

博时研究慧选混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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.....	4
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	7
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遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45

7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时研究慧选混合型证券投资基金	
基金简称	博时研究慧选混合	
基金主代码	012153	
交易代码	012153	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 8 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	127,200,440.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
下属分级基金的交易代码	012153	012154
报告期末下属分级基金的份额总额	111,674,031.87 份	15,526,408.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产配置和深度挖掘具备良好成长潜力及合理估值的个股，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过跟踪考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势、外汇占款等）及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，判断经济周期当前所处的位置及未来发展方向，并通过监测重要行业的产能利用与经济景气轮动研究，调整股票资产和固定收益资产的配置比例。本基金的投资策略还包括股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、流通受限证券投资策略、参与融资业务的投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	95105568	95588
传真	0755-83195140	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	江向阳	陈四清

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	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
本期已实现收益	1,671,887.03	175,823.44
本期利润	1,549,124.49	178,025.94
加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0111
本期加权平均净值利润率	1.38%	1.12%
本期基金份额净值增长率	1.33%	1.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
期末可供分配利润	623,331.73	-105,223.50
期末可供分配基金份额利润	0.0056	-0.0068
期末基金资产净值	112,297,363.60	15,421,185.25
期末基金份额净值	1.0056	0.9932
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
基金份额累计净值增长率	0.56%	-0.68%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时研究慧选混合 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	4.05%	0.94%	1.35%	0.61%	2.70%	0.33%
过去三个月	4.54%	0.82%	-2.71%	0.58%	7.25%	0.24%
过去六个月	1.33%	0.82%	0.31%	0.59%	1.02%	0.23%
过去一年	-7.81%	0.85%	-8.04%	0.70%	0.23%	0.15%
自基金合同生效起至今	0.56%	1.09%	-17.11%	0.78%	17.67%	0.31%

博时研究慧选混合 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	3.99%	0.94%	1.35%	0.61%	2.64%	0.33%
过去三个月	4.38%	0.82%	-2.71%	0.58%	7.09%	0.24%
过去六个月	1.03%	0.82%	0.31%	0.59%	0.72%	0.23%
过去一年	-8.37%	0.85%	-8.04%	0.70%	-0.33%	0.15%
自基金合同生效起至今	-0.68%	1.09%	-17.11%	0.78%	16.43%	0.31%

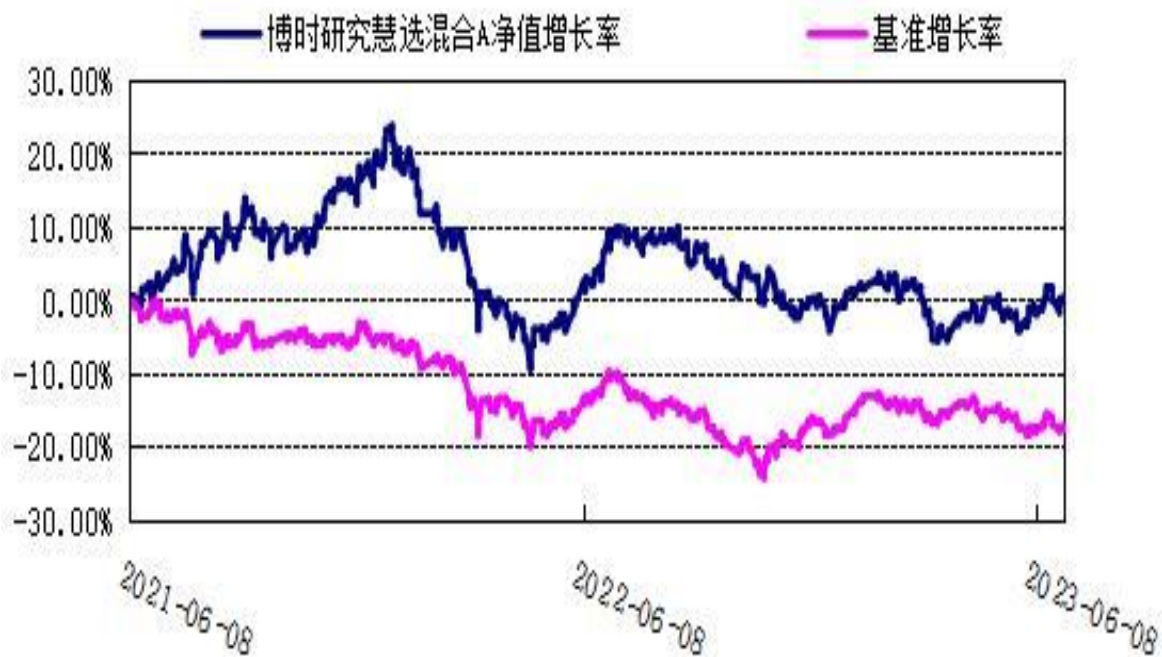
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时研究慧选混合型证券投资基金

