

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

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：浙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。

基金托管人浙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合规守信情况的说明.....	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.....	9
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合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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.....	11
§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	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54

7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时智选量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	博时智选量化多因子股票	
基金主代码	013465	
交易代码	013465	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 2 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	352,702,770.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
下属分级基金的交易代码	013465	013466
报告期末下属分级基金的份额总额	63,669,992.84 份	289,032,777.27 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金。投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，大类资产配置策略主要是通过通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。其次，股票投资策略以“量化投资”为主要投资策略，通过多因子模型进行股票选择并构建股票投资组合。其他资产投资策略包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、流通受限证券投资策略、参与融资业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*90%+中债综合财富（总值）指数收益率*5%+活期存款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	朱巍
	联系电话	0755-83169999	0571-87659806
	电子邮箱	service@bosera.com	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		95105568	95527

传真	0755-83195140	0571-88268688
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	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码	518040	310006
法定代表人	江向阳	陆建强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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）	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
本期已实现收益	2,128,833.56	7,679,995.72
本期利润	4,873,344.37	16,362,539.03
加权平均基金份额本期利润	0.0715	0.0574
本期加权平均净值利润率	7.55%	6.11%
本期基金份额净值增长率	7.83%	7.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
期末可供分配利润	-3,067,058.32	-16,183,962.83
期末可供分配基金份额利润	-0.0482	-0.0560
期末基金资产净值	60,778,201.74	273,618,049.57
期末基金份额净值	0.9546	0.9467

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
基金份额累计净值增长率	-4.54%	-5.33%

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

博时智选量化多因子股票 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	1.97%	0.95%	0.59%	0.94%	1.38%	0.01%
过去三个月	0.55%	0.86%	-3.48%	0.83%	4.03%	0.03%
过去六个月	7.83%	0.82%	4.77%	0.80%	3.06%	0.02%
过去一年	-2.46%	1.05%	-4.74%	0.99%	2.28%	0.06%
自基金合同生效起至今	-4.54%	1.24%	-9.71%	1.23%	5.17%	0.01%

博时智选量化多因子股票 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	1.93%	0.95%	0.59%	0.94%	1.34%	0.01%
过去三个月	0.42%	0.86%	-3.48%	0.83%	3.90%	0.03%
过去六个月	7.57%	0.82%	4.77%	0.80%	2.80%	0.02%
过去一年	-2.95%	1.05%	-4.74%	0.99%	1.79%	0.06%
自基金合同生效起至今	-5.33%	1.24%	-9.71%	1.23%	4.38%	0.01%

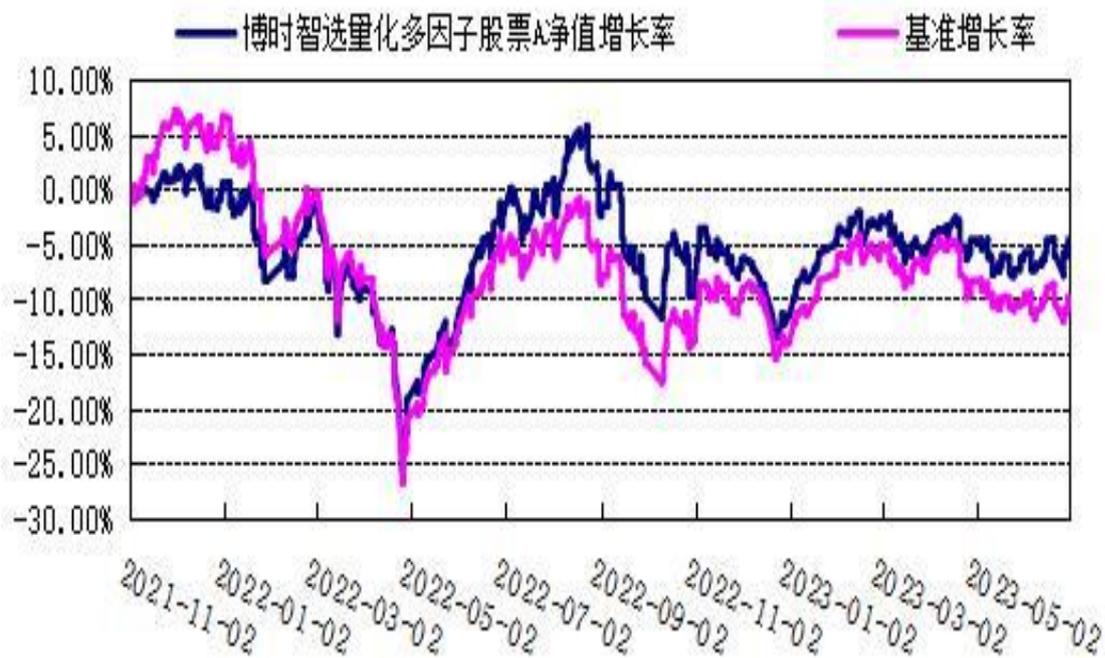
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

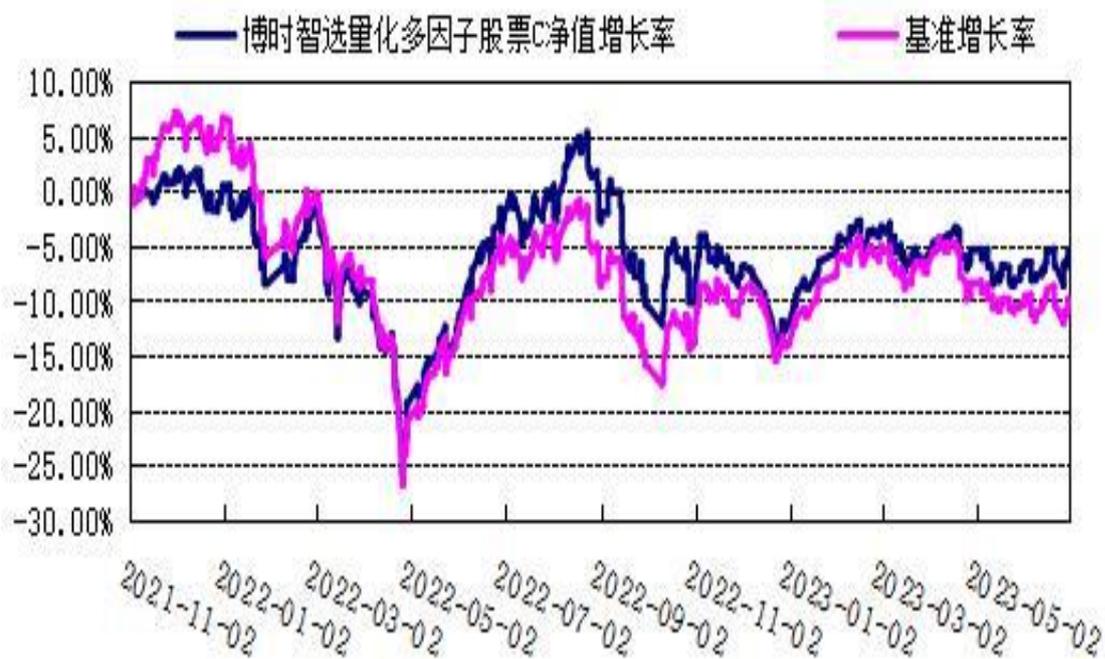
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月2日至2023年6月30日)

博时智选量化多因子股票 A



博时智选量化多因子股票 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 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		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2021-11-02	-	16.8	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日一至今)、博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日一至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日一至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日一至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日一至今)的基金经理。
刘玉强	基金经理助理	2021-11-08	2023-02-06	7.9	刘玉强先生，硕士。2015 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。曾任研究员、基金经理助理。现任博时专精特新主题混合型证券投资基金

