

博时量化多策略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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	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	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59

7.12 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 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	95,656,043.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化多策略股票 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	91,213,083.83 份	4,442,959.61 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	<p>1、量化选股策略</p> <p>(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</p> <p>(2) 港股投资策略： 本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下港股市场的投资机会。</p> <p>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。</p>
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	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	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）	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	26,615,238.49	5,186,153.43
本期利润	18,497,686.64	2,322,698.85
加权平均基金份额本期利润	0.1586	0.1092
本期加权平均净值利润率	10.20%	7.20%
本期基金份额净值增长率	10.68%	10.22%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	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	54,721,866.90	2,482,449.37
期末可供分配基金份额利润	0.5999	0.5587
期末基金资产净值	148,333,591.57	7,038,375.70
期末基金份额净值	1.6262	1.5842
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	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	62.62%	58.42%

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
过去一个月	2.21%	0.81%	0.30%	0.65%	1.91%	0.16%
过去三个月	5.73%	0.82%	5.24%	0.69%	0.49%	0.13%
过去六个月	10.68%	1.07%	3.79%	0.97%	6.89%	0.10%
过去一年	42.01%	1.15%	18.86%	1.06%	23.15%	0.09%
过去三年	77.79%	1.26%	33.74%	1.15%	44.05%	0.11%
自基金合同生效起至今	62.62%	1.24%	22.07%	1.15%	40.55%	0.09%

博时量化多策略股票 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	2.15%	0.81%	0.30%	0.65%	1.85%	0.16%
过去三个月	5.52%	0.81%	5.24%	0.69%	0.28%	0.12%
过去六个月	10.22%	1.07%	3.79%	0.97%	6.43%	0.10%
过去一年	40.87%	1.15%	18.86%	1.06%	22.01%	0.09%
过去三年	73.55%	1.26%	33.74%	1.15%	39.81%	0.11%
自基金合同生效起至今	58.42%	1.24%	22.07%	1.15%	36.35%	0.09%

注：本基金的业绩比较基准为：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%。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。

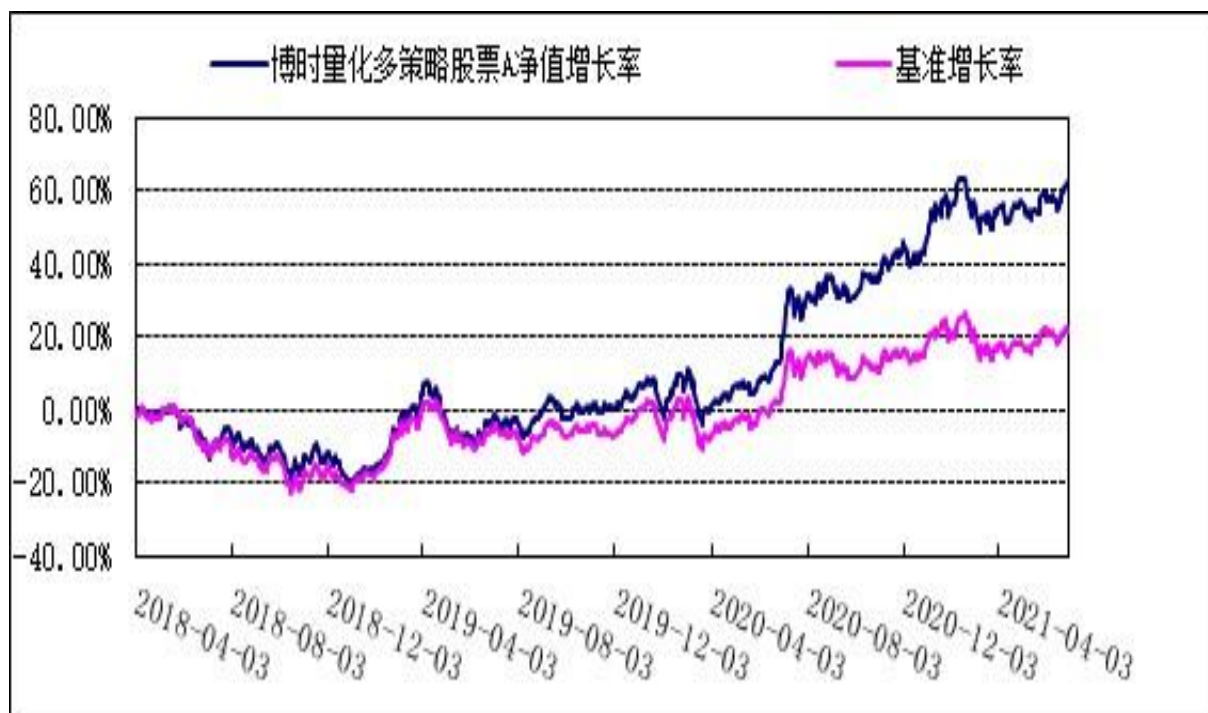
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化多策略股票型证券投资基金

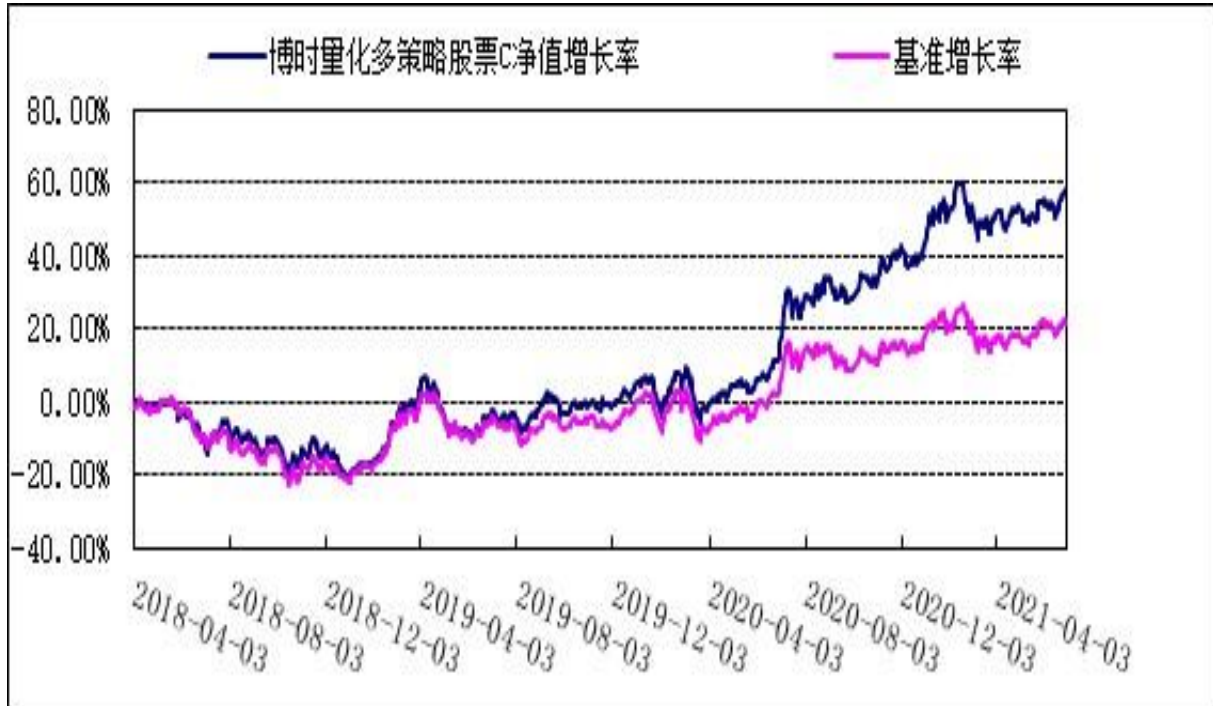
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 4 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日)

博时量化多策略股票 A



博时量化多策略股票 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	2018-04-03	-	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

					<p>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。</p>
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/基金经理	2018-04-03	-	18.9	<p>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。</p>

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	2018-04-09	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 年上半年全市场波动相比去年同期有所下降，市场在一季度冲高回落，二季度震荡向上。总体而言，市场成交活跃，成交量持续增长。在本轮行情中，各指数表现分化较为明显，当中以创业板和科创 50 表现最好，分别录得 17.22% 和 14.01% 的涨幅，此外上证 50 跌 3.90%，沪深 300 涨 0.24%，中证 500 涨 6.93%，中证 1000 涨 6.58%。

市场风格方面，对于大小盘来说，一季度风格切换剧烈，春节前大盘表现优异，春节后小盘强势反弹。二季度风格较为稳定，小盘持续好于大盘。对于价值成长来说，一季度走强的价值风格在二季度开始回落，并持续弱于成长风格。具体到指数上，小盘成长表现最好，大幅领先大盘价值。动量风格则反复变化，1 月走强，2 月回落，3、4 月走强，5 月回撤，6 月再度走强。

在行业层面，周期板块表现较好，消费板块较弱。具体而言，化工、钢铁、电力设备及新能源涨幅靠前，非银、家电、军工、房地产跌幅较大。

本基金在 2021 年上半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，获取了一定的超额收益。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 2021 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.6262 元，份额累计净值为 1.6262 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.5842 元，份额累计净值为 1.5842 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 10.68%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 10.22%，同期业绩基准增长率为 3.79%。

