

博时量化平衡混合型证券投资基金

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：中国工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。

基金托管人中国工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.....	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计意见.....	14
6.2 形成审计意见的基础.....	15
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	86
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	87

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	88
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	88
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	88
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	88
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	88
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	89
8.12 投资组合报告附注	89
§9 基金份额持有人信息	91
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	91
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	91
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	91
§10 开放式基金份额变动	91
§11 重大事件揭示	92
11.1 基金份额持有人大会决议	92
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	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	92
11.4 基金投资策略的改变	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	92
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	92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	92
11.8 其他重大事件	94
§12 影响投资者决策的其他重要信息	97
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	97
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	97
§13 备查文件目录	97
13.1 备查文件目录	97
13.2 存放地点	97
13.3 查阅方式	97

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化平衡混合型证券投资基金
基金简称	博时量化平衡混合
基金主代码	004495
交易代码	004495
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年5月4日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	747,145,531.52 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799

	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		江向阳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	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
本期已实现收益	103,563,074.20	11,289,815.26	5,615,151.78
本期利润	136,288,299.97	17,522,139.26	9,232,107.19
加权平均基金份额本期利润	0.2402	0.1193	0.2232
本期加权平均净值利润率	16.18%	9.02%	19.98%
本期基金份额净值增长率	18.96%	14.56%	22.94%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	417,443,864.72	205,865,315.04	6,935,251.87
期末可供分配基金份额利润	0.5587	0.3513	0.1560
期末基金资产净值	1,164,903,254.11	791,854,934.01	52,444,204.57
期末基金份额净值	1.5591	1.3513	1.1796
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	60.75%	35.13%	17.96%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

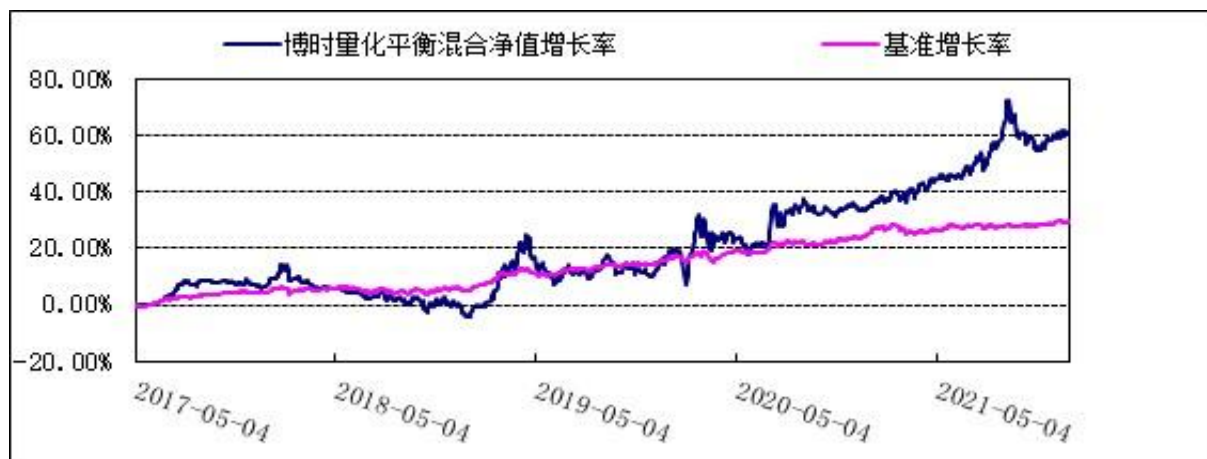
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.37%	0.63%	1.31%	0.16%	-0.94%	0.47%
过去六个月	8.24%	0.84%	1.28%	0.21%	6.96%	0.63%
过去一年	18.96%	0.73%	3.22%	0.24%	15.74%	0.49%
过去三年	67.54%	0.98%	23.15%	0.25%	44.39%	0.73%
自基金合同生效起至今	60.75%	0.84%	29.71%	0.24%	31.04%	0.60%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中债综合指数(总财富)收益率*80%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

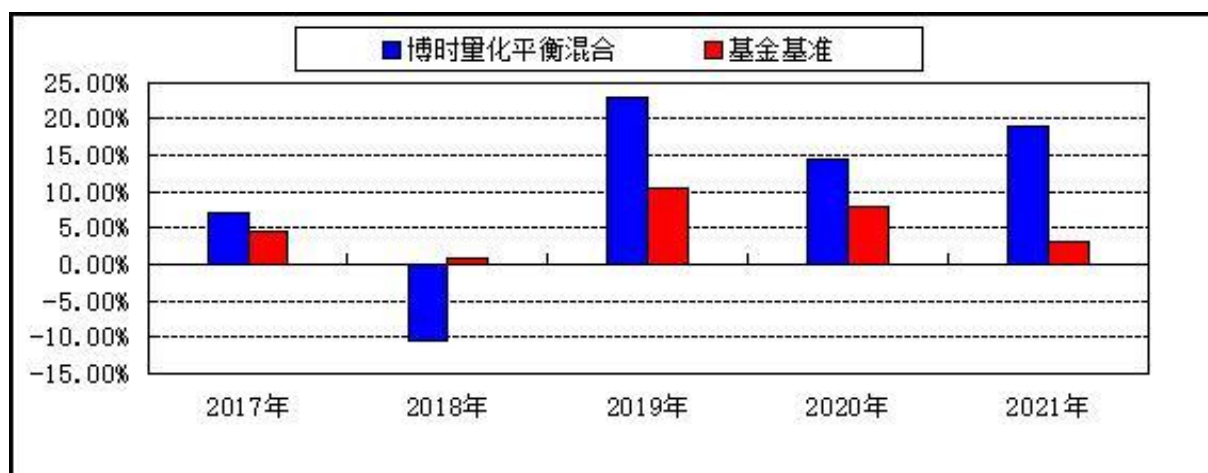
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 5 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日)



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基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同于 2017 年 5 月 4 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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.4400	19,207,800.67	1,352,009.62	20,559,810.29	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	0.4400	19,207,800.67	1,352,009.62	20,559,810.29	-

§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	2017-05-04	-	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	2017-05-04	-	19.4	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、

	金经理				长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监(主持工作)兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日)、博时价值增长贰号证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2018 年 6 月 21 日)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日—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	2017-05-16	2021-06-03	6.3	2014 年 1 月至 2015 年 4 月在平安磐海资本工作。2015 年 4 月加入博时基金管理有限公司, 历任研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理。2021 年 6 月 3 日离职。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，得益于疫苗接种不断推进、财政货币政策持续发力，全球经济经历了疫后全面反弹，即使疫情反复带来了冲击与波折，经济正常化的步伐未曾停歇。随着经济正常化，市场对于美联储加息节奏的预期进一步增强，A 股市场里在过去两年流动性宽松预期中得到估值大幅提升的大盘成长板块在 2021 年开始改变上行趋势进入宽幅震荡，带动整个市场全年也呈现出震荡格局，结构方面出现多次脉冲式的行情，但是持续性都不强。2021 年企业盈利主要由两大板块支撑，一是供给收缩强化价格弹性的周期行业，二是以新能源、新能源车为代表的量价齐升的新兴产业、高端制

造业及其上游原材料。反映到 A 股市场，2021 年的市场风格和行业板块的表现也体现了这种盈利分布的特征。全年来看，风格上，以上证 50 和沪深 300 为代表的大盘指数收益为负，以中证 1000 和国证 2000 为代表的小盘指数涨幅超过 20%，大小盘成为 2021 年市场风格的主要矛盾。成长相对价值虽然全年下来有微弱优势，但是两者的收益差距震荡加剧，最终差异相对前两年大幅减少。行业板块的收益差距也较为明显，传统消费板块在春节后进入回撤，金融板块全年表现都相对低迷，三季度周期板块盈利表现突出同时估值处于底部从而带来行业的戴维斯双击，四季度则主要是以新能源板块为代表的新兴产业表现一枝独秀。全年来看，中信一级行业中，电力设备及新能源、基础化工、有色金属、煤炭、钢铁涨幅名列前茅，消费者服务、非银行金融、家电和地产跌幅较大。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，维持了中高水平的股票平均仓位；选股方面，根据盈利和估值信号全年超配周期板块，获得了一定的超额收益；同时，基金也维持了较高的中低风险转债的配置，在强化防御的同时贡献了绝对收益。未来本基金仍然保持在追求稳健收益的同时，注重回撤风险的控制。本基金将通过量化多策略体系充分挖掘和利用股票及债券市场的规律，注重资产本身的收益能力和空间，力争获得相对平稳的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.5591 元，份额累计净值为 1.6031 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 18.96%，同期业绩基准增长率 3.22%。

