

博时量化多策略股票型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	82
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	82
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	82
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	82
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	82
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
8.12	投资组合报告附注	83
§9	基金份额持有人信息	84
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	85
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	85
§10	开放式基金份额变动	85
§11	重大事件揭示	85
11.1	基金份额持有人大会决议	86
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	86
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4	基金投资策略的改变	86
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8	其他重大事件	87
§12	影响投资者决策的其他重要信息	90
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	90
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	90
§13	备查文件目录	91
13.1	备查文件目录	91
13.2	存放地点	91
13.3	查阅方式	91

§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	151,413,892.69 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	137,957,614.05 份	13,456,278.64 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露负责人	姓名	孙麒清	张燕
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	26,667,125.71	4,681,534.29	37,060,324.58	13,588,805.51	15,685,782.88	16,257,018.70
本期利润	15,968,064.64	1,923,162.69	45,365,625.00	17,010,984.99	21,852,571.79	21,788,487.09
加权平均基金份额本期利润	0.1273	0.1017	0.4140	0.4299	0.3118	0.3612
本期加权平均净值利润率	7.93%	6.53%	33.27%	36.04%	32.03%	38.21%

本期基金份额净值增长率	11.46%	10.55%	39.07%	37.98%	31.16%	30.10%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
期末可供分配利润	86,288,960.75	7,767,628.80	57,753,897.70	10,674,786.86	4,805,137.43	1,336,174.82
期末可供分配基金份额利润	0.6255	0.5772	0.3994	0.3692	0.0504	0.0359
期末基金资产净值	225,926,644.84	21,380,857.03	212,477,074.85	41,559,106.77	100,733,957.49	38,733,874.26
期末基金份额净值	1.6377	1.5889	1.4693	1.4373	1.0565	1.0417
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金份额累计净值增长率	63.77%	58.89%	46.93%	43.73%	5.65%	4.17%

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

1. 博时量化多策略股票 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.80%	0.68%	1.75%	0.64%	-3.55%	0.04%
过去六个月	0.71%	0.87%	-2.62%	0.86%	3.33%	0.01%
过去一年	11.46%	0.97%	1.07%	0.91%	10.39%	0.06%
过去三年	103.31%	1.16%	50.38%	1.09%	52.93%	0.07%
自基金合同生效起至今	63.77%	1.20%	18.87%	1.11%	44.90%	0.09%

2. 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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-2.00%	0.68%	1.75%	0.64%	-3.75%	0.04%
过去六个月	0.30%	0.87%	-2.62%	0.86%	2.92%	0.01%
过去一年	10.55%	0.97%	1.07%	0.91%	9.48%	0.06%
过去三年	98.44%	1.16%	50.38%	1.09%	48.06%	0.07%
自基金合同生效起至今	58.89%	1.20%	18.87%	1.11%	40.02%	0.09%

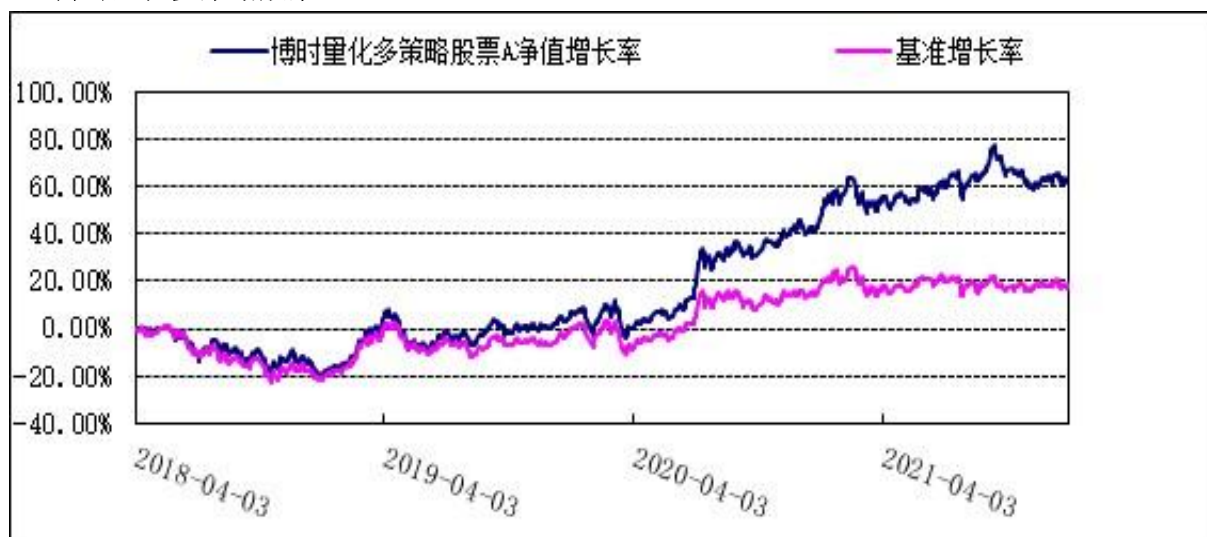
本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、20% 和 10% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

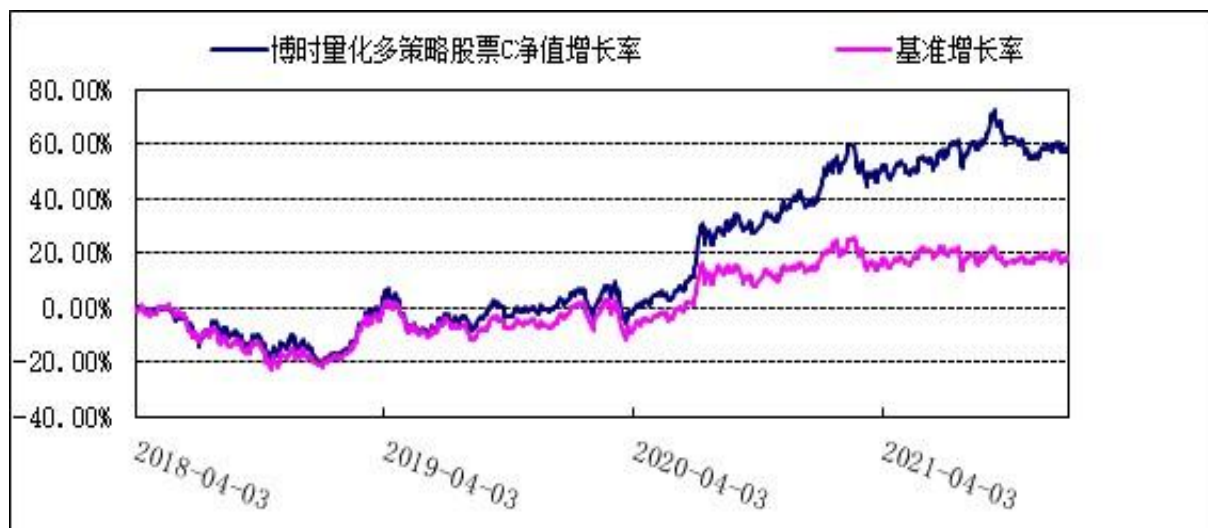
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 4 月 3 日至 2021 年 12 月 31 日)

1、博时量化多策略股票 A



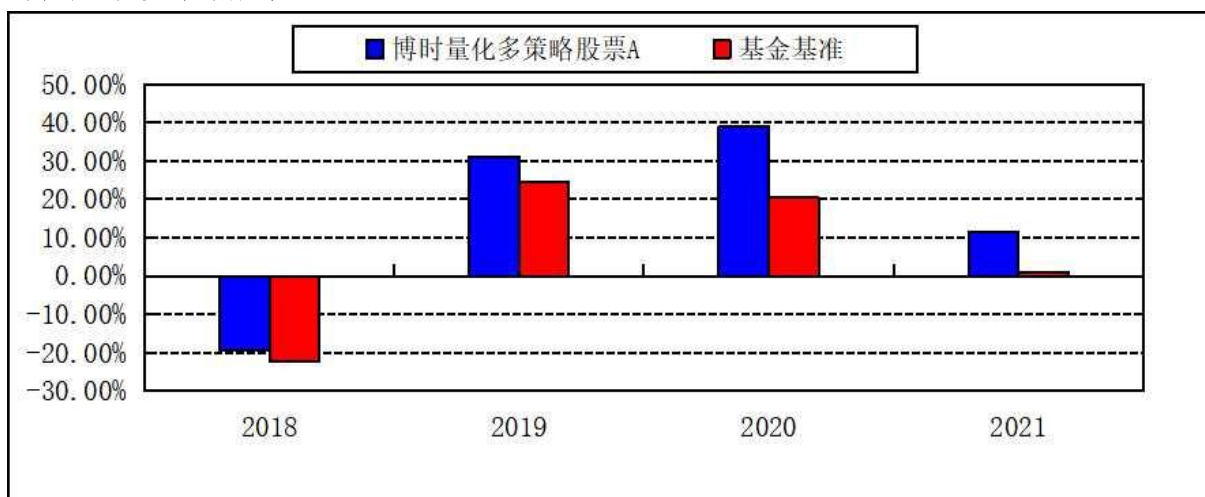
2、博时量化多策略股票 C



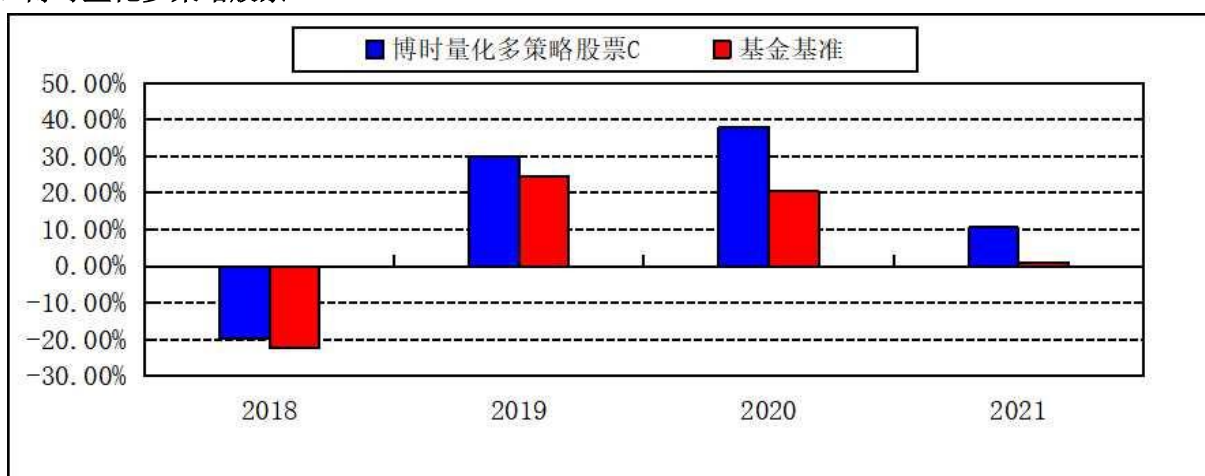
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时量化多策略股票 A



2、博时量化多策略股票 C



注：本基金的基金合同于 2018 年 4 月 3 日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 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 16687 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 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 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。

其他大事件

2021 年 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021 年 9 月 28 日，由中国证券报社有限公司主办的第十八届中国基金业金牛奖评选结果正式揭晓，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时信用债纯债债券一举荣获了“五年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2021 年 9 月 27 日，由证券时报报社有限公司主办的第十六届中国基金业明星基金奖正式公布，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时天颐债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。

2021 年 9 月，由北京济安金信科技有限公司主办的第三届济安“群星汇”评选结果揭晓，凭借卓越的综合管理实力和旗下基金产品出色的长期业绩，博时基金一举获得了“济安众星奖”、“济安五星奖”两项重量级的公司奖项。博时旗下产品博时合惠货币(004841)获得了“基金产品单项奖-货币型”，博时合惠货币基金经理魏桢则荣获了“五星基金明星奖”奖。

2021 年 7 月 6 日，由上海证券报社有限公司主办的第十七届“金基金”奖的评选结果揭晓。凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获 2021 年度“金基金”债券投资回报基金管理公

司奖，博时富瑞纯债债券荣获 2021 年度“金基金”债券基金三年期奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林景艺	基金经理	2018-04-03	-	11.4	林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理、博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015 年 5 月 20 日-2021 年 5 月 18 日)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—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日—至今)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/基金经理	2018-04-03	-	19.4	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管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、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—至

					今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日—至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	11.6	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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 41 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 年年内两度受到不同的新冠病毒变异毒株扩散影响，因其超强的传播能力而让多国屡次封锁，但疫苗研发和接种的快速推进令疫情防控效果显著，加之多项非常规刺激政策持续发力，经济逐步适应了与疫情共振，生产活动逐步恢复到疫情前水平，全球风险情绪明显改善。不过，疫情的冲击扰乱了全球供应链，全球贸易商品和能源价格上涨，从芯片到薯片的所有产品都难以满足需求，劳动力市场收紧，通胀水平持续提升，各国央行为了抑制通胀快速上行而收紧货币政策。疫情反复、通胀上升和央行货币政策转向是影响市场情绪的主要因素。聚焦到国内市场，2021 年 A 股波动相比去年有所下降，市场在一季度冲高回落，二季度后震荡向上。总体而言，市场成交活跃，成交量持续增长，已经接近历史最高水平。在本轮行情中，各指数表现分化较为明显，当中中证 1000 表现最好，录得 20.52% 的涨幅，此外上证 50 跌 10.06%，沪深 300 跌 5.20%，中证 500 涨 15.59%，创业板涨 12.02%，科创板涨 0.37%。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。从二季度开始风格趋于稳定，小盘持续好于大盘并贯穿全年。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，三季度价值风格相对走强，但四季度无法延续趋势，重新走弱。具体到指数上，小盘成长和小盘价值表现亮眼，大幅领先大盘价值和大盘动量，其中小盘成长表现最好而大盘价值表现最差。动量风格则反复变化，1 月走强，2 月回落，3 月到 8 月持续走强，随后进入震荡整理状态。在行业层面，虽然 A 股指数水平并没有太大变化，但是它的内部结构发生了非常大的变化，大量资金重新回到了传统的、周期性的、低估值的板块，最终体现在周期板块表现较好，消费板块较弱。具体而言，电力设备及新能源、基础化工、有色金属、煤炭、钢铁涨幅靠前，消费者服务、非银、家电、房地产、食品饮料跌幅较大。本基金在 2021 年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了较高的股票仓位。在量化策略的配置上，及时对风格变化做出响应，超配小盘成长和小盘价值，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 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.6377 元，份额累计净值为 1.6377 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.5889 元，份额累计净值为 1.5889 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 11.46%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 10.55%，同期业绩基准增长率为 1.07%。

