

博时量化价值股票型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55

7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化价值股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化价值股票	
基金主代码	005960	
交易代码	005960	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	47,073,384.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
下属分级基金的交易代码	005960	005961
报告期末下属分级基金的份额总额	4,011,271.41 份	43,062,113.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。
投资策略	本基金投资策略主要由 A 股投资策略、港股投资策略和其他投资策略三部分组成。A 股投资策略：本基金运用量化方法进行价值型投资，本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础，对其中的价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。港股投资策略：本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。其他投资策略主要包括：存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于中高风险/收益的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	秦一楠
	联系电话	0755-83169999	010-66060069

电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	95105568	95599
传真	0755-83195140	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	江向阳	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
本期已实现收益	789,467.47	51,808,991.66
本期利润	456,381.19	25,621,189.79
加权平均基金份额本期利润	0.1138	0.0799
本期加权平均净值利润率	7.82%	5.63%
本期基金份额净值增长率	7.45%	7.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期末可供分配利润	2,031,152.69	20,245,709.34
期末可供分配基金份额利润	0.5064	0.4702
期末基金资产净值	6,042,424.10	63,307,822.82
期末基金份额净值	1.5064	1.4702

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金份额累计净值增长率	50.64%	47.02%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时量化价值股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.94%	0.75%	-1.41%	0.67%	3.35%	0.08%
过去三个月	3.99%	0.71%	2.57%	0.80%	1.42%	-0.09%
过去六个月	7.45%	0.97%	1.33%	1.11%	6.12%	-0.14%
过去一年	25.66%	1.08%	21.43%	1.11%	4.23%	-0.03%
过去三年	50.58%	1.23%	38.51%	1.16%	12.07%	0.07%
自基金合同生效起至今	50.64%	1.23%	37.57%	1.16%	13.07%	0.07%

博时量化价值股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.86%	0.75%	-1.41%	0.67%	3.27%	0.08%
过去三个月	3.77%	0.71%	2.57%	0.80%	1.20%	-0.09%
过去六个月	7.01%	0.97%	1.33%	1.11%	5.68%	-0.14%
过去一年	24.64%	1.08%	21.43%	1.11%	3.21%	-0.03%
过去三年	46.98%	1.23%	38.51%	1.16%	8.47%	0.07%
自基金合同生效起至今	47.02%	1.23%	37.57%	1.16%	9.45%	0.07%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、20%和 10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

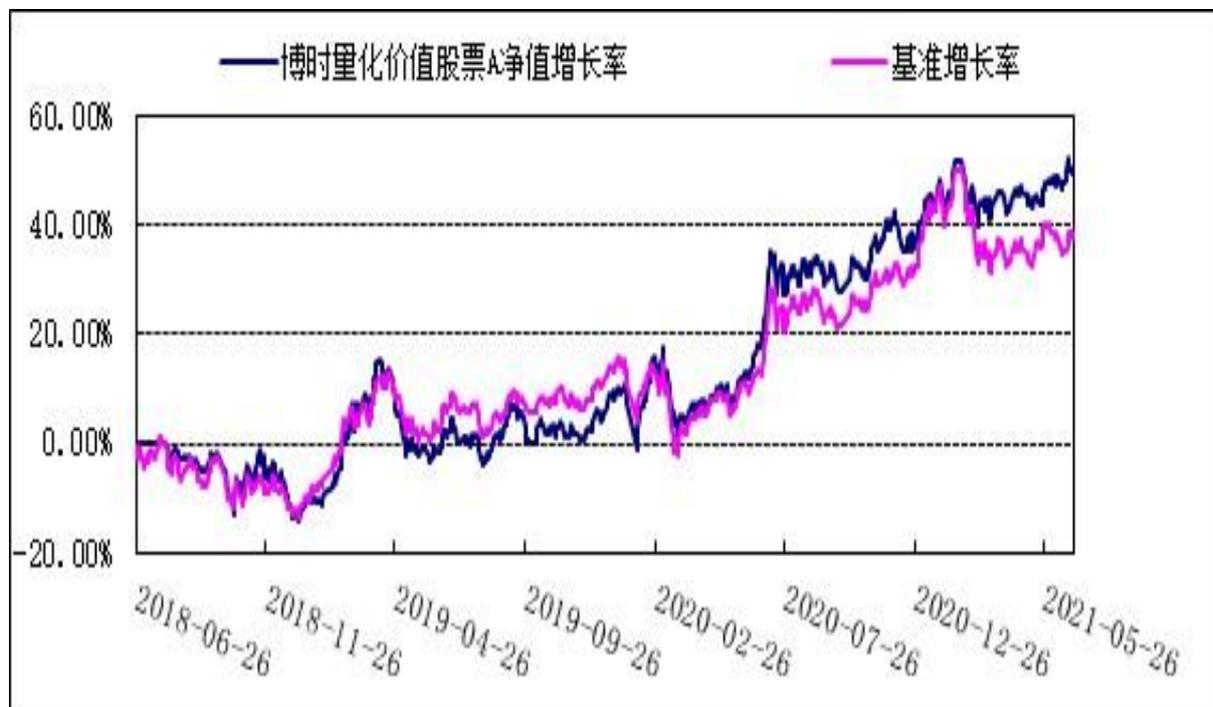
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化价值股票型证券投资基金

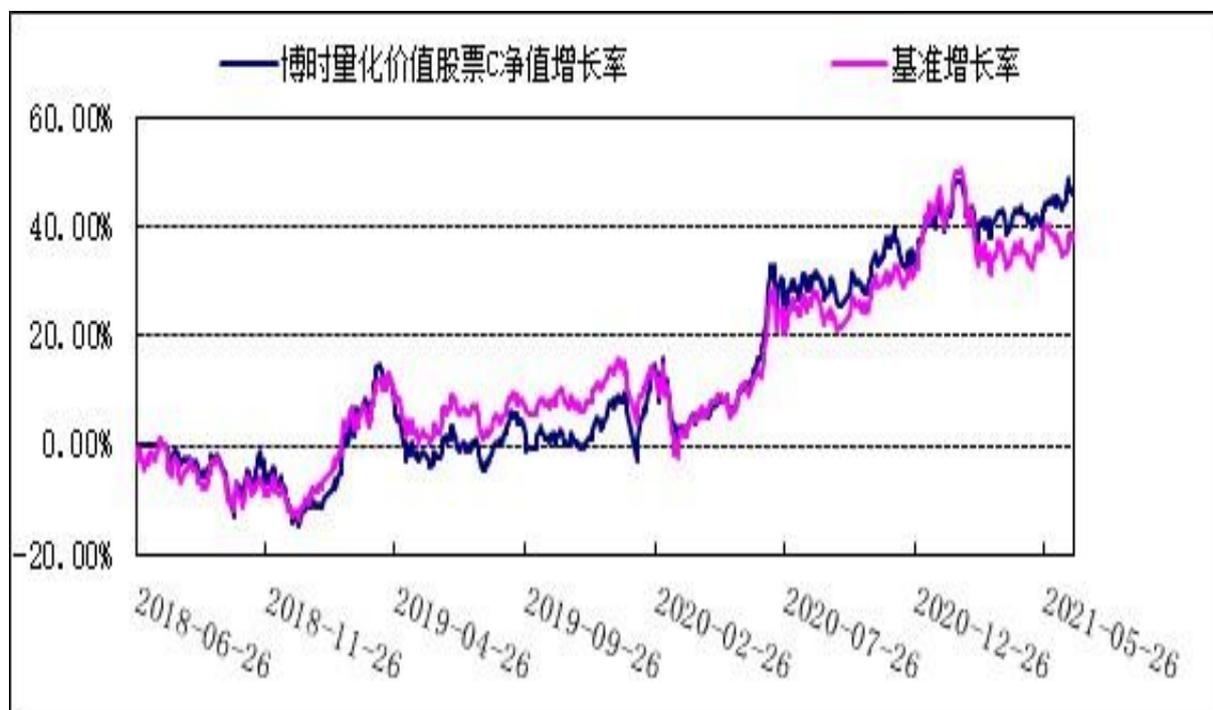
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 6 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日)