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，宏观方面，海外，随着美联储刺激政策的逐步退出，美国经济增速将从高位自然回落，市场对于紧缩的预期变化或将主导美国市场的波动。国内，中央经济工作会议明确我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，要保持平稳健康的经济环境，必须坚持高质量发展，坚持以经济建设为中心。政策基调是稳字当头、稳中求进，财政政策力度加大，节奏加快，适度超前开展基础设施投资；尽快形成实物工作量，货币政策整体保持稳中偏松的态势，保持流动性合理充裕，为风险化解储备充足资源，中小微、科技和高端制造、新能源和绿色信贷是政策结构性发力的重点。稳信用诉求提升，政策边际放松，政策预期改善，总的来说，虽然 2022 年国内将面临一定经济增长的压力，但政策环境对 A 股的影响将偏正面。从股债相对估值来看，目前整体处在中位数水平以下，我们对权益市场并不悲观。从宽基指数本身的估值情况来看，当前市场也没有特别极端。但经历了持续三年的结构性牛市之后，公募基金核心配置的几大赛道整体估值不便宜，包括汽车、新能源车、电力设备和食品饮料，估值都处在较高位置，医药内部分化比较大，传统药企经历了较久的杀估值，而公募重配的 CXO 高位有所回落但也不算便宜，半导体龙头估值也相对较

高。同时基金的发行热度也相对前两年显著降低，因此主赛道板块在当前的回报空间将比较有限。考虑到货币政策稳健偏松，全年维度来看估值应不会成为市场的核心制约因素，但其中的结构性差异将依然是市场的主题。大盘成长相对大盘价值的估值差异在 2021 年春节前达到历史顶点之后开始震荡回归，当前依然位于历史较高的位置，价值策略的超额收益位于中长期的底部，如果市场出现风格切换，那么大概率会是剧烈的。大小盘方面当前货币宽松信用预期也开始从紧到松的情况下，小盘板块依然会有一些的机会。板块方面，当前从盈利增长和稳定性上看，周期和消费依然相对具有优势，同时金融板块的估值位于历史底部，可能随着价值风格的变化而有所表现。同时，2021 年港股市场依然明显跑输全球其它市场，估值进一步受到压制，AH 股溢价指数当前依然处于过去 10 年的高位，意味着两地上市的股票 H 股价格显著低于 A 股；港股通资金占用比例在持续增大，表明香港市场已成为内地资金的重要资产配置市场，因此我们认为 2022 年港股性价比好于 A 股，在中长期维度上具备极强的配置价值。债券市场方面，宽货币能否向宽信用传导是决定利率趋势的关键，我们需要密切关注降息和宽信用实质落地情况。稳增长压力下，信用风险边际缓解，但信用分层仍将持续。作为固收+资金的战略配置资产，增量资金的持续流入支撑转债高估值弹性，权益市场的结构性行情也降低了转债估值系统性下挫风险，估值的阶段调整提供配置机会。转债市场的持续扩容给我们提供了足够的投资广度，虽然当前整体转债的估值不如前几年低，但是从量化策略的角度，转债资产中依然存在一定的投资机会。

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

收益分配原则：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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金管理人于 2021 年 6 月 9 日发布公告，以 2021 年 6 月 3 日可分配利润为基准，每 10 份基金份额发放红利 0.4400 元人民币。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 24237 号

博时量化平衡混合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平衡混合型证券投资基金(以下简称“博时量化平衡混合”)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平衡混合 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平衡混合，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

博时量化平衡混合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平衡混合的持续经营能力，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平衡混合、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平衡混合的财务报告过程。

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，就可能对博时量化平衡混合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平衡混合不能持续经营。

(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：博时量化平衡混合型证券投资基金

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	84,670,868.17	72,562,601.33
结算备付金		8,277,369.95	23,750,966.22
存出保证金		182,868.13	353,202.58
交易性金融资产	7.4.7.2	1,073,754,589.84	494,336,926.49
其中：股票投资		457,159,483.75	242,354,752.41
基金投资		-	-
债券投资		616,595,106.09	251,982,174.08
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	-	215,000,000.00
应收证券清算款		195,968.08	240,779.53
应收利息	7.4.7.5	1,903,450.65	2,367,391.87
应收股利		-	-
应收申购款		185,851.70	2,205.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,169,170,966.52	808,614,073.98
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		-	14,395,886.22
应付赎回款		167,537.65	204,194.43
应付管理人报酬		1,479,828.17	936,683.78
应付托管费		246,638.03	156,114.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,186,246.80	900,547.22
应交税费		7,794.47	932.63
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,667.29	164,781.69
负债合计		4,267,712.41	16,759,139.97
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	747,145,531.52	585,989,618.97
未分配利润	7.4.7.10	417,757,722.59	205,865,315.04
所有者权益合计		1,164,903,254.11	791,854,934.01
负债和所有者权益总计		1,169,170,966.52	808,614,073.98

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5591 元，基金份额总额 747,145,531.52 份。

7.2 利润表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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		160,418,208.15	23,274,338.27

1.利息收入		4,146,435.43	1,827,137.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	397,097.96	223,738.34
债券利息收入		3,428,853.46	838,051.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		320,484.01	765,347.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		122,340,325.53	14,628,384.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	55,004,249.20	11,040,990.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	61,644,969.10	3,048,312.72
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	47,242.72	-
股利收益	7.4.7.15	5,643,864.51	539,081.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	32,725,225.77	6,232,324.00
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	1,206,221.42	586,492.89
减：二、费用		24,129,908.18	5,752,199.01
1. 管理人报酬		12,603,747.50	2,865,138.12
2. 托管费		2,100,624.55	477,522.99
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	9,219,812.55	2,227,411.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8,036.00	554.00
7. 其他费用	7.4.7.19	197,687.58	181,572.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		136,288,299.97	17,522,139.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		136,288,299.97	17,522,139.26

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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)	585,989,618.97	205,865,315.04	791,854,934.01
二、本期经营活动产生的基金净	-	136,288,299.97	136,288,299.97

值变动数（本期利润）			
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）	161,155,912.55	96,163,917.87	257,319,830.42
其中：1.基金申购款	509,494,078.99	246,946,650.94	756,440,729.93
2.基金赎回款	-348,338,166.44	-150,782,733.07	-499,120,899.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-20,559,810.29	-20,559,810.29
五、期末所有者权益（基金净值）	747,145,531.52	417,757,722.59	1,164,903,254.11
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）	44,460,510.27	7,983,694.30	52,444,204.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,522,139.26	17,522,139.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	541,529,108.70	180,359,481.48	721,888,590.18
其中：1.基金申购款	638,587,954.74	211,279,509.56	849,867,464.30
2.基金赎回款	-97,058,846.04	-30,920,028.08	-127,978,874.12
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）	585,989,618.97	205,865,315.04	791,854,934.01

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：侣方方

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时量化平衡混合型证券投资基金(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[2016]3045号《关于准予博时量化平衡混合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《博时量化平衡混合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，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 262,200,888.35 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(2017)第 442 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

262,251,781.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 50,893.54 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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、存托凭证)、权证、股指期货、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、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、国债期货以及现金，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相关规定)。基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)投资比例为基金资产的 0%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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：沪深 300 指数收益率*20%+中债综合指数(总财富)*80%。

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》、《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和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和托管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

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	84,670,868.17	72,562,601.33
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	84,670,868.17	72,562,601.33

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	451,395,928.50	457,159,483.75	5,763,555.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	580,464,289.83	616,595,106.09
	银行间市场	-	-
	合计	580,464,289.83	616,595,106.09
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,031,860,218.33	1,073,754,589.84	41,894,371.51
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	234,063,146.32	242,354,752.41	8,291,606.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	101,406,854.43	101,727,174.08
	银行间市场	149,776,200.00	150,255,000.00

	合计	251,183,054.43	251,982,174.08	799,119.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		485,246,200.75	494,336,926.49	9,090,725.74

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	1,485,060.00	-	-	-
股指期货	1,485,060.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,485,060.00	-	-	-

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，本基金未持持股指期货合约。

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
IF2103	沪深300股指期货 IF2103 合约	1	1,563,480.00	78,420.00
减：可抵销期货暂收款				78,420.00
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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	215,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	215,000,000.00	-

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	9,311.36	25,662.74
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	4,097.28	11,740.88
应收债券利息	1,889,951.48	2,401,675.23
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-71,753.42
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	90.53	66.44
合计	1,903,450.65	2,367,391.87

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	2,186,246.80	900,022.22
银行间市场应付交易费用	-	525.00
合计	2,186,246.80	900,547.22

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	167.29	281.69
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	179,500.00	164,500.00
合计	179,667.29	164,781.69

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	585,989,618.97	585,989,618.97
本期申购	509,494,078.99	509,494,078.99
本期赎回（以“-”号填列）	-348,338,166.44	-348,338,166.44
本期末	747,145,531.52	747,145,531.52

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	245,867,900.97	-40,002,585.93	205,865,315.04
本期利润	103,563,074.20	32,725,225.77	136,288,299.97
本期基金份额交易产生的变动数	88,572,699.84	7,591,218.03	96,163,917.87
其中：基金申购款	250,571,799.26	-3,625,148.32	246,946,650.94
基金赎回款	-161,999,099.42	11,216,366.35	-150,782,733.07
本期已分配利润	-20,559,810.29	-	-20,559,810.29
本期末	417,443,864.72	313,857.87	417,757,722.59