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 2022 年，尽管全球经济总体处于复苏态势中，但是诸多风险依然不容乐观。从新冠病毒、到德尔塔病毒、再到年底出现的奥密克戎病毒，病毒的变异加大了全球经济复苏的不确定性。而得益于中国政权的强大执行力，我国有效控制了疫情传播，在此基础上，宏观政策可以更加灵活精确，我们预期中国经济将保持复苏，复苏动能也将逐步由外需拉动向更多内需驱动转换。中国在保持经济增长的同时，消费有望继续回暖，新国货加速崛起。房地产调控将持续，稳市场稳预期是核心政策目标。数字化转型、医疗创新和可持续发展这三大趋势将继续推动研发和投资，创造更多价值。数字化转型只会不断加速，医疗创新将不断寻求突破，探索疫情下的解决方案。而愈加频繁、更具破坏性的自然灾害，都揭示了关注可持续投资的重要性。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。在经历了 21 年的低波动环境后，今年市场的整体波动可能会加剧，在这种市场环境下，量化投资策略具有一定的优势。较为分散的持仓特点很大程度上减小了在极端环境下的利润损失，通过稳定的个股选择能力力争实现组合业绩的稳步增长。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

2021 年，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步完善投资管理相关的管理机制，修订了《股票池管理办法》、《债券池管理办法》、《信用风险处置制度》等制度文件。系统建设方面，对“金手指估值系统”进行升级改造，对“博时产品管理系统”、“新一代决策支持系统”等管理平台进行持续迭代更新，同时上线了“统一风险管理平台”，提升了公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，

严格规范基金销售业务，制定了《销售机构管理规范》，日常业务中按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 24240 号

博时量化多策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时量化多策略股票型证券投资基金(以下简称“博时量化多策略股票”)的财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表, 2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时量化多策略股票 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

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

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

基金管理人治理层负责监督博时量化多策略股票的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、

故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
 薛竞 叶尔甸
 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
 2022 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	14,002,379.60	16,637,329.69
结算备付金		6,181,764.16	5,644,934.85
存出保证金		130,696.28	1,079,128.88
交易性金融资产	7.4.7.2	228,718,141.08	231,675,807.13

其中：股票投资		227,748,048.18	231,382,807.13
基金投资		-	-
债券投资		970,092.90	293,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		155,658.44	347,275.03
应收利息	7.4.7.5	4,939.57	5,178.88
应收股利		-	-
应收申购款		17,431.52	279.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		249,211,010.65	255,389,934.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,461.38	385,578.69
应付管理人报酬		320,075.02	309,926.54
应付托管费		53,345.82	51,654.42
应付销售服务费		21,937.02	25,627.55
应付交易费用	7.4.7.7	1,333,182.67	415,243.03
应交税费		0.35	1,210.92
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	169,506.52	164,511.60
负债合计		1,903,508.78	1,353,752.75
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	151,413,892.69	173,528,789.84
未分配利润	7.4.7.10	95,893,609.18	80,507,391.78
所有者权益合计		247,307,501.87	254,036,181.62
负债和所有者权益总计		249,211,010.65	255,389,934.37

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 151,413,892.69 份。其中 A 类基金份额净值 1.6377 元，基金份额 137,957,614.05 份；C 类基金份额净值 1.5889 元，基金份额 13,456,278.64 份。

7.2 利润表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		29,393,699.65	68,920,393.47
1.利息收入		157,218.21	155,987.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	155,971.02	123,105.68
债券利息收入		1,247.19	32,881.56
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）		42,506,607.09	57,015,483.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	38,086,243.01	51,745,656.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	943,901.55	109,840.94
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	450,565.82	2,359,218.43
股利收益	7.4.7.15	3,025,896.71	2,800,767.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-13,457,432.67	11,727,479.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	187,307.02	21,442.98
减：二、费用		11,502,472.32	6,543,783.48
1. 管理人报酬		3,493,097.23	2,733,043.37
2. 托管费		582,182.75	455,507.23
3. 销售服务费		241,735.25	376,290.11
4. 交易费用	7.4.7.18	6,993,859.54	2,786,431.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,685.68	8,493.44
7. 其他费用	7.4.7.19	189,911.87	184,017.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,891,227.33	62,376,609.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,891,227.33	62,376,609.99

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	17,891,227.33	17,891,227.33
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）	-22,114,897.15	-2,505,009.93	-24,619,907.08
其中：1.基金申购款	219,576,148.12	130,997,741.75	350,573,889.87
2.基金赎回款	-241,691,045.27	-133,502,751.68	-375,193,796.95
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）	151,413,892.69	95,893,609.18	247,307,501.87
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	62,376,609.99	62,376,609.99
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）	40,996,534.73	11,195,205.15	52,191,739.88
其中：1.基金申购款	154,804,802.13	38,781,684.38	193,586,486.51
2.基金赎回款	-113,808,267.40	-27,586,479.23	-141,394,746.63
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）	173,528,789.84	80,507,391.78	254,036,181.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：孙献，会计机构负责人：倡方方

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗

交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	14,002,379.60	16,637,329.69
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	14,002,379.60	16,637,329.69

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		223,683,910.01	227,748,048.18	4,064,138.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	913,777.99	970,092.90	56,314.91
	银行间市场	-	-	-
	合计	913,777.99	970,092.90	56,314.91
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		224,597,688.00	228,718,141.08	4,120,453.08
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		214,024,386.38	231,382,807.13	17,358,420.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	293,000.00	293,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	293,000.00	293,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		214,317,386.38	231,675,807.13	17,358,420.75

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,326,775.00	-	-	-
股指期货	6,326,775.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,326,775.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有股指期货合约。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IH2103	上证50股指期货 IH2103合约	6	6,546,240.00	219,465.00
总额合计				219,465.00
减：可抵销期货暂收款				219,465.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,550.39	2,933.58
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	3,056.23	2,174.00
应收债券利息	268.27	23.12
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	64.68	48.18

合计	4,939.57	5,178.88
----	----------	----------

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,333,182.67	415,243.03
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,333,182.67	415,243.03

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6.52	11.60
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	169,500.00	164,500.00
合计	169,506.52	164,511.60

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	144,614,046.25	144,614,046.25
本期申购	160,412,624.60	160,412,624.60
本期赎回（以“-”号填列）	-167,069,056.80	-167,069,056.80
本期末	137,957,614.05	137,957,614.05

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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	28,914,743.59	28,914,743.59
本期申购	59,163,523.52	59,163,523.52
本期赎回（以“-”号填列）	-74,621,988.47	-74,621,988.47
本期末	13,456,278.64	13,456,278.64

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

7.4.7.10 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	26,667,125.71	-10,699,061.07	15,968,064.64
本期基金份额交易产生的变动数	1,867,937.34	2,270,000.21	4,137,937.55
其中：基金申购款	96,474,809.85	1,229,853.42	97,704,663.27
基金赎回款	-94,606,872.51	1,040,146.79	-93,566,725.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,288,960.75	1,680,070.04	87,969,030.79

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	4,681,534.29	-2,758,371.60	1,923,162.69
本期基金份额交易产生的变动数	-7,588,692.35	945,744.87	-6,642,947.48
其中：基金申购款	30,370,768.02	2,922,310.46	33,293,078.48
基金赎回款	-37,959,460.37	-1,976,565.59	-39,936,025.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,767,628.80	156,949.59	7,924,578.39

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	67,083.07	58,354.16
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	87,024.93	63,365.20
其他	1,863.02	1,386.32
合计	155,971.02	123,105.68

7.4.7.12 股票投资收益

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	2,645,756,257.30	1,029,549,860.01
减：卖出股票成本总额	2,607,670,014.29	977,804,203.13

买卖股票差价收入	38,086,243.01	51,745,656.88
----------	---------------	---------------

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,219,680.66	4,039,456.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,272,998.01	3,839,420.00
减：应收利息总额	2,781.10	90,195.47
买卖债券差价收入	943,901.55	109,840.94

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	450,565.82	2,359,218.43

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,025,896.71	2,800,767.10
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,025,896.71	2,800,767.10

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-13,237,967.67	11,508,014.90
——股票投资	-13,294,282.58	11,510,114.90
——债券投资	56,314.91	-2,100.00
——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	219,465.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-219,465.00	219,465.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-13,457,432.67	11,727,479.90

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	182,262.43	16,095.33
基金转换费收入	5,044.59	5,347.65
合计	187,307.02	21,442.98

7.4.7.18 交易费用

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	6,993,859.54	2,786,431.76
银行间市场交易费用	-	-
合计	6,993,859.54	2,786,431.76

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	45,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	6,911.87	6,017.57

中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	189,911.87	184,017.57

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：1. 根据中国证券监督管理委员会《关于核准博时基金管理有限公司设立子公司的批复》（证监许可[2021]2709号），博时基金管理有限公司获准设立子公司博时财富基金销售有限公司，注册地为深圳市，注册资本为人民币5,000万元，业务范围为证券投资基金销售业务以及中国证监会许可的其他业务。博时财富基金销售有限公司于2021年9月7日获得深圳市市场监督管理局颁发的企业法人营业执照。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	750,062,962.21	14.33%	230,849,308.71	11.10%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	469,022.00	10.47%	158,229.80	16.65%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	548,529.54	14.33%	106.21	0.01%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	168,824.39	11.10%	57,254.81	13.79%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,493,097.23

其中: 支付销售机构的客户维护费	135,154.10	184,963.16
------------------	------------	------------

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:

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	582,182.75	455,507.23

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:

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	177,435.68	177,435.68
招商银行	-	2,522.41	2,522.41
招商证券	-	151.46	151.46
合计	-	180,109.55	180,109.55
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	182,783.24	182,783.24
招商银行	-	1,472.42	1,472.42
招商证券	-	151.89	151.89
合计	-	184,407.55	184,407.55

注: 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.80% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给博时基金, 再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明
7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

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

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	14,002,379.60	67,083.07	16,637,329.69	58,354.16

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券	601728	中国电信	网下发行	562,873.00	2,549,814.69
招商证券	688103	国力股份	网下发行	1,595.00	19,203.80
招商证券	688739	成大生物	网下发行	988.00	108,680.00
招商证券	001288	运机集团	网下发行	537.00	7,813.35
招商证券	301193	家联科技	网下发行	2,112.00	64,901.76
招商证券	688206	概伦电子	网下发行	3,240.00	91,627.20
招商证券	600941	中国移动	网下发行	124,803.00	7,186,156.74
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券
7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
600941	中国移动	2021-1-24	2022-07-05	首次公开发行限售	57.58	57.58	87,363.00	5,030,361.54	5,030,361.54	-
600941	中国移动	2021-1-24	2022-01-05	新股未上市	57.58	57.58	37,440.00	2,155,795.20	2,155,795.20	-
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	首次公开发行限售	4.53	4.27	394,011.00	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688779	长远锂科	2021-08-03	2022-02-11	首次公开发行限售	5.65	22.86	7,293.00	41,205.45	166,717.98	-
688707	振华新材	2021-09-06	2022-03-14	首次公开发行限售	11.75	47.16	3,333.00	39,162.75	157,184.28	-
688246	嘉和美康	2021-1-2-07	2022-06-14	首次公开发行限售	39.50	34.89	3,453.00	136,393.50	120,475.17	-
688103	国力股份	2021-09-02	2022-03-10	首次公开发行限售	12.04	66.10	1,595.00	19,203.80	105,429.50	-
688151	华强科技	2021-1-1-29	2022-06-06	首次公开发行限售	35.09	33.82	2,790.00	97,901.10	94,357.80	-
688262	国芯科技	2021-1-2-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	2,083.00	87,444.34	87,444.34	-
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	首次公开发行限售	28.09	54.52	869.00	24,410.21	47,377.88	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	首次公开发行限售	3.55	18.24	1,386.00	4,920.30	25,280.64	-

301155	海力风电	2021-1-17	2022-05-24	首次公开发行限售	60.66	96.75	258.00	15,650.28	24,961.50	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	首次公开发行限售	4.17	30.94	587.00	2,447.79	18,161.78	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	首次公开发行限售	14.14	89.87	189.00	2,672.46	16,985.43	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	首次公开发行限售	19.11	67.93	220.00	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	首次公开发行限售	12.20	22.72	654.00	7,978.80	14,858.88	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	首次公开发行限售	22.70	49.02	290.00	6,583.00	14,215.80	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	首次公开发行限售	8.34	48.99	290.00	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	首次公开发行限售	10.48	36.68	379.00	3,971.92	13,901.72	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	首次公开发行限售	10.07	16.76	760.00	7,653.20	12,737.60	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	首次公开发行限售	25.80	33.65	377.00	9,726.60	12,686.05	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	首次公开发行限售	11.90	45.45	268.00	3,189.20	12,180.60	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	首次公开发行限售	26.91	43.36	271.00	7,292.61	11,750.56	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	首次公开发行限售	116.88	116.08	99.00	11,571.12	11,491.92	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	首次公开发行	26.17	44.86	247.00	6,463.99	11,080.42	-