					(2023 年 2 月 1 日—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，人工智能和中特估是市场关注的热点，冲高回落的态势进一步印证了 A 股整体上的宽幅震荡趋势；“结构化”和“反转”则是行情演绎的另两个特征。在这一背景下，A 股各行业赛道之间的差异较大，之前一年表现不佳的计算机、传媒、通讯、电子等人工智能相关行业和央企主题在 2023 年上半年仍然是整体上行；而消费者服务、食品饮料、房地产和 2021 年风光无限的电力设备及新能源等行业则为负收益。资金场内博弈的态势得以延续，“反转”特征也将继续延续。

从因子角度来看，上半年价值类因子维持上升通道；成长、分析师等因子则整体上呈现下跌趋势，并有所企稳；风险因子中的小市值等因子十分突出，延续了去年下半年以来的强趋势。

不过即便市场多有变化，本基金仍然坚持了相对稳定且偏长期的因子配置逻辑：以业绩基准指

数中证 1000 指数为锚，不做仓位择时，只追求超额收益；在因子的配置上，坚持成长、分析师、价值、动量、反转等因子的协同互补，坚持模型逻辑的合理性和一致性；控制跟踪误差，限制市值敞口的一定偏离，略有放松对行业偏离的限制。在风险因子上，本基金适当控制了小市值因子的风险敞口，虽然在一定程度上影响了超额收益，但对整个基金净值跟踪误差的降低大有裨益。

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 0.9546 元，份额累计净值为 0.9546 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9467 元，份额累计净值为 0.9467 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 7.83%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 7.57%，同期业绩基准增长率为 4.77%。

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，宏观层面，A 股大结构见底的概率日益增强。近日召开的政治局会议在分析研究当前经济形势时作出了明确判断。疫情防控平稳转段后，我国经济逐步向常态化运行轨道回归，综合优势仍然突出，作为世界第二大经济体、第二大消费市场、制造业第一大国、货物贸易第一大国、服务贸易第二大国、外汇储备第一大国的地位继续巩固，为我们抵御各种风险挑战、跃上更高发展台阶筑牢了基石。随着宏观调控的继续开展，A 股从底部回升的概率日益增强。

在行业主题层面，本基金特别关注央企类相关主题：其业绩增速稳定、估值相对较低、机构资金不拥挤，有可能成为下半年资金的重点关注对象。

在因子层面，随着市场炒作热度的降温，上市公司的股价终将回归基本面：相对景气的行业、有扎实的业绩增长的公司将会表现略好。因此，成长、分析师等因子迟早将回归上升通道。

本基金将继续坚持量化多因子模型的框架，紧扣长期表现稳定、逻辑清晰的因子，坚持控制基金与业绩基准中证 1000 指数的跟踪误差，适当暴露一定的行业偏离，根据模型结果配置股票组合，争取获得一定的超额收益。

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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时智选量化多因子股票型证券投资基金 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复核，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：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

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	13,067,522.37	4,025,130.53
结算备付金		6,700,094.00	15,982,642.71
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	314,193,313.44	273,950,011.82
其中：股票投资		314,193,313.44	273,950,011.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,939,710.19	69,995.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		335,900,640.00	294,027,780.73
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		-	-
应付赎回款		693,731.77	565,795.48
应付管理人报酬		438,675.44	396,475.17
应付托管费		87,735.09	79,295.02

应付销售服务费		121,521.37	102,436.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	162,725.02	40,113.06
负债合计		1,504,388.69	1,184,115.70
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	352,702,770.11	332,278,363.14
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	-18,306,518.80	-39,434,698.11
净资产合计		334,396,251.31	292,843,665.03
负债和净资产总计		335,900,640.00	294,027,780.73

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 352,702,770.11 份。其中 A 类基金份额净值 0.9546 元，基金份额总额 63,669,992.84 份；C 类基金份额净值 0.9467 元，基金份额总额 289,032,777.27 份。

6.2 利润表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

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		24,918,988.24	-16,450,586.13
1. 利息收入		60,140.90	60,823.17
其中：存款利息收入	6.4.3.10	57,576.52	60,823.17
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		2,564.38	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,133,687.77	-49,597,511.68
其中：股票投资收益	6.4.3.11	9,664,730.37	-52,283,460.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	97,378.32
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	-8,039.78	-286,706.01
股利收益	6.4.3.15	3,476,997.18	2,875,276.28
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	11,427,054.12	33,015,093.52
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	298,105.45	71,008.86
减：二、营业总支出		3,683,104.84	4,536,249.87
1. 管理人报酬		2,454,537.93	2,944,120.57
2. 托管费		490,907.55	588,824.08
3. 销售服务费		658,105.57	918,920.86
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		10.63	81.80
8. 其他费用	6.4.3.19	79,543.16	84,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,235,883.40	-20,986,836.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,235,883.40	-20,986,836.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,235,883.40	-20,986,836.00

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

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）	332,278,363.14	-	-39,434,698.11	292,843,665.03
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）	332,278,363.14	-	-39,434,698.11	292,843,665.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	20,424,406.97	-	21,128,179.31	41,552,586.28

(一)、综合收益总额	-	-	21,235,883.40	21,235,883.40
(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)	20,424,406.97	-	-107,704.09	20,316,702.88
其中: 1. 基金申购款	244,822,110.78	-	-14,393,118.84	230,428,991.94
2. 基金赎回款	-224,397,703.81	-	14,285,414.75	-210,112,289.06
(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)	352,702,770.11	-	-18,306,518.80	334,396,251.31
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)	473,529,308.34	-	2,740,772.34	476,270,080.68
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)	473,529,308.34	-	2,740,772.34	476,270,080.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-65,934,996.58	-	-12,659,936.24	-78,594,932.82
(一)、综合收益总额	-	-	-20,986,836.00	-20,986,836.00
(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)	-65,934,996.58	-	8,326,899.76	-57,608,096.82
其中: 1. 基金申购款	63,449,508.45	-	-5,319,579.13	58,129,929.32
2. 基金赎回款	-129,384,505.03	-	13,646,478.89	-115,738,026.14

				. 14
(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）	407,594,311.76	-	-9,919,163.90	397,675,147.86

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

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；

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，以利息及利息性质的收入为销售额；

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	13,067,522.37
等于：本金	13,066,943.38
加：应计利息	578.99
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	13,067,522.37

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	314,080,835.44	-	314,193,313.44	112,478.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-
交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		314,080,835.44	-	314,193,313.44	112,478.00

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

无余额。

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	1.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-

应付利息	-
其他应付款	43,380.00
预提费用	119,343.16
合计	162,725.02

6.4.3.8 实收基金

博时智选量化多因子股票 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	75,813,359.90	75,813,359.90
本期申购	18,513,687.30	18,513,687.30
本期赎回（以“-”号填列）	-30,657,054.36	-30,657,054.36
本期末	63,669,992.84	63,669,992.84

博时智选量化多因子股票 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	256,465,003.24	256,465,003.24
本期申购	226,308,423.48	226,308,423.48
本期赎回（以“-”号填列）	-193,740,649.45	-193,740,649.45
本期末	289,032,777.27	289,032,777.27

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

博时智选量化多因子股票 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	-5,997,832.92	-2,696,874.46	-8,694,707.38
本期利润	2,128,833.56	2,744,510.81	4,873,344.37
本期基金份额交易产生的变动数	801,941.04	127,630.87	929,571.91
其中：基金申购款	-1,033,438.92	126,560.07	-906,878.85
基金赎回款	1,835,379.96	1,070.80	1,836,450.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,067,058.32	175,267.22	-2,891,791.10