博时量化价值股票 A



博时量化价值股票 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2021 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 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 15482 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 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林景艺	基金经理	2018-06-26	-	10.9	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)基金经理。现任博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日一至今)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/基金经理	2018-06-26	-	18.9	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资

					副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、博时价值增长贰号证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2015年2月9日-2018年6月21日)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017年5月4日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日一至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	11.1	2010年7月加入博时基金管理有限公司，历任程序员、系统运维经理。2016年1月调任博时资本，任投资经理。2018年2月再次加入博时基金管理有限公司，现任基金经理助理。
周江	资深研究员兼基金经理助理	2018-07-27	2021-06-03	6.3	2014年1月至2015年4月在平安磐海资本工作。2015年4月加入博时基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理。2021年6月3日离职。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 24 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

2021 年上半年，随着后疫情时代的复工复产，全球经济整体向好，市场流动性充裕，放大了资产价格弹性。国内方面，得益于我国对疫情的高度重视和及时有效的防控措施，中国疫情防控效果领先全球，借助供应链优势，中国出口和制造业链条呈现高景气，在逆周期政策支持下，中国经济表现出蓬勃发展动力。

A 股市场在春节前整体上涨，春节后经历了约一个月时间的调整，3 月下旬开始进入震荡上行阶段。2021 年上半年，多数指数取得正的收益：代表中国经济长期内生动能的创业板指数上涨 17.22%，创成长指数涨幅达 27.21%；代表价值风格的红利指数在上半年开始发力，涨幅达 10.77%。风格结构方面，风格之间的切换显著，具体而言：以春节为分界点，春节前，大盘成长风格延续 2020 年的强势行情，价值风格震荡走弱，成长和价值的估值差进一步放大，并且屡创历史新高；春节后，市场风格反转，大盘成长风格回撤显著，价值和小盘成长风格表现出较强的韧性；进入二季度，市场进入震荡上行阶段，整体看小盘价值和小盘成长风格表现更优。行业板块方面，行业之间的差异进一步加大，板块轮动速度明显加快。以中信一级行业为代表，基础化工、钢铁、电力设备及新能源、综合这四个行业涨幅在 20% 以上，非银行金融、家电、国防军工这三个行业跌幅在 10% 以上。全部 A 股逾 4000 只股票，涨幅的中位数是 -7.2%，涨幅的均值是 8.5%，个股涨幅集中度较高。

2021 年上半年，恒生指数上涨 5.86%，板块方面，生物科技、工业、沪深港通中国新基建板块

上涨 10%以上，恒生沪深港通大湾区资讯科技业指数及消费品指数小幅下跌。

本基金是风格鲜明的运用量化方法进行价值型投资的产品。我们以自主研发的量化多策略体系为基础，从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格等多个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资。大盘价值市盈率从 18 年底的 8.1 倍到现在的 7.2 倍；大盘成长市盈率从 2018 年底的 15 倍到现在的 40 倍。当前，价值板块与其他板块的估值差已经达到历史高位，未来具有较大的结构性估值修复空间。我们认为未来两年内，大盘价值具有良好的基本面和极低的估值，具有更高的安全性和性价比。伴随后疫情时代的经济复苏，价值风格对应的金融和周期行业在复苏预期下更加具有业绩改善和估值修复的可能。我们将持续对价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.5064 元，份额累计净值为 1.5064 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.4702 元，份额累计净值为 1.4702 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 7.45%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 7.01%，同期业绩基准增长率为 1.33%。

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 2021 年下半年，宏观上，随着新冠疫苗在欧美主要经济体全面普及，欧美疫情有望较快控制，全球经济复苏将更加全面和均衡，当前供需不均衡的局面有望逐步修复。

国内经济方面，整体经济延续良好的复苏态势，同时受益于较为完善的供应链和良好的要素效率，经济整体景气复苏趋势良好。货币政策方面，目前流动性还是延续整体充裕性，当前由于全球经济复苏使得大宗商品价格大幅上涨，PPI 持续走高，未来随着产能未来逐渐释放，该矛盾点有望逐渐得到解决，后续需要紧密跟踪相关原材料价格的趋势变化。货币流动性整体上仍然充裕，但是在逐步回归常态的过程中，信用政策的边际收紧可能会对 A 股的估值带来压力，加大 A 股的波动。预计未来，A 股的驱动力逐步从估值扩张向盈利增长转变，基于当前极致的估值差异，我们认为 2021 年 A 股市场大概率上会加快风格和板块轮动的节奏。我们认为，紧扣上市公司的盈利预期变化或是未来投资的主线，估值低且盈利情况改善的个股和板块将更有机会。

港股方面，经济增长回升有望继续驱动港股盈利不断修复；AH 股溢价指数当前处于过去 10 年的高位，意味着两地上市股票 H 股价格显著低于 A 股；港股通资金占用比例显著增大，香港市场已成为内地资金的重要资产配置市场，因此我们认为在中长期维度上港股仍然具备配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—博时基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.3.1	33,113,002.95	42,990,560.16
结算备付金		2,108,573.59	14,706,899.75
存出保证金		215,382.59	2,879,468.28
交易性金融资产	6.4.3.2	63,610,426.94	503,963,225.09
其中：股票投资		63,550,926.94	503,152,225.09
基金投资		-	-
债券投资		59,500.00	811,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		-	642,769.31
应收利息	6.4.3.5	9,399.47	16,893.65
应收股利		-	1,620.12

应收申购款		24,173.71	68,433.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		99,080,959.25	565,269,869.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.3.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		27,739,907.48	4.18
应付赎回款		12,809.36	42,740.63
应付管理人报酬		138,339.36	422,157.89
应付托管费		38,427.64	117,266.09
应付销售服务费	6.4.3.7	119,186.69	370,308.22
应付交易费用		1,598,198.64	894,319.88
应交税费		-	2.11
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	83,843.16	164,500.00
负债合计		29,730,712.33	2,011,299.00
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	47,073,384.89	409,879,824.90
未分配利润	6.4.3.10	22,276,862.03	153,378,745.91
所有者权益合计		69,350,246.92	563,258,570.81
负债和所有者权益总计		99,080,959.25	565,269,869.81

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 47,073,384.89 份。其中 A 类基金份额净值 1.5064 元，基金份额总额 4,011,271.41 份；C 类基金份额净值 1.4702 元，基金份额总额 43,062,113.48 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
一、收入		36,923,217.02	58,928,324.85
1. 利息收入		248,058.95	182,075.40
其中：存款利息收入	6.4.3.11	239,324.74	176,436.69

债券利息收入		8,734.21	5,638.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		63,175,067.59	38,615,080.69
其中：股票投资收益	6.4.3.12	59,285,622.14	32,010,483.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13 .1	186,761.61	148,162.58
资产支持证券投资收益	6.4.3.13 .2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	1,694,970.87	1,752,485.44
股利收益	6.4.3.15	2,007,712.97	4,703,949.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-26,520,888.15	20,119,524.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	20,978.63	11,644.49
减：二、费用		10,845,646.04	10,752,165.34
1. 管理人报酬		2,086,908.83	1,991,123.53
2. 托管费		579,696.91	553,089.83
3. 销售服务费		1,831,881.75	1,731,324.68
4. 交易费用	6.4.3.18	6,245,102.95	6,373,521.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6,132.37	6,309.34
7. 其他费用	6.4.3.19	95,923.23	96,796.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,077,570.98	48,176,159.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,077,570.98	48,176,159.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	409,879,824.90	153,378,745.91	563,258,570.81