				限售						
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	首次公开发行限售	60.64	234.74	47.00	2,850.08	11,032.78	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	10.64	30.44	331.00	3,521.84	10,075.64	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	首次公开发行限售	86.06	94.50	102.00	8,778.12	9,639.00	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	首次公开发行限售	4.57	21.08	444.00	2,029.08	9,359.52	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	首次公开发行限售	27.81	31.14	292.00	8,120.52	9,092.88	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	首次公开发行限售	27.12	30.58	294.00	7,973.28	8,990.52	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	首次公开发行限售	3.31	17.01	523.00	1,731.13	8,896.23	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	首次公开发行限售	69.89	88.72	100.00	6,989.00	8,872.00	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	首次公开发行限售	39.08	52.13	168.00	6,565.44	8,757.84	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-02-28	首次公开发行限售	8.11	33.64	252.00	2,043.72	8,477.28	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	首次公开发行限售	18.03	62.73	132.00	2,379.96	8,280.36	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	首次公开发行限售	13.57	38.51	213.00	2,890.41	8,202.63	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	首次公开发行限售	5.24	22.84	344.00	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	首次公开发行限售	8.40	23.88	328.00	2,755.20	7,832.64	-
301133	金钟	2021-1	2022-	首次公	14.33	26.95	286.00	4,098.38	7,707.70	-

	股份	1-19	05-26	开发行 限售						
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	首次公开发行限售	6.10	31.52	242.00	1,476.20	7,627.84	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	首次公开发行限售	43.99	50.77	146.00	6,422.54	7,412.42	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	首次公开发行限售	4.13	12.96	566.00	2,337.58	7,335.36	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	首次公开发行限售	33.16	24.67	294.00	9,749.04	7,252.98	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	首次公开发行限售	27.85	27.46	260.00	7,241.00	7,139.60	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	首次公开发行限售	79.60	78.53	85.00	6,766.00	6,675.05	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	首次公开发行限售	15.14	59.97	106.00	1,604.84	6,356.82	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	首次公开发行限售	57.27	53.71	118.00	6,757.86	6,337.78	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	首次公开发行限售	30.73	29.14	212.00	6,514.76	6,177.68	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	首次公开发行限售	36.31	35.52	171.00	6,209.01	6,073.92	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	首次公开发行限售	4.97	12.51	485.00	2,410.45	6,067.35	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	首次公开发行限售	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	首次公开发行限售	7.46	33.41	181.00	1,350.26	6,047.21	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	首次公开发行限售	5.31	13.50	438.00	2,325.78	5,913.00	-

300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	首次公开发行限售	9.96	27.29	203.00	2,021.88	5,539.87	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333.00	5,504.49	5,504.49	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	首次公开发行限售	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	首次公开发行限售	8.03	19.02	218.00	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	首次公开发行限售	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	首次公开发行限售	11.92	24.82	140.00	1,668.80	3,474.80	-

7.4.12.1.2 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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	6,770.00	677,000.00	677,000.00	-

注：1、基金作为特定投资者认购的由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为特定投资者认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期；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。

3、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。

4、基金通过询价转让受让的科创板上市公司股东首次公开发行前已发行股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、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。

7.4.12.2 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
300261	雅本化学	2021-12-29	重大事项	19.16	2022-01-06	19.99	200.00	1,095.78	3,832.00	-

注：本基金截至本期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。

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

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

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	877,376.00	293,000.00
AAA 以下	92,716.90	-
未评级	-	-
合计	970,092.90	293,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	14,002,379.60	-	-	-	14,002,379.60
结算备付金	6,181,764.16	-	-	-	6,181,764.16
存出保证金	130,696.28	-	-	-	130,696.28
交易性金融资产	-	55,287.68	914,805.22	227,748,048.18	228,718,141.08
应收证券清算款	-	-	-	155,658.44	155,658.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,939.57	4,939.57
应收申购款	-	-	-	17,431.52	17,431.52
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,314,840.04	55,287.68	914,805.22	227,926,077.71	249,211,010.65
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,461.38	5,461.38
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	320,075.02	320,075.02

应付托管费	-	-	-	53,345.82	53,345.82
应付销售服务费	-	-	-	21,937.02	21,937.02
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
应付交易费用	-	-	-	1,333,182.67	1,333,182.67
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	169,506.52	169,506.52
负债总计	-	-	-	1,903,508.78	1,903,508.78
利率敏感度缺口	20,314,840.04	55,287.68	914,805.22	226,022,568.93	247,307,501.87
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。

7.4.13.4.1.2 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(不包括可转债与可交换债)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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	227,748,048.18	92.09	231,382,807.13	91.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	970,092.90	0.39	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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	228,718,141.08	92.48	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，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 943	增加约 1,109
业绩比较基准下降 5%	减少约 943	减少约 1,109	

7.4.14 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 217,894,972.04 元，属于第二层次的余额为 10,823,169.04 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证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1

日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	227,748,048.18	91.39
	其中：股票	227,748,048.18	91.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	970,092.90	0.39
	其中：债券	970,092.90	0.39
	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	20,184,143.76	8.10
8	其他各项资产	308,725.81	0.12
9	合计	249,211,010.65	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	887,270.56	0.36
B	采矿业	6,273,310.00	2.54
C	制造业	129,163,137.64	52.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,379,274.00	1.37
E	建筑业	9,798,213.80	3.96
F	批发和零售业	6,947,652.90	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	3,596,342.79	1.45

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,348,848.85	7.42
J	金融业	33,200,655.65	13.42
K	房地产业	5,972,958.00	2.42
L	租赁和商务服务业	3,764,200.00	1.52
M	科学研究和技术服务业	1,661,499.05	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	527,490.21	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	40,872.00	0.02
Q	卫生和社会工作	1,244,897.78	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,973,816.95	0.80
S	综合	967,608.00	0.39
	合计	227,748,048.18	92.09

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	2.91
2	600519	贵州茅台	2,500	5,125,000.00	2.07
3	601318	中国平安	87,500	4,410,875.00	1.78
4	601166	兴业银行	191,100	3,638,544.00	1.47
5	601328	交通银行	530,700	2,446,527.00	0.99
6	000333	美的集团	29,820	2,201,014.20	0.89
7	000725	京东方 A	424,300	2,142,715.00	0.87
8	601668	中国建筑	404,000	2,020,000.00	0.82
9	600887	伊利股份	42,000	1,741,320.00	0.70
10	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.68
11	601288	农业银行	558,800	1,642,872.00	0.66
12	000651	格力电器	41,700	1,544,151.00	0.62
13	601398	工商银行	330,549	1,530,441.87	0.62
14	601669	中国电建	178,100	1,439,048.00	0.58
15	600309	万华化学	14,200	1,434,200.00	0.58
16	000001	平安银行	87,000	1,433,760.00	0.58
17	601012	隆基股份	16,510	1,423,162.00	0.58
18	002415	海康威视	26,700	1,396,944.00	0.56
19	601600	中国铝业	226,600	1,379,994.00	0.56
20	601919	中远海控	73,080	1,365,865.20	0.55
21	600436	片仔癀	3,100	1,355,165.00	0.55
22	000100	TCL 科技	217,200	1,340,124.00	0.54
23	002142	宁波银行	34,740	1,329,847.20	0.54
24	600089	特变电工	60,800	1,287,136.00	0.52
25	300316	晶盛机电	18,000	1,251,000.00	0.51
26	601888	中国中免	5,700	1,250,637.00	0.51

27	600019	宝钢股份	173,931	1,245,345.96	0.50
28	600057	厦门象屿	141,400	1,200,486.00	0.49
29	000858	五粮液	5,300	1,180,098.00	0.48
30	603986	兆易创新	6,700	1,178,195.00	0.48
31	300059	东方财富	31,348	1,163,324.28	0.47
32	600522	中天科技	66,600	1,129,536.00	0.46
33	603259	药明康德	9,172	1,087,615.76	0.44
34	601988	中国银行	355,000	1,082,750.00	0.44
35	601939	建设银行	183,671	1,076,312.06	0.44
36	603517	绝味食品	15,600	1,065,948.00	0.43
37	600308	华泰股份	171,300	1,060,347.00	0.43
38	600030	中信证券	39,600	1,045,836.00	0.42
39	000568	泸州老窖	4,100	1,040,867.00	0.42
40	601577	长沙银行	132,100	1,031,701.00	0.42
41	600031	三一重工	44,200	1,007,760.00	0.41
42	600141	兴发集团	26,300	996,244.00	0.40
43	600546	山煤国际	121,200	995,052.00	0.40
44	603501	韦尔股份	3,200	994,464.00	0.40
45	000789	万年青	81,100	991,042.00	0.40
46	000898	鞍钢股份	262,800	985,500.00	0.40
47	000498	山东路桥	159,400	985,092.00	0.40
48	600449	宁夏建材	80,900	973,227.00	0.39
49	600039	四川路桥	80,300	966,812.00	0.39
50	601899	紫金矿业	98,200	952,540.00	0.39
51	603882	金域医学	8,500	946,645.00	0.38
52	000039	中集集团	55,100	945,516.00	0.38
53	600808	马钢股份	246,600	909,954.00	0.37
54	600581	八一钢铁	143,800	892,998.00	0.36
55	601898	中煤能源	140,900	886,261.00	0.36
56	300750	宁德时代	1,500	882,000.00	0.36
57	000932	华菱钢铁	171,700	877,387.00	0.35
58	000717	韶钢松山	184,500	876,375.00	0.35
59	601319	中国人保	186,200	875,140.00	0.35
60	688200	华峰测控	1,665	852,313.50	0.34
61	601117	中国化学	70,600	847,200.00	0.34
62	002199	东晶电子	101,200	829,840.00	0.34
63	688536	思瑞浦	1,076	826,368.00	0.33
64	000009	中国宝安	56,600	816,738.00	0.33
65	600884	杉杉股份	24,800	812,696.00	0.33
66	000666	经纬纺机	93,300	810,777.00	0.33
67	600507	方大特钢	103,100	804,180.00	0.33
68	600809	山西汾酒	2,540	802,081.20	0.32
69	603198	迎驾贡酒	11,500	798,675.00	0.32

70	600985	淮北矿业	71,400	798,252.00	0.32
71	000959	首钢股份	139,100	797,043.00	0.32
72	600096	云天化	40,500	794,610.00	0.32
73	600779	水井坊	6,615	793,733.85	0.32
74	600282	南钢股份	212,100	784,770.00	0.32
75	600997	开滦股份	109,700	781,064.00	0.32
76	300672	国科微	4,200	779,100.00	0.32
77	688508	芯朋微	6,717	778,231.62	0.31
78	002594	比亚迪	2,900	777,548.00	0.31
79	600276	恒瑞医药	15,244	773,023.24	0.31
80	300573	兴齐眼药	5,600	766,080.00	0.31
81	601838	成都银行	63,819	765,828.00	0.31
82	600765	中航重机	15,000	757,350.00	0.31
83	600028	中国石化	175,700	743,211.00	0.30
84	002475	立讯精密	15,100	742,920.00	0.30
85	000825	太钢不锈	104,200	733,568.00	0.30
86	002497	雅化集团	25,100	719,366.00	0.29
87	600585	海螺水泥	17,800	717,340.00	0.29
88	601158	重庆水务	110,900	710,869.00	0.29
89	688301	奕瑞科技	1,421	706,094.90	0.29
90	600136	当代文体	103,700	694,790.00	0.28
91	601818	光大银行	208,600	692,552.00	0.28
92	300833	浩洋股份	8,300	672,549.00	0.27
93	688595	芯海科技	5,230	650,873.50	0.26
94	600271	航天信息	48,000	642,720.00	0.26
95	000830	鲁西化工	41,900	639,394.00	0.26
96	601601	中国太保	23,500	637,320.00	0.26
97	603790	雅运股份	60,000	631,800.00	0.26
98	601390	中国中铁	107,300	621,267.00	0.25
99	000069	华侨城 A	86,800	611,072.00	0.25
100	603288	海天味业	5,800	609,638.00	0.25
101	000063	中兴通讯	18,160	608,360.00	0.25
102	603322	超讯通信	47,700	601,497.00	0.24
103	002807	江阴银行	156,000	600,600.00	0.24
104	002133	广宇集团	191,200	598,456.00	0.24
105	300122	智飞生物	4,800	598,080.00	0.24
106	600883	博闻科技	69,600	592,992.00	0.24
107	603880	南卫股份	80,900	579,244.00	0.23
108	002410	广联达	9,000	575,820.00	0.23
109	600697	欧亚集团	45,600	568,176.00	0.23
110	600287	江苏舜天	120,000	562,800.00	0.23
111	002244	滨江集团	119,500	556,870.00	0.23
112	603685	晨丰科技	44,100	552,132.00	0.22

113	600232	金鹰股份	101,700	550,197.00	0.22
114	600183	生益科技	23,200	546,360.00	0.22
115	000617	中油资本	104,900	543,382.00	0.22
116	000926	福星股份	127,800	543,150.00	0.22
117	600273	嘉化能源	46,900	542,633.00	0.22
118	000031	大悦城	144,500	538,985.00	0.22
119	000050	深天马 A	41,200	536,424.00	0.22
120	603679	华体科技	39,400	535,840.00	0.22
121	300637	扬帆新材	63,900	531,009.00	0.21
122	600027	华电国际	98,200	525,370.00	0.21
123	300553	集智股份	13,500	523,935.00	0.21
124	000627	天茂集团	158,100	523,311.00	0.21
125	002024	苏宁易购	126,700	522,004.00	0.21
126	603196	日播时尚	65,300	521,094.00	0.21
127	605399	晨光新材	13,100	520,201.00	0.21
128	000521	长虹美菱	141,600	519,672.00	0.21
129	600176	中国巨石	28,484	518,408.80	0.21
130	002092	中泰化学	54,300	518,022.00	0.21
131	000667	美好置业	297,300	517,302.00	0.21
132	600050	中国联通	131,600	517,188.00	0.21
133	603226	菲林格尔	69,876	516,383.64	0.21
134	002482	广田集团	212,100	515,403.00	0.21
135	601857	中国石油	104,700	514,077.00	0.21
136	600111	北方稀土	11,200	512,960.00	0.21
137	688298	东方生物	2,225	512,862.50	0.21
138	300749	顶固集创	52,800	511,632.00	0.21
139	000046	泛海控股	269,900	507,412.00	0.21
140	300521	爱司凯	35,900	505,831.00	0.20
141	000715	中兴商业	102,700	502,203.00	0.20
142	002839	张家港行	86,800	499,968.00	0.20
143	600104	上汽集团	24,200	499,246.00	0.20
144	000402	金融街	88,100	498,646.00	0.20
145	600647	同达创业	38,600	496,010.00	0.20
146	002958	青农商行	127,300	491,378.00	0.20
147	002861	瀛通通讯	38,530	489,331.00	0.20
148	603706	东方环宇	33,000	488,070.00	0.20
149	300014	亿纬锂能	4,100	484,538.00	0.20
150	300270	中威电子	75,700	483,723.00	0.20
151	600153	建发股份	52,600	477,082.00	0.19
152	300626	华瑞股份	46,900	472,752.00	0.19
153	002460	赣锋锂业	3,300	471,405.00	0.19
154	002948	青岛银行	101,800	471,334.00	0.19
155	601186	中国铁建	58,200	453,960.00	0.18