博时智选量化多因子股票 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	-21,650,451.96	-9,089,538.77	-30,739,990.73

本期利润	7,679,995.72	8,682,543.31	16,362,539.03
本期基金份额交易产生的变动数	-2,213,506.59	1,176,230.59	-1,037,276.00
其中：基金申购款	-14,291,648.56	805,408.57	-13,486,239.99
基金赎回款	12,078,141.97	370,822.02	12,448,963.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,183,962.83	769,235.13	-15,414,727.70

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	22,026.27
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	35,550.25
其他	-
合计	57,576.52

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	1,445,875,559.22
减：卖出股票成本总额	1,432,414,129.08
减：交易费用	3,796,699.77
买卖股票差价收入	9,664,730.37

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

无发生额。

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	-8,039.78

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	3,476,997.18
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	3,476,997.18

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	11,427,054.12
——股票投资	11,427,054.12
——债券投资	-
——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	11,427,054.12

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	294,662.02
基金转换费收入	3,443.43
合计	298,105.45

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	200.00
合计	79,543.16

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
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	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

无。

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	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管理费	2,454,537.93	2,944,120.57
其中：支付销售机构的客户维护费	500,442.77	631,147.96

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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	490,907.55	588,824.08

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

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		
	博时智选量化多 因子股票 A	博时智选量化多因子 股票 C	合计
博时基金	-	39,692.63	39,692.63
浙商银行	-	28,538.68	28,538.68
合计	-	68,231.31	68,231.31
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		
	博时智选量化多 因子股票 A	博时智选量化多因子 股票 C	合计
浙商银行	-	42,794.65	42,794.65
博时基金	-	390.20	390.20
招商证券	-	283.45	283.45
合计	-	43,468.30	43,468.30

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 0.50% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

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
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 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
浙商银行-活期存款	13,067,522.37	22,026.27	10,229,667.86	13,506.71

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
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	4,179.00	105,519.75
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	3,603.00	134,139.69
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
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,559.00	121,634.12	121,634.12	-
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	1,735.00	100,040.10	100,040.10	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	4,612.00	92,193.88	92,193.88	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7 个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	1,851.00	36,760.86	33,429.06	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开	11.10	17.04	1,280.00	14,208.00	21,811.20	-

				发行 限售							
30130 1	川宁 生物	2022- 12-20	6 个月	首次 公开发 行 限售	5.00	8.96	2,337 .00	11,68 5.00	20,93 9.52	-	
30129 3	三博 脑科	2023- 04-25	6 个月	首次 公开发 行 限售	29.60	71.42	293.0 0	8,672 .80	20,92 6.06	-	
68844 3	智翔 金泰	2023- 06-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	37.88	29.49	607.0 0	22,99 3.16	17,90 0.43	-	
68836 1	中科 飞测	2023- 05-12	6 个月	首次 公开发 行 限售	23.60	64.67	276.0 0	6,513 .60	17,84 8.92	-	
68846 9	中芯 集成	2023- 04-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	5.69	5.41	3,292 .00	18,73 1.48	17,80 9.72	-	
30132 5	曼恩 斯特	2023- 05-04	6 个月	首次 公开发 行 限售	76.80	107.9 5	164.0 0	12,59 5.20	17,70 3.80	-	
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次 公开发 行 限售	43.67	53.05	287.0 0	12,53 3.29	15,22 5.35	-	
68847 8	晶升 股份	2023- 04-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	32.52	42.37	346.0 0	11,25 1.92	14,66 0.02	-	
30135 8	湖南 裕能	2023- 02-01	6 个月	首次 公开发 行 限售	23.77	42.89	340.0 0	8,081 .80	14,58 2.60	-	
30141 9	阿莱 德	2023- 02-02	6 个月	首次 公开发 行 限售	24.80	43.85	330.0 0	8,184 .00	14,47 0.50	-	
68857 6	西山 科技	2023- 05-30	6 个月	首次 公开	135.8 0	120.4 1	120.0 0	16,29 6.00	14,44 9.20	-	

				发行 限售							
30129 1	明阳 电气	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	38.13	31.03	459.0 0	17,50 1.67	14,24 2.77	-	
68856 2	航天 软件	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	12.68	22.31	616.0 0	7,810 .88	13,74 2.96	-	
68858 2	芯动 联科	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.74	40.68	334.0 0	8,931 .16	13,58 7.12	-	
30139 5	仁信 新材	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.68	26.68	507.0 0	13,52 6.76	13,52 6.76	-	
30132 0	豪江 智能	2023- 06-01	6 个月	首次 公开 发行 限售	13.06	20.62	642.0 0	8,384 .52	13,23 8.04	-	
68862 9	华丰 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	9.26	18.59	708.0 0	6,556 .08	13,16 1.72	-	
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	10.68	12.34	1,016 .00	10,85 0.88	12,53 7.44	-	
30130 7	美利 信	2023- 04-14	6 个月	首次 公开 发行 限售	32.34	31.86	376.0 0	12,15 9.84	11,97 9.36	-	
30136 0	荣旗 科技	2023- 04-17	6 个月	首次 公开 发行 限售	71.88	92.60	128.0 0	9,200 .64	11,85 2.80	-	
68848 4	南芯 科技	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.99	36.71	321.0 0	12,83 6.79	11,78 3.91	-	
30121 0	金杨 股份	2023- 06-21	6 个月	首次 公开	57.88	49.17	239.0 0	13,83 3.32	11,75 1.63	-	

				发行 限售							
68814 6	中船 特气	2023- 04-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	36.15	38.13	303.0 0	10,95 3.45	11,55 3.39	-	
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.86	23.85	472.0 0	10,31 7.92	11,25 7.20	-	
30148 6	致尚 科技	2023- 06-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	57.66	57.66	193.0 0	11,12 8.38	11,12 8.38	-	
30140 8	华人 健康	2023- 02-22	6 个月	首次 公开 发行 限售	16.24	16.95	655.0 0	10,63 7.20	11,10 2.25	-	
68853 1	日联 科技	2023- 03-24	6 个月	首次 公开 发行 限售	152.3 8	135.9 7	81.00	12,34 2.78	11,01 3.57	-	
30138 3	天键 股份	2023- 05-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	46.16	35.72	302.0 0	13,94 0.32	10,78 7.44	-	
30130 3	真兰 仪表	2023- 02-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.80	22.32	482.0 0	12,91 7.60	10,75 8.24	-	
30148 8	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.78	39.78	262.0 0	10,42 2.36	10,42 2.36	-	
30138 2	蜂助 手	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.80	32.84	317.0 0	7,544 .60	10,41 0.28	-	
30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	19.99	513.0 0	10,25 4.87	10,25 4.87	-	
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次 公开	14.16	16.21	632.0 0	8,949 .12	10,24 4.72	-	

				发行 限售							
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.18	14.59	695.0 0	7,770 .10	10,14 0.05	-	
30124 6	宏源 药业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	50.00	30.71	329.0 0	16,45 0.00	10,10 3.59	-	
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	75.00	90.76	111.0 0	8,325 .00	10,07 4.36	-	
68835 2	颀中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	12.10	12.07	795.0 0	9,619 .50	9,595 .65	-	
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.17	23.50	403.0 0	8,531 .51	9,470 .50	-	
30135 5	南王 科技	2023- 06-02	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.55	16.75	563.0 0	9,880 .65	9,430 .25	-	
00128 7	中电 港	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.88	21.02	440.0 0	5,227 .20	9,248 .80	-	
68858 1	安杰 思	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	125.8 0	118.0 3	75.00	9,435 .00	8,852 .25	-	
30117 0	锡南 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	34.00	34.93	250.0 0	8,500 .00	8,732 .50	-	
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	20.92	19.16	455.0 0	9,518 .60	8,717 .80	-	
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次 公开	26.66	31.50	269.0 0	7,171 .54	8,473 .50	-	

