	84,167.78

6.4.3.9 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	25,404,457.13	25,404,457.13
本期申购	2,432,425.63	2,432,425.63
本期赎回（以“-”号填列）	-21,953,557.45	-21,953,557.45
本期末	5,883,325.31	5,883,325.31

博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	403,890,977.96	403,890,977.96
本期申购	1,730,331.15	1,730,331.15
本期赎回（以“-”号填列）	-2,102,584.98	-2,102,584.98
本期末	403,518,724.13	403,518,724.13

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.3.10 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	4,170,093.97	-2,235,285.34	1,934,808.63
本期利润	716,303.71	471,668.30	1,187,972.01

本期基金份额交易产生的变动数	-3,490,609.14	1,537,471.99	-1,953,137.15
其中：基金申购款	517,787.90	-349,775.67	168,012.23
基金赎回款	-4,008,397.04	1,887,247.66	-2,121,149.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,395,788.54	-226,145.05	1,169,643.49

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	60,908,025.94	-35,400,955.96	25,507,069.98
本期利润	27,340,331.53	19,647,855.97	46,988,187.50
本期基金份额交易产生的变动数	-62,005.76	23,896.54	-38,109.22
其中：基金申购款	342,432.99	-209,590.48	132,842.51
基金赎回款	-404,438.75	233,487.02	-170,951.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,186,351.71	-15,729,203.45	72,457,148.26

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	130,254.84
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	43,502.29
其他	2,679.56
合计	176,436.69

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	2,198,853,751.78
减：卖出股票成本总额	2,166,843,268.12
买卖股票差价收入	32,010,483.66

6.4.3.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,514,310.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	8,193,760.00

成本总额	
减：应收利息总额	172,387.99
买卖债券差价收入	148,162.58

6.4.3.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	1,752,485.44

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,703,949.01
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	4,703,949.01

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	18,601,104.27
——股票投资	18,603,873.27
——债券投资	-2,769.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,518,420.00
——权证投资	-
——股指期货	1,518,420.00
4. 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	20,119,524.27

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	5,311.49
基金转换费收入	6,333.00

合计	11,644.49
----	-----------

- 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。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	6,373,521.22
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	6,373,521.22

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	8,233.62
中债登账户维护费	9,000.00
合计	96,796.74

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 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。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、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
--------------------	----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	424,671,916.38	9.82%	685,474,273.04	64.79%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30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	-	-	262,510.31	25.48%

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	395,502.75	10.56%	7,253.72	0.51%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

招商证券	638,388.61	66.19%	95,204.60	37.04%
------	------------	--------	-----------	--------

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。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,991,123.53	432,217.00
其中：支付销售机构的客户维护费	30,686.31	187,943.08

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。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	553,089.83	72,036.20

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

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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
中国农业银行	-	338.13	338.13
招商证券	-	3.09	3.09
博时基金	-	1,724,161.12	1,724,161.12
合计	-	1,724,502.34	1,724,502.34

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	-	1,264.32	1,264.32
招商证券	-	130.81	130.81
中国农业银行	-	2,498.49	2,498.49
合计	-	3,893.62	3,893.62

注：A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费 C 类按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$C \text{ 类日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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。

6.4.6.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	56,721,812.31	130,254.84	4,811,299.38	17,471.31

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688004	博汇科技	2020-06-05	2020-12-14	首次公开发行限售	28.77	71.90	2,500.00	71,925.00	179,750.00	-
688159	有方科技	2020-01-16	2020-07-23	首次公开发行限售	20.35	52.73	3,341.00	67,989.35	176,170.93	-
688026	洁特生物	2020-01-15	2020-07-22	首次公开发行限售	16.49	83.32	4,433.00	73,100.17	369,357.56	-
688558	国盛智科	2020-06-19	2020-12-30	首次公开发行限售	17.37	35.26	8,488.00	147,436.56	299,286.88	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470.00	8,286.10	8,286.10	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股未上市	11.33	11.33	8,337.00	94,458.21	94,458.21	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131.00	3,811.47	3,811.47	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	11,020.00	178,634.20	178,634.20	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185.00	7,038.90	7,038.90	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894.00	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810.00	106,072.40	106,072.40	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751.00	7,517.51	7,517.51	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830.00	102,389.40	102,389.40	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421.00	9,861.74	9,861.74	-
6.4.8.1.2 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
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	新债未上市	100.00	100.00	101.00	10,100.00	10,100.00	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	新债未上市	100.00	100.00	449.00	44,900.00	44,900.00	-

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

公开发行的股份，所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 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%(根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定)；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。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.03% (2019 年 12 月 31 日：0.11%)。

6.4.9.2.1 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 2020 年 6 月 30 日	上年末 2019 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。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.9.2.4 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 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	56,741.80	422,000.00
AAA 以下	103,209.20	66,400.00
未评级	-	-
合计	159,951.00	488,400.00