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	268,967.55	152,090.05
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	117,364.92	58,997.09
其他	10,765.49	12,651.20

合计	397,097.96	223,738.34
----	------------	------------

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	3,074,518,711.43	664,059,016.70
减：卖出股票成本总额	3,019,514,462.23	653,018,026.35
买卖股票差价收入	55,004,249.20	11,040,990.35

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	848,114,546.44	86,656,555.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	781,633,888.13	83,430,111.03
减：应收利息总额	4,835,689.21	178,132.18
买卖债券差价收入	61,644,969.10	3,048,312.72

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	47,242.72	-

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	5,643,864.51	539,081.28
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	5,643,864.51	539,081.28

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	32,803,645.77	6,153,904.00
——股票投资	-2,528,050.84	6,969,520.41
——债券投资	35,331,696.61	-815,616.41
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-78,420.00	78,420.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-78,420.00	78,420.00
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	32,725,225.77	6,232,324.00

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	1,198,096.65	304,239.41
基金转换费收入	8,124.77	282,253.48
合计	1,206,221.42	586,492.89

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	9,219,137.55	2,226,886.20
银行间市场交易费用	675.00	525.00
合计	9,219,812.55	2,227,411.20

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	55,000.00	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	4,687.58	3,572.70
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	197,687.58	181,572.70

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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	595,552,243.57	9.70%	65,109,508.84	4.26%

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	91,187,093.78	5.53%	24,122,021.89	9.88%

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	554,648.62	10.07%	338,422.28	15.48%
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	60,636.40	4.29%	38,933.08	4.33%

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	12,603,747.50	2,865,138.12
其中：支付销售机构的客户维护费	91,237.27	77,082.41

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年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托管费	2,100,624.55	477,522.99

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
----	-----------------------------	----------------------------------

期初持有的基金份额	1,856,029.64	1,856,029.64
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,856,029.64	-
期末持有的基金份额	-	1,856,029.64
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.32%

注：1.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）。
 2.基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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
中国工商银行-活期存款	84,670,868.17	268,967.55	72,562,601.33	152,090.05

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	3,582.00	394,020.00
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	2,970.00	91,268.10
招商证券	688206	概伦电子	网下发行	6,000.00	169,680.00
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

单位：人民币元

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

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 2-24	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 2-24	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	2021-0 8-11	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	-
688187	时代 电气	2021-0 8-30	2022- 03-07	首次公 开发行 限售	31.38	76.65	13,038.00	409,132.44	999,362.70	-
688075	安旭 生物	2021-11 -10	2022- 05-18	首次公 开发行 限售	78.28	128.77	4,177.00	326,975.56	537,872.29	-
688262	国芯 科技	2021-1 2-28	2022- 01-06	新股未 上市	41.98	41.98	7,129.00	299,275.42	299,275.42	-
688553	汇宇 制药	2021-1 0-14	2022- 04-26	首次公 开发行 限售	38.87	32.11	8,928.00	347,031.36	286,678.08	-
688285	高铁 电气	2021-1 0-12	2022- 04-20	首次公 开发行 限售	7.18	9.14	15,159.00	108,841.62	138,553.26	-
301155	海力 风电	2021-11 -17	2022- 05-24	首次公 开发行 限售	60.66	96.75	1,054.00	63,935.64	101,974.50	-

688768	容知日新	2021-07-16	2022-01-26	首次公开发行股票限售	18.23	108.54	907.00	16,534.61	98,445.78	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	首次公开发行股票限售	116.88	116.08	469.00	54,816.72	54,441.52	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	首次公开发行股票限售	60.64	234.74	203.00	12,309.92	47,652.22	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	首次公开发行股票限售	14.14	89.87	462.00	6,532.68	41,519.94	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	首次公开发行股票限售	25.80	33.65	967.00	24,948.60	32,539.55	-
688701	卓锦股份	2021-09-08	2022-03-16	首次公开发行股票限售	7.48	13.50	2,340.00	17,503.20	31,590.00	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	首次公开发行股票限售	6.96	12.51	2,064.00	14,365.44	25,820.64	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	首次公开发行股票限售	3.55	18.24	1,386.00	4,920.30	25,280.64	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	首次公开发行股票限售	69.89	88.72	280.00	19,569.20	24,841.60	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	首次公开发行股票限售	86.06	94.50	253.00	21,773.18	23,908.50	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	首次公开发行股票限售	79.60	78.53	272.00	21,651.20	21,360.16	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	首次公开发行股票限售	10.07	16.76	1,214.00	12,224.98	20,346.64	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	首次公开发行股票限售	11.90	45.45	420.00	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	首次公开发行股票限售	27.81	31.14	599.00	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	首次公开发行股票	4.17	30.94	587.00	2,447.79	18,161.78	-

				限售						
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	首次公开发行限售	33.16	24.67	704.00	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	首次公开发行限售	39.08	52.13	329.00	12,857.32	17,150.77	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	首次公开发行限售	26.91	43.36	371.00	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	首次公开发行限售	27.85	27.46	575.00	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	首次公开发行限售	22.70	49.02	315.00	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	首次公开发行限售	57.27	53.71	280.00	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	首次公开发行限售	43.99	50.77	295.00	12,977.05	14,977.15	-
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	-
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	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	10.64	30.44	421.00	4,479.44	12,815.24	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	首次公开发行限售	26.17	44.86	285.00	7,458.45	12,785.10	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	首次公开发行限售	18.03	62.73	203.00	3,660.09	12,734.19	-
301021	英诺	2021-0	2022-	首次公	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	-

	激光	6-28	01-06	开发行 限售						
301092	争光 股份	2021-1 0-21	2022- 05-05	首次公 开发行 限售	36.31	35.52	323.00	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰 重工	2021-0 8-11	2022- 02-28	首次公 开发行 限售	4.13	12.96	843.00	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚 机械	2021-0 7-12	2022- 01-20	首次公 开发行 限售	5.31	13.50	733.00	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄 科技	2021-0 8-06	2022- 02-17	首次公 开发行 限售	15.81	28.37	335.00	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍 杰 特	2021-0 7-26	2022- 02-16	首次公 开发行 限售	4.57	21.08	444.00	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环 海陆	2021-0 7-26	2022- 02-07	首次公 开发行 限售	13.57	38.51	241.00	3,270.37	9,280.91	-
301182	凯旺 科技	2021-1 2-16	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	2021-0 9-07	2022- 03-14	首次公 开发行 限售	3.31	17.01	523.00	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联 科技	2021-1 2-02	2022- 06-09	首次公 开发行 限售	30.73	29.14	297.00	9,126.81	8,654.58	-
301066	万 事 利	2021-0 9-13	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	2021-0 8-04	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 股份	2021-11 -19	2022- 05-26	首次公 开发行 限售	14.33	26.95	286.00	4,098.38	7,707.70	-
301030	仕净 科技	2021-0 7-15	2022- 01-24	首次公 开发行 限售	6.10	31.52	242.00	1,476.20	7,627.84	-
301033	迈普 医学	2021-0 7-15	2022- 01-26	首次公 开发行 限售	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	-

301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	首次公开发行股票限售	4.97	12.51	513.00	2,549.61	6,417.63	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	首次公开发行股票限售	23.38	29.93	205.00	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	首次公开发行股票限售	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	首次公开发行股票限售	7.46	33.41	181.00	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	首次公开发行股票限售	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	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	首次公开发行股票限售	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	首次公开发行股票限售	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	首次公开发行股票限售	11.45	16.65	286.00	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	首次公开发行股票限售	14.82	24.26	193.00	2,860.26	4,682.18	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	首次公开发行股票限售	8.03	19.02	218.00	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	首次公开发行股票限售	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	首次公开发行股票限售	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	2021-12-28	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	23,830.00	2,383,000.00	2,383,000.00	-

113637	华翔 转债	2021-1 2-23	2022- 01-20	新债未 上市	100.0 0	100.00	30.00	3,000.00	3,000.00	-
--------	----------	----------------	----------------	-----------	------------	--------	-------	----------	----------	---

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

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在

董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-

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

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	241,991,993.36	30,793,378.88
AAA 以下	374,603,112.73	-
未评级	-	9,294,000.00
合计	616,595,106.09	40,087,378.88