156	000415	渤海租赁	154,700	450,177.00	0.18
157	000157	中联重科	62,600	448,842.00	0.18
158	000965	天保基建	171,130	444,938.00	0.18
159	600894	广日股份	58,100	438,074.00	0.18
160	600097	开创国际	38,000	437,760.00	0.18
161	002601	龙佰集团	15,200	434,568.00	0.18
162	601009	南京银行	47,652	426,961.92	0.17
163	300450	先导智能	5,700	423,909.00	0.17
164	600919	江苏银行	72,700	423,841.00	0.17
165	600251	冠农股份	44,300	418,635.00	0.17
166	600148	长春一东	23,700	415,224.00	0.17
167	603933	睿能科技	26,900	408,342.00	0.17
168	002636	金安国纪	26,800	403,340.00	0.16
169	600893	航发动力	6,300	399,798.00	0.16
170	603115	海星股份	15,200	398,240.00	0.16
171	002709	天赐材料	3,470	397,835.50	0.16
172	603380	易德龙	10,300	394,490.00	0.16
173	000951	中国重汽	23,100	390,159.00	0.16
174	603696	安记食品	40,600	388,542.00	0.16
175	688111	金山办公	1,450	384,250.00	0.16
176	300625	三雄极光	25,100	381,269.00	0.15
177	600353	旭光电子	51,700	381,029.00	0.15
178	300760	迈瑞医疗	1,000	380,800.00	0.15
179	000701	厦门信达	69,700	377,077.00	0.15
180	002869	金溢科技	23,793	369,743.22	0.15
181	002049	紫光国微	1,600	360,000.00	0.15
182	600586	金晶科技	38,400	355,584.00	0.14
183	600613	神奇制药	55,100	353,742.00	0.14
184	002371	北方华创	1,000	347,020.00	0.14
185	002817	黄山胶囊	28,700	346,122.00	0.14
186	603920	世运电路	15,500	345,650.00	0.14
187	601077	渝农商行	89,500	344,575.00	0.14
188	601336	新华保险	8,700	338,256.00	0.14
189	002027	分众传媒	41,000	335,790.00	0.14
190	002241	歌尔股份	6,200	335,420.00	0.14
191	600742	一汽富维	27,900	333,684.00	0.13
192	002322	理工环科	27,745	332,662.55	0.13
193	000590	启迪药业	33,600	331,968.00	0.13
194	600573	惠泉啤酒	32,400	327,564.00	0.13
195	002812	恩捷股份	1,300	325,520.00	0.13
196	300274	阳光电源	2,200	320,760.00	0.13
197	601086	国芳集团	80,600	319,176.00	0.13
198	600132	重庆啤酒	2,100	317,772.00	0.13

199	002107	沃华医药	42,700	315,980.00	0.13
200	601138	工业富联	26,500	315,880.00	0.13
201	603117	万林物流	78,200	311,236.00	0.13
202	300583	赛托生物	12,600	310,968.00	0.13
203	600724	宁波富达	84,700	310,849.00	0.13
204	603168	莎普爱思	32,600	309,048.00	0.12
205	000528	柳工	40,000	308,400.00	0.12
206	603773	沃格光电	15,000	307,800.00	0.12
207	002495	佳隆股份	113,900	307,530.00	0.12
208	002304	洋河股份	1,857	305,903.61	0.12
209	600998	九州通	20,600	303,232.00	0.12
210	601618	中国中冶	78,600	301,038.00	0.12
211	002129	中环股份	7,200	300,600.00	0.12
212	600426	华鲁恒升	9,540	298,602.00	0.12
213	603156	养元饮品	10,500	298,305.00	0.12
214	600438	通威股份	6,600	296,736.00	0.12
215	002231	奥维通信	49,200	296,676.00	0.12
216	601225	陕西煤业	24,100	294,020.00	0.12
217	603839	安正时尚	33,600	292,656.00	0.12
218	002394	联发股份	35,500	291,455.00	0.12
219	600186	莲花健康	96,800	291,368.00	0.12
220	000020	深华发 A	31,800	291,288.00	0.12
221	600675	中华企业	96,600	290,766.00	0.12
222	002660	茂硕电源	36,000	289,800.00	0.12
223	688118	普元信息	11,849	289,352.58	0.12
224	600066	宇通客车	26,100	287,622.00	0.12
225	600720	祁连山	27,600	287,040.00	0.12
226	002315	焦点科技	16,900	286,962.00	0.12
227	000678	襄阳轴承	61,200	285,804.00	0.12
228	601019	山东出版	46,300	284,745.00	0.12
229	000900	现代投资	67,400	284,428.00	0.12
230	002014	永新股份	33,100	283,998.00	0.11
231	002887	绿茵生态	29,000	283,910.00	0.11
232	600582	天地科技	64,800	283,824.00	0.11
233	600269	赣粤高速	82,600	283,318.00	0.11
234	600846	同济科技	34,700	283,152.00	0.11
235	002381	双箭股份	34,800	281,184.00	0.11
236	600665	天地源	90,700	281,170.00	0.11
237	600987	航民股份	50,500	280,780.00	0.11
238	603323	苏农银行	57,600	280,512.00	0.11
239	002732	燕塘乳业	10,399	279,109.16	0.11
240	002106	莱宝高科	24,000	276,240.00	0.11
241	000425	徐工机械	46,000	275,540.00	0.11

242	601566	九牧王	22,200	274,392.00	0.11
243	300677	英科医疗	4,700	271,848.00	0.11
244	601985	中国核电	32,700	271,410.00	0.11
245	000800	一汽解放	26,300	270,627.00	0.11
246	300349	金卡智能	22,400	269,920.00	0.11
247	601678	滨化股份	33,700	268,589.00	0.11
248	002961	瑞达期货	10,900	268,576.00	0.11
249	601088	中国神华	11,900	267,988.00	0.11
250	603889	新澳股份	43,200	267,408.00	0.11
251	603225	新凤鸣	18,000	267,300.00	0.11
252	002714	牧原股份	5,000	266,800.00	0.11
253	000002	万科 A	13,500	266,760.00	0.11
254	600966	博汇纸业	25,700	265,738.00	0.11
255	300773	拉卡拉	9,100	264,082.00	0.11
256	002048	宁波华翔	12,200	263,886.00	0.11
257	000429	粤高速 A	35,500	262,700.00	0.11
258	603328	依顿电子	32,800	262,400.00	0.11
259	688399	硕世生物	1,900	261,250.00	0.11
260	601717	郑煤机	22,500	260,775.00	0.11
261	000633	合金投资	43,800	259,296.00	0.10
262	002382	蓝帆医疗	15,800	257,382.00	0.10
263	000997	新大陆	14,100	255,492.00	0.10
264	600123	兰花科创	27,200	254,864.00	0.10
265	600219	南山铝业	54,000	254,340.00	0.10
266	601766	中国中车	41,600	253,344.00	0.10
267	603444	吉比特	600	253,110.00	0.10
268	002449	国星光电	23,300	251,174.00	0.10
269	000933	神火股份	27,600	250,884.00	0.10
270	300130	新国都	16,960	248,972.80	0.10
271	600048	保利发展	15,700	245,391.00	0.10
272	603799	华友钴业	2,200	242,682.00	0.10
273	002388	新亚制程	42,000	236,460.00	0.10
274	600502	安徽建工	56,700	235,305.00	0.10
275	002352	顺丰控股	3,400	234,328.00	0.09
276	600745	闻泰科技	1,800	232,740.00	0.09
277	600741	华域汽车	8,200	232,060.00	0.09
278	600760	中航沈飞	3,400	231,336.00	0.09
279	601233	桐昆股份	10,800	228,744.00	0.09
280	688396	华润微	3,490	225,454.00	0.09
281	601001	晋控煤业	23,200	222,952.00	0.09
282	601699	潞安环能	19,300	218,283.00	0.09
283	300231	银信科技	24,300	217,728.00	0.09
284	002821	凯莱英	500	217,500.00	0.09

285	603368	柳药股份	11,400	217,056.00	0.09
286	000921	海信家电	14,300	216,645.00	0.09
287	600967	内蒙一机	18,000	215,100.00	0.09
288	002726	龙大美食	20,400	213,384.00	0.09
289	688058	宝兰德	2,620	212,508.20	0.09
290	002109	兴化股份	34,600	209,330.00	0.08
291	000625	长安汽车	13,700	208,103.00	0.08
292	603599	广信股份	5,300	206,700.00	0.08
293	601231	环旭电子	12,700	203,962.00	0.08
294	600690	海尔智家	6,700	200,263.00	0.08
295	603260	合盛硅业	1,500	197,955.00	0.08
296	000823	超声电子	14,500	197,490.00	0.08
297	300552	万集科技	4,900	197,421.00	0.08
298	000949	新乡化纤	35,000	196,350.00	0.08
299	603486	科沃斯	1,300	196,235.00	0.08
300	601006	大秦铁路	30,200	193,280.00	0.08
301	601900	南方传媒	22,400	191,744.00	0.08
302	600551	时代出版	23,700	188,889.00	0.08
303	300433	蓝思科技	8,100	186,138.00	0.08
304	000976	华铁股份	33,400	185,370.00	0.07
305	601607	上海医药	9,300	184,791.00	0.07
306	002884	凌霄泵业	6,600	184,602.00	0.07
307	600373	中文传媒	14,900	184,164.00	0.07
308	002648	卫星化学	4,600	184,138.00	0.07
309	002815	崇达技术	10,800	181,980.00	0.07
310	000636	风华高科	6,100	181,780.00	0.07
311	002296	辉煌科技	23,700	178,224.00	0.07
312	300837	浙矿股份	3,500	177,730.00	0.07
313	600335	国机汽车	20,400	177,072.00	0.07
314	600073	上海梅林	21,700	175,553.00	0.07
315	600348	华阳股份	14,500	171,825.00	0.07
316	605266	健之佳	2,200	168,454.00	0.07
317	601211	国泰君安	9,400	168,166.00	0.07
318	002555	三七互娱	6,200	167,524.00	0.07
319	688181	八亿时空	3,522	166,942.80	0.07
320	688779	长远锂科	7,293	166,717.98	0.07
321	002605	姚记科技	7,300	165,929.00	0.07
322	000893	亚钾国际	6,100	162,565.00	0.07
323	600835	上海机电	10,200	162,384.00	0.07
324	002758	浙农股份	13,100	162,309.00	0.07
325	603833	欧派家居	1,100	162,250.00	0.07
326	002757	南兴股份	10,600	161,650.00	0.07
327	300711	广哈通信	11,600	161,588.00	0.07

328	688707	振华新材	3,333	157,184.28	0.06
329	000338	潍柴动力	8,700	155,643.00	0.06
330	300512	中亚股份	9,700	154,812.00	0.06
331	002493	荣盛石化	8,500	154,360.00	0.06
332	300124	汇川技术	2,250	154,350.00	0.06
333	300127	银河磁体	6,100	154,025.00	0.06
334	601636	旗滨集团	9,000	153,900.00	0.06
335	601168	西部矿业	11,200	152,432.00	0.06
336	688598	金博股份	427	151,602.08	0.06
337	603956	威派格	8,500	151,300.00	0.06
338	603848	好太太	10,800	149,580.00	0.06
339	600603	广汇物流	37,600	149,272.00	0.06
340	300112	万讯自控	10,400	146,848.00	0.06
341	300628	亿联网络	1,800	146,610.00	0.06
342	002889	东方嘉盛	5,400	146,016.00	0.06
343	600918	中泰证券	14,600	145,562.00	0.06
344	000011	深物业 A	12,400	144,584.00	0.06
345	600011	华能国际	14,900	144,381.00	0.06
346	600874	创业环保	20,300	143,521.00	0.06
347	000906	浙商中拓	12,900	143,319.00	0.06
348	002952	亚世光电	10,800	143,316.00	0.06
349	003816	中国广核	45,600	142,728.00	0.06
350	000960	锡业股份	7,300	142,569.00	0.06
351	601816	京沪高铁	29,400	142,002.00	0.06
352	000895	双汇发展	4,500	141,975.00	0.06
353	600880	博瑞传播	18,900	141,939.00	0.06
354	300759	康龙化成	1,000	141,270.00	0.06
355	002254	泰和新材	7,200	141,192.00	0.06
356	300840	酷特智能	12,100	140,118.00	0.06
357	600763	通策医疗	700	139,300.00	0.06
358	001872	招商港口	8,200	138,990.00	0.06
359	600571	信雅达	11,300	138,312.00	0.06
360	002061	浙江交科	24,700	137,826.00	0.06
361	300015	爱尔眼科	3,200	135,296.00	0.05
362	600352	浙江龙盛	10,700	135,141.00	0.05
363	002008	大族激光	2,500	135,000.00	0.05
364	300408	三环集团	3,000	133,800.00	0.05
365	601015	陕西黑猫	20,600	133,488.00	0.05
366	601688	华泰证券	7,500	133,200.00	0.05
367	603327	福蓉科技	7,552	132,915.20	0.05
368	002469	三维化学	19,600	132,692.00	0.05
369	603659	璞泰来	820	131,700.20	0.05
370	300782	卓胜微	400	130,720.00	0.05