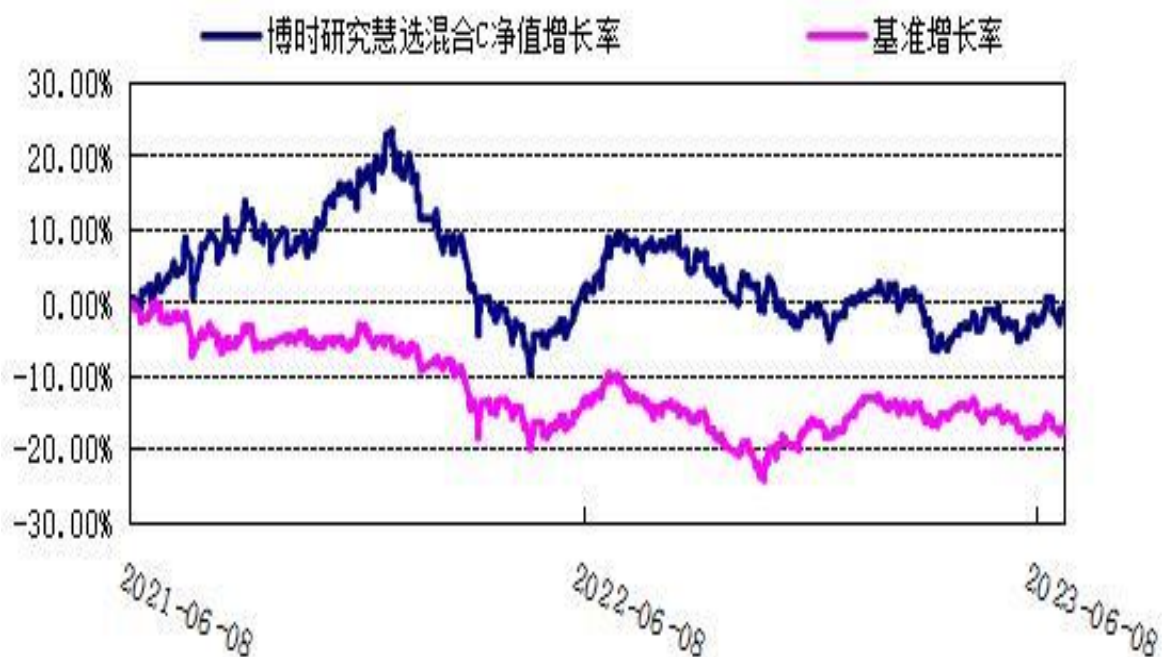
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 6 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日)

博时研究慧选混合 A



博时研究慧选混合 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 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 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。

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		
于玥	基金经理	2022-02-09	2023-02-24	9.9	于玥女士，硕士。2013 年起先后在光大金控资产管理有限公司、中金公司、中金基金工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时研究慧选混合型证券投资基金(2022 年 2 月 9 日-2023 年 2 月 24 日)基金经理。现任博时第三产业成长混合型证券投资基金(2022 年 2 月 9 日-至今)的基金经理。
冀楠	基金经理	2021-11-08	2023-02-24	10.8	冀楠女士，硕士。2012 年起先后在华创证券、泰达宏利基金工作。2021 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时研究慧选混合型证券投资基金(2021 年 11 月 8 日-2023 年 2 月 24 日)基金经理。现任博时精选混合型证券投资基金(2021 年 5 月 18 日-至今)、博时核心资产精选混合型证券投资基金(2021 年 9 月 17 日-至今)、博时厚泽回报灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 11 月 8 日-至今)、博时卓越品牌混合型证券投资基金 (LOF) (2022

					年 7 月 22 日一至今)、博时优质精选混合型证券投资基金(2022 年 8 月 22 日一至今)、博时厚泽匠选一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 4 月 28 日一至今)的基金经理。
吴鹏	基金经理	2023-02-24	-	7.2	吴鹏先生, 硕士。2011 年至 2012 年参加大学生西部计划支教。2016 年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时研究优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2020 年 10 月 28 日一至今)、博时研究慧选混合型证券投资基金(2023 年 2 月 24 日一至今)的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定, 并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产, 为基金持有人谋求最大利益。本报告期内, 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 89 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

2023 年上半年，A 股在经历了年初一波修复后有所走弱，整体上半年表现相对平淡，其中沪深 300 指数下跌-0.75%，上证指数上涨+3.65%，创业板指数下跌-5.61%；香港市场同样表现疲弱，上半年恒生指数下跌-4.37%，恒生中国企业指数下跌-4.18%。具体各行业指数表现分化剧烈，表现较好的板块有通信、传媒、计算机（+27.6%）等，这些行业上半年上涨明显，主要系与 AI 表现相关；而表现较差的行业主要为房地产、美容护理、商贸零售、建筑材料等，这些行业上半年呈现负收益，主要由于房地产等领域经济预期较为悲观。整体上半年经济预期在年初疫情放开后有所修复，后续逐步转弱甚至进一步悲观发酵，对应市场的表现也是年初在顺周期方面有所修复后，市场在 AI、机器人、中特估等板块不停轮动切换。本基金年初因为仓位较低收益表现平平，并在 3 月份经济预期转向仓位调整不够及时回撤明显，而在二季度随着在保险、公用事业、TMT 等领域的布局，收益率有所改善，整体实现了上半年正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0056 元，份额累计净值为 1.0056 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9932 元，份额累计净值为 0.9932 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.33%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.03%，同期业绩基准增长率为 0.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为在二季度经济动能有所减弱的背景下，相关稳经济措施有望加速出台，最新政治局定调已经明确奠定了该基调。后续我们将持续跟踪相关领域政策的推进节奏，并评估其对整体经济及具体领域行业的影响。站在当前时点，我们一方面对于政策所带来的信心修复持相对正向态度，一方面也需客观评估在新经济发展形势下相关领域的固有发展节奏。我们认为经济亘古不变的是周期，而市场总是倾向在相应周期中放大情绪，目前看无论是汇率、债市、股票等都记入了较大幅度的中国经济悲观预期，而部分供给端受限、现金流较好、中长期成长具备确定性的个股已然具备较好投资机会，我们将沿着该思路不断发掘相关投资机会并重点布局。