				发行 限售							
30114 1	中科 磁业	2023- 03-27	6 个月	首次 公开发 行 限售	41.20	42.69	198.0 0	8,157 .60	8,452 .62	-	
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.28	29.87	282.0 0	7,128 .96	8,423 .34	-	
30133 2	德尔 玛	2023- 05-09	6 个月	首次 公开发 行 限售	14.81	13.73	613.0 0	9,078 .53	8,416 .49	-	
30137 3	凌玮 科技	2023- 01-20	6 个月	首次 公开发 行 限售	33.73	31.85	263.0 0	8,870 .99	8,376 .55	-	
68853 5	华海 诚科	2023- 03-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	35.00	51.23	161.0 0	5,635 .00	8,248 .03	-	
30130 5	朗坤 环境	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.25	19.69	418.0 0	10,55 4.50	8,230 .42	-	
30123 2	飞沃 科技	2023- 06-08	6 个月	首次 公开发 行 限售	72.50	58.42	140.0 0	10,15 0.00	8,178 .80	-	
30135 7	北方 长龙	2023- 04-11	6 个月	首次 公开发 行 限售	50.00	48.39	165.0 0	8,250 .00	7,984 .35	-	
30129 5	美硕 科技	2023- 06-19	6 个月	首次 公开发 行 限售	37.40	36.07	215.0 0	8,041 .00	7,755 .05	-	
30132 3	新莱 福	2023- 05-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	39.06	39.36	197.0 0	7,694 .82	7,753 .92	-	
30132 2	绿通 科技	2023- 02-27	6 个月	首次 公开	87.71	53.24	142.0 0	12,45 5.45	7,560 .08	-	

				发行 限售							
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	36.90	36.90	198.0 0	7,306 .20	7,306 .20	-	
30142 8	世纪 恒通	2023- 05-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.35	30.60	229.0 0	6,034 .15	7,007 .40	-	
68847 9	友车 科技	2023- 05-04	6 个月	首次 公开发 行 限售	33.99	29.49	227.0 0	7,715 .73	6,694 .23	-	
30120 3	国泰 环保	2023- 03-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	46.13	34.40	191.0 0	8,810 .83	6,570 .40	-	
30138 6	未来 电器	2023- 03-21	6 个月	首次 公开发 行 限售	29.99	23.79	275.0 0	8,247 .25	6,542 .25	-	
60106 1	中信 金属	2023- 03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	6.58	7.58	833.0 0	5,481 .14	6,314 .14	-	
30143 9	泓淋 电力	2023- 03-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	19.99	16.90	370.0 0	7,396 .30	6,253 .00	-	
60313 5	中重 科技	2023- 03-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	17.80	17.89	297.0 0	5,286 .60	5,313 .33	-	
30134 5	涛涛 车业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	73.45	46.64	110.0 0	8,079 .50	5,130 .40	-	
00138 0	华纬 科技	2023- 05-09	6 个月	首次 公开发 行 限售	28.84	30.78	159.0 0	4,585 .56	4,894 .02	-	
60113 3	柏诚 股份	2023- 03-31	6 个月	首次 公开	11.66	12.26	294.0 0	3,428 .04	3,604 .44	-	

				发行 限售							
00128 2	三联 锻造	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	27.93	33.03	105.0 0	2,932 .65	3,468 .15	-	
60106 5	江盐 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	10.36	11.84	286.0 0	2,962 .96	3,386 .24	-	
00132 8	登康 口腔	2023- 03-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	20.68	25.49	124.0 0	2,564 .32	3,160 .76	-	
60313 7	恒尚 节能	2023- 04-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	15.90	17.09	139.0 0	2,210 .10	2,375 .51	-	
60312 5	常青 科技	2023- 03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.98	24.53	94.00	2,442 .12	2,305 .82	-	
00136 0	南矿 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	15.38	14.87	154.0 0	2,368 .52	2,289 .98	-	
00132 4	长青 科技	2023- 05-12	6 个月	首次 公开发 行 限售	18.88	19.60	114.0 0	2,152 .32	2,234 .40	-	
00136 7	海森 药业	2023- 03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	44.48	39.48	55.00	2,446 .40	2,171 .40	-	
60317 2	万丰 股份	2023- 04-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	14.58	16.13	122.0 0	1,778 .76	1,967 .86	-	

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

本基金为股票型基金,理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过多因子量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越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与绩效分析工作,确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

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，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

无。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

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	13,067,522.37	-	-	-	13,067,522.37
结算备付金	6,700,094.00	-	-	-	6,700,094.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	314,193,313.44	314,193,313.44
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,939,710.19	1,939,710.19
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,767,616.37	-	-	316,133,023.63	335,900,640.00
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	693,731.77	693,731.77
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	438,675.44	438,675.44
应付托管费	-	-	-	87,735.09	87,735.09
应付销售服务费	-	-	-	121,521.37	121,521.37
应交税费	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	162,725.02	162,725.02
负债总计	-	-	-	1,504,388.69	1,504,388.69
利率敏感度缺口	19,767,616.37	-	-	-314,628,634.94	334,396,251.31
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	4,025,130.53	-	-	-	4,025,130.53
结算备付金	15,982,642.71	-	-	-	15,982,642.71
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	273,950,011.82	273,950,011.82
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	69,995.67	69,995.67
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,007,773.24	-	-	274,020,007.49	294,027,780.73
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	565,795.48	565,795.48
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	396,475.17	396,475.17
应付托管费	-	-	-	79,295.02	79,295.02
应付销售服务费	-	-	-	102,436.97	102,436.97
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	40,113.06	40,113.06
负债总计	-	-	-	1,184,115.70	1,184,115.70
利率敏感度缺口	20,007,773.24	0.00	-	272,835,891.79	292,843,665.03

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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	314,193,313.44	93.96	273,950,011.82	93.55
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	314,193,313.44	93.96	273,950,011.82	93.55

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 1,496	增加约 1,317
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,496	减少约 1,317

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	312,936,923.74
第二层次	525,725.85
第三层次	730,663.85
合计	314,193,313.44

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	314,193,313.44	93.54
	其中：股票	314,193,313.44	93.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,767,616.37	5.88
8	其他各项资产	1,939,710.19	0.58
9	合计	335,900,640.00	100.00

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	1,584,374.00	0.47
B	采矿业	16,102,662.00	4.82
C	制造业	192,944,765.78	57.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,635,423.00	1.98
E	建筑业	33,106,765.95	9.90
F	批发和零售业	9,018,650.19	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,735,062.00	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,224,947.72	9.64
J	金融业	3,820,212.00	1.14
K	房地产业	2,127,455.00	0.64
L	租赁和商务服务业	1,072,749.20	0.32
M	科学研究和技术服务业	4,309,951.72	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	2,492,688.82	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,926.06	0.01
R	文化、体育和娱乐业	3,812,016.00	1.14
S	综合	184,664.00	0.06
	合计	314,193,313.44	93.96