371	600332	白云山	3,800	129,960.00	0.05
372	688122	西部超导	1,340	129,899.60	0.05
373	002966	苏州银行	19,100	129,307.00	0.05
374	300751	迈为股份	200	128,460.00	0.05
375	300601	康泰生物	1,300	128,102.00	0.05
376	002968	新大正	3,600	127,548.00	0.05
377	600782	新钢股份	24,100	127,248.00	0.05
378	600926	杭州银行	9,900	126,918.00	0.05
379	300575	中旗股份	5,600	125,720.00	0.05
380	000550	江铃汽车	7,700	125,587.00	0.05
381	603369	今世缘	2,300	125,120.00	0.05
382	600460	士兰微	2,300	124,660.00	0.05
383	688009	中国通号	25,023	124,614.54	0.05
384	002367	康力电梯	15,400	123,662.00	0.05
385	688030	山石网科	4,144	122,911.04	0.05
386	002916	深南电路	1,000	121,820.00	0.05
387	600862	中航高科	3,400	121,584.00	0.05
388	000761	本钢板材	28,900	121,380.00	0.05
389	688246	嘉和美康	3,453	120,475.17	0.05
390	688005	容百科技	1,038	119,972.04	0.05
391	300559	佳发教育	13,200	119,592.00	0.05
392	601518	吉林高速	44,100	119,070.00	0.05
393	600566	济川药业	4,100	116,194.00	0.05
394	002527	新时达	13,800	115,368.00	0.05
395	603100	川仪股份	5,400	114,264.00	0.05
396	600900	长江电力	5,000	113,500.00	0.05
397	002064	华峰化学	10,800	112,752.00	0.05
398	002459	晶澳科技	1,200	111,240.00	0.04
399	603689	皖天然气	10,500	110,460.00	0.04
400	600933	爱柯迪	5,700	109,896.00	0.04
401	002412	汉森制药	17,300	109,855.00	0.04
402	300190	维尔利	18,000	109,800.00	0.04
403	000421	南京公用	22,100	109,174.00	0.04
404	300417	南华仪器	9,000	109,080.00	0.04
405	601882	海天精工	4,400	108,988.00	0.04
406	603297	永新光学	900	108,963.00	0.04
407	601666	平煤股份	12,900	107,973.00	0.04
408	300896	爱美客	200	107,222.00	0.04
409	600190	锦州港	37,500	106,875.00	0.04
410	601216	君正集团	20,400	106,692.00	0.04
411	603993	洛阳钼业	19,100	106,578.00	0.04
412	002380	科远智慧	7,300	106,507.00	0.04
413	002938	鹏鼎控股	2,500	106,075.00	0.04

414	600327	大东方	17,800	105,910.00	0.04
415	000166	申万宏源	20,600	105,472.00	0.04
416	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.04
417	600010	包钢股份	37,700	105,183.00	0.04
418	002043	兔宝宝	8,700	105,096.00	0.04
419	688566	吉贝尔	4,580	104,515.60	0.04
420	601865	福莱特	1,800	104,292.00	0.04
421	601658	邮储银行	20,400	104,040.00	0.04
422	603321	梅轮电梯	14,600	103,952.00	0.04
423	600510	黑牡丹	13,800	103,224.00	0.04
424	603707	健友股份	2,440	102,480.00	0.04
425	002949	华阳国际	5,600	102,480.00	0.04
426	300347	泰格医药	800	102,240.00	0.04
427	002539	云图控股	7,700	102,179.00	0.04
428	300033	同花顺	700	101,206.00	0.04
429	601568	北元集团	12,400	100,812.00	0.04
430	300821	东岳硅材	5,500	100,540.00	0.04
431	600606	绿地控股	23,100	100,254.00	0.04
432	000028	国药一致	2,700	99,846.00	0.04
433	603289	泰瑞机器	10,300	99,601.00	0.04
434	002736	国信证券	8,600	98,728.00	0.04
435	300769	德方纳米	200	98,232.00	0.04
436	300196	长海股份	5,600	98,168.00	0.04
437	300154	瑞凌股份	14,500	98,020.00	0.04
438	000596	古井贡酒	400	97,600.00	0.04
439	001979	招商蛇口	7,300	97,382.00	0.04
440	603456	九洲药业	1,700	95,642.00	0.04
441	002543	万和电气	12,500	94,625.00	0.04
442	688151	华强科技	2,790	94,357.80	0.04
443	603616	韩建河山	15,400	93,170.00	0.04
444	002233	塔牌集团	8,800	93,104.00	0.04
445	002978	安宁股份	2,200	93,016.00	0.04
446	003013	地铁设计	4,600	92,368.00	0.04
447	600079	人福医药	4,100	92,332.00	0.04
448	600853	龙建股份	33,300	92,241.00	0.04
449	300498	温氏股份	4,756	91,600.56	0.04
450	002738	中矿资源	1,300	91,468.00	0.04
451	603421	鼎信通讯	10,700	91,057.00	0.04
452	300037	新宙邦	800	90,400.00	0.04
453	002007	华兰生物	3,100	90,334.00	0.04
454	300515	三德科技	6,800	90,236.00	0.04
455	002116	中国海诚	12,600	89,964.00	0.04
456	603008	喜临门	2,300	89,769.00	0.04

457	603025	大豪科技	3,400	89,726.00	0.04
458	603803	瑞斯康达	11,200	88,704.00	0.04
459	603392	万泰生物	400	88,600.00	0.04
460	002545	东方铁塔	9,600	87,552.00	0.04
461	688398	赛特新材	1,723	87,528.40	0.04
462	688262	国芯科技	2,083	87,444.34	0.04
463	300595	欧普康视	1,500	86,055.00	0.03
464	300121	阳谷华泰	7,400	85,914.00	0.03
465	002820	桂发祥	8,400	85,680.00	0.03
466	300299	富春股份	12,900	85,269.00	0.03
467	600116	三峡水利	7,300	85,118.00	0.03
468	300596	利安隆	1,900	85,044.00	0.03
469	000798	中水渔业	11,000	84,920.00	0.03
470	603938	三孚股份	2,300	84,617.00	0.03
471	002066	瑞泰科技	7,600	84,208.00	0.03
472	600810	神马股份	6,700	83,415.00	0.03
473	601515	东风股份	10,200	82,926.00	0.03
474	000553	安道麦 A	9,800	82,712.00	0.03
475	002641	永高股份	15,000	82,200.00	0.03
476	601799	星宇股份	400	81,700.00	0.03
477	002062	宏润建设	20,100	81,606.00	0.03
478	002325	洪涛股份	28,500	81,510.00	0.03
479	000661	长春高新	300	81,420.00	0.03
480	002841	视源股份	1,000	81,400.00	0.03
481	002876	三利谱	1,300	81,224.00	0.03
482	002811	郑中设计	9,000	80,910.00	0.03
483	600548	深高速	8,100	80,838.00	0.03
484	600584	长电科技	2,600	80,652.00	0.03
485	600192	长城电工	13,800	80,592.00	0.03
486	300223	北京君正	600	80,400.00	0.03
487	603929	亚翔集成	6,600	80,256.00	0.03
488	688004	博汇科技	2,258	79,391.28	0.03
489	600549	厦门钨业	3,500	79,205.00	0.03
490	688418	震有科技	5,201	78,951.18	0.03
491	600803	新奥股份	4,300	78,948.00	0.03
492	002267	陕天然气	10,700	78,859.00	0.03
493	600299	安迪苏	6,400	78,848.00	0.03
494	600497	驰宏锌锗	15,800	78,842.00	0.03
495	603106	恒银科技	12,900	78,561.00	0.03
496	600711	盛屯矿业	7,300	78,329.00	0.03
497	601615	明阳智能	3,000	78,300.00	0.03
498	603528	多伦科技	11,200	78,288.00	0.03
499	603612	索通发展	3,800	77,976.00	0.03

500	002421	达实智能	20,200	77,972.00	0.03
501	002558	巨人网络	6,500	77,805.00	0.03
502	300641	正丹股份	11,100	77,700.00	0.03
503	688010	福光股份	2,760	77,694.00	0.03
504	300621	维业股份	8,500	77,605.00	0.03
505	688098	申联生物	7,027	77,578.08	0.03
506	600714	金瑞矿业	5,700	77,178.00	0.03
507	688099	晶晨股份	592	77,078.40	0.03
508	603768	常青股份	4,600	77,004.00	0.03
509	002955	鸿合科技	3,529	77,002.78	0.03
510	603053	成都燃气	7,400	76,886.00	0.03
511	300747	锐科激光	1,300	76,843.00	0.03
512	600018	上港集团	14,000	76,720.00	0.03
513	000541	佛山照明	13,500	76,275.00	0.03
514	300740	水羊股份	4,800	76,272.00	0.03
515	600971	恒源煤电	11,800	76,228.00	0.03
516	603217	元利科技	1,500	76,020.00	0.03
517	002989	中天精装	3,000	75,870.00	0.03
518	600545	卓郎智能	25,200	75,852.00	0.03
519	601886	江河集团	11,500	75,785.00	0.03
520	601969	海南矿业	6,300	75,663.00	0.03
521	600917	重庆燃气	9,000	75,510.00	0.03
522	603159	上海亚虹	4,800	75,216.00	0.03
523	603516	淳中科技	3,700	75,036.00	0.03
524	002925	盈趣科技	2,200	74,866.00	0.03
525	603711	香飘飘	4,500	73,800.00	0.03
526	601100	恒立液压	900	73,620.00	0.03
527	002517	恺英网络	12,600	73,332.00	0.03
528	002311	海大集团	1,000	73,300.00	0.03
529	002585	双星新材	2,700	73,116.00	0.03
530	002642	荣联科技	12,750	73,057.50	0.03
531	300548	博创科技	2,200	72,688.00	0.03
532	688369	致远互联	1,015	72,217.25	0.03
533	600406	国电南瑞	1,800	72,054.00	0.03
534	000156	华数传媒	8,500	71,910.00	0.03
535	600831	广电网络	11,600	71,804.00	0.03
536	300504	天邑股份	3,700	71,558.00	0.03
537	002202	金风科技	4,300	70,821.00	0.03
538	300465	高伟达	5,800	70,586.00	0.03
539	002179	中航光电	700	70,392.00	0.03
540	688579	山大地纬	5,408	70,304.00	0.03
541	300768	迪普科技	1,700	70,125.00	0.03
542	002222	福晶科技	3,700	70,041.00	0.03

543	002541	鸿路钢构	1,300	69,602.00	0.03
544	603999	读者传媒	12,700	69,596.00	0.03
545	300380	安硕信息	4,100	69,536.00	0.03
546	300529	健帆生物	1,300	69,290.00	0.03
547	601949	中国出版	11,800	68,912.00	0.03
548	002137	实益达	11,300	68,365.00	0.03
549	600728	佳都科技	8,200	68,306.00	0.03
550	603118	共进股份	7,100	67,876.00	0.03
551	002152	广电运通	5,700	67,830.00	0.03
552	300493	润欣科技	8,500	67,830.00	0.03
553	002161	远望谷	13,300	67,564.00	0.03
554	300142	沃森生物	1,200	67,440.00	0.03
555	300891	惠云钛业	4,200	67,242.00	0.03
556	601916	浙商银行	19,200	67,200.00	0.03
557	002065	东华软件	8,600	67,080.00	0.03
558	603186	华正新材	1,600	66,864.00	0.03
559	688313	仕佳光子	5,181	66,783.09	0.03
560	600623	华谊集团	7,300	66,430.00	0.03
561	601628	中国人寿	2,200	66,198.00	0.03
562	002396	星网锐捷	2,800	65,996.00	0.03
563	600819	耀皮玻璃	11,800	65,844.00	0.03
564	688258	卓易信息	1,866	65,832.48	0.03
565	002281	光迅科技	2,800	65,212.00	0.03
566	300721	怡达股份	1,300	65,130.00	0.03
567	002082	万邦德	4,400	65,076.00	0.03
568	002401	中远海科	6,400	64,768.00	0.03
569	600939	重庆建工	15,800	64,622.00	0.03
570	300042	朗科科技	4,200	64,596.00	0.03
571	601878	浙商证券	4,900	64,582.00	0.03
572	603232	格尔软件	4,000	64,400.00	0.03
573	603003	龙宇燃油	9,000	64,260.00	0.03
574	600756	浪潮软件	4,900	64,239.00	0.03
575	600231	凌钢股份	24,100	64,106.00	0.03
576	688055	龙腾光电	9,322	63,855.70	0.03
577	603602	纵横通信	6,200	63,736.00	0.03
578	603496	恒为科技	4,100	63,550.00	0.03
579	601933	永辉超市	15,500	62,775.00	0.03
580	300592	华凯创意	3,300	61,776.00	0.02
581	000776	广发证券	2,500	61,475.00	0.02
582	603383	顶点软件	1,700	61,030.00	0.02
583	000851	高鸿股份	10,200	60,996.00	0.02
584	688168	安博通	981	60,890.67	0.02
585	300667	必创科技	2,600	59,358.00	0.02

586	600795	国电电力	18,700	59,279.00	0.02
587	300852	四会富仕	1,000	58,420.00	0.02
588	688356	键凯科技	172	57,986.36	0.02
589	600707	彩虹股份	8,500	57,970.00	0.02
590	600029	南方航空	8,500	57,885.00	0.02
591	600389	江山股份	1,400	57,568.00	0.02
592	600596	新安股份	2,300	57,477.00	0.02
593	000977	浪潮信息	1,600	57,328.00	0.02
594	300550	和仁科技	4,420	56,797.00	0.02
595	002286	保龄宝	4,200	56,784.00	0.02
596	002573	清新环境	7,600	55,328.00	0.02
597	601881	中国银河	4,900	54,831.00	0.02
598	600958	东方证券	3,600	53,064.00	0.02
599	601236	红塔证券	4,450	53,044.00	0.02
600	300772	运达股份	1,200	52,776.00	0.02
601	600578	京能电力	15,700	52,752.00	0.02
602	601808	中海油服	3,500	52,500.00	0.02
603	000708	中信特钢	2,540	52,019.20	0.02
604	000731	四川美丰	5,000	51,900.00	0.02
605	002932	明德生物	700	51,800.00	0.02
606	600362	江西铜业	2,300	51,359.00	0.02
607	000703	恒逸石化	4,800	50,976.00	0.02
608	603043	广州酒家	2,100	50,526.00	0.02
609	600570	恒生电子	800	49,720.00	0.02
610	002327	富安娜	5,800	49,532.00	0.02
611	300593	新雷能	900	48,942.00	0.02
612	300613	富瀚微	300	48,915.00	0.02
613	600180	瑞茂通	6,800	48,552.00	0.02
614	002623	亚玛顿	1,400	47,824.00	0.02
615	002183	怡亚通	7,200	47,664.00	0.02
616	601377	兴业证券	4,800	47,424.00	0.02
617	688511	天微电子	869	47,377.88	0.02
618	601066	中信建投	1,600	46,800.00	0.02
619	300171	东富龙	900	45,486.00	0.02
620	000659	珠海中富	11,000	45,430.00	0.02
621	000822	山东海化	6,500	45,175.00	0.02
622	688017	绿的谐波	254	44,338.24	0.02
623	600196	复星医药	900	44,046.00	0.02
624	600170	上海建工	12,100	43,560.00	0.02
625	600989	宝丰能源	2,500	43,400.00	0.02
626	002253	川大智胜	2,400	42,816.00	0.02
627	002466	天齐锂业	400	42,800.00	0.02
628	603589	口子窖	600	42,522.00	0.02

