

博时量化平衡混合型证券投资基金
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：中国工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。

基金托管人中国工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	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	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
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	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43

10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化平衡混合型证券投资基金
基金简称	博时量化平衡混合
基金主代码	004495
交易代码	004495
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 4 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	488,529,452.09 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用平衡型配置，严格控制最大回撤，基于多个逻辑不同的量化择时策略，最大程度地去过滤下跌，减少回撤，力争获取长期相对稳定的收益。
投资策略	本基金的量化多策略体系是在大类资产配置策略的基础之上，基于多因子模型、事件驱动类策略以及量化择时模型等多种量化策略进行择时和选股，并同时运用股指期货进行适量系统性风险对冲的绝对收益策略体系。主要包括：1、大类资产配置策略，本基金的大类资产配置策略主要是基于对宏观经济周期运行规律的研究予以决策，根据经济周期决定股票资产和债券资产的投资比例，以实现股债的平衡配置；2、量化择时策略，博时基金的量化多策略择时体系以择时策略的多逻辑、多期限以及多品种为目标进行设计和开发，在各品种上综合考虑基本面和市场面的择时模型，从而形成对品种的长、中、短期趋势和方向的判断。基金经理根据市场的实际情况，综合前瞻性地运用各种择时策略进行操作；3、量化选股策略，博时的量化选股策略体系包括基本面策略、市场面策略以及基本面和市场面结合的策略，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特征；4、其他投资策略包括：债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券的投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资融券交易策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数（总财富）收益率×80%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路	北京市西城区复兴门内大街55号

	5999号基金大厦21层	
邮政编码	518040	100140
法定代表人	江向阳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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）
本期已实现收益	36,874,507.27
本期利润	61,556,326.83
加权平均基金份额本期利润	0.1340
本期加权平均净值利润率	9.51%
本期基金份额净值增长率	9.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	215,145,822.20
期末可供分配基金份额利润	0.4404
期末基金资产净值	703,675,274.29
期末基金份额净值	1.4404
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	48.52%

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

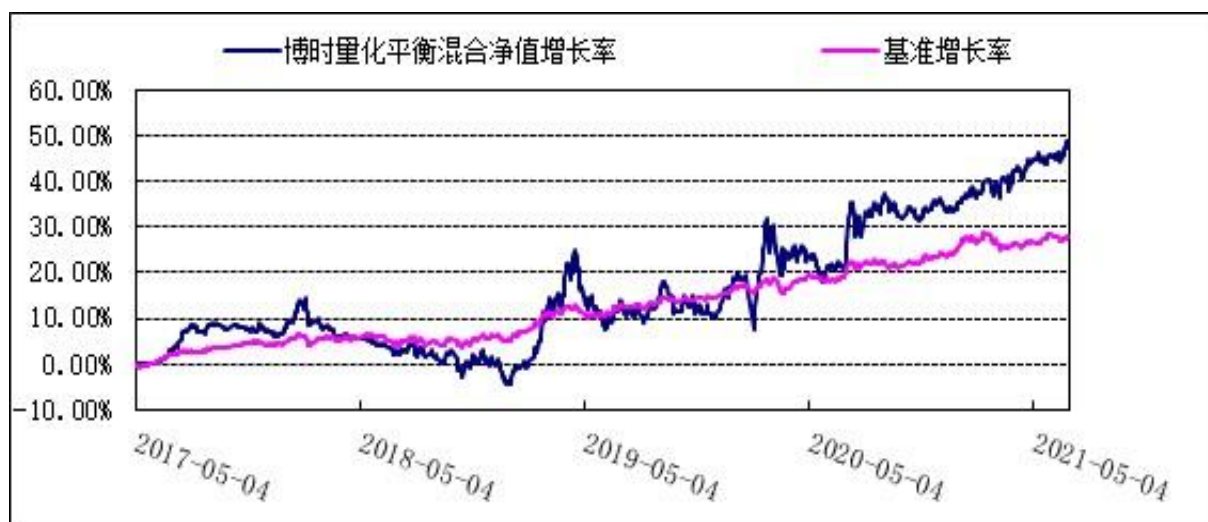
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.72%	0.45%	-0.24%	0.17%	1.96%	0.28%
过去三个月	5.75%	0.53%	1.72%	0.20%	4.03%	0.33%

过去六个月	9.91%	0.59%	1.92%	0.27%	7.99%	0.32%
过去一年	22.27%	0.74%	7.33%	0.26%	14.94%	0.48%
过去三年	44.25%	0.97%	22.13%	0.26%	22.12%	0.71%
自基金合同生效起至今	48.52%	0.84%	28.07%	0.24%	20.45%	0.60%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中债综合指数（总财富）收益率*80%。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 80%、20%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



§ 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	2017-05-04	-	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

					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	2017-05-04	-	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	2017-05-16	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 年上半年的 A 股市场大致可以分为三个阶段：第一个阶段是春节前，市场延续去年大盘成长风格趋势，沪深 300 涨幅超过 11%，同期以中证 1000 为代表的小盘股则持续下跌；第二个阶段是春节后一个月，市场方向显著变化，大盘股显著调整，特别是机构抱团的白马股大部分回撤都在 20% 以上，沪深 300 回撤超过 13%，而价值风格反而逆势上涨，上证红利指数在春节后到一季度末上涨超过 8%；第三个阶段是是整个二季度，在经济持续恢复和企业盈利增长数据向好的提振下，A 股市场实现整体震荡上扬，其中科创板和创业板表现最为突出，科创 50 和创业板指涨幅均超过 25%，而如上证综指、沪深 300 等传统市场指数涨幅在 5% 以下，呈现明显的结构分化。整体来看，上半年创业板、科创板、红利指数和中小市值指数显著跑赢以沪深 300 和上证 50 为代表的传统大盘指数。风格方面，与市场的三个阶段相匹配，春节前后市场从极致的大盘成长风格切换为极致的中小盘价值风格，一季度表现抢眼的价值风格在二季度遭遇回撤，整体来说上半年成长风格好于价值风格，小盘风格优于大盘风格。行业板块上，结构分化非常明显，行业的切换也与风格切换一致，以春节为节点，节前领先的消费者服务、食品饮料、医药和电力设备及新能源行业在节后显著回撤，节前落后的电力及公用事业、建筑、钢铁、煤炭行业在节后显著抬升，二季度科技板块显著反弹，具体而言，截至上半年，中信一级行业指数中，基础化工、钢铁、电力设备新能源等行业涨幅超过 20%，国防军工、家电和非银金融行业下跌超过 10%，行业板块间差异进一步拉大。