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,077,570.98	26,077,570.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-362,806,440.01	-157,179,454.86	-519,985,894.87
其中：1. 基金申购款	25,384,893.95	11,641,558.86	37,026,452.81
2. 基金赎回款	-388,191,333.96	-168,821,013.72	-557,012,347.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	47,073,384.89	22,276,862.03	69,350,246.92
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	429,295,435.09	27,441,878.61	456,737,313.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	48,176,159.51	48,176,159.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-19,893,385.65	-1,991,246.37	-21,884,632.02
其中：1. 基金申购款	4,162,756.78	300,854.74	4,463,611.52
2. 基金赎回款	-24,056,142.43	-2,292,101.11	-26,348,243.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	409,402,049.44	73,626,791.75	483,028,841.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：孙献，会计机构负责人：侣方方

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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]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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、对证券投资基金管理人运用基金买卖国债、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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(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。

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

比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	33,113,002.95
定期存款	-
其他存款	-
合计	33,113,002.95

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	58,481,443.61	63,550,926.94	5,069,483.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	59,500.00	59,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	59,500.00	59,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	58,540,943.61	63,610,426.94	5,069,483.33

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日

应收活期存款利息	8,011.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,286.30
应收债券利息	4.21
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	97.00
合计	9,399.47

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,598,198.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,598,198.64

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	83,843.16
合计	83,843.16

6.4.3.9 实收基金

博时量化价值股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	5,160,504.50	5,160,504.50
本期申购	2,182,461.34	2,182,461.34
本期赎回（以“-”号填列）	-3,331,694.43	-3,331,694.43
本期末	4,011,271.41	4,011,271.41

博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	404,719,320.40	404,719,320.40
本期申购	23,202,432.61	23,202,432.61
本期赎回（以“-”号填列）	-384,859,639.53	-384,859,639.53
本期末	43,062,113.48	43,062,113.48

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

6.4.3.10 未分配利润
博时量化价值股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,363,520.74	-289,606.46	2,073,914.28
本期利润	789,467.47	-333,086.28	456,381.19
本期基金份额交易产生的变动数	-500,126.86	984.08	-499,142.78
其中：基金申购款	1,241,729.01	-226,334.83	1,015,394.18
基金赎回款	-1,741,855.87	227,318.91	-1,514,536.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,652,861.35	-621,708.66	2,031,152.69

博时量化价值股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	174,179,375.03	-22,874,543.40	151,304,831.63
本期利润	51,808,991.66	-26,187,801.87	25,621,189.79
本期基金份额交易产生的变动数	-199,145,372.33	42,465,060.25	-156,680,312.08
其中：基金申购款	14,223,583.45	-3,597,418.77	10,626,164.68
基金赎回款	-213,368,955.78	46,062,479.02	-167,306,476.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,842,994.36	-6,597,285.02	20,245,709.34

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	96,266.67

其他	1,772.16
合计	239,324.74

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	2,214,308,501.71
减：卖出股票成本总额	2,155,022,879.57
买卖股票差价收入	59,285,622.14

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,744,623.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,555,402.75
减：应收利息总额	2,458.94
买卖债券差价收入	186,761.61

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	1,694,970.87

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,007,712.97
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	2,007,712.97

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-24,576,648.15
——股票投资	-24,576,648.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,944,240.00
——权证投资	-
——股指期货	-1,944,240.00
4. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-26,520,888.15

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	10,282.17
转换费收入	10,696.46
合计	20,978.63

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	6,245,102.95
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	6,245,102.95

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	7,580.07
中债登账户维护费	9,000.00
合计	95,923.23

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	521,791,403.12	13.23%	424,671,916.38	9.82%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

无。

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	486,139.93	13.29%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	395,502.75	10.56%	7,253.72	0.51%

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,086,908.83
其中：支付销售机构的客户维护费	15,627.35	30,686.31

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.90% 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 × 0.90% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	579,696.91

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
博时基金	-	1,819,569.08	1,819,569.08
中国农业银行	-	2,601.40	2,601.40
合计	-	1,822,170.48	1,822,170.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
中国农业银行	-	338.13	338.13
招商证券	-	3.09	3.09
博时基金	-	1,724,161.12	1,724,161.12
合计	-	1,724,502.34	1,724,502.34

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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 类基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

博时量化价值股票 C

份额单位：份

关联方名称	博时量化价值股票 C 本期末 2021 年 6 月 30 日		博时量化价值股票 C 上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例
博时资本管理有限 公司	20,522,643.32	43.60%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国农业银行-活 期存款	33,113,002.95	141,285.91	56,721,812.31	130,254.84

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单位： 股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600905	三峡 能源	2021- 06-02	2021- 12-10	首次 公开 发行 限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-

688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	首次公开发售	150.50	524.08	1,038.00	156,219.00	543,995.04	-
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	首次公开发售	75.42	103.88	1,191.00	89,825.22	123,721.08	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	首次公开发售	17.71	84.01	1,452.00	25,714.92	121,982.52	-
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	首次公开发售	14.01	35.62	3,258.00	45,644.58	116,049.96	-
688575	亚辉龙	2021-05-10	2021-11-17	首次公开发售	14.80	32.09	3,435.00	50,838.00	110,229.15	-
688607	康众医疗	2021-01-25	2021-08-02	首次公开发售	23.21	44.50	1,890.00	43,866.90	84,105.00	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发售	47.33	251.96	322.00	15,240.26	81,131.12	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发售	24.60	163.00	460.00	11,316.00	74,980.00	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-10-08	首次公开发售	11.38	17.74	3,203.00	36,450.14	56,821.22	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发售	13.60	19.87	2,693.00	36,624.80	53,509.91	-
688499	利元	2021-	2022-	首次	38.85	38.85	1,356.00	52,680.60	52,680.60	-

	亨	06-23	01-03	公开发 行限 售						
301020	密封 科技	2021- 06-28	2021- 07-06	新股 未上 市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
300973	立高 食品	2021- 04-08	2021- 10-15	首次 公开 发行 限售	28.28	115.71	345.00	9,756.60	39,919.95	-
300979	华利 集团	2021- 04-15	2021- 10-26	首次 公开 发行 限售	33.22	87.50	440.00	14,616.80	38,500.00	-
688367	工大 高科	2021- 06-21	2021- 12-28	首次 公开 发行 限售	11.53	17.94	1,717.00	19,797.01	30,802.98	-
301021	英诺 激光	2021- 06-28	2021- 07-06	新股 未上 市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕 科技	2021- 03-11	2021- 09-22	首次 公开 发行 限售	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识 科技	2021- 02-02	2021- 08-09	首次 公开 发行 限售	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
300981	中红 医疗	2021- 04-19	2021- 10-27	首次 公开 发行 限售	48.59	90.39	206.00	10,009.54	18,620.34	-
688226	威腾 电气	2021- 06-28	2021- 07-07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
301015	百洋 医药	2021- 06-22	2021- 12-30	首次 公开 发行 限售	7.64	38.83	372.00	2,842.08	14,444.76	-
300982	苏文 电能	2021- 04-19	2021- 10-27	首次 公开 发行 限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-

300940	南 极 光	2021- 01-27	2021- 08-03	首次 公开发 行 限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川 畅银	2021- 05-18	2021- 11-25	首次 公开发 行 限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药 易 购	2021- 01-20	2021- 07-27	首次 公开发 行 限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞 生物	2021- 02-02	2021- 08-09	首次 公开发 行 限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
301009	可靠 股份	2021- 06-08	2021- 12-17	首次 公开发 行 限售	12.54	27.89	453.00	5,680.62	12,634.17	-
300997	欢 乐 家	2021- 05-26	2021- 12-02	首次 公开发 行 限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛 股份	2021- 05-27	2021- 12-07	首次 公开发 行 限售	18.71	57.62	193.00	3,611.03	11,120.66	-
605287	德才 股份	2021- 06-28	2021- 07-06	新股 未上 市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨 家化	2021- 03-16	2021- 09-24	首次 公开发 行 限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联 软件	2021- 05-26	2021- 12-03	首次 公开发 行 限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300952	恒辉 安防	2021- 03-03	2021- 09-13	首次 公开发 行 限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同	2021-	2021-	首次	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-

