

博时量化多策略股票型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	102

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	102
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	102
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	102
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	102
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	102
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	103
8.12 投资组合报告附注	103
§9 基金份额持有人信息	103
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	103
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	104
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	104
§10 开放式基金份额变动	104
§11 重大事件揭示	105
11.1 基金份额持有人大会决议	105
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	105
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	105
11.4 基金投资策略的改变	105
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	105
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	105
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	106
11.8 其他重大事件	107
§12 影响投资者决策的其他重要信息	110
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	110
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	111
§13 备查文件目录	111
13.1 备查文件目录	111
13.2 存放地点	112
13.3 查阅方式	112

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化多策略股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化多策略股票	
基金主代码	005635	
交易代码	005635	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	567,484,186.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
下属分级基金的交易代码	005635	005636
报告期末下属分级基金的份额总额	504,330,069.27 份	63,154,117.47 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。
投资策略	1、量化选股策略 （1）A 股投资策略：本基金的选股策略以量化多策略体系为基础，涵盖因子打分、事件驱动、量价特征等多种投资逻辑。其中因子打分策略主要包括价值、成长、质量、市场情绪和分析师预期等因子，事件策略包括高管增持、股权激励、定向增发等，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特征 （2）港股投资策略： 本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下港股市场的投资机会。 2、其他投资策略： 存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券的投资策略、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于高风险/收益的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	孙麒清	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		江向阳	缪建民

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	-44,429,298.54	-10,870,001.32	-22,858,296.00	-1,371,958.84	26,667,125.71	4,681,534.29
本期利润	-37,043,692.90	-11,671,741.92	-23,552,371.98	-1,480,616.88	15,968,064.64	1,923,162.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1471	-0.2350	-0.1800	-0.1729	0.1273	0.1017
本期加权平均净值利润率	-10.24%	-16.77%	-12.15%	-12.03%	7.93%	6.53%

本期基金份额净值增长率	-5.35%	-6.10%	-10.98%	-11.71%	11.46%	10.55%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
期末可供分配利润	86,021,154.86	8,814,984.41	65,419,680.50	4,389,286.06	86,288,960.75	7,767,628.80
期末可供分配基金份额利润	0.1706	0.1396	0.4405	0.3864	0.6255	0.5772
期末基金资产净值	596,355,066.02	72,708,984.71	216,526,714.19	15,934,969.36	225,926,644.84	21,380,857.03
期末基金份额净值	1.1825	1.1513	1.4579	1.4029	1.6377	1.5889
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金份额累计净值增长率	37.99%	31.73%	45.79%	40.29%	63.77%	58.89%

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

1. 博时量化多策略股票 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-7.47%	0.73%	-3.94%	0.77%	-3.53%	-0.04%
过去六个月	-9.53%	0.73%	-8.20%	0.79%	-1.33%	-0.06%
过去一年	-5.35%	0.72%	-6.79%	0.77%	1.44%	-0.05%
过去三年	-6.08%	0.95%	-20.64%	0.98%	14.56%	-0.03%
过去五年	71.31%	1.08%	18.08%	1.06%	53.23%	0.02%
自基金合同生效起至今	37.99%	1.11%	-6.66%	1.08%	44.65%	0.03%

2. 博时量化多策略股票 C：

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

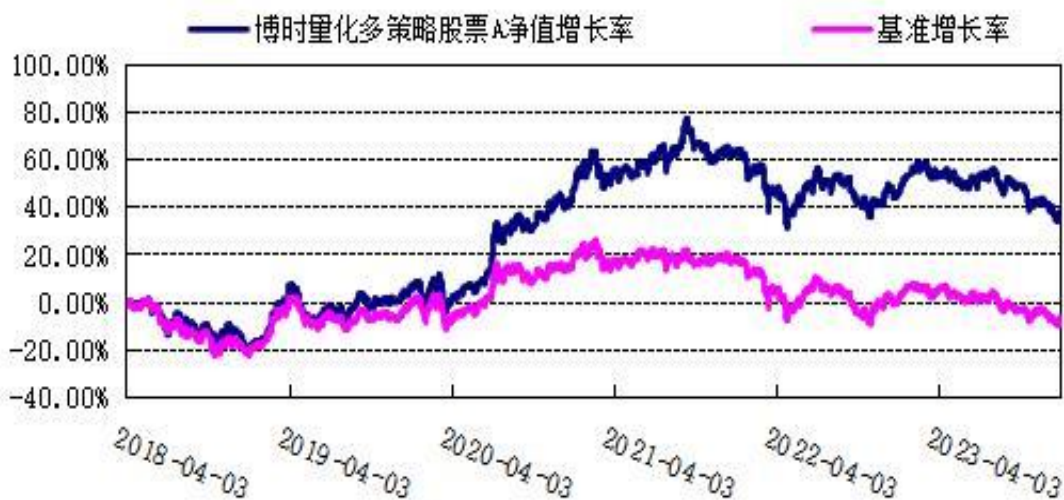
	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-7.66%	0.73%	-3.94%	0.77%	-3.72%	-0.04%
过去六个月	-9.90%	0.73%	-8.20%	0.79%	-1.70%	-0.06%
过去一年	-6.10%	0.72%	-6.79%	0.77%	0.69%	-0.05%
过去三年	-8.35%	0.95%	-20.64%	0.98%	12.29%	-0.03%
过去五年	64.52%	1.08%	18.08%	1.06%	46.44%	0.02%
自基金合同生效起至今	31.73%	1.11%	-6.66%	1.08%	38.39%	0.03%

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

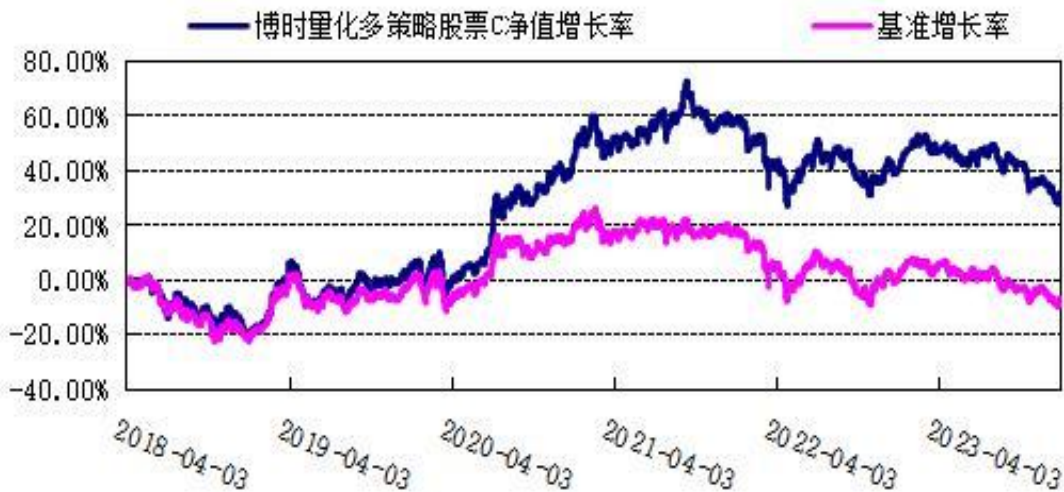
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018年4月3日至2023年12月31日)

1、博时量化多策略股票 A



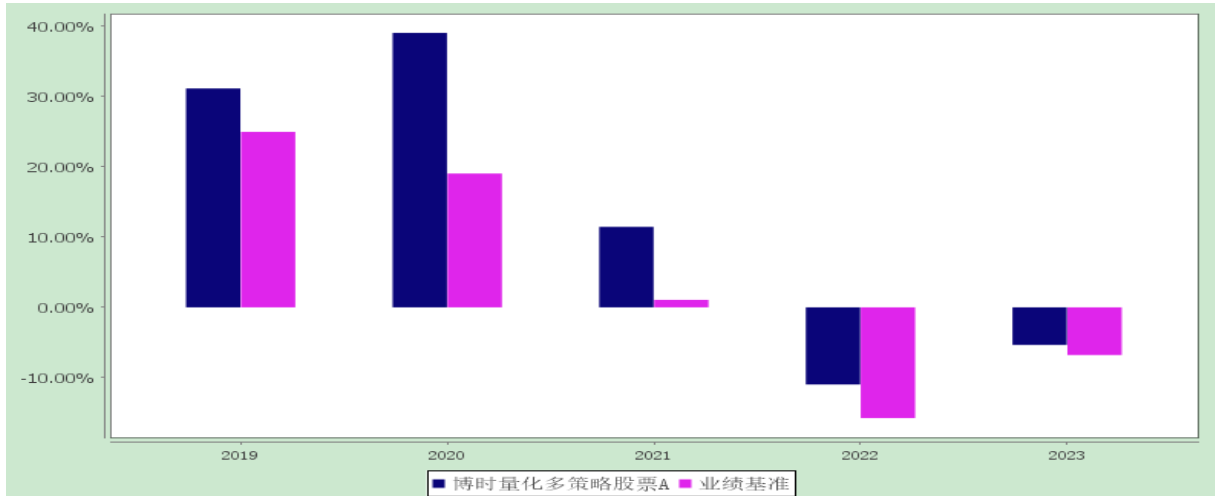
2、博时量化多策略股票 C



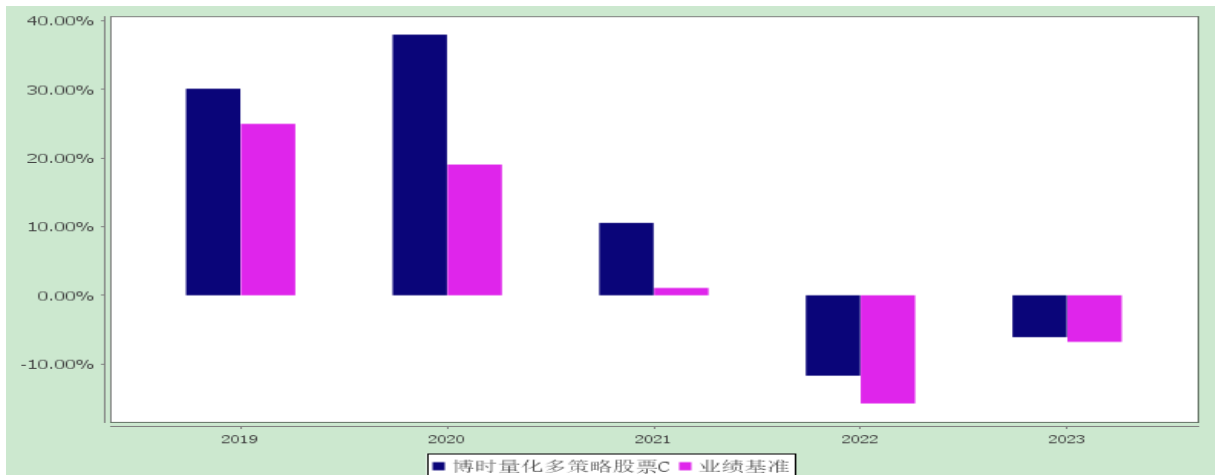
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时量化多策略股票 A



2、博时量化多策略股票 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、博时量化多策略股票 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	1.9910	71,702,870.65	19,077,531.38	90,780,402.03	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	1.9910	71,702,870.65	19,077,531.38	90,780,402.03	-

2、博时量化多策略股票 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	1.6760	10,072,809.36	1,329,629.81	11,402,439.17	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	1.6760	10,072,809.36	1,329,629.81	11,402,439.17	-

§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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 367 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 14668 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 5478 亿元人民币，累计分红逾 1936 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

深圳证券交易所发布 2023 年度基金市场优秀机构和个人评选结果，博时基金荣获“优秀 ETF 研究支持奖”。

中债金融估值中心有限公司发布 2023 年度中债指数用户综合评价结果，博时基金管理有限公司荣获“行业发展领军机构”。

12 月 28 日，中国证券报第二十届中国基金业金牛奖榜单出炉，博时基金凭借领先的综合实力，荣膺“海外投资金牛基金公司”“金牛奖 20 周年特别贡献公司”两个奖项。

10 月 25 日，中央国债登记结算有限责任公司重磅揭晓中债指数“20 周年 20 人”行业领军人物。博时基金董事长江向阳荣获中债指数“20 周年 20 人”行业领军人物。

9 月，中国保险资产管理业协会公布 2022 年度中国保险资产管理业“最受险资欢迎投资业务合作机构”基金公司推介结果，博时基金荣获“中国保险资产管理行业 20 年突出贡献合作机构”“最受险资欢迎公募基金公司——固收类公募产品业务”“最受险资欢迎公募基金公司——单一资产管理计划业务”三项推介。

8月17日，由上海证券报主办的第二十届“金基金”奖出炉，博时基金凭借优秀的资产管理能力荣获“金基金 债券投资回报基金管理公司奖”，体现出行业和专业评价机构对公司的高度认可。此外，博时基金凭借《固收的夏日海边茶会》精彩投教案例斩获上海证券报举办的首届投教类奖项“上证 中国基金投教最佳案例奖”。

6月7日，第十八届中国基金业明星基金奖出炉，博时基金荣获三项大奖。博时基金管理有限公司荣获“三年量化投资明星基金公司”，博时新收益灵活配置混合荣获“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”，博时安盈债券荣获“五年持续回报普通债券型明星基金奖”。

5月26日，由北京济安金信科技有限公司主办的第四届济安“群星汇”评选结果揭晓，博时基金凭借卓越的综合资产管理能力荣获基金公司综合奖济安群星汇“五星奖”、“众星奖”，基金公司单项奖“一级债基金管理奖”。博时旗下产品博时合惠货币市场基金获得了“货币型基金”产品奖，博时稳健回报债券（LOF）获得了“一级债基金”产品奖。

4月6日，中国人民银行公布了“2021 年度金融科技发展奖”的获奖名单，博时基金的“云原生信创注册登记（TA）系统”和“基于超自动化的新一代基金运营管理平台”双双荣获二等奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林景艺	基金经理	2018-04-03	2023-03-08	13.4	林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理、博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015 年 5 月 20 日-2021 年 5 月 18 日)、博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日-2023 年 3 月 8 日)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日-2023 年 3 月 8 日)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2022 年 2 月 28 日-2023 年 3 月 8 日)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部投资总监/ 基金经理	2018-04-03	-	21.4	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管

则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 195 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，A 股市场经历了较大波动，行业的频繁轮动和不断变更的主题投资成为市场的结构性主线。随着全面注册制改革的深入推进，中国资本市场制度建设取得突破性进展，多层次资本市场结构不断优化，资本市场制度型开放稳步扩大，私募基金行业顶层制度初步建立，一二级市场的逆周期调节机制不断加强，资本市场服务实体经济的功能得到有效发挥。然而受风险情绪积累、全球宏观环境等因素拖累，A 股市场在上半年冲高回落后步入震荡行情，三大指数年内均出现了不同程度的回撤，以北证 50 指数为代表的北交所市场成为全年最大的亮点。

市场风格方面，对于大小盘来说，全年下来小盘风格占优，大盘在一二季度初期有所反弹，但持续时间较短。对于价值成长来说，价值风格显著好于成长风格，成长风格基本上全年处于持续走

弱中，而价值风格则震荡向上。具体到指数上，大盘成长表现最差。动量风格则维持强势。

行业层面，受人工智能技术推动影响，与之相关的通信、传媒、计算机、电子具有不同程度的涨幅，而商贸零售和房地产则受制于各种不及预期的数据而有较大调整。

本基金在 2023 年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了较高的股票仓位。在量化策略的配置上，及时对风格变化做出响应，超配小盘成长和小盘价值。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求为投资者获取长期稳健的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1825 元，份额累计净值为 1.3816 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1513 元，份额累计净值为 1.3189 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-5.35%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-6.10%，同期业绩基准增长率为-6.79%。

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 2024 年，A 股市场将有许多机遇。一是 2023 年国内经济总体状况向好、经济总量持续增加、居民收入和消费回升、企业盈利改善以及经济转型持续推进等多个积极信号正在释放。二是国内近期多家银行宣布下调存款挂牌利率，政策宽松助力稳增长；同时相关部门强化政策统筹，确保同向发力、形成合力。三是海外方面，美元指数走弱，人民币汇率走强，全球经济的复苏和外资有望流入 A 股市场，A 股有望迎来一个更为乐观的环境。

我们认为经济以及市场波动加剧的新格局影响正在显现，在这种市场环境下，量化投资策略具有一定的优势。较为分散的持仓特点很大程度上减小了在极端环境下的利润损失，最终通过稳定的个股选择能力实现组合业绩的稳步增长。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告。

报告期内，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全投资管理相关的管理机制，完善了《信用评级管理办法》、《个人养老金业务管理制度》、《风险事件管理制度》、《股票池

管理办法》、《交易管理制度》、《交易监督管理制度》、《基金资产估值委员会制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台进行迭代更新，搭建了“博时合规管理及审计系统”，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则为：由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

本基金管理人于 2023 年 10 月 24 日发布公告，以 2023 年 10 月 19 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.7020 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5990 元人民币；

本基金管理人于 2023 年 11 月 24 日发布公告，以 2023 年 11 月 17 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.6760 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5740 元人民币；

本基金管理人于 2023 年 12 月 23 日发布公告，以 2023 年 12 月 19 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.6130 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5030 元人民币。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 26863 号

博时量化多策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“博时量化多策略股票”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了博时量化多策略股票 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博时量化多策略股票,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时量化多策略股票的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估博时量化多策略股票的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算博时量化多策略股票、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时量化多策略股票的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时量化多策略股票持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时量化多策略股票不能持续经营。

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

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

叶尔甸 陈轶杰

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	64,033,805.62	34,315,271.99
结算备付金		27,714,351.93	6,316,058.87
存出保证金		3,145,864.43	1,305,728.22
交易性金融资产	7.4.7.2	625,574,155.46	207,072,296.69
其中：股票投资		604,675,860.12	207,071,073.69
基金投资		-	-
债券投资		20,898,295.34	1,223.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	7.4.7.5	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,073.22	19,638.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		720,472,250.66	249,028,994.56
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		45,924,929.40	14,957,876.83
应付赎回款		11,776.73	9,526.01
应付管理人报酬		654,804.35	289,492.17

应付托管费		109,134.07	48,248.68
应付销售服务费		43,399.62	7,535.86
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	7.4.7.7	4,664,155.76	1,254,631.46
负债合计		51,408,199.93	16,567,311.01
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	567,484,186.74	159,874,747.07
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	101,579,863.99	72,586,936.48
净资产合计		669,064,050.73	232,461,683.55
负债和净资产总计		720,472,250.66	249,028,994.56

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 567,484,186.74 份。其中 A 类基金份额净值 1.1825 元，基金份额总额 504,330,069.27 份；C 类基金份额净值 1.1513 元，基金份额总额 63,154,117.47 份。