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 2021 年下半年，全球经济有望加速复苏，资本或会脱虚向实，宏观政策或将呈现“紧信用、松货币、宽财政”的组合。在利率中枢易上难下的市场预期下，类似去年高动量、高估值的风格特征恐难以持续。短期来看投资者行为或将会趋于稳健保守，加上 A 股的机构化和国际化日益凸显，市场的整体波动有望降低。当前我国的经济结构改革正在加速，碳达峰与碳中和也为市场指出了未来的经济结构改革优化方向，在此背景下，景气程度高、产业前景相对明确、估值和业绩匹配度较好的具有成长潜力的公司更具有配置价值。

在当前的市场环境下，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，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

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合规守信、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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化多策略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	9,692,233.03	16,637,329.69
结算备付金		5,291,364.91	5,644,934.85
存出保证金		127,068.52	1,079,128.88
交易性金融资产	6.4.3.2	142,456,030.45	231,675,807.13
其中：股票投资		142,282,930.45	231,382,807.13
基金投资		-	-
债券投资		173,100.00	293,000.00
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		302,788.71	347,275.03
应收利息	6.4.3.5	3,976.59	5,178.88
应收股利		-	-
应收申购款		89,505.79	279.91
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		157,962,968.00	255,389,934.37
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		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,403,347.32	385,578.69
应付管理人报酬		236,862.98	309,926.54
应付托管费		39,477.16	51,654.42
应付销售服务费		7,858.24	25,627.55
应付交易费用	6.4.3.7	816,888.23	415,243.03
应交税费		-	1,210.92
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	86,566.80	164,511.60
负债合计		2,591,000.73	1,353,752.75
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.3.9	95,656,043.44	173,528,789.84
未分配利润	6.4.3.10	59,715,923.83	80,507,391.78
所有者权益合计		155,371,967.27	254,036,181.62
负债和所有者权益总计		157,962,968.00	255,389,934.37

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 95,656,043.44 份。其中 A 类基金份额净值 1.6262 元，基金份额总额 91,213,083.83 份；C 类基金份额净值 1.5842 元，基金份额总额 4,442,959.61 份。

6.2 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：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		25,972,893.16	13,280,775.57
1. 利息收入		84,242.11	64,636.70
其中：存款利息收入	6.4.3.11	83,248.57	31,837.94
债券利息收入		993.54	32,798.76
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）		36,834,951.83	13,096,314.06
其中：股票投资收益	6.4.3.12	34,011,546.28	10,891,370.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	941,608.69	36,119.68
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	450,565.82	451,689.31
股利收益	6.4.3.15	1,431,231.04	1,717,134.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-10,981,006.43	113,233.20
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	34,705.65	6,591.61
减：二、费用		5,152,507.67	2,046,076.31
1. 管理人报酬		1,606,751.81	959,426.12
2. 托管费		267,791.89	159,904.31
3. 销售服务费		130,483.50	149,940.09
4. 交易费用	6.4.3.18	3,050,858.08	683,854.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,685.46	1,626.11
7. 其他费用	6.4.3.19	94,936.93	91,325.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,820,385.49	11,234,699.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,820,385.49	11,234,699.26

6.3 所有者权益（基金净值）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：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）	173,528,789.84	80,507,391.78	254,036,181.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,820,385.49	20,820,385.49
三、本期基金份额交易产	-77,872,746.40	-41,611,853.44	-119,484,599.84

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	106,575,845.82	57,225,335.97	163,801,181.79
2. 基金赎回款	-184,448,592.22	-98,837,189.41	-283,285,781.63
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）	95,656,043.44	59,715,923.83	155,371,967.27
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）	132,532,255.11	6,935,576.64	139,467,831.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,234,699.26	11,234,699.26
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）	-13,514,483.10	-1,665,889.36	-15,180,372.46
其中：1. 基金申购款	22,547,356.52	422,123.34	22,969,479.86
2. 基金赎回款	-36,061,839.62	-2,088,012.70	-38,149,852.32
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）	119,017,772.01	16,504,386.54	135,522,158.55

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：佘方方

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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 2018 年 1 月 1 日起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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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	9,692,233.03
定期存款	-
其他存款	-
合计	9,692,233.03

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	135,686,051.13	142,282,930.45	6,596,879.32

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	173,100.00	173,100.00
	银行间市场	-	-
	合计	173,100.00	173,100.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	135,859,151.13	142,456,030.45	6,596,879.32

6.4.3.3 买入返售金融资产

6.4.3.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.4 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	1,530.09
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	2,376.76
应收债券利息	12.54
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	57.20
合计	3,976.59

6.4.3.5 其他资产

无余额。

6.4.3.6 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	816,888.23
银行间市场应付交易费用	-

合计	816,888.23
----	------------

6.4.3.7 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	243.94
应付证券出借违约金	-
预提费用	86,322.86
合计	86,566.80

6.4.3.8 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 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	144,614,046.25	144,614,046.25
本期申购	80,491,085.74	80,491,085.74
本期赎回（以“-”号填列）	-133,892,048.16	-133,892,048.16
本期末	91,213,083.83	91,213,083.83

博时量化多策略股票 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	28,914,743.59	28,914,743.59
本期申购	26,084,760.08	26,084,760.08
本期赎回（以“-”号填列）	-50,556,544.06	-50,556,544.06
本期末	4,442,959.61	4,442,959.61

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

6.4.3.9 未分配利润

博时量化多策略股票 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	57,753,897.70	10,109,130.90	67,863,028.60
本期利润	26,615,238.49	-8,117,551.85	18,497,686.64
本期基金份额交易产生的变动数	-29,647,269.29	407,061.79	-29,240,207.50
其中：基金申购款	45,160,161.56	-1,121,853.78	44,038,307.78
基金赎回款	-74,807,430.85	1,528,915.57	-73,278,515.28

本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,721,866.90	2,398,640.84	57,120,507.74

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	10,674,786.86	1,969,576.32	12,644,363.18
本期利润	5,186,153.43	-2,863,454.58	2,322,698.85
本期基金份额交易产生的变动数	-13,378,490.92	1,006,844.98	-12,371,645.94
其中：基金申购款	10,641,699.09	2,545,329.10	13,187,028.19
基金赎回款	-24,020,190.01	-1,538,484.12	-25,558,674.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,482,449.37	112,966.72	2,595,416.09

6.4.3.10 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	36,869.65
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	45,567.08
其他	811.84
合计	83,248.57

6.4.3.11 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	1,179,200,839.12
减：卖出股票成本总额	1,145,189,292.84
买卖股票差价收入	34,011,546.28

6.4.3.12 债券投资收益
6.4.3.12.1 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	5,210,786.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,266,398.01
减：应收利息总额	2,779.44

买卖债券差价收入	941,608.69
----------	------------

6.4.3.12.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

6.4.3.13 衍生工具收益

6.4.3.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.13.2 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	450,565.82

6.4.3.14 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	1,431,231.04
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	1,431,231.04

6.4.3.15 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	-10,761,541.43
——股票投资	-10,761,541.43
——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	-219,465.00
——权证投资	-
——股指期货	-219,465.00
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	-10,981,006.43

6.4.3.16 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	32,583.64
转换费收入	2,122.01
合计	34,705.65

6.4.3.17 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	3,050,858.08
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	3,050,858.08

6.4.3.18 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,114.07
中债登账户维护费	9,000.00
合计	94,936.93

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

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	603,953,592.94	27.04%	152,562,410.14	30.74%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	469,022.00	10.50%	143,737.40	23.99%

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	441,678.09	27.04%	441,477.39	54.04%
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	111,569.58	30.74%	32,996.83	21.14%

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	1,606,751.81	959,426.12
其中：支付销售机构的客户维护费	65,504.20	21,657.49

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

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

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	267,791.89	159,904.31

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 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		
	博时量化多策略 股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	102,091.50	102,091.50
招商银行	-	1,290.46	1,290.46
招商证券	-	73.20	73.20

合计	-	103,455.16	103,455.16
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		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
招商证券	-	76.87	76.87
招商银行	-	587.17	587.17
博时基金	-	68,430.62	68,430.62
合计	-	69,094.66	69,094.66

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

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行-活期存款	9,692,233.03	36,869.65	11,924,171.43	19,033.17

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

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	首次公开发行股票限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688538	和辉光电	2021-05-20	2021-11-29	首次公开发行股票限售	2.65	3.38	41,792.00	110,748.80	141,256.96	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	首次公开发行股票限售	15.57	48.55	2,866.00	44,623.62	139,144.30	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	首次公开发行股票限售	10.19	18.40	7,487.00	76,292.53	137,760.80	-
688619	罗普特	2021-02-08	2021-08-23	首次公开发行股票限售	19.31	26.74	2,946.00	56,887.26	78,776.04	-
688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	首次公开发行股票限售	25.91	55.53	1,199.00	31,066.09	66,580.47	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	首次公开发行股票限售	7.72	19.11	3,347.00	25,838.84	63,961.17	-
688639	华恒生物	2021-04-14	2021-10-22	首次公开发行股票限售	23.16	42.28	1,477.00	34,207.32	62,447.56	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	首次公开发行股票限售	10.10	16.24	3,750.00	37,875.00	60,900.00	-