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.9.3 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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指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。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日 资产	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
银行存款	56,721,812.31	-	-	-	56,721,812.31
结算备付金	7,294,739.12	-	-	-	7,294,739.12
存出保证金	3,980,207.61	-	-	-	3,980,207.61
交易性金融资产	-	-	159,951.00	417,308,554.22	417,468,505.22
应收证券清算款	-	-	-	113,036.70	113,036.70
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	14,715.22	14,715.22
应收申购款	-	-	-	33,144.38	33,144.38
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	67,996,759.04	-	159,951.00	417,469,450.52	485,626,160.56
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	305,291.92	305,291.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	339,753.83	339,753.83
应付托管费	-	-	-	94,376.07	94,376.07

应付销售服务费	-	-	-	297,030.53	297,030.53
应交税费	-	-	-	45,042.24	45,042.24
应付交易费用	-	-	-	1,431,657.00	1,431,657.00
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	84,167.78	84,167.78
负债总计	-	-	-	2,597,319.37	2,597,319.37
利率敏感度缺口	67,996,759.04	-	159,951.00	414,872,131.15	483,028,841.19
上年度末 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	-	-	-	-	-
资产总计	28,701,863.85	-	488,400.00	429,647,571.11	458,837,834.96
负债					
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
负债总计	-	-	-	2,100,521.26	2,100,521.26
利率敏感度缺口	28,701,863.85	-	488,400.00	427,547,049.85	456,737,313.70

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

6.4.9.4.1.2 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。

6.4.9.4.2 外汇风险

无。

6.4.9.4.3 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。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	417,308,554.22	86.39	429,532,572.96	94.04
交易性金融资产—债券投资	159,951.00	0.03	488,400.00	0.11
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	417,468,505.22	86.43	430,020,972.96	94.15

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。

6.4.9.4.3.2 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,640	增加约 2,299
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,640	减少约 2,299

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 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 415,741,250.44 元，属于第二层次的余额为人民币 1,727,254.78 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 419,430,000.88 元，第二层次人民币 13,392,652.08 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）。

6.4.10.2 承诺事项

无。

6.4.10.3 其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	417,308,554.22	85.93
	其中：股票	417,308,554.22	85.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	159,951.00	0.03
	其中：债券	159,951.00	0.03
	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	64,016,551.43	13.18

8	其他各项资产	4,141,103.91	0.85
9	合计	485,626,160.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,581,742.00	2.40
B	采矿业	3,923,526.00	0.81
C	制造业	244,867,541.27	50.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,843,132.32	0.59
E	建筑业	7,190,652.00	1.49
F	批发和零售业	17,167,374.40	3.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,417,357.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,909,917.77	7.64
J	金融业	57,195,893.46	11.84
K	房地产业	11,570,412.00	2.40
L	租赁和商务服务业	1,845,281.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	7,525,568.00	1.56
N	水利、环境和公共设施管理业	1,354,858.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,378,175.00	0.49
Q	卫生和社会工作	6,094,739.00	1.26
R	文化、体育和娱乐业	3,442,385.00	0.71
S	综合	-	-
	合计	417,308,554.22	86.39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,800	11,410,464.00	2.36
2	600276	恒瑞医药	113,180	10,446,514.00	2.16
3	000858	五粮液	51,100	8,744,232.00	1.81
4	601318	中国平安	117,200	8,368,080.00	1.73
5	002475	立讯精密	161,486	8,292,306.10	1.72
6	000661	长春高新	17,200	7,487,160.00	1.55
7	002555	三七互娱	152,320	7,128,576.00	1.48
8	002714	牧原股份	81,850	6,711,700.00	1.39
9	300529	健帆生物	80,140	5,569,730.00	1.15
10	300760	迈瑞医疗	16,400	5,013,480.00	1.04
11	300498	温氏股份	221,160	4,821,288.00	1.00

12	300347	泰格医药	47,100	4,798,548.00	0.99
13	300628	亿联网络	68,500	4,675,810.00	0.97
14	603288	海天味业	37,380	4,650,072.00	0.96
15	601012	隆基股份	113,000	4,602,490.00	0.95
16	600015	华夏银行	739,600	4,526,352.00	0.94
17	000002	万科 A	167,700	4,383,678.00	0.91
18	601166	兴业银行	275,100	4,341,078.00	0.90
19	600919	江苏银行	746,100	4,230,387.00	0.88
20	300059	东方财富	201,880	4,077,976.00	0.84
21	603444	吉比特	7,100	3,897,971.00	0.81
22	601328	交通银行	739,500	3,793,635.00	0.79
23	601601	中国太保	137,700	3,752,325.00	0.78
24	601658	邮储银行	796,578	3,640,361.46	0.75
25	600585	海螺水泥	66,400	3,513,224.00	0.73
26	300676	华大基因	22,400	3,492,384.00	0.72
27	601838	成都银行	430,200	3,424,392.00	0.71
28	601997	贵阳银行	468,000	3,350,880.00	0.69
29	300433	蓝思科技	119,500	3,350,780.00	0.69
30	000333	美的集团	55,100	3,294,429.00	0.68
31	603233	大参林	39,920	3,242,302.40	0.67
32	300482	万孚生物	30,800	3,203,200.00	0.66
33	000895	双汇发展	66,100	3,046,549.00	0.63
34	002223	鱼跃医疗	82,800	3,013,920.00	0.62
35	300770	新媒股份	13,300	2,974,678.00	0.62
36	002304	洋河股份	28,200	2,964,948.00	0.61
37	300124	汇川技术	76,600	2,910,034.00	0.60
38	300033	同花顺	19,900	2,648,292.00	0.55
39	600887	伊利股份	84,600	2,633,598.00	0.55
40	603259	药明康德	27,200	2,627,520.00	0.54
41	002410	广联达	36,300	2,530,110.00	0.52
42	600346	恒力石化	172,100	2,409,400.00	0.50
43	002607	中公教育	85,700	2,378,175.00	0.49
44	002415	海康威视	77,600	2,355,160.00	0.49
45	002216	三全食品	97,900	2,339,810.00	0.48
46	300782	卓胜微	5,760	2,337,235.20	0.48
47	002869	金溢科技	34,900	2,306,192.00	0.48
48	300552	万集科技	53,500	2,278,030.00	0.47
49	000651	格力电器	40,000	2,262,800.00	0.47
50	002531	天顺风能	372,500	2,227,550.00	0.46
51	300418	昆仑万维	88,400	2,206,464.00	0.46
52	000568	泸州老窖	24,200	2,205,104.00	0.46
53	300677	英科医疗	17,200	2,198,160.00	0.46
54	300558	贝达药业	15,700	2,197,686.00	0.45