7.2 利润表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-41,343,014.07	-21,138,976.90
1.利息收入		309,803.86	166,603.03
其中：存款利息收入	7.4.7.10	309,803.86	166,603.03
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-48,550,121.59	-20,570,862.78
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-54,754,849.65	-24,635,091.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	361,282.75	246,748.52
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-1,071,678.67	-318,317.10
股利收益	7.4.7.15	6,915,123.98	4,135,797.42
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）	7.4.7.16	6,583,865.04	-802,734.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	313,438.62	68,016.87
减：二、营业总支出		7,372,420.75	3,894,011.96
1. 管理人报酬		5,670,825.89	3,087,470.36
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		945,137.68	514,578.43
3. 销售服务费		557,964.82	98,791.96
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,833.94	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,833.94	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		3,718.40	0.16
8. 其他费用	7.4.7.19	192,940.02	193,171.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-48,715,434.82	-25,032,988.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-48,715,434.82	-25,032,988.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-48,715,434.82	-25,032,988.86

7.3 净资产变动表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	159,874,747.07	72,586,936.48	232,461,683.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	159,874,747.07	72,586,936.48	232,461,683.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	407,609,439.67	28,992,927.51	436,602,367.18
（一）、综合收益	-	-48,715,434.82	-48,715,434.8

总额			2
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	407,609,439.67	179,891,203.53	587,500,643.20
其中: 1.基金申购款	620,719,096.80	274,126,580.44	894,845,677.24
2.基金赎回款	-213,109,657.13	-94,235,376.91	-307,345,034.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-102,182,841.20	-102,182,841.20
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	567,484,186.74	101,579,863.99	669,064,050.73
项目	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	151,413,892.69	95,893,609.18	247,307,501.87
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	151,413,892.69	95,893,609.18	247,307,501.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,460,854.38	-23,306,672.70	-14,845,818.32
(一)、综合收益总额	-	-25,032,988.86	-25,032,988.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	8,460,854.38	1,726,316.16	10,187,170.54
其中: 1.基金申购款	113,804,426.61	56,902,773.25	170,707,199.86
2.基金赎回款	-105,343,572.23	-55,176,457.09	-160,520,029.32

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	159,874,747.07	72,586,936.48	232,461,683.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：陈子成

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1982 号《关于准予博时量化多策略股票型证券投资基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 910,902,796.19 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0197 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 911,230,422.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 327,626.17 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》以及《博时量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监

会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、权证、股指期货、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的规定)。本基金的投资组合比例:股票投资占基金资产的 80%-95%(其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例为 0-50%);权证投资比例为基金资产净值的 0-3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证全指指数收益率 \times 70%+恒生综合指数收益率 \times 20%+中债综合财富(总值)指数收益率 \times 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成

为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如

它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票

投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	64,033,805.62	34,315,271.99
等于：本金	64,029,586.93	34,312,487.69
加：应计利息	4,218.69	2,784.30
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	64,033,805.62	34,315,271.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	595,355,739.47	-	604,675,860.12	9,320,120.65	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	20,502,027.00	396,245.34	20,898,295.34	23.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,502,027.00	396,245.34	20,898,295.34	23.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	615,857,766.47	396,245.34	625,574,155.46	9,320,143.65	
项目	上年度末				

	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	203,580,951.01	-	207,071,073.69	3,490,122.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	1,223.00	222.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,000.00	1,223.00	222.70
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	203,581,951.01	0.30	207,072,296.69	3,490,345.38

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	23,854,159.55	-	-	-
---股指期货	23,854,159.55	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,854,159.55	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,510,746.32	-	-	-
股指期货	10,510,746.32	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,510,746.32	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IH2401	IH2401	35.00	24,435,600.00	581,440.45

合计	-	-	-	581,440.45
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	581,440.45
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他权益工具投资

7.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	19.52
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,490,655.76	1,200,111.94
其中：交易所市场	4,490,655.76	1,200,111.94
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	173,500.00	54,500.00
合计	4,664,155.76	1,254,631.46

7.4.7.8 实收基金

博时量化多策略股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

	基金份额(份)	账面金额
上年度末	148,516,527.87	148,516,527.87
本期申购	427,710,592.50	427,710,592.50
本期赎回（以“-”号填列）	-71,897,051.10	-71,897,051.10
本期末	504,330,069.27	504,330,069.27

博时量化多策略股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,358,219.20	11,358,219.20
本期申购	193,008,504.30	193,008,504.30
本期赎回（以“-”号填列）	-141,212,606.03	-141,212,606.03
本期末	63,154,117.47	63,154,117.47

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)。

7.4.7.9 未分配利润
博时量化多策略股票 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	65,419,680.50	2,590,505.82	68,010,186.32
本期期初	65,419,680.50	2,590,505.82	68,010,186.32
本期利润	-44,429,298.54	7,385,605.64	-37,043,692.90
本期基金份额交易产生的变动数	155,811,174.93	-3,972,269.57	151,838,905.36
其中：基金申购款	193,480,949.91	-2,649,880.99	190,831,068.92
基金赎回款	-37,669,774.98	-1,322,388.58	-38,992,163.56
本期已分配利润	-90,780,402.03	-	-90,780,402.03
本期末	86,021,154.86	6,003,841.89	92,024,996.75

博时量化多策略股票 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	4,389,286.06	187,464.10	4,576,750.16
本期期初	4,389,286.06	187,464.10	4,576,750.16
本期利润	-10,870,001.32	-801,740.60	-11,671,741.92
本期基金份额交易产生的变动数	26,698,138.84	1,354,159.33	28,052,298.17
其中：基金申购款	81,472,307.95	1,823,203.57	83,295,511.52
基金赎回款	-54,774,169.11	-469,044.24	-55,243,213.35
本期已分配利润	-11,402,439.17	-	-11,402,439.17
本期末	8,814,984.41	739,882.83	9,554,867.24

7.4.7.10 存款利息收入

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	124,004.52	63,227.07
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	183,204.28	101,627.12
其他	2,595.06	1,748.84
合计	309,803.86	166,603.03

7.4.7.11 股票投资收益

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,990,376,854.31	2,725,987,881.22
减：卖出股票成本总额	7,027,927,340.77	2,743,416,947.16
减：交易费用	17,204,363.19	7,206,025.68
买卖股票差价收入	-54,754,849.65	-24,635,091.62

7.4.7.12 债券投资收益
7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	139,053.44	9,004.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	222,229.31	237,743.54
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	361,282.75	246,748.52

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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 12 月	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月

	31 日	31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,247,748.41	7,645,177.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,010,243.53	7,273,377.99
减：应计利息总额	14,972.89	134,044.63
减：交易费用	302.68	11.39
买卖债券差价收入	222,229.31	237,743.54

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-1,071,678.67	-318,317.10

7.4.7.15 股利收益

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,915,123.98	4,135,797.42
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	6,915,123.98	4,135,797.42

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

1.交易性金融资产	5,829,798.27	-630,107.70
——股票投资	5,829,997.97	-574,015.49
——债券投资	-199.70	-56,092.21
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	754,066.77	-172,626.32
——权证投资	-	-
——股指期货	754,066.77	-172,626.32
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	6,583,865.04	-802,734.02

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	260,275.26	66,167.57
基金转换费收入	53,163.36	1,849.30
合计	313,438.62	68,016.87

7.4.7.18 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	49,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	401.41	55.31
银行汇划费	5,538.61	5,115.74
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	192,940.02	193,171.05

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注： 1.经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议，股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。于 2023 年 8 月 29 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，本次股东变更完成后，基金管理人股权结构为：招商证券股份有限公司 49%，中国长城资产管理股份有限公司 25%，上海汇华实业有限公司 12%，天津港(集团)有限公司 6%，上海盛业股权投资基金有限公司 6% 和浙江省国贸集团资产经营有限公司 2%。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	6,770,985,424.75	47.04%	3,206,942,852.07	58.99%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	18,083,839.07	64.49%	6,429,634.88	85.57%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	1,000,000.00	24.94%	-	-

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	5,013,669.09	47.09%	2,013,875.58	44.85%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	2,345,224.56	58.97%	344,449.11	28.70%

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,670,825.89	3,087,470.36
其中：应支付销售机构的客户维护	296,107.72	111,297.91

费		
应支付基金管理人的净管理费	5,374,718.17	2,976,172.45

注：于本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，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。

自 2023 年 7 月 10 日起，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 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	945,137.68	514,578.43

注：于本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，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。

自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	223,232.06	223,232.06
招商证券	-	172,788.54	172,788.54
招商银行	-	2,170.43	2,170.43
合计	-	398,191.03	398,191.03
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	12,664.29	12,664.29
招商银行	-	1,606.06	1,606.06
招商证券	-	139.51	139.51
合计	-	14,409.86	14,409.86

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 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明
7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况
7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	64,033,805.62	124,004.52	34,315,271.99	63,227.07

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。

7.4.10.7 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12月31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	4,806.00	121,351.50
招商证券股份有限公司	001378	德冠新材	网下发行	2,044.00	64,753.92
招商证券股份有限公司	688653	康希通信	网下发行	6,478.00	68,019.00
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	002948	青岛银行	配股	30,540.00	97,728.00
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	1,710.00	63,663.30
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	5,565.00	80,302.95
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

博时量化多策略股票 A

单位:人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023-10-26	-	2023-10-26	0.7020	26,022,103.17	5,359,229.03	31,381,332.20	-
2	2023-11-28	-	2023-11-28	0.6760	23,956,038.42	7,017,975.09	30,974,013.51	-
3	2023-12-26	-	2023-12-26	0.6130	21,724,729.06	6,700,327.26	28,425,056.32	-
合计				1.9910	71,702,870.65	19,077,531.38	90,780,402.03	-

博时量化多策略股票 C

单位:人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023-10-26	-	2023-10-26	0.5990	5,444,180.59	461,392.63	5,905,573.22	-
2	2023-11-28	-	2023-11-28	0.5740	2,227,117.39	449,468.88	2,676,586.27	-
3	2023-12-26	-	2023-12-26	0.5030	2,401,511.38	418,768.30	2,820,279.68	-
合计				1.6760	10,072,809.36	1,329,629.81	11,402,439.17	-

7.4.12 期末(2023年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	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
301526	国际 复材	2023-1 2-19	6个月	首次公 开发行 限售	2.66	4.45	9,037.00	24,038.42	40,214.65	-
301348	蓝箭	2023-0	6个月	首次公	18.08	44.57	561.00	10,142.88	25,003.77	-

	电子	8-01		开发行 限售							
688652	京仪 装备	2023-1 1-22	6 个月	首次公 开发行 限售	31.95	52.25	416.00	13,291.20	21,736.00	-	
301421	波长 光电	2023-0 8-16	6 个月	首次公 开发行 限售	29.38	59.37	332.00	9,754.16	19,710.84	-	
301558	三态 股份	2023-0 9-21	6 个月	首次公 开发行 限售	7.33	13.40	1,419.00	10,401.27	19,014.60	-	
300904	威力 传动	2023-0 8-02	6 个月	首次公 开发行 限售	35.41	61.53	304.00	10,764.64	18,705.12	-	
301488	豪恩 汽电	2023-0 6-26	6 个月	首次公 开发行 限售	39.78	69.09	262.00	10,422.36	18,101.58	-	
688627	精智 达	2023-0 7-11	6 个月	首次公 开发行 限售	46.77	87.72	187.00	8,745.99	16,403.64	-	
688549	中巨 芯	2023-0 8-30	6 个月	首次公 开发行 限售	5.18	8.09	1,920.00	9,945.60	15,532.80	-	
301381	赛维 时代	2023-0 7-05	6 个月	首次公 开发行 限售	20.45	29.69	514.00	10,511.30	15,260.66	-	
688548	广钢 气体	2023-0 8-08	6 个月	首次公 开发行 限售	9.87	12.75	1,107.00	10,926.09	14,114.25	-	
301510	固高 科技	2023-0 8-04	6 个月	首次公 开发行 限售	12.00	35.01	396.00	4,752.00	13,863.96	-	
688563	航材 股份	2023-0 7-12	6 个月	首次公 开发行 限售	78.99	60.49	229.00	18,088.71	13,852.21	-	
301370	国科 恒泰	2023-0 7-03	6 个月	首次公 开发行 限售	13.39	16.01	831.00	11,127.09	13,304.31	-	
301291	明阳 电气	2023-0 6-21	6 个月	首次公 开发行 限售	38.13	28.36	459.00	17,501.67	13,017.24	-	
688582	芯动 联科	2023-0 6-21	6 个月	首次公 开发行 限售	26.74	38.67	334.00	8,931.16	12,915.78	-	

301566	达利凯普	2023-1 2-22	6 个月	首次公开发 行限售	8.90	22.14	576.00	5,126.40	12,752.64	-
688591	泰凌微	2023-0 8-18	6 个月	首次公开发 行限售	24.98	28.02	424.00	10,591.52	11,880.48	-
601083	锦江航运	2023-1 1-28	6 个月	首次公开发 行限售	11.25	11.07	1,026.00	11,542.50	11,357.82	-
301508	中机认检	2023-1 1-23	6 个月	首次公开发 行限售	16.82	26.68	419.00	7,047.58	11,178.92	-
301251	威尔高	2023-0 8-30	6 个月	首次公开发 行限售	28.88	34.59	321.00	9,270.48	11,103.39	-
688592	司南导航	2023-0 8-07	6 个月	首次公开发 行限售	50.50	50.53	216.00	10,908.00	10,914.48	-
301210	金杨股份	2023-0 6-21	6 个月	首次公开发 行限售	57.88	45.48	239.00	13,833.32	10,869.72	-
301499	维科精密	2023-0 7-13	6 个月	首次公开发 行限售	19.50	28.93	371.00	7,234.50	10,733.03	-
301507	民生健康	2023-0 8-24	6 个月	首次公开发 行限售	10.00	15.85	675.00	6,750.00	10,698.75	-
301550	斯菱股份	2023-0 9-06	6 个月	首次公开发 行限售	37.56	43.57	240.00	9,014.40	10,456.80	-
688653	康希通信	2023-1 1-10	6 个月	首次公开发 行限售	10.50	15.99	648.00	6,804.00	10,361.52	-
301498	乖宝宠物	2023-0 8-09	6 个月	首次公开发 行限售	39.99	38.81	262.00	10,477.38	10,168.22	-
301261	恒工精密	2023-0 6-29	6 个月	首次公开发 行限售	36.90	50.85	198.00	7,306.20	10,068.30	-
301292	海科新源	2023-0 6-29	6 个月	首次公开发 行限售	19.99	19.35	513.00	10,254.87	9,926.55	-
603296	华勤技术	2023-0 8-01	6 个月	首次公开发 行	80.80	77.75	127.00	10,261.60	9,874.25	-

				限售							
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	首次公开发售	71.80	68.91	142.00	10,195.60	9,785.22	-	
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	首次公开发售	42.66	48.18	203.00	8,659.98	9,780.54	-	
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	首次公开发售	28.00	22.67	426.00	11,928.00	9,657.42	-	
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	首次公开发售	33.25	58.19	164.00	5,453.00	9,543.16	-	
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	首次公开发售	26.68	18.69	507.00	13,526.76	9,475.83	-	
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	首次公开发售	6.87	15.51	604.00	4,149.48	9,368.04	-	
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	首次公开发售	36.58	33.09	275.00	10,059.50	9,099.75	-	
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	首次公开发售	69.98	60.10	149.00	10,427.02	8,954.90	-	
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	首次公开发售	29.66	36.39	246.00	7,296.36	8,951.94	-	
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	首次公开发售	23.23	35.58	246.00	5,714.58	8,752.68	-	
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	首次公开发售	21.00	22.23	390.00	8,190.00	8,669.70	-	
301418	协昌科技	2023-08-10	6 个月	首次公开发售	51.88	50.20	170.00	8,819.60	8,534.00	-	
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	首次公开发售	57.66	47.25	180.00	10,378.80	8,505.00	-	
301500	飞南资源	2023-09-13	6 个月	首次公开发售	23.97	20.89	404.00	9,683.88	8,439.56	-	
688638	誉辰	2023-0	6 个月	首次公	83.90	59.68	141.00	11,829.90	8,414.88	-	

	智能	7-04		开发行 限售							
301519	舜禹 股份	2023-0 7-19	6 个月	首次公 开发行 限售	20.93	20.21	416.00	8,706.88	8,407.36	-	
688602	康鹏 科技	2023-0 7-13	6 个月	首次公 开发行 限售	8.66	11.06	755.00	6,538.30	8,350.30	-	
301459	丰茂 股份	2023-1 2-06	6 个月	首次公 开发行 限售	31.90	39.84	208.00	6,635.20	8,286.72	-	
688720	艾森 股份	2023-1 1-29	6 个月	首次公 开发行 限售	28.03	49.84	165.00	4,624.95	8,223.60	-	
301518	长华 化学	2023-0 7-26	6 个月	首次公 开发行 限售	25.75	23.01	357.00	9,192.75	8,214.57	-	
688573	信宇 人	2023-0 8-09	6 个月	首次公 开发行 限售	23.68	28.80	285.00	6,748.80	8,208.00	-	
301489	思泉 新材	2023-1 0-16	6 个月	首次公 开发行 限售	41.66	64.11	128.00	5,332.48	8,206.08	-	
688651	盛邦 安全	2023-0 7-19	6 个月	首次公 开发行 限售	39.90	46.05	178.00	7,102.20	8,196.90	-	
301517	陕西 华达	2023-1 0-09	6 个月	首次公 开发行 限售	26.87	43.69	185.00	4,970.95	8,082.65	-	
301578	辰奕 智能	2023-1 2-21	6 个月	首次公 开发行 限售	48.94	68.32	118.00	5,774.92	8,061.76	-	
688671	碧兴 物联	2023-0 8-02	6 个月	首次公 开发行 限售	36.12	34.30	226.00	8,163.12	7,751.80	-	
688693	锆威 特	2023-0 8-10	6 个月	首次公 开发行 限售	40.83	43.41	178.00	7,267.74	7,726.98	-	
301393	昊帆 生物	2023-0 7-05	6 个月	首次公 开发行 限售	67.68	59.37	130.00	8,798.40	7,718.10	-	
301559	中集 环科	2023-0 9-26	6 个月	首次公 开发行 限售	24.22	18.24	421.00	10,196.62	7,679.04	-	