债券市场方面，上半年全球流动性宽松之后，通胀预期有所抬头，国内货币政策“稳”字当头，“宽

货币+紧信用”的政策组合逐步清晰，经济韧性较强，国债长端利率在 2 月初拉升，随后逐步企稳回落。转债市场受权益市场影响较大，整体呈现 N 型走势，部分高转股溢价率的转债在 2 月回撤较大，而正股有业绩支撑的转债投资价值显现。

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，维持了中高水平的股票平均仓位；选股方面，在小盘和成长风格上获得了一定的超额收益；同时，基金也维持了较高的中低风险转债的配置，在强化防御的同时贡献了绝对收益。未来本基金仍然保持在追求稳健收益的同时，注重回撤风险的控制。本基金将通过量化多策略体系充分挖掘和利用股票及债券市场的规律，注重资产本身的收益能力和空间，力争获得平稳的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.4404 元，份额累计净值为 1.4844 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 9.91%，同期业绩基准增长率 1.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，2021 年下半年，全球疫情影响逐渐淡化，服务消费有望进一步修复，而原本受益财政补贴和服务消费受限的商品消费将从高点逐步回归，去年以来对中国经济支撑明显的出口和地产动能边际放缓，经济的景气链条开始迁移，预计经济整体动能温和放缓。流动性方面，国内货币政策“稳”字当头，“宽货币+紧信用”的政策组合已然相对稳定，资金面整体波动较以往明显收窄。从当前盈利数据看，A 股上市公司中报和三季度报将继续保持高增长，叠加整体估值相对合理，我们认为 A 股整体大概率仍以区间震荡为主，但是行业和板块间的切换也依然会相对频繁。大盘成长与大盘价值的估值差仍在最高位，抱团股的波动性也在增加，未来估值低且盈利情况改善的个股和板块将更有机会。

债券方面，增长动能放缓，通胀筑顶，利率债的胜率在提高。当前信用利差结构性分化，信用出清压力仍在，我们对信用债特别是地产债的预期相对谨慎。权益市场结构性行情的背景下，转债重点关注结构性活跃机会。

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副总经理、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

本基金管理人于 2021 年 6 月 9 日发布公告，以 2021 年 6 月 3 日可分配利润为基准，每 10 份基金份额发放红利 0.440 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，博时量化平衡混合型证券投资基金的管理人——博时基金管理有限公司在博时量化平衡混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

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	47,705,415.48	72,562,601.33
结算备付金		4,306,409.69	23,750,966.22
存出保证金		123,707.40	353,202.58
交易性金融资产	6.4.3.2	651,478,831.14	494,336,926.49
其中：股票投资		277,551,964.36	242,354,752.41
基金投资		-	-
债券投资		373,926,866.78	251,982,174.08
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	-	215,000,000.00
应收证券清算款		526,579.86	240,779.53
应收利息	6.4.3.5	1,093,805.11	2,367,391.87
应收股利		-	-
应收申购款		378,888.52	2,205.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		705,613,637.20	808,614,073.98
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		-	14,395,886.22
应付赎回款		10,344.80	204,194.43
应付管理人报酬		832,068.82	936,683.78
应付托管费		138,678.12	156,114.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.3.7	738,652.67	900,547.22
应交税费		7,332.53	932.63
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	211,285.97	164,781.69
负债合计		1,938,362.91	16,759,139.97
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.3.9	488,529,452.09	585,989,618.97
未分配利润	6.4.3.10	215,145,822.20	205,865,315.04
所有者权益合计		703,675,274.29	791,854,934.01
负债和所有者权益总计		705,613,637.20	808,614,073.98

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4404 元，基金份额总额 488,529,452.09 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

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		70,934,679.72	2,205,620.75
1. 利息收入		2,309,050.15	68,449.33
其中：存款利息收入	6.4.3.11	192,122.02	14,017.32
债券利息收入		1,796,444.12	54,432.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		320,484.01	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		43,004,012.52	6,801,551.43
其中：股票投资收益	6.4.3.12	23,229,640.57	2,495,206.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13	17,156,550.37	4,048,131.20
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	47,242.72	-
股利收益	6.4.3.15	2,570,578.86	258,214.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	24,681,819.56	-4,700,921.66
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	939,797.49	36,541.65
减：二、费用		9,378,352.89	804,240.41
1. 管理人报酬		4,835,646.57	351,263.26
2. 托管费		805,941.09	58,543.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.3.18	3,634,813.32	324,292.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,313.53	189.38
7. 其他费用	6.4.3.19	98,638.38	69,951.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,556,326.83	1,401,380.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		61,556,326.83	1,401,380.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

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）	585,989,618.97	205,865,315.04	791,854,934.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,556,326.83	61,556,326.83
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）	-97,460,166.88	-31,716,009.38	-129,176,176.26
其中：1. 基金申购款	153,375,284.67	64,878,070.52	218,253,355.19
2. 基金赎回款	-250,835,451.55	-96,594,079.90	-347,429,531.45
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）	-	-20,559,810.29	-20,559,810.29
五、期末所有者权益（基金净值）	488,529,452.09	215,145,822.20	703,675,274.29
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）	44,460,510.27	7,983,694.30	52,444,204.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,401,380.34	1,401,380.34
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）	-4,028,178.17	-705,814.62	-4,733,992.79
其中：1. 基金申购款	8,299,660.24	1,941,429.89	10,241,090.13
2. 基金赎回款	-12,327,838.41	-2,647,244.51	-14,975,082.92
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）	40,432,332.10	8,679,260.02	49,111,592.12