688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,482.00	51,453.36	51,453.36	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	1,290.00	50,116.50	50,116.50	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	首次公开发行限售	14.48	19.21	1,818.00	26,324.64	34,923.78	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	2,972.00	31,622.08	31,622.08	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发行限售	24.60	163.00	189.00	4,649.40	30,807.00	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	120.00	5,679.60	30,235.20	-
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	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	1,111.00	24,397.56	24,397.56	-
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	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	161.00	4,631.97	16,075.85	-
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	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	33.22	87.50	162.00	5,381.64	14,175.00	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	首次公开发行限售	7.64	38.83	354.00	2,704.56	13,745.82	-
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	-
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	-
300941	创识	2021-0	2021-0	首次公	21.31	49.94	245.00	5,220.95	12,235.30	-

	科技	2-02	8-09	开发行 限售						
300614	百川 畅银	2021-0 5-18	2021-1 1-25	首次公 开发行 限售	9.19	40.38	291.00	2,674.29	11,750.58	-
605287	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股未 上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨 家化	2021-0 3-16	2021-0 9-24	首次公 开发行 限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
301009	可靠 股份	2021-0 6-08	2021-1 2-17	首次公 开发行 限售	12.54	27.89	381.00	4,777.74	10,626.09	-
300973	立高 食品	2021-0 4-08	2021-1 0-15	首次公 开发行 限售	28.28	115.71	84.00	2,375.52	9,719.64	-
300952	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	首次公 开发行 限售	11.72	27.08	337.00	3,949.64	9,125.96	-
301002	崧盛 股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	首次公 开发行 限售	18.71	57.62	158.00	2,956.18	9,103.96	-
300945	曼 卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	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	2021-0 2-18	2021-0 8-25	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	2021-0 1-13	2021-0 7-21	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	2021-0 3-23	2021-0 9-30	首次公 开发行 限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德 固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	首次公 开发行 限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-
300966	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	首次公 开发行 限售	8.24	31.54	263.00	2,167.12	8,295.02	-
300958	建工 修复	2021-0 3-18	2021-0 9-29	首次公 开发行 限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300926	博俊	2020-1	2021-0	首次公	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-

	科技	2-29	7-12	开发行限售						
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	首次公开发行限售	4.94	13.05	608.00	3,003.52	7,934.40	-
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	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	48.59	90.39	73.00	3,547.07	6,598.47	-
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	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	8.42	13.60	479.00	4,033.18	6,514.40	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	首次公开发行限售	5.48	13.03	475.00	2,603.00	6,189.25	-
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	-
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	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	首次公开发行限售	18.24	28.29	177.00	3,228.48	5,007.33	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	首次公开发行限售	12.13	22.49	210.00	2,547.30	4,722.90	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	首次公开发行限售	7.19	12.65	356.00	2,559.64	4,503.40	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	首次公开发行限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发行限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-

300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发行限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发行限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	首次公开发行限售	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行限售	4.54	11.54	326.00	1,480.04	3,762.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	10.64	10.64	331.00	3,521.84	3,521.84	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行限售	24.90	24.81	103.00	2,564.70	2,555.43	-

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	2021-06-15	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	1,550.00	155,000.00	155,000.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债未上市	100.00	100.00	101.00	10,100.00	10,100.00	-
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	新债未上市	100.00	100.00	80.00	8,000.00	8,000.00	-

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
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	23,700.00	159,318.94	132,483.00	-
600460	士兰微	2021-06-30	重要公告	56.35	2021-07-01	59.49	5,100.00	235,104.89	287,385.00	-
601015	陕西黑猫	2021-06-30	配股	8.95	2021-07-08	7.68	72,500.00	745,170.14	648,875.00	-

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。

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	163,000.00	293,000.00
AAA 以下	10,100.00	-
未评级	-	-
合计	173,100.00	293,000.00

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	9,692,233.03	-	-	-	9,692,233.03
结算备付金	5,291,364.91	-	-	-	5,291,364.91
存出保证金	127,068.52	-	-	-	127,068.52
交易性金融资产	-	-	173,100.00	142,282,930.45	142,456,030.45
应收证券清算款	-	-	-	302,788.71	302,788.71
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,976.59	3,976.59
应收申购款	-	-	-	89,505.79	89,505.79
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,110,666.46	-	173,100.00	142,679,201.54	157,962,968.00
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,403,347.32	1,403,347.32
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	236,862.98	236,862.98
应付托管费	-	-	-	39,477.16	39,477.16
应付销售服务费	-	-	-	7,858.24	7,858.24
应交税费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	816,888.23	816,888.23
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	86,566.80	86,566.80
负债总计	-	-	-	2,591,000.73	2,591,000.73
利率敏感度缺口	15,110,666.46	-	173,100.00	140,088,200.81	155,371,967.27
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	16,637,329.69	-	-	-	16,637,329.69
结算备付金	5,644,934.85	-	-	-	5,644,934.85
存出保证金	97,192.88	-	-	981,936.00	1,079,128.88
交易性金融资产	-	-	293,000.00	231,382,807.13	231,675,807.13
应收证券清算款	-	-	-	347,275.03	347,275.03
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
应收利息				5,178.88	5,178.88
应收申购款				279.91	279.91
应收股利				-	-
其他资产				-	-
资产总计	22,379,457.42		293,000.00	232,717,476.95	255,389,934.37
负债					
卖出回购金融资产款				-	-
应付赎回款				385,578.69	385,578.69
应付证券清算款				-	-
应付管理人报酬				309,926.54	309,926.54
应付托管费				51,654.42	51,654.42
应付销售服务费				25,627.55	25,627.55
应交税费				1,210.92	1,210.92
应付交易费用				415,243.03	415,243.03
应付利息				-	-
其他负债				164,511.60	164,511.60
负债总计				1,353,752.75	1,353,752.75
利率敏感度缺口	22,379,457.42		293,000.00	231,363,724.20	254,036,181.62

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。

6.4.9.4.3 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	142,282,930.45	91.58	231,382,807.13	91.08
交易性金融资产—债券投资	173,100.00	0.11	293,000.00	0.12
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	142,456,030.45	91.69	231,675,807.13	91.20

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 557	增加约 1,109
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 557	减少约 1,109	

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

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末，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中属于第一层次的余额为 134,659,997.94 元，属于第二层次的余额为 7,796,032.51 元，属于第三层次的余额为 0.00

元（上年度末：第一层次 224,340,034.97 元，第二层次 7,335,772.16 元，第三层次 0.00 元）。

(ii) 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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(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	142,282,930.45	90.07
	其中：股票	142,282,930.45	90.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	173,100.00	0.11
	其中：债券	173,100.00	0.11
	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	14,983,597.94	9.49

8	其他各项资产	523,339.61	0.33
9	合计	157,962,968.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	845,714.56	0.54
B	采矿业	3,891,837.72	2.50
C	制造业	86,281,965.10	55.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,317,343.41	4.07
E	建筑业	3,344,447.37	2.15
F	批发和零售业	1,188,029.43	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	2,965,981.00	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,443,385.64	4.15
J	金融业	22,220,849.79	14.30
K	房地产业	1,414,761.72	0.91
L	租赁和商务服务业	2,725,574.00	1.75
M	科学研究和技术服务业	1,566,903.48	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	55,623.89	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	95,046.00	0.06
Q	卫生和社会工作	1,919,509.34	1.24
R	文化、体育和娱乐业	1,005,958.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	142,282,930.45	91.58

注：上表按行业分类的股票投资组合仅包括在上海证券交易所和深圳证券交易所上市交易的股票。

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	3.31
2	601318	中国平安	48,900	3,143,292.00	2.02
3	600519	贵州茅台	1,500	3,085,050.00	1.99
4	000725	京东方 A	387,200	2,416,128.00	1.56
5	600887	伊利股份	58,100	2,139,823.00	1.38
6	000001	平安银行	92,000	2,081,040.00	1.34
7	601328	交通银行	390,900	1,915,410.00	1.23
8	300223	北京君正	17,700	1,786,284.00	1.15