301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	首次公开发行限售	29.50	33.16	225.00	6,637.50	7,461.00	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	首次公开发行限售	22.88	32.44	224.00	5,125.12	7,266.56	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	首次公开发行限售	67.88	52.74	134.00	9,095.92	7,067.16	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	首次公开发行限售	46.80	36.07	193.00	9,032.40	6,961.51	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	首次公开发行限售	26.35	35.81	194.00	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	首次公开发行限售	36.60	37.88	182.00	6,661.20	6,894.16	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月	首次公开发行限售	55.68	37.58	177.00	9,855.36	6,651.66	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	首次公开发行限售	31.16	28.27	230.00	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	首次公开发行限售	15.18	21.43	303.00	4,599.54	6,493.29	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	首次公开发行限售	103.40	78.23	83.00	8,582.20	6,493.09	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	首次公开发行限售	58.08	57.81	112.00	6,504.96	6,474.72	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	首次公开发行限售	99.57	81.46	79.00	7,866.03	6,435.34	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6 个月	首次公开发行限售	31.68	31.27	205.00	6,494.40	6,410.35	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	首次公开发行限售	66.80	58.99	105.00	7,014.00	6,193.95	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	首次公开发行	16.80	31.19	195.00	3,276.00	6,082.05	-

				限售							
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	首次公开发行限售	47.29	37.97	150.00	7,093.50	5,695.50	-	
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	首次公开发行限售	14.23	18.19	292.00	4,155.16	5,311.48	-	
603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	首次公开发行限售	21.77	29.58	168.00	3,657.36	4,969.44	-	
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	首次公开发行限售	53.09	36.42	133.00	7,060.97	4,843.86	-	
001306	夏厦精密	2023-11-09	6 个月	首次公开发行限售	53.63	75.36	64.00	3,432.32	4,823.04	-	
001326	联域股份	2023-11-01	6 个月	首次公开发行限售	41.18	48.64	99.00	4,076.82	4,815.36	-	
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	首次公开发行限售	17.38	16.66	244.00	4,240.72	4,065.04	-	
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	首次公开发行限售	15.32	23.87	162.00	2,481.84	3,866.94	-	
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	首次公开发行限售	41.00	44.16	87.00	3,567.00	3,841.92	-	
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	首次公开发行限售	12.05	19.92	189.00	2,277.45	3,764.88	-	
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	首次公开发行限售	21.29	21.53	161.00	3,427.69	3,466.33	-	
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	首次公开发行限售	25.73	24.88	134.00	3,447.82	3,333.92	-	
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	首次公开发行限售	23.10	23.31	139.00	3,210.90	3,240.09	-	
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	首次公开发行限售	19.10	34.75	88.00	1,680.80	3,058.00	-	

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金,属于风险水平较高的基金。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,除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金运用科学的量化方法,把握市场规律,跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势,并针对当前市场风格特点,选择因子和构建策略组合,力求获取长期相对市场的超额收益。

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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,898,295.34	-
合计	20,898,295.34	-

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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	1,223.00
未评级	-	-
合计	-	1,223.00

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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约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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	64,033,805.62	-	-	-	64,033,805.62
结算备付金	27,714,351.93	-	-	-	27,714,351.93
存出保证金	213,592.43	-	-	2,932,272.00	3,145,864.43
交易性金融资产	20,898,295.34	-	-	604,675,860.12	625,574,155.46
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,073.22	4,073.22
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	112,860,045.32	-	-	607,612,205.34	720,472,250.66
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,776.73	11,776.73
应付清算款	-	-	-	45,924,929.40	45,924,929.40
应付管理人报酬	-	-	-	654,804.35	654,804.35
应付托管费	-	-	-	109,134.07	109,134.07
应付销售服务费	-	-	-	43,399.62	43,399.62
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,664,155.76	4,664,155.76
负债总计	-	-	-	51,408,199.93	51,408,199.93
利率敏感度缺口	112,860,045.32	-	-	556,204,005.41	669,064,050.73
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	34,315,271.99	-	-	-	34,315,271.99
结算备付金	6,316,058.87	-	-	-	6,316,058.87
存出保证金	65,153.82	-	-	1,240,574.40	1,305,728.22
交易性金融资产	-	-	1,223.00	207,071,073.69	207,072,296.69
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	19,638.79	19,638.79
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	40,696,484.68	-	1,223.00	208,331,286.88	249,028,994.56
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9,526.01	9,526.01

应付清算款	-	-	-	14,957,876.83	14,957,876.83
应付管理人报酬	-	-	-	289,492.17	289,492.17
应付托管费	-	-	-	48,248.68	48,248.68
应付销售服务费	-	-	-	7,535.86	7,535.86
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,254,631.46	1,254,631.46
负债总计	-	-	-	16,567,311.01	16,567,311.01
利率敏感度缺口	40,696,484.68	-	1,223.00	191,763,975.87	232,461,683.55

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 0	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0	-

注：1.上年度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。

2.以上金额为四舍五入的结果。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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			
资产合计	-	-	-
以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外	-	-	-

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
汇风险敞口净额			
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	95,803.21	95,803.21
资产合计	-	95,803.21	95,803.21
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	-	95,803.21	95,803.21

7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 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 0
2.所有港币均相对人民币贬值 5%	-	增加约 0	

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比

		例 (%)		例 (%)
交易性金融资产—股票投资	604,675,860.12	90.38	207,071,073.69	89.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	1,223.00	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	604,675,860.12	90.38	207,072,296.69	89.08

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。

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,353	增加约 1,040
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,353	减少约 1,040

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	603,814,287.48	206,020,535.14
第二层次	20,898,295.34	96,275.41
第三层次	861,572.64	955,486.14
合计	625,574,155.46	207,072,296.69

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	955,486.14	955,486.14
当期购买	-	1,486,343.31	1,486,343.31
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,918,141.45	1,918,141.45
当期利得或损失总额	-	337,884.64	337,884.64
其中:计入损益的利得或损失	-	337,884.64	337,884.64
计入其他综合收益的利得或损失(若有)	-	-	-
期末余额	-	861,572.64	861,572.64
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	142,605.90	142,605.90
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	787,993.01	787,993.01
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	167,493.13	167,493.13
其中:计入损益的利得或	-	167,493.13	167,493.13

损失			
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	955,486.14	955,486.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	167,493.13	167,493.13

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	861,572.64	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.55%-217.52%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	955,486.14	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.91%-247.56%	负相关

7.4.14.3 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（上年度末：同）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	604,675,860.12	83.93

	其中：股票	604,675,860.12	83.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,898,295.34	2.90
	其中：债券	20,898,295.34	2.90
	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	91,748,157.55	12.73
8	其他各项资产	3,149,937.65	0.44
9	合计	720,472,250.66	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,724,217.00	0.71
B	采矿业	64,356,821.00	9.62
C	制造业	368,311,571.46	55.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,239,662.12	3.32
E	建筑业	10,176,815.00	1.52
F	批发和零售业	13,161,674.95	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	19,946,427.82	2.98
H	住宿和餐饮业	95,680.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,663,633.72	2.34
J	金融业	57,161,968.00	8.54
K	房地产业	4,979,449.00	0.74
L	租赁和商务服务业	11,364,231.00	1.70
M	科学研究和技术服务业	5,868,906.69	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	1,122,892.36	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,047,641.00	0.16
Q	卫生和社会工作	2,651,432.00	0.40
R	文化、体育和娱乐业	1,802,837.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	604,675,860.12	90.38

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601857	中国石油	2,392,200	16,888,932.00	2.52
2	300750	宁德时代	93,800	15,313,788.00	2.29
3	000333	美的集团	228,565	12,486,505.95	1.87
4	601899	紫金矿业	971,000	12,098,660.00	1.81
5	000858	五粮液	68,000	9,541,080.00	1.43
6	000651	格力电器	289,300	9,306,781.00	1.39
7	688036	传音控股	64,541	8,932,474.40	1.34
8	300274	阳光电源	100,600	8,811,554.00	1.32
9	601600	中国铝业	1,428,600	8,057,304.00	1.20
10	600089	特变电工	542,350	7,484,430.00	1.12
11	600941	中国移动	75,200	7,480,896.00	1.12
12	603019	中科曙光	188,100	7,428,069.00	1.11
13	600028	中国石化	1,289,900	7,197,642.00	1.08
14	601985	中国核电	947,800	7,108,500.00	1.06
15	002027	分众传媒	1,106,300	6,991,816.00	1.05
16	601166	兴业银行	421,400	6,830,894.00	1.02
17	600938	中国海油	324,900	6,813,153.00	1.02
18	300059	东方财富	474,800	6,666,192.00	1.00
19	002466	天齐锂业	117,200	6,538,588.00	0.98
20	601012	隆基绿能	280,600	6,425,740.00	0.96
21	300760	迈瑞医疗	22,100	6,422,260.00	0.96
22	600438	通威股份	255,700	6,400,171.00	0.96
23	688981	中芯国际	120,164	6,371,095.28	0.95
24	002594	比亚迪	32,100	6,355,800.00	0.95
25	601138	工业富联	417,500	6,312,600.00	0.94
26	002475	立讯精密	170,200	5,863,390.00	0.88
27	000932	华菱钢铁	1,100,700	5,668,605.00	0.85
28	000568	泸州老窖	28,000	5,023,760.00	0.75
29	300308	中际旭创	44,000	4,968,040.00	0.74
30	002459	晶澳科技	236,500	4,900,280.00	0.73
31	601318	中国平安	120,500	4,856,150.00	0.73
32	688169	石头科技	16,885	4,777,610.75	0.71
33	000725	京东方 A	1,206,200	4,704,180.00	0.70
34	600153	建发股份	478,300	4,606,029.00	0.69
35	603259	药明康德	62,900	4,576,604.00	0.68
36	603688	石英股份	52,100	4,526,448.00	0.68
37	300316	晶盛机电	102,100	4,501,589.00	0.67
38	300124	汇川技术	71,100	4,489,254.00	0.67
39	601818	光大银行	1,516,000	4,396,400.00	0.66

40	601288	农业银行	1,204,900	4,385,836.00	0.66
41	300130	新国都	177,000	4,283,400.00	0.64
42	003816	中国广核	1,376,600	4,281,226.00	0.64
43	600398	海澜之家	568,000	4,214,560.00	0.63
44	000921	海信家电	202,300	4,126,920.00	0.62
45	300394	天孚通信	44,300	4,054,336.00	0.61
46	002236	大华股份	218,800	4,036,860.00	0.60
47	002714	牧原股份	97,900	4,031,522.00	0.60
48	600309	万华化学	52,300	4,017,686.00	0.60
49	600519	贵州茅台	2,300	3,969,800.00	0.59
50	600150	中国船舶	134,600	3,962,624.00	0.59
51	300896	爱美客	13,200	3,885,156.00	0.58
52	601021	春秋航空	77,100	3,870,420.00	0.58
53	601111	中国国航	524,300	3,848,362.00	0.58
54	601088	中国神华	122,000	3,824,700.00	0.57
55	603885	吉祥航空	312,999	3,755,988.00	0.56
56	000933	神火股份	223,400	3,753,120.00	0.56
57	688596	正帆科技	90,000	3,566,700.00	0.53
58	600886	国投电力	270,600	3,566,508.00	0.53
59	000002	万科 A	327,400	3,424,604.00	0.51
60	600741	华域汽车	209,800	3,415,544.00	0.51
61	600015	华夏银行	598,100	3,361,322.00	0.50
62	600096	云天化	207,000	3,229,200.00	0.48
63	600755	厦门国贸	461,800	3,218,746.00	0.48
64	000625	长安汽车	185,900	3,128,697.00	0.47
65	600057	厦门象屿	452,900	3,038,959.00	0.45
66	600803	新奥股份	180,200	3,030,964.00	0.45
67	000977	浪潮信息	89,500	2,971,400.00	0.44
68	601225	陕西煤业	138,800	2,899,532.00	0.43
69	600111	北方稀土	149,100	2,883,594.00	0.43
70	600546	山煤国际	163,600	2,864,636.00	0.43
71	601898	中煤能源	295,000	2,858,550.00	0.43
72	600985	淮北矿业	169,500	2,818,785.00	0.42
73	600809	山西汾酒	12,000	2,768,760.00	0.41
74	601666	平煤股份	234,800	2,714,288.00	0.41
75	603799	华友钴业	81,200	2,673,916.00	0.40
76	002371	北方华创	10,800	2,653,668.00	0.40
77	688516	奥特维	29,300	2,651,650.00	0.40
78	300015	爱尔眼科	167,600	2,651,432.00	0.40
79	000090	天健集团	574,000	2,640,400.00	0.39
80	601117	中国化学	412,100	2,620,956.00	0.39
81	300122	智飞生物	42,800	2,615,508.00	0.39
82	601169	北京银行	576,900	2,613,357.00	0.39

83	603501	韦尔股份	24,200	2,582,382.00	0.39
84	601229	上海银行	431,300	2,574,861.00	0.38
85	600170	上海建工	1,096,700	2,566,278.00	0.38
86	601601	中国太保	105,500	2,508,790.00	0.37
87	600016	民生银行	670,300	2,506,922.00	0.37
88	300751	迈为股份	19,300	2,499,543.00	0.37
89	601919	中远海控	260,600	2,496,548.00	0.37
90	002129	TCL 中环	152,875	2,390,965.00	0.36
91	601077	渝农商行	575,600	2,348,448.00	0.35
92	000792	盐湖股份	146,400	2,335,080.00	0.35
93	603993	洛阳钼业	447,100	2,324,920.00	0.35
94	601997	贵阳银行	424,000	2,179,360.00	0.33
95	688556	高测股份	55,001	2,144,488.99	0.32
96	600872	中炬高新	75,500	2,121,550.00	0.32
97	600436	片仔癀	8,700	2,105,313.00	0.31
98	688012	中微公司	13,500	2,073,600.00	0.31
99	300724	捷佳伟创	27,900	2,064,879.00	0.31
100	688041	海光信息	29,000	2,058,420.00	0.31
101	605499	东鹏饮料	11,200	2,044,112.00	0.31
102	600029	南方航空	353,200	2,034,432.00	0.30
103	600050	中国联通	458,400	2,007,792.00	0.30
104	300014	亿纬锂能	47,100	1,987,620.00	0.30
105	688111	金山办公	6,100	1,928,820.00	0.29
106	002241	歌尔股份	91,700	1,926,617.00	0.29
107	600115	中国东航	484,300	1,879,084.00	0.28
108	002460	赣锋锂业	42,100	1,801,880.00	0.27
109	300782	卓胜微	12,700	1,790,700.00	0.27
110	603986	兆易创新	19,200	1,773,888.00	0.27
111	000661	长春高新	11,200	1,632,960.00	0.24
112	002049	紫光国微	24,200	1,632,290.00	0.24
113	688271	联影医疗	11,800	1,616,718.00	0.24
114	600900	长江电力	66,618	1,554,864.12	0.23
115	600582	天地科技	276,900	1,506,336.00	0.23
116	000895	双汇发展	54,100	1,445,011.00	0.22
117	688599	天合光能	50,600	1,443,618.00	0.22
118	300776	帝尔激光	23,300	1,404,058.00	0.21
119	301030	仕净科技	30,900	1,288,530.00	0.19
120	601231	环旭电子	84,800	1,281,328.00	0.19
121	002812	恩捷股份	22,300	1,267,086.00	0.19
122	688223	晶科能源	143,000	1,266,980.00	0.19
123	603283	赛腾股份	17,100	1,240,776.00	0.19
124	600547	山东黄金	53,500	1,223,545.00	0.18
125	000301	东方盛虹	127,200	1,221,120.00	0.18

126	002493	荣盛石化	115,900	1,199,565.00	0.18
127	300033	同花顺	7,500	1,176,525.00	0.18
128	002997	瑞鹤模具	34,600	1,152,872.00	0.17
129	600779	水井坊	19,450	1,143,076.50	0.17
130	002709	天赐材料	44,600	1,118,568.00	0.17
131	300820	英杰电气	17,500	1,002,400.00	0.15
132	601995	中金公司	25,400	966,470.00	0.14
133	601398	工商银行	201,700	964,126.00	0.14
134	002919	名臣健康	37,500	961,500.00	0.14
135	601881	中国银河	79,300	955,565.00	0.14
136	600188	兖矿能源	48,100	952,861.00	0.14
137	601328	交通银行	155,623	893,276.02	0.13
138	601788	光大证券	57,200	882,024.00	0.13
139	603806	福斯特	33,000	800,910.00	0.12
140	601066	中信建投	33,400	790,244.00	0.12
141	601100	恒立液压	14,200	776,456.00	0.12
142	603392	万泰生物	10,200	766,326.00	0.11
143	300795	米奥会展	20,500	755,835.00	0.11
144	603886	元祖股份	39,200	714,616.00	0.11
145	600742	一汽富维	73,800	704,790.00	0.11
146	002394	联发股份	83,200	691,392.00	0.10
147	300450	先导智能	25,700	657,920.00	0.10
148	300771	智莱科技	60,200	654,374.00	0.10
149	688303	大全能源	21,967	649,564.19	0.10
150	603920	世运电路	35,300	645,284.00	0.10
151	600219	南山铝业	218,100	641,214.00	0.10
152	301004	嘉益股份	13,400	609,030.00	0.09
153	603659	璞泰来	27,500	575,575.00	0.09
154	601728	中国电信	105,700	571,837.00	0.09
155	600362	江西铜业	31,900	569,734.00	0.09
156	603208	江山欧派	18,900	561,141.00	0.08
157	000708	中信特钢	39,300	551,772.00	0.08
158	600998	九州通	76,738	537,933.38	0.08
159	603102	百合股份	13,800	535,164.00	0.08
160	600919	江苏银行	78,942	528,121.98	0.08
161	300532	今天国际	32,000	525,440.00	0.08
162	002756	永兴材料	10,000	522,100.00	0.08
163	300772	运达股份	48,900	520,296.00	0.08
164	000877	天山股份	76,600	511,688.00	0.08
165	603057	紫燕食品	23,600	509,288.00	0.08
166	601668	中国建筑	105,700	508,417.00	0.08
167	000526	学大教育	9,900	494,901.00	0.07
168	002158	汉钟精机	22,000	489,720.00	0.07