	药业	03-31	10-11	公开发 行限 售						
300945	曼卡 龙	2021- 02-03	2021- 08-10	首次公 开发 行限 售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021- 02-18	2021- 08-25	首次公 开发 行限 售	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用 电梯	2021- 01-13	2021- 07-21	首次公 开发 行限 售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水 海纳	2021- 03-23	2021- 09-30	首次公 开发 行限 售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固 特	2021- 02-24	2021- 09-03	首次公 开发 行限 售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中 港	2021- 06-29	2021- 07-07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工 修复	2021- 03-18	2021- 09-29	首次公 开发 行限 售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300978	东箭 科技	2021- 04-15	2021- 10-26	首次公 开发 行限 售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊 科技	2020- 12-29	2021- 07-12	首次公 开发 行限 售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通 新材	2021- 01-13	2021- 07-21	首次公 开发 行限 售	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-
300971	博亚 精工	2021- 04-07	2021- 10-15	首次公 开	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-

				发行 限售						
300927	江天 化学	2020- 12-29	2021- 07-07	首次 公开发 行 限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300985	致远 新能	2021- 04-21	2021- 10-29	首次 公开发 行 限售	24.90	24.81	260.00	6,474.00	6,450.60	-
300975	商络 电子	2021- 04-14	2021- 10-21	首次 公开发 行 限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲 特材	2021- 03-30	2021- 10-11	首次 公开发 行 限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立 科技	2021- 06-09	2021- 12-17	首次 公开发 行 限售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖 智控	2021- 02-03	2021- 08-10	首次 公开发 行 限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣 股份	2021- 04-02	2021- 10-13	首次 公开发 行 限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰 生物	2021- 04-08	2021- 10-19	首次 公开发 行 限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐 环保	2021- 01-12	2021- 07-21	首次 公开发 行 限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
301020	密封 科技	2021- 06-28	2022- 01-06	首次 公开发 行 限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德 新材	2021- 05-17	2021- 11-26	首次 公开	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-

				发行限售						
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	580.00	58,000.00	58,000.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债未上市	100.00	100.00	15.00	1,500.00	1,500.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%(根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上

上市公司证券发行管理暂行办法的决定》〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重要公告	56.35	2021-07-01	59.49	800.00	33,178.55	45,080.00	-
601015	陕西黑猫	2021-06-30	配股	8.95	2021-07-08	7.68	19,300.00	153,208.45	172,735.00	-
688368	晶丰明源	2021-06-21	拟筹划重大资产重组	335.26	2021-07-05	402.31	1,000.00	334,687.50	335,260.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.9.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	58,000.00	811,000.00
AAA 以下	1,500.00	-
未评级	-	-
合计	59,500.00	811,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不

计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	33,113,002.95	-	-	-	33,113,002.95
结算备付金	2,108,573.59	-	-	-	2,108,573.59
存出保证金	215,382.59	-	-	-	215,382.59
交易性金融资产	-	-	59,500.00	63,550,926.94	63,610,426.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,399.47	9,399.47
应收申购款	-	-	-	24,173.71	24,173.71
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,436,959.13	-	59,500.00	63,584,500.12	99,080,959.25
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	12,809.36	12,809.36
应付证券清算款	-	-	-	27,739,907.48	27,739,907.48
应付管理人报酬	-	-	-	138,339.36	138,339.36
应付托管费	-	-	-	38,427.64	38,427.64
应付销售服务费	-	-	-	119,186.69	119,186.69
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,598,198.64	1,598,198.64
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	83,843.16	83,843.16
负债总计	-	-	-	29,730,712.33	29,730,712.33
利率敏感度缺口	35,436,959.13	-	59,500.00	33,853,787.79	69,350,246.92
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	42,990,560.16	-	-	-	42,990,560.16
结算备付金	14,706,899.75	-	-	-	14,706,899.75
存出保证金	269,607.96	-	-	2,609,860.32	2,879,468.28
交易性金融资产	-	-	811,000.00	503,152,225.09	503,963,225.09
应收证券清算款	-	-	-	642,769.31	642,769.31
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	16,893.65	16,893.65
应收申购款	-	-	-	68,433.45	68,433.45
应收股利	-	-	-	1,620.12	1,620.12

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	57,967,067.87	-	811,000.00	506,491,801.94	565,269,869.81
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	42,740.63	42,740.63
应付证券清算款	-	-	-	4.18	4.18
应付管理人报酬	-	-	-	422,157.89	422,157.89
应付托管费	-	-	-	117,266.09	117,266.09
应付销售服务费	-	-	-	370,308.22	370,308.22
应交税费	-	-	-	2.11	2.11
应付交易费用	-	-	-	894,319.88	894,319.88
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,500.00	164,500.00
负债总计	-	-	-	2,011,299.00	2,011,299.00
利率敏感度缺口	57,967,067.87	-	811,000.00	504,480,502.94	563,258,570.81

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	上年度末 2020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			
交易性金融资产	-	9,566,711.47	9,566,711.47
应收股利	-	1,620.12	1,620.12
资产合计	-	9,568,331.59	9,568,331.59
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净	-	9,568,331.59	9,568,331.59

额			
---	--	--	--

6.4.9.4.2 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
----	------------------

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	63,550,926.94	91.64	503,152,225.09	89.33
交易性金融资产—债券投资	59,500.00	0.09	811,000.00	0.14
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	63,610,426.94	91.72	503,963,225.09	89.47

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。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 90	增加约 2,339
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 90	减少约 2,339

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

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

(a) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 55,776,053.45 元，属于第二层次的余额为人民币 7,834,373.49 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：第一层次人民币 498,748,908.64 元，第二层次人民币 5,214,316.45 元，第三层次人民币 0.00 元）。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在第一层次和第二层次之间无重大转换（上年度：无）。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	63,550,926.94	64.14
	其中：股票	63,550,926.94	64.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,500.00	0.06
	其中：债券	59,500.00	0.06
	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	35,221,576.54	35.55
8	其他各项资产	248,955.77	0.25
9	合计	99,080,959.25	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	171,297.68	0.25
B	采矿业	2,008,717.00	2.90
C	制造业	28,493,518.66	41.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,606,028.20	8.08
E	建筑业	2,967,371.15	4.28
F	批发和零售业	2,272,689.92	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,225,101.00	1.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,534,309.20	3.65
J	金融业	14,021,363.90	20.22
K	房地产业	2,295,794.86	3.31
L	租赁和商务服务业	907,200.00	1.31
M	科学研究和技术服务业	167,343.60	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	128,807.33	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	446,742.44	0.64
R	文化、体育和娱乐业	266,666.00	0.38
S	综合	37,976.00	0.05
	合计	63,550,926.94	91.64

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	7.42
2	601318	中国平安	37,400	2,404,072.00	3.47
3	600153	建发股份	140,300	1,136,430.00	1.64
4	601818	光大银行	299,670	1,132,752.60	1.63
5	688083	中望软件	1,920	1,031,123.64	1.49
6	601166	兴业银行	48,100	988,455.00	1.43
7	000001	平安银行	42,500	961,350.00	1.39
8	002142	宁波银行	22,600	880,722.00	1.27
9	000725	京东方 A	138,000	861,120.00	1.24
10	600808	马钢股份	199,200	854,568.00	1.23
11	603486	科沃斯	3,600	821,088.00	1.18
12	600418	江淮汽车	62,300	774,389.00	1.12