9	000100	TCL 科技	224,600	1,718,190.00	1.11
10	600809	山西汾酒	3,700	1,657,600.00	1.07
11	000858	五粮液	5,400	1,608,606.00	1.04
12	601888	中国中免	5,100	1,530,510.00	0.99
13	000333	美的集团	21,400	1,527,318.00	0.98
14	601398	工商银行	262,349	1,356,344.33	0.87
15	300782	卓胜微	2,400	1,290,000.00	0.83
16	601919	中远海控	39,400	1,203,276.00	0.77
17	601988	中国银行	390,500	1,202,740.00	0.77
18	600030	中信证券	48,200	1,202,108.00	0.77
19	002415	海康威视	18,100	1,167,450.00	0.75
20	603260	合盛硅业	14,900	1,145,959.00	0.74
21	601288	农业银行	377,300	1,143,219.00	0.74
22	300015	爱尔眼科	15,833	1,123,826.34	0.72
23	300122	智飞生物	5,900	1,101,707.00	0.71
24	000723	美锦能源	140,900	1,065,204.00	0.69
25	603486	科沃斯	4,600	1,049,168.00	0.68
26	600015	华夏银行	166,500	1,030,635.00	0.66
27	002920	德赛西威	9,200	1,012,736.00	0.65
28	300003	乐普医疗	31,300	1,005,356.00	0.65
29	600702	舍得酒业	4,700	1,004,766.00	0.65
30	000568	泸州老窖	4,200	990,948.00	0.64
31	603659	璞泰来	7,220	986,252.00	0.63
32	603259	药明康德	6,272	982,132.48	0.63
33	601669	中国电建	252,700	977,949.00	0.63
34	600426	华鲁恒升	31,440	973,068.00	0.63
35	603501	韦尔股份	3,000	966,000.00	0.62
36	603337	杰克股份	36,000	962,280.00	0.62
37	601939	建设银行	144,100	958,265.00	0.62
38	300633	开立医疗	30,000	947,400.00	0.61
39	601229	上海银行	113,600	931,520.00	0.60
40	600309	万华化学	8,500	924,970.00	0.60
41	601077	渝农商行	229,700	916,503.00	0.59
42	000651	格力电器	17,400	906,540.00	0.58
43	002876	三利谱	14,000	905,800.00	0.58
44	002475	立讯精密	19,662	904,452.00	0.58
45	603010	万盛股份	42,980	901,290.60	0.58
46	002601	龙蟠佰利	25,800	892,164.00	0.57
47	300463	迈克生物	20,500	862,845.00	0.56
48	002833	弘亚数控	22,120	857,150.00	0.55
49	002027	分众传媒	86,100	810,201.00	0.52
50	601857	中国石油	144,900	766,521.00	0.49
51	601601	中国太保	25,600	741,632.00	0.48

52	600028	中国石化	168,300	733,788.00	0.47
53	300124	汇川技术	9,650	716,609.00	0.46
54	601390	中国中铁	134,100	702,684.00	0.45
55	601699	潞安环能	59,100	697,971.00	0.45
56	601211	国泰君安	38,600	661,604.00	0.43
57	000039	中集集团	36,100	656,298.00	0.42
58	601015	陕西黑猫	72,500	648,875.00	0.42
59	300059	东方财富	19,448	637,699.92	0.41
60	601208	东材科技	38,900	634,848.00	0.41
61	600031	三一重工	21,800	633,726.00	0.41
62	603599	广信股份	20,600	619,648.00	0.40
63	000683	远兴能源	130,800	610,836.00	0.39
64	688036	传音控股	2,900	607,550.00	0.39
65	601336	新华保险	13,100	601,421.00	0.39
66	002714	牧原股份	9,466	575,722.12	0.37
67	601166	兴业银行	27,900	573,345.00	0.37
68	603288	海天味业	4,360	562,222.00	0.36
69	300696	爱乐达	13,370	556,459.40	0.36
70	002648	卫星石化	14,100	552,579.00	0.36
71	002064	华峰化学	36,200	514,040.00	0.33
72	688111	金山办公	1,300	513,240.00	0.33
73	600089	特变电工	39,900	512,715.00	0.33
74	000063	中兴通讯	15,000	498,450.00	0.32
75	601012	隆基股份	5,610	498,392.40	0.32
76	600132	重庆啤酒	2,500	494,875.00	0.32
77	600104	上汽集团	22,500	494,325.00	0.32
78	002049	紫光国微	3,200	493,408.00	0.32
79	603986	兆易创新	2,600	488,540.00	0.31
80	603267	鸿远电子	3,800	486,096.00	0.31
81	601636	旗滨集团	25,700	476,992.00	0.31
82	601628	中国人寿	13,900	471,071.00	0.30
83	300454	深信服	1,800	467,064.00	0.30
84	300676	华大基因	3,900	462,540.00	0.30
85	300724	捷佳伟创	3,800	440,838.00	0.28
86	601818	光大银行	114,600	433,188.00	0.28
87	300413	芒果超媒	6,300	432,180.00	0.28
88	600966	博汇纸业	33,100	431,955.00	0.28
89	002460	赣锋锂业	3,500	423,815.00	0.27
90	601668	中国建筑	89,400	415,710.00	0.27
91	601319	中国人保	69,200	410,356.00	0.26
92	600660	福耀玻璃	7,300	407,705.00	0.26
93	600606	绿地控股	74,700	407,115.00	0.26
94	000830	鲁西化工	21,700	406,441.00	0.26

95	002142	宁波银行	10,400	405,288.00	0.26
96	000425	徐工机械	62,900	400,673.00	0.26
97	600019	宝钢股份	52,300	399,572.00	0.26
98	000488	晨鸣纸业	48,400	393,976.00	0.25
99	300726	宏达电子	5,400	380,646.00	0.24
100	002812	恩捷股份	1,600	374,560.00	0.24
101	600570	恒生电子	4,000	373,000.00	0.24
102	600763	通策医疗	900	369,900.00	0.24
103	603195	公牛集团	1,800	363,600.00	0.23
104	600436	片仔癀	800	358,640.00	0.23
105	603369	今世缘	6,600	357,456.00	0.23
106	600332	白云山	10,500	355,425.00	0.23
107	603806	福斯特	3,360	353,236.80	0.23
108	300677	英科医疗	2,800	349,440.00	0.22
109	300587	天铁股份	15,345	344,495.25	0.22
110	600418	江淮汽车	27,500	341,825.00	0.22
111	603678	火炬电子	5,000	337,500.00	0.22
112	300373	扬杰科技	5,500	332,970.00	0.21
113	601006	大秦铁路	50,600	332,948.00	0.21
114	000807	云铝股份	27,700	329,630.00	0.21
115	002240	盛新锂能	11,500	328,325.00	0.21
116	601138	工业富联	26,200	325,142.00	0.21
117	300750	宁德时代	600	320,880.00	0.21
118	600845	宝信软件	6,190	315,071.00	0.20
119	300280	紫天科技	8,600	313,986.00	0.20
120	000661	长春高新	800	309,600.00	0.20
121	002371	北方华创	1,100	305,118.00	0.20
122	002444	巨星科技	8,900	303,312.00	0.20
123	600438	通威股份	6,900	298,563.00	0.19
124	601928	凤凰传媒	41,500	296,310.00	0.19
125	601186	中国铁建	39,800	295,714.00	0.19
126	300755	华致酒行	7,200	293,832.00	0.19
127	002410	广联达	4,300	293,260.00	0.19
128	300196	长海股份	16,900	290,004.00	0.19
129	002507	涪陵榨菜	7,700	289,982.00	0.19
130	300760	迈瑞医疗	600	288,030.00	0.19
131	603882	金域医学	1,800	287,586.00	0.19
132	600460	士兰微	5,100	287,385.00	0.18
133	300121	阳谷华泰	22,800	280,668.00	0.18
134	000401	冀东水泥	22,300	275,405.00	0.18
135	601117	中国化学	31,000	271,560.00	0.17
136	300769	德方纳米	1,300	268,697.00	0.17
137	601898	中煤能源	37,500	268,125.00	0.17

138	600276	恒瑞医药	3,944	268,073.68	0.17
139	000932	华菱钢铁	40,600	267,960.00	0.17
140	300639	凯普生物	8,054	265,862.54	0.17
141	001979	招商蛇口	24,100	263,895.00	0.17
142	300761	立华股份	7,900	261,727.00	0.17
143	300377	赢时胜	23,200	258,448.00	0.17
144	600585	海螺水泥	6,200	254,510.00	0.16
145	002382	蓝帆医疗	12,100	252,285.00	0.16
146	300476	胜宏科技	11,500	251,275.00	0.16
147	300748	金力永磁	7,900	249,877.00	0.16
148	300610	晨化股份	18,700	244,970.00	0.16
149	688012	中微公司	1,476	244,897.92	0.16
150	300295	三六五网	20,600	239,578.00	0.15
151	601607	上海医药	11,100	234,543.00	0.15
152	300193	佳士科技	14,600	232,432.00	0.15
153	300274	阳光电源	2,000	230,120.00	0.15
154	000799	酒鬼酒	900	230,040.00	0.15
155	002092	中泰化学	22,300	229,021.00	0.15
156	688016	心脉医疗	500	227,305.00	0.15
157	002230	科大讯飞	3,300	223,014.00	0.14
158	000708	中信特钢	10,700	222,988.00	0.14
159	300260	新莱应材	10,400	222,040.00	0.14
160	600586	金晶科技	23,600	219,716.00	0.14
161	000977	浪潮信息	7,800	219,414.00	0.14
162	600808	马钢股份	50,700	217,503.00	0.14
163	000938	紫光股份	9,900	216,612.00	0.14
164	600409	三友化工	21,100	213,321.00	0.14
165	688058	宝兰德	2,300	212,750.00	0.14
166	603444	吉比特	400	212,000.00	0.14
167	600048	保利地产	17,600	211,904.00	0.14
168	300806	斯迪克	4,460	211,404.00	0.14
169	002430	杭氧股份	6,100	210,999.00	0.14
170	600588	用友网络	6,300	209,538.00	0.13
171	600839	四川长虹	71,500	208,065.00	0.13
172	601088	中国神华	10,600	206,912.00	0.13
173	600741	华域汽车	7,700	202,279.00	0.13
174	001965	招商公路	27,900	201,438.00	0.13
175	000429	粤高速 A	28,000	200,760.00	0.13
176	000050	深天马 A	14,100	199,938.00	0.13
177	300341	麦克奥迪	22,700	198,852.00	0.13
178	002465	海格通信	21,000	198,660.00	0.13
179	601618	中国中冶	66,600	198,468.00	0.13
180	600900	长江电力	9,500	196,080.00	0.13