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	84,670,868.17	-	-	-	84,670,868.17
结算备付金	8,277,369.95	-	-	-	8,277,369.95
存出保证金	182,868.13	-	-	-	182,868.13
交易性金融资产	107,191,600.00	429,028,493.69	80,375,012.40	457,159,483.75	1,073,754,589.84
应收证券清算款	-	-	-	195,968.08	195,968.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,903,450.65	1,903,450.65
应收申购款	-	-	-	185,851.70	185,851.70
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	200,322,706.25	429,028,493.69	80,375,012.40	459,444,754.18	1,169,170,966.52
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	167,537.65	167,537.65
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,479,828.17	1,479,828.17
应付托管费	-	-	-	246,638.03	246,638.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,794.47	7,794.47
应付交易费用	-	-	-	2,186,246.80	2,186,246.80
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,667.29	179,667.29
负债总计	-	-	-	4,267,712.41	4,267,712.41
利率敏感度缺口	200,322,706.25	429,028,493.69	80,375,012.40	455,177,041.77	1,164,903,254.11
上年度末					
2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	72,562,601.33	-	-	-	72,562,601.33
结算备付金	23,750,966.22	-	-	-	23,750,966.22
存出保证金	134,315.38	-	-	218,887.20	353,202.58
交易性金融资产	211,894,795.20	30,180,000.00	9,907,378.88	242,354,752.41	494,336,926.49
应收证券清算款	-	-	-	240,779.53	240,779.53
买入返售金融资产	215,000,000.00	-	-	-	215,000,000.00

应收利息	-	-	-	2,367,391.87	2,367,391.87
应收申购款	-	-	-	2,205.96	2,205.96
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	523,342,678.13	30,180,000.00	9,907,378.88	245,184,016.97	808,614,073.98
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	204,194.43	204,194.43
应付证券清算款	-	-	-	14,395,886.22	14,395,886.22
应付管理人报酬	-	-	-	936,683.78	936,683.78
应付托管费	-	-	-	156,114.00	156,114.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	932.63	932.63
应付交易费用	-	-	-	900,547.22	900,547.22
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,781.69	164,781.69
负债总计	-	-	-	16,759,139.97	16,759,139.97
利率敏感度缺口	523,342,678.13	30,180,000.00	9,907,378.88	228,424,877.00	791,854,934.01

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	减少约 70
市场利率下降 25 个基点	-	增加约 72	

注：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。

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	457,159,483.75	39.24	242,354,752.41	30.61
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	616,595,106.09	52.93	30,793,378.88	3.89
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,073,754,589.84	92.18	273,148,131.29	34.49

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 2,108	增加约 1,149
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,108	减少约 1,149

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 1,059,220,802.57 元，属于第二层次的余额为 14,533,787.27 元，属于第三层次的余额为 0.00 元（上年度末：第一层次 270,146,059.16 元，第二层次 224,190,867.33 元，第三层次 0.00 元）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关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	457,159,483.75	39.10
	其中：股票	457,159,483.75	39.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	616,595,106.09	52.74
	其中：债券	616,595,106.09	52.74
	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	92,948,238.12	7.95
8	其他各项资产	2,468,138.56	0.21
9	合计	1,169,170,966.52	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	1,226,978.00	0.11
B	采矿业	9,553,151.00	0.82
C	制造业	221,862,316.89	19.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,781,913.00	0.67
E	建筑业	10,653,915.80	0.91
F	批发和零售业	63,030,460.80	5.41
G	交通运输、仓储和邮政业	4,439,759.88	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,861,049.23	1.70
J	金融业	90,709,890.07	7.79
K	房地产业	14,679,890.00	1.26
L	租赁和商务服务业	4,348,704.23	0.37
M	科学研究和技术服务业	3,158,178.01	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	414,182.39	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	67,596.00	0.01
Q	卫生和社会工作	2,031,480.78	0.17
R	文化、体育和娱乐业	2,569,211.67	0.22
S	综合	770,806.00	0.07
	合计	457,159,483.75	39.24

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	600755	厦门国贸	6,453,985	46,533,231.85	3.99
2	000333	美的集团	239,968	17,712,038.08	1.52
3	601318	中国平安	236,931	11,943,691.71	1.03
4	000932	华菱钢铁	2,201,900	11,251,709.00	0.97
5	600153	建发股份	1,181,600	10,717,112.00	0.92
6	601166	兴业银行	540,061	10,282,761.44	0.88
7	600782	新钢股份	1,776,500	9,379,920.00	0.81
8	000651	格力电器	239,600	8,872,388.00	0.76
9	600036	招商银行	164,700	8,022,537.00	0.69
10	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.62
11	000001	平安银行	386,574	6,370,739.52	0.55
12	601328	交通银行	1,260,200	5,809,522.00	0.50
13	000002	万科 A	267,600	5,287,776.00	0.45
14	600519	贵州茅台	2,500	5,125,000.00	0.44
15	601288	农业银行	1,684,100	4,951,254.00	0.43
16	600048	保利发展	311,500	4,868,745.00	0.42
17	601628	中国人寿	135,000	4,062,150.00	0.35
18	002142	宁波银行	103,210	3,950,878.80	0.34
19	601988	中国银行	1,236,500	3,771,325.00	0.32
20	601939	建设银行	636,300	3,728,718.00	0.32
21	601577	长沙银行	434,700	3,395,007.00	0.29
22	601668	中国建筑	673,600	3,368,000.00	0.29
23	600887	伊利股份	76,200	3,159,252.00	0.27
24	601838	成都银行	256,100	3,073,200.00	0.26
25	000776	广发证券	112,400	2,763,916.00	0.24
26	601319	中国人保	547,000	2,570,900.00	0.22
27	600019	宝钢股份	350,700	2,511,012.00	0.22
28	600436	片仔癀	5,400	2,360,610.00	0.20
29	300750	宁德时代	4,000	2,352,000.00	0.20
30	600057	厦门象屿	269,100	2,284,659.00	0.20
31	000725	京东方 A	442,800	2,236,140.00	0.19
32	603986	兆易创新	11,800	2,075,030.00	0.18
33	300059	东方财富	55,360	2,054,409.60	0.18
34	600308	华泰股份	310,900	1,924,471.00	0.17
35	000717	韶钢松山	405,000	1,923,750.00	0.17
36	601919	中远海控	101,980	1,906,006.20	0.16
37	600546	山煤国际	232,000	1,904,720.00	0.16
38	688200	华峰测控	3,678	1,882,768.20	0.16
39	000538	云南白药	17,900	1,873,235.00	0.16

40	300573	兴齐眼药	13,600	1,860,480.00	0.16
41	000898	鞍钢股份	496,000	1,860,000.00	0.16
42	000498	山东路桥	300,200	1,855,236.00	0.16
43	603198	迎驾贡酒	26,500	1,840,425.00	0.16
44	600449	宁夏建材	152,587	1,835,621.61	0.16
45	601898	中煤能源	290,100	1,824,729.00	0.16
46	688301	奕瑞科技	3,670	1,823,623.00	0.16
47	600779	水井坊	15,100	1,811,849.00	0.16
48	600808	马钢股份	490,300	1,809,207.00	0.16
49	603882	金域医学	16,200	1,804,194.00	0.15
50	600581	八一钢铁	289,700	1,799,037.00	0.15
51	600031	三一重工	78,600	1,792,080.00	0.15
52	603517	绝味食品	26,225	1,791,954.25	0.15
53	688508	芯朋微	15,414	1,785,866.04	0.15
54	300672	国科微	9,600	1,780,800.00	0.15
55	000789	万年青	144,700	1,768,234.00	0.15
56	600985	淮北矿业	158,000	1,766,440.00	0.15
57	000825	太钢不锈	250,500	1,763,520.00	0.15
58	600507	方大特钢	223,500	1,743,300.00	0.15
59	600282	南钢股份	469,500	1,737,150.00	0.15
60	600997	开滦股份	243,900	1,736,568.00	0.15
61	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.14
62	002497	雅化集团	58,400	1,673,744.00	0.14
63	600585	海螺水泥	41,300	1,664,390.00	0.14
64	600765	中航重机	32,800	1,656,072.00	0.14
65	601601	中国太保	60,600	1,643,472.00	0.14
66	001979	招商蛇口	122,700	1,636,818.00	0.14
67	603259	药明康德	13,800	1,636,404.00	0.14
68	600136	当代文体	240,100	1,608,670.00	0.14
69	000895	双汇发展	50,900	1,605,895.00	0.14
70	000959	首钢股份	276,500	1,584,345.00	0.14
71	601158	重庆水务	246,800	1,581,988.00	0.14
72	688536	思瑞浦	2,052	1,575,936.00	0.14
73	600522	中天科技	92,200	1,563,712.00	0.13
74	000039	中集集团	90,700	1,556,412.00	0.13
75	688595	芯海科技	12,447	1,549,029.15	0.13
76	000568	泸州老窖	6,100	1,548,607.00	0.13
77	600104	上汽集团	71,800	1,481,234.00	0.13
78	601012	隆基股份	17,000	1,465,400.00	0.13
79	600809	山西汾酒	4,638	1,464,587.64	0.13
80	300833	浩洋股份	17,900	1,450,437.00	0.12
81	601857	中国石油	290,100	1,424,391.00	0.12
82	605399	晨光新材	35,200	1,397,792.00	0.12