55	002594	比亚迪	30,600	2,197,080.00	0.45
56	601137	博威合金	140,400	2,195,856.00	0.45
57	600604	市北高新	232,800	2,190,648.00	0.45
58	603501	韦尔股份	10,700	2,160,865.00	0.45
59	600019	宝钢股份	470,300	2,144,568.00	0.44
60	002443	金洲管道	311,600	2,121,996.00	0.44
61	601336	新华保险	47,100	2,085,588.00	0.43
62	600153	建发股份	257,400	2,084,940.00	0.43
63	600745	闻泰科技	16,500	2,078,175.00	0.43
64	600183	生益科技	69,500	2,034,265.00	0.42
65	002214	大立科技	70,000	1,972,600.00	0.41
66	600657	信达地产	461,200	1,900,144.00	0.39
67	002091	江苏国泰	309,100	1,870,055.00	0.39
68	300661	圣邦股份	6,100	1,860,805.00	0.39
69	000977	浪潮信息	45,900	1,798,362.00	0.37
70	002709	天赐材料	52,500	1,773,975.00	0.37
71	600104	上汽集团	104,300	1,772,057.00	0.37
72	000090	天健集团	251,500	1,737,865.00	0.36
73	002416	爱施德	242,000	1,737,560.00	0.36
74	601390	中国中铁	344,800	1,730,896.00	0.36
75	002920	德赛西威	28,100	1,723,373.00	0.36
76	600809	山西汾酒	11,800	1,711,000.00	0.35
77	600584	长电科技	52,700	1,647,929.00	0.34
78	601766	中国中车	293,800	1,636,466.00	0.34
79	603000	人民网	82,400	1,633,992.00	0.34
80	600845	宝信软件	27,600	1,630,608.00	0.34
81	600000	浦发银行	149,700	1,583,826.00	0.33
82	002601	龙蟠佰利	85,400	1,579,900.00	0.33
83	603208	江山欧派	16,140	1,572,036.00	0.33
84	300497	富祥药业	76,400	1,495,148.00	0.31
85	300122	智飞生物	14,800	1,482,220.00	0.31
86	002027	分众传媒	266,000	1,481,620.00	0.31
87	601668	中国建筑	307,600	1,467,252.00	0.30
88	002624	完美世界	25,400	1,464,056.00	0.30
89	002705	新宝股份	39,200	1,430,016.00	0.30
90	002142	宁波银行	52,400	1,376,548.00	0.28
91	600050	中国联通	284,300	1,376,012.00	0.28
92	603338	浙江鼎力	17,800	1,348,706.00	0.28
93	000963	华东医药	51,700	1,308,010.00	0.27
94	300114	中航电测	114,200	1,303,022.00	0.27
95	601808	中海油服	97,400	1,279,836.00	0.26
96	300759	康龙化成	13,000	1,279,200.00	0.26
97	600010	包钢股份	1,181,800	1,276,344.00	0.26