13	300223	北京君正	7,300	736,716.00	1.06
14	600426	华鲁恒升	21,880	677,186.00	0.98
15	600809	山西汾酒	1,500	672,000.00	0.97
16	603260	合盛硅业	8,700	669,117.00	0.96
17	600015	华夏银行	106,600	659,854.00	0.95
18	000100	TCL 科技	83,000	634,950.00	0.92
19	600887	伊利股份	15,200	559,816.00	0.81
20	603010	万盛股份	26,520	556,124.40	0.80
21	601328	交通银行	112,300	550,270.00	0.79
22	002876	三利谱	8,400	543,480.00	0.78
23	600030	中信证券	21,300	531,222.00	0.77
24	300633	开立医疗	15,000	473,700.00	0.68
25	601398	工商银行	89,700	463,749.00	0.67
26	603659	璞泰来	3,380	461,708.00	0.67
27	601117	中国化学	52,200	457,272.00	0.66
28	603337	杰克股份	16,300	435,699.00	0.63
29	601668	中国建筑	91,700	426,405.00	0.61
30	601601	中国太保	14,600	422,962.00	0.61
31	601988	中国银行	135,600	417,648.00	0.60
32	300003	乐普医疗	13,000	417,560.00	0.60
33	601699	潞安环能	34,700	409,807.00	0.59
34	002920	德赛西威	3,700	407,296.00	0.59
35	300696	爱乐达	9,720	404,546.40	0.58
36	603599	广信股份	13,400	403,072.00	0.58
37	601208	东材科技	24,600	401,472.00	0.58
38	600919	江苏银行	55,200	391,920.00	0.57
39	601211	国泰君安	22,500	385,650.00	0.56
40	601229	上海银行	46,600	382,120.00	0.55
41	301015	百洋医药	6,916	381,955.80	0.55
42	601390	中国中铁	71,400	374,136.00	0.54
43	601939	建设银行	55,600	369,740.00	0.53
44	601077	渝农商行	91,100	363,489.00	0.52
45	000401	冀东水泥	28,960	357,656.00	0.52
46	000825	太钢不锈	47,400	355,026.00	0.51
47	600028	中国石化	78,700	343,132.00	0.49
48	600309	万华化学	3,100	337,342.00	0.49
49	688368	晶丰明源	1,000	335,260.00	0.48
50	600985	淮北矿业	27,400	334,554.00	0.48
51	000498	山东路桥	59,500	333,200.00	0.48
52	601618	中国中冶	108,000	321,840.00	0.46
53	000651	格力电器	6,000	312,600.00	0.45
54	600782	新钢股份	55,600	310,248.00	0.45
55	600308	华泰股份	56,200	310,224.00	0.45

56	000932	华菱钢铁	46,700	308,220.00	0.44
57	000333	美的集团	4,300	306,891.00	0.44
58	000906	浙商中拓	23,700	306,678.00	0.44
59	002124	天邦股份	43,420	304,374.20	0.44
60	601669	中国电建	77,900	301,473.00	0.43
61	002027	分众传媒	31,700	298,297.00	0.43
62	000778	新兴铸管	77,800	289,416.00	0.42
63	000723	美锦能源	37,800	285,768.00	0.41
64	600449	宁夏建材	24,400	277,184.00	0.40
65	000717	韶钢松山	60,200	276,318.00	0.40
66	000789	万年青	23,700	271,128.00	0.39
67	601888	中国中免	900	270,090.00	0.39
68	688575	亚辉龙	6,975	267,405.15	0.39
69	300782	卓胜微	480	258,000.00	0.37
70	600720	祁连山	24,000	252,960.00	0.36
71	600188	兖州煤业	16,100	247,296.00	0.36
72	600325	华发股份	36,100	243,314.00	0.35
73	600269	赣粤高速	71,600	240,576.00	0.35
74	000830	鲁西化工	12,800	239,744.00	0.35
75	601336	新华保险	5,200	238,732.00	0.34
76	688689	银河微电	6,543	238,219.11	0.34
77	688667	菱电电控	2,227	237,691.44	0.34
78	600376	首开股份	42,100	235,760.00	0.34
79	000926	福星股份	53,800	235,106.00	0.34
80	002948	青岛银行	47,000	233,590.00	0.34
81	000671	阳光城	44,600	231,920.00	0.33
82	600340	华夏幸福	44,100	231,084.00	0.33
83	002064	华峰化学	16,200	230,040.00	0.33
84	000666	经纬纺机	28,500	227,145.00	0.33
85	601688	华泰证券	14,300	225,940.00	0.33
86	600170	上海建工	81,378	224,603.28	0.32
87	600339	中油工程	78,900	224,076.00	0.32
88	000039	中集集团	12,300	223,614.00	0.32
89	002133	广宇集团	75,800	223,610.00	0.32
90	600051	宁波联合	33,100	220,446.00	0.32
91	000415	渤海租赁	90,100	218,042.00	0.31
92	002146	荣盛发展	38,600	217,704.00	0.31
93	002482	广田集团	74,700	215,136.00	0.31
94	002807	江阴银行	54,360	214,178.40	0.31
95	000667	美好置业	124,414	210,259.66	0.30
96	600519	贵州茅台	100	205,670.00	0.30
97	300463	迈克生物	4,800	202,032.00	0.29
98	002415	海康威视	3,100	199,950.00	0.29

99	688036	传音控股	951	199,234.50	0.29
100	603882	金城医学	1,200	191,724.00	0.28
101	300677	英科医疗	1,500	187,200.00	0.27
102	600089	特变电工	14,400	185,040.00	0.27
103	600377	宁沪高速	18,600	181,536.00	0.26
104	601857	中国石油	34,000	179,860.00	0.26
105	001965	招商公路	24,200	174,724.00	0.25
106	688607	康众医疗	3,836	174,204.80	0.25
107	300724	捷佳伟创	1,500	174,015.00	0.25
108	601015	陕西黑猫	19,300	172,735.00	0.25
109	601628	中国人寿	5,000	169,450.00	0.24
110	601919	中远海控	5,400	164,916.00	0.24
111	688161	威高骨科	1,468	155,681.40	0.22
112	002311	海大集团	1,900	155,040.00	0.22
113	000858	五粮液	500	148,945.00	0.21
114	601928	凤凰传媒	20,800	148,512.00	0.21
115	002092	中泰化学	14,400	147,888.00	0.21
116	600966	博汇纸业	11,300	147,465.00	0.21
117	300760	迈瑞医疗	300	144,015.00	0.21
118	603267	鸿远电子	1,100	140,712.00	0.20
119	600570	恒生电子	1,500	139,875.00	0.20
120	600039	四川路桥	22,200	139,194.00	0.20
121	002648	卫星石化	3,480	136,381.20	0.20
122	300957	贝泰妮	522	135,469.12	0.20
123	002240	盛新锂能	4,700	134,185.00	0.19
124	000799	酒鬼酒	500	127,800.00	0.18
125	603833	欧派家居	900	127,764.00	0.18
126	601377	兴业证券	13,100	126,546.00	0.18
127	688191	智洋创新	6,429	126,502.82	0.18
128	600606	绿地控股	23,200	126,440.00	0.18
129	300124	汇川技术	1,700	126,242.00	0.18
130	688099	晶晨股份	1,112	124,766.40	0.18
131	300919	中伟股份	760	123,880.00	0.18
132	600763	通策医疗	300	123,300.00	0.18
133	601006	大秦铁路	18,700	123,046.00	0.18
134	601126	四方股份	13,700	122,615.00	0.18
135	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.18
136	601636	旗滨集团	6,400	118,784.00	0.17
137	000429	粤高速 A	16,500	118,305.00	0.17
138	000568	泸州老窖	500	117,970.00	0.17
139	600867	通化东宝	9,700	115,818.00	0.17
140	688195	腾景科技	5,461	113,769.27	0.16
141	600104	上汽集团	4,800	105,456.00	0.15