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	002415	海康威视	227,300	7,525,903.00	2.25
2	601186	中国铁建	465,300	4,583,205.00	1.37
3	601857	中国石油	608,000	4,541,760.00	1.36
4	601669	中国电建	786,200	4,512,788.00	1.35
5	603688	石英股份	39,200	4,462,528.00	1.33
6	601390	中国中铁	587,300	4,451,734.00	1.33
7	601766	中国中车	681,500	4,429,750.00	1.32
8	600050	中国联通	921,400	4,422,720.00	1.32
9	601668	中国建筑	762,600	4,377,324.00	1.31
10	002600	领益智造	619,200	4,278,672.00	1.28
11	300232	洲明科技	457,000	4,176,980.00	1.25
12	600028	中国石化	653,000	4,153,080.00	1.24
13	601800	中国交建	379,800	4,143,618.00	1.24
14	600728	佳都科技	592,100	4,103,253.00	1.23
15	603283	赛腾股份	91,100	4,053,950.00	1.21
16	601618	中国中冶	1,000,100	3,970,397.00	1.19
17	300853	申昊科技	112,300	3,941,730.00	1.18
18	603757	大元泵业	129,900	3,876,216.00	1.16
19	002381	双箭股份	457,700	3,533,444.00	1.06
20	601117	中国化学	424,700	3,516,516.00	1.05
21	601567	三星医疗	275,800	3,483,354.00	1.04
22	600481	双良节能	246,211	3,442,029.78	1.03
23	603191	望变电气	167,200	3,252,040.00	0.97
24	601728	中国电信	577,100	3,249,073.00	0.97
25	600583	海油工程	542,700	3,174,795.00	0.95
26	688019	安集科技	18,280	3,013,092.40	0.90
27	601985	中国核电	410,500	2,894,025.00	0.87
28	688609	九联科技	223,419	2,658,686.10	0.80
29	600019	宝钢股份	448,400	2,520,008.00	0.75
30	600929	雪天盐业	306,700	2,435,198.00	0.73
31	688551	科威尔	36,700	2,406,786.00	0.72
32	688120	华海清科	9,451	2,382,124.55	0.71
33	603859	能科科技	46,500	2,377,545.00	0.71
34	301030	仕净科技	34,300	2,370,130.00	0.71
35	003029	吉大正元	73,000	2,368,850.00	0.71
36	300693	盛弘股份	63,615	2,348,665.80	0.70
37	600328	中盐化工	260,780	2,347,020.00	0.70
38	688676	金盘科技	77,237	2,339,508.73	0.70

39	300900	广联航空	81,200	2,339,372.00	0.70
40	300634	彩讯股份	88,600	2,339,040.00	0.70
41	000063	中兴通讯	50,900	2,317,986.00	0.69
42	688981	中芯国际	45,773	2,312,451.96	0.69
43	688589	力合微	56,685	2,309,346.90	0.69
44	300274	阳光电源	19,800	2,309,274.00	0.69
45	601126	四方股份	152,000	2,308,880.00	0.69
46	688207	格灵深瞳	92,620	2,306,238.00	0.69
47	300017	网宿科技	323,900	2,302,929.00	0.69
48	601717	郑煤机	184,700	2,299,515.00	0.69
49	000922	佳电股份	174,600	2,297,736.00	0.69
50	000048	京基智农	117,320	2,290,086.40	0.68
51	000777	中核科技	169,600	2,287,904.00	0.68
52	002270	华明装备	208,900	2,287,455.00	0.68
53	688569	铁科轨道	53,759	2,261,641.13	0.68
54	003011	海象新材	67,700	2,183,325.00	0.65
55	600229	城市传媒	233,300	1,987,716.00	0.59
56	600875	东方电气	106,000	1,976,900.00	0.59
57	301039	中集车辆	149,300	1,975,239.00	0.59
58	003816	中国广核	633,300	1,969,563.00	0.59
59	002912	中新赛克	44,000	1,936,440.00	0.58
60	605599	菜百股份	146,300	1,932,623.00	0.58
61	300622	博士眼镜	79,600	1,878,560.00	0.56
62	000885	城发环境	138,700	1,846,097.00	0.55
63	600271	航天信息	133,900	1,833,091.00	0.55
64	601958	金铂股份	164,300	1,831,945.00	0.55
65	601600	中国铝业	326,200	1,790,838.00	0.54
66	002459	晶澳科技	40,420	1,685,514.00	0.50
67	000786	北新建材	64,500	1,580,895.00	0.47
68	600372	中航电子	103,200	1,566,576.00	0.47
69	600528	中铁工业	150,200	1,483,976.00	0.44
70	603567	珍宝岛	97,300	1,455,608.00	0.44
71	600612	老凤祥	20,800	1,453,504.00	0.43
72	600312	平高电气	114,700	1,421,133.00	0.42
73	605009	豪悦护理	27,900	1,339,200.00	0.40
74	603199	九华旅游	38,300	1,323,265.00	0.40
75	601021	春秋航空	22,500	1,293,075.00	0.39
76	688187	时代电气	27,976	1,171,075.36	0.35
77	688009	中国通号	200,426	1,162,470.80	0.35
78	600970	中材国际	90,300	1,151,325.00	0.34
79	300638	广和通	49,840	1,130,371.20	0.34
80	601868	中国能建	467,000	1,092,780.00	0.33
81	002422	科伦药业	36,600	1,086,288.00	0.32

82	002478	常宝股份	140,200	1,044,490.00	0.31
83	603345	安井食品	6,900	1,012,920.00	0.30
84	603551	奥普家居	77,900	1,007,247.00	0.30
85	603040	新坐标	37,753	1,003,852.27	0.30
86	603628	清源股份	62,800	994,124.00	0.30
87	002080	中材科技	48,400	993,168.00	0.30
88	603027	千禾味业	46,100	973,632.00	0.29
89	002851	麦格米特	26,600	970,102.00	0.29
90	300839	博汇股份	72,300	960,867.00	0.29
91	002772	众兴菌业	81,500	920,950.00	0.28
92	300869	康泰医学	40,100	920,696.00	0.28
93	600785	新华百货	67,000	910,530.00	0.27
94	603279	景津装备	28,100	881,216.00	0.26
95	300866	安克创新	10,000	875,000.00	0.26
96	603129	春风动力	5,400	874,260.00	0.26
97	002215	诺普信	116,300	873,413.00	0.26
98	600035	楚天高速	213,600	871,488.00	0.26
99	600251	冠农股份	96,500	871,395.00	0.26
100	603367	辰欣药业	57,400	871,332.00	0.26
101	688396	华润微	16,544	867,071.04	0.26
102	600639	浦东金桥	69,700	864,977.00	0.26
103	600981	汇鸿集团	297,200	861,880.00	0.26
104	301096	百诚医药	14,200	860,662.00	0.26
105	300228	富瑞特装	134,100	858,240.00	0.26
106	002832	比音勒芬	24,200	856,922.00	0.26
107	002956	西麦食品	54,100	845,583.00	0.25
108	605287	德才股份	35,300	836,610.00	0.25
109	002448	中原内配	119,300	835,100.00	0.25
110	601377	兴业证券	135,200	827,424.00	0.25
111	002568	百润股份	22,200	806,970.00	0.24
112	601566	九牧王	59,300	712,786.00	0.21
113	300729	乐歌股份	39,400	702,896.00	0.21
114	688526	科前生物	29,000	689,910.00	0.21
115	300494	盛天网络	27,800	689,162.00	0.21
116	300499	高澜股份	39,100	688,942.00	0.21
117	600378	昊华科技	18,300	688,812.00	0.21
118	002491	通鼎互联	99,500	688,540.00	0.21
119	603327	福蓉科技	57,710	685,594.80	0.21
120	300856	科思股份	8,700	685,299.00	0.20
121	002017	东信和平	52,230	684,735.30	0.20
122	000426	兴业银锡	76,800	681,984.00	0.20
123	688208	道通科技	22,400	678,944.00	0.20
124	688033	天宜上佳	35,500	678,760.00	0.20