181	600176	中国巨石	12,617	195,689.67	0.13
182	600050	中国联通	45,200	195,264.00	0.13
183	000825	太钢不锈	25,800	193,242.00	0.12
184	601225	陕西煤业	16,200	191,970.00	0.12
185	603606	东方电缆	9,200	185,288.00	0.12
186	600377	宁沪高速	18,900	184,464.00	0.12
187	000498	山东路桥	32,400	181,440.00	0.12
188	003816	中国广核	67,400	179,958.00	0.12
189	002466	天齐锂业	2,900	179,858.00	0.12
190	601678	滨化股份	22,000	174,020.00	0.11
191	601238	广汽集团	13,300	172,235.00	0.11
192	601838	成都银行	13,600	171,904.00	0.11
193	002932	明德生物	1,700	165,869.00	0.11
194	002245	蔚蓝锂芯	8,300	163,510.00	0.11
195	600018	上港集团	34,100	162,657.00	0.10
196	002124	天邦股份	22,200	155,622.00	0.10
197	002472	双环传动	9,900	155,430.00	0.10
198	600153	建发股份	19,000	153,900.00	0.10
199	300415	伊之密	7,100	152,650.00	0.10
200	002568	百润股份	1,600	151,664.00	0.10
201	002594	比亚迪	600	150,600.00	0.10
202	600483	福能股份	14,200	148,958.00	0.10
203	600742	一汽富维	14,600	148,774.00	0.10
204	000863	三湘印象	44,700	147,063.00	0.09
205	600111	北方稀土	7,100	146,970.00	0.09
206	300529	健帆生物	1,700	146,812.00	0.09
207	600985	淮北矿业	11,900	145,299.00	0.09
208	002293	罗莱生活	10,800	144,612.00	0.09
209	688538	和辉光电	41,792	141,256.96	0.09
210	600782	新钢股份	25,300	141,174.00	0.09
211	600711	盛屯矿业	19,800	141,174.00	0.09
212	600039	四川路桥	22,400	140,448.00	0.09
213	000923	河钢资源	7,300	139,211.00	0.09
214	688076	诺泰生物	2,866	139,144.30	0.09
215	600308	华泰股份	25,200	139,104.00	0.09
216	000789	万年青	12,100	138,424.00	0.09
217	000778	新兴铸管	37,200	138,384.00	0.09
218	601598	中国外运	27,400	138,370.00	0.09
219	603100	川仪股份	7,900	138,329.00	0.09
220	002636	金安国纪	8,500	137,870.00	0.09
221	688079	美迪凯	7,487	137,760.80	0.09
222	601100	恒立液压	1,600	137,472.00	0.09
223	300588	熙菱信息	8,900	137,238.00	0.09

224	603355	莱克电气	2,200	136,906.00	0.09
225	601899	紫金矿业	14,100	136,629.00	0.09
226	600449	宁夏建材	12,000	136,320.00	0.09
227	300408	三环集团	3,200	135,744.00	0.09
228	002919	名臣健康	3,000	135,600.00	0.09
229	600507	方大特钢	19,900	134,922.00	0.09
230	688258	卓易信息	2,600	134,732.00	0.09
231	300379	东方通	4,700	133,903.00	0.09
232	002024	苏宁易购	23,700	132,483.00	0.09
233	600720	祁连山	12,500	131,750.00	0.08
234	300271	华宇软件	6,700	128,975.00	0.08
235	603290	斯达半导	400	128,000.00	0.08
236	000717	韶钢松山	27,700	127,143.00	0.08
237	000301	东方盛虹	6,000	125,400.00	0.08
238	600006	东风汽车	16,800	122,640.00	0.08
239	300609	汇纳科技	6,400	122,176.00	0.08
240	600079	人福医药	4,300	121,561.00	0.08
241	600522	中天科技	12,100	121,000.00	0.08
242	002396	星网锐捷	5,600	119,560.00	0.08
243	601688	华泰证券	7,500	118,500.00	0.08
244	300628	亿联网络	1,400	117,320.00	0.08
245	002281	光迅科技	4,700	115,620.00	0.07
246	300270	中威电子	15,400	114,268.00	0.07
247	300405	科隆股份	11,200	112,560.00	0.07
248	000048	京基智农	6,100	112,545.00	0.07
249	300737	科顺股份	3,500	110,040.00	0.07
250	300496	中科创达	700	109,942.00	0.07
251	600012	皖通高速	16,900	109,174.00	0.07
252	000762	西藏矿业	4,100	108,978.00	0.07
253	601600	中国铝业	20,500	108,650.00	0.07
254	002302	西部建设	13,200	104,280.00	0.07
255	601155	新城控股	2,500	104,000.00	0.07
256	300014	亿纬锂能	1,000	103,930.00	0.07
257	000528	柳工	12,500	102,500.00	0.07
258	000157	中联重科	11,013	101,760.12	0.07
259	300619	金银河	4,200	99,918.00	0.06
260	300555	路通视信	10,600	99,746.00	0.06
261	002888	惠威科技	7,900	99,382.00	0.06
262	002576	通达动力	8,600	98,384.00	0.06
263	002139	拓邦股份	5,400	97,146.00	0.06
264	002407	多氟多	2,700	95,958.00	0.06
265	002417	深南股份	15,000	95,850.00	0.06
266	002649	博彦科技	9,127	95,833.50	0.06

267	000596	古井贡酒	400	95,800.00	0.06
268	300022	吉峰科技	20,200	95,546.00	0.06
269	002884	凌霄泵业	4,100	95,489.00	0.06
270	000548	湖南投资	25,200	95,256.00	0.06
271	002718	友邦吊顶	6,900	95,220.00	0.06
272	300166	东方国信	7,700	95,172.00	0.06
273	000692	惠天热电	27,500	95,150.00	0.06
274	300338	开元教育	18,600	95,046.00	0.06
275	600038	中直股份	1,800	94,932.00	0.06
276	000605	渤海股份	17,900	94,870.00	0.06
277	603489	八方股份	400	94,552.00	0.06
278	000819	岳阳兴长	15,200	94,088.00	0.06
279	300620	光库科技	1,900	93,955.00	0.06
280	002857	三晖电气	6,700	93,599.00	0.06
281	600502	安徽建工	24,100	93,508.00	0.06
282	600690	海尔智家	3,600	93,276.00	0.06
283	002390	信邦制药	8,900	93,272.00	0.06
284	300335	迪森股份	18,500	93,055.00	0.06
285	002043	兔宝宝	9,400	92,684.00	0.06
286	300084	海默科技	20,500	92,660.00	0.06
287	000933	神火股份	9,800	92,610.00	0.06
288	300652	雷迪克	4,700	92,402.00	0.06
289	000895	双汇发展	2,900	92,220.00	0.06
290	002261	拓维信息	9,000	91,530.00	0.06
291	300316	晶盛机电	1,800	90,900.00	0.06
292	000626	远大控股	5,200	89,856.00	0.06
293	002606	大连电瓷	12,300	89,667.00	0.06
294	000550	江铃汽车	3,800	89,034.00	0.06
295	000516	国际医学	4,700	88,407.00	0.06
296	601985	中国核电	17,300	87,538.00	0.06
297	002372	伟星新材	4,200	86,814.00	0.06
298	000768	中航西飞	3,300	86,724.00	0.06
299	603877	太平鸟	1,600	85,408.00	0.05
300	300302	同有科技	7,700	83,083.00	0.05
301	002645	华宏科技	5,100	81,498.00	0.05
302	300366	创意信息	9,100	81,172.00	0.05
303	688981	中芯国际	1,300	80,366.00	0.05
304	601360	三六零	6,500	79,365.00	0.05
305	688126	沪硅产业	2,700	78,786.00	0.05
306	688619	罗普特	2,946	78,776.04	0.05
307	300474	景嘉微	800	78,336.00	0.05
308	000782	美达股份	20,100	78,189.00	0.05
309	600737	中粮糖业	7,800	78,078.00	0.05