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公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：博时研究慧选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	10,356,265.84	8,306,299.54
结算备付金		1,301,270.26	2,716,974.72
存出保证金		86,055.28	21,874.78
交易性金融资产	6.4.3.2	113,487,232.06	91,283,536.85
其中：股票投资		113,354,891.41	91,283,536.85
基金投资		-	-
债券投资		132,340.65	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	699,758.17	28,635,001.96
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		3,680,812.67	2,010,996.08
应收股利		105,688.80	-
应收申购款		5,186.28	7,114.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		129,722,269.36	132,981,798.30
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,212,564.40	1,259,082.02
应付赎回款		7,426.74	19,038.79
应付管理人报酬		156,756.95	167,226.98
应付托管费		26,126.15	27,871.17
应付销售服务费		7,614.63	8,340.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	593,230.97	225,527.97
负债合计		2,003,720.51	1,707,087.80
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	127,200,440.62	132,440,027.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	518,108.23	-1,165,316.67
净资产合计		127,718,548.85	131,274,710.50
负债和净资产总计		129,722,269.36	132,981,798.30

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 127,200,440.62 份。其中 A 类基金份额净值 1.0056 元，基金份额总额 111,674,031.87 份；C 类基金份额净值 0.9932 元，基金份额总额 15,526,408.75 份。

6.2 利润表

会计主体：博时研究慧选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,990,334.72	-26,159,313.59
1. 利息收入		106,665.44	221,547.75
其中：存款利息收入	6.4.3.10	37,529.14	41,730.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		69,136.30	179,817.04
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,003,324.83	-10,474,178.74
其中：股票投资收益	6.4.3.11	2,419,301.21	-11,220,004.53
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.3.12	67.49	40.78
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-90,412.47	-
股利收益	6.4.3.15	674,368.60	745,785.01
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-120,560.04	-15,977,328.25
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	904.49	70,645.65
减：二、营业总支出		1,263,184.29	1,681,168.33
1. 管理人报酬		956,562.22	1,294,559.78
2. 托管费		159,427.00	215,759.95
3. 销售服务费		47,213.74	70,493.70
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		0.21	0.16
8. 其他费用	6.4.3.19	99,981.12	100,354.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,727,150.43	-27,840,481.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,727,150.43	-27,840,481.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,727,150.43	-27,840,481.92

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时研究慧选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	132,440,027.17	-	-1,165,316.67	131,274,710.50
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	132,440,027.17	-	-1,165,316.67	131,274,710.50
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-5,239,586.55	-	1,683,424.90	-3,556,161.65
（一）、综合收益总额	-	-	1,727,150.43	1,727,150.43
（二）、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）	-5,239,586.55	-	-43,725.53	-5,283,312.08
其中：1. 基金申购款	2,598,500.48	-	-34,023.49	2,564,476.99
2. 基金赎回款	-7,838,087.03	-	-9,702.04	-7,847,789.07
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	127,200,440.62	-	518,108.23	127,718,548.85
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	178,746,028.37	-	41,632,316.09	220,378,344.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	178,746,028.37	-	41,632,316.09	220,378,344.46
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-28,567,199.70	-	-28,129,180.81	-56,696,380.51
（一）、综合收益总额	-	-	-27,840,481.92	-27,840,481.92
（二）、本期基金份额	-28,567,199.70	-	-288,698.89	-28,855,898.

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				59
其中：1. 基金申购款	29,190,844.71	-	3,930,535.27	33,121,379.98
2. 基金赎回款	-57,758,044.41	-	-4,219,234.16	-61,977,278.57
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	150,178,828.67	-	13,503,135.28	163,681,963.95

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：徐卫，会计机构负责人：侣方方

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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 2023 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	10,356,265.84
等于：本金	10,355,493.22
加：应计利息	772.62
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,356,265.84

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	112,551,573.15	-	113,354,891.41	803,318.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	69.33	132,340.65	17,671.32
	银行间市场	-	-	-
	合计	69.33	132,340.65	17,671.32
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	112,666,173.15	69.33	113,487,232.06	820,989.58

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	699,758.17	-
银行间市场	-	-
合计	699,758.17	-

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.59
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	499,467.23
其中：交易所市场	499,467.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,760.15
合计	593,230.97

6.4.3.8 实收基金

博时研究慧选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	115,842,890.85	115,842,890.85
本期申购	1,701,715.48	1,701,715.48
本期赎回（以“-”号填列）	-5,870,574.46	-5,870,574.46
本期末	111,674,031.87	111,674,031.87