83	600309	万华化学	13,800	1,393,800.00	0.12
84	000858	五粮液	6,200	1,380,492.00	0.12
85	600900	长江电力	59,700	1,355,190.00	0.12
86	000100	TCL 科技	208,000	1,283,360.00	0.11
87	002415	海康威视	24,100	1,260,912.00	0.11
88	600919	江苏银行	212,000	1,235,960.00	0.11
89	000063	中兴通讯	35,800	1,199,300.00	0.10
90	000069	华侨城 A	168,500	1,186,240.00	0.10
91	601888	中国中免	5,300	1,162,873.00	0.10
92	600089	特变电工	54,500	1,153,765.00	0.10
93	600028	中国石化	272,000	1,150,560.00	0.10
94	000830	鲁西化工	71,300	1,088,038.00	0.09
95	601009	南京银行	119,800	1,073,408.00	0.09
96	601600	中国铝业	175,600	1,069,404.00	0.09
97	600027	华电国际	194,800	1,042,180.00	0.09
98	000050	深天马 A	80,000	1,041,600.00	0.09
99	601818	光大银行	308,100	1,022,892.00	0.09
100	002092	中泰化学	105,500	1,006,470.00	0.09
101	601669	中国电建	124,500	1,005,960.00	0.09
102	688187	时代电气	13,038	999,362.70	0.09
103	601899	紫金矿业	100,800	977,760.00	0.08
104	603380	易德龙	25,100	961,330.00	0.08
105	601766	中国中车	156,700	954,303.00	0.08
106	003816	中国广核	304,300	952,459.00	0.08
107	600030	中信证券	36,000	950,760.00	0.08
108	600050	中国联通	241,600	949,488.00	0.08
109	600271	航天信息	70,200	939,978.00	0.08
110	603501	韦尔股份	3,000	932,310.00	0.08
111	601985	中国核电	108,500	900,550.00	0.08
112	600586	金晶科技	97,100	899,146.00	0.08
113	300316	晶盛机电	12,700	882,650.00	0.08
114	601390	中国中铁	147,400	853,446.00	0.07
115	000666	经纬纺机	97,500	847,275.00	0.07
116	600141	兴发集团	21,300	806,844.00	0.07
117	002594	比亚迪	3,000	804,360.00	0.07
118	600097	开创国际	69,700	802,944.00	0.07
119	002732	燕塘乳业	29,500	791,780.00	0.07
120	600251	冠农股份	83,300	787,185.00	0.07
121	601688	华泰证券	44,300	786,768.00	0.07
122	300014	亿纬锂能	6,578	777,388.04	0.07
123	600132	重庆啤酒	5,100	771,732.00	0.07
124	002475	立讯精密	15,400	757,680.00	0.07
125	600096	云天化	38,500	755,370.00	0.06

126	600276	恒瑞医药	14,800	750,508.00	0.06
127	002129	中环股份	17,800	743,150.00	0.06
128	000708	中信特钢	35,600	729,088.00	0.06
129	600741	华域汽车	25,700	727,310.00	0.06
130	601211	国泰君安	40,500	724,545.00	0.06
131	600884	杉杉股份	21,440	702,588.80	0.06
132	002199	东晶电子	84,700	694,540.00	0.06
133	600039	四川路桥	57,300	689,892.00	0.06
134	000933	神火股份	73,600	669,024.00	0.06
135	601678	滨化股份	83,020	661,669.40	0.06
136	000009	中国宝安	45,100	650,793.00	0.06
137	000429	粤高速 A	86,300	638,620.00	0.05
138	603696	安记食品	65,400	625,878.00	0.05
139	603933	睿能科技	40,900	620,862.00	0.05
140	601117	中国化学	51,500	618,000.00	0.05
141	000617	中油资本	117,300	607,614.00	0.05
142	601006	大秦铁路	93,300	597,120.00	0.05
143	603685	晨丰科技	47,100	589,692.00	0.05
144	603288	海天味业	5,400	567,594.00	0.05
145	002961	瑞达期货	23,000	566,720.00	0.05
146	600760	中航沈飞	8,200	557,928.00	0.05
147	601186	中国铁建	71,500	557,700.00	0.05
148	002410	广联达	8,600	550,228.00	0.05
149	002231	奥维通信	91,200	549,936.00	0.05
150	601077	渝农商行	142,600	549,010.00	0.05
151	300122	智飞生物	4,400	548,240.00	0.05
152	002636	金安国纪	36,100	543,305.00	0.05
153	688075	安旭生物	4,177	537,872.29	0.05
154	600183	生益科技	22,700	534,585.00	0.05
155	000528	柳工	67,500	520,425.00	0.04
156	002460	赣锋锂业	3,600	514,260.00	0.04
157	601225	陕西煤业	42,000	512,400.00	0.04
158	601088	中国神华	22,600	508,952.00	0.04
159	002736	国信证券	43,800	502,824.00	0.04
160	600353	旭光电子	68,100	501,897.00	0.04
161	300759	康龙化成	3,500	494,445.00	0.04
162	600176	中国巨石	27,100	493,220.00	0.04
163	600111	北方稀土	10,600	485,480.00	0.04
164	600582	天地科技	110,300	483,114.00	0.04
165	601336	新华保险	12,400	482,112.00	0.04
166	002821	凯莱英	1,100	478,500.00	0.04
167	300583	赛托生物	19,000	468,920.00	0.04
168	000590	启迪药业	47,400	468,312.00	0.04

169	000701	厦门信达	84,900	459,309.00	0.04
170	002817	黄山胶囊	37,900	457,074.00	0.04
171	000157	中联重科	63,500	455,295.00	0.04
172	002241	歌尔股份	8,400	454,440.00	0.04
173	300433	蓝思科技	19,400	445,812.00	0.04
174	688118	普元信息	18,100	442,002.00	0.04
175	600613	神奇制药	68,800	441,696.00	0.04
176	300450	先导智能	5,900	438,783.00	0.04
177	600573	惠泉啤酒	42,500	429,675.00	0.04
178	603323	苏农银行	88,000	428,560.00	0.04
179	603989	艾华集团	10,100	418,140.00	0.04
180	601138	工业富联	34,900	416,008.00	0.04
181	601658	邮储银行	81,100	413,610.00	0.04
182	603773	沃格光电	19,960	409,579.20	0.04
183	603566	普莱柯	18,500	408,850.00	0.04
184	603117	万林物流	102,500	407,950.00	0.04
185	603168	莎普爱思	43,000	407,640.00	0.03
186	002495	佳隆股份	149,600	403,920.00	0.03
187	603706	东方环宇	27,300	403,767.00	0.03
188	000633	合金投资	67,800	401,376.00	0.03
189	002709	天赐材料	3,500	401,275.00	0.03
190	603790	雅运股份	37,500	394,875.00	0.03
191	300274	阳光电源	2,700	393,660.00	0.03
192	002660	茂硕电源	48,600	391,230.00	0.03
193	600958	东方证券	26,200	386,188.00	0.03
194	603799	华友钴业	3,500	386,085.00	0.03
195	002371	北方华创	1,100	381,722.00	0.03
196	000678	襄阳轴承	81,600	381,072.00	0.03
197	600186	莲花健康	126,600	381,066.00	0.03
198	000020	深华发 A	41,500	380,140.00	0.03
199	603889	新澳股份	60,500	374,495.00	0.03
200	603322	超讯通信	29,600	373,256.00	0.03
201	600011	华能国际	38,400	372,096.00	0.03
202	300661	圣邦股份	1,200	370,800.00	0.03
203	002601	龙佰集团	12,900	368,811.00	0.03
204	000425	徐工机械	61,400	367,786.00	0.03
205	600926	杭州银行	27,600	353,832.00	0.03
206	600883	博闻科技	40,900	348,468.00	0.03
207	688181	八亿时空	7,300	346,020.00	0.03
208	688111	金山办公	1,300	344,500.00	0.03
209	600232	金鹰股份	63,400	342,994.00	0.03
210	600697	欧亚集团	27,300	340,158.00	0.03
211	002048	宁波华翔	15,700	339,591.00	0.03