310	600756	浪潮软件	5,800	78,068.00	0.05
311	603392	万泰生物	300	77,754.00	0.05
312	603019	中科曙光	2,800	77,308.00	0.05
313	601377	兴业证券	8,000	77,280.00	0.05
314	600718	东软集团	7,800	76,284.00	0.05
315	002368	太极股份	3,800	76,228.00	0.05
316	300624	万兴科技	1,300	76,154.00	0.05
317	688008	澜起科技	1,200	74,856.00	0.05
318	601126	四方股份	8,300	74,285.00	0.05
319	600536	中国软件	1,300	74,009.00	0.05
320	000002	万科 A	3,100	73,811.00	0.05
321	600582	天地科技	18,900	73,710.00	0.05
322	000677	恒天海龙	26,000	73,320.00	0.05
323	000066	中国长城	5,000	73,000.00	0.05
324	600548	深高速	8,300	72,376.00	0.05
325	002179	中航光电	900	71,118.00	0.05
326	600810	神马股份	5,900	70,623.00	0.05
327	600688	上海石化	18,500	69,560.00	0.04
328	603466	风语筑	4,200	68,670.00	0.04
329	603799	华友钴业	600	68,520.00	0.04
330	300033	同花顺	600	67,668.00	0.04
331	688345	博力威	1,199	66,580.47	0.04
332	603738	泰晶科技	1,900	65,588.00	0.04
333	688298	东方生物	300	65,280.00	0.04
334	002311	海大集团	800	65,280.00	0.04
335	688533	上声电子	3,347	63,961.17	0.04
336	600958	东方证券	6,400	63,936.00	0.04
337	688139	海尔生物	600	63,060.00	0.04
338	688639	华恒生物	1,477	62,447.56	0.04
339	000166	申万宏源	13,300	62,244.00	0.04
340	002850	科达利	700	61,180.00	0.04
341	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.04
342	002402	和而泰	2,500	59,925.00	0.04
343	000615	奥园美谷	2,700	59,400.00	0.04
344	002022	科华生物	3,300	59,103.00	0.04
345	601901	方正证券	6,300	58,968.00	0.04
346	600919	江苏银行	8,300	58,930.00	0.04
347	300207	欣旺达	1,800	58,608.00	0.04
348	300775	三角防务	1,500	57,300.00	0.04
349	603833	欧派家居	400	56,784.00	0.04
350	002455	百川股份	7,200	56,232.00	0.04
351	688363	华熙生物	200	55,572.00	0.04
352	300394	天孚通信	2,180	55,197.60	0.04

353	000733	振华科技	900	54,963.00	0.04
354	688396	华润微	600	54,612.00	0.04
355	605111	新洁能	300	54,081.00	0.03
356	300803	指南针	1,400	54,040.00	0.03
357	000859	国风塑业	9,000	53,370.00	0.03
358	600011	华能国际	12,600	53,172.00	0.03
359	300616	尚品宅配	600	53,106.00	0.03
360	002531	天顺风能	6,100	52,765.00	0.03
361	600346	恒力石化	2,000	52,480.00	0.03
362	601788	光大证券	2,900	51,881.00	0.03
363	600207	安彩高科	6,600	51,678.00	0.03
364	688239	航宇科技	4,482	51,453.36	0.03
365	002241	歌尔股份	1,200	51,288.00	0.03
366	600010	包钢股份	32,900	50,995.00	0.03
367	601233	桐昆股份	2,100	50,589.00	0.03
368	300661	圣邦股份	200	50,546.00	0.03
369	300866	安克创新	300	50,241.00	0.03
370	688499	利元亨	1,290	50,116.50	0.03
371	300244	迪安诊断	1,300	49,790.00	0.03
372	002870	香山股份	1,500	49,500.00	0.03
373	300705	九典制药	1,300	49,465.00	0.03
374	300452	山河药辅	3,300	49,236.00	0.03
375	300074	华平股份	11,800	49,088.00	0.03
376	300249	依米康	7,000	49,070.00	0.03
377	002203	海亮股份	4,600	48,944.00	0.03
378	002268	卫士通	2,500	48,700.00	0.03
379	002840	华统股份	5,400	48,654.00	0.03
380	002345	潮宏基	9,200	48,208.00	0.03
381	002968	新大正	1,100	47,905.00	0.03
382	000756	新华制药	5,500	47,630.00	0.03
383	000700	模塑科技	8,500	47,175.00	0.03
384	002253	川大智胜	2,800	46,984.00	0.03
385	002157	正邦科技	3,900	46,605.00	0.03
386	000598	兴蓉环境	8,900	46,369.00	0.03
387	000407	胜利股份	11,400	46,284.00	0.03
388	002442	龙星化工	7,400	46,176.00	0.03
389	300679	电连技术	1,600	46,112.00	0.03
390	300447	全信股份	2,900	45,965.00	0.03
391	600109	国金证券	3,600	45,684.00	0.03
392	603989	艾华集团	1,400	45,626.00	0.03
393	300747	锐科激光	400	45,624.00	0.03
394	002736	国信证券	4,200	45,150.00	0.03
395	002101	广东鸿图	5,500	45,100.00	0.03

396	603993	洛阳钼业	8,700	44,892.00	0.03
397	002008	大族激光	1,100	44,429.00	0.03
398	300788	中信出版	1,200	44,124.00	0.03
399	002677	浙江美大	2,400	43,872.00	0.03
400	300799	左江科技	800	43,840.00	0.03
401	603186	华正新材	1,200	43,752.00	0.03
402	002315	焦点科技	2,400	43,440.00	0.03
403	002056	横店东磁	3,300	42,900.00	0.03
404	300667	必创科技	1,800	42,768.00	0.03
405	300701	森霸传感	1,800	42,606.00	0.03
406	300768	迪普科技	1,100	42,493.00	0.03
407	002615	哈尔斯	9,200	42,320.00	0.03
408	002493	荣盛石化	2,450	42,311.50	0.03
409	300811	铂科新材	800	42,176.00	0.03
410	600183	生益科技	1,800	42,138.00	0.03
411	300531	优博讯	2,700	42,120.00	0.03
412	300450	先导智能	700	42,098.00	0.03
413	603228	景旺电子	1,600	41,920.00	0.03
414	002429	兆驰股份	6,900	41,883.00	0.03
415	603232	格尔软件	2,500	41,725.00	0.03
416	000783	长江证券	5,700	41,724.00	0.03
417	002106	莱宝高科	3,700	41,625.00	0.03
418	000823	超声电子	3,700	41,551.00	0.03
419	603118	共进股份	4,500	41,535.00	0.03
420	002544	杰赛科技	3,100	41,354.00	0.03
421	002148	北纬科技	9,000	41,220.00	0.03
422	002845	同兴达	1,600	40,992.00	0.03
423	601066	中信建投	1,300	40,859.00	0.03
424	603818	曲美家居	4,600	40,848.00	0.03
425	603380	易德龙	1,700	40,834.00	0.03
426	603003	龙宇燃油	5,600	40,768.00	0.03
427	601900	南方传媒	5,200	40,560.00	0.03
428	600386	北巴传媒	11,500	40,480.00	0.03
429	688299	长阳科技	1,500	40,470.00	0.03
430	603516	淳中科技	1,900	40,470.00	0.03
431	300218	安利股份	2,600	40,248.00	0.03
432	603496	恒为科技	2,700	40,203.00	0.03
433	002897	意华股份	1,900	40,185.00	0.03
434	002296	辉煌科技	5,800	40,136.00	0.03
435	601858	中国科传	4,500	40,095.00	0.03
436	002955	鸿合科技	2,100	40,089.00	0.03
437	603890	春秋电子	3,100	40,052.00	0.03
438	600757	长江传媒	7,500	39,825.00	0.03

439	603660	苏州科达	5,700	39,672.00	0.03
440	600571	信雅达	5,400	39,636.00	0.03
441	300756	金马游乐	1,300	39,585.00	0.03
442	603773	沃格光电	1,500	39,555.00	0.03
443	600633	浙数文化	5,500	39,490.00	0.03
444	600618	氯碱化工	4,300	39,345.00	0.03
445	002362	汉王科技	1,900	39,140.00	0.03
446	600602	云赛智联	6,600	39,138.00	0.03
447	300617	安靠智电	800	39,032.00	0.03
448	002866	传艺科技	2,800	39,004.00	0.03
449	600446	金证股份	2,700	38,988.00	0.03
450	300451	创业慧康	4,410	38,984.40	0.03
451	002777	久远银海	2,200	38,918.00	0.03
452	601108	财通证券	3,700	38,813.00	0.02
453	000656	金科股份	6,700	38,793.00	0.02
454	300058	蓝色光标	6,400	38,720.00	0.02
455	002425	凯撒文化	4,600	38,502.00	0.02
456	603528	多伦科技	4,500	38,475.00	0.02
457	603258	电魂网络	1,500	38,385.00	0.02
458	300515	三德科技	3,800	37,810.00	0.02
459	002446	盛路通信	5,800	37,700.00	0.02
460	000635	英力特	3,300	37,389.00	0.02
461	603938	三孚股份	1,100	37,147.00	0.02
462	603189	网达软件	2,100	37,107.00	0.02
463	300635	中达安	1,900	37,031.00	0.02
464	300565	科信技术	2,600	36,946.00	0.02
465	688561	奇安信	400	36,924.00	0.02
466	600998	九州通	2,400	36,888.00	0.02
467	002912	中新赛克	900	36,873.00	0.02
468	300467	迅游科技	2,600	36,816.00	0.02
469	601555	东吴证券	4,400	36,696.00	0.02
470	600271	航天信息	2,800	36,484.00	0.02
471	002701	奥瑞金	7,000	35,980.00	0.02
472	000728	国元证券	4,500	35,865.00	0.02
473	301020	密封科技	3,303	35,143.92	0.02
474	300334	津膜科技	5,600	35,112.00	0.02
475	002469	三维化学	6,500	35,100.00	0.02
476	002533	金杯电工	6,800	34,952.00	0.02
477	688663	新风光	1,818	34,923.78	0.02
478	002655	共达电声	3,700	34,854.00	0.02
479	002739	万达电影	2,200	34,738.00	0.02
480	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
481	000885	城发环境	3,600	34,416.00	0.02