169	601607	上海医药	29,000	485,170.00	0.07
170	601988	中国银行	121,100	483,189.00	0.07
171	688278	特宝生物	8,858	463,716.30	0.07
172	603063	禾望电气	18,100	452,500.00	0.07
173	603185	弘元绿能	13,493	449,047.04	0.07
174	600837	海通证券	47,300	443,201.00	0.07
175	000719	中原传媒	45,500	442,715.00	0.07
176	300515	三德科技	37,900	437,366.00	0.07
177	000789	万年青	63,300	434,238.00	0.06
178	002739	万达电影	33,300	433,566.00	0.06
179	601688	华泰证券	31,000	432,450.00	0.06
180	600585	海螺水泥	18,900	426,384.00	0.06
181	600048	保利发展	42,700	422,730.00	0.06
182	300390	天华新能	16,500	418,275.00	0.06
183	600312	平高电气	32,700	414,963.00	0.06
184	605098	行动教育	10,700	412,485.00	0.06
185	601006	大秦铁路	56,200	405,202.00	0.06
186	603260	合盛硅业	7,900	402,900.00	0.06
187	301257	普蕊斯	6,300	400,050.00	0.06
188	605336	帅丰电器	26,700	397,296.00	0.06
189	688080	映翰通	9,464	384,049.12	0.06
190	300645	正元智慧	21,100	383,809.00	0.06
191	600000	浦发银行	56,400	373,368.00	0.06
192	601211	国泰君安	25,000	372,000.00	0.06
193	688127	蓝特光学	15,948	371,428.92	0.06
194	000521	长虹美菱	65,500	368,765.00	0.06
195	002938	鹏鼎控股	16,300	363,816.00	0.05
196	601009	南京银行	49,000	361,620.00	0.05
197	002991	甘源食品	5,000	357,300.00	0.05
198	601186	中国铁建	45,100	343,211.00	0.05
199	301046	能辉科技	12,600	341,712.00	0.05
200	601717	郑煤机	26,900	340,285.00	0.05
201	300217	东方电热	63,000	338,940.00	0.05
202	688489	三未信安	7,200	338,544.00	0.05
203	688078	龙软科技	8,352	336,752.64	0.05
204	688510	航亚科技	18,900	333,018.00	0.05
205	603197	保隆科技	5,900	332,760.00	0.05
206	605116	奥锐特	12,800	330,496.00	0.05
207	601633	长城汽车	13,100	330,382.00	0.05
208	000655	金岭矿业	46,000	329,820.00	0.05
209	601877	正泰电器	15,300	329,103.00	0.05
210	300787	海能实业	19,400	326,308.00	0.05
211	000543	皖能电力	51,800	324,268.00	0.05

212	600966	博汇纸业	52,200	324,162.00	0.05
213	600612	老凤祥	4,600	317,400.00	0.05
214	000586	汇源通信	25,200	317,016.00	0.05
215	300280	紫天科技	7,400	316,202.00	0.05
216	601766	中国中车	57,900	304,554.00	0.05
217	300789	唐源电气	13,500	304,290.00	0.05
218	600271	航天信息	28,500	303,240.00	0.05
219	600732	爱旭股份	17,100	301,644.00	0.05
220	601390	中国中铁	52,900	300,472.00	0.04
221	300922	天秦装备	17,500	298,725.00	0.04
222	688439	振华风光	3,300	294,063.00	0.04
223	601699	潞安环能	13,400	293,594.00	0.04
224	603080	新疆火炬	17,600	293,216.00	0.04
225	000589	贵州轮胎	46,800	286,416.00	0.04
226	600019	宝钢股份	47,800	283,454.00	0.04
227	600511	国药股份	9,900	283,338.00	0.04
228	600027	华电国际	53,400	274,476.00	0.04
229	601658	邮储银行	61,400	267,090.00	0.04
230	002932	明德生物	11,472	263,511.84	0.04
231	601939	建设银行	39,700	258,447.00	0.04
232	300389	艾比森	14,600	253,164.00	0.04
233	002506	协鑫集成	92,100	252,354.00	0.04
234	002519	银河电子	40,300	248,651.00	0.04
235	688011	新光光电	10,272	242,932.80	0.04
236	600737	中粮糖业	29,100	239,784.00	0.04
237	603829	洛凯股份	14,600	238,418.00	0.04
238	601865	福莱特	8,900	237,630.00	0.04
239	603928	兴业股份	17,700	236,649.00	0.04
240	300543	朗科智能	21,528	235,085.76	0.04
241	603937	丽岛新材	18,500	234,395.00	0.04
242	603508	思维列控	14,900	233,930.00	0.03
243	600528	中铁工业	31,200	232,128.00	0.03
244	300118	东方日升	13,000	229,450.00	0.03
245	603585	苏利股份	16,000	228,960.00	0.03
246	002696	百洋股份	34,500	228,390.00	0.03
247	601388	怡球资源	87,100	228,202.00	0.03
248	300562	乐心医疗	19,800	225,918.00	0.03
249	600761	安徽合力	12,400	225,804.00	0.03
250	003019	宸展光电	9,950	224,870.00	0.03
251	688393	安必平	9,000	224,730.00	0.03
252	301182	凯旺科技	9,600	224,448.00	0.03
253	300763	锦浪科技	3,200	223,680.00	0.03
254	000049	德赛电池	8,210	222,655.20	0.03

255	688390	固德威	1,700	221,986.00	0.03
256	000983	山西焦煤	22,400	221,312.00	0.03
257	000591	太阳能	38,900	217,062.00	0.03
258	600497	驰宏锌锗	42,800	216,140.00	0.03
259	601336	新华保险	6,900	214,797.00	0.03
260	600161	天坛生物	6,900	213,486.00	0.03
261	301269	华大九天	2,000	211,700.00	0.03
262	601319	中国人保	43,700	211,508.00	0.03
263	600901	江苏金租	41,900	202,796.00	0.03
264	600760	中航沈飞	4,800	202,464.00	0.03
265	603199	九华旅游	7,300	189,435.00	0.03
266	603589	口子窖	4,100	185,730.00	0.03
267	603103	横店影视	10,400	184,912.00	0.03
268	002748	世龙实业	15,400	180,950.00	0.03
269	600926	杭州银行	17,900	179,179.00	0.03
270	600269	赣粤高速	43,200	177,552.00	0.03
271	600970	中材国际	19,000	177,460.00	0.03
272	002820	桂发祥	15,100	172,442.00	0.03
273	688589	力合微	4,302	171,692.82	0.03
274	603099	长白山	11,300	169,274.00	0.03
275	603301	振德医疗	6,900	169,050.00	0.03
276	688056	莱伯泰科	5,000	167,550.00	0.03
277	002483	润邦股份	32,000	167,040.00	0.02
278	002788	鹭燕医药	18,500	166,315.00	0.02
279	000028	国药一致	5,700	165,243.00	0.02
280	688408	中信博	2,300	165,025.00	0.02
281	600132	重庆啤酒	2,400	159,480.00	0.02
282	688113	联测科技	3,400	157,896.00	0.02
283	600750	江中药业	7,500	156,600.00	0.02
284	688288	鸿泉物联	6,572	156,150.72	0.02
285	600876	凯盛新能	11,100	155,733.00	0.02
286	002056	横店东磁	11,500	155,710.00	0.02
287	002114	罗平锌电	20,800	155,584.00	0.02
288	002743	富煌钢构	25,900	154,882.00	0.02
289	605259	绿田机械	6,800	154,360.00	0.02
290	603681	永冠新材	10,200	154,020.00	0.02
291	600537	亿晶光电	27,900	153,729.00	0.02
292	603182	嘉华股份	10,400	153,608.00	0.02
293	300828	锐新科技	9,800	153,272.00	0.02
294	301042	安联锐视	3,900	152,880.00	0.02
295	301290	东星医疗	5,500	151,745.00	0.02
296	600356	恒丰纸业	19,000	151,620.00	0.02
297	300109	新开源	8,400	151,536.00	0.02

298	000875	吉电股份	34,400	151,360.00	0.02
299	600039	四川路桥	20,200	151,298.00	0.02
300	001218	丽臣实业	7,000	151,270.00	0.02
301	600833	第一医药	12,500	150,250.00	0.02
302	000623	吉林敖东	9,900	149,886.00	0.02
303	600433	冠豪高新	43,300	149,818.00	0.02
304	601838	成都银行	13,200	148,632.00	0.02
305	300295	三六五网	12,000	147,960.00	0.02
306	601518	吉林高速	57,500	146,625.00	0.02
307	603611	诺力股份	7,700	145,761.00	0.02
308	688466	金科环境	8,200	145,550.00	0.02
309	600744	华银电力	44,900	145,476.00	0.02
310	601778	晶科科技	41,300	144,550.00	0.02
311	002911	佛燃能源	12,600	144,396.00	0.02
312	000862	银星能源	23,700	144,333.00	0.02
313	300453	三鑫医疗	18,900	144,207.00	0.02
314	600403	大有能源	37,400	142,120.00	0.02
315	000700	模塑科技	20,200	141,400.00	0.02
316	603551	奥普家居	13,200	139,788.00	0.02
317	002865	钧达股份	1,800	139,464.00	0.02
318	002617	露笑科技	22,300	138,260.00	0.02
319	601998	中信银行	26,000	137,540.00	0.02
320	002815	崇达技术	14,300	136,994.00	0.02
321	002610	爱康科技	62,400	134,784.00	0.02
322	600821	金开新能	22,000	134,640.00	0.02
323	688598	金博股份	1,900	132,810.00	0.02
324	600481	双良节能	15,400	130,284.00	0.02
325	001965	招商公路	13,100	127,987.00	0.02
326	600176	中国巨石	12,900	126,807.00	0.02
327	603919	金徽酒	5,100	125,562.00	0.02
328	601163	三角轮胎	8,600	123,926.00	0.02
329	601222	林洋能源	19,200	122,688.00	0.02
330	002335	科华数据	4,400	121,792.00	0.02
331	601098	中南传媒	11,800	120,006.00	0.02
332	300393	中来股份	11,600	119,944.00	0.02
333	603368	柳药集团	6,300	119,196.00	0.02
334	601618	中国中冶	38,600	118,116.00	0.02
335	603323	苏农银行	28,300	117,728.00	0.02
336	600908	无锡银行	23,100	116,655.00	0.02
337	002839	张家港行	30,000	116,400.00	0.02
338	300655	晶瑞电材	11,800	114,814.00	0.02
339	002841	视源股份	2,500	114,400.00	0.02
340	000012	南玻 A	19,500	108,615.00	0.02

341	603661	恒林股份	2,400	106,968.00	0.02
342	600702	舍得酒业	1,100	106,370.00	0.02
343	002079	苏州固锴	9,400	106,032.00	0.02
344	600888	新疆众和	14,600	105,704.00	0.02
345	301195	北路智控	2,600	105,508.00	0.02
346	000751	锌业股份	32,400	105,300.00	0.02
347	601579	会稽山	9,800	105,252.00	0.02
348	002302	西部建设	16,100	104,328.00	0.02
349	688391	钜泉科技	2,100	104,160.00	0.02
350	300668	杰恩设计	4,200	103,320.00	0.02
351	688586	江航装备	9,300	103,137.00	0.02
352	300388	节能国祯	15,900	102,237.00	0.02
353	000404	长虹华意	17,200	101,308.00	0.02
354	002811	郑中设计	10,100	99,485.00	0.01
355	603212	赛伍技术	5,700	99,009.00	0.01
356	300860	锋尚文化	1,800	98,334.00	0.01
357	600586	金晶科技	14,600	97,528.00	0.01
358	002130	沃尔核材	12,900	97,395.00	0.01
359	300870	欧陆通	2,200	97,394.00	0.01
360	600151	航天机电	14,700	96,873.00	0.01
361	002045	国光电器	5,800	96,570.00	0.01
362	601137	博威合金	6,200	96,286.00	0.01
363	600754	锦江酒店	3,200	95,680.00	0.01
364	688093	世华科技	5,166	94,072.86	0.01
365	002518	科士达	3,400	93,840.00	0.01
366	300827	上能电气	3,100	93,806.00	0.01
367	688168	安博通	2,584	93,437.44	0.01
368	603348	文灿股份	2,400	93,120.00	0.01
369	002069	獐子岛	20,600	92,494.00	0.01
370	688128	中国电研	4,500	92,340.00	0.01
371	688060	云涌科技	1,946	91,247.94	0.01
372	300893	松原股份	3,100	90,613.00	0.01
373	603917	合力科技	5,100	90,576.00	0.01
374	601908	京运通	19,800	90,486.00	0.01
375	002732	燕塘乳业	4,700	90,240.00	0.01
376	688051	佳华科技	2,700	90,045.00	0.01
377	300689	澄天伟业	4,600	89,102.00	0.01
378	601801	皖新传媒	12,800	88,960.00	0.01
379	300094	国联水产	18,900	88,830.00	0.01
380	002978	安宁股份	2,800	88,648.00	0.01
381	300726	宏达电子	2,900	87,551.00	0.01
382	002955	鸿合科技	2,700	87,237.00	0.01
383	603871	嘉友国际	5,500	87,230.00	0.01

384	600826	兰生股份	9,800	86,632.00	0.01
385	301153	中科江南	1,100	86,097.00	0.01
386	003022	联泓新科	4,700	86,057.00	0.01
387	300622	博士眼镜	4,300	85,269.00	0.01
388	002225	濮耐股份	22,500	85,050.00	0.01
389	001217	华尔泰	6,000	84,720.00	0.01
390	301061	匠心家居	1,700	84,575.00	0.01
391	300557	理工光科	2,400	84,552.00	0.01
392	002080	中材科技	5,300	84,376.00	0.01
393	000777	中核科技	5,800	84,332.00	0.01
394	000548	湖南投资	15,400	83,930.00	0.01
395	300234	开尔新材	16,000	83,360.00	0.01
396	605389	长龄液压	3,100	82,956.00	0.01
397	601168	西部矿业	5,800	82,766.00	0.01
398	600983	惠而浦	9,300	82,677.00	0.01
399	601702	华峰铝业	4,600	82,570.00	0.01
400	000619	海螺新材	11,900	82,348.00	0.01
401	002906	华阳集团	2,300	81,075.00	0.01
402	003035	南网能源	15,400	81,004.00	0.01
403	688226	威腾电气	4,300	80,840.00	0.01
404	300801	泰和科技	4,700	80,746.00	0.01
405	600085	同仁堂	1,500	80,550.00	0.01
406	600018	上港集团	16,400	80,360.00	0.01
407	300174	元力股份	5,000	80,050.00	0.01
408	688273	麦澜德	2,400	79,944.00	0.01
409	603628	清源股份	3,800	79,800.00	0.01
410	600319	亚星化学	13,800	79,764.00	0.01
411	600714	金瑞矿业	8,300	79,680.00	0.01
412	002607	中公教育	19,400	79,152.00	0.01
413	603698	航天工程	5,500	79,035.00	0.01
414	688267	中触媒	4,100	78,802.00	0.01
415	688077	大地熊	3,300	78,705.00	0.01
416	601860	紫金银行	31,100	78,683.00	0.01
417	603519	立霸股份	6,000	78,240.00	0.01
418	300871	回盛生物	5,400	78,084.00	0.01
419	301388	欣灵电气	3,200	78,048.00	0.01
420	002332	仙琚制药	6,100	77,897.00	0.01
421	600072	中船科技	4,200	77,868.00	0.01
422	300641	正丹股份	13,800	77,832.00	0.01
423	688069	德林海	3,900	77,532.00	0.01
424	002731	萃华珠宝	7,000	77,420.00	0.01
425	600063	皖维高新	18,000	77,400.00	0.01
426	688285	高铁电气	8,700	77,256.00	0.01

427	600038	中直股份	2,000	77,060.00	0.01
428	603655	朗博科技	3,700	77,034.00	0.01
429	301115	建科股份	4,300	76,970.00	0.01
430	002802	洪汇新材	6,000	76,860.00	0.01
431	002014	永新股份	9,200	76,820.00	0.01
432	600757	长江传媒	10,300	76,735.00	0.01
433	600502	安徽建工	16,500	76,725.00	0.01
434	000498	山东路桥	13,600	76,704.00	0.01
435	002060	粤水电	15,600	76,596.00	0.01
436	300800	力合科技	5,600	76,552.00	0.01
437	002718	友邦吊顶	4,500	76,545.00	0.01
438	603396	金辰股份	1,400	76,510.00	0.01
439	002105	信隆健康	11,800	76,464.00	0.01
440	000990	诚志股份	9,300	76,353.00	0.01
441	002715	登云股份	4,700	76,281.00	0.01
442	002809	红墙股份	7,000	76,160.00	0.01
443	000881	中广核技	10,500	76,125.00	0.01
444	301090	华润材料	7,000	76,020.00	0.01
445	000811	冰轮环境	5,600	75,992.00	0.01
446	300024	机器人	6,400	75,968.00	0.01
447	003002	壶化股份	5,000	75,950.00	0.01
448	300818	耐普矿机	2,300	75,923.00	0.01
449	688026	洁特生物	4,400	75,856.00	0.01
450	600971	恒源煤电	6,800	75,820.00	0.01
451	301256	华融化学	9,200	75,716.00	0.01
452	301212	联盛化学	2,800	75,600.00	0.01
453	002136	安纳达	6,500	75,530.00	0.01
454	688622	禾信仪器	2,100	75,495.00	0.01
455	002258	利尔化学	6,300	75,411.00	0.01
456	603041	美思德	5,600	75,376.00	0.01
457	001208	华菱线缆	8,100	75,249.00	0.01
458	002320	海峡股份	12,900	75,207.00	0.01
459	600510	黑牡丹	13,300	75,145.00	0.01
460	600697	欧亚集团	5,900	75,107.00	0.01
461	000930	中粮科技	11,300	75,032.00	0.01
461	601330	绿色动力	11,300	75,032.00	0.01
462	002612	朗姿股份	3,900	74,997.00	0.01
463	688420	美腾科技	2,900	74,936.00	0.01
464	002109	兴化股份	15,800	74,892.00	0.01
464	601568	北元集团	15,800	74,892.00	0.01
465	002479	富春环保	15,700	74,889.00	0.01
466	300851	交大思诺	2,400	74,808.00	0.01
467	002140	东华科技	8,800	74,800.00	0.01

468	603060	国检集团	8,900	74,760.00	0.01
469	600736	苏州高新	15,700	74,732.00	0.01
470	688216	气派科技	2,700	74,709.00	0.01
471	605099	共创草坪	3,700	74,666.00	0.01
472	603167	渤海轮渡	8,400	74,592.00	0.01
473	000695	滨海能源	6,900	74,589.00	0.01
474	601963	重庆银行	10,700	74,472.00	0.01
475	002039	黔源电力	5,400	74,466.00	0.01
476	603908	牧高笛	2,000	74,420.00	0.01
477	300425	中建环能	15,900	74,412.00	0.01
478	600791	京能置业	15,300	74,358.00	0.01
479	000962	东方钨业	6,000	74,340.00	0.01
480	002789	建艺集团	5,400	74,304.00	0.01
480	600889	南京化纤	12,900	74,304.00	0.01
481	600928	西安银行	22,300	74,259.00	0.01
482	002707	众信旅游	10,400	74,256.00	0.01
483	600881	亚泰集团	38,000	74,100.00	0.01
484	002061	浙江交科	20,300	74,095.00	0.01
485	600665	天地源	19,600	74,088.00	0.01
486	000402	金融街	20,400	74,052.00	0.01
487	600648	外高桥	7,500	73,950.00	0.01
488	002167	东方锆业	11,500	73,945.00	0.01
489	000850	华茂股份	19,400	73,914.00	0.01
490	600561	江西长运	11,500	73,830.00	0.01
491	600281	华阳新材	15,900	73,776.00	0.01
492	601588	北辰实业	38,800	73,720.00	0.01
493	000720	新能泰山	17,800	73,692.00	0.01
493	300981	中红医疗	4,600	73,692.00	0.01
494	001338	永顺泰	6,100	73,566.00	0.01
495	600622	光大嘉宝	28,500	73,530.00	0.01
496	002296	辉煌科技	8,900	73,425.00	0.01
497	002006	精工科技	4,800	73,344.00	0.01
498	000900	现代投资	18,700	73,304.00	0.01
499	600743	华远地产	47,900	73,287.00	0.01
500	300243	瑞丰高材	7,500	73,275.00	0.01
501	688456	有研粉材	2,600	73,242.00	0.01
502	300808	久量股份	4,700	73,226.00	0.01
503	603369	今世缘	1,500	73,125.00	0.01
504	001210	金房能源	3,700	73,075.00	0.01
505	605189	富春染织	4,500	72,900.00	0.01
506	301109	军信股份	4,600	72,680.00	0.01
507	002627	三峡旅游	13,600	72,624.00	0.01
508	300286	安科瑞	2,800	72,604.00	0.01