98	002511	中顺洁柔	55,200	1,230,960.00	0.25
99	002157	正邦科技	70,200	1,227,096.00	0.25
100	603019	中科曙光	31,620	1,214,208.00	0.25
101	601138	工业富联	77,800	1,178,670.00	0.24
102	002507	涪陵榨菜	32,400	1,166,724.00	0.24
103	002841	视源股份	11,700	1,164,384.00	0.24
104	601799	星宇股份	9,000	1,143,000.00	0.24
105	601100	恒立液压	14,200	1,138,840.00	0.24
106	603986	兆易创新	4,820	1,137,086.20	0.24
107	601186	中国铁建	133,900	1,122,082.00	0.23
108	002075	沙钢股份	89,200	1,115,000.00	0.23
109	603156	养元饮品	51,720	1,111,980.00	0.23
110	603218	日月股份	60,360	1,104,588.00	0.23
111	600900	长江电力	57,700	1,092,838.00	0.23
112	300750	宁德时代	6,100	1,063,596.00	0.22
113	600030	中信证券	43,300	1,043,963.00	0.22
114	300246	宝莱特	28,800	1,010,304.00	0.21
115	002001	新和成	34,400	1,001,040.00	0.21
116	600782	新钢股份	241,400	984,912.00	0.20
117	000001	平安银行	76,700	981,760.00	0.20
118	601881	中国银河	85,500	980,685.00	0.20
119	000932	华菱钢铁	256,000	965,120.00	0.20
120	601398	工商银行	193,200	962,136.00	0.20
121	603606	东方电缆	65,400	950,916.00	0.20
122	000829	天音控股	143,900	942,545.00	0.20
123	300413	芒果超媒	14,200	925,840.00	0.19
124	600850	华东电脑	37,000	906,870.00	0.19
125	000789	万年青	68,400	880,308.00	0.18
126	002859	洁美科技	29,100	872,418.00	0.18
127	000876	新希望	29,000	864,200.00	0.18
128	300171	东富龙	52,900	855,922.00	0.18
129	002007	华兰生物	16,700	836,837.00	0.17
130	300638	广和通	13,800	829,380.00	0.17
131	300457	赢合科技	25,900	825,692.00	0.17
132	000538	云南白药	8,800	825,528.00	0.17
133	600685	中船防务	47,800	808,298.00	0.17
134	600027	华电国际	233,500	798,570.00	0.17
135	000157	中联重科	123,300	792,819.00	0.16
136	002602	世纪华通	51,700	791,527.00	0.16
137	600064	南京高科	80,700	784,404.00	0.16
138	002432	九安医疗	70,300	782,439.00	0.16
139	603866	桃李面包	15,100	768,439.00	0.16
140	600055	万东医疗	46,500	744,465.00	0.15

141	600516	方大炭素	117,700	739,156.00	0.15
142	000401	冀东水泥	45,800	734,632.00	0.15
143	600180	瑞茂通	114,500	730,510.00	0.15
144	002139	拓邦股份	128,500	723,455.00	0.15
145	600704	物产中大	171,200	720,752.00	0.15
146	600522	中天科技	62,900	720,205.00	0.15
147	601688	华泰证券	38,100	716,280.00	0.15
148	300072	三聚环保	164,100	702,348.00	0.15
149	603360	百傲化学	36,000	699,480.00	0.14
150	600031	三一重工	36,800	690,368.00	0.14
151	000035	中国天楹	134,700	686,970.00	0.14
152	600756	浪潮软件	36,600	677,100.00	0.14
153	603920	世运电路	27,200	674,288.00	0.14
154	601928	凤凰传媒	98,600	670,480.00	0.14
155	601818	光大银行	186,900	669,102.00	0.14
156	601988	中国银行	191,000	664,680.00	0.14
157	603113	金能科技	55,600	661,084.00	0.14
158	603883	老百姓	6,600	660,264.00	0.14
159	300115	长盈精密	28,400	648,940.00	0.13
160	000425	徐工机械	109,400	646,554.00	0.13
161	300618	寒锐钴业	10,400	645,008.00	0.13
162	600157	永泰能源	511,000	643,860.00	0.13
163	000063	中兴通讯	15,700	630,041.00	0.13
164	300133	华策影视	86,500	627,125.00	0.13
165	002384	东山精密	20,900	625,955.00	0.13
166	000034	神州数码	25,200	613,368.00	0.13
167	300015	爱尔眼科	13,900	603,955.00	0.13
168	000100	TCL 科技	96,500	598,300.00	0.12
169	600711	盛屯矿业	116,200	597,268.00	0.12
170	601098	中南传媒	55,800	590,364.00	0.12
171	600126	杭钢股份	56,600	588,640.00	0.12
172	300146	汤臣倍健	29,700	584,793.00	0.12
173	601857	中国石油	137,700	576,963.00	0.12
174	600048	保利地产	38,700	571,986.00	0.12
175	600511	国药股份	13,900	565,313.00	0.12
176	000830	鲁西化工	74,800	558,008.00	0.12
177	300206	理邦仪器	30,100	549,024.00	0.11
178	601933	永辉超市	58,400	547,792.00	0.11
179	002099	海翔药业	68,300	540,253.00	0.11
180	600606	绿地控股	87,400	540,132.00	0.11
181	600022	山东钢铁	407,200	525,288.00	0.11
182	603939	益丰药房	5,700	518,700.00	0.11
183	600018	上港集团	120,500	506,100.00	0.10