博时研究慧选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	16,597,136.32	16,597,136.32
本期申购	896,785.00	896,785.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,967,512.57	-1,967,512.57
本期末	15,526,408.75	15,526,408.75

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

6.4.3.9 未分配利润
博时研究慧选混合 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	10,558,726.42	-11,443,340.64	-884,614.22
本期利润	1,671,887.03	-122,762.54	1,549,124.49
本期基金份额交易产生的变动数	-326,633.63	285,455.09	-41,178.54
其中：基金申购款	125,590.55	-141,170.13	-15,579.58
基金赎回款	-452,224.18	426,625.22	-25,598.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,903,979.82	-11,280,648.09	623,331.73

博时研究慧选混合 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	1,351,136.96	-1,631,839.41	-280,702.45
本期利润	175,823.44	2,202.50	178,025.94
本期基金份额交易产生的变动数	-72,097.54	69,550.55	-2,546.99
其中：基金申购款	60,733.51	-79,177.42	-18,443.91
基金赎回款	-132,831.05	148,727.97	15,896.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,454,862.86	-1,560,086.36	-105,223.50

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	19,638.92
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	17,514.61
其他	375.61
合计	37,529.14

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	548,721,535.80
减：卖出股票成本总额	544,695,096.06
减：交易费用	1,607,138.53
买卖股票差价收入	2,419,301.21

6.4.3.12 债券投资收益
6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	67.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	67.49

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.3.13 资产支持证券投资收益
6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益
6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-90,412.47

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	674,368.60
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	674,368.60

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-120,560.04
——股票投资	-138,231.36
——债券投资	17,671.32
——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	-120,560.04

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	877.67
基金转换费收入	26.82

合计	904.49
----	--------

6.4.3.18 信用减值损失

无。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	335.61
中债登账户维护费	9,000.00
银行汇划费	1,385.36
合计	99,981.12

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

截至财务报表批准报出日，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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 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	13,374,514.56	1.20%	-	-

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	10,102.33	1.18%	6,721.64	1.35%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
-	-	-	-	-

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	956,562.22
其中：支付销售机构的客户维护费	448,228.32	597,373.60

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	159,427.00	215,759.95

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	合计
中国工商银行	-	21,534.31	21,534.31
博时基金	-	109.80	109.80
招商证券	-	34.04	34.04
合计	-	21,678.15	21,678.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	合计
中国工商银行	-	29,546.62	29,546.62
博时基金	-	529.98	529.98
招商证券	-	72.34	72.34
合计	-	30,148.94	30,148.94

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 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：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.60% / 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
6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

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自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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国工商银行-活期存款	10,356,265.84	19,638.92	13,389,607.77	26,698.90

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	1,674.00	62,323.02
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	40,187.00	579,898.41

招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89
------------	--------	------	------	--------	-----------

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 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（2023 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	受限期	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
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	480.00	5,328.00	8,179.20	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	首次公开发行限售	5.69	5.41	1,332.00	7,579.08	7,206.12	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	23.60	64.67	110.00	2,596.00	7,113.70	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发行限售	9.26	18.59	353.00	3,268.78	6,562.27	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	12.68	22.31	250.00	3,170.00	5,577.50	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	首次公开发行限售	135.80	120.41	46.00	6,246.80	5,538.86	-
68844	智翔	2023-	6 个月	首次	37.88	29.49	182.0	6,894	5,367	-

3	金泰	06-13		公开发 行限 售			0	.16	.18	
68858 2	芯动 联科	2023- 06-21	6 个月	首次公 开发 行限 售	26.74	40.68	123.0 0	3,289 .02	5,003 .64	-
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次公 开发 行限 售	43.67	53.05	89.00	3,886 .63	4,721 .45	-
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次公 开发 行限 售	21.86	23.85	186.0 0	4,065 .96	4,436 .10	-
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次公 开发 行限 售	10.68	12.34	351.0 0	3,748 .68	4,331 .34	-
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次公 开发 行限 售	75.00	90.76	44.00	3,300 .00	3,993 .44	-
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次公 开发 行限 售	21.17	23.50	168.0 0	3,556 .56	3,948 .00	-
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次公 开发 行限 售	14.16	16.21	240.0 0	3,398 .40	3,890 .40	-
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次公 开发 行限 售	11.18	14.59	264.0 0	2,951 .52	3,851 .76	-
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次公 开发 行限 售	20.92	19.16	188.0 0	3,932 .96	3,602 .08	-
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次公 开发 行限 售	25.28	29.87	99.00	2,502 .72	2,957 .13	-
68847	友车	2023-	6 个月	首次	33.99	29.49	92.00	3,127	2,713	-

9	科技	05-04		公开发 行限 售				.08	.08	
60317 2	万丰 股份	2023- 04-28	6 个月	首次 公开发 行限 售	14.58	16.13	86.00	1,253 .88	1,387 .18	-

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

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

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

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

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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过大类资产配置和深度挖掘具备良好成长潜力及合理估值的个股，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2023 年 6 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	132,340.65	-
未评级	-	-
合计	132,340.65	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