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[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[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、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。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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(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	47,705,415.48

定期存款	-
其他存款	-
合计	47,705,415.48

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	262,958,693.96	277,551,964.36	14,593,270.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	354,669,171.88	373,926,866.78
	银行间市场	-	-
	合计	354,669,171.88	373,926,866.78
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	617,627,865.84	651,478,831.14	33,850,965.30

6.4.3.3 买入返售金融资产

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	4,902.59
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	1,937.90
应收债券利息	1,086,909.02
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	55.60
合计	1,093,805.11

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	738,652.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	738,652.67

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	5.52
应付证券出借违约金	-
预提费用	211,280.45
合计	211,285.97

6.4.3.8 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	585,989,618.97	585,989,618.97
本期申购	153,375,284.67	153,375,284.67
本期赎回（以“-”号填列）	-250,835,451.55	-250,835,451.55
本期末	488,529,452.09	488,529,452.09

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

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	245,867,900.97	-40,002,585.93	205,865,315.04
本期利润	36,874,507.27	24,681,819.56	61,556,326.83
本期基金份额交易产生的变动数	-40,586,031.13	8,870,021.75	-31,716,009.38
其中：基金申购款	70,529,012.61	-5,650,942.09	64,878,070.52
基金赎回款	-111,115,043.74	14,520,963.84	-96,594,079.90
本期已分配利润	-20,559,810.29	-	-20,559,810.29
本期末	221,596,566.82	-6,450,744.62	215,145,822.20

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	124,358.51
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	64,768.60
其他	2,994.91
合计	192,122.02

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	1,247,031,087.35

减：卖出股票成本总额	1,223,801,446.78
买卖股票差价收入	23,229,640.57

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	468,613,938.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	448,326,626.21
减：应收利息总额	3,130,762.22
买卖债券差价收入	17,156,550.37

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

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	47,242.72

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	2,570,578.86
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	2,570,578.86

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	24,760,239.56
——股票投资	6,301,664.31
——债券投资	18,458,575.25
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-78,420.00
——权证投资	-
——股指期货	-78,420.00
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	24,681,819.56
----	---------------

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	935,428.84
转换费收入	4,368.65
合计	939,797.49

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	3,634,138.32
银行间市场交易费用	675.00
交易基金产生的费用	0.00
其中：申购费	-
赎回费	-
基金交易费用	0.00
合计	3,634,813.32

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,857.93
中债登账户维护费	9,000.00
合计	98,638.38

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

截至财务报告批准报出日，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、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、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、基金代销机构
--------------------	-----------------

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	77,120,078.23	3.15%	23,304,629.26	10.90%

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	46,325,864.53	5.71%	24,044,709.89	29.59%

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	71,824.37	3.36%	-	-
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	21,703.32	11.16%	13,102.94	18.71%

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	4,835,646.57	351,263.26
其中：支付销售机构的客户维护费	22,982.84	47,364.74

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	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	805,941.09	58,543.85

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。

6.4.6.3 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

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
期初持有的基金份额	1,856,029.64	1,856,029.64
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,856,029.64	1,856,029.64
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%	4.59%

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	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
中国工商银行-活期存款	47,705,415.48	124,358.51	3,999,004.97	12,412.92

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021-06-11	-	2021-06-11	0.4400	19,207,800.67	1,352,009.62	20,559,810.29	-
合计				0.4400	19,207,800.67	1,352,009.62	20,559,810.29	-

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	-
688575	亚辉龙	2021-05-10	2021-11-17	首次公开发行股票限售	14.80	32.09	3,435.00	50,838.00	110,229.15	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发行股票限售	24.60	163.00	576.00	14,169.60	93,888.00	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	首次公开发行股票限售	9.88	27.34	3,412.00	33,710.56	93,284.08	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行股票限售	47.33	251.96	310.00	14,672.30	78,107.60	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	首次公开发行股票限售	16.49	37.79	1,499.00	24,718.51	56,647.21	-
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	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行	33.22	87.50	564.00	18,736.08	49,350.00	-

				限售						
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
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	-
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	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	48.59	90.39	262.00	12,730.58	23,682.18	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	首次公开发行限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
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	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	首次公开发行限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
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	-
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	-
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	201.00	3,760.71	11,581.62	-
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	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	首次公开发行	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-

				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	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行限售	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	首次公开发行限售	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
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	-
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	中洲新材	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	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-

基金代码	股票名称	首次发行日期	限售日期	限售类型	期初估值	期末估值	期初数量	期末数量	期末估值总额	备注
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	-
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	-

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	1,890.00	189,000.00	189,000.00	-

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
688368	晶丰明源	2021-06-21	拟筹划重大资产重组	335.26	2021-07-05	402.31	5,247.00	1,879,208.74	1,759,109.22	-
601015	陕西黑猫	2021-06-30	配股	8.95	2021-07-08	7.68	193,900.00	1,719,931.25	1,735,405.00	-

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金的投资范围为具有良

好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

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，将风险控制可在可承受的范围之内。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	211,894,795.20
合计	-	211,894,795.20

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在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

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	187,737,448.70	30,793,378.88
AAA 以下	186,189,418.08	-
未评级	-	9,294,000.00
合计	373,926,866.78	40,087,378.88

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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内

变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	47,705,415.48	-	-	-	47,705,415.48
结算备付金	4,306,409.69	-	-	-	4,306,409.69
存出保证金	123,707.40	-	-	-	123,707.40
交易性金融资产	62,099,006.40	205,003,488.45	106,824,371.93	277,551,964.36	651,478,831.14
应收证券清算款	-	-	-	526,579.86	526,579.86
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,093,805.11	1,093,805.11
应收申购款	-	-	-	378,888.52	378,888.52
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	114,234,538.97	205,003,488.45	106,824,371.	279,551,237.85	705,613,637.20