509	000608	阳光股份	25,200	72,576.00	0.01
510	603221	爱丽家居	7,300	72,562.00	0.01
511	000926	福星股份	17,400	72,558.00	0.01
512	601512	中新集团	9,400	72,474.00	0.01
513	600611	大众交通	24,300	72,414.00	0.01
514	002826	易明医药	6,100	72,407.00	0.01
515	300498	温氏股份	3,600	72,216.00	0.01
516	301019	宁波色母	3,000	72,090.00	0.01
517	300446	航天智造	4,600	72,082.00	0.01
518	000517	荣安地产	29,400	72,030.00	0.01
519	600236	桂冠电力	13,000	72,020.00	0.01
520	000899	赣能股份	9,300	71,982.00	0.01
521	002757	南兴股份	4,600	71,944.00	0.01
522	001336	楚环科技	2,500	71,800.00	0.01
523	688375	国博电子	900	71,577.00	0.01
524	688682	霍莱沃	1,500	71,565.00	0.01
525	002998	优彩资源	9,000	71,550.00	0.01
526	002559	亚威股份	6,200	71,486.00	0.01
527	000553	安道麦 A	10,300	71,482.00	0.01
528	605158	华达新材	9,400	71,440.00	0.01
529	000561	烽火电子	8,500	71,400.00	0.01
530	600716	凤凰股份	19,400	71,392.00	0.01
531	600033	福建高速	23,000	71,300.00	0.01
532	002017	东信和平	6,800	70,788.00	0.01
533	600593	大连圣亚	3,600	70,776.00	0.01
534	600256	广汇能源	9,900	70,686.00	0.01
535	300396	迪瑞医疗	2,400	70,680.00	0.01
536	002030	达安基因	7,300	70,664.00	0.01
537	002072	凯瑞德	11,500	70,610.00	0.01
538	300753	爱朋医疗	4,100	70,397.00	0.01
539	300864	南大环境	3,200	70,112.00	0.01
540	000761	本钢板材	19,600	69,972.00	0.01
541	002828	贝肯能源	6,700	69,881.00	0.01
542	000596	古井贡酒	300	69,840.00	0.01
543	600345	长江通信	3,600	69,732.00	0.01
544	002623	亚玛顿	2,600	69,550.00	0.01
545	688058	宝兰德	1,472	69,493.12	0.01
546	688386	泛亚微透	1,700	69,360.00	0.01
547	300534	陇神戎发	7,000	69,090.00	0.01
548	688606	奥泰生物	1,000	68,600.00	0.01
549	002993	奥海科技	1,800	68,580.00	0.01
550	601339	百隆东方	14,000	68,180.00	0.01
551	300696	爱乐达	3,900	67,899.00	0.01

552	000004	国网网安	4,200	67,746.00	0.01
553	000520	凤凰航运	24,400	67,588.00	0.01
554	600686	金龙汽车	8,900	67,373.00	0.01
555	603679	华体科技	4,500	67,185.00	0.01
556	002076	星光股份	30,100	67,123.00	0.01
557	601798	蓝科高新	8,800	66,968.00	0.01
558	000070	特发信息	8,400	66,696.00	0.01
559	600467	好当家	27,900	66,402.00	0.01
560	002930	宏川智慧	3,400	65,926.00	0.01
561	601619	嘉泽新能	18,600	65,658.00	0.01
562	600032	浙江新能	8,100	65,286.00	0.01
563	000915	华特达因	2,200	63,712.00	0.01
564	601500	通用股份	15,300	63,342.00	0.01
565	002316	亚联发展	12,100	63,041.00	0.01
566	000550	江铃汽车	3,200	60,896.00	0.01
567	000798	中水渔业	6,800	60,452.00	0.01
568	300291	百纳千成	9,200	59,248.00	0.01
569	600098	广州发展	11,000	59,070.00	0.01
570	002218	拓日新能	12,900	58,179.00	0.01
571	603859	能科科技	1,500	56,595.00	0.01
572	688159	有方科技	1,500	56,475.00	0.01
573	300528	幸福蓝海	5,300	56,339.00	0.01
574	600257	大湖股份	9,100	56,147.00	0.01
575	603105	芯能科技	4,800	55,584.00	0.01
576	603639	海利尔	3,500	54,950.00	0.01
577	688680	海优新材	800	52,520.00	0.01
578	600097	开创国际	4,600	49,174.00	0.01
579	002043	兔宝宝	5,500	48,730.00	0.01
580	300080	易成新能	10,000	48,400.00	0.01
581	002986	宇新股份	3,100	48,360.00	0.01
582	603398	沐邦高科	2,700	48,357.00	0.01
583	002897	意华股份	1,300	48,308.00	0.01
584	300447	全信股份	3,200	46,400.00	0.01
585	601019	山东出版	4,800	45,024.00	0.01
586	002393	力生制药	1,700	44,370.00	0.01
587	600636	国新文化	4,200	44,268.00	0.01
588	000848	承德露露	5,600	43,960.00	0.01
589	002311	海大集团	978	43,921.98	0.01
590	002327	富安娜	4,900	43,855.00	0.01
591	601000	唐山港	12,500	43,750.00	0.01
592	603758	秦安股份	3,800	43,472.00	0.01
593	300317	珈伟新能	8,300	42,247.00	0.01
594	002922	伊戈尔	2,800	41,580.00	0.01

595	603507	振江股份	1,600	41,456.00	0.01
596	002480	新筑股份	8,100	40,986.00	0.01
597	002646	天佑德酒	3,000	40,830.00	0.01
598	301526	国际复材	9,037	40,214.65	0.01
599	600461	洪城环境	4,300	39,302.00	0.01
600	600479	千金药业	3,600	38,772.00	0.01
601	002729	好利科技	1,700	38,692.00	0.01
602	001269	欧晶科技	700	37,415.00	0.01
603	000951	中国重汽	2,800	37,408.00	0.01
604	688560	明冠新材	2,000	37,240.00	0.01
605	600135	乐凯胶片	4,500	36,315.00	0.01
606	603938	三孚股份	2,000	35,960.00	0.01
607	600207	安彩高科	7,500	35,775.00	0.01
608	000048	京基智农	1,900	34,770.00	0.01
609	000762	西藏矿业	1,200	34,320.00	0.01
610	300269	联建光电	6,100	33,672.00	0.01
611	300456	赛微电子	1,400	33,656.00	0.01
612	601038	一拖股份	2,300	33,511.00	0.01
613	600012	皖通高速	3,000	33,060.00	0.00
614	600335	国机汽车	3,700	32,930.00	0.00
615	603013	亚普股份	1,900	32,832.00	0.00
616	300757	罗博特科	400	32,556.00	0.00
617	300602	飞荣达	1,800	32,526.00	0.00
618	603093	南华期货	2,700	32,400.00	0.00
619	688722	同益中	2,100	32,130.00	0.00
620	000922	佳电股份	3,100	31,837.00	0.00
621	688218	江苏北人	1,600	31,792.00	0.00
622	603366	日出东方	5,100	31,773.00	0.00
623	002529	海源复材	2,500	31,700.00	0.00
624	600318	新力金融	4,500	31,590.00	0.00
625	002969	嘉美包装	7,600	31,312.00	0.00
626	300467	迅游科技	1,800	31,284.00	0.00
627	603357	设计总院	3,500	31,150.00	0.00
628	000731	四川美丰	4,200	31,080.00	0.00
629	300621	维业股份	2,700	31,023.00	0.00
630	600230	沧州大化	2,300	30,981.00	0.00
631	600469	风神股份	5,000	30,850.00	0.00
632	601975	招商南油	11,000	30,800.00	0.00
633	688246	嘉和美康	919	30,712.98	0.00
634	600685	中船防务	1,200	30,660.00	0.00
635	002535	林州重机	6,600	30,624.00	0.00
636	600094	大名城	10,200	30,600.00	0.00
637	600391	航发科技	1,600	30,592.00	0.00

638	600790	轻纺城	7,700	30,569.00	0.00
639	600820	隧道股份	5,300	30,528.00	0.00
640	600508	上海能源	2,200	30,492.00	0.00
641	002165	红宝丽	7,200	30,456.00	0.00
642	300070	碧水源	6,100	30,439.00	0.00
643	002419	天虹股份	5,500	30,415.00	0.00
644	688136	科兴制药	1,500	30,375.00	0.00
645	601236	红塔证券	4,000	30,360.00	0.00
646	600320	振华重工	9,100	30,212.00	0.00
647	603466	风语筑	2,100	30,198.00	0.00
648	300985	致远新能	800	30,168.00	0.00
649	002196	方正电机	4,200	30,156.00	0.00
650	000727	冠捷科技	11,200	30,016.00	0.00
650	600428	中远海特	5,600	30,016.00	0.00
651	600824	益民集团	7,800	29,874.00	0.00
652	002437	誉衡药业	11,900	29,869.00	0.00
653	000999	华润三九	600	29,838.00	0.00
654	000523	红棉股份	9,500	29,830.00	0.00
655	688425	铁建重工	7,500	29,775.00	0.00
656	300350	华鹏飞	5,800	29,754.00	0.00
657	600328	中盐化工	3,800	29,716.00	0.00
658	600583	海油工程	5,000	29,700.00	0.00
659	600787	中储股份	5,800	29,580.00	0.00
660	601918	新集能源	5,600	29,512.00	0.00
661	600307	酒钢宏兴	19,800	29,502.00	0.00
662	600458	时代新材	3,200	29,472.00	0.00
663	600101	明星电力	3,500	29,435.00	0.00
664	600035	楚天高速	7,700	29,414.00	0.00
665	002131	利欧股份	12,900	29,412.00	0.00
666	603136	天目湖	1,600	29,392.00	0.00
667	600054	黄山旅游	2,700	29,376.00	0.00
667	600977	中国电影	2,400	29,376.00	0.00
668	000530	冰山冷热	5,500	29,370.00	0.00
669	688336	三生国健	1,300	29,263.00	0.00
670	000928	中钢国际	5,000	29,150.00	0.00
671	002481	双塔食品	6,600	29,106.00	0.00
672	000059	华锦股份	5,300	29,097.00	0.00
673	600710	苏美达	4,100	29,069.00	0.00
674	688578	艾力斯	697	29,037.02	0.00
675	002233	塔牌集团	4,100	29,028.00	0.00
676	002314	南山控股	10,000	29,000.00	0.00
677	300043	星辉娱乐	7,800	28,938.00	0.00
678	600262	北方股份	1,500	28,875.00	0.00

679	600570	恒生电子	1,000	28,760.00	0.00
680	002418	康盛股份	10,300	28,737.00	0.00
681	002106	莱宝高科	2,700	28,728.00	0.00
681	600501	航天晨光	2,100	28,728.00	0.00
681	601968	宝钢包装	5,600	28,728.00	0.00
682	688707	振华新材	1,400	28,700.00	0.00
683	600698	湖南天雁	5,100	28,662.00	0.00
684	000026	飞亚达	2,600	28,496.00	0.00
685	600420	国药现代	2,900	28,391.00	0.00
686	002791	坚朗五金	700	28,343.00	0.00
687	600850	电科数字	1,300	28,275.00	0.00
688	605365	立达信	1,500	27,915.00	0.00
689	688235	百济神州	200	27,808.00	0.00
690	002046	国机精工	2,400	27,720.00	0.00
691	002223	鱼跃医疗	800	27,664.00	0.00
692	603160	汇顶科技	400	27,640.00	0.00
693	300017	网宿科技	3,500	27,475.00	0.00
694	300872	天阳科技	2,000	27,360.00	0.00
695	000151	中成股份	2,400	27,192.00	0.00
696	688256	寒武纪	200	26,992.00	0.00
697	300623	捷捷微电	1,700	26,979.00	0.00
698	600706	曲江文旅	1,800	26,676.00	0.00
699	688626	翔宇医疗	500	26,645.00	0.00
700	603650	彤程新材	800	26,640.00	0.00
701	603128	华贸物流	3,600	26,604.00	0.00
702	002436	兴森科技	1,800	26,514.00	0.00
703	600066	宇通客车	2,000	26,500.00	0.00
704	688618	三旺通信	452	26,487.20	0.00
705	001203	大中矿业	2,600	26,442.00	0.00
706	002228	合兴包装	7,700	26,411.00	0.00
707	600409	三友化工	4,800	26,352.00	0.00
708	002891	中宠股份	1,000	26,350.00	0.00
709	300809	华辰装备	900	26,325.00	0.00
710	002073	软控股份	4,000	26,280.00	0.00
711	300132	青松股份	5,000	26,100.00	0.00
712	000876	新希望	2,800	26,096.00	0.00
713	002582	好想你	3,400	26,078.00	0.00
714	603583	捷昌驱动	1,300	26,039.00	0.00
715	600206	有研新材	2,100	26,019.00	0.00
716	600201	生物股份	2,400	25,848.00	0.00
717	000089	深圳机场	4,000	25,720.00	0.00
718	300145	中金环境	8,500	25,670.00	0.00
719	600011	华能国际	3,300	25,410.00	0.00

720	600536	中国软件	700	25,382.00	0.00
721	002766	索菱股份	4,600	25,070.00	0.00
722	301348	蓝箭电子	561	25,003.77	0.00
723	603051	鹿山新材	700	24,311.00	0.00
724	605177	东亚药业	900	23,832.00	0.00
725	002441	众业达	2,500	23,675.00	0.00
726	301278	快可电子	400	23,300.00	0.00
727	002088	鲁阳节能	1,600	22,800.00	0.00
728	000685	中山公用	3,100	22,661.00	0.00
729	688287	观典防务	2,281	22,513.47	0.00
730	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
731	688768	容知日新	589	21,681.09	0.00
732	002701	奥瑞金	5,200	21,528.00	0.00
733	002571	德力股份	3,200	21,344.00	0.00
734	300514	友讯达	1,300	21,190.00	0.00
735	002852	道道全	1,900	20,558.00	0.00
736	600368	五洲交通	5,200	20,540.00	0.00
737	688083	中望软件	205	20,405.70	0.00
738	300476	胜宏科技	1,100	20,295.00	0.00
739	688181	八亿时空	737	19,899.00	0.00
740	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
741	600880	博瑞传播	3,900	19,539.00	0.00
742	301558	三态股份	1,419	19,014.60	0.00
743	003032	传智教育	1,300	18,720.00	0.00
743	600390	五矿资本	4,000	18,720.00	0.00
744	000778	新兴铸管	4,900	18,718.00	0.00
745	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
746	688508	芯朋微	375	18,453.75	0.00
747	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
748	300805	电声股份	1,600	17,920.00	0.00
749	300402	宝色股份	900	17,856.00	0.00
750	301318	维海德	500	17,705.00	0.00
751	600180	瑞茂通	2,900	17,661.00	0.00
752	002990	盛视科技	500	17,265.00	0.00
753	600713	南京医药	3,500	16,940.00	0.00
754	603155	新亚强	700	16,877.00	0.00
755	000726	鲁泰 A	2,600	16,848.00	0.00
756	688678	福立旺	900	16,569.00	0.00
757	688627	精智达	187	16,403.64	0.00
758	301011	华立科技	700	16,380.00	0.00
759	603367	辰欣药业	1,100	16,104.00	0.00
760	688209	英集芯	900	16,074.00	0.00
761	002168	惠程科技	3,500	16,030.00	0.00

762	600649	城投控股	4,300	15,910.00	0.00
763	603922	金鸿顺	600	15,852.00	0.00
764	002099	海翔药业	2,200	15,818.00	0.00
765	603515	欧普照明	900	15,642.00	0.00
766	002884	凌霄泵业	900	15,624.00	0.00
767	000529	广弘控股	2,300	15,617.00	0.00
768	601900	南方传媒	1,200	15,588.00	0.00
769	688057	金达莱	1,100	15,576.00	0.00
770	688549	中巨芯	1,920	15,532.80	0.00
771	300251	光线传媒	1,900	15,485.00	0.00
772	603901	永创智能	1,300	15,470.00	0.00
773	300685	艾德生物	700	15,386.00	0.00
774	002085	万丰奥威	3,100	15,314.00	0.00
775	301102	兆讯传媒	800	15,312.00	0.00
776	002323	雅博股份	6,300	15,309.00	0.00
777	301381	赛维时代	514	15,260.66	0.00
778	688553	汇宇制药	1,000	15,130.00	0.00
779	600725	云维股份	5,200	15,080.00	0.00
780	601811	新华文轩	1,100	15,026.00	0.00
781	688257	新锐股份	600	15,024.00	0.00
782	002968	新大正	1,200	15,012.00	0.00
783	002574	明牌珠宝	2,500	15,000.00	0.00
784	603718	海利生物	1,400	14,994.00	0.00
785	000055	方大集团	3,300	14,916.00	0.00
786	600576	祥源文旅	2,000	14,880.00	0.00
787	600967	内蒙一机	1,800	14,868.00	0.00
788	600717	天津港	3,600	14,796.00	0.00
789	000598	兴蓉环境	2,600	14,794.00	0.00
790	300628	亿联网络	500	14,775.00	0.00
791	300682	朗新集团	900	14,751.00	0.00
792	300051	珪升科技	1,300	14,703.00	0.00
793	300711	广哈通信	1,100	14,685.00	0.00
794	688225	亚信安全	800	14,672.00	0.00
795	688211	中科微至	400	14,668.00	0.00
796	300755	华致酒行	800	14,632.00	0.00
797	002283	天润工业	2,500	14,625.00	0.00
798	300882	万胜智能	600	14,616.00	0.00
799	300353	东土科技	1,500	14,520.00	0.00
800	603730	岱美股份	1,000	14,490.00	0.00
801	301006	迈拓股份	800	14,488.00	0.00
802	688039	当虹科技	400	14,464.00	0.00
803	300414	中光防雷	1,500	14,445.00	0.00
804	001330	博纳影业	2,000	14,400.00	0.00