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

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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进

行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,356,265.84	-	-	-	10,356,265

					.84
结算备付金	1,301,270.26	-	-	-	1,301,270.26
存出保证金	86,055.28	-	-	-	86,055.28
交易性金融资产	-	-	132,340.65	113,354,891.41	113,487,232.06
应收清算款	-	-	-	3,680,812.67	3,680,812.67
买入返售金融资产	699,758.17	-	-	-	699,758.17
应收申购款	-	-	-	5,186.28	5,186.28
应收股利	-	-	-	105,688.80	105,688.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,443,349.55	-	132,340.65	117,146,579.16	129,722,269.36
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,426.74	7,426.74
应付清算款	-	-	-	1,212,564.40	1,212,564.40
应付管理人报酬	-	-	-	156,756.95	156,756.95
应付托管费	-	-	-	26,126.15	26,126.15
应付销售服务费	-	-	-	7,614.63	7,614.63
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	593,230.97	593,230.97
负债总计	-	-	-	2,003,720.51	2,003,720.51
利率敏感度缺口	12,443,349.55	-	132,340.65	115,142,858.65	127,718,548.85
上年度末					
2022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	8,306,299.54	-	-	-	8,306,299.54
结算备付金	2,716,974.72	-	-	-	2,716,974.72
存出保证金	21,874.78	-	-	-	21,874.78
交易性金融资产	-	-	-	91,283,536.85	91,283,536.85
应收清算款	-	-	-	2,010,996.08	2,010,996.08
买入返售金融资产	28,635,001.96	-	-	-	28,635,001.96

					.96
应收申购款	-	-	-	7,114.37	7,114.37
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,680,151.00	-	-	93,301,647.30	132,981,798.30
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	19,038.79	19,038.79
应付清算款	-	-	-	1,259,082.02	1,259,082.02
应付管理人报酬	-	-	-	167,226.98	167,226.98
应付托管费	-	-	-	27,871.17	27,871.17
应付销售服务费	-	-	-	8,340.87	8,340.87
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	225,527.97	225,527.97
负债总计				1,707,087.80	1,707,087.80
利率敏感度缺口	39,680,151.00	0.00		91,594,559.50	131,274,710.50

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。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	10,752,757.70	10,752,757.70

应收股利	-	105,688.80	105,688.80
资产合计	-	10,858,446.50	10,858,446.50
以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	10,858,446.50	10,858,446.50

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	1. 所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 54	-
	2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 54	-

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	113,354,891 .41	88.75	91,283,536. 85	69.54
交易性金融资产—债券投资	132,340.65	0.10	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	113,487,232 .06	88.86	91,283,536. 85	69.54

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约575	增加约455
	业绩比较基准下降5%	减少约575	减少约455

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	113,396,851.63
第二层次	-
第三层次	90,380.43
合计	113,487,232.06

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	113,354,891.41	87.38
	其中：股票	113,354,891.41	87.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,340.65	0.10
	其中：债券	132,340.65	0.10
	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	699,758.17	0.54
	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	11,657,536.10	8.99
8	其他各项资产	3,877,743.03	2.99
9	合计	129,722,269.36	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 10,752,757.70 元，净值占比 8.42%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,823,805.00	6.91
B	采矿业	9,132,372.00	7.15
C	制造业	65,338,956.78	51.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,559,280.00	2.00
E	建筑业	2,010,074.00	1.57

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,915,869.53	3.85
J	金融业	8,976,206.00	7.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	823,796.40	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	21,774.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	102,602,133.71	80.33

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
电信业务	6,756,601.35	5.29
非日常生活消费品	1,267,722.50	0.99
能源	2,728,433.85	2.14
合计	10,752,757.70	8.42

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	0700	腾讯控股	22,100	6,756,601.35	5.29
2	601899	紫金矿业	574,500	6,532,065.00	5.11
3	0857	中国石油股份	546,000	2,728,433.85	2.14
3	601857	中国石油	348,100	2,600,307.00	2.04
4	000568	泸州老窖	19,800	4,149,486.00	3.25
5	300498	温氏股份	213,800	3,923,230.00	3.07
6	002475	立讯精密	116,800	3,790,160.00	2.97
7	301339	通行宝	149,000	3,744,370.00	2.93
8	688121	卓然股份	92,012	3,441,248.80	2.69
9	601528	瑞丰银行	655,500	3,179,175.00	2.49
10	000858	五粮液	17,900	2,927,903.00	2.29
11	688319	欧林生物	128,423	2,777,789.49	2.17
12	600975	新五丰	289,000	2,762,840.00	2.16
13	000807	云铝股份	213,700	2,720,401.00	2.13