629	601689	拓普集团	800	42,400.00	0.02
630	600703	三安光电	1,100	41,316.00	0.02
631	002607	中公教育	5,200	40,872.00	0.02
632	002745	木林森	2,700	40,851.00	0.02
633	000657	中钨高新	2,500	40,200.00	0.02
634	600588	用友网络	1,100	39,468.00	0.02
635	688578	艾力斯	1,300	39,260.00	0.02
636	688521	芯原股份	500	38,680.00	0.02
637	000877	天山股份	2,500	38,275.00	0.02
638	002039	黔源电力	1,800	37,944.00	0.02
639	002533	金杯电工	4,200	36,162.00	0.01
640	300623	捷捷微电	1,100	34,606.00	0.01
641	600295	鄂尔多斯	1,400	33,026.00	0.01
642	600009	上海机场	700	32,683.00	0.01
643	600676	交运股份	7,300	31,536.00	0.01
644	688036	传音控股	200	31,380.00	0.01
645	600346	恒力石化	1,300	29,861.00	0.01
646	000938	紫光股份	1,300	29,705.00	0.01
647	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
648	600256	广汇能源	4,500	29,430.00	0.01
649	603566	普莱柯	1,300	28,730.00	0.01
650	002120	韵达股份	1,400	28,644.00	0.01
651	002111	威海广泰	2,300	28,152.00	0.01
652	603087	甘李药业	400	28,136.00	0.01
653	000514	渝开发	7,100	28,116.00	0.01
654	600829	人民同泰	4,100	27,552.00	0.01
655	601901	方正证券	3,500	27,440.00	0.01
656	603022	新通联	2,200	27,280.00	0.01
657	002271	东方雨虹	500	26,340.00	0.01
658	002230	科大讯飞	500	26,255.00	0.01
659	601108	财通证券	2,300	25,576.00	0.01
660	601788	光大证券	1,700	25,381.00	0.01
661	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
662	600824	益民集团	6,500	25,090.00	0.01
663	301155	海力风电	258	24,961.50	0.01
664	600109	国金证券	2,200	24,926.00	0.01
665	000783	长江证券	3,300	24,882.00	0.01
666	688016	心脉医疗	100	24,874.00	0.01
667	000733	振华科技	200	24,856.00	0.01
668	000963	华东医药	600	24,120.00	0.01
669	688599	天合光能	300	23,670.00	0.01
670	000510	新金路	4,000	23,640.00	0.01
671	603357	设计总院	2,500	23,050.00	0.01

672	300413	芒果超媒	400	22,888.00	0.01
673	603506	南都物业	1,300	21,892.00	0.01
674	603199	九华旅游	1,000	21,720.00	0.01
675	601877	正泰电器	400	21,556.00	0.01
676	601555	东吴证券	2,400	21,264.00	0.01
677	600547	山东黄金	1,100	20,702.00	0.01
678	688012	中微公司	163	20,635.80	0.01
679	000683	远兴能源	2,800	20,440.00	0.01
680	603236	移远通信	100	20,390.00	0.01
681	600409	三友化工	2,300	20,010.00	0.01
682	688335	复洁环保	600	19,860.00	0.01
683	600167	联美控股	2,200	19,822.00	0.01
684	603026	石大胜华	100	19,799.00	0.01
685	300395	菲利华	300	19,722.00	0.01
686	601995	中金公司	400	19,612.00	0.01
687	600655	豫园股份	1,900	19,570.00	0.01
688	002556	辉隆股份	1,500	19,305.00	0.01
689	300639	凯普生物	654	19,299.54	0.01
690	688018	乐鑫科技	100	19,004.00	0.01
691	000062	深圳华强	1,100	18,953.00	0.01
692	600814	杭州解百	2,900	18,937.00	0.01
693	601188	龙江交通	5,400	18,900.00	0.01
694	002145	中核钛白	1,500	18,885.00	0.01
695	600660	福耀玻璃	400	18,856.00	0.01
696	601990	南京证券	1,900	18,829.00	0.01
697	688981	中芯国际	355	18,811.45	0.01
698	600061	国投资本	2,256	18,544.32	0.01
699	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
700	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
701	603797	联泰环保	2,600	18,148.00	0.01
702	600157	永泰能源	9,800	17,836.00	0.01
703	605111	新洁能	100	17,810.00	0.01
704	002671	龙泉股份	3,700	17,575.00	0.01
705	601696	中银证券	1,300	17,485.00	0.01
706	301029	怡合达	189	16,985.43	0.01
707	300416	苏试试验	500	16,975.00	0.01
708	300398	飞凯材料	700	16,912.00	0.01
709	688037	芯源微	100	16,880.00	0.01
710	688008	澜起科技	200	16,774.00	0.01
711	002472	双环传动	600	16,548.00	0.01
712	603658	安图生物	300	16,518.00	0.01
713	002906	华阳集团	300	16,488.00	0.01
714	300102	乾照光电	1,800	16,182.00	0.01

715	300012	华测检测	600	16,122.00	0.01
716	000672	上峰水泥	800	16,056.00	0.01
717	002850	科达利	100	16,034.00	0.01
718	601958	金钼股份	2,300	15,755.00	0.01
719	002743	富煌钢构	2,200	15,752.00	0.01
720	300650	太龙股份	500	15,615.00	0.01
721	002677	浙江美大	900	15,615.00	0.01
722	300680	隆盛科技	500	15,600.00	0.01
723	300696	爱乐达	300	15,582.00	0.01
724	300861	美畅股份	200	15,554.00	0.01
725	002963	豪尔赛	900	15,516.00	0.01
726	600284	浦东建设	2,400	15,168.00	0.01
727	600717	天津港	3,600	15,084.00	0.01
728	300305	裕兴股份	800	15,008.00	0.01
729	002430	杭氧股份	500	15,005.00	0.01
730	601162	天风证券	3,700	14,985.00	0.01
731	002690	美亚光电	400	14,984.00	0.01
732	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
733	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.01
734	002128	电投能源	1,000	14,850.00	0.01
735	002434	万里扬	1,000	14,740.00	0.01
736	000768	中航西飞	400	14,600.00	0.01
737	601633	长城汽车	300	14,562.00	0.01
738	002877	智能自控	2,100	14,532.00	0.01
739	688368	晶丰明源	45	14,404.50	0.01
740	603937	丽岛新材	1,300	14,391.00	0.01
741	301118	恒光股份	290	14,215.80	0.01
742	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
743	600188	兖矿能源	600	14,118.00	0.01
744	300705	九典制药	400	14,056.00	0.01
745	002132	恒星科技	2,300	14,053.00	0.01
746	600639	浦东金桥	1,100	14,047.00	0.01
747	600733	北汽蓝谷	1,400	14,028.00	0.01
748	002593	日上集团	3,400	13,906.00	0.01
749	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
750	601018	宁波港	3,500	13,895.00	0.01
751	002150	通润装备	2,200	13,860.00	0.01
752	002091	江苏国泰	1,000	13,730.00	0.01
753	300327	中颖电子	200	13,580.00	0.01
754	603713	密尔克卫	100	13,478.00	0.01
755	300470	中密控股	300	13,401.00	0.01
756	300088	长信科技	1,000	13,280.00	0.01
757	002441	众业达	1,300	13,260.00	0.01

758	002521	齐峰新材	2,100	13,146.00	0.01
759	600486	扬农化工	100	13,120.00	0.01
760	000887	中鼎股份	600	13,086.00	0.01
761	600201	生物股份	800	13,080.00	0.01
762	603806	福斯特	100	13,055.00	0.01
763	300909	汇创达	300	12,915.00	0.01
764	002293	罗莱生活	900	12,897.00	0.01
765	002833	弘亚数控	400	12,872.00	0.01
766	600380	健康元	1,000	12,840.00	0.01
767	002266	浙富控股	1,800	12,816.00	0.01
768	000913	钱江摩托	900	12,771.00	0.01
769	301149	隆华新材	760	12,737.60	0.01
770	301211	亨迪药业	377	12,686.05	0.01
771	002050	三花智控	500	12,650.00	0.01
772	002301	齐心集团	1,500	12,555.00	0.01
773	600023	浙能电力	3,100	12,524.00	0.01
774	002001	新和成	400	12,448.00	0.01
775	300662	科锐国际	200	12,442.00	0.01
776	600618	氯碱化工	1,000	12,410.00	0.01
777	300994	久祺股份	268	12,180.60	0.00
778	000650	仁和药业	1,300	12,116.00	0.00
779	600062	华润双鹤	900	12,033.00	0.00
780	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
781	002105	信隆健康	1,200	11,988.00	0.00
782	300166	东方国信	1,100	11,880.00	0.00
783	603738	泰晶科技	200	11,860.00	0.00
784	002845	同兴达	400	11,820.00	0.00
785	600360	华微电子	1,300	11,804.00	0.00
786	301101	明月镜片	271	11,750.56	0.00
787	002236	大华股份	500	11,740.00	0.00
788	002276	万马股份	1,300	11,713.00	0.00
789	000049	德赛电池	200	11,664.00	0.00
790	688065	凯赛生物	63	11,609.64	0.00
791	002727	一心堂	300	11,553.00	0.00
792	002003	伟星股份	900	11,538.00	0.00
793	600248	陕西建工	2,400	11,520.00	0.00
794	300294	博雅生物	300	11,505.00	0.00
795	301177	迪阿股份	99	11,491.92	0.00
796	002223	鱼跃医疗	300	11,340.00	0.00
797	002687	乔治白	1,600	11,312.00	0.00
798	603739	蔚蓝生物	600	11,160.00	0.00
799	301138	华研精机	247	11,080.42	0.00
800	301050	雷电微力	47	11,032.78	0.00

801	002282	博深股份	1,200	11,028.00	0.00
802	600736	苏州高新	2,400	11,016.00	0.00
803	688166	博瑞医药	300	11,013.00	0.00
804	601989	中国重工	2,600	10,972.00	0.00
805	002602	世纪华通	1,300	10,907.00	0.00
806	002384	东山精密	400	10,840.00	0.00
807	000573	粤宏远 A	3,400	10,812.00	0.00
808	603160	汇顶科技	100	10,777.00	0.00
809	000786	北新建材	300	10,749.00	0.00
810	688518	联赢激光	217	10,691.59	0.00
811	000637	茂化实华	2,200	10,626.00	0.00
812	601928	凤凰传媒	1,300	10,517.00	0.00
813	000538	云南白药	100	10,465.00	0.00
814	688389	普门科技	450	10,350.00	0.00
815	688050	爱博医疗	49	10,301.27	0.00
816	002597	金禾实业	200	10,270.00	0.00
817	688312	燕麦科技	379	10,233.00	0.00
818	688357	建龙微纳	53	10,172.82	0.00
819	603838	四通股份	1,300	10,153.00	0.00
820	603677	奇精机械	800	10,128.00	0.00
821	000554	泰山石油	1,900	10,127.00	0.00
822	603855	华荣股份	400	10,112.00	0.00
823	300019	硅宝科技	500	10,080.00	0.00
824	301020	密封科技	331	10,075.64	0.00
825	603305	旭升股份	200	9,976.00	0.00
826	600150	中国船舶	400	9,916.00	0.00
827	600600	青岛啤酒	100	9,900.00	0.00
828	002808	恒久科技	1,200	9,828.00	0.00
829	300775	三角防务	200	9,778.00	0.00
830	002654	万润科技	2,300	9,752.00	0.00
831	301166	优宁维	102	9,639.00	0.00
832	002615	哈尔斯	1,700	9,486.00	0.00
833	300438	鹏辉能源	200	9,448.00	0.00
834	300260	新莱应材	200	9,434.00	0.00
835	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
836	002729	好利科技	200	9,328.00	0.00
837	603730	岱美股份	400	9,328.00	0.00
838	600592	龙溪股份	900	9,315.00	0.00
839	601965	中国汽研	500	9,305.00	0.00
840	300069	金利华电	400	9,224.00	0.00
841	300022	吉峰科技	1,800	9,198.00	0.00
842	600886	国投电力	800	9,176.00	0.00
843	301100	风光股份	292	9,092.88	0.00

844	688139	海尔生物	100	9,082.00	0.00
845	600543	莫高股份	1,300	9,061.00	0.00
846	300003	乐普医疗	400	9,052.00	0.00
847	600085	同仁堂	200	8,996.00	0.00
848	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
849	600577	精达股份	1,200	8,928.00	0.00
850	601360	三六零	700	8,904.00	0.00
851	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
852	300445	康斯特	600	8,886.00	0.00
853	301221	光庭信息	100	8,872.00	0.00
854	300676	华大基因	100	8,780.00	0.00
855	601866	中远海发	2,700	8,775.00	0.00
856	301168	通灵股份	168	8,757.84	0.00
857	603239	浙江仙通	500	8,750.00	0.00
858	601155	新城控股	300	8,739.00	0.00
859	603298	杭叉集团	500	8,575.00	0.00
860	688388	嘉元科技	68	8,537.40	0.00
861	601298	青岛港	1,500	8,535.00	0.00
862	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
863	300207	欣旺达	200	8,432.00	0.00
864	600475	华光环能	700	8,288.00	0.00
865	301026	浩通科技	132	8,280.36	0.00
866	603019	中科曙光	300	8,271.00	0.00
867	002665	首航高科	1,600	8,240.00	0.00
868	301040	中环海陆	213	8,202.63	0.00
869	300911	亿田智能	100	8,192.00	0.00
870	002624	完美世界	400	8,124.00	0.00
871	300519	新光药业	400	8,076.00	0.00
872	603901	永创智能	500	8,050.00	0.00
873	603338	浙江鼎力	100	8,026.00	0.00
874	002977	火箭科技	100	8,006.00	0.00
875	300558	贝达药业	100	7,983.00	0.00
876	603859	能科科技	200	7,938.00	0.00
877	688300	联瑞新材	71	7,871.77	0.00
878	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
879	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
880	002698	博实股份	600	7,824.00	0.00
881	603915	国茂股份	200	7,780.00	0.00
882	000301	东方盛虹	400	7,736.00	0.00
883	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
884	603286	日盈电子	400	7,664.00	0.00
885	002386	天原股份	600	7,638.00	0.00
886	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00