184	002252	上海莱士	59,700	505,062.00	0.10
185	600570	恒生电子	4,670	502,959.00	0.10
186	601005	重庆钢铁	336,600	501,534.00	0.10
187	002019	亿帆医药	21,500	493,855.00	0.10
188	300493	润欣科技	54,200	493,220.00	0.10
189	601865	福莱特	25,900	486,920.00	0.10
190	002174	游族网络	18,600	485,088.00	0.10
191	600459	贵研铂业	16,100	479,941.00	0.10
192	600643	爱建集团	60,200	478,590.00	0.10
193	600028	中国石化	122,100	477,411.00	0.10
194	601607	上海医药	25,200	463,176.00	0.10
195	600282	南钢股份	142,300	459,629.00	0.10
196	603229	奥翔药业	8,820	458,640.00	0.09
197	300014	亿纬锂能	9,527	455,866.95	0.09
198	000629	攀钢钒钛	224,100	450,441.00	0.09
199	002568	百润股份	9,900	448,668.00	0.09
200	601200	上海环境	37,200	446,400.00	0.09
201	000709	河钢股份	218,000	444,720.00	0.09
202	601717	郑煤机	75,100	442,339.00	0.09
203	603611	诺力股份	20,600	442,076.00	0.09
204	601618	中国中冶	176,100	442,011.00	0.09
205	603283	赛腾股份	8,200	441,160.00	0.09
206	600638	新黄浦	72,200	440,420.00	0.09
207	601718	际华集团	132,100	438,572.00	0.09
208	600998	九州通	23,400	435,708.00	0.09
209	603993	洛阳钼业	118,700	435,629.00	0.09
210	002605	姚记科技	11,400	433,200.00	0.09
211	600271	航天信息	26,600	431,984.00	0.09
212	002736	国信证券	38,100	430,530.00	0.09
213	002110	三钢闽光	64,400	428,904.00	0.09
214	002440	闰土股份	46,900	428,666.00	0.09
215	000778	新兴铸管	124,900	428,407.00	0.09
216	002107	沃华医药	38,500	427,350.00	0.09
217	300439	美康生物	23,500	424,645.00	0.09
218	603327	福蓉科技	16,400	423,612.00	0.09
219	300726	宏达电子	15,200	422,712.00	0.09
220	300601	康泰生物	2,600	421,616.00	0.09
221	300129	泰胜风能	114,800	421,316.00	0.09
222	002957	科瑞技术	17,500	418,250.00	0.09
223	601163	三角轮胎	31,500	417,060.00	0.09
224	603887	城地股份	16,900	412,360.00	0.09
225	002950	奥美医疗	14,500	411,510.00	0.09
226	002483	润邦股份	91,500	407,175.00	0.08

227	601319	中国人保	63,100	406,364.00	0.08
228	000825	太钢不锈	120,700	400,724.00	0.08
229	603609	禾丰牧业	26,800	399,320.00	0.08
230	600808	马钢股份	154,200	397,836.00	0.08
231	300666	江丰电子	6,600	393,888.00	0.08
232	002437	誉衡药业	121,700	393,091.00	0.08
233	002324	普利特	25,700	385,757.00	0.08
234	300709	精研科技	4,000	384,600.00	0.08
235	300527	中船应急	41,900	380,033.00	0.08
236	000807	云铝股份	87,100	379,756.00	0.08
237	603416	信捷电气	9,500	378,670.00	0.08
238	300432	富临精工	45,800	375,560.00	0.08
239	300229	拓尔思	32,300	370,804.00	0.08
240	688026	洁特生物	4,433	369,357.56	0.08
241	300016	北陆药业	30,300	368,448.00	0.08
242	300147	香雪制药	37,400	366,894.00	0.08
243	300613	富瀚微	3,200	362,560.00	0.08
244	603129	春风动力	5,300	361,513.00	0.07
245	002100	天康生物	22,400	360,640.00	0.07
246	600864	哈投股份	60,000	360,600.00	0.07
247	002726	龙大肉食	42,200	356,168.00	0.07
248	300559	佳发教育	16,700	354,374.00	0.07
249	002387	维信诺	24,700	352,716.00	0.07
250	601989	中国重工	88,100	352,400.00	0.07
251	300180	华峰超纤	40,700	348,392.00	0.07
252	300684	中石科技	10,000	347,000.00	0.07
253	601006	大秦铁路	48,700	342,848.00	0.07
254	600867	通化东宝	19,500	339,885.00	0.07
255	300316	晶盛机电	13,500	333,990.00	0.07
256	000959	首钢股份	77,300	332,390.00	0.07
257	002124	天邦股份	25,400	326,390.00	0.07
258	000166	申万宏源	64,600	326,230.00	0.07
259	600547	山东黄金	8,900	325,918.00	0.07
260	300003	乐普医疗	8,900	325,028.00	0.07
261	603808	歌力思	24,900	320,712.00	0.07
262	600637	东方明珠	33,100	319,415.00	0.07
263	002311	海大集团	6,700	318,853.00	0.07
264	002271	东方雨虹	7,700	312,851.00	0.06
265	002131	利欧股份	81,000	312,660.00	0.06
266	300315	掌趣科技	42,600	312,258.00	0.06
267	600761	安徽合力	32,200	310,408.00	0.06
268	600060	海信视像	25,500	309,825.00	0.06
269	603579	荣泰健康	11,500	308,430.00	0.06