14	688072	拓荆科技	6,138	2,614,603.86	2.05
15	301168	通灵股份	38,800	2,417,240.00	1.89
16	1211	比亚迪股份	5,500	1,267,722.50	0.99
16	002594	比亚迪	4,400	1,136,388.00	0.89
17	600519	贵州茅台	1,400	2,367,400.00	1.85
18	688687	凯因科技	79,444	2,343,598.00	1.83
19	603606	东方电缆	46,300	2,270,089.00	1.78
20	301227	森鹰窗业	80,400	2,229,492.00	1.75
21	603063	禾望电气	70,500	2,167,875.00	1.70
22	603477	巨星农牧	64,100	2,137,735.00	1.67
23	002271	东方雨虹	73,900	2,014,514.00	1.58
24	300855	图南股份	55,600	1,963,792.00	1.54
25	600085	同仁堂	30,000	1,726,800.00	1.35
26	300693	盛弘股份	43,781	1,616,394.52	1.27
27	600522	中天科技	93,100	1,481,221.00	1.16
28	300727	润禾材料	55,400	1,462,560.00	1.15
29	600765	中航重机	50,100	1,328,151.00	1.04
30	601881	中国银河	112,500	1,306,125.00	1.02
31	688186	广大特材	39,098	1,271,857.94	1.00
32	603986	兆易创新	11,800	1,253,750.00	0.98
33	002371	北方华创	3,900	1,238,835.00	0.97
34	300408	三环集团	41,300	1,212,155.00	0.95
35	601688	华泰证券	87,600	1,206,252.00	0.94
36	002840	华统股份	76,300	1,193,332.00	0.93
37	600837	海通证券	128,100	1,181,082.00	0.92
38	001223	欧克科技	12,900	1,173,771.00	0.92
39	688318	财富趋势	11,606	1,160,251.82	0.91
40	605376	博迁新材	36,700	1,151,646.00	0.90
41	601390	中国中铁	147,400	1,117,292.00	0.87
42	600481	双良节能	79,600	1,112,808.00	0.87
43	301278	快可电子	17,000	1,105,000.00	0.87
44	600803	新奥股份	52,100	988,858.00	0.77
45	001219	青岛食品	53,950	984,048.00	0.77
46	300033	同花顺	5,600	981,568.00	0.77
47	600452	涪陵电力	41,700	887,376.00	0.69
48	688439	振华风光	7,693	844,845.26	0.66
49	002311	海大集团	17,900	838,436.00	0.66
50	603518	锦泓集团	73,200	830,820.00	0.65
51	000690	宝新能源	97,300	683,046.00	0.53
52	600426	华鲁恒升	21,883	670,276.29	0.52
53	600958	东方证券	61,300	594,610.00	0.47
54	002236	大华股份	30,100	594,475.00	0.47
55	002941	新疆交建	38,400	594,432.00	0.47

56	688036	传音控股	3,997	587,559.00	0.46
57	301115	建科股份	23,700	541,782.00	0.42
58	601601	中国太保	20,300	527,394.00	0.41
59	600970	中材国际	23,400	298,350.00	0.23
60	300416	苏试试验	12,900	278,124.00	0.22
61	688332	中科蓝讯	2,367	198,070.56	0.16
62	688582	芯动联科	1,227	56,726.04	0.04
63	000888	峨眉山 A	1,900	21,774.00	0.02
64	688472	阿特斯	480	8,179.20	0.01
65	688469	中芯集成	1,332	7,206.12	0.01
66	688361	中科飞测	110	7,113.70	0.01
67	688629	华丰科技	353	6,562.27	0.01
68	688562	航天软件	250	5,577.50	0.00
69	688576	西山科技	46	5,538.86	0.00
70	688443	智翔金泰	182	5,367.18	0.00
71	688543	国科军工	89	4,721.45	0.00
72	688523	航天环宇	186	4,436.10	0.00
73	688620	安凯微	351	4,331.34	0.00
74	688458	美芯晟	44	3,993.44	0.00
75	688552	航天南湖	168	3,948.00	0.00
76	688334	西高院	240	3,890.40	0.00
77	688593	新相微	264	3,851.76	0.00
78	688512	慧智微	188	3,602.08	0.00
79	301101	明月镜片	78	3,200.34	0.00
80	688631	莱斯信息	99	2,957.13	0.00
81	688479	友车科技	92	2,713.08	0.00
82	603172	万丰股份	86	1,387.18	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	0700	腾讯控股	10,535,775.21	8.03
2	600426	华鲁恒升	10,082,427.00	7.68
3	601857	中国石油	9,899,937.00	7.54
4	601899	紫金矿业	9,657,007.47	7.36
5	601318	中国平安	8,849,374.84	6.74
6	002271	东方雨虹	8,722,321.00	6.64
7	600703	三安光电	8,688,210.22	6.62
8	601528	瑞丰银行	8,164,420.10	6.22
9	300059	东方财富	7,739,231.80	5.90