482	600161	天坛生物	1,000	34,250.00	0.02
483	603899	晨光文具	400	33,824.00	0.02
484	688099	晶晨股份	300	33,660.00	0.02
485	300659	中孚信息	1,000	33,570.00	0.02
486	688288	鸿泉物联	700	33,313.00	0.02
487	600061	国投资本	3,856	32,737.44	0.02
488	600547	山东黄金	1,676	32,212.72	0.02
489	002080	中材科技	1,200	31,404.00	0.02
490	300894	火星人	461	31,348.00	0.02
491	600516	方大炭素	4,200	31,248.00	0.02
492	601162	天风证券	6,400	31,104.00	0.02
493	300595	欧普康视	300	31,065.00	0.02
494	300919	中伟股份	189	30,807.00	0.02
495	300832	新产业	500	30,800.00	0.02
496	600188	兖州煤业	2,000	30,720.00	0.02
497	600705	中航资本	7,900	30,573.00	0.02
498	300957	贝泰妮	120	30,235.20	0.02
499	603898	好莱客	2,200	30,140.00	0.02
500	601878	浙商证券	2,300	30,084.00	0.02
501	300601	康泰生物	200	29,800.00	0.02
502	603181	皇马科技	1,700	29,359.00	0.02
503	000959	首钢股份	5,200	29,224.00	0.02
504	002541	鸿路钢构	500	29,175.00	0.02
505	002603	以岭药业	1,000	29,160.00	0.02
506	603612	索通发展	1,600	28,752.00	0.02
507	601990	南京证券	2,700	28,404.00	0.02
508	002918	蒙娜丽莎	900	28,251.00	0.02
509	600141	兴发集团	1,500	28,245.00	0.02
510	600159	大龙地产	11,300	28,024.00	0.02
511	603937	丽岛新材	2,200	27,786.00	0.02
512	002226	江南化工	5,400	27,648.00	0.02
513	601168	西部矿业	2,300	27,439.00	0.02
514	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
515	000983	山西焦煤	3,300	27,423.00	0.02
516	002753	永东股份	3,000	27,420.00	0.02
517	300796	贝斯美	1,500	27,390.00	0.02
518	002068	黑猫股份	3,600	27,324.00	0.02
519	603823	百合花	1,800	27,252.00	0.02
520	603113	金能科技	1,500	27,090.00	0.02
521	002352	顺丰控股	400	27,080.00	0.02
522	002949	华阳国际	1,600	27,040.00	0.02
523	603979	金诚信	1,500	27,000.00	0.02
524	601226	华电重工	6,700	26,934.00	0.02

525	300522	世名科技	1,500	26,910.00	0.02
526	603357	设计总院	3,100	26,846.00	0.02
527	002915	中欣氟材	1,400	26,824.00	0.02
528	000709	河钢股份	10,900	26,814.00	0.02
529	002540	亚太科技	5,500	26,785.00	0.02
530	603969	银龙股份	6,300	26,649.00	0.02
531	603948	建业股份	1,400	26,628.00	0.02
532	002818	富森美	2,200	26,532.00	0.02
533	002066	瑞泰科技	2,700	26,514.00	0.02
534	600231	凌钢股份	9,300	26,505.00	0.02
535	600150	中国船舶	1,600	26,416.00	0.02
536	002254	泰和新材	1,300	26,351.00	0.02
537	002395	双象股份	2,200	26,136.00	0.02
538	002081	金螳螂	3,300	26,136.00	0.02
539	600678	四川金顶	4,700	25,709.00	0.02
540	002832	比音勒芬	1,000	25,590.00	0.02
541	002827	高争民爆	2,500	25,550.00	0.02
542	600623	华谊集团	2,900	25,549.00	0.02
543	000023	深天地 A	1,700	25,483.00	0.02
544	600779	水井坊	200	25,270.00	0.02
545	603639	海利尔	1,400	25,186.00	0.02
546	000603	盛达资源	2,000	25,180.00	0.02
547	600075	新疆天业	3,700	25,160.00	0.02
548	002749	国光股份	2,716	25,123.00	0.02
549	600528	中铁工业	3,100	25,110.00	0.02
550	603217	元利科技	900	25,074.00	0.02
551	601696	中银证券	1,200	24,708.00	0.02
552	601995	中金公司	400	24,600.00	0.02
553	300567	精测电子	400	24,560.00	0.02
554	603393	新天然气	1,340	24,495.20	0.02
555	688087	英科再生	1,111	24,397.56	0.02
556	603317	天味食品	800	23,544.00	0.02
557	600800	渤海化学	5,400	23,382.00	0.02
558	600989	宝丰能源	1,700	23,256.00	0.01
559	600600	青岛啤酒	200	23,130.00	0.01
560	601005	重庆钢铁	8,600	22,962.00	0.01
561	002242	九阳股份	700	22,743.00	0.01
562	300550	和仁科技	1,600	22,640.00	0.01
563	002855	捷荣技术	2,400	22,632.00	0.01
564	600362	江西铜业	1,000	22,380.00	0.01
565	600157	永泰能源	15,500	22,320.00	0.01
566	002673	西部证券	2,600	21,450.00	0.01
567	002498	汉缆股份	5,800	20,764.00	0.01

568	002304	洋河股份	100	20,720.00	0.01
569	601881	中国银河	1,900	20,482.00	0.01
570	603613	国联股份	200	19,994.00	0.01
571	600035	楚天高速	6,400	19,200.00	0.01
572	002745	木林森	1,400	18,760.00	0.01
573	002376	新北洋	1,900	17,366.00	0.01
574	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
575	603517	绝味食品	200	16,858.00	0.01
576	688088	虹软科技	300	16,725.00	0.01
577	002271	东方雨虹	300	16,596.00	0.01
578	688233	神工股份	300	16,200.00	0.01
579	300953	震裕科技	161	16,075.85	0.01
580	002939	长城证券	1,400	15,582.00	0.01
581	603900	莱绅通灵	2,000	15,120.00	0.01
582	002025	航天电器	300	15,051.00	0.01
583	600649	城投控股	3,122	14,860.72	0.01
584	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
585	688080	映翰通	300	14,286.00	0.01
586	300979	华利集团	162	14,175.00	0.01
587	301015	百洋医药	354	13,745.82	0.01
588	601236	红塔证券	1,000	13,560.00	0.01
589	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
590	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
591	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
592	688369	致远互联	200	12,780.00	0.01
593	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
594	002128	露天煤业	1,200	12,492.00	0.01
595	600269	赣粤高速	3,700	12,432.00	0.01
596	300941	创识科技	245	12,235.30	0.01
597	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
598	603358	华达科技	700	12,159.00	0.01
599	600918	中泰证券	1,100	11,902.00	0.01
600	300614	百川畅银	291	11,750.58	0.01
601	601808	中海油服	800	11,488.00	0.01
602	600486	扬农化工	100	11,177.00	0.01
603	688168	安博通	200	11,158.00	0.01
604	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
605	000703	恒逸石化	900	10,755.00	0.01
606	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
607	601666	平煤股份	1,500	10,665.00	0.01
608	002709	天赐材料	100	10,658.00	0.01
609	688181	八亿时空	200	10,634.00	0.01
610	301009	可靠股份	381	10,626.09	0.01

611	300037	新宙邦	100	10,010.00	0.01
612	300083	创世纪	900	9,855.00	0.01
613	002521	齐峰新材	1,500	9,750.00	0.01
614	300973	立高食品	84	9,719.64	0.01
615	600533	栖霞建设	3,100	9,672.00	0.01
616	300395	菲利华	200	9,644.00	0.01
617	300952	恒辉安防	337	9,125.96	0.01
618	301002	崧盛股份	158	9,103.96	0.01
619	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
620	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
621	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
622	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.01
623	300593	新雷能	200	8,690.00	0.01
624	002627	宜昌交运	1,400	8,624.00	0.01
625	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
626	300966	共同药业	263	8,295.02	0.01
627	000628	高新发展	1,000	8,260.00	0.01
628	300958	建工修复	300	8,166.00	0.01
629	002078	太阳纸业	600	8,010.00	0.01
630	601199	江南水务	2,200	7,986.00	0.01
631	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.01
632	002244	滨江集团	1,900	7,961.00	0.01
633	300997	欢乐家	608	7,934.40	0.01
634	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.01
635	603816	顾家家居	100	7,728.00	0.00
636	601689	拓普集团	200	7,486.00	0.00
637	002050	三花智控	300	7,194.00	0.00
638	600871	石化油服	3,600	7,092.00	0.00
639	002441	众业达	900	7,056.00	0.00
640	002732	燕塘乳业	300	6,999.00	0.00
641	600803	新奥股份	400	6,604.00	0.00
642	300981	中红医疗	73	6,598.47	0.00
643	300146	汤臣倍健	200	6,580.00	0.00
644	600323	瀚蓝环境	300	6,537.00	0.00
645	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
646	300978	东箭科技	479	6,514.40	0.00
647	601567	三星医疗	300	6,390.00	0.00
648	002375	亚厦股份	800	6,336.00	0.00
649	600885	宏发股份	100	6,270.00	0.00
650	000581	威孚高科	300	6,249.00	0.00
651	600066	宇通客车	500	6,245.00	0.00
652	601128	常熟银行	1,000	6,200.00	0.00
653	300975	商络电子	475	6,189.25	0.00