805	600229	城市传媒	1,900	14,345.00	0.00
806	688380	中微半导	600	14,316.00	0.00
807	603786	科博达	200	14,272.00	0.00
808	600984	建设机械	3,800	14,250.00	0.00
809	688388	嘉元科技	700	14,196.00	0.00
810	002478	常宝股份	2,600	14,170.00	0.00
811	600551	时代出版	1,300	14,157.00	0.00
812	002434	万里扬	1,900	14,155.00	0.00
813	000528	柳工	2,100	14,154.00	0.00
814	002491	通鼎互联	2,700	14,148.00	0.00
815	300196	长海股份	1,300	14,144.00	0.00
816	688548	广钢气体	1,107	14,114.25	0.00
817	603039	泛微网络	300	14,070.00	0.00
818	688588	凌志软件	1,182	14,065.80	0.00
819	688030	山石网科	700	14,014.00	0.00
820	600158	中体产业	1,800	14,004.00	0.00
821	300962	中金辐照	900	13,968.00	0.00
822	600638	新黄浦	2,700	13,959.00	0.00
823	000626	远大控股	1,900	13,870.00	0.00
824	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
825	688563	航材股份	229	13,852.21	0.00
826	688569	铁科轨道	500	13,805.00	0.00
827	603787	新日股份	1,100	13,761.00	0.00
828	603043	广州酒家	700	13,671.00	0.00
829	002153	石基信息	1,400	13,636.00	0.00
830	002163	海南发展	1,500	13,620.00	0.00
831	002392	北京利尔	3,600	13,608.00	0.00
832	600104	上汽集团	1,000	13,530.00	0.00
833	301370	国科恒泰	831	13,304.31	0.00
834	002385	大北农	2,200	13,112.00	0.00
835	605006	山东玻纤	1,900	13,110.00	0.00
836	300345	华民股份	1,700	13,090.00	0.00
837	301291	明阳电气	459	13,017.24	0.00
838	688151	华强科技	700	12,992.00	0.00
839	688582	芯动联科	334	12,915.78	0.00
840	688045	必易微	300	12,849.00	0.00
841	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
842	000417	合肥百货	2,500	12,475.00	0.00
843	688161	威高骨科	300	12,435.00	0.00
844	688231	隆达股份	552	12,149.52	0.00
845	300359	全通教育	2,200	12,100.00	0.00
846	002299	圣农发展	700	12,026.00	0.00
847	688591	泰凌微	424	11,880.48	0.00

848	300179	四方达	1,300	11,583.00	0.00
849	601083	锦江航运	1,026	11,357.82	0.00
850	600730	中国高科	2,000	11,300.00	0.00
851	603477	巨星农牧	300	11,241.00	0.00
852	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
853	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
854	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
855	301210	金杨股份	239	10,869.72	0.00
856	300192	科德教育	1,100	10,857.00	0.00
857	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
858	600661	昂立教育	1,000	10,700.00	0.00
859	301507	民生健康	675	10,698.75	0.00
860	301550	斯菱股份	240	10,456.80	0.00
861	600323	瀚蓝环境	600	10,398.00	0.00
862	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
863	300235	方直科技	900	10,323.00	0.00
864	600125	铁龙物流	1,700	10,285.00	0.00
865	301498	乖宝宠物	262	10,168.22	0.00
866	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
867	600480	凌云股份	1,100	10,021.00	0.00
868	301292	海科新源	513	9,926.55	0.00
869	603296	华勤技术	127	9,874.25	0.00
870	301528	多浦乐	142	9,785.22	0.00
871	688702	盛科通信	203	9,780.54	0.00
872	301511	德福科技	426	9,657.42	0.00
873	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
874	002659	凯文教育	2,200	9,526.00	0.00
875	301395	仁信新材	507	9,475.83	0.00
876	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
877	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
878	688719	爱科赛博	149	8,954.90	0.00
879	688716	中研股份	246	8,951.94	0.00
880	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
881	301329	信音电子	390	8,669.70	0.00
882	301418	协昌科技	170	8,534.00	0.00
883	301486	致尚科技	180	8,505.00	0.00
884	301500	飞南资源	404	8,439.56	0.00
885	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
886	301519	舜禹股份	416	8,407.36	0.00
887	300761	立华股份	400	8,388.00	0.00
888	688602	康鹏科技	755	8,350.30	0.00
889	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
890	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00

891	301518	长华化学	357	8,214.57	0.00
892	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
893	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
894	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
895	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
896	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
897	002066	瑞泰科技	700	7,777.00	0.00
898	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
899	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
900	301393	昊帆生物	130	7,718.10	0.00
901	301559	中集环科	421	7,679.04	0.00
902	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
903	600975	新五丰	700	7,315.00	0.00
904	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
905	301295	美硕科技	215	7,135.85	0.00
906	301520	万邦医药	134	7,067.16	0.00
907	688646	逸飞激光	193	6,961.51	0.00
908	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
909	301170	锡南科技	228	6,938.04	0.00
910	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
911	301371	敷尔佳	177	6,651.66	0.00
912	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
913	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
914	688657	浩辰软件	83	6,493.09	0.00
915	603062	麦加芯彩	112	6,474.72	0.00
916	002458	益生股份	600	6,456.00	0.00
917	301525	儒竞科技	79	6,435.34	0.00
918	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
919	301548	崇德科技	105	6,193.95	0.00
920	605296	神农集团	200	6,146.00	0.00
921	002100	天康生物	700	6,139.00	0.00
922	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
923	002567	唐人神	800	6,000.00	0.00
924	600195	中牧股份	500	5,930.00	0.00
925	688612	威迈斯	150	5,695.50	0.00
926	002462	嘉事堂	400	5,684.00	0.00
927	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
928	603270	金帝股份	168	4,969.44	0.00
929	300119	瑞普生物	300	4,917.00	0.00
930	688450	光格科技	133	4,843.86	0.00
931	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
932	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
933	603566	普莱柯	200	4,530.00	0.00

934	603609	禾丰股份	500	4,280.00	0.00
935	300360	炬华科技	300	4,098.00	0.00
936	688526	科前生物	200	4,076.00	0.00
937	603193	润本股份	244	4,065.04	0.00
938	002124	天邦食品	1,100	3,993.00	0.00
939	002952	亚世光电	100	3,876.00	0.00
940	603119	浙江荣泰	162	3,866.94	0.00
941	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
942	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
943	603668	天马科技	200	3,668.00	0.00
944	002746	仙坛股份	500	3,520.00	0.00
945	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
946	000735	罗牛山	600	3,462.00	0.00
947	001313	粤海饲料	400	3,448.00	0.00
948	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
949	603075	热威股份	139	3,240.09	0.00
950	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
951	603363	傲农生物	500	3,035.00	0.00
952	002234	民和股份	200	2,420.00	0.00
953	001201	东瑞股份	100	2,414.00	0.00
954	002548	金新农	400	2,252.00	0.00
955	002982	湘佳股份	100	2,131.00	0.00
956	002868	绿康生化	100	2,126.00	0.00
957	603739	蔚蓝生物	100	1,522.00	0.00
958	603151	邦基科技	100	1,509.00	0.00
959	688098	申联生物	200	1,496.00	0.00
960	300967	晓鸣股份	100	1,428.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	102,464,125.26	44.08
2	300750	宁德时代	73,712,698.71	31.71
3	601166	兴业银行	72,191,005.48	31.06
4	600519	贵州茅台	69,481,215.70	29.89
5	000333	美的集团	57,996,421.14	24.95
6	000858	五粮液	53,948,295.11	23.21
7	601818	光大银行	51,378,741.00	22.10
8	300059	东方财富	43,082,296.57	18.53
9	600015	华夏银行	41,580,328.32	17.89
10	601288	农业银行	40,446,922.00	17.40

11	300274	阳光电源	38,549,145.00	16.58
12	601077	渝农商行	37,822,577.00	16.27
13	601899	紫金矿业	36,862,876.00	15.86
14	601997	贵阳银行	36,702,138.75	15.79
15	000651	格力电器	36,601,108.28	15.75
16	600919	江苏银行	36,079,098.00	15.52
17	601169	北京银行	34,696,971.00	14.93
18	300760	迈瑞医疗	33,473,125.80	14.40
19	601857	中国石油	33,290,805.00	14.32
20	601229	上海银行	31,850,338.34	13.70
21	600030	中信证券	30,962,395.20	13.32
22	600050	中国联通	30,642,028.00	13.18
23	000002	万科 A	30,261,396.00	13.02
24	000725	京东方 A	29,814,766.00	12.83
25	601398	工商银行	29,484,327.00	12.68
26	603323	苏农银行	28,524,294.02	12.27
27	301042	安联锐视	28,402,202.48	12.22
28	002594	比亚迪	27,907,861.00	12.01
29	000568	泸州老窖	27,789,756.98	11.95
30	601328	交通银行	27,455,408.13	11.81
31	600153	建发股份	27,424,379.04	11.80
32	603259	药明康德	27,123,133.79	11.67
33	601699	潞安环能	26,696,559.34	11.48
34	000625	长安汽车	26,694,731.69	11.48
35	600028	中国石化	26,242,394.71	11.29
36	600900	长江电力	26,192,274.22	11.27
37	601012	隆基绿能	25,852,072.68	11.12
38	601668	中国建筑	25,160,585.09	10.82
39	600016	民生银行	24,906,942.80	10.71
40	300308	中际旭创	24,709,282.10	10.63
41	600048	保利发展	24,373,034.00	10.48
42	300532	今天国际	23,609,440.00	10.16
43	600089	特变电工	22,969,729.88	9.88
44	688556	高测股份	22,419,110.36	9.64
45	603019	中科曙光	22,375,428.37	9.63
46	300122	智飞生物	22,046,714.15	9.48
47	600438	通威股份	21,806,151.86	9.38
48	600741	华域汽车	21,489,257.00	9.24
49	601601	中国太保	20,934,891.28	9.01
50	002475	立讯精密	20,527,482.64	8.83
51	601138	工业富联	20,499,395.79	8.82
52	002415	海康威视	20,340,789.00	8.75
53	300515	三德科技	20,027,819.32	8.62

54	002027	分众传媒	19,864,867.00	8.55
55	002105	信隆健康	19,447,389.44	8.37
56	688169	石头科技	19,207,811.75	8.26
57	601088	中国神华	18,846,045.62	8.11
58	600941	中国移动	18,512,101.45	7.96
59	300543	朗科智能	18,426,963.32	7.93
60	000921	海信家电	18,152,836.00	7.81
61	601901	方正证券	18,056,217.11	7.77
62	300394	天孚通信	17,843,559.43	7.68
63	600309	万华化学	17,615,921.00	7.58
64	688011	新光光电	17,366,799.11	7.47
65	601577	长沙银行	17,288,215.08	7.44
66	300124	汇川技术	17,255,973.60	7.42
67	000338	潍柴动力	17,111,597.00	7.36
68	600985	淮北矿业	17,009,563.68	7.32
69	600276	恒瑞医药	16,971,535.00	7.30
70	601186	中国铁建	16,815,684.66	7.23
71	601985	中国核电	16,737,163.00	7.20
72	600546	山煤国际	16,642,369.58	7.16
73	300015	爱尔眼科	16,625,477.39	7.15
74	000548	湖南投资	16,589,073.71	7.14
75	300789	唐源电气	16,585,314.68	7.13
76	300316	晶盛机电	16,526,861.50	7.11
77	002938	鹏鼎控股	16,474,688.00	7.09
78	002466	天齐锂业	16,428,944.00	7.07
79	601919	中远海控	16,271,063.56	7.00
80	603928	兴业股份	16,264,620.00	7.00
81	300896	爱美客	16,098,547.11	6.93
82	601225	陕西煤业	16,059,970.00	6.91
83	600000	浦发银行	15,938,491.92	6.86
84	603706	东方环宇	15,887,970.00	6.83
85	601390	中国中铁	15,838,130.00	6.81
86	688981	中芯国际	15,777,303.29	6.79
87	603006	黎明股份	15,723,672.20	6.76
88	601231	环旭电子	15,636,808.92	6.73
89	300970	华绿生物	15,635,168.00	6.73
90	603688	石英股份	15,602,985.40	6.71
91	603926	铁流股份	15,406,972.20	6.63
92	688036	传音控股	15,390,021.33	6.62
93	000983	山西焦煤	15,304,525.00	6.58
94	605108	同庆楼	14,971,401.60	6.44
95	603035	常熟汽饰	14,857,693.00	6.39
96	601898	中煤能源	14,612,733.34	6.29

97	603102	百合股份	14,412,046.09	6.20
98	600809	山西汾酒	14,410,767.92	6.20
99	002142	宁波银行	14,407,132.09	6.20
100	300407	凯发电气	14,385,806.23	6.19
101	603937	丽岛新材	14,036,714.00	6.04
102	603197	保隆科技	13,970,838.00	6.01
103	605287	德才股份	13,945,851.21	6.00
104	603788	宁波高发	13,888,453.40	5.97
105	002714	牧原股份	13,878,086.30	5.97
106	600887	伊利股份	13,833,330.00	5.95
107	300771	智莱科技	13,627,652.00	5.86
108	600837	海通证券	13,611,111.00	5.86
109	300743	天地数码	13,610,549.61	5.85
110	002600	领益智造	13,557,436.00	5.83
111	601939	建设银行	13,520,430.36	5.82
112	601728	中国电信	13,479,327.60	5.80
113	601666	平煤股份	13,447,029.37	5.78
114	600057	厦门象屿	13,399,439.65	5.76
115	601117	中国化学	13,162,855.00	5.66
116	301004	嘉益股份	13,108,404.12	5.64
117	600803	新奥股份	13,052,779.86	5.62
118	000933	神火股份	12,953,483.00	5.57
119	300689	澄天伟业	12,923,878.60	5.56
120	300389	艾比森	12,689,578.44	5.46
121	605009	豪悦护理	12,628,544.45	5.43
122	600612	老凤祥	12,596,571.24	5.42
123	0883	中国海洋石油	12,423,199.07	5.34
124	002991	甘源食品	12,397,608.72	5.33
125	603767	中马传动	12,396,741.54	5.33
126	301002	崧盛股份	12,331,085.00	5.30
127	603585	苏利股份	12,329,020.90	5.30
128	688080	映翰通	12,284,172.56	5.28
129	600051	宁波联合	12,201,649.00	5.25
130	0939	建设银行	12,191,040.37	5.24
131	000932	华菱钢铁	12,176,654.00	5.24
132	605077	华康股份	12,162,900.48	5.23
133	000090	天健集团	11,982,271.00	5.15
134	000906	浙商中拓	11,971,959.95	5.15
135	603529	爱玛科技	11,907,433.00	5.12
136	601688	华泰证券	11,893,896.58	5.12
137	600132	重庆啤酒	11,874,104.00	5.11
138	002011	盾安环境	11,868,663.22	5.11

139	603027	千禾味业	11,862,995.80	5.10
140	002568	百润股份	11,753,563.40	5.06
141	605151	西上海	11,710,396.00	5.04
142	002649	博彦科技	11,660,087.00	5.02
143	600508	上海能源	11,628,185.49	5.00
144	601717	郑煤机	11,484,587.40	4.94
145	300130	新国都	11,362,112.00	4.89
146	601600	中国铝业	11,355,337.00	4.88
147	600406	国电南瑞	11,350,666.48	4.88
148	300076	GQY 视讯	11,338,982.00	4.88
149	601766	中国中车	11,120,733.00	4.78
150	605088	冠盛股份	11,087,930.00	4.77
151	601336	新华保险	11,065,785.08	4.76
152	000001	平安银行	10,972,945.88	4.72
153	600073	上海梅林	10,923,419.00	4.70
154	000028	国药一致	10,909,162.50	4.69
155	600833	第一医药	10,849,913.00	4.67
156	603508	思维列控	10,838,152.15	4.66
157	300866	安克创新	10,724,323.00	4.61
158	688511	天微电子	10,709,041.22	4.61
159	002230	科大讯飞	10,685,588.66	4.60
160	601916	浙商银行	10,672,547.00	4.59
161	688112	鼎阳科技	10,659,864.80	4.59
162	600150	中国船舶	10,581,008.00	4.55
163	003011	海象新材	10,570,084.00	4.55
164	600096	云天化	10,531,529.00	4.53
165	603551	奥普家居	10,519,424.00	4.53
166	002959	小熊电器	10,509,998.00	4.52
167	600436	片仔癀	10,443,878.00	4.49
168	601998	中信银行	10,423,153.00	4.48
169	603886	元祖股份	10,345,397.60	4.45
170	301257	普蕊斯	10,328,590.00	4.44
171	300731	科创新源	10,287,068.81	4.43
172	600997	开滦股份	10,222,727.40	4.40
173	600419	天润乳业	10,092,093.20	4.34
174	601211	国泰君安	10,088,059.00	4.34
175	600011	华能国际	10,082,136.00	4.34
176	603063	禾望电气	10,039,847.99	4.32
177	600886	国投电力	9,984,650.00	4.30
178	000655	金岭矿业	9,964,938.00	4.29
179	688127	蓝特光学	9,880,967.59	4.25
180	002136	安纳达	9,879,380.00	4.25
181	603057	紫燕食品	9,878,586.00	4.25

182	600180	瑞茂通	9,870,960.30	4.25
183	002371	北方华创	9,819,566.31	4.22
184	688399	硕世生物	9,790,112.45	4.21
185	603368	柳药集团	9,758,215.91	4.20
186	000543	皖能电力	9,758,212.91	4.20
187	600188	兖矿能源	9,686,085.00	4.17
188	002129	TCL 中环	9,644,211.00	4.15
189	000063	中兴通讯	9,635,580.00	4.15
190	003015	日久光电	9,556,996.00	4.11
191	002952	亚世光电	9,504,643.00	4.09
192	603345	安井食品	9,503,522.00	4.09
193	688288	鸿泉物联	9,496,542.88	4.09
194	601988	中国银行	9,444,991.00	4.06
195	000895	双汇发展	9,402,233.00	4.04
196	600938	中国海油	9,355,614.00	4.02
197	003816	中国广核	9,255,961.00	3.98
198	002459	晶澳科技	9,226,501.00	3.97
199	601888	中国中免	9,162,435.00	3.94
200	000822	山东海化	9,103,499.40	3.92
201	603579	荣泰健康	9,087,020.00	3.91
202	600755	厦门国贸	9,016,871.59	3.88
203	301003	江苏博云	9,015,582.10	3.88
204	601319	中国人保	9,004,772.00	3.87
205	603657	春光科技	9,004,545.40	3.87
206	601816	京沪高铁	8,964,825.00	3.86
207	300884	狄耐克	8,932,787.51	3.84
208	600998	九州通	8,892,614.05	3.83
209	603501	韦尔股份	8,844,413.96	3.80
210	600548	深高速	8,789,952.00	3.78
211	000878	云南铜业	8,773,648.00	3.77
212	000786	北新建材	8,763,891.59	3.77
213	300724	捷佳伟创	8,705,664.00	3.74
214	600039	四川路桥	8,700,027.00	3.74
215	601669	中国电建	8,697,405.00	3.74
216	300782	卓胜微	8,608,578.20	3.70
217	002085	万丰奥威	8,582,994.00	3.69
218	000521	长虹美菱	8,476,221.00	3.65
219	603095	越剑智能	8,448,427.80	3.63
220	001979	招商蛇口	8,428,006.00	3.63
221	300017	网宿科技	8,411,369.00	3.62
222	300845	捷安高科	8,404,628.16	3.62
223	600060	海信视像	8,380,989.00	3.61
224	600398	海澜之家	8,367,513.56	3.60