10	301153	中科江南	6,679,516.60	5.09
11	688186	广大特材	6,604,261.71	5.03
12	603063	禾望电气	6,340,939.00	4.83
13	0388	香港交易所	6,295,698.93	4.80
14	000690	宝新能源	6,161,103.00	4.69
15	300033	同花顺	5,853,648.00	4.46
16	603191	望变电气	5,489,849.00	4.18
17	002922	伊戈尔	5,452,503.91	4.15
18	001223	欧克科技	5,169,698.00	3.94
19	601128	常熟银行	5,042,892.00	3.84
20	301339	通行宝	4,842,219.00	3.69
21	300693	盛弘股份	4,816,512.08	3.67
22	601601	中国太保	4,761,332.00	3.63
23	300498	温氏股份	4,757,445.70	3.62
24	688318	财富趋势	4,674,309.50	3.56
25	000933	神火股份	4,413,020.16	3.36
26	601838	成都银行	4,396,698.00	3.35
27	688121	卓然股份	4,382,727.21	3.34
28	688687	凯因科技	4,367,813.30	3.33
29	0857	中国石油股份	4,112,893.10	3.13
30	600085	同仁堂	4,103,770.00	3.13
31	002475	立讯精密	4,087,561.00	3.11
32	601688	华泰证券	4,006,533.48	3.05
33	601677	明泰铝业	3,996,213.00	3.04
34	603260	合盛硅业	3,986,240.00	3.04
35	601658	邮储银行	3,886,754.00	2.96
36	600027	华电国际	3,874,703.84	2.95
37	600958	东方证券	3,846,096.00	2.93
38	600837	海通证券	3,751,199.00	2.86
39	603606	东方电缆	3,747,745.00	2.85
40	601628	中国人寿	3,743,137.58	2.85
41	1368	特步国际	3,665,746.30	2.79
42	002895	川恒股份	3,651,770.00	2.78
43	2601	中国太保	3,646,096.43	2.78
44	000807	云铝股份	3,616,598.00	2.75
45	688596	正帆科技	3,562,200.57	2.71
46	688590	新致软件	3,543,572.94	2.70
47	688319	欧林生物	3,512,442.00	2.68
48	300129	泰胜风能	3,495,153.00	2.66
49	000935	四川双马	3,444,905.00	2.62
50	603163	圣晖集成	3,390,523.00	2.58
51	600000	浦发银行	3,367,747.00	2.57
52	600522	中天科技	3,355,323.95	2.56

53	601818	光大银行	3,336,352.00	2.54
54	000617	中油资本	3,276,546.00	2.50
55	1024	快手-W	3,256,257.29	2.48
56	300750	宁德时代	3,212,796.00	2.45
57	002230	科大讯飞	3,169,947.00	2.41
58	601328	交通银行	3,158,640.00	2.41
59	300408	三环集团	3,155,751.00	2.40
60	002941	新疆交建	3,147,113.00	2.40
61	002182	云海金属	3,141,342.00	2.39
62	600765	中航重机	3,102,681.00	2.36
63	000858	五粮液	3,072,000.00	2.34
64	688072	拓荆科技	3,067,291.37	2.34
65	600109	国金证券	2,998,361.00	2.28
66	603995	甬金股份	2,998,127.00	2.28
67	9966	康宁杰瑞制药-B	2,996,050.73	2.28
68	605305	中际联合	2,911,190.80	2.22
69	600452	涪陵电力	2,866,140.00	2.18
70	002532	天山铝业	2,728,402.00	2.08
71	300842	帝科股份	2,690,665.00	2.05
72	600975	新五丰	2,686,083.00	2.05

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

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	600519	贵州茅台	10,651,052.00	8.11
2	301101	明月镜片	9,954,853.00	7.58
3	600426	华鲁恒升	9,168,890.33	6.98
4	601318	中国平安	9,130,487.00	6.96
5	600703	三安光电	8,574,739.00	6.53
6	601857	中国石油	8,354,455.00	6.36
7	603688	石英股份	7,939,966.00	6.05
8	300059	东方财富	7,393,691.60	5.63
9	301153	中科江南	7,159,903.13	5.45
10	002271	东方雨虹	6,652,973.00	5.07
11	688186	广大特材	6,385,572.21	4.86
12	0388	香港交易所	6,303,711.13	4.80
13	000690	宝新能源	5,811,122.00	4.43
14	002922	伊戈尔	5,302,354.00	4.04
15	300750	宁德时代	5,144,557.20	3.92

16	300033	同花顺	5,028,460.00	3.83
17	601128	常熟银行	5,018,548.00	3.82
18	601528	瑞丰银行	4,781,738.00	3.64
19	601601	中国太保	4,757,498.00	3.62
20	603191	望变电气	4,633,026.00	3.53
21	600765	中航重机	4,591,301.00	3.50
22	300856	科思股份	4,488,194.50	3.42
23	300034	钢研高纳	4,462,809.00	3.40
24	300129	泰胜风能	4,389,012.00	3.34
25	600027	华电国际	4,380,991.00	3.34
26	002594	比亚迪	4,253,281.00	3.24
27	601838	成都银行	4,216,224.00	3.21
28	000933	神火股份	4,213,478.00	3.21
29	301073	君亭酒店	4,086,311.00	3.11
30	2601	中国太保	4,050,264.03	3.09
31	688596	正帆科技	4,023,159.11	3.06
32	601677	明泰铝业	4,021,556.00	3.06
33	001223	欧克科技	3,980,715.00	3.03
34	601628	中国人寿	3,979,366.00	3.03
35	603063	禾望电气	3,938,561.00	3.00
36	601225	陕西煤业	3,923,163.00	2.99
37	603260	合盛硅业	3,868,812.00	2.95
38	603163	圣晖集成	3,833,268.00	2.92
39	688318	财富趋势	3,832,306.56	2.92
40	601658	邮储银行	3,709,299.00	2.83
41	0700	腾讯控股	3,571,740.87	2.72
42	1024	快手-W	3,540,937.87	2.70
43	601888	中国中免	3,529,414.00	2.69
44	000935	四川双马	3,507,348.00	2.67
45	688590	新致软件	3,415,314.88	2.60
46	601689	拓普集团	3,399,842.00	2.59
47	002230	科大讯飞	3,392,549.00	2.58
48	600000	浦发银行	3,275,602.00	2.50
49	605305	中际联合	3,256,725.20	2.48
50	603606	东方电缆	3,250,179.00	2.48
51	603995	甬金股份	3,240,170.00	2.47
52	600958	东方证券	3,226,488.00	2.46
53	1368	特步国际	3,225,089.05	2.46
54	000617	中油资本	3,174,579.00	2.42
55	2015	理想汽车-W	3,154,054.48	2.40
56	601818	光大银行	3,120,889.00	2.38
57	002182	云海金属	3,089,407.00	2.35
58	002895	川恒股份	3,029,433.00	2.31