142	601985	中国核电	20,800	105,248.00	0.15
143	688139	海尔生物	1,000	105,100.00	0.15
144	300015	爱尔眼科	1,478	104,908.44	0.15
145	601898	中煤能源	14,600	104,390.00	0.15
146	603877	太平鸟	1,900	101,422.00	0.15
147	600958	东方证券	10,100	100,899.00	0.15
148	000166	申万宏源	21,500	100,620.00	0.15
149	600012	皖通高速	15,300	98,838.00	0.14
150	002714	牧原股份	1,620	98,528.40	0.14
151	603501	韦尔股份	300	96,600.00	0.14
152	601138	工业富联	7,770	96,425.70	0.14
153	601901	方正证券	10,100	94,536.00	0.14
154	300122	智飞生物	500	93,365.00	0.13
155	300059	东方财富	2,680	87,877.20	0.13
156	603288	海天味业	680	87,686.00	0.13
157	688188	柏楚电子	197	85,892.00	0.12
158	603259	药明康德	540	84,558.60	0.12
159	688169	石头科技	67	84,487.00	0.12
160	300894	火星人	1,228	83,504.00	0.12
161	600031	三一重工	2,800	81,396.00	0.12
162	600036	招商银行	1,500	81,285.00	0.12
163	603806	福斯特	760	79,898.80	0.12
164	600585	海螺水泥	1,900	77,995.00	0.11
165	300529	健帆生物	900	77,724.00	0.11
166	300726	宏达电子	1,100	77,539.00	0.11
167	601100	恒立液压	900	77,328.00	0.11
168	300280	紫天科技	2,100	76,671.00	0.11
169	600050	中国联通	17,700	76,464.00	0.11
170	603345	安井食品	300	76,206.00	0.11
171	600742	一汽富维	7,300	74,387.00	0.11
172	002465	海格通信	7,800	73,788.00	0.11
173	000050	深天马 A	5,200	73,736.00	0.11
174	300450	先导智能	1,220	73,370.80	0.11
175	002736	国信证券	6,800	73,100.00	0.11
176	600839	四川长虹	25,000	72,750.00	0.10
177	300979	华利集团	740	72,670.00	0.10
178	603606	东方电缆	3,600	72,504.00	0.10
179	688111	金山办公	183	72,248.40	0.10
180	002179	中航光电	900	71,118.00	0.10
181	300973	立高食品	545	70,919.95	0.10
182	600507	方大特钢	10,300	69,834.00	0.10
183	688367	工大高科	3,471	68,636.76	0.10
184	600109	国金证券	5,400	68,526.00	0.10

185	600060	海信视像	4,000	67,600.00	0.10
186	000488	晨鸣纸业	8,200	66,748.00	0.10
187	603613	国联股份	665	66,480.05	0.10
188	601066	中信建投	2,100	66,003.00	0.10
189	601012	隆基股份	720	63,964.80	0.09
190	000783	长江证券	8,700	63,684.00	0.09
191	600779	水井坊	500	63,175.00	0.09
192	601108	财通证券	6,000	62,940.00	0.09
193	603678	火炬电子	900	60,750.00	0.09
194	601678	滨化股份	7,600	60,116.00	0.09
195	600483	福能股份	5,700	59,793.00	0.09
196	600132	重庆啤酒	300	59,385.00	0.09
197	600548	深高速	6,800	59,296.00	0.09
198	601319	中国人保	9,700	57,521.00	0.08
199	600586	金晶科技	6,100	56,791.00	0.08
200	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.08
201	603926	铁流股份	3,600	56,304.00	0.08
202	600096	云天化	4,000	56,160.00	0.08
203	300415	伊之密	2,600	55,900.00	0.08
204	600741	华域汽车	2,100	55,167.00	0.08
205	300373	扬杰科技	900	54,486.00	0.08
206	600025	华能水电	9,400	54,426.00	0.08
207	603444	吉比特	100	53,000.00	0.08
208	688499	利元亨	1,356	52,680.60	0.08
209	600446	金证股份	3,600	51,984.00	0.07
210	300803	指南针	1,300	50,180.00	0.07
211	300761	立华股份	1,500	49,695.00	0.07
212	000923	河钢资源	2,600	49,582.00	0.07
213	002603	以岭药业	1,700	49,572.00	0.07
214	601598	中国外运	9,700	48,985.00	0.07
215	603369	今世缘	900	48,744.00	0.07
216	300349	金卡智能	4,100	48,093.00	0.07
217	002410	广联达	700	47,740.00	0.07
218	600038	中直股份	900	47,466.00	0.07
219	603017	中衡设计	4,500	47,205.00	0.07
220	600711	盛屯矿业	6,600	47,058.00	0.07
221	600665	天地源	14,560	46,883.20	0.07
222	300953	震裕科技	440	45,754.00	0.07
223	600460	士兰微	800	45,080.00	0.07
224	600522	中天科技	4,500	45,000.00	0.06
225	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.06
226	603013	亚普股份	3,300	44,814.00	0.06
227	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.06

228	300625	三雄极光	2,800	44,436.00	0.06
229	002043	兔宝宝	4,500	44,370.00	0.06
230	000528	柳工	5,400	44,280.00	0.06
231	002293	罗莱生活	3,300	44,187.00	0.06
232	002394	联发股份	5,400	44,118.00	0.06
233	600138	中青旅	4,200	44,100.00	0.06
234	601218	吉鑫科技	12,500	44,000.00	0.06
235	000959	首钢股份	7,800	43,836.00	0.06
236	000036	华联控股	9,400	43,804.00	0.06
237	601019	山东出版	7,600	43,624.00	0.06
238	601555	东吴证券	5,200	43,368.00	0.06
239	002014	永新股份	5,000	43,250.00	0.06
240	600894	广日股份	6,400	43,008.00	0.06
241	000537	广宇发展	8,200	42,886.00	0.06
242	300587	天铁股份	1,900	42,655.00	0.06
243	002416	爱施德	4,200	42,126.00	0.06
244	603100	川仪股份	2,400	42,024.00	0.06
245	600681	百川能源	9,000	41,850.00	0.06
246	600006	东风汽车	5,700	41,610.00	0.06
247	603706	东方环宇	3,100	41,540.00	0.06
248	600232	金鹰股份	8,400	41,412.00	0.06
249	000863	三湘印象	12,100	39,809.00	0.06
250	600683	京投发展	10,600	39,644.00	0.06
251	000977	浪潮信息	1,400	39,382.00	0.06
252	603393	新天然气	2,120	38,753.60	0.06
253	601989	中国重工	9,400	38,728.00	0.06
254	000661	长春高新	100	38,700.00	0.06
255	600338	西藏珠峰	2,700	38,259.00	0.06
256	002811	郑中设计	4,650	38,176.50	0.06
257	600603	广汇物流	9,400	37,976.00	0.05
258	600061	国投资本	4,440	37,695.60	0.05
259	603586	金麒麟	3,100	37,417.00	0.05
260	000938	紫光股份	1,700	37,196.00	0.05
261	688016	心脉医疗	81	36,823.41	0.05
262	300755	华致酒行	900	36,729.00	0.05
263	601878	浙商证券	2,800	36,624.00	0.05
264	600705	中航资本	9,400	36,378.00	0.05
265	601233	桐昆股份	1,500	36,135.00	0.05
266	002752	昇兴股份	6,400	35,584.00	0.05
267	300676	华大基因	300	35,580.00	0.05
268	300941	创识科技	699	35,346.06	0.05
269	600207	安彩高科	4,500	35,235.00	0.05
270	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.05