			93		
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,344.80	10,344.80
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	832,068.82	832,068.82
应付托管费	-	-	-	138,678.12	138,678.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,332.53	7,332.53
应付交易费用	-	-	-	738,652.67	738,652.67
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	211,285.97	211,285.97
负债总计	-	-	-	1,938,362.91	1,938,362.91
利率敏感度缺口	114,234,538.97	205,003,488.45	106,824,371.93	277,612,874.94	703,675,274.29
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	72,562,601.33	-	-	-	72,562,601.33
结算备付金	23,750,966.22	-	-	-	23,750,966.22
存出保证金	134,315.38	-	-	218,887.20	353,202.58
交易性金融资产	211,894,795.20	30,180,000.00	9,907,378.88	242,354,752.41	494,336,926.49
应收证券清算款	-	-	-	240,779.53	240,779.53
买入返售金融资产	215,000,000.00	-	-	-	215,000,000.00
应收利息	-	-	-	2,367,391.87	2,367,391.87
应收申购款	-	-	-	2,205.96	2,205.96
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	523,342,678.13	30,180,000.00	9,907,378.88	245,184,016.97	808,614,073.98
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	204,194.43	204,194.43
应付证券清算款	-	-	-	14,395,886.22	14,395,886.22
应付管理人报酬	-	-	-	936,683.78	936,683.78
应付托管费	-	-	-	156,114.00	156,114.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	932.63	932.63
应付交易费用	-	-	-	900,547.22	900,547.22
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,781.69	164,781.69
负债总计	-	-	-	16,759,139.97	16,759,139.97
利率敏感度缺口	523,342,678.13	30,180,000.00	9,907,378.88	228,424,877.00	791,854,934.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日

1. 市场利率下降 25 个基点	-	增加约 72
2. 市场利率上升 25 个基点	-	减少约 70

注：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。

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	277,551,964.36	39.44	242,354,752.41	30.61
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	373,926,866.78	53.14	30,793,378.88	3.89
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	651,478,831.14	92.58	273,148,131.29	34.49

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 1,164	增加约 1,149
2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 1,164	减少约 1,149	

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 641,421,485.86 元，属于第二层次的余额为 10,057,345.28 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 270,146,059.16 元，第二层次 224,190,867.33 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	277,551,964.36	39.33
	其中：股票	277,551,964.36	39.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	373,926,866.78	52.99
	其中：债券	373,926,866.78	52.99
	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	52,011,825.17	7.37
8	其他各项资产	2,122,980.89	0.30
9	合计	705,613,637.20	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,183,202.48	0.17
B	采矿业	5,445,988.00	0.77
C	制造业	189,665,802.29	26.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,005,256.60	1.14
E	建筑业	8,101,743.37	1.15
F	批发和零售业	9,472,641.58	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	6,409,859.00	0.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,017,878.91	2.13
J	金融业	22,214,693.70	3.16
K	房地产业	643,190.00	0.09
L	租赁和商务服务业	5,067,900.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	1,457,880.20	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,244,451.90	0.46
R	文化、体育和娱乐业	1,577,038.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	277,551,964.36	39.44

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	600782	新钢股份	3,589,900	20,031,642.00	2.85
2	300782	卓胜微	14,700	7,901,250.00	1.12
3	600153	建发股份	924,600	7,489,260.00	1.06
4	603486	科沃斯	24,400	5,565,152.00	0.79
5	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.73
6	600426	华鲁恒升	161,920	5,011,424.00	0.71
7	002475	立讯精密	99,300	4,567,800.00	0.65
8	000725	京东方 A	712,500	4,446,000.00	0.63
9	601328	交通银行	780,900	3,826,410.00	0.54
10	603010	万盛股份	181,820	3,812,765.40	0.54

11	600809	山西汾酒	8,500	3,808,000.00	0.54
12	000100	TCL 科技	490,500	3,752,325.00	0.53
13	603337	杰克股份	131,900	3,525,687.00	0.50
14	600702	舍得酒业	15,800	3,377,724.00	0.48
15	002876	三利谱	51,800	3,351,460.00	0.48
16	688036	传音控股	15,454	3,237,613.00	0.46
17	000001	平安银行	133,100	3,010,722.00	0.43
18	002415	海康威视	45,700	2,947,650.00	0.42
19	002064	华峰化学	202,800	2,879,760.00	0.41
20	600519	贵州茅台	1,400	2,879,380.00	0.41
21	002027	分众传媒	293,000	2,757,130.00	0.39
22	603599	广信股份	90,800	2,731,264.00	0.39
23	603260	合盛硅业	34,291	2,637,320.81	0.37
24	603267	鸿远电子	19,500	2,494,440.00	0.35
25	300633	开立医疗	78,600	2,482,188.00	0.35
26	603659	璞泰来	18,100	2,472,460.00	0.35
27	002920	德赛西威	22,400	2,465,792.00	0.35
28	300223	北京君正	24,100	2,432,172.00	0.35
29	688188	柏楚电子	5,500	2,398,000.00	0.34
30	002601	龙蟠佰利	68,400	2,365,272.00	0.34
31	300003	乐普医疗	72,600	2,331,912.00	0.33
32	002648	卫星石化	59,380	2,327,102.20	0.33
33	601888	中国中免	7,700	2,310,770.00	0.33
34	002833	弘亚数控	58,100	2,251,375.00	0.32
35	688139	海尔生物	20,600	2,165,060.00	0.31
36	601699	潞安环能	182,400	2,154,144.00	0.31
37	601318	中国平安	32,300	2,076,244.00	0.30
38	688099	晶晨股份	18,289	2,052,025.80	0.29
39	601208	东材科技	124,900	2,038,368.00	0.29
40	000683	远兴能源	429,600	2,006,232.00	0.29
41	603877	太平鸟	36,100	1,927,018.00	0.27
42	001965	招商公路	265,900	1,919,798.00	0.27
43	600015	华夏银行	301,900	1,868,761.00	0.27
44	600966	博汇纸业	138,179	1,803,235.95	0.26
45	600039	四川路桥	286,700	1,797,609.00	0.26
46	688368	晶丰明源	5,247	1,759,109.22	0.25
47	601015	陕西黑猫	193,900	1,735,405.00	0.25
48	600012	皖通高速	268,300	1,733,218.00	0.25
49	300760	迈瑞医疗	3,600	1,728,180.00	0.25
50	300696	爱乐达	41,300	1,718,906.00	0.24
51	300677	英科医疗	13,600	1,697,280.00	0.24
52	601636	旗滨集团	88,500	1,642,560.00	0.23
53	600309	万华化学	15,000	1,632,300.00	0.23
54	601288	农业银行	528,600	1,601,658.00	0.23
55	601988	中国银行	492,100	1,515,668.00	0.22
56	601939	建设银行	227,300	1,511,545.00	0.21
57	600132	重庆啤酒	7,600	1,504,420.00	0.21
58	601229	上海银行	183,200	1,502,240.00	0.21
59	688111	金山办公	3,800	1,500,240.00	0.21
60	601077	渝农商行	369,700	1,475,103.00	0.21