225	002871	伟隆股份	8,317,740.25	3.58
226	301017	漱玉平民	8,305,554.85	3.57
227	300519	新光药业	8,283,917.00	3.56
228	600111	北方稀土	8,277,836.00	3.56
229	001210	金房能源	8,156,893.24	3.51
230	300787	海能实业	8,052,841.20	3.46
231	601021	春秋航空	8,025,687.04	3.45
232	300014	亿纬锂能	7,985,583.00	3.44
233	300575	中旗股份	7,953,702.00	3.42
234	603676	卫信康	7,887,942.92	3.39
235	601618	中国中冶	7,881,198.00	3.39
236	003019	宸展光电	7,757,801.56	3.34
237	300314	戴维医疗	7,742,865.00	3.33
238	601628	中国人寿	7,732,602.00	3.33
239	600600	青岛啤酒	7,674,451.00	3.30
240	603799	华友钴业	7,616,537.40	3.28
241	002595	豪迈科技	7,616,165.00	3.28
242	688569	铁科轨道	7,607,711.64	3.27
243	002756	永兴材料	7,596,912.42	3.27
244	688190	云路股份	7,581,282.96	3.26
245	300218	安利股份	7,572,615.00	3.26
246	300042	朗科科技	7,494,963.00	3.22
247	003040	楚天龙	7,468,665.46	3.21
248	002056	横店东磁	7,467,669.00	3.21
249	603086	先达股份	7,428,743.60	3.20
250	002022	科华生物	7,422,575.63	3.19
251	600585	海螺水泥	7,398,868.49	3.18
252	600528	中铁工业	7,388,837.00	3.18
253	603266	天龙股份	7,385,150.00	3.18
254	688517	金冠电气	7,366,911.05	3.17
255	300910	瑞丰新材	7,345,788.00	3.16
256	600197	伊力特	7,344,638.00	3.16
257	002543	万和电气	7,283,123.97	3.13
258	002982	湘佳股份	7,166,643.00	3.08
259	300932	三友联众	7,158,680.70	3.08
260	002612	朗姿股份	7,119,648.00	3.06
261	300298	三诺生物	7,118,535.91	3.06
262	600958	东方证券	7,096,791.88	3.05
263	300761	立华股份	7,081,592.00	3.05
264	300502	新易盛	7,048,111.00	3.03
265	600019	宝钢股份	7,038,787.00	3.03
266	002533	金杯电工	6,990,983.00	3.01
267	002748	世龙实业	6,989,207.00	3.01

268	600559	老白干酒	6,985,610.92	3.01
269	300889	爱克股份	6,978,013.00	3.00
270	603986	兆易创新	6,961,666.00	2.99
271	002324	普利特	6,953,781.15	2.99
272	600170	上海建工	6,948,480.00	2.99
273	688529	豪森智能	6,945,750.72	2.99
274	603993	洛阳钼业	6,905,349.00	2.97
275	688019	安集科技	6,899,693.80	2.97
276	600356	恒丰纸业	6,890,242.00	2.96
277	300740	水羊股份	6,887,043.00	2.96
278	002774	快意电梯	6,871,254.91	2.96
279	002236	大华股份	6,863,887.00	2.95
280	600702	舍得酒业	6,834,424.00	2.94
281	002352	顺丰控股	6,820,956.00	2.93
282	300583	赛托生物	6,802,681.46	2.93
283	603099	长白山	6,786,847.00	2.92
284	300922	天秦装备	6,785,015.78	2.92
285	600873	梅花生物	6,763,009.00	2.91
286	601111	中国国航	6,720,317.44	2.89
287	603283	赛腾股份	6,712,377.00	2.89
288	603301	振德医疗	6,704,977.00	2.88
289	688596	正帆科技	6,689,504.63	2.88
290	301103	何氏眼科	6,680,243.10	2.87
291	601058	赛轮轮胎	6,677,076.00	2.87
292	688083	中望软件	6,674,441.96	2.87
293	300058	蓝色光标	6,671,196.00	2.87
294	688123	聚辰股份	6,655,531.12	2.86
295	002049	紫光国微	6,652,159.00	2.86
296	301039	中集车辆	6,648,153.00	2.86
297	688111	金山办公	6,630,228.97	2.85
298	600502	安徽建工	6,625,585.00	2.85
299	000719	中原传媒	6,622,563.00	2.85
300	300856	科思股份	6,615,301.00	2.85
301	605258	协和电子	6,577,605.45	2.83
302	603080	新疆火炬	6,551,284.00	2.82
303	603810	丰山集团	6,544,151.76	2.82
304	603681	永冠新材	6,532,180.00	2.81
305	1929	周大福	6,456,037.08	2.78
306	603326	我乐家居	6,420,462.00	2.76
307	601633	长城汽车	6,408,313.00	2.76
308	688516	奥特维	6,400,960.53	2.75
309	300375	鹏翎股份	6,375,947.00	2.74
310	600370	三房巷	6,367,053.00	2.74

311	002809	红墙股份	6,312,986.80	2.72
312	600926	杭州银行	6,299,803.00	2.71
313	002835	同为股份	6,252,767.00	2.69
314	600312	平高电气	6,241,257.99	2.68
315	603071	物产环能	6,212,083.81	2.67
316	002852	道道全	6,149,827.77	2.65
317	002048	宁波华翔	6,081,792.31	2.62
318	601658	邮储银行	6,075,736.53	2.61
319	002133	广宇集团	6,051,215.00	2.60
320	688012	中微公司	6,031,105.61	2.59
321	002865	钧达股份	6,021,580.98	2.59
322	002955	鸿合科技	6,018,946.26	2.59
323	003033	征和工业	6,014,199.00	2.59
324	000997	新大陆	5,995,503.18	2.58
325	688329	艾隆科技	5,965,559.78	2.57
326	603898	好莱客	5,955,814.00	2.56
327	002722	物产金轮	5,941,184.61	2.56
328	300141	和顺电气	5,938,561.00	2.55
329	000661	长春高新	5,913,040.00	2.54
330	001218	丽臣实业	5,910,996.92	2.54
331	000977	浪潮信息	5,895,495.32	2.54
332	601995	中金公司	5,886,158.00	2.53
333	300498	温氏股份	5,866,325.60	2.52
334	002555	三七互娱	5,857,347.00	2.52
335	605116	奥锐特	5,853,730.00	2.52
336	300708	聚灿光电	5,845,842.00	2.51
337	688069	德林海	5,832,849.82	2.51
338	300155	安居宝	5,826,365.89	2.51
339	002179	中航光电	5,803,639.00	2.50
340	000811	冰轮环境	5,785,284.16	2.49
341	600826	兰生股份	5,767,383.80	2.48
342	605117	德业股份	5,755,339.00	2.48
343	688227	品高股份	5,732,325.34	2.47
344	600202	哈空调	5,720,597.38	2.46
345	002493	荣盛石化	5,701,066.00	2.45
346	000830	鲁西化工	5,695,406.03	2.45
347	002394	联发股份	5,683,188.38	2.44
348	300795	米奥会展	5,661,773.00	2.44
349	601788	光大证券	5,650,998.00	2.43
350	002304	洋河股份	5,640,420.66	2.43
351	603298	杭叉集团	5,625,912.00	2.42
352	300121	阳谷华泰	5,619,354.00	2.42
353	000937	冀中能源	5,595,458.00	2.41

354	000048	京基智农	5,594,943.57	2.41
355	688303	大全能源	5,594,326.64	2.41
356	688510	航亚科技	5,573,149.57	2.40
357	600596	新安股份	5,570,801.19	2.40
358	000792	盐湖股份	5,526,081.00	2.38
359	300109	新开源	5,516,039.00	2.37
360	688228	开普云	5,510,753.80	2.37
361	300951	博硕科技	5,486,585.50	2.36
362	600704	物产中大	5,473,701.00	2.35
363	000550	江铃汽车	5,473,150.00	2.35
364	601838	成都银行	5,460,560.22	2.35
365	002736	国信证券	5,454,313.00	2.35
366	601009	南京银行	5,452,353.07	2.35
367	002271	东方雨虹	5,433,612.00	2.34
368	600346	恒力石化	5,422,531.66	2.33
369	300935	盈建科	5,416,722.40	2.33
370	603185	弘元绿能	5,385,245.38	2.32
371	603156	养元饮品	5,367,115.00	2.31
372	600710	苏美达	5,364,629.00	2.31
373	688312	燕麦科技	5,318,952.52	2.29
374	300639	凯普生物	5,315,172.72	2.29
375	002384	东山精密	5,313,783.00	2.29
376	000617	中油资本	5,301,041.00	2.28
377	688217	睿昂基因	5,298,312.65	2.28
378	600674	川投能源	5,279,466.00	2.27
379	600966	博汇纸业	5,267,929.00	2.27
380	603586	金麒麟	5,256,413.00	2.26
381	000913	钱江摩托	5,240,240.00	2.25
382	600690	海尔智家	5,238,600.00	2.25
383	688351	微电生理	5,228,434.36	2.25
384	301046	能辉科技	5,222,996.00	2.25
385	603611	诺力股份	5,222,727.60	2.25
386	000422	湖北宜化	5,220,316.45	2.25
387	002932	明德生物	5,205,455.91	2.24
388	002492	恒基达鑫	5,200,135.00	2.24
389	002241	歌尔股份	5,177,790.00	2.23
390	605060	联德股份	5,159,648.00	2.22
391	002743	富煌钢构	5,135,576.00	2.21
392	000596	古井贡酒	5,132,850.00	2.21
393	002478	常宝股份	5,116,227.00	2.20
394	600582	天地科技	5,113,407.00	2.20
395	300462	华铭智能	5,109,764.00	2.20
396	688212	澳华内镜	5,088,297.14	2.19

397	688305	科德数控	5,087,834.84	2.19
398	603757	大元泵业	5,076,222.00	2.18
399	600782	新钢股份	5,048,370.00	2.17
400	600256	广汇能源	5,040,495.80	2.17
401	000776	广发证券	5,029,732.00	2.16
402	603602	纵横通信	5,021,068.40	2.16
403	300150	世纪瑞尔	5,018,092.00	2.16
404	300390	天华新能	5,007,859.49	2.15
405	603199	九华旅游	4,971,829.00	2.14
406	603115	海星股份	4,958,349.20	2.13
407	300153	科泰电源	4,952,818.00	2.13
408	603885	吉祥航空	4,952,071.05	2.13
409	300624	万兴科技	4,913,373.00	2.11
410	1088	中国神华	4,885,758.92	2.10
411	300280	紫天科技	4,867,690.00	2.09
412	300413	芒果超媒	4,841,367.00	2.08
413	002727	一心堂	4,838,848.00	2.08
414	002462	嘉事堂	4,829,724.00	2.08
415	603920	世运电路	4,757,682.55	2.05
416	301106	骏成科技	4,738,791.00	2.04
417	002837	英维克	4,734,367.00	2.04

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	103,227,833.38	44.41
2	600519	贵州茅台	83,042,104.22	35.72
3	601166	兴业银行	71,155,615.00	30.61
4	300750	宁德时代	63,437,362.34	27.29
5	000858	五粮液	50,956,691.00	21.92
6	000333	美的集团	48,702,286.50	20.95
7	601818	光大银行	46,112,519.00	19.84
8	300059	东方财富	41,720,550.17	17.95
9	601288	农业银行	40,852,484.00	17.57
10	600015	华夏银行	38,122,445.65	16.40
11	601077	渝农商行	35,785,194.57	15.39
12	600030	中信证券	35,010,632.85	15.06
13	600919	江苏银行	34,951,280.52	15.04
14	601997	贵阳银行	33,842,521.00	14.56
15	601398	工商银行	33,779,463.21	14.53
16	601169	北京银行	31,802,000.36	13.68
17	300760	迈瑞医疗	31,277,781.80	13.46

18	000651	格力电器	31,136,938.28	13.39
19	601328	交通银行	30,842,810.00	13.27
20	600900	长江电力	30,017,220.41	12.91
21	300274	阳光电源	29,561,666.86	12.72
22	601229	上海银行	29,108,057.55	12.52
23	301042	安联锐视	29,097,479.15	12.52
24	000001	平安银行	28,294,623.55	12.17
25	603323	苏农银行	27,710,087.00	11.92
26	601699	潞安环能	27,686,766.50	11.91
27	000568	泸州老窖	27,665,429.00	11.90
28	603259	药明康德	27,396,836.22	11.79
29	600016	民生银行	27,314,840.00	11.75
30	600050	中国联通	27,225,618.00	11.71
31	601899	紫金矿业	26,687,892.80	11.48
32	000002	万科 A	26,585,790.00	11.44
33	601668	中国建筑	26,265,940.20	11.30
34	000725	京东方 A	24,591,631.99	10.58
35	600048	保利发展	23,932,561.00	10.30
36	300532	今天国际	23,518,435.00	10.12
37	002594	比亚迪	23,486,365.71	10.10
38	601012	隆基绿能	22,037,986.73	9.48
39	600153	建发股份	21,996,294.00	9.46
40	002415	海康威视	21,619,776.87	9.30
41	600276	恒瑞医药	21,434,167.23	9.22
42	000625	长安汽车	21,241,940.57	9.14
43	688556	高测股份	20,626,310.10	8.87
44	600000	浦发银行	20,159,558.12	8.67
45	002475	立讯精密	19,534,700.00	8.40
46	300308	中际旭创	19,427,928.07	8.36
47	600887	伊利股份	19,334,438.64	8.32
48	002105	信隆健康	19,286,684.00	8.30
49	600028	中国石化	19,089,360.90	8.21
50	300515	三德科技	18,984,470.00	8.17
51	300543	朗科智能	18,417,430.82	7.92
52	600741	华域汽车	17,996,934.00	7.74
53	600309	万华化学	17,869,327.00	7.69
54	601857	中国石油	17,858,234.69	7.68
55	300122	智飞生物	17,837,329.62	7.67
56	601601	中国太保	17,787,145.00	7.65
57	300124	汇川技术	17,221,948.00	7.41
58	601577	长沙银行	16,905,354.60	7.27
59	603928	兴业股份	16,889,821.00	7.27
60	688011	新光光电	16,875,410.14	7.26

61	000548	湖南投资	16,790,871.50	7.22
62	603006	黎明股份	16,738,606.00	7.20
63	000338	潍柴动力	16,664,033.00	7.17
64	601901	方正证券	16,458,112.02	7.08
65	300789	唐源电气	16,378,412.40	7.05
66	002938	鹏鼎控股	16,296,436.50	7.01
67	601186	中国铁建	16,208,492.00	6.97
68	603019	中科曙光	15,867,000.23	6.83
69	603706	东方环宇	15,754,417.00	6.78
70	603926	铁流股份	15,719,085.26	6.76
71	600438	通威股份	15,657,097.00	6.74
72	601390	中国中铁	15,440,769.00	6.64
73	600089	特变电工	15,341,310.34	6.60
74	300970	华绿生物	15,337,511.01	6.60
75	000983	山西焦煤	15,156,126.00	6.52
76	601088	中国神华	15,076,047.00	6.49
77	603035	常熟汽饰	14,867,934.64	6.40
78	300407	凯发电气	14,727,213.47	6.34
79	600985	淮北矿业	14,415,289.11	6.20
80	605108	同庆楼	14,208,184.58	6.11
81	688169	石头科技	14,172,830.01	6.10
82	603788	宁波高发	14,098,314.32	6.06
83	601231	环旭电子	14,097,992.09	6.06
84	002714	牧原股份	14,008,403.59	6.03
85	605287	德才股份	13,858,953.84	5.96
86	002142	宁波银行	13,840,932.60	5.95
87	600546	山煤国际	13,777,124.85	5.93
88	002600	领益智造	13,694,835.00	5.89
89	300394	天孚通信	13,692,126.94	5.89
90	601919	中远海控	13,681,642.00	5.89
91	601888	中国中免	13,672,845.78	5.88
92	603937	丽岛新材	13,603,774.00	5.85
93	000921	海信家电	13,521,280.00	5.82
94	603102	百合股份	13,498,982.00	5.81
95	601939	建设银行	13,465,089.00	5.79
96	601225	陕西煤业	13,341,861.00	5.74
97	300015	爱尔眼科	13,215,702.93	5.69
98	300771	智莱科技	13,102,775.00	5.64
99	300743	天地数码	13,094,963.81	5.63
100	002027	分众传媒	12,966,404.00	5.58
101	600837	海通证券	12,966,151.00	5.58
102	601138	工业富联	12,960,363.99	5.58
103	603197	保隆科技	12,904,805.71	5.55

104	603767	中马传动	12,800,535.40	5.51
105	301004	嘉益股份	12,619,261.00	5.43
106	600612	老凤祥	12,526,558.00	5.39
107	300389	艾比森	12,515,580.32	5.38
108	300689	澄天伟业	12,457,623.00	5.36
109	605009	豪悦护理	12,328,566.00	5.30
110	601728	中国电信	12,325,366.00	5.30
111	0939	建设银行	12,149,259.49	5.23
112	301002	崧盛股份	12,148,919.60	5.23
113	600051	宁波联合	12,111,535.00	5.21
114	605151	西上海	12,032,627.00	5.18
115	600809	山西汾酒	12,002,025.20	5.16
116	688080	映翰通	11,996,308.44	5.16
117	603585	苏利股份	11,935,184.80	5.13
118	601898	中煤能源	11,865,623.00	5.10
119	300896	爱美客	11,822,883.00	5.09
120	605077	华康股份	11,808,412.48	5.08
121	300316	晶盛机电	11,756,199.00	5.06
122	603529	爱玛科技	11,744,801.33	5.05
123	0883	中国海洋石油	11,733,085.07	5.05
124	605088	冠盛股份	11,648,507.00	5.01
125	002568	百润股份	11,621,022.00	5.00
126	600508	上海能源	11,476,328.72	4.94
127	002011	盾安环境	11,471,745.74	4.93
128	603027	千禾味业	11,391,279.00	4.90
129	002649	博彦科技	11,268,762.00	4.85
130	002959	小熊电器	11,266,731.00	4.85
131	600406	国电南瑞	11,264,611.66	4.85
132	600132	重庆啤酒	11,264,083.00	4.85
133	002230	科大讯飞	11,260,273.51	4.84
134	002991	甘源食品	11,234,205.00	4.83
135	000906	浙商中拓	11,219,135.89	4.83
136	600833	第一医药	11,203,972.00	4.82
137	600941	中国移动	11,173,924.08	4.81
138	601688	华泰证券	11,166,465.00	4.80
139	601717	郑煤机	11,007,541.00	4.74
140	300076	GQY 视讯	11,006,538.00	4.73
141	601998	中信银行	10,950,967.83	4.71
142	000028	国药一致	10,871,315.70	4.68
143	300731	科创新源	10,720,605.00	4.61
144	601766	中国中车	10,704,058.00	4.60
145	603688	石英股份	10,626,437.00	4.57