271	300775	三角防务	900	34,380.00	0.05
272	000728	国元证券	4,300	34,271.00	0.05
273	601068	中铝国际	9,900	34,155.00	0.05
274	603897	长城科技	1,400	34,090.00	0.05
275	002022	科华生物	1,900	34,029.00	0.05
276	002230	科大讯飞	500	33,790.00	0.05
277	601186	中国铁建	4,500	33,435.00	0.05
278	000157	中联重科	3,600	33,264.00	0.05
279	300595	欧普康视	320	33,136.00	0.05
280	600704	物产中大	4,100	32,267.00	0.05
281	688298	东方生物	147	31,987.20	0.05
282	600048	保利地产	2,600	31,304.00	0.05
283	002382	蓝帆医疗	1,500	31,275.00	0.05
284	600810	神马股份	2,600	31,122.00	0.04
285	600900	长江电力	1,500	30,960.00	0.04
286	000733	振华科技	500	30,535.00	0.04
287	600332	白云山	900	30,465.00	0.04
288	600502	安徽建工	7,800	30,264.00	0.04
289	300981	中红医疗	306	29,906.34	0.04
290	300408	三环集团	700	29,694.00	0.04
291	002281	光迅科技	1,200	29,520.00	0.04
292	002932	明德生物	300	29,271.00	0.04
293	300997	欢乐家	1,828	28,994.40	0.04
294	000895	双汇发展	900	28,620.00	0.04
295	300737	科顺股份	900	28,296.00	0.04
296	000700	模塑科技	5,000	27,750.00	0.04
297	002371	北方华创	100	27,738.00	0.04
298	601162	天风证券	5,700	27,702.00	0.04
299	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.04
300	600582	天地科技	7,000	27,300.00	0.04
301	600475	华光环能	2,670	27,234.00	0.04
302	603055	台华新材	4,000	27,000.00	0.04
303	300244	迪安诊断	700	26,810.00	0.04
304	000425	徐工机械	4,200	26,754.00	0.04
305	600369	西南证券	5,400	26,298.00	0.04
306	002302	西部建设	3,300	26,070.00	0.04
307	300454	深信服	100	25,948.00	0.04
308	300982	苏文电能	517	25,546.93	0.04
309	300316	晶盛机电	500	25,250.00	0.04
310	002594	比亚迪	100	25,100.00	0.04
311	603103	横店影视	1,700	25,024.00	0.04
312	300614	百川畅银	529	24,349.02	0.04
313	300937	药易购	444	24,109.24	0.03

314	000826	启迪环境	4,500	24,075.00	0.03
315	603000	人民网	1,400	24,066.00	0.03
316	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.03
317	002244	滨江集团	5,700	23,883.00	0.03
318	300394	天孚通信	940	23,800.80	0.03
319	002322	理工环科	2,100	23,625.00	0.03
320	603305	旭升股份	700	23,611.00	0.03
321	300121	阳谷华泰	1,900	23,389.00	0.03
322	000656	金科股份	4,000	23,160.00	0.03
323	301009	可靠股份	753	22,738.17	0.03
324	000048	京基智农	1,230	22,693.50	0.03
325	001207	联科科技	682	22,581.02	0.03
326	300940	南极光	507	22,237.66	0.03
327	300748	金力永磁	700	22,141.00	0.03
328	300942	易瑞生物	743	21,547.36	0.03
329	300996	普联软件	441	21,455.43	0.03
330	300377	赢时胜	1,900	21,166.00	0.03
331	600774	汉商集团	1,400	21,028.00	0.03
332	001979	招商蛇口	1,900	20,805.00	0.03
333	601155	新城控股	500	20,800.00	0.03
334	300955	嘉亨家化	432	20,792.24	0.03
335	603738	泰晶科技	600	20,712.00	0.03
336	300413	芒果超媒	300	20,580.00	0.03
337	600276	恒瑞医药	300	20,391.00	0.03
338	603195	公牛集团	100	20,200.00	0.03
339	000046	泛海控股	8,700	20,010.00	0.03
340	300379	东方通	700	19,943.00	0.03
341	000859	国风塑业	3,300	19,569.00	0.03
342	002056	横店东磁	1,500	19,500.00	0.03
343	301002	崧盛股份	293	19,310.66	0.03
344	600111	北方稀土	900	18,630.00	0.03
345	300966	共同药业	486	18,162.44	0.03
346	002649	博彦科技	1,700	17,850.00	0.03
347	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.02
348	300978	东箭科技	1,093	17,209.80	0.02
349	603818	曲美家居	1,900	16,872.00	0.02
350	300931	通用电梯	1,272	16,861.92	0.02
351	300945	曼卡龙	874	16,841.12	0.02
352	600588	用友网络	500	16,630.00	0.02
353	000063	中兴通讯	500	16,615.00	0.02
354	601225	陕西煤业	1,400	16,590.00	0.02
355	300083	创世纪	1,500	16,425.00	0.02
356	002455	百川股份	2,100	16,401.00	0.02

357	300961	深水海纳	694	16,063.58	0.02
358	603392	万泰生物	60	15,550.80	0.02
359	600667	太极实业	1,700	15,470.00	0.02
360	002049	紫光国微	100	15,419.00	0.02
361	600155	华创阳安	1,400	14,980.00	0.02
362	300952	恒辉安防	540	14,839.20	0.02
363	601607	上海医药	700	14,791.00	0.02
364	300926	博俊科技	659	14,749.80	0.02
365	603466	风语筑	900	14,715.00	0.02
366	300948	冠中生态	524	14,666.08	0.02
367	002636	金安国纪	900	14,598.00	0.02
368	002739	万达电影	900	14,211.00	0.02
369	300958	建工修复	500	14,002.00	0.02
370	300971	博亚精工	445	13,983.05	0.02
371	600998	九州通	900	13,833.00	0.02
372	300975	商络电子	892	13,798.76	0.02
373	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
374	000768	中航西飞	500	13,140.00	0.02
375	002442	龙星化工	2,100	13,104.00	0.02
376	603927	中科软	300	12,885.00	0.02
377	300930	屹通新材	522	12,860.56	0.02
378	300950	德固特	319	12,675.47	0.02
379	300963	中洲特材	483	12,564.67	0.02
380	300967	晓鸣股份	907	12,510.78	0.02
381	002606	大连电瓷	1,700	12,393.00	0.02
382	603898	好莱客	900	12,330.00	0.02
383	603171	税友股份	637	12,230.40	0.02
384	300985	致远新能	460	12,228.60	0.02
385	600618	氯碱化工	1,300	11,895.00	0.02
386	600011	华能国际	2,800	11,816.00	0.02
387	600271	航天信息	900	11,727.00	0.02
388	002138	顺络电子	300	11,631.00	0.02
389	600803	新奥股份	700	11,557.00	0.02
390	300274	阳光电源	100	11,506.00	0.02
391	300033	同花顺	100	11,278.00	0.02
392	600497	驰宏锌锗	2,600	11,206.00	0.02
393	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02
394	000690	宝新能源	2,100	10,731.00	0.02
395	300943	春晖智控	455	10,597.55	0.02
396	301011	华立科技	275	10,592.00	0.02
397	300972	万辰生物	730	10,563.50	0.02
398	000635	英力特	900	10,197.00	0.01
399	601600	中国铝业	1,900	10,070.00	0.01

400	300017	网宿科技	1,700	9,945.00	0.01
401	300146	汤臣倍健	300	9,870.00	0.01
402	300927	江天化学	317	9,568.70	0.01
403	601990	南京证券	900	9,468.00	0.01
404	601838	成都银行	700	8,848.00	0.01
405	301007	德迈仕	503	8,489.32	0.01
406	300929	华骐环保	283	8,417.65	0.01
407	300628	亿联网络	100	8,380.00	0.01
408	600390	五矿资本	1,400	8,372.00	0.01
409	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.01
410	600018	上港集团	1,700	8,109.00	0.01
411	600260	凯乐科技	900	7,992.00	0.01
412	600690	海尔智家	300	7,773.00	0.01
413	601198	东兴证券	700	7,651.00	0.01
414	301012	扬电科技	270	7,600.20	0.01
415	601881	中国银河	700	7,546.00	0.01
416	300995	奇德新材	291	7,534.12	0.01
417	002673	西部证券	900	7,425.00	0.01
418	300998	宁波方正	301	7,381.32	0.01
419	000002	万科 A	300	7,143.00	0.01
420	600967	内蒙一机	700	7,084.00	0.01
421	300992	泰福泵业	300	6,943.00	0.01
422	002352	顺丰控股	100	6,770.00	0.01
423	000933	神火股份	700	6,615.00	0.01
424	301010	晶雪节能	318	6,225.98	0.01
425	600660	福耀玻璃	100	5,585.00	0.01
426	002271	东方雨虹	100	5,532.00	0.01
427	603900	莱绅通灵	700	5,292.00	0.01
428	600150	中国船舶	300	4,953.00	0.01
429	300390	天华超净	100	4,803.00	0.01
430	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01
431	002508	老板电器	100	4,650.00	0.01
432	002475	立讯精密	86	3,956.00	0.01
433	000028	国药一致	100	3,784.00	0.01
434	601339	百隆东方	700	3,773.00	0.01
435	003816	中国广核	1,400	3,738.00	0.01
436	603712	七一二	100	3,610.00	0.01
437	600062	华润双鹤	300	3,573.00	0.01
438	601899	紫金矿业	300	2,907.00	0.00
439	002068	黑猫股份	300	2,277.00	0.00
440	600398	海澜之家	300	2,172.00	0.00
441	603368	柳药股份	100	1,974.00	0.00
442	600176	中国巨石	116	1,799.16	0.00