212	600438	通威股份	7,500	337,200.00	0.03
213	000733	振华科技	2,700	335,556.00	0.03
214	002348	高乐股份	153,600	334,848.00	0.03
215	603880	南卫股份	46,466	332,696.56	0.03
216	600287	江苏舜天	70,700	331,583.00	0.03
217	603100	川仪股份	15,600	330,096.00	0.03
218	603926	铁流股份	20,100	327,429.00	0.03
219	603679	华体科技	23,900	325,040.00	0.03
220	600352	浙江龙盛	25,700	324,591.00	0.03
221	688058	宝兰德	4,000	324,440.00	0.03
222	300553	集智股份	8,300	322,123.00	0.03
223	300637	扬帆新材	38,500	319,935.00	0.03
224	600893	航发动力	5,000	317,300.00	0.03
225	688168	安博通	5,097	316,370.79	0.03
226	603196	日播时尚	38,800	309,624.00	0.03
227	002745	木林森	20,400	308,652.00	0.03
228	603226	菲林格尔	40,900	302,251.00	0.03
229	600647	同达创业	23,500	301,975.00	0.03
230	000715	中兴商业	61,700	301,713.00	0.03
231	300521	爱司凯	21,400	301,526.00	0.03
232	300749	顶固集创	31,000	300,390.00	0.03
233	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
234	002861	瀛通通讯	23,500	298,450.00	0.03
235	000799	酒鬼酒	1,400	297,500.00	0.03
236	300347	泰格医药	2,300	293,940.00	0.03
237	600998	九州通	19,900	292,928.00	0.03
238	002049	紫光国微	1,300	292,500.00	0.03
239	688553	汇宇制药	8,928	286,678.08	0.02
240	300626	华瑞股份	28,100	283,248.00	0.02
241	002615	哈尔斯	50,500	281,790.00	0.02
242	600219	南山铝业	59,800	281,658.00	0.02
243	688005	容百科技	2,431	280,974.98	0.02
244	000401	冀东水泥	23,400	279,864.00	0.02
245	601677	明泰铝业	6,300	277,767.00	0.02
246	603260	合盛硅业	2,100	277,137.00	0.02
247	603386	广东骏亚	13,100	274,576.00	0.02
248	603115	海星股份	10,300	269,860.00	0.02
249	300760	迈瑞医疗	700	266,560.00	0.02
250	300593	新雷能	4,900	266,462.00	0.02
251	002382	蓝帆医疗	16,300	265,527.00	0.02
252	603678	火炬电子	3,500	264,775.00	0.02
253	002027	分众传媒	32,300	264,537.00	0.02
254	300625	三雄极光	17,300	262,787.00	0.02

255	601618	中国中冶	68,500	262,355.00	0.02
256	688122	西部超导	2,675	259,314.50	0.02
257	600745	闻泰科技	2,000	258,600.00	0.02
258	000625	长安汽车	16,900	256,711.00	0.02
259	600332	白云山	7,400	253,080.00	0.02
260	300677	英科医疗	4,350	251,604.00	0.02
261	688202	美迪西	517	251,050.03	0.02
262	002322	理工环科	20,800	249,392.00	0.02
263	002869	金溢科技	16,000	248,640.00	0.02
264	603456	九洲药业	4,400	247,544.00	0.02
265	603920	世运电路	11,100	247,530.00	0.02
266	300270	中威电子	38,400	245,376.00	0.02
267	002746	仙坛股份	23,200	243,368.00	0.02
268	603486	科沃斯	1,600	241,520.00	0.02
269	000949	新乡化纤	41,600	233,376.00	0.02
270	688396	华润微	3,536	228,425.60	0.02
271	300680	隆盛科技	7,300	227,760.00	0.02
272	603659	璞泰来	1,400	224,854.00	0.02
273	601607	上海医药	11,200	222,544.00	0.02
274	000596	古井贡酒	900	219,600.00	0.02
275	600894	广日股份	28,800	217,152.00	0.02
276	601086	国芳集团	54,200	214,632.00	0.02
277	300896	爱美客	400	214,444.00	0.02
278	002304	洋河股份	1,300	214,149.00	0.02
279	002677	浙江美大	12,200	211,670.00	0.02
280	002724	海洋王	12,800	209,280.00	0.02
281	600967	内蒙一机	17,500	209,125.00	0.02
282	002527	新时达	25,000	209,000.00	0.02
283	603739	蔚蓝生物	11,100	206,460.00	0.02
284	002107	沃华医药	27,900	206,460.00	0.02
285	600724	宁波富达	56,200	206,254.00	0.02
286	600426	华鲁恒升	6,420	200,946.00	0.02
287	002812	恩捷股份	800	200,320.00	0.02
288	300363	博腾股份	2,200	196,790.00	0.02
289	002394	联发股份	23,600	193,756.00	0.02
290	002315	焦点科技	11,400	193,572.00	0.02
291	601882	海天精工	7,800	193,206.00	0.02
292	002381	双箭股份	23,700	191,496.00	0.02
293	601216	君正集团	36,600	191,418.00	0.02
294	600675	中华企业	63,200	190,232.00	0.02
295	603839	安正时尚	21,820	190,052.20	0.02
296	000906	浙商中拓	17,100	189,981.00	0.02
297	000900	现代投资	44,900	189,478.00	0.02

298	601019	山东出版	30,800	189,420.00	0.02
299	002008	大族激光	3,500	189,000.00	0.02
300	002014	永新股份	22,000	188,760.00	0.02
301	002388	新亚制程	33,500	188,605.00	0.02
302	002887	绿茵生态	19,200	187,968.00	0.02
303	600987	航民股份	33,800	187,928.00	0.02
304	600269	赣粤高速	54,600	187,278.00	0.02
305	002714	牧原股份	3,500	186,760.00	0.02
306	002938	鹏鼎控股	4,400	186,692.00	0.02
307	300390	天华超净	2,300	186,300.00	0.02
308	600846	同济科技	22,700	185,232.00	0.02
309	603369	今世缘	3,400	184,960.00	0.02
310	600886	国投电力	16,000	183,520.00	0.02
311	002916	深南电路	1,500	182,730.00	0.02
312	688356	键凯科技	538	181,375.94	0.02
313	300349	金卡智能	14,900	179,545.00	0.02
314	600690	海尔智家	6,000	179,340.00	0.02
315	600373	中文传媒	14,500	179,220.00	0.02
316	600123	兰花科创	19,000	178,030.00	0.02
317	000848	承德露露	16,400	177,940.00	0.02
318	601566	九牧王	14,300	176,748.00	0.02
319	603328	依顿电子	22,000	176,000.00	0.02
320	300773	拉卡拉	6,000	174,120.00	0.01
321	000800	一汽解放	16,900	173,901.00	0.01
322	601231	环旭电子	10,700	171,842.00	0.01
323	600862	中航高科	4,800	171,648.00	0.01
324	603444	吉比特	400	168,740.00	0.01
325	600429	三元股份	28,000	168,280.00	0.01
326	002555	三七互娱	6,200	167,524.00	0.01
327	300171	东富龙	3,300	166,782.00	0.01
328	603676	卫信康	17,900	166,291.00	0.01
329	300130	新国都	11,300	165,884.00	0.01
330	600502	安徽建工	39,700	164,755.00	0.01
331	603599	广信股份	4,200	163,800.00	0.01
332	601233	桐昆股份	7,700	163,086.00	0.01
333	601699	潞安环能	14,300	161,733.00	0.01
334	000976	华铁股份	28,800	159,840.00	0.01
335	601001	晋控煤业	16,600	159,526.00	0.01
336	600606	绿地控股	36,400	157,976.00	0.01
337	002459	晶澳科技	1,700	157,590.00	0.01
338	002884	凌霄泵业	5,600	156,632.00	0.01
339	603225	新凤鸣	10,500	155,925.00	0.01
340	000048	京基智农	8,900	154,059.00	0.01

341	300552	万集科技	3,800	153,102.00	0.01
342	688198	佰仁医疗	600	152,580.00	0.01
343	300837	浙矿股份	3,000	152,340.00	0.01
344	002109	兴化股份	25,100	151,855.00	0.01
345	601881	中国银河	13,500	151,065.00	0.01
346	300498	温氏股份	7,800	150,228.00	0.01
347	600018	上港集团	27,300	149,604.00	0.01
348	300327	中颖电子	2,200	149,380.00	0.01
349	603886	元祖股份	6,300	148,365.00	0.01
350	603833	欧派家居	1,000	147,500.00	0.01
351	603707	健友股份	3,500	147,000.00	0.01
352	000338	潍柴动力	8,200	146,698.00	0.01
353	600295	鄂尔多斯	6,200	146,258.00	0.01
354	002543	万和电气	19,300	146,101.00	0.01
355	300231	银信科技	16,300	146,048.00	0.01
356	601900	南方传媒	16,900	144,664.00	0.01
357	600551	时代出版	17,800	141,866.00	0.01
358	300196	长海股份	8,000	140,240.00	0.01
359	002449	国星光电	13,000	140,140.00	0.01
360	600835	上海机电	8,800	140,096.00	0.01
361	300726	宏达电子	1,400	140,084.00	0.01
362	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.01
363	603127	昭衍新药	1,200	138,516.00	0.01
364	002296	辉煌科技	18,400	138,368.00	0.01
365	002839	张家港行	24,000	138,240.00	0.01
366	002757	南兴股份	9,000	137,250.00	0.01
367	002133	广宇集团	43,500	136,155.00	0.01
368	000661	长春高新	500	135,700.00	0.01
369	601155	新城控股	4,600	133,998.00	0.01
370	601168	西部矿业	9,800	133,378.00	0.01
371	600665	天地源	42,700	132,370.00	0.01
372	000926	福星股份	31,000	131,750.00	0.01
373	603956	威派格	7,400	131,720.00	0.01
374	600327	大东方	22,100	131,495.00	0.01
375	002352	顺丰控股	1,900	130,948.00	0.01
376	002758	浙农股份	10,475	129,785.25	0.01
377	002202	金风科技	7,800	128,466.00	0.01
378	300751	迈为股份	200	128,460.00	0.01
379	002493	荣盛石化	7,000	127,120.00	0.01
380	601816	京沪高铁	26,200	126,546.00	0.01
381	601636	旗滨集团	7,300	124,830.00	0.01
382	600207	安彩高科	18,400	124,752.00	0.01
383	002815	崇达技术	7,400	124,690.00	0.01