59	601328	交通银行	3,017,361.00	2.30
60	300693	盛弘股份	2,941,544.75	2.24
61	600109	国金证券	2,924,121.00	2.23
62	002050	三花智控	2,910,501.15	2.22
63	002532	天山铝业	2,879,548.00	2.19
64	002371	北方华创	2,846,072.13	2.17
65	9966	康宁杰瑞制药-B	2,834,697.22	2.16
66	601688	华泰证券	2,802,336.00	2.13
67	600028	中国石化	2,757,402.00	2.10
68	0390	中国中铁	2,738,725.05	2.09
69	1138	中远海能	2,686,532.47	2.05
70	600837	海通证券	2,638,494.00	2.01
71	688072	拓荆科技	2,633,629.76	2.01

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	566,904,681.98
卖出股票的收入（成交）总额	548,721,535.80

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）	132,340.65	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,340.65	0.10

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	123186	志特转债	1,146	132,340.65	0.10

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 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

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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	86,055.28
2	应收清算款	3,680,812.67
3	应收股利	105,688.80
4	应收利息	-

5	应收申购款	5,186.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,877,743.03

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
博时研究慧选混合 A	2,314	48,260.17	98.14	0.00%	111,673,933.73	100.00%
博时研究慧选混合 C	1,348	11,518.11	99.30	0.00%	15,526,309.45	100.00%
合计	3,568	35,650.35	197.44	0.00%	127,200,243.18	100.00%

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	博时研究慧选混合 A	-	-
	博时研究慧选混合 C	15.02	0.00%
	合计	15.02	0.00%

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

- 1、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基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 8 日）基金份额总额	761,215,820.05	37,635,981.42
本报告期期初基金份额总额	115,842,890.85	16,597,136.32
本报告期基金总申购份额	1,701,715.48	896,785.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,870,574.46	1,967,512.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	111,674,031.87	15,526,408.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

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

基金管理人于 2023 年 2 月 18 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》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 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》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，聘请普华永道中天会计师事务所（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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	2,535,539.32	0.23%	1,854.47	0.22%	-
山西证券	1	35,357,487.39	3.17%	25,857.22	3.02%	增加 1 个
宏信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	55,011,910.18	4.94%	51,232.90	5.97%	增加 1 个
东方证券	1	66,537,860.96	5.97%	48,658.12	5.67%	-
中信证券	1	77,963,955.34	7.00%	69,852.34	8.14%	-
开源证券	2	110,698,139.79	9.93%	80,956.08	9.44%	-
华西证券	2	110,806,063.61	9.94%	81,030.16	9.45%	-
南京证券	1	90,717.16	0.01%	66.35	0.01%	增加 1 个
国元证券	1	141,938,210.97	12.74%	132,187.18	15.41%	增加 1 个
招商证券	3	13,374,514.56	1.20%	10,102.33	1.18%	增加 1 个
安信证券	1	72,276,772.11	6.48%	67,310.57	7.85%	-
国联证券	1	44,989,534.50	4.04%	32,899.99	3.84%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	220,319,292.57	19.77%	115,973.43	13.52%	增加 1 个
中金公司	2	75,142,143.69	6.74%	69,979.68	8.16%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	76,127,464.74	6.83%	59,063.73	6.89%	增加 1 个
中泰证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	11,368,219.60	1.02%	10,587.33	1.23%	-

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，我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
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	94,758,000.00	16.15%	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	39,333,000.00	6.70%	-	-
东方证券	-	-	37,894,000.00	6.46%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	36,186,000.00	6.17%	-	-
华西证券	-	-	39,670,000.00	6.76%	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	40,101,000.00	6.84%	-	-
国联证券	-	-	15,257,000.00	2.60%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	239,429,000.00	40.81%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	44,012,000.00	7.50%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时研究慧选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
4	博时研究慧选混合型证券投资基金 2022 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站	2023-03-30
5	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 A) 基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-25
6	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 C) 基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-25
7	博时研究慧选混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-24
8	博时基金管理有限公司关于博时研究慧选混合型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-24
9	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
10	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13

11	博时研究慧选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§ 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

无。

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

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时研究慧选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时研究慧选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时研究慧选混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时研究慧选混合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询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日