443	002139	拓邦股份	100	1,799.00	0.00
444	600512	腾达建设	500	1,520.00	0.00
445	300639	凯普生物	42	1,386.42	0.00
446	600761	安徽合力	100	1,106.00	0.00
447	002726	龙大肉食	100	1,012.00	0.00
448	001696	宗申动力	100	798.00	0.00
449	000785	居然之家	100	607.00	0.00
450	600649	城投控股	100	476.00	0.00
451	600027	华电国际	100	344.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	32,302,568.17	5.73
2	601318	中国平安	23,531,499.95	4.18
3	600519	贵州茅台	20,968,688.00	3.72
4	000725	京东方 A	20,305,523.00	3.61
5	601818	光大银行	19,493,842.30	3.46
6	300124	汇川技术	17,664,655.22	3.14
7	002714	牧原股份	15,909,829.73	2.82
8	600900	长江电力	15,474,759.62	2.75
9	002027	分众传媒	15,147,509.67	2.69
10	600887	伊利股份	15,106,400.27	2.68
11	000001	平安银行	15,104,779.88	2.68
12	601166	兴业银行	13,931,333.13	2.47
13	002460	赣锋锂业	13,385,354.34	2.38
14	300059	东方财富	12,320,238.70	2.19
15	600015	华夏银行	11,752,970.20	2.09
16	603806	福斯特	11,721,373.90	2.08
17	300408	三环集团	11,647,239.61	2.07
18	002142	宁波银行	11,436,805.74	2.03
19	600153	建发股份	11,363,095.00	2.02
20	601857	中国石油	11,193,009.00	1.99

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例 (%)
1	601318	中国平安	55,036,023.76	9.77
2	000333	美的集团	46,763,722.66	8.30
3	000725	京东方 A	22,691,769.99	4.03
4	600519	贵州茅台	22,532,132.00	4.00
5	601857	中国石油	21,627,700.00	3.84
6	601166	兴业银行	20,818,507.05	3.70
7	000002	万科 A	20,287,792.81	3.60
8	600900	长江电力	20,153,272.26	3.58
9	601328	交通银行	19,713,039.00	3.50
10	300124	汇川技术	19,119,999.40	3.39
11	600015	华夏银行	18,918,569.14	3.36
12	002714	牧原股份	18,824,412.45	3.34
13	600887	伊利股份	18,795,428.80	3.34
14	601818	光大银行	18,581,390.00	3.30
15	601668	中国建筑	17,671,917.00	3.14
16	601398	工商银行	17,106,262.28	3.04
17	600028	中国石化	16,567,057.00	2.94
18	002460	赣锋锂业	16,060,164.25	2.85
19	002027	分众传媒	15,835,372.00	2.81
20	000001	平安银行	14,806,068.43	2.63
21	601186	中国铁建	13,491,515.82	2.40
22	002142	宁波银行	13,466,902.96	2.39
23	600104	上汽集团	13,124,026.83	2.33
24	601088	中国神华	13,081,026.00	2.32
25	600019	宝钢股份	12,968,080.37	2.30
26	600309	万华化学	12,768,063.74	2.27
27	603486	科沃斯	12,700,996.00	2.25
28	601601	中国太保	12,628,557.16	2.24
29	601390	中国中铁	12,577,015.00	2.23
30	300059	东方财富	12,500,666.40	2.22
31	603806	福斯特	11,878,072.80	2.11
32	601799	星宇股份	11,593,703.11	2.06

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,739,998,229.57
卖出股票的收入（成交）总额	2,214,308,501.71

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	59,500.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,500.00	0.09

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113050	南银转债	580	58,000.00	0.08
2	127038	国微转债	15	1,500.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					1,694,970.87
股指期货投资本期公允价值变动					-1,944,240.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除光大银行(601818)、兴业银行(601166)、平安银行(000001)、宁波银行(002142)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2021年6月15日，因存在1、以受让不良贷款本金为条件向企业融资，违规处置不良资产，且部分新增贷款已形成风险2、信贷资产收益权不真实转让，借助通道实现部分不良贷款违规出表3、结构性存款不真实，通过设置“假结构”违规吸收存款4、个人贷款管理不审慎，贷款资金违规流入证券类账户或用于购买理财产品5、贴现资金管控不严，导致企业利用关联关系套取银行信用，部分贴现资金回流至出票人并转存为本行结构性存款6、未按监管要求在增值税发票正面加注已承兑信息等违规行为，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对中国光大银行股份有限公司昆明分行处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2020年9月11日，因存在1、为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2、为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3、违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4、违反银行卡收单外包管理规定；5、未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2021年5月28日，因存在利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金

部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品等违规行为，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对平安银行股份有限公司处以罚款的监管处罚。

主要违规事实：2021 年 6 月 10 日和 2020 年 10 月 16 日，因存在代理销售保险不规范、授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	215,382.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,399.47
5	应收申购款	24,173.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	248,955.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	7.42	首次公开发行限售
2	688083	中望软件	543,995.04	0.78	首次公开发行限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时量化价值股票 A	592	6,775.80	0.00	0.00%	4,011,271.41	100.00%
博时量化价值股票 C	408	105,544.40	40,567,908.31	94.21%	2,494,205.17	5.79%
合计	956	49,239.94	40,567,908.31	86.18%	6,505,476.58	13.82%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化价值股票 A	223,351.24	5.57%
	博时量化价值股票 C	50.00	0.00%
	合计	223,401.24	0.47%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金合同生效日 (2018 年 6 月 26 日) 基金份额总额	177,981,219.30	163,210,681.29
本报告期期初基金份额总额	5,160,504.50	404,719,320.40
本报告期基金总申购份额	2,182,461.34	23,202,432.61
减：本报告期基金总赎回份额	3,331,694.43	384,859,639.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,011,271.41	43,062,113.48

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生担任公司总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
高华证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	2	2,024,803,242.69	51.34%	1,885,714.89	51.57%	-
国信证券	2	624,835,571.67	15.84%	581,909.92	15.91%	-
申港证券	1	8,740,850.02	0.22%	6,992.86	0.19%	新增 1 个
中信建投	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	167,922,352.42	4.26%	156,382.77	4.28%	-
招商证券	2	521,791,403.12	13.23%	486,139.93	13.29%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	177,962,587.44	4.51%	165,739.04	4.53%	-
海通证券	1	76,557,262.09	1.94%	55,989.42	1.53%	新增 1 个
中金公司	1	339,613,481.09	8.61%	316,284.41	8.65%	-
华泰证券	1	1,880,899.18	0.05%	1,504.75	0.04%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
高华证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	12,145,382.23	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时量化价值股票型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-23
2	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
3	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华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
4	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
5	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
6	博时量化价值股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
7	博时量化价值股票型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
8	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
9	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
10	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210310	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的	中国证券报、基金管理人	2021-02-20

	长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	网站、证监会基金电子披露网站	
12	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
13	博时量化价值股票型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	2	2021-01-01~2021-06-29	192,470,061.67	-	192,470,061.67	-	-
	3	2021-01-01~2021-06-29	93,295,413.51	-	93,295,413.51	-	-
	4	2021-01-01~2021-06-21	96,234,524.81	-	96,234,524.81	-	-

产品特有风险

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

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

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

金合并或者终止基金合同等情形。

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时量化价值股票型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时量化价值股票型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时量化价值股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，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
二〇二一年八月三十一日