125	002916	深南电路	9,000	678,330.00	0.20
126	603708	家家悦	54,000	677,160.00	0.20
127	688029	南微医学	8,300	676,948.00	0.20
128	600419	天润乳业	41,700	676,374.00	0.20
129	300872	天阳科技	43,400	674,436.00	0.20
130	603633	徕木股份	51,600	674,412.00	0.20
131	600537	亿晶光电	88,200	673,848.00	0.20
132	688357	建龙微纳	10,400	672,776.00	0.20
133	300127	银河磁体	37,100	672,623.00	0.20
134	600228	返利科技	66,800	672,008.00	0.20
135	600446	金证股份	46,200	671,748.00	0.20
136	605266	健之佳	8,000	670,640.00	0.20
137	688336	三生国健	39,200	669,928.00	0.20
138	300342	天银机电	62,100	668,817.00	0.20
139	300674	宇信科技	37,800	668,304.00	0.20
140	601163	三角轮胎	42,100	668,127.00	0.20
141	688318	财富趋势	6,660	665,800.20	0.20
142	603339	四方科技	41,800	665,038.00	0.20
143	688190	云路股份	9,100	664,300.00	0.20
144	300970	华绿生物	28,400	663,424.00	0.20
145	002011	盾安环境	47,900	662,457.00	0.20
146	002990	盛视科技	18,000	662,400.00	0.20
147	600757	长江传媒	76,400	657,040.00	0.20
148	301101	明月镜片	16,000	656,480.00	0.20
149	300855	图南股份	18,220	643,530.40	0.19
150	600197	伊力特	23,400	635,778.00	0.19
151	600968	海油发展	204,400	627,508.00	0.19
152	000538	云南白药	11,300	593,024.00	0.18
153	600320	振华重工	153,700	573,301.00	0.17
154	601519	大智慧	78,800	564,208.00	0.17
155	002419	天虹股份	94,300	551,655.00	0.16
156	300978	东箭科技	39,800	542,474.00	0.16
157	601528	瑞丰银行	111,600	541,260.00	0.16
158	002737	葵花药业	22,100	537,914.00	0.16
159	688425	铁建重工	108,966	524,126.46	0.16
160	600871	石化油服	258,000	510,840.00	0.15
161	000778	新兴铸管	125,200	510,816.00	0.15
162	603877	太平鸟	19,600	495,488.00	0.15
163	600803	新奥股份	25,900	491,582.00	0.15
164	300113	顺网科技	26,900	462,949.00	0.14
165	600329	达仁堂	9,900	444,411.00	0.13
166	000878	云南铜业	39,700	438,685.00	0.13
167	600486	扬农化工	5,000	437,100.00	0.13

168	601318	中国平安	8,900	412,960.00	0.12
169	000657	中钨高新	42,500	411,825.00	0.12
170	300795	米奥会展	9,800	408,758.00	0.12
171	300811	铂科新材	6,620	393,492.80	0.12
172	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.11
173	603466	风语筑	24,900	346,110.00	0.10
174	601965	中国汽研	16,700	344,855.00	0.10
175	601619	嘉泽新能	75,400	343,070.00	0.10
176	002967	广电计量	16,900	339,521.00	0.10
177	002027	分众传媒	49,800	339,138.00	0.10
178	000050	深天马 A	36,000	330,480.00	0.10
179	605168	三人行	3,780	324,853.20	0.10
180	300314	戴维医疗	14,700	310,758.00	0.09
181	600764	中国海防	11,300	307,586.00	0.09
182	688322	奥比中光	7,348	306,558.56	0.09
183	300779	惠城环保	5,700	303,753.00	0.09
184	000888	峨眉山 A	26,300	301,398.00	0.09
185	600497	驰宏锌锗	57,900	290,658.00	0.09
186	601808	中海油服	20,900	290,092.00	0.09
187	605300	佳禾食品	13,200	286,968.00	0.09
188	600893	航发动力	6,700	283,142.00	0.08
189	301051	信濠光电	4,600	278,254.00	0.08
190	601801	皖新传媒	29,600	277,944.00	0.08
191	301004	嘉益股份	6,700	259,960.00	0.08
192	600500	中化国际	45,600	253,536.00	0.08
193	002389	航天彩虹	11,400	253,194.00	0.08
194	601877	正泰电器	9,000	248,850.00	0.07
195	601106	中国一重	72,900	244,944.00	0.07
196	600633	浙数文化	15,000	243,150.00	0.07
197	600038	中直股份	5,700	226,974.00	0.07
198	002970	锐明技术	6,600	207,834.00	0.06
199	688639	华恒生物	2,286	206,837.28	0.06
200	002997	瑞鹄模具	6,800	202,164.00	0.06
201	000570	苏常柴 A	36,000	200,520.00	0.06
202	002337	赛象科技	29,500	197,060.00	0.06
203	603655	朗博科技	7,800	195,468.00	0.06
204	603315	福鞍股份	16,300	195,274.00	0.06
205	600400	红豆股份	59,300	194,504.00	0.06
206	300982	苏文电能	3,200	193,792.00	0.06
207	600824	益民集团	54,400	193,664.00	0.06
208	300206	理邦仪器	12,800	193,024.00	0.06
209	002367	康力电梯	21,100	192,643.00	0.06
210	603897	长城科技	9,600	192,576.00	0.06

211	300577	开润股份	11,800	192,222.00	0.06
212	600531	豫光金铅	30,500	192,150.00	0.06
213	603032	德新科技	5,560	192,042.40	0.06
214	605167	利柏特	19,800	191,664.00	0.06
215	603696	安记食品	20,300	191,632.00	0.06
216	600020	中原高速	52,200	191,574.00	0.06
217	601003	柳钢股份	47,400	191,496.00	0.06
218	002314	南山控股	58,000	191,400.00	0.06
219	603878	武进不锈	22,640	191,308.00	0.06
220	002133	广宇集团	56,400	191,196.00	0.06
221	002926	华西证券	23,000	191,130.00	0.06
222	605066	天正电气	20,300	191,023.00	0.06
223	300155	安居宝	37,900	191,016.00	0.06
224	000517	荣安地产	62,600	190,930.00	0.06
225	600858	银座股份	31,600	190,864.00	0.06
226	600060	海信视像	7,700	190,575.00	0.06
227	605499	东鹏饮料	1,100	190,190.00	0.06
228	601686	友发集团	27,800	190,152.00	0.06
229	600628	新世界	26,300	190,149.00	0.06
230	002388	新亚制程	26,700	190,104.00	0.06
231	000417	合肥百货	40,600	190,008.00	0.06
232	001218	丽臣实业	8,400	189,924.00	0.06
233	002233	塔牌集团	24,600	189,912.00	0.06
234	002746	仙坛股份	24,100	189,908.00	0.06
235	600784	鲁银投资	26,200	189,688.00	0.06
236	600167	联美控股	27,200	189,584.00	0.06
237	600782	新钢股份	51,100	189,581.00	0.06
238	300279	和晶科技	33,900	189,501.00	0.06
239	301116	益客食品	12,300	189,420.00	0.06
240	600638	新黄浦	35,800	189,382.00	0.06
241	601908	京运通	31,300	189,365.00	0.06
242	002392	北京利尔	52,300	189,326.00	0.06
243	000548	湖南投资	39,100	189,244.00	0.06
244	601162	天风证券	63,500	189,230.00	0.06
245	600611	大众交通	63,900	189,144.00	0.06
246	603101	汇嘉时代	30,900	189,108.00	0.06
247	600864	哈投股份	37,000	189,070.00	0.06
248	002169	智光电气	22,800	189,012.00	0.06
249	601929	吉视传媒	102,700	188,968.00	0.06
250	600512	腾达建设	70,400	188,672.00	0.06
251	603950	长源东谷	12,600	188,496.00	0.06
252	000563	陕国投 A	61,800	188,490.00	0.06
253	000533	顺钠股份	44,300	188,275.00	0.06