384	002244	滨江集团	26,700	124,422.00	0.01
385	300821	东岳硅材	6,800	124,304.00	0.01
386	603993	洛阳钼业	22,000	122,760.00	0.01
387	002605	姚记科技	5,400	122,742.00	0.01
388	688030	山石网科	4,100	121,606.00	0.01
389	300711	广哈通信	8,700	121,191.00	0.01
390	688598	金博股份	340	120,713.60	0.01
391	002179	中航光电	1,200	120,672.00	0.01
392	603848	好太太	8,700	120,495.00	0.01
393	000965	天保基建	46,300	120,380.00	0.01
394	002349	精华制药	10,600	119,568.00	0.01
395	688388	嘉元科技	950	119,272.50	0.01
396	601800	中国交建	13,900	119,262.00	0.01
397	300840	酷特智能	10,200	118,116.00	0.01
398	601015	陕西黑猫	18,100	117,288.00	0.01
399	000031	大悦城	31,400	117,122.00	0.01
400	002024	苏宁易购	28,400	117,008.00	0.01
401	603185	上机数控	700	116,886.00	0.01
402	600874	创业环保	16,500	116,655.00	0.01
403	002889	东方嘉盛	4,300	116,272.00	0.01
404	000011	深物业 A	9,900	115,434.00	0.01
405	605266	健之佳	1,500	114,855.00	0.01
406	600603	广汇物流	28,900	114,733.00	0.01
407	000028	国药一致	3,100	114,638.00	0.01
408	300772	运达股份	2,600	114,348.00	0.01
409	300628	亿联网络	1,400	114,030.00	0.01
410	000627	天茂集团	34,400	113,864.00	0.01
411	600460	士兰微	2,100	113,820.00	0.01
412	603156	养元饮品	4,000	113,640.00	0.01
413	002482	广田集团	46,700	113,481.00	0.01
414	601916	浙商银行	32,400	113,400.00	0.01
415	300260	新莱应材	2,400	113,208.00	0.01
416	002061	浙江交科	20,100	112,158.00	0.01
417	000521	长虹美菱	30,500	111,935.00	0.01
418	000402	金融街	19,600	110,936.00	0.01
419	002807	江阴银行	28,800	110,880.00	0.01
420	600285	羚锐制药	7,000	110,600.00	0.01
421	000636	风华高科	3,700	110,260.00	0.01
422	300124	汇川技术	1,600	109,760.00	0.01
423	002958	青农商行	28,300	109,238.00	0.01
424	300112	万讯自控	7,700	108,724.00	0.01
425	300127	银河磁体	4,300	108,575.00	0.01
426	601666	平煤股份	12,900	107,973.00	0.01

427	300408	三环集团	2,400	107,040.00	0.01
428	000667	美好置业	61,500	107,010.00	0.01
429	000893	亚钾国际	4,000	106,600.00	0.01
430	300015	爱尔眼科	2,500	105,700.00	0.01
431	002585	双星新材	3,900	105,612.00	0.01
432	000415	渤海租赁	36,153	105,205.23	0.01
433	001872	招商港口	6,200	105,090.00	0.01
434	002948	青岛银行	22,600	104,638.00	0.01
435	002088	鲁阳节能	4,000	104,000.00	0.01
436	000960	锡业股份	5,300	103,509.00	0.01
437	002968	新大正	2,900	102,747.00	0.01
438	002952	亚世光电	7,700	102,179.00	0.01
439	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
440	600571	信雅达	8,300	101,592.00	0.01
441	000046	泛海控股	54,000	101,520.00	0.01
442	300575	中旗股份	4,500	101,025.00	0.01
443	300512	中亚股份	6,300	100,548.00	0.01
444	603327	福蓉科技	5,700	100,320.00	0.01
445	000166	申万宏源	19,500	99,840.00	0.01
446	600763	通策医疗	500	99,500.00	0.01
447	688566	吉贝尔	4,338	98,993.16	0.01
448	688768	容知日新	907	98,445.78	0.01
449	300782	卓胜微	300	98,040.00	0.01
450	300613	富瀚微	600	97,830.00	0.01
451	002850	科达利	600	96,204.00	0.01
452	300519	新光药业	4,700	94,893.00	0.01
453	603321	梅轮电梯	13,300	94,696.00	0.01
454	601518	吉林高速	35,000	94,500.00	0.01
455	603289	泰瑞机器	9,700	93,799.00	0.01
456	688078	龙软科技	1,575	91,665.00	0.01
457	600880	博瑞传播	12,200	91,622.00	0.01
458	600110	诺德股份	5,700	90,915.00	0.01
459	600933	爱柯迪	4,700	90,616.00	0.01
460	300559	佳发教育	10,000	90,600.00	0.01
461	600739	辽宁成大	4,600	89,792.00	0.01
462	600742	一汽富维	7,500	89,700.00	0.01
463	600010	包钢股份	31,800	88,722.00	0.01
464	603803	瑞斯康达	11,200	88,704.00	0.01
465	300601	康泰生物	900	88,686.00	0.01
466	300696	爱乐达	1,700	88,298.00	0.01
467	000421	南京公用	17,800	87,932.00	0.01
468	002007	华兰生物	3,000	87,420.00	0.01
469	300190	维尔利	14,200	86,620.00	0.01

470	002412	汉森制药	13,600	86,360.00	0.01
471	603689	皖天然气	8,200	86,264.00	0.01
472	600711	盛屯矿业	8,000	85,840.00	0.01
473	688521	芯原股份	1,100	85,096.00	0.01
474	300121	阳谷华泰	7,300	84,753.00	0.01
475	000798	中水渔业	10,900	84,148.00	0.01
476	600190	锦州港	29,200	83,220.00	0.01
477	600192	长城电工	14,100	82,344.00	0.01
478	002759	天际股份	2,800	82,040.00	0.01
479	603768	常青股份	4,900	82,026.00	0.01
480	300852	四会富仕	1,400	81,788.00	0.01
481	601799	星宇股份	400	81,700.00	0.01
482	002641	永高股份	14,900	81,652.00	0.01
483	002820	桂发祥	8,000	81,600.00	0.01
484	300417	南华仪器	6,700	81,204.00	0.01
485	300595	欧普康视	1,400	80,318.00	0.01
486	600510	黑牡丹	10,600	79,288.00	0.01
487	688418	震有科技	5,200	78,936.00	0.01
488	002380	科远智慧	5,400	78,786.00	0.01
489	002517	恺英网络	13,500	78,570.00	0.01
490	300861	美畅股份	1,000	77,770.00	0.01
491	300154	瑞凌股份	11,500	77,740.00	0.01
492	000553	安道麦 A	9,200	77,648.00	0.01
493	002267	陕天然气	10,500	77,385.00	0.01
494	688098	申联生物	7,000	77,280.00	0.01
495	002111	威海广泰	6,300	77,112.00	0.01
496	300641	正丹股份	11,000	77,000.00	0.01
497	603528	多伦科技	11,000	76,890.00	0.01
498	688010	福光股份	2,700	76,005.00	0.01
499	600545	卓郎智能	25,200	75,852.00	0.01
500	603053	成都燃气	7,300	75,847.00	0.01
501	000541	佛山照明	13,400	75,710.00	0.01
502	601615	明阳智能	2,900	75,690.00	0.01
503	600917	重庆燃气	9,000	75,510.00	0.01
504	300723	一品红	2,100	75,390.00	0.01
505	600025	华能水电	11,400	75,126.00	0.01
506	300515	三德科技	5,600	74,312.00	0.01
507	600389	江山股份	1,800	74,016.00	0.01
508	601568	北元集团	9,100	73,983.00	0.01
509	600372	中航电子	3,300	73,887.00	0.01
510	603166	福达股份	8,500	73,865.00	0.01
511	601886	江河集团	11,200	73,808.00	0.01
512	603711	香飘飘	4,500	73,800.00	0.01