61	000858	五粮液	4,878	1,453,107.42	0.21
62	603259	药明康德	8,780	1,374,860.20	0.20
63	600028	中国石化	313,100	1,365,116.00	0.19
64	601668	中国建筑	291,100	1,353,615.00	0.19
65	603882	金城医学	8,200	1,310,114.00	0.19
66	000799	酒鬼酒	4,900	1,252,440.00	0.18
67	000568	泸州老窖	5,000	1,179,700.00	0.17
68	002311	海大集团	14,400	1,175,040.00	0.17
69	603833	欧派家居	7,900	1,121,484.00	0.16
70	600377	宁沪高速	113,000	1,102,880.00	0.16
71	601919	中远海控	35,600	1,087,224.00	0.15
72	600887	伊利股份	28,000	1,031,240.00	0.15
73	300122	智飞生物	5,300	989,669.00	0.14
74	600763	通策医疗	2,400	986,400.00	0.14
75	300454	深信服	3,800	986,024.00	0.14
76	002919	名臣健康	21,600	976,320.00	0.14
77	688169	石头科技	762	960,882.00	0.14
78	300015	爱尔眼科	13,355	947,937.90	0.13
79	601390	中国中铁	180,800	947,392.00	0.13
80	600570	恒生电子	9,800	913,850.00	0.13
81	300124	汇川技术	12,300	913,398.00	0.13
82	300534	陇神戎发	132,400	910,912.00	0.13
83	000782	美达股份	231,000	898,590.00	0.13
84	600104	上汽集团	40,900	898,573.00	0.13
85	601117	中国化学	99,200	868,992.00	0.12
86	000619	海螺型材	157,500	830,025.00	0.12
87	601985	中国核电	161,800	818,708.00	0.12
88	002888	惠威科技	64,940	816,945.20	0.12
89	002636	金安国纪	49,900	809,378.00	0.12
90	601211	国泰君安	46,900	803,866.00	0.11
91	603955	大千生态	59,100	800,805.00	0.11
92	600476	湘邮科技	74,000	799,940.00	0.11
93	600148	长春一东	61,824	799,384.32	0.11
94	600232	金鹰股份	160,900	793,237.00	0.11
95	002696	百洋股份	153,300	792,561.00	0.11
96	000819	岳阳兴长	128,000	792,320.00	0.11
97	600854	春兰股份	226,500	790,485.00	0.11
98	603527	众源新材	104,400	788,220.00	0.11
99	603559	中通国脉	61,700	782,356.00	0.11
100	603226	菲林格尔	120,700	777,308.00	0.11
101	603501	韦尔股份	2,400	772,800.00	0.11
102	300652	雷迪克	39,000	766,740.00	0.11
103	000401	冀东水泥	61,700	761,995.00	0.11
104	002124	天邦股份	107,580	754,135.80	0.11
105	002382	蓝帆医疗	36,000	750,600.00	0.11
106	002898	赛隆药业	76,900	749,775.00	0.11
107	300750	宁德时代	1,400	748,720.00	0.11
108	600463	空港股份	124,000	747,720.00	0.11
109	603683	晶华新材	79,600	747,444.00	0.11
110	300084	海默科技	164,200	742,184.00	0.11