254	300375	鹏翎股份	48,900	188,265.00	0.06
255	600635	大众公用	56,700	188,244.00	0.06
256	601010	文峰股份	76,700	187,915.00	0.06
257	603689	皖天然气	21,400	187,678.00	0.06
258	301029	怡合达	4,200	187,656.00	0.06
259	000967	盈峰环境	37,100	187,355.00	0.06
260	301087	可孚医疗	3,800	187,340.00	0.06
261	603309	维力医疗	12,100	187,187.00	0.06
262	600582	天地科技	32,100	187,143.00	0.06
263	300074	华平股份	43,400	187,054.00	0.06
264	600637	东方明珠	23,900	186,898.00	0.06
265	601319	中国人保	32,000	186,880.00	0.06
266	002283	天润工业	29,100	186,822.00	0.06
267	002779	中坚科技	7,100	186,801.00	0.06
268	000783	长江证券	32,200	186,760.00	0.06
269	300018	中元股份	27,400	186,594.00	0.06
270	603488	展鹏科技	23,200	186,296.00	0.06
271	603331	百达精工	12,600	186,228.00	0.06
272	002595	豪迈科技	5,300	186,189.00	0.06
273	300833	浩洋股份	1,700	186,031.00	0.06
274	600681	百川能源	39,800	185,866.00	0.06
275	000531	穗恒运 A	25,700	185,811.00	0.06
276	301257	普蕊斯	3,300	185,460.00	0.06
277	600191	华资实业	32,400	185,328.00	0.06
278	603630	拉芳家化	11,600	185,252.00	0.06
279	000997	新大陆	9,800	185,220.00	0.06
280	600576	祥源文旅	23,200	184,904.00	0.06
281	600517	国网英大	32,400	184,680.00	0.06
282	600770	综艺股份	32,800	184,664.00	0.06
283	603197	保隆科技	3,400	184,450.00	0.06
284	600215	派斯林	21,500	183,825.00	0.05
285	002867	周大生	10,300	183,134.00	0.05
286	300190	维尔利	45,800	182,742.00	0.05
287	002739	万达电影	14,300	179,322.00	0.05
288	601928	凤凰传媒	15,700	178,980.00	0.05
289	603136	天目湖	6,900	178,020.00	0.05
290	603368	柳药集团	7,100	175,441.00	0.05
291	002139	拓邦股份	13,300	173,565.00	0.05
292	000596	古井贡酒	700	173,166.00	0.05
293	600006	东风汽车	27,700	163,707.00	0.05
294	000898	鞍钢股份	58,400	162,352.00	0.05
295	600658	电子城	29,300	162,029.00	0.05
296	002446	盛路通信	17,000	160,650.00	0.05

297	688106	金宏气体	5,854	159,228.80	0.05
298	688007	光峰科技	7,600	158,460.00	0.05
299	600908	无锡银行	29,500	158,120.00	0.05
300	002402	和而泰	9,300	157,914.00	0.05
301	600761	安徽合力	7,900	157,447.00	0.05
302	600986	浙文互联	24,600	157,440.00	0.05
303	002583	海能达	27,000	156,870.00	0.05
304	002332	仙琚制药	11,800	156,350.00	0.05
305	000811	冰轮环境	9,900	156,024.00	0.05
306	300777	中简科技	3,300	155,958.00	0.05
307	002859	洁美科技	5,600	155,120.00	0.05
308	600201	生物股份	16,300	155,013.00	0.05
309	603601	再升科技	36,300	155,001.00	0.05
310	000789	万年青	20,000	155,000.00	0.05
311	300119	瑞普生物	8,700	154,860.00	0.05
312	002768	国恩股份	6,400	154,816.00	0.05
313	002158	汉钟精机	6,200	154,752.00	0.05
314	600662	外服控股	27,000	154,440.00	0.05
315	002254	泰和新材	6,300	154,161.00	0.05
316	601222	林洋能源	18,800	153,972.00	0.05
317	600007	中国国贸	8,300	153,716.00	0.05
318	603588	高能环境	16,400	153,668.00	0.05
319	000951	中国重汽	9,100	153,335.00	0.05
320	002643	万润股份	8,800	153,208.00	0.05
321	300294	博雅生物	4,200	152,376.00	0.05
322	600562	国睿科技	9,400	152,280.00	0.05
323	600363	联创光电	4,100	152,110.00	0.05
324	002929	润建股份	3,500	151,935.00	0.05
325	603171	税友股份	3,800	151,924.00	0.05
326	600990	四创电子	4,800	151,872.00	0.05
327	600323	瀚蓝环境	8,000	151,440.00	0.05
328	002747	埃斯顿	5,400	151,200.00	0.05
329	301291	明阳电气	4,589	148,880.77	0.04
330	002698	博实股份	8,500	148,665.00	0.04
331	300470	中密控股	3,200	147,904.00	0.04
332	688100	威胜信息	4,900	146,069.00	0.04
333	600335	国机汽车	12,700	144,780.00	0.04
334	000825	太钢不锈	35,100	135,837.00	0.04
335	600808	马钢股份	52,600	135,182.00	0.04
336	301395	仁信新材	5,066	135,160.88	0.04
337	688273	麦澜德	3,568	132,051.68	0.04
338	301360	荣旗科技	1,273	131,253.40	0.04
339	301307	美利信	3,753	126,155.73	0.04

340	601005	重庆钢铁	89,200	124,880.00	0.04
341	301089	拓新药业	2,000	123,880.00	0.04
342	000800	一汽解放	14,600	122,202.00	0.04
343	301210	金杨股份	2,381	121,700.49	0.04
344	002518	科士达	3,000	120,030.00	0.04
345	301486	致尚科技	1,928	111,168.48	0.03
346	002014	永新股份	12,400	107,632.00	0.03
347	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
348	301292	海科新源	5,125	102,448.75	0.03
349	600418	江淮汽车	7,600	95,684.00	0.03
350	000928	中钢国际	8,500	82,025.00	0.02
351	300615	欣天科技	4,600	81,374.00	0.02
352	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
353	002223	鱼跃医疗	2,000	71,980.00	0.02
354	000829	天音控股	5,200	47,008.00	0.01
355	603289	泰瑞机器	3,000	33,660.00	0.01
356	688249	晶合集成	1,851	33,429.06	0.01
357	688472	阿特斯	1,280	21,811.20	0.01
358	301301	川宁生物	2,337	20,939.52	0.01
359	301293	三博脑科	293	20,926.06	0.01
360	688443	智翔金泰	607	17,900.43	0.01
361	688361	中科飞测	276	17,848.92	0.01
362	002743	富煌钢构	3,100	17,825.00	0.01
363	688469	中芯集成	3,292	17,809.72	0.01
364	301325	曼恩斯特	164	17,703.80	0.01
365	688543	国科军工	287	15,225.35	0.00
366	688478	晶升股份	346	14,660.02	0.00
367	301358	湖南裕能	340	14,582.60	0.00
368	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
369	688576	西山科技	120	14,449.20	0.00
370	688562	航天软件	616	13,742.96	0.00
371	688582	芯动联科	334	13,587.12	0.00
372	301139	元道通信	469	13,549.41	0.00
373	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
374	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
375	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
376	688484	南芯科技	321	11,783.91	0.00
377	688146	中船特气	303	11,553.39	0.00
378	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
379	301408	华人健康	655	11,102.25	0.00
380	688531	日联科技	81	11,013.57	0.00
381	301383	天键股份	302	10,787.44	0.00
382	301303	真兰仪表	482	10,758.24	0.00