146	601666	平煤股份	10,565,754.00	4.55
147	688511	天微电子	10,551,648.15	4.54
148	600073	上海梅林	10,527,748.00	4.53
149	603508	思维列控	10,518,914.00	4.53
150	601336	新华保险	10,492,263.96	4.51
151	300866	安克创新	10,449,095.00	4.49
152	601916	浙商银行	10,341,646.00	4.45
153	600997	开滦股份	10,228,359.25	4.40
154	603551	奥普家居	10,225,114.00	4.40
155	601117	中国化学	10,194,100.78	4.39
156	002466	天齐锂业	10,126,163.33	4.36
157	003011	海象新材	10,098,007.00	4.34
158	600011	华能国际	10,094,881.00	4.34
159	600057	厦门象屿	10,083,297.30	4.34
160	601816	京沪高铁	10,033,498.00	4.32
161	600803	新奥股份	9,982,606.00	4.29
162	002952	亚世光电	9,951,870.00	4.28
163	600180	瑞茂通	9,874,858.00	4.25
164	601985	中国核电	9,831,685.00	4.23
165	002136	安纳达	9,815,014.00	4.22
166	603063	禾望电气	9,736,504.00	4.19
167	600419	天润乳业	9,704,960.00	4.17
168	601009	南京银行	9,694,545.83	4.17
169	603886	元祖股份	9,656,642.00	4.15
170	003015	日久光电	9,635,379.00	4.14
171	688112	鼎阳科技	9,605,367.33	4.13
172	601211	国泰君安	9,599,121.49	4.13
173	601988	中国银行	9,552,856.00	4.11
174	603368	柳药集团	9,481,761.00	4.08
175	688399	硕世生物	9,457,595.00	4.07
176	000655	金岭矿业	9,436,301.00	4.06
177	601319	中国人保	9,409,128.00	4.05
178	000063	中兴通讯	9,374,544.00	4.03
179	000933	神火股份	9,267,494.71	3.99
180	301257	普蕊斯	9,254,173.00	3.98
181	688127	蓝特光学	9,219,708.00	3.97
182	300884	狄耐克	9,204,328.53	3.96
183	688981	中芯国际	9,167,846.95	3.94
184	000822	山东海化	9,156,961.00	3.94
185	688288	鸿泉物联	9,047,930.20	3.89
186	000543	皖能电力	9,042,132.00	3.89
187	301003	江苏博云	9,029,157.30	3.88
188	002085	万丰奥威	9,019,584.20	3.88

189	603345	安井食品	9,005,855.00	3.87
190	603657	春光科技	8,825,693.00	3.80
191	000090	天健集团	8,812,877.60	3.79
192	603579	荣泰健康	8,782,231.03	3.78
193	000895	双汇发展	8,753,589.00	3.77
194	600548	深高速	8,745,864.00	3.76
195	603326	我乐家居	8,681,561.60	3.73
196	603057	紫燕食品	8,664,532.92	3.73
197	300017	网宿科技	8,613,592.00	3.71
198	600039	四川路桥	8,601,785.00	3.70
199	600060	海信视像	8,525,634.00	3.67
200	600188	兖矿能源	8,524,427.00	3.67
201	300042	朗科科技	8,423,571.00	3.62
202	603095	越剑智能	8,422,876.84	3.62
203	300845	捷安高科	8,366,965.00	3.60
204	600998	九州通	8,359,696.44	3.60
205	300519	新光药业	8,348,188.00	3.59
206	000878	云南铜业	8,326,109.00	3.58
207	601669	中国电建	8,312,794.00	3.58
208	600436	片仔癀	8,298,273.00	3.57
209	603266	天龙股份	8,297,012.00	3.57
210	003040	楚天龙	8,295,580.00	3.57
211	001210	金房能源	8,194,968.67	3.53
212	600600	青岛啤酒	8,167,006.00	3.51
213	601628	中国人寿	8,148,638.00	3.51
214	002871	伟隆股份	8,135,611.97	3.50
215	000521	长虹美菱	8,017,637.00	3.45
216	001979	招商蛇口	7,923,147.00	3.41
217	000786	北新建材	7,923,063.08	3.41
218	002352	顺丰控股	7,821,958.00	3.36
219	301017	漱玉平民	7,738,349.50	3.33
220	300575	中旗股份	7,704,132.00	3.31
221	601618	中国中冶	7,680,497.00	3.30
222	300761	立华股份	7,671,640.00	3.30
223	300314	戴维医疗	7,629,261.00	3.28
224	688569	铁科轨道	7,604,249.60	3.27
225	300910	瑞丰新材	7,601,883.00	3.27
226	003019	宸展光电	7,530,831.36	3.24
227	300218	安利股份	7,483,731.00	3.22
228	300787	海能实业	7,430,836.00	3.20
229	600197	伊力特	7,417,498.00	3.19
230	603676	卫信康	7,414,344.00	3.19
231	300502	新易盛	7,386,959.99	3.18

232	002982	湘佳股份	7,378,007.00	3.17
233	002371	北方华创	7,357,346.00	3.16
234	002022	科华生物	7,253,929.00	3.12
235	002129	TCL 中环	7,249,939.75	3.12
236	688190	云路股份	7,235,619.90	3.11
237	603086	先达股份	7,223,543.20	3.11
238	002774	快意电梯	7,201,854.00	3.10
239	002543	万和电气	7,174,689.99	3.09
240	300889	爱克股份	7,150,403.00	3.08
241	002756	永兴材料	7,106,054.10	3.06
242	688019	安集科技	7,094,982.85	3.05
243	300932	三友联众	7,087,603.00	3.05
244	300130	新国都	7,085,770.00	3.05
245	600958	东方证券	7,055,822.00	3.04
246	002533	金杯电工	7,042,565.90	3.03
247	002595	豪迈科技	7,035,109.00	3.03
248	002748	世龙实业	7,021,503.40	3.02
249	600585	海螺水泥	7,003,102.90	3.01
250	600528	中铁工业	7,001,889.00	3.01
251	600096	云天化	6,978,740.11	3.00
252	300298	三诺生物	6,977,527.00	3.00
253	600873	梅花生物	6,906,493.00	2.97
254	002056	横店东磁	6,891,076.92	2.96
255	688517	金冠电气	6,873,901.68	2.96
256	300583	赛托生物	6,861,836.34	2.95
257	600356	恒丰纸业	6,812,481.00	2.93
258	600559	老白干酒	6,810,286.00	2.93
259	002324	普利特	6,783,979.00	2.92
260	300782	卓胜微	6,782,195.00	2.92
261	600150	中国船舶	6,782,068.96	2.92
262	000913	钱江摩托	6,755,876.00	2.91
263	603681	永冠新材	6,708,070.00	2.89
264	300856	科思股份	6,694,121.50	2.88
265	603099	长白山	6,685,685.00	2.88
266	002612	朗姿股份	6,667,179.99	2.87
267	600019	宝钢股份	6,665,951.84	2.87
268	300922	天秦装备	6,640,176.15	2.86
269	605258	协和电子	6,639,464.00	2.86
270	600886	国投电力	6,575,535.00	2.83
271	600702	舍得酒业	6,571,935.00	2.83
272	1929	周大福	6,571,328.99	2.83
273	688036	传音控股	6,545,340.22	2.82
274	301039	中集车辆	6,538,712.00	2.81

275	603810	丰山集团	6,513,410.00	2.80
276	601058	赛轮轮胎	6,511,062.00	2.80
277	600502	安徽建工	6,490,627.00	2.79
278	300058	蓝色光标	6,470,764.00	2.78
279	002809	红墙股份	6,454,494.50	2.78
280	000932	华菱钢铁	6,423,821.00	2.76
281	300724	捷佳伟创	6,409,303.98	2.76
282	000719	中原传媒	6,391,432.00	2.75
283	603501	韦尔股份	6,390,249.00	2.75
284	603301	振德医疗	6,380,237.00	2.74
285	688529	豪森智能	6,373,453.05	2.74
286	300375	鹏翎股份	6,371,094.00	2.74
287	688123	聚辰股份	6,362,016.28	2.74
288	003033	征和工业	6,348,108.00	2.73
289	300624	万兴科技	6,303,004.00	2.71
290	301103	何氏眼科	6,295,272.54	2.71
291	600370	三房巷	6,261,302.00	2.69
292	002955	鸿合科技	6,201,704.00	2.67
293	688069	德林海	6,195,925.07	2.67
294	300155	安居宝	6,186,231.00	2.66
295	300708	聚灿光电	6,174,207.00	2.66
296	603080	新疆火炬	6,157,862.00	2.65
297	002722	物产金轮	6,122,876.99	2.63
298	002852	道道全	6,106,740.00	2.63
299	603071	物产环能	6,099,660.46	2.62
300	300740	水羊股份	6,079,869.00	2.62
301	688217	睿昂基因	6,078,325.98	2.61
302	600926	杭州银行	6,074,407.00	2.61
303	000048	京基智农	6,066,215.00	2.61
304	002133	广宇集团	6,057,524.00	2.61
305	300014	亿纬锂能	6,050,116.00	2.60
306	002048	宁波华翔	6,039,849.00	2.60
307	002304	洋河股份	6,027,303.38	2.59
308	603898	好莱客	6,022,332.98	2.59
309	688083	中望软件	5,989,565.44	2.58
310	688329	艾隆科技	5,961,888.52	2.56
311	000997	新大陆	5,884,876.00	2.53
312	600312	平高电气	5,848,540.00	2.52
313	603156	养元饮品	5,820,413.00	2.50
314	300141	和顺电气	5,814,943.00	2.50
315	300498	温氏股份	5,794,269.57	2.49
316	600202	哈空调	5,793,755.00	2.49
317	001218	丽臣实业	5,765,710.32	2.48

318	603298	杭叉集团	5,733,648.00	2.47
319	601658	邮储银行	5,715,214.00	2.46
320	000550	江铃汽车	5,709,521.89	2.46
321	688227	品高股份	5,707,274.43	2.46
322	002835	同为股份	5,685,106.00	2.45
323	600755	厦门国贸	5,671,572.00	2.44
324	002179	中航光电	5,671,086.60	2.44
325	603586	金麒麟	5,655,127.00	2.43
326	002865	钧达股份	5,652,869.80	2.43
327	600826	兰生股份	5,618,524.00	2.42
328	688228	开普云	5,612,983.48	2.41
329	601633	长城汽车	5,606,999.00	2.41
330	002384	东山精密	5,601,955.00	2.41
331	688312	燕麦科技	5,580,060.02	2.40
332	601838	成都银行	5,576,560.00	2.40
333	688351	微电生理	5,558,006.20	2.39
334	000811	冰轮环境	5,551,299.00	2.39
335	300121	阳谷华泰	5,550,451.00	2.39
336	000937	冀中能源	5,526,958.00	2.38
337	605117	德业股份	5,526,047.80	2.38
338	002555	三七互娱	5,511,454.00	2.37
339	600111	北方稀土	5,503,119.00	2.37
340	000596	古井贡酒	5,459,071.05	2.35
341	600704	物产中大	5,442,924.74	2.34
342	000830	鲁西化工	5,442,072.00	2.34
343	600674	川投能源	5,437,644.00	2.34
344	605116	奥锐特	5,435,979.00	2.34
345	603283	赛腾股份	5,403,830.00	2.32
346	002736	国信证券	5,364,764.00	2.31
347	000617	中油资本	5,344,482.14	2.30
348	600596	新安股份	5,336,696.60	2.30
349	600710	苏美达	5,330,891.00	2.29
350	300109	新开源	5,322,841.19	2.29
351	600346	恒力石化	5,318,019.00	2.29
352	300935	盈建科	5,301,606.60	2.28
353	002492	恒基达鑫	5,287,260.00	2.27
354	603986	兆易创新	5,285,841.00	2.27
355	002271	东方雨虹	5,251,171.00	2.26
356	600782	新钢股份	5,237,490.00	2.25
357	300639	凯普生物	5,218,704.39	2.24
358	002478	常宝股份	5,203,255.00	2.24
359	603611	诺力股份	5,186,316.00	2.23
360	600690	海尔智家	5,175,395.00	2.23

361	002049	紫光国微	5,160,063.00	2.22
362	300150	世纪瑞尔	5,141,821.00	2.21
363	688305	科德数控	5,095,684.55	2.19
364	600256	广汇能源	5,090,609.94	2.19
365	300951	博硕科技	5,084,762.82	2.19
366	300795	米奥会展	5,067,572.00	2.18
367	002743	富煌钢构	5,051,180.00	2.17
368	000422	湖北宜化	5,050,136.00	2.17
369	003816	中国广核	5,041,127.00	2.17
370	603799	华友钴业	5,027,903.24	2.16
371	002394	联发股份	5,027,248.00	2.16
372	300822	贝仕达克	4,991,780.50	2.15
373	603602	纵横通信	4,981,913.60	2.14
374	688510	航亚科技	4,977,197.22	2.14
375	603115	海星股份	4,958,788.90	2.13
376	601995	中金公司	4,948,550.00	2.13
377	300153	科泰电源	4,924,482.00	2.12
378	688303	大全能源	4,895,132.04	2.11
379	300462	华铭智能	4,894,129.00	2.11
380	605060	联德股份	4,870,335.72	2.10
381	000166	申万宏源	4,860,502.00	2.09
382	000776	广发证券	4,837,036.00	2.08
383	688212	澳华内镜	4,832,976.06	2.08
384	1088	中国神华	4,812,455.23	2.07
385	002462	嘉事堂	4,799,468.00	2.06
386	603321	梅轮电梯	4,787,400.00	2.06
387	301106	骏成科技	4,748,054.00	2.04
388	300413	芒果超媒	4,742,877.00	2.04
389	688111	金山办公	4,737,474.39	2.04
390	002727	一心堂	4,732,205.98	2.04
391	601788	光大证券	4,730,689.00	2.04
392	603199	九华旅游	4,727,385.00	2.03
393	603757	大元泵业	4,721,984.00	2.03
394	301046	能辉科技	4,716,911.80	2.03
395	603338	浙江鼎力	4,713,573.00	2.03
396	002459	晶澳科技	4,690,102.00	2.02
397	603993	洛阳钼业	4,668,454.00	2.01
398	603185	弘元绿能	4,657,850.92	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	7,419,702,129.23
---------------	------------------

卖出股票的收入（成交）总额	6,990,376,854.31
---------------	------------------

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,898,295.34	3.12
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,898,295.34	3.12

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019694	23 国债 01	205,000	20,898,295.34	3.12

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,145,864.43
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,073.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,149,937.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
博时量化多策略股票 A	1,500	336,220.05	486,808,837.84	96.53%	17,521,231.43	3.47%
博时量化多策略股票 C	614	102,856.87	56,678,236.54	89.75%	6,475,880.93	10.25%
合计	2,054	276,282.47	543,487,074.38	95.77%	23,997,112.36	4.23%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化多策略股票 A	394,890.88	0.08%
	博时量化多策略股票 C	116.21	0.00%
	合计	395,007.09	0.07%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	-
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	10~50
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金合同生效日（2018年4月3日）基金份额总额	146,135,440.46	765,094,981.90
本报告期期初基金份额总额	148,516,527.87	11,358,219.20
本报告期基金总申购份额	427,710,592.50	193,008,504.30
减：本报告期基金总赎回份额	71,897,051.10	141,212,606.03
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	504,330,069.27	63,154,117.47

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2023 年 2 月 18 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,邵凯先生不再担任公司副总经理。

2023 年 5 月 27 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,吴慧峰先生任公司副总经理、财务负责人,孙献女士不再担任公司财务负责人。

2023 年 11 月 1 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,高阳先生不再担任公司总经理,江向阳先生代任公司总经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请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。报告期内本基金应付审计费为 49000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	6	6,770,985,424.75	47.04%	5,013,669.09	47.09%	-
长江证券	2	2,613,152,296.04	18.15%	1,933,415.34	18.16%	-
中金公司	2	1,549,123,637.35	10.76%	1,139,788.21	10.71%	-
中信证券	2	1,041,332,446.82	7.23%	766,496.98	7.20%	-
德邦证券	2	894,216,627.48	6.21%	655,074.37	6.15%	-
银河证券	2	622,715,375.95	4.33%	464,481.45	4.36%	-
国泰君安	1	444,083,015.98	3.08%	331,231.62	3.11%	-
西部证券	1	310,776,182.05	2.16%	231,807.63	2.18%	增加 1 个
中泰证券	1	149,007,262.45	1.04%	111,146.16	1.04%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	18,083,839.07	64.49%	1,000,000.00	24.94%	-	-
长江证券	35,784.41	0.13%	-	-	-	-
中金公司	6,782,585.76	24.19%	-	-	-	-
中信证券	119,377.96	0.43%	-	-	-	-
德邦证券	3,004,770.00	10.72%	3,010,000.00	75.06%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-
西部证券	15,954.34	0.06%	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时量化多策略股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-12-23
2	博时量化多策略股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-12-22
3	博时量化多策略股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-24
4	博时量化多策略股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-23
5	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通平安银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-22
6	博时基金管理有限公司关于暂停使用平安银行直联快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-22
7	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	2023-11-14
8	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	2023-11-11
9	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	2023-10-25

		子披露网站	
10	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年第 3 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	2023-10-25
11	博时量化多策略股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-10-24
12	博时量化多策略股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-10-24
13	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-09-28
14	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年中期报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-31
15	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 A）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-25
16	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-25
17	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-22
18	博时基金管理有限公司关于与银联商务股份有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-03
19	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通的华夏银行借记卡网上支付服务迁移的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-03
20	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电	2023-07-21

		子披露网站	
21	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
22	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 A）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
23	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
24	博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
25	博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
26	博时基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
27	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
28	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
29	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
30	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
31	博时量化多策略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	2023-04-22

		子披露网站	
32	博时量化多策略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
33	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 A）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
34	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
35	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
36	博时基金管理有限公司关于博时量化多策略股票型证券投资基金的基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
37	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
38	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
39	博时量化多策略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
40	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	2023-01-01~2023-03-05;2023-03-13~2023-04-06;2023-06-02~2023-07-27	39,774,145.30	6,377,894.00	-	46,152,039.30	8.13%

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化多策略股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化多策略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、博时量化多策略股票型证券投资基金各年度审计报告正本

6、报告期内博时量化多策略股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，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
二〇二四年三月二十九日