111	300022	吉峰科技	156,800	741,664.00	0.11
112	600050	中国联通	168,000	725,760.00	0.10
113	300450	先导智能	11,960	719,274.40	0.10
114	601928	凤凰传媒	99,800	712,572.00	0.10
115	601336	新华保险	15,400	707,014.00	0.10
116	603100	川仪股份	40,000	700,400.00	0.10
117	300529	健帆生物	8,000	690,880.00	0.10
118	300413	芒果超媒	10,000	686,000.00	0.10
119	601319	中国人保	113,300	671,869.00	0.10
120	000039	中集集团	35,900	652,662.00	0.09
121	600036	招商银行	11,800	639,442.00	0.09
122	600308	华泰股份	109,600	604,992.00	0.09
123	600742	一汽富维	58,800	599,172.00	0.09
124	600667	太极实业	65,800	598,780.00	0.09
125	688016	心脉医疗	1,300	590,993.00	0.08
126	300059	东方财富	17,560	575,792.40	0.08
127	600483	福能股份	54,400	570,656.00	0.08
128	600985	淮北矿业	46,400	566,544.00	0.08
129	603195	公牛集团	2,800	565,600.00	0.08
130	600025	华能水电	97,300	563,367.00	0.08
131	000825	太钢不锈	74,100	555,009.00	0.08
132	300463	迈克生物	12,900	542,961.00	0.08
133	000932	华菱钢铁	80,100	528,660.00	0.08
134	600808	马钢股份	123,200	528,528.00	0.08
135	603986	兆易创新	2,800	526,120.00	0.07
136	000789	万年青	45,900	525,096.00	0.07
137	688200	华峰测控	1,100	520,663.00	0.07
138	601618	中国中冶	174,100	518,818.00	0.07
139	000498	山东路桥	92,500	518,000.00	0.07
140	000626	远大控股	29,900	516,672.00	0.07
141	601100	恒立液压	6,000	515,520.00	0.07
142	603678	火炬电子	7,600	513,000.00	0.07
143	688608	恒玄科技	1,600	507,056.00	0.07
144	300408	三环集团	11,900	504,798.00	0.07
145	600522	中天科技	50,200	502,000.00	0.07
146	600720	祁连山	47,500	500,650.00	0.07
147	600507	方大特钢	73,500	498,330.00	0.07
148	601678	滨化股份	62,000	490,420.00	0.07
149	000778	新兴铸管	131,200	488,064.00	0.07
150	600660	福耀玻璃	8,500	474,725.00	0.07
151	603806	福斯特	4,500	473,085.00	0.07
152	000717	韶钢松山	102,100	468,639.00	0.07
153	600449	宁夏建材	40,500	460,080.00	0.07
154	300496	中科创达	2,900	455,474.00	0.06
155	000690	宝新能源	88,700	453,257.00	0.06
156	688058	宝兰德	4,888	452,140.00	0.06
157	600845	宝信软件	8,860	450,974.00	0.06
158	603290	斯达半导	1,400	448,000.00	0.06
159	300595	欧普康视	4,320	447,336.00	0.06
160	600271	航天信息	34,300	446,929.00	0.06

161	002430	杭氧股份	12,900	446,211.00	0.06
162	000063	中兴通讯	13,100	435,313.00	0.06
163	002230	科大讯飞	6,400	432,512.00	0.06
164	300373	扬杰科技	7,100	429,834.00	0.06
165	000661	长春高新	1,100	425,700.00	0.06
166	601857	中国石油	79,600	421,084.00	0.06
167	600690	海尔智家	16,200	419,742.00	0.06
168	002402	和而泰	17,200	412,284.00	0.06
169	300316	晶盛机电	8,100	409,050.00	0.06
170	002092	中泰化学	38,600	396,422.00	0.06
171	002371	北方华创	1,400	388,332.00	0.06
172	600260	凯乐科技	43,400	385,392.00	0.05
173	300724	捷佳伟创	3,200	371,232.00	0.05
174	000157	中联重科	39,700	366,828.00	0.05
175	601186	中国铁建	49,300	366,299.00	0.05
176	605111	新洁能	2,000	360,540.00	0.05
177	300628	亿联网络	4,300	360,340.00	0.05
178	603288	海天味业	2,700	348,165.00	0.05
179	603369	今世缘	6,300	341,208.00	0.05
180	000048	京基智农	18,100	333,945.00	0.05
181	002932	明德生物	3,400	331,738.00	0.05
182	688536	思瑞浦	600	330,600.00	0.05
183	002410	广联达	4,800	327,360.00	0.05
184	000807	云铝股份	27,300	324,870.00	0.05
185	300866	安克创新	1,900	318,193.00	0.05
186	603444	吉比特	600	318,000.00	0.05
187	002241	歌尔股份	7,400	316,276.00	0.04
188	600056	中国医药	25,700	312,255.00	0.04
189	300207	欣旺达	9,000	293,040.00	0.04
190	300737	科顺股份	9,200	289,248.00	0.04
191	000429	粤高速 A	39,900	286,083.00	0.04
192	601012	隆基股份	3,220	286,064.80	0.04
193	603489	八方股份	1,200	283,656.00	0.04
194	600038	中直股份	5,200	274,248.00	0.04
195	000333	美的集团	3,768	268,922.16	0.04
196	002460	赣锋锂业	2,200	266,398.00	0.04
197	600062	华润双鹤	21,300	253,683.00	0.04
198	600649	城投控股	52,000	247,520.00	0.04
199	000863	三湘印象	71,700	235,893.00	0.03
200	002179	中航光电	2,900	229,158.00	0.03
201	000528	柳工	27,600	226,320.00	0.03
202	600967	内蒙一机	20,700	209,484.00	0.03
203	300761	立华股份	6,200	205,406.00	0.03
204	300083	创世纪	18,000	197,100.00	0.03
205	600031	三一重工	6,700	194,769.00	0.03
206	603392	万泰生物	700	181,426.00	0.03
207	603355	莱克电气	2,900	180,467.00	0.03
208	600373	中文传媒	18,100	178,466.00	0.03
209	002714	牧原股份	2,860	173,945.20	0.02
210	000723	美锦能源	22,700	171,612.00	0.02