270	002401	中远海科	19,100	304,263.00	0.06
271	000898	鞍钢股份	123,700	303,065.00	0.06
272	600529	山东药玻	5,200	301,600.00	0.06
273	688558	国盛智科	8,488	299,286.88	0.06
274	300142	沃森生物	5,700	298,452.00	0.06
275	000625	长安汽车	26,600	292,600.00	0.06
276	603368	柳药股份	12,740	292,383.00	0.06
277	002821	凯莱英	1,200	291,600.00	0.06
278	000596	古井贡酒	1,900	285,456.00	0.06
279	600763	通策医疗	1,700	283,509.00	0.06
280	600308	华泰股份	60,900	280,140.00	0.06
281	600639	浦东金桥	17,500	279,650.00	0.06
282	601800	中国交建	37,900	278,186.00	0.06
283	600058	五矿发展	45,400	274,216.00	0.06
284	603916	苏博特	10,900	274,135.00	0.06
285	002534	杭锅股份	33,700	273,644.00	0.06
286	600373	中文传媒	22,700	267,406.00	0.06
287	600340	华夏幸福	11,500	262,890.00	0.05
288	600352	浙江龙盛	20,500	262,195.00	0.05
289	603363	傲农生物	11,100	259,407.00	0.05
290	600521	华海药业	7,590	257,528.70	0.05
291	002847	盐津铺子	2,700	257,094.00	0.05
292	300058	蓝色光标	32,800	255,840.00	0.05
293	002460	赣锋锂业	4,700	251,779.00	0.05
294	002236	大华股份	12,500	240,125.00	0.05
295	002737	葵花药业	16,300	238,469.00	0.05
296	000860	顺鑫农业	4,100	233,618.00	0.05
297	600741	华域汽车	10,900	226,611.00	0.05
298	300197	铁汉生态	87,200	221,488.00	0.05
299	603517	绝味食品	3,100	219,294.00	0.05
300	600383	金地集团	15,800	216,460.00	0.04
301	600690	海尔智家	12,100	214,170.00	0.04
302	300408	三环集团	7,700	213,290.00	0.04
303	002044	美年健康	14,700	211,827.00	0.04
304	600588	用友网络	4,770	210,357.00	0.04
305	002595	豪迈科技	10,500	204,330.00	0.04
306	002202	金风科技	20,400	203,388.00	0.04
307	000768	中航飞机	11,400	202,236.00	0.04
308	603966	法兰泰克	20,100	198,588.00	0.04
309	002352	顺丰控股	3,600	196,920.00	0.04
310	603882	金城医学	2,200	196,900.00	0.04
311	600757	长江传媒	38,600	196,474.00	0.04
312	601018	宁波港	54,100	193,137.00	0.04

313	600566	济川药业	7,400	188,404.00	0.04
314	600436	片仔癀	1,100	187,275.00	0.04
315	002916	深南电路	1,080	180,921.60	0.04
316	002493	荣盛石化	14,700	180,810.00	0.04
317	600438	通威股份	10,400	180,752.00	0.04
318	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.04
319	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.04
320	601298	青岛港	31,400	178,352.00	0.04
321	603160	汇顶科技	800	178,320.00	0.04
322	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.04
323	300450	先导智能	3,800	175,598.00	0.04
324	600089	特变电工	25,700	173,989.00	0.04
325	002241	歌尔股份	5,900	173,224.00	0.04
326	002626	金达威	6,500	168,740.00	0.03
327	000739	普洛药业	7,100	165,359.00	0.03
328	600332	白云山	5,100	164,883.00	0.03
329	300144	宋城演艺	9,520	164,696.00	0.03
330	601066	中信建投	4,100	161,458.00	0.03
331	600196	复星医药	4,700	159,095.00	0.03
332	603707	健友股份	2,400	154,968.00	0.03
333	603345	安井食品	1,300	153,400.00	0.03
334	300454	深信服	700	144,172.00	0.03
335	603605	珀莱雅	800	144,016.00	0.03
336	600837	海通证券	11,400	143,412.00	0.03
337	603369	今世缘	3,600	143,244.00	0.03
338	002050	三花智控	6,460	141,474.00	0.03
339	002557	洽洽食品	2,600	140,894.00	0.03
340	600872	中炬高新	2,400	140,472.00	0.03
341	002649	博彦科技	15,000	139,500.00	0.03
342	002371	北方华创	800	136,728.00	0.03
343	601128	常熟银行	17,700	132,927.00	0.03
344	000786	北新建材	6,100	130,113.00	0.03
345	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
346	300012	华测检测	6,400	126,464.00	0.03
347	600167	联美控股	8,500	121,890.00	0.03
348	002128	露天煤业	15,500	120,125.00	0.02
349	600703	三安光电	4,800	120,000.00	0.02
350	600023	浙能电力	32,800	115,128.00	0.02
351	600188	兖州煤业	12,600	110,376.00	0.02
352	000028	国药一致	2,400	108,024.00	0.02
353	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
354	601888	中国中免	700	107,821.00	0.02
355	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.02