887	601598	中国外运	1,700	7,616.00	0.00
888	000876	新希望	500	7,605.00	0.00
889	601238	广汽集团	500	7,595.00	0.00
890	600872	中炬高新	200	7,594.00	0.00
891	603678	火炬电子	100	7,565.00	0.00
892	603666	亿嘉和	100	7,512.00	0.00
893	600885	宏发股份	100	7,464.00	0.00
894	688567	孚能科技	221	7,436.65	0.00
895	000818	航锦科技	200	7,422.00	0.00
896	301179	泽宇智能	146	7,412.42	0.00
897	603277	银都股份	400	7,400.00	0.00
898	603203	快克股份	200	7,374.00	0.00
899	301048	金鹰重工	566	7,335.36	0.00
900	601966	玲珑轮胎	200	7,310.00	0.00
901	601111	中国国航	800	7,304.00	0.00
902	002414	高德红外	300	7,263.00	0.00
903	301088	戎美股份	294	7,252.98	0.00
904	603311	金海高科	500	7,150.00	0.00
905	301190	善水科技	260	7,139.60	0.00
906	000066	中国长城	500	7,080.00	0.00
907	603886	元祖股份	300	7,065.00	0.00
908	601872	招商轮船	1,700	6,970.00	0.00
909	600560	金白天正	700	6,902.00	0.00
910	688177	百奥泰	262	6,767.46	0.00
911	000902	新洋丰	400	6,756.00	0.00
912	600115	中国东航	1,300	6,708.00	0.00
913	301096	百诚医药	85	6,675.05	0.00
914	000983	山西焦煤	800	6,616.00	0.00
915	600489	中金黄金	800	6,584.00	0.00
916	603926	铁流股份	400	6,516.00	0.00
917	600026	中远海能	1,100	6,512.00	0.00
918	600383	金地集团	500	6,485.00	0.00
919	603077	和邦生物	1,900	6,479.00	0.00
920	603899	晨光文具	100	6,451.00	0.00
921	301033	迈普医学	106	6,356.82	0.00
922	301108	洁雅股份	118	6,337.78	0.00
923	300999	金龙鱼	100	6,293.00	0.00
924	300890	翔丰华	100	6,183.00	0.00
925	301193	家联科技	212	6,177.68	0.00
926	002438	江苏神通	300	6,153.00	0.00
927	688516	奥特维	25	6,143.00	0.00
928	002252	上海莱士	900	6,138.00	0.00
929	600845	宝信软件	100	6,083.00	0.00

930	301092	争光股份	171	6,073.92	0.00
931	301032	新柴股份	485	6,067.35	0.00
932	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
933	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
934	300215	电科院	600	6,018.00	0.00
935	002568	百润股份	100	5,983.00	0.00
936	301028	东亚机械	438	5,913.00	0.00
937	002600	领益智造	800	5,888.00	0.00
938	002240	盛新锂能	100	5,795.00	0.00
939	600161	天坛生物	200	5,792.00	0.00
940	300144	宋城演艺	400	5,728.00	0.00
941	601021	春秋航空	100	5,680.00	0.00
942	688116	天奈科技	38	5,673.02	0.00
943	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
944	603939	益丰药房	100	5,511.00	0.00
945	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
946	002044	美年健康	700	5,495.00	0.00
947	600277	亿利洁能	1,030	5,428.10	0.00
948	300407	凯发电气	600	5,394.00	0.00
949	002250	联化科技	300	5,391.00	0.00
950	002867	周大生	300	5,334.00	0.00
951	002074	国轩高科	100	5,125.00	0.00
952	000598	兴蓉环境	800	5,056.00	0.00
953	600143	金发科技	400	5,032.00	0.00
954	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
955	002895	川恒股份	200	4,938.00	0.00
956	600259	广晟有色	100	4,924.00	0.00
957	600328	中盐化工	300	4,923.00	0.00
958	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
959	601228	广州港	1,400	4,662.00	0.00
960	603279	景津环保	100	4,638.00	0.00
961	002407	多氟多	100	4,499.00	0.00
962	300748	金力永磁	100	4,489.00	0.00
963	600848	上海临港	300	4,461.00	0.00
964	603233	大参林	100	4,211.00	0.00
965	600151	航天机电	300	4,155.00	0.00
966	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
967	600075	新疆天业	500	4,110.00	0.00
968	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
969	600452	涪陵电力	200	4,028.00	0.00
970	600392	盛和资源	200	3,924.00	0.00
971	000831	五矿稀土	100	3,902.00	0.00
972	002157	正邦科技	400	3,864.00	0.00

973	000937	冀中能源	700	3,857.00	0.00
974	601000	唐山港	1,400	3,850.00	0.00
975	300261	雅本化学	200	3,832.00	0.00
976	002274	华昌化工	300	3,801.00	0.00
977	002056	横店东磁	200	3,774.00	0.00
978	603876	鼎胜新材	100	3,765.00	0.00
979	600063	皖维高新	600	3,678.00	0.00
980	002453	华软科技	200	3,628.00	0.00
981	002004	华邦健康	500	3,620.00	0.00
982	601326	秦港股份	1,300	3,614.00	0.00
983	002907	华森制药	200	3,610.00	0.00
984	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
985	002258	利尔化学	100	3,373.00	0.00
986	600135	乐凯胶片	400	3,336.00	0.00
987	600025	华能水电	500	3,295.00	0.00
988	000582	北部湾港	400	3,216.00	0.00
989	688159	有方科技	100	3,160.00	0.00
990	603212	赛伍技术	100	3,113.00	0.00
991	300082	奥克股份	200	3,090.00	0.00
992	002538	司尔特	300	3,087.00	0.00
993	688089	嘉必优	49	3,010.56	0.00
994	002320	海峡股份	500	3,000.00	0.00
995	688233	神工股份	34	2,998.80	0.00
996	300080	易成新能	500	2,910.00	0.00
997	688026	洁特生物	33	2,909.28	0.00
998	603663	三祥新材	100	2,775.00	0.00
999	002571	德力股份	400	2,772.00	0.00
1,000	002455	百川股份	200	2,650.00	0.00
1,001	688158	优刻得	99	2,625.48	0.00
1,002	600691	阳煤化工	500	2,560.00	0.00
1,003	600428	中远海特	500	2,520.00	0.00
1,004	603639	海利尔	100	2,511.00	0.00
1,005	002610	爱康科技	500	2,350.00	0.00
1,006	688060	云涌科技	32	2,344.00	0.00
1,007	000998	隆平高科	100	2,326.00	0.00
1,008	000919	金陵药业	300	2,295.00	0.00
1,009	002125	湘潭电化	200	2,280.00	0.00
1,010	601918	新集能源	500	2,270.00	0.00
1,011	601975	招商南油	1,100	2,211.00	0.00
1,012	600395	盘江股份	300	2,181.00	0.00
1,013	600527	江南高纤	900	2,160.00	0.00
1,014	603979	金诚信	100	2,148.00	0.00
1,015	000012	南玻 A	200	1,986.00	0.00

1,016	600017	日照港	700	1,967.00	0.00
1,017	002348	高乐股份	900	1,962.00	0.00
1,018	300340	科恒股份	100	1,941.00	0.00
1,019	300110	华仁药业	400	1,920.00	0.00
1,020	002215	诺普信	300	1,914.00	0.00
1,021	603299	苏盐井神	200	1,912.00	0.00
1,022	002506	协鑫集成	500	1,900.00	0.00
1,023	600367	红星发展	100	1,858.00	0.00
1,024	000548	湖南投资	459	1,840.59	0.00
1,025	601908	京运通	200	1,834.00	0.00
1,026	002588	史丹利	300	1,785.00	0.00
1,027	002549	凯美特气	100	1,706.00	0.00
1,028	600575	淮河能源	700	1,680.00	0.00
1,029	603105	芯能科技	100	1,662.00	0.00
1,030	002136	安纳达	100	1,626.00	0.00
1,031	600330	天通股份	100	1,623.00	0.00
1,032	002391	长青股份	200	1,616.00	0.00
1,033	600770	综艺股份	200	1,598.00	0.00
1,034	688505	复旦张江	108	1,522.80	0.00
1,035	002617	露笑科技	100	1,520.00	0.00
1,036	600227	圣济堂	400	1,516.00	0.00
1,037	601698	中国卫通	100	1,439.00	0.00
1,038	600537	亿晶光电	300	1,419.00	0.00
1,039	600746	江苏索普	100	1,380.00	0.00
1,040	000552	靖远煤电	400	1,380.00	0.00
1,041	600722	金牛化工	200	1,378.00	0.00
1,042	600207	安彩高科	200	1,356.00	0.00
1,043	002170	芭田股份	200	1,342.00	0.00
1,044	300387	富邦股份	200	1,340.00	0.00
1,045	603628	清源股份	100	1,337.00	0.00
1,046	002734	利民股份	100	1,310.00	0.00
1,047	603360	百傲化学	100	1,304.00	0.00
1,048	000507	珠海港	200	1,292.00	0.00
1,049	002165	红宝丽	200	1,258.00	0.00
1,050	600798	宁波海运	300	1,257.00	0.00
1,051	603086	先达股份	100	1,239.00	0.00
1,052	600279	重庆港	300	1,221.00	0.00
1,053	601222	林洋能源	100	1,213.00	0.00
1,054	600538	国发股份	200	1,208.00	0.00
1,055	000545	金浦钛业	300	1,200.00	0.00
1,056	000635	英力特	100	1,181.00	0.00
1,057	688222	成都先导	50	1,174.50	0.00
1,058	002749	国光股份	116	1,160.00	0.00

1,059	601008	连云港	300	1,155.00	0.00
1,060	600638	新黄浦	200	1,146.00	0.00
1,061	600508	上海能源	100	1,129.00	0.00
1,062	002748	世龙实业	100	1,125.00	0.00
1,063	002611	东方精工	200	1,116.00	0.00
1,064	600844	丹化科技	300	1,113.00	0.00
1,065	603067	振华股份	100	1,104.00	0.00
1,066	000848	承德露露	100	1,085.00	0.00
1,067	600727	鲁北化工	100	1,039.00	0.00
1,068	000520	长航凤凰	300	1,029.00	0.00
1,069	688586	江航装备	30	1,017.00	0.00
1,070	603637	镇海股份	100	1,010.00	0.00
1,071	600481	双良节能	100	1,006.00	0.00
1,072	688039	当虹科技	13	998.66	0.00
1,073	300405	科隆股份	100	980.00	0.00
1,074	600121	郑州煤电	200	956.00	0.00
1,075	000862	银星能源	100	886.00	0.00
1,076	688057	金达莱	34	874.82	0.00
1,077	600731	湖南海利	100	858.00	0.00
1,078	605001	威奥股份	100	837.00	0.00
1,079	002378	章源钨业	100	832.00	0.00
1,080	603167	渤海轮渡	100	794.00	0.00
1,081	000905	厦门港务	100	752.00	0.00
1,082	002999	天禾股份	100	687.00	0.00
1,083	002218	拓日新能	100	676.00	0.00
1,084	000565	渝三峡 A	100	667.00	0.00
1,085	603399	吉翔股份	100	661.00	0.00
1,086	688015	交控科技	17	625.60	0.00
1,087	002040	南京港	100	618.00	0.00
1,088	002492	恒基达鑫	100	595.00	0.00
1,089	600281	华阳新材	100	579.00	0.00
1,090	600397	安源煤业	200	576.00	0.00
1,091	601619	嘉泽新能	100	516.00	0.00
1,092	688090	瑞松科技	16	509.60	0.00
1,093	600469	风神股份	100	499.00	0.00
1,094	600106	重庆路桥	100	450.00	0.00
1,095	600261	阳光照明	100	438.00	0.00
1,096	600495	晋西车轴	100	404.00	0.00
1,097	601616	广电电气	100	378.00	0.00
1,098	600828	茂业商业	100	361.00	0.00
1,099	600981	汇鸿集团	100	353.00	0.00
1,100	688165	埃夫特	16	176.32	0.00
1,101	688138	清溢光电	2	38.44	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	50,802,946.50	20.00
2	000333	美的集团	48,780,478.41	19.20
3	601318	中国平安	39,868,423.23	15.69
4	601166	兴业银行	29,538,848.33	11.63
5	000001	平安银行	28,876,396.40	11.37
6	601818	光大银行	28,520,715.00	11.23
7	000002	万科 A	19,345,650.61	7.62
8	000858	五粮液	18,902,597.40	7.44
9	000651	格力电器	17,072,029.63	6.72
10	601012	隆基股份	17,041,655.39	6.71
11	601288	农业银行	16,822,537.00	6.62
12	002142	宁波银行	16,322,782.26	6.43
13	601009	南京银行	14,782,654.04	5.82
14	601857	中国石油	13,819,789.00	5.44
15	601398	工商银行	13,700,400.03	5.39
16	600887	伊利股份	13,682,416.06	5.39
17	603259	药明康德	13,598,044.26	5.35
18	000725	京东方 A	13,237,439.00	5.21
19	601888	中国中免	13,136,533.00	5.17
20	600309	万华化学	13,034,210.41	5.13
21	300059	东方财富	12,770,700.32	5.03
22	600276	恒瑞医药	12,691,256.82	5.00
23	601328	交通银行	12,642,942.00	4.98
24	600030	中信证券	12,267,705.00	4.83
25	601668	中国建筑	12,110,810.00	4.77
26	300750	宁德时代	11,832,377.80	4.66
27	600809	山西汾酒	11,396,887.20	4.49
28	300124	汇川技术	11,343,455.68	4.47
29	600900	长江电力	11,237,242.40	4.42
30	601988	中国银行	10,827,799.00	4.26
31	000100	TCL 科技	10,808,876.00	4.25
32	002460	赣锋锂业	10,663,636.50	4.20
33	600919	江苏银行	10,550,258.80	4.15
34	002415	海康威视	10,240,944.00	4.03
35	600031	三一重工	10,119,776.00	3.98
36	601838	成都银行	10,021,860.00	3.95
37	600028	中国石化	9,892,417.00	3.89
38	000932	华菱钢铁	9,841,909.03	3.87