211	601138	工业富联	13,700	170,017.00	0.02
212	601669	中国电建	40,600	157,122.00	0.02
213	600998	九州通	10,100	155,237.00	0.02
214	600023	浙能电力	41,500	152,305.00	0.02
215	002677	浙江美大	8,300	151,724.00	0.02
216	002649	博彦科技	14,100	148,050.00	0.02
217	300146	汤臣倍健	4,400	144,760.00	0.02
218	000028	国药一致	3,700	140,008.00	0.02
219	601006	大秦铁路	21,200	139,496.00	0.02
220	600779	水井坊	1,100	138,985.00	0.02
221	600688	上海石化	36,100	135,736.00	0.02
222	600436	片仔癀	300	134,490.00	0.02
223	001696	宗申动力	16,500	131,670.00	0.02
224	300755	华致酒行	3,200	130,592.00	0.02
225	600803	新奥股份	7,900	130,429.00	0.02
226	601628	中国人寿	3,700	125,393.00	0.02
227	300014	亿纬锂能	1,200	124,716.00	0.02
228	600548	深高速	14,000	122,080.00	0.02
229	601166	兴业银行	5,500	113,025.00	0.02
230	600027	华电国际	32,800	112,832.00	0.02
231	000589	贵州轮胎	19,700	110,911.00	0.02
232	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.02
233	600761	安徽合力	9,800	108,388.00	0.02
234	600711	盛屯矿业	14,900	106,237.00	0.02
235	000830	鲁西化工	5,600	104,888.00	0.01
236	300394	天孚通信	4,140	104,824.80	0.01
237	300919	中伟股份	576	93,888.00	0.01
238	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
239	600894	广日股份	12,600	84,672.00	0.01
240	600335	国机汽车	14,200	84,206.00	0.01
241	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
242	300676	华大基因	700	83,020.00	0.01
243	002869	金溢科技	3,500	82,880.00	0.01
244	300390	天华超净	1,700	81,651.00	0.01
245	603026	石大胜华	500	81,025.00	0.01
246	300957	贝泰妮	310	78,107.60	0.01
247	600919	江苏银行	10,700	75,970.00	0.01
248	600048	保利地产	6,100	73,444.00	0.01
249	002441	众业达	9,100	71,344.00	0.01
250	000651	格力电器	1,300	67,730.00	0.01
251	002043	兔宝宝	6,600	65,076.00	0.01
252	300552	万集科技	1,800	59,904.00	0.01
253	603368	柳药股份	3,000	59,220.00	0.01
254	603606	东方电缆	2,900	58,406.00	0.01
255	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.01
256	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
257	601865	福莱特	1,400	55,342.00	0.01
258	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
259	600418	江淮汽车	4,300	53,449.00	0.01
260	600582	天地科技	13,700	53,430.00	0.01

261	600276	恒瑞医药	760	51,657.20	0.01
262	002240	盛新锂能	1,800	51,390.00	0.01
263	002726	龙大肉食	4,900	49,588.00	0.01
264	300979	华利集团	564	49,350.00	0.01
265	300726	宏达电子	700	49,343.00	0.01
266	001979	招商蛇口	4,500	49,275.00	0.01
267	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
268	600588	用友网络	1,300	43,238.00	0.01
269	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
270	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
271	603613	国联股份	400	39,988.00	0.01
272	601607	上海医药	1,800	38,034.00	0.01
273	601225	陕西煤业	3,100	36,735.00	0.01
274	601898	中煤能源	5,000	35,750.00	0.01
275	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
276	600741	华域汽车	1,300	34,151.00	0.00
277	600030	中信证券	1,230	30,676.20	0.00
278	600900	长江电力	1,400	28,896.00	0.00
279	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
280	002594	比亚迪	100	25,100.00	0.00
281	601600	中国铝业	4,700	24,910.00	0.00
282	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
283	300981	中红医疗	262	23,682.18	0.00
284	300033	同花顺	200	22,556.00	0.00
285	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
286	688298	东方生物	100	21,760.00	0.00
287	601838	成都银行	1,600	20,224.00	0.00
288	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
289	600018	上港集团	4,000	19,080.00	0.00
290	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
291	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
292	000488	晨鸣纸业	1,900	15,466.00	0.00
293	000656	金科股份	2,600	15,054.00	0.00
294	600011	华能国际	3,500	14,770.00	0.00
295	002293	罗莱生活	1,100	14,729.00	0.00
296	002603	以岭药业	500	14,580.00	0.00
297	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
298	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
299	000923	河钢资源	700	13,349.00	0.00
300	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
301	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
302	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
303	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
304	601155	新城控股	300	12,480.00	0.00
305	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
306	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
307	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
308	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
309	300415	伊之密	500	10,750.00	0.00
310	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00

311	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
312	000002	万科 A	400	9,524.00	0.00
313	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
314	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
315	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
316	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
317	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
318	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
319	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
320	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
321	600150	中国船舶	500	8,255.00	0.00
322	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
323	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
324	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
325	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
326	002068	黑猫股份	1,000	7,590.00	0.00
327	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
328	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
329	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
330	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
331	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
332	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
333	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
334	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
335	601601	中国太保	200	5,794.00	0.00
336	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
337	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
338	601899	紫金矿业	500	4,845.00	0.00
339	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
340	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
341	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
342	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
343	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
344	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
345	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000932	华菱钢铁	52,925,343.39	6.68
2	600782	新钢股份	20,551,900.04	2.60
3	000001	平安银行	20,362,528.50	2.57
4	600519	贵州茅台	14,300,382.00	1.81
5	002714	牧原股份	13,965,879.40	1.76
6	300124	汇川技术	13,902,817.73	1.76
7	000333	美的集团	13,355,346.01	1.69

8	002027	分众传媒	12,985,168.93	1.64
9	600809	山西汾酒	12,495,161.19	1.58
10	000725	京东方 A	11,826,548.00	1.49
11	600740	山西焦化	11,347,260.93	1.43
12	601888	中国中免	10,480,282.00	1.32
13	600153	建发股份	9,894,066.00	1.25
14	600900	长江电力	9,479,006.05	1.20
15	300782	卓胜微	9,260,394.38	1.17
16	300059	东方财富	8,991,519.19	1.14
17	601818	光大银行	8,942,376.00	1.13
18	000100	TCL 科技	8,829,344.00	1.12
19	601318	中国平安	8,791,199.00	1.11
20	600309	万华化学	8,409,033.56	1.06