356	002884	凌霄泵业	6,200	104,842.00	0.02
357	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
358	002449	国星光电	8,700	100,920.00	0.02
359	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
360	000049	德赛电池	1,900	93,119.00	0.02
361	601992	金隅集团	30,200	92,412.00	0.02
362	002294	信立泰	3,000	88,980.00	0.02
363	601628	中国人寿	3,100	84,351.00	0.02
364	600582	天地科技	28,700	84,091.00	0.02
365	002558	巨人网络	4,800	83,520.00	0.02
366	300009	安科生物	4,300	76,970.00	0.02
367	002734	利民股份	5,070	75,897.90	0.02
368	300763	锦浪科技	1,160	74,344.40	0.02
369	601677	明泰铝业	7,800	67,704.00	0.01
370	600742	一汽富维	7,540	61,978.80	0.01
371	600483	福能股份	8,000	58,080.00	0.01
372	601236	红塔证券	2,800	54,320.00	0.01
373	002462	嘉事堂	3,800	51,756.00	0.01
374	300511	雪榕生物	3,800	48,754.00	0.01
375	300741	华宝股份	1,000	36,880.00	0.01
376	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
377	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.01
378	002567	唐人神	2,400	22,848.00	0.00
379	601211	国泰君安	1,200	20,712.00	0.00
380	600211	西藏药业	300	19,116.00	0.00
381	002459	晶澳科技	1,000	18,780.00	0.00
382	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
383	601939	建设银行	2,700	17,037.00	0.00
384	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
385	000848	承德露露	1,800	12,600.00	0.00
386	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
387	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
388	000987	越秀金控	800	9,328.00	0.00
389	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
390	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
391	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
392	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	31,654,498.14	6.93
2	601318	中国平安	28,240,680.24	6.18
3	600000	浦发银行	26,549,113.92	5.81
4	601390	中国中铁	25,500,047.00	5.58
5	600015	华夏银行	24,077,006.36	5.27
6	601328	交通银行	24,009,072.73	5.26
7	000651	格力电器	22,872,035.98	5.01
8	300014	亿纬锂能	22,109,535.00	4.84
9	000858	五粮液	20,892,348.91	4.57
10	601668	中国建筑	20,863,824.00	4.57
11	000333	美的集团	20,077,330.51	4.40
12	300498	温氏股份	18,103,819.68	3.96
13	601997	贵阳银行	18,055,451.98	3.95
14	600276	恒瑞医药	15,500,292.41	3.39
15	300059	东方财富	15,256,689.78	3.34
16	000661	长春高新	14,992,866.80	3.28
17	000961	中南建设	14,946,723.84	3.27
18	300628	亿联网络	14,616,386.69	3.20
19	002714	牧原股份	14,241,322.98	3.12
20	600585	海螺水泥	14,060,552.25	3.08
21	601166	兴业银行	12,998,762.00	2.85
22	300033	同花顺	12,887,493.68	2.82
23	600048	保利地产	12,814,958.80	2.81
24	600919	江苏银行	12,705,921.00	2.78
25	002555	三七互娱	12,151,873.52	2.66
26	300433	蓝思科技	12,011,854.44	2.63
27	300316	晶盛机电	11,339,000.55	2.48
28	000708	中信特钢	11,001,317.00	2.41
29	601009	南京银行	10,810,194.94	2.37
30	601838	成都银行	10,691,938.19	2.34
31	601117	中国化学	10,647,516.46	2.33
32	002607	中公教育	10,596,541.28	2.32
33	601988	中国银行	10,591,137.00	2.32
34	600346	恒力石化	10,275,028.36	2.25
35	600887	伊利股份	10,250,308.68	2.24
36	300760	迈瑞医疗	10,018,037.76	2.19
37	601012	隆基股份	9,948,578.63	2.18
38	002475	立讯精密	9,882,420.02	2.16
39	300015	爱尔眼科	9,823,189.30	2.15
40	601601	中国太保	9,735,885.82	2.13
41	601186	中国铁建	9,660,419.43	2.12
42	601336	新华保险	9,615,076.38	2.11

43	300552	万集科技	9,254,874.14	2.03
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	32,313,213.57	7.07
2	600000	浦发银行	29,889,608.64	6.54
3	600519	贵州茅台	28,251,688.88	6.19
4	601328	交通银行	26,529,314.32	5.81
5	600015	华夏银行	25,454,681.46	5.57
6	601997	贵阳银行	25,272,576.70	5.53
7	000651	格力电器	23,664,001.31	5.18
8	601390	中国中铁	23,523,771.48	5.15
9	601668	中国建筑	21,561,940.84	4.72
10	300014	亿纬锂能	21,345,538.23	4.67
11	000858	五粮液	19,547,750.64	4.28
12	000333	美的集团	18,606,686.72	4.07
13	300498	温氏股份	17,995,363.73	3.94
14	300059	东方财富	17,015,747.93	3.73
15	603160	汇顶科技	16,133,665.70	3.53
16	300316	晶盛机电	15,881,204.70	3.48
17	000708	中信特钢	15,319,620.91	3.35
18	000961	中南建设	15,007,755.41	3.29
19	300628	亿联网络	14,908,197.28	3.26
20	601988	中国银行	14,445,614.00	3.16
21	300033	同花顺	14,136,132.36	3.10
22	300433	蓝思科技	13,984,692.08	3.06
23	002714	牧原股份	13,294,334.94	2.91
24	600585	海螺水泥	13,212,029.35	2.89
25	600782	新钢股份	12,954,710.42	2.84
26	600048	保利地产	12,101,590.05	2.65
27	601838	成都银行	11,964,211.73	2.62
28	601628	中国人寿	11,535,563.84	2.53
29	000661	长春高新	11,529,495.61	2.52
30	002555	三七互娱	11,345,402.98	2.48
31	000401	冀东水泥	11,251,764.21	2.46
32	000672	上峰水泥	10,964,167.00	2.40
33	000876	新希望	10,801,580.87	2.36
34	600153	建发股份	10,651,390.74	2.33