383	301298	东利机械	634	10,416.62	0.00
384	301382	蜂助手	317	10,410.28	0.00
385	688334	西高院	632	10,244.72	0.00
386	688593	新相微	695	10,140.05	0.00
387	301246	宏源药业	329	10,103.59	0.00
388	688458	美芯晟	111	10,074.36	0.00
389	301125	腾亚精工	327	9,993.12	0.00
390	688352	硕中科技	795	9,595.65	0.00
391	688552	航天南湖	403	9,470.50	0.00
392	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
393	001287	中电港	440	9,248.80	0.00
394	688581	安杰思	75	8,852.25	0.00
395	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
396	688512	慧智微	455	8,717.80	0.00
397	688433	华曙高科	269	8,473.50	0.00
398	301141	中科磁业	198	8,452.62	0.00
399	688631	莱斯信息	282	8,423.34	0.00
400	301332	德尔玛	613	8,416.49	0.00
401	301373	凌玮科技	263	8,376.55	0.00
402	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
403	301305	朗坤环境	418	8,230.42	0.00
404	301232	飞沃科技	140	8,178.80	0.00
405	301357	北方长龙	165	7,984.35	0.00
406	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
407	301323	新莱福	197	7,753.92	0.00
408	301322	绿通科技	142	7,560.08	0.00
409	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
410	688479	友车科技	227	6,694.23	0.00
411	301203	国泰环保	191	6,570.40	0.00
412	301386	未来电器	275	6,542.25	0.00
413	601061	中信金属	833	6,314.14	0.00
414	603083	剑桥科技	100	6,289.00	0.00
415	301439	泓淋电力	370	6,253.00	0.00
416	603135	中重科技	297	5,313.33	0.00
417	301345	涛涛车业	110	5,130.40	0.00
418	001380	华纬科技	159	4,894.02	0.00
419	601133	柏诚股份	294	3,604.44	0.00
420	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
421	601065	江盐集团	286	3,386.24	0.00
422	001328	登康口腔	124	3,160.76	0.00
423	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
424	603125	常青科技	94	2,305.82	0.00
425	001360	南矿集团	154	2,289.98	0.00

426	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
427	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
428	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
429	600105	永鼎股份	100	745.00	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	600406	国电南瑞	16,575,157.80	5.66
2	601766	中国中车	13,600,590.00	4.64
3	002415	海康威视	12,890,810.00	4.40
4	601390	中国中铁	11,127,391.00	3.80
5	002230	科大讯飞	10,410,966.00	3.56
6	601728	中国电信	9,026,663.00	3.08
7	601857	中国石油	8,558,698.00	2.92
8	002179	中航光电	8,443,508.46	2.88
9	603757	大元泵业	8,325,665.00	2.84
10	000922	佳电股份	8,289,707.80	2.83
11	603688	石英股份	7,776,360.00	2.66
12	600050	中国联通	7,550,903.00	2.58
13	601186	中国铁建	7,441,891.34	2.54
14	600028	中国石化	7,303,695.00	2.49
15	300853	申昊科技	7,247,708.00	2.47
16	002937	兴瑞科技	7,036,321.39	2.40
17	688981	中芯国际	7,030,079.26	2.40
18	601669	中国电建	7,016,304.00	2.40
19	601668	中国建筑	6,901,436.00	2.36
20	000048	京基智农	6,778,390.41	2.31
21	601985	中国核电	6,661,719.00	2.27
22	600537	亿晶光电	6,645,127.00	2.27
23	002600	领益智造	6,623,712.00	2.26
24	600728	佳都科技	6,425,402.39	2.19
25	600761	安徽合力	6,419,946.00	2.19
26	300232	洲明科技	6,349,175.00	2.17
27	601117	中国化学	6,327,773.00	2.16
28	600817	宇通重工	6,258,485.00	2.14
29	600732	爱旭股份	6,061,046.00	2.07
30	000400	许继电气	5,983,550.00	2.04
31	603338	浙江鼎力	5,963,839.00	2.04
32	600583	海油工程	5,870,516.00	2.00

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

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	600406	国电南瑞	16,987,414.84	5.80
2	002230	科大讯飞	12,086,330.00	4.13
3	601766	中国中车	9,458,114.00	3.23
4	300856	科思股份	8,599,242.00	2.94
5	002179	中航光电	8,547,139.10	2.92
6	002959	小熊电器	8,105,814.00	2.77
7	300910	瑞丰新材	8,041,429.00	2.75
8	600732	爱旭股份	7,886,460.00	2.69
9	300532	今天国际	7,821,416.00	2.67
10	000922	佳电股份	7,622,009.89	2.60
11	605077	华康股份	7,344,179.26	2.51
12	600073	上海梅林	7,144,737.00	2.44
13	601390	中国中铁	7,075,842.00	2.42
14	002733	雄韬股份	7,018,519.00	2.40
15	002583	海能达	6,772,834.00	2.31
16	002937	兴瑞科技	6,452,823.00	2.20
17	600761	安徽合力	6,409,712.00	2.19
18	000400	许继电气	5,995,048.00	2.05
19	603633	徕木股份	5,986,274.00	2.04
20	600481	双良节能	5,968,333.00	2.04
21	603338	浙江鼎力	5,860,124.12	2.00

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	1,461,230,376.58
卖出股票的收入（成交）总额	1,445,875,559.22

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建筑股份有限公司在报告编制前一年受到衡水市交通运输局、重庆市住房城乡建委的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,939,710.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,939,710.19

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
博时智选量化多因子股票 A	4,980	12,785.14	24,770,497.32	38.90%	38,899,495.52	61.10%
博时智选量化多因子股票 C	15,885	18,195.33	1,744,963.71	0.60%	287,287,813.56	99.40%
合计	20,694	17,043.72	26,515,461.03	7.52%	326,187,309.08	92.48%

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	博时智选量化多因子股票 A	1,504,452.74	2.36%
	博时智选量化多因子股票 C	107,665.81	0.04%
	合计	1,612,118.55	0.46%

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	-
	博时智选量化多因子股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	>100
	博时智选量化多因子股票 C	-
	合计	>100

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
基金合同生效日（2021 年 11 月 2 日）基金份额总额	30,217,799.02	443,311,509.32
本报告期期初基金份额总额	75,813,359.90	256,465,003.24
本报告期基金总申购份额	18,513,687.30	226,308,423.48
减：本报告期基金总赎回份额	30,657,054.36	193,740,649.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	63,669,992.84	289,032,777.27

§ 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。

基金托管人于 2023 年 5 月 17 日发布公告，自 2023 年 5 月 10 日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自 2023 年 5 月 10 日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

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

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
华创证券	2	2,899,289,681.82	100.00%	2,120,201.57	100.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下估值的时效性要求。

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
华创证券	-	-	10,000,000.00	100.00%	-	-

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	上海证券报、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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12
5	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22

		露网站	
6	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人 网站、证监会基金电子披 露网站	2023-03-30
7	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变 更的公告	上海证券报、基金管理人 网站、证监会基金电子披 露网站	2023-02-18
8	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	上海证券报、基金管理人 网站、证监会基金电子披 露网站	2023-02-13
9	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人 网站、证监会基金电子披 露网站	2023-01-20
10	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	上海证券报、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

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	2023-05-09 ~2023-05-3 0	-	94,921,783. 61	93,293,208. 42	1,628,575. 19	0.46 %

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。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。
2. 份额占比为四舍五入后的结果。

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智选量化多因子股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时智选量化多因子股票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、博时智选量化多因子股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时智选量化多因子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