39	601899	紫金矿业	9,835,327.50	3.87
40	601919	中远海控	9,632,608.80	3.79
41	601939	建设银行	8,865,247.90	3.49
42	603486	科沃斯	8,839,018.00	3.48
43	002594	比亚迪	8,833,128.20	3.48
44	600019	宝钢股份	8,821,133.00	3.47
45	601601	中国太保	8,806,662.87	3.47
46	300498	温氏股份	8,686,208.66	3.42
47	601077	渝农商行	8,653,222.00	3.41
48	300274	阳光电源	7,875,932.00	3.10
49	601088	中国神华	7,730,008.45	3.04
50	603501	韦尔股份	7,710,388.55	3.04
51	300122	智飞生物	7,659,460.00	3.02
52	603288	海天味业	7,437,522.20	2.93
53	601600	中国铝业	7,242,633.00	2.85
54	600941	中国移动	7,186,156.74	2.83
55	600438	通威股份	7,170,299.00	2.82
56	002027	分众传媒	7,021,677.00	2.76
57	601186	中国铁建	7,005,565.37	2.76
58	002648	卫星化学	6,955,435.00	2.74
59	601628	中国人寿	6,951,743.00	2.74
60	002714	牧原股份	6,917,985.63	2.72
61	601577	长沙银行	6,916,898.00	2.72
62	300316	晶盛机电	6,904,086.00	2.72
63	600808	马钢股份	6,740,123.00	2.65
64	600176	中国巨石	6,340,469.00	2.50
65	600585	海螺水泥	6,334,895.00	2.49
66	002709	天赐材料	6,313,133.29	2.49
67	600048	保利发展	6,270,855.41	2.47
68	300408	三环集团	6,265,521.27	2.47
69	000568	泸州老窖	6,176,304.53	2.43
70	603806	福斯特	6,127,229.00	2.41
71	600436	片仔癀	6,099,666.00	2.40
72	002475	立讯精密	6,007,856.00	2.36
73	600966	博汇纸业	5,993,102.00	2.36
74	601336	新华保险	5,987,169.56	2.36
75	603986	兆易创新	5,974,057.92	2.35
76	601688	华泰证券	5,882,339.00	2.32
77	603882	金城医学	5,854,610.00	2.30
78	300760	迈瑞医疗	5,770,887.00	2.27
79	600426	华鲁恒升	5,712,857.71	2.25
80	000498	山东路桥	5,697,518.00	2.24
81	601225	陕西煤业	5,603,302.48	2.21

82	300223	北京君正	5,585,415.00	2.20
83	600141	兴发集团	5,502,742.14	2.17
84	603010	万盛股份	5,445,245.12	2.14
85	600015	华夏银行	5,425,600.00	2.14
86	002064	华峰化学	5,424,677.28	2.14
87	601229	上海银行	5,404,885.91	2.13
88	601319	中国人保	5,283,568.23	2.08
89	300015	爱尔眼科	5,282,324.40	2.08
90	600089	特变电工	5,247,457.00	2.07
91	601799	星宇股份	5,241,140.91	2.06
92	601390	中国中铁	5,191,628.00	2.04
93	300677	英科医疗	5,178,704.50	2.04
94	000063	中兴通讯	5,159,465.95	2.03

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	52,709,214.70	20.75
2	000333	美的集团	46,294,912.17	18.22
3	601318	中国平安	42,242,014.00	16.63
4	601166	兴业银行	30,218,413.89	11.90
5	601818	光大银行	29,812,030.00	11.74
6	000001	平安银行	29,270,213.05	11.52
7	000858	五粮液	21,606,187.28	8.51
8	000002	万科 A	19,989,549.05	7.87
9	601012	隆基股份	17,706,014.60	6.97
10	002142	宁波银行	17,111,135.04	6.74
11	600900	长江电力	15,820,248.00	6.23
12	600887	伊利股份	15,804,656.70	6.22
13	000725	京东方 A	15,190,909.00	5.98
14	601857	中国石油	15,155,550.00	5.97
15	000651	格力电器	14,979,051.80	5.90
16	601288	农业银行	14,927,066.00	5.88
17	601888	中国中免	14,586,796.24	5.74
18	600276	恒瑞医药	14,578,060.67	5.74
19	601398	工商银行	14,526,072.00	5.72
20	601009	南京银行	14,441,055.71	5.68
21	300124	汇川技术	14,257,848.02	5.61
22	300059	东方财富	13,958,282.38	5.49
23	002594	比亚迪	13,562,390.81	5.34
24	603259	药明康德	13,552,779.83	5.33
25	601328	交通银行	13,139,138.00	5.17

26	600030	中信证券	12,556,771.00	4.94
27	002714	牧原股份	12,380,392.50	4.87
28	600309	万华化学	11,974,161.00	4.71
29	600028	中国石化	11,537,235.00	4.54
30	601899	紫金矿业	11,332,576.00	4.46
31	002415	海康威视	11,096,967.89	4.37
32	601668	中国建筑	11,085,674.00	4.36
33	600809	山西汾酒	10,934,547.81	4.30
34	600919	江苏银行	10,816,027.00	4.26
35	601919	中远海控	10,761,339.15	4.24
36	300750	宁德时代	10,758,791.00	4.24
37	600031	三一重工	10,639,702.50	4.19
38	601838	成都银行	10,564,949.27	4.16
39	002027	分众传媒	10,507,554.22	4.14
40	603501	韦尔股份	10,454,650.00	4.12
41	002460	赣锋锂业	10,275,094.32	4.04
42	601988	中国银行	10,028,208.00	3.95
43	603288	海天味业	9,898,963.46	3.90
44	603486	科沃斯	9,628,485.00	3.79
45	000100	TCL 科技	9,414,208.18	3.71
46	002475	立讯精密	9,159,560.23	3.61
47	300498	温氏股份	9,084,282.85	3.58
48	601601	中国太保	9,025,729.00	3.55
49	000932	华菱钢铁	8,979,437.08	3.53
50	300274	阳光电源	8,564,151.50	3.37
51	600438	通威股份	8,474,445.13	3.34
52	600019	宝钢股份	8,370,230.99	3.29
53	601077	渝农商行	8,221,145.00	3.24
54	002709	天赐材料	8,139,901.49	3.20
55	600905	三峡能源	8,094,888.19	3.19
56	300122	智飞生物	8,029,163.94	3.16
57	000568	泸州老窖	7,947,523.00	3.13
58	601088	中国神华	7,775,066.00	3.06
59	300015	爱尔眼科	7,742,602.76	3.05
60	601939	建设银行	7,736,236.00	3.05
61	601628	中国人寿	7,689,140.30	3.03
62	601225	陕西煤业	7,309,160.32	2.88
63	300677	英科医疗	7,296,085.00	2.87
64	600015	华夏银行	6,884,486.00	2.71
65	601186	中国铁建	6,815,196.00	2.68
66	002648	卫星化学	6,703,652.12	2.64
67	601211	国泰君安	6,671,572.98	2.63
68	601390	中国中铁	6,565,526.00	2.58

69	300223	北京君正	6,556,631.00	2.58
70	300760	迈瑞医疗	6,481,990.00	2.55
71	603806	福斯特	6,218,887.28	2.45
72	600585	海螺水泥	6,192,479.00	2.44
73	300408	三环集团	6,171,715.60	2.43
74	600966	博汇纸业	6,165,851.00	2.43
75	600176	中国巨石	6,120,872.87	2.41
76	601600	中国铝业	6,027,081.02	2.37
77	603260	合盛硅业	5,892,249.53	2.32
78	600048	保利发展	5,844,671.00	2.30
79	600690	海尔智家	5,844,612.79	2.30
80	601577	长沙银行	5,840,764.00	2.30
81	300146	汤臣倍健	5,754,110.25	2.27
82	601336	新华保险	5,745,185.14	2.26
83	601688	华泰证券	5,737,271.98	2.26
84	601799	星宇股份	5,663,866.00	2.23
85	603010	万盛股份	5,628,094.16	2.22
86	300316	晶盛机电	5,536,777.00	2.18
87	603882	金域医学	5,521,299.01	2.17
88	600426	华鲁恒升	5,386,702.00	2.12
89	600104	上汽集团	5,373,775.00	2.12
90	600808	马钢股份	5,364,620.00	2.11
91	000338	潍柴动力	5,353,490.34	2.11
92	601229	上海银行	5,345,305.76	2.10
93	000661	长春高新	5,258,043.00	2.07
94	002241	歌尔股份	5,256,585.91	2.07
95	603986	兆易创新	5,202,785.60	2.05
96	600050	中国联通	5,200,364.00	2.05
97	002271	东方雨虹	5,088,504.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,617,329,537.92
卖出股票的收入（成交）总额	2,645,756,257.30

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

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）	970,092.90	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	970,092.90	0.39

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113052	兴业转债	6,770	677,000.00	0.27
2	113050	南银转债	1,590	188,128.80	0.08
3	127041	弘亚转债	448	55,287.68	0.02
4	127038	国微转债	101	19,837.41	0.01
5	113049	长汽转债	80	12,247.20	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本报告期内，本基金投资的前十名证券中除兴业银行(601166)、交通银行(601328)、中国建筑(601668)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8月5日，因存在1.违规办理内保外贷业务 2.未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料 3.违反外汇市场交易管理规定 4.未按规定保存交易通讯记录 5.违规办理银行卡业务的违规行为，国家外汇管理局福建省分局对兴业银行股份有限公司处以罚款等行政处罚。2021年8月20日，因存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，中国人民银行对兴业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021年7月16日，因存在：1、理财业务和同业业务制度不健全；2、理财业务数据与事实不符；3、部分理财业务发展与监管导向不符；4、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；5、理财资金违规投向土地储备项目；6、理财产品相互交易调节收益；7、面向机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；8、公募理财产品投资单只证券超限额；9、理财资金违规投向交易所上市交易的股票；10、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021年10月18日，因中国建筑股份有限公司存在危大工程管理不到位的情形，重庆市住房和城乡建设委员会对其处以罚款等处罚。

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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	130,696.28
2	应收证券清算款	155,658.44
3	应收股利	-
4	应收利息	4,939.57
5	应收申购款	17,431.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	308,725.81

8.12.4 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	113050	南银转债	188,128.80	0.08
2	127038	国微转债	19,837.41	0.01
3	113049	长汽转债	12,247.20	0.00

8.12.5 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	600941	中国移动	7,186,156.74	2.91	新股未上市
2	601728	中国电信	1,682,426.97	0.68	首次公开发行限售

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金	持有人结构
------	-------	---------	-------

	(户)	份额	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	1,336	103,261.69	129,518,939.29	93.88%	8,438,674.76	6.12%
博时量化多策略股票 C	545	24,690.42	9,037,479.48	67.16%	4,418,799.16	32.84%
合计	1,819	83,240.18	138,556,418.77	91.51%	12,857,473.92	8.49%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化多策略股票 A	74,524.87	0.05%
	博时量化多策略股票 C	-	-
	合计	74,524.87	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	-
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	0~10
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金合同生效日 (2018 年 4 月 3 日) 基金份额总额	146,135,440.46	765,094,981.90
本报告期期初基金份额总额	144,614,046.25	28,914,743.59
本报告期基金总申购份额	160,412,624.60	59,163,523.52
减：本报告期基金总赎回份额	167,069,056.80	74,621,988.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,957,614.05	13,456,278.64

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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》，高阳先生任博时基金管理有限公司总经理。

基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内重大人事变动情况：自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 45000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	128,689,277.08	2.46%	94,111.80	2.46%	-
银河证券	2	2,326,203,924.84	44.44%	1,701,221.37	44.44%	新增 1 个
长江证券	2	1,094,650,058.31	20.91%	800,519.24	20.91%	-
国泰君安	1	178,179,681.26	3.40%	130,301.61	3.40%	-
中信证券	1	217,624,827.03	4.16%	159,154.52	4.16%	-
招商证券	6	750,062,962.21	14.33%	548,529.54	14.33%	-

中金公司	2	116,653,416.17	2.23%	85,305.52	2.23%	-
中信建投	2	422,402,145.22	8.07%	308,915.02	8.07%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	12,191.22	0.27%	-	-	-	-
长江证券	3,975,786.04	88.75%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,304.20	0.03%	-	-	-	-
招商证券	469,022.00	10.47%	-	-	-	-
中金公司	21,706.40	0.48%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-12-28
2	博时基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北京证券交易所股票的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-11-26
3	博时量化多策略股票型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电	2021-10-27

		子披露网站	
4	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	2021-09-30
5	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-30
6	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-20210928	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-28
7	博时量化多策略股票型证券投资基金 2021 年中期报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-31
8	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 A）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-25
9	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-25
10	博时量化多策略股票型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-21
11	博时基金管理有限公司关于修订博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-14
12	博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-14
13	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	2021-07-01
14	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	2021-06-22

		子披露网站	
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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	2021-02-06

		子披露网站	
26	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	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;2021-06-09~2021-09-02	-	29,369,092.57	-	29,369,092.57	19.40%
	2	2021-07-16~2021-08-17;2021-08-19~2021-08-31	-	27,204,522.10	-	27,204,522.10	17.97%
	3	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份额提出的申购及转换转入申请。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 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
- 13.1.2 《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议》
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 13.1.5 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
- 13.1.6 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日