35	601117	中国化学	10,632,821.58	2.33
36	601009	南京银行	10,512,015.57	2.30
37	600276	恒瑞医药	10,292,025.24	2.25
38	600282	南钢股份	10,200,263.00	2.23
39	600746	江苏索普	9,961,707.00	2.18
40	002475	立讯精密	9,702,238.93	2.12
41	002607	中公教育	9,682,201.02	2.12
42	600622	光大嘉宝	9,620,108.12	2.11
43	600346	恒力石化	9,609,336.62	2.10
44	600466	蓝光发展	9,581,622.35	2.10
45	601186	中国铁建	9,546,303.09	2.09
46	300251	光线传媒	9,387,107.63	2.06
47	603986	兆易创新	9,330,399.47	2.04

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,136,015,376.11
卖出股票的收入（成交）总额	2,198,853,751.78

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	159,951.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	159,951.00	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	------	-----------

					(%)
1	110067	华安转债	530	56,741.80	0.01
2	128100	搜特转债	520	48,209.20	0.01
3	128114	正邦转债	449	44,900.00	0.01
4	128112	歌尔转 2	101	10,100.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2009	IF2009	16.00	19,524,480.00	756,660.00	-
IC2009	IC2009	10.00	11,328,800.00	671,760.00	-
IC2012	IC2012	2.00	2,198,640.00	90,000.00	-
公允价值变动总额合计					1,518,420.00
股指期货投资本期收益					1,752,485.44
股指期货投资本期公允价值变动					1,518,420.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,980,207.61
2	应收证券清算款	113,036.70
3	应收股利	-
4	应收利息	14,715.22
5	应收申购款	33,144.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,141,103.91

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时量化价值股票 A	674	8,728.97	-	-	5,883,325.31	100.00%

博时量化价值股票 C	380	1,061,891.38	402,045,264.98	99.63%	1,473,459.15	0.37%
合计	1,006	406,960.29	402,045,264.98	98.20%	7,356,784.46	1.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化价值股票 A	169,525.50	2.88%
	博时量化价值股票 C	50.00	0.00%
	合计	169,575.50	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	10~50
	博时量化价值股票 C	-
	合计	10~50
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	-
	合计	10~50

§ 9 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	25,404,457.13	403,890,977.96
本报告期基金总申购份额	2,432,425.63	1,730,331.15
减：本报告期基金总赎回份额	21,953,557.45	2,102,584.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,883,325.31	403,518,724.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：1、基金管理人于 2020 年 1 月 10 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张光华先生不再担任公司董事长职务，由公司总经理江向阳先生代为履行董事长职务。2、基金管理人于 2020 年 4 月 17 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》，江向阳先生任博时基金管理有限公司董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券	2	1,224,998,722.50	28.32%	1,016,678.05	27.15%	新增 1 个

华泰证券	1	794,750,722.61	18.38%	581,208.41	15.52%	-
国信证券	2	637,976,627.43	14.75%	594,154.98	15.87%	-
申万宏源	2	574,155,614.07	13.28%	534,708.14	14.28%	-
国泰君安	1	496,826,644.71	11.49%	462,685.68	12.36%	新增 1 个
招商证券	2	424,671,916.38	9.82%	395,502.75	10.56%	-
中银国际证券	1	129,888,468.68	3.00%	120,962.70	3.23%	新增 1 个
国金证券	1	41,638,528.82	0.96%	38,777.67	1.04%	-
银河证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	4,694,288.60	84.69%	-	-	-	-
华泰证券	218,679.38	3.95%	-	-	-	-
国信证券	82,933.60	1.50%	-	-	-	-
申万宏源	146,105.00	2.64%	-	-	-	-
国泰君安	400,800.00	7.23%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于暂停使用中国银行理财直付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
2	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-29
3	关于博时旗下部分基金参加招商银行申购及定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-06-01
4	博时量化价值股票型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-22
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-04-17
6	博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-03-27
7	博时基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购赎回等业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-28
8	博时量化价值股票型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网	2020-01-17

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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者超过 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	2020-01-01~2020-06-30	200,878,839.88	-	-	200,878,839.88	49.07%
	2	2020-01-01~2020-06-30	100,727,585.22	-	-	100,727,585.22	24.60%
	3	2020-01-01~2020-06-30	100,438,839.88	-	-	100,438,839.88	24.53%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准博时量化价值股票型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时量化价值股票型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日