654	000967	盈峰环境	900	6,183.00	0.00
655	600862	中航高科	200	6,156.00	0.00
656	000012	南玻 A	600	6,144.00	0.00
657	002202	金风科技	500	6,080.00	0.00
658	600988	赤峰黄金	400	5,996.00	0.00
659	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
660	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
661	600025	华能水电	1,000	5,790.00	0.00
662	600057	厦门象屿	900	5,625.00	0.00
663	000026	飞亚达	400	5,568.00	0.00
664	002945	华林证券	400	5,528.00	0.00
665	600380	健康元	400	5,492.00	0.00
666	603730	岱美股份	300	5,466.00	0.00
667	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
668	000338	潍柴动力	300	5,361.00	0.00
669	600167	联美控股	600	5,358.00	0.00
670	002643	万润股份	300	5,334.00	0.00
671	002705	新宝股份	200	5,250.00	0.00
672	600933	爱柯迪	400	5,216.00	0.00
673	300144	宋城演艺	300	5,040.00	0.00
674	300971	博亚精工	177	5,007.33	0.00
675	000513	丽珠集团	100	5,002.00	0.00
676	300390	天华超净	100	4,803.00	0.00
677	300963	中洲特材	210	4,722.90	0.00
678	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
679	300972	万辰生物	356	4,503.40	0.00
680	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
681	603103	横店影视	300	4,416.00	0.00
682	002967	广电计量	100	4,380.00	0.00
683	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
684	601633	长城汽车	100	4,359.00	0.00
685	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
686	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
687	600085	同仁堂	100	4,085.00	0.00
688	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
689	000786	北新建材	100	3,925.00	0.00
690	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
691	300967	晓鸣股份	326	3,762.04	0.00
692	000561	烽火电子	500	3,345.00	0.00
693	002001	新和成	100	2,868.00	0.00
694	688159	有方科技	100	2,771.00	0.00
695	300985	致远新能	103	2,555.43	0.00
696	000666	经纬纺机	300	2,391.00	0.00

697	688089	嘉必优	49	2,249.10	0.00
698	000065	北方国际	100	863.00	0.00
699	600848	上海临港	20	358.00	0.00
700	688098	申联生物	7	95.27	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	25,895,290.35	10.19
2	000001	平安银行	15,484,984.40	6.10
3	600519	贵州茅台	14,951,427.66	5.89
4	601318	中国平安	13,207,505.23	5.20
5	601166	兴业银行	12,424,524.00	4.89
6	601009	南京银行	9,833,023.24	3.87
7	300124	汇川技术	8,841,163.68	3.48
8	000858	五粮液	8,786,166.40	3.46
9	000002	万科 A	8,761,902.61	3.45
10	002460	赣锋锂业	8,318,770.50	3.27
11	600900	长江电力	7,414,692.40	2.92
12	600887	伊利股份	7,347,305.06	2.89
13	601857	中国石油	7,200,930.00	2.83
14	000725	京东方 A	7,015,952.00	2.76
15	601818	光大银行	6,950,532.00	2.74
16	000932	华菱钢铁	6,834,701.51	2.69
17	000100	TCL 科技	6,582,495.00	2.59
18	300059	东方财富	6,454,695.00	2.54
19	002142	宁波银行	6,351,450.46	2.50
20	601668	中国建筑	6,219,699.00	2.45
21	601328	交通银行	6,197,388.00	2.44
22	601288	农业银行	6,167,153.00	2.43
23	600309	万华化学	6,152,570.41	2.42
24	600919	江苏银行	5,910,172.80	2.33
25	300408	三环集团	5,802,351.27	2.28
26	603806	福斯特	5,678,610.00	2.24
27	600276	恒瑞医药	5,677,305.40	2.23
28	601988	中国银行	5,408,756.00	2.13
29	601229	上海银行	5,404,885.91	2.13
30	603486	科沃斯	5,399,654.00	2.13

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	000333	美的集团	24,670,353.75	9.71
2	600519	贵州茅台	19,414,591.00	7.64
3	601318	中国平安	18,508,489.00	7.29
4	601166	兴业银行	16,535,936.89	6.51
5	000001	平安银行	15,968,016.00	6.29
6	600900	长江电力	12,097,693.00	4.76
7	000858	五粮液	11,517,892.28	4.53
8	300124	汇川技术	11,156,830.02	4.39
9	000002	万科 A	10,639,847.05	4.19
10	002714	牧原股份	10,004,509.34	3.94
11	601009	南京银行	9,852,681.03	3.88
12	000725	京东方 A	9,383,128.00	3.69
13	601818	光大银行	9,091,556.00	3.58
14	600887	伊利股份	8,710,183.70	3.43
15	002594	比亚迪	8,417,297.27	3.31
16	601857	中国石油	8,229,984.00	3.24
17	300059	东方财富	8,176,775.52	3.22
18	002142	宁波银行	8,007,485.04	3.15
19	600276	恒瑞医药	8,004,580.67	3.15
20	002460	赣锋锂业	7,903,912.69	3.11
21	002027	分众传媒	7,503,181.22	2.95
22	601328	交通银行	7,354,201.00	2.89
23	601888	中国中免	7,088,761.00	2.79
24	601668	中国建筑	6,800,179.00	2.68
25	000932	华菱钢铁	6,791,687.08	2.67
26	600919	江苏银行	6,610,660.80	2.60
27	002415	海康威视	6,179,306.89	2.43
28	603486	科沃斯	6,140,289.00	2.42
29	601899	紫金矿业	6,092,764.00	2.40
30	300677	英科医疗	6,068,541.00	2.39
31	601398	工商银行	6,023,840.00	2.37
32	600309	万华化学	5,963,695.00	2.35
33	603288	海天味业	5,883,510.16	2.32
34	600028	中国石化	5,712,601.00	2.25
35	300408	三环集团	5,694,695.60	2.24
36	601012	隆基股份	5,520,733.60	2.17
37	601799	星宇股份	5,424,952.00	2.14

38	603806	福斯特	5,415,283.86	2.13
39	300146	汤臣倍健	5,332,914.25	2.10
40	000100	TCL 科技	5,235,495.00	2.06
41	002475	立讯精密	5,228,840.23	2.06
42	601838	成都银行	5,170,337.00	2.04
43	603501	韦尔股份	5,115,140.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,066,850,957.59
卖出股票的收入（成交）总额	1,179,200,839.12

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）	173,100.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	173,100.00	0.11

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	1,550	155,000.00	0.10
2	127038	国微转债	101	10,100.00	0.01
3	113049	长汽转债	80	8,000.00	0.01

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					450,565.82
股指期货投资本期公允价值变动					-219,465.00

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

本基金现阶段主要通过股指期货合约调节整体组合的市场风险。基金管理人将根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，以套期保值为主要目的，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，优化股指期货组合，创造额外收益。

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平安银行(000001)、交通银行(601328)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18日，因存在未按监管要求监测贷款资金用途，贷款资金回流部分转作银行承兑汇票保证金等违规行为，中国银行保险监督管理委员会临沂监管分局对交通银行股份有限公司临沂分行处以罚款的行政处罚。

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	127,068.52
2	应收证券清算款	302,788.71
3	应收股利	-
4	应收利息	3,976.59
5	应收申购款	89,505.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	523,339.61

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	3.31	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
博时量化多策略股票 A	1,081	84,378.43	85,889,034.40	94.16%	5,324,049.43	5.84%
博时量化多策略股票 C	430	10,332.46	0.00	0.00%	4,442,959.61	100.00%
合计	1,474	64,895.55	85,889,034.40	89.79%	9,767,009.04	10.21%

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	博时量化多策略股票 A	291,424.82	0.32%
	博时量化多策略股票 C	-	-
	合计	291,424.82	0.30%

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	博时量化多策略股票 A	10~50
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	10~50
	博时量化多策略股票 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	144,614,046.25	28,914,743.59
本报告期基金总申购份额	80,491,085.74	26,084,760.08
减：本报告期基金总赎回份额	133,892,048.16	50,556,544.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	91,213,083.83	4,442,959.61

§ 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
长江证券	2	1,094,650,058.31	49.01%	800,519.24	49.01%	-
招商证券	6	603,953,592.94	27.04%	441,678.09	27.04%	-
中金公司	2	21,491,589.73	0.96%	15,715.17	0.96%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	125,702,925.08	5.63%	91,995.98	5.63%	新增 1 个
中泰证券	1	128,689,277.08	5.76%	94,111.80	5.76%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	258,841,858.12	11.59%	189,303.06	11.59%	-

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
长江证券	3,975,786.04	89.04%	-	-	-	-
招商证券	469,022.00	10.50%	-	-	-	-
中金公司	20,327.30	0.46%	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	博时量化多策略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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-22
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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
6	博时量化多策略股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
7	博时量化多策略股票型证券投资基金 2020 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	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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、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长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
12	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	2021-02-06

		露网站	
13	博时量化多策略股票型证券投资基金 2020 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	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	1	2021-04-13~2021-06-03; 2021-06-09~2021-06-30	-	29,369,092.57	-	29,369,092.57	30.70%
	2	2021-01-01~2021-02-22	42,363,091.55	-	42,363,091.55	-	-

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多策略股票型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时量化多策略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 博时量化多策略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

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