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	000932	华菱钢铁	45,660,164.41	5.77
2	000333	美的集团	30,970,945.81	3.91
3	601318	中国平安	26,819,302.42	3.39
4	000001	平安银行	23,980,753.46	3.03
5	601166	兴业银行	14,967,417.00	1.89
6	002142	宁波银行	14,923,747.92	1.88
7	601818	光大银行	14,663,540.00	1.85
8	000002	万科 A	14,169,746.54	1.79
9	002714	牧原股份	13,953,714.88	1.76
10	300124	汇川技术	12,916,044.57	1.63
11	600900	长江电力	12,101,521.00	1.53
12	600519	贵州茅台	11,663,995.00	1.47
13	600740	山西焦化	11,589,145.77	1.46
14	002027	分众传媒	10,248,995.80	1.29
15	601857	中国石油	10,044,692.00	1.27
16	601899	紫金矿业	9,915,554.00	1.25
17	600887	伊利股份	9,299,125.67	1.17
18	600309	万华化学	9,098,868.21	1.15
19	600809	山西汾酒	8,874,185.00	1.12
20	000725	京东方 A	8,832,699.63	1.12

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,252,696,994.42
卖出股票的收入（成交）总额	1,247,031,087.35

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）	373,926,866.78	53.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	373,926,866.78	53.14

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	110033	国贸转债	537,840	62,099,006.40	8.82
2	127014	北方转债	376,874	42,157,125.64	5.99
3	127027	靖远转债	411,619	41,178,364.76	5.85
4	127018	本钢转债	314,553	31,480,464.24	4.47
5	127023	华菱转 2	199,991	26,510,806.96	3.77

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

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					47,242.72
股指期货投资本期公允价值变动					-78,420.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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靖远转债(127027)、苏银转债(110053)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：2020年6月29日，因公司魏家地煤矿收到甘肃煤矿安全监察局兰州监察分局下发的《行政处罚决定书》(甘煤安监兰二罚(2020)12号)，认为事故是一起责任事故，事故事实违反了《中华人民共和国安全生产法》第四条的规定。甘肃煤矿安全监察局兰州监察分局对甘肃靖远煤电股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2020年12月30日，因存在1、个人贷款资金用途管控不严；2、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款；3、理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理；4、个人理财资金对接项目资本金；5、理财业务未与自营业务相分离；6、理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求等违规行为，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对江苏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	123,707.40
2	应收证券清算款	526,579.86
3	应收股利	-
4	应收利息	1,093,805.11
5	应收申购款	378,888.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,122,980.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110033	国贸转债	62,099,006.40	8.82

2	127014	北方转债	42,157,125.64	5.99
3	127027	靖远转债	41,178,364.76	5.85
4	127018	本钢转债	31,480,464.24	4.47
5	127023	华菱转 2	26,510,806.96	3.77
6	110053	苏银转债	23,058,400.00	3.28
7	113026	核能转债	20,342,452.00	2.89
8	110048	福能转债	17,707,364.80	2.52
9	123085	万顺转 2	17,221,622.16	2.45
10	123048	应急转债	12,208,842.77	1.74
11	128107	交科转债	11,504,646.00	1.63
12	113044	大秦转债	10,353,775.10	1.47
13	127026	超声转债	9,935,126.15	1.41
14	110064	建工转债	8,784,105.60	1.25
15	123002	国祯转债	8,735,177.40	1.24
16	110041	蒙电转债	8,599,483.20	1.22
17	110043	无锡转债	7,887,600.00	1.12
18	113532	海环转债	6,755,484.00	0.96
19	110062	烽火转债	2,792,460.80	0.40
20	113011	光大转债	2,311,600.00	0.33
21	113036	宁建转债	900,076.80	0.13
22	110056	亨通转债	678,282.00	0.10
23	110071	湖盐转债	535,600.00	0.08

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	0.73	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

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
1,259	388,029.75	480,981,899.96	98.46%	7,547,552.13	1.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	158,877.55	0.03%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年5月4日）基金份额总额	262,251,781.89
本报告期期初基金份额总额	585,989,618.97
本报告期基金总申购份额	153,375,284.67
减：本报告期基金总赎回份额	250,835,451.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	488,529,452.09

§ 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，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	
新时代证券	1	94,920,649.02	3.87%	69,416.27	3.25%	新增 1 个
申万宏源	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	374,854,530.58	15.29%	349,105.63	16.35%	-
广发证券	1	148,649,150.00	6.06%	138,441.22	6.48%	减少 1 个
招商证券	2	77,120,078.23	3.15%	71,824.37	3.36%	-
东吴证券	1	386,198,068.20	15.75%	359,670.51	16.84%	-
中金公司	2	153,708,634.11	6.27%	143,151.09	6.70%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	272,851,343.31	11.13%	254,105.35	11.90%	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	56,348,426.87	2.30%	52,478.08	2.46%	-
西部证券	1	198,967,418.84	8.12%	145,466.30	6.81%	新增 1 个
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	3	411,271,611.88	16.78%	300,773.34	14.08%	新增 2 个
平安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	140,663,708.79	5.74%	131,001.01	6.13%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	103,092,165.47	4.20%	96,012.09	4.50%	-
中信建投	1	33,041,693.93	1.35%	24,163.79	1.13%	-

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,我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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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
新时代证券	60,293,394.41	7.44%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	42,189,286.87	5.20%	660,000,000.00	42.17%	-	-
广发证券	113,980,185.57	14.06%	295,000,000.00	18.85%	-	-
招商证券	46,325,864.53	5.71%	-	-	-	-
东吴证券	59,132,184.39	7.29%	-	-	-	-
中金公司	144,858,832.80	17.86%	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	171,883,143.82	21.20%	610,000,000.00	38.98%	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	37,695,678.51	4.65%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	69,011,656.59	8.51%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	15,847,020.11	1.95%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证	47,420,087.59	5.85%	-	-	-	-

券						
中信建投	2,251,300.42	0.28%	-	-	-	-

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	博时量化平衡混合型证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-09
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	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
6	博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
7	关于博时旗下部分开放式基金增加贵州银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-02
8	博时量化平衡混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
9	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
10	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
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-20210310	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210220	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
13	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
14	博时量化平衡混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券日报、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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时量化平衡混合型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时量化平衡混合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 博时量化平衡混合型证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时量化平衡混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日