513	603712	七一二	1,700	73,610.00	0.01
514	002841	视源股份	900	73,260.00	0.01
515	600971	恒源煤电	11,300	72,998.00	0.01
516	300033	同花顺	500	72,290.00	0.01
517	603159	上海亚虹	4,600	72,082.00	0.01
518	603267	鸿远电子	400	71,776.00	0.01
519	603738	泰晶科技	1,200	71,160.00	0.01
520	002346	柘中股份	3,700	70,929.00	0.01
521	002013	中航机电	3,900	70,902.00	0.01
522	002539	云图控股	5,300	70,331.00	0.01
523	603203	快克股份	1,900	70,053.00	0.01
524	601236	红塔证券	5,800	69,136.00	0.01
525	002064	华峰化学	6,600	68,904.00	0.01
526	688399	硕世生物	500	68,750.00	0.01
527	002607	中公教育	8,600	67,596.00	0.01
528	300114	中航电测	3,800	67,184.00	0.01
529	300223	北京君正	500	67,000.00	0.01
530	600853	龙建股份	24,100	66,757.00	0.01
531	002254	泰和新材	3,400	66,674.00	0.01
532	002082	万邦德	4,500	66,555.00	0.01
533	603025	大豪科技	2,500	65,975.00	0.01
534	002925	盈趣科技	1,900	64,657.00	0.01
535	300299	富春股份	9,700	64,117.00	0.01
536	002738	中矿资源	900	63,324.00	0.01
537	300493	润欣科技	7,900	63,042.00	0.01
538	002043	兔宝宝	5,200	62,816.00	0.01
539	600299	安迪苏	5,000	61,600.00	0.01
540	603612	索通发展	3,000	61,560.00	0.01
541	000877	天山股份	4,000	61,240.00	0.01
542	002949	华阳国际	3,300	60,390.00	0.01
543	600566	济川药业	2,100	59,514.00	0.01
544	300747	锐科激光	1,000	59,110.00	0.01
545	603516	淳中科技	2,900	58,812.00	0.01
546	002558	巨人网络	4,900	58,653.00	0.01
547	601100	恒立液压	700	57,260.00	0.00
548	300667	必创科技	2,500	57,075.00	0.00
549	603589	口子窖	800	56,696.00	0.00
550	688579	山大地纬	4,300	55,900.00	0.00
551	603217	元利科技	1,100	55,748.00	0.00
552	600348	华阳股份	4,700	55,695.00	0.00
553	002989	中天精装	2,200	55,638.00	0.00
554	002545	东方铁塔	6,100	55,632.00	0.00
555	605006	山东玻纤	4,000	55,600.00	0.00

556	002253	川大智胜	3,100	55,304.00	0.00
557	600831	广电网络	8,900	55,091.00	0.00
558	002978	安宁股份	1,300	54,964.00	0.00
559	002955	鸿合科技	2,500	54,550.00	0.00
560	301177	迪阿股份	469	54,441.52	0.00
561	002642	荣联科技	9,500	54,435.00	0.00
562	002116	中国海诚	7,600	54,264.00	0.00
563	000156	华数传媒	6,400	54,144.00	0.00
564	688369	致远互联	760	54,074.00	0.00
565	688099	晶晨股份	412	53,642.40	0.00
566	300465	高伟达	4,400	53,548.00	0.00
567	300529	健帆生物	1,000	53,300.00	0.00
568	601933	永辉超市	13,100	53,055.00	0.00
569	002421	达实智能	13,600	52,496.00	0.00
570	603806	福斯特	400	52,220.00	0.00
571	300504	天邑股份	2,700	52,218.00	0.00
572	601865	福莱特	900	52,146.00	0.00
573	002469	三维化学	7,700	52,129.00	0.00
574	002066	瑞泰科技	4,700	52,076.00	0.00
575	688004	博汇科技	1,480	52,036.80	0.00
576	300034	钢研高纳	900	51,840.00	0.00
577	600728	佳都科技	6,200	51,646.00	0.00
578	603999	读者传媒	9,400	51,512.00	0.00
579	002137	实益达	8,500	51,425.00	0.00
580	601949	中国出版	8,800	51,392.00	0.00
581	002311	海大集团	700	51,310.00	0.00
582	002648	卫星化学	1,280	51,238.40	0.00
583	002222	福晶科技	2,700	51,111.00	0.00
584	600810	神马股份	4,100	51,045.00	0.00
585	300380	安硕信息	3,000	50,880.00	0.00
586	603616	韩建河山	8,400	50,820.00	0.00
587	688398	赛特新材	1,000	50,800.00	0.00
588	002161	远望谷	10,000	50,800.00	0.00
589	600578	京能电力	15,100	50,736.00	0.00
590	603118	共进股份	5,300	50,668.00	0.00
591	002325	洪涛股份	17,700	50,622.00	0.00
592	603106	恒银科技	8,300	50,547.00	0.00
593	688313	仕佳光子	3,900	50,271.00	0.00
594	003013	地铁设计	2,500	50,200.00	0.00
595	603186	华正新材	1,200	50,148.00	0.00
596	002876	三利谱	800	49,984.00	0.00
597	002152	广电运通	4,200	49,980.00	0.00
598	002065	东华软件	6,400	49,920.00	0.00

599	688016	心脉医疗	200	49,748.00	0.00
600	300548	博创科技	1,500	49,560.00	0.00
601	002062	宏润建设	12,200	49,532.00	0.00
602	002811	郑中设计	5,500	49,445.00	0.00
603	300596	利安隆	1,100	49,236.00	0.00
604	600795	国电电力	15,500	49,135.00	0.00
605	300769	德方纳米	100	49,116.00	0.00
606	600819	耀皮玻璃	8,800	49,104.00	0.00
607	600939	重庆建工	12,000	49,080.00	0.00
608	002281	光迅科技	2,100	48,909.00	0.00
609	600497	驰宏锌锗	9,800	48,902.00	0.00
610	000761	本钢板材	11,600	48,720.00	0.00
611	002327	富安娜	5,700	48,678.00	0.00
612	002233	塔牌集团	4,600	48,668.00	0.00
613	603929	亚翔集成	4,000	48,640.00	0.00
614	603003	龙宇燃油	6,800	48,552.00	0.00
615	600756	浪潮软件	3,700	48,507.00	0.00
616	002039	黔源电力	2,300	48,484.00	0.00
617	600231	凌钢股份	18,200	48,412.00	0.00
618	688578	艾力斯	1,600	48,320.00	0.00
619	002541	鸿路钢构	900	48,186.00	0.00
620	688055	龙腾光电	7,027	48,134.95	0.00
621	601969	海南矿业	4,000	48,040.00	0.00
622	300891	惠云钛业	3,000	48,030.00	0.00
623	600180	瑞茂通	6,700	47,838.00	0.00
624	300042	朗科科技	3,100	47,678.00	0.00
625	300740	水羊股份	3,000	47,670.00	0.00
626	301050	雷电微力	203	47,652.22	0.00
627	002401	中远海科	4,700	47,564.00	0.00
628	600714	金瑞矿业	3,500	47,390.00	0.00
629	002396	星网锐捷	2,000	47,140.00	0.00
630	600029	南方航空	6,900	46,989.00	0.00
631	300592	华凯创意	2,500	46,800.00	0.00
632	603232	格尔软件	2,900	46,690.00	0.00
633	603383	顶点软件	1,300	46,670.00	0.00
634	000977	浪潮信息	1,300	46,579.00	0.00
635	300621	维业股份	5,100	46,563.00	0.00
636	600623	华谊集团	5,100	46,410.00	0.00
637	603602	纵横通信	4,500	46,260.00	0.00
638	688188	柏楚电子	119	45,869.74	0.00
639	688258	卓易信息	1,300	45,864.00	0.00
640	300768	迪普科技	1,100	45,375.00	0.00
641	300037	新宙邦	400	45,200.00	0.00

642	603496	恒为科技	2,900	44,950.00	0.00
643	600676	交运股份	10,400	44,928.00	0.00
644	000851	高鸿股份	7,500	44,850.00	0.00
645	300682	朗新科技	1,200	44,436.00	0.00
646	300181	佐力药业	3,800	44,308.00	0.00
647	603392	万泰生物	200	44,300.00	0.00
648	603938	三孚股份	1,200	44,148.00	0.00
649	000938	紫光股份	1,900	43,415.00	0.00
650	002466	天齐锂业	400	42,800.00	0.00
651	688333	铂力特	200	42,600.00	0.00
652	688029	南微医学	200	42,534.00	0.00
653	601878	浙商证券	3,200	42,176.00	0.00
654	601808	中海油服	2,800	42,000.00	0.00
655	300393	中来股份	2,200	41,888.00	0.00
656	603901	永创智能	2,600	41,860.00	0.00
657	600989	宝丰能源	2,400	41,664.00	0.00
658	600416	湘电股份	1,900	41,591.00	0.00
659	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
660	600015	华夏银行	7,400	41,440.00	0.00
661	600170	上海建工	11,500	41,400.00	0.00
662	000683	远兴能源	5,600	40,880.00	0.00
663	600851	海欣股份	4,599	40,839.12	0.00
664	000862	银星能源	4,600	40,756.00	0.00
665	000703	恒逸石化	3,800	40,356.00	0.00
666	600362	江西铜业	1,800	40,194.00	0.00
667	600151	航天机电	2,900	40,165.00	0.00
668	300721	怡达股份	800	40,080.00	0.00
669	603105	芯能科技	2,400	39,888.00	0.00
670	300550	和仁科技	3,100	39,835.00	0.00
671	002120	韵达股份	1,900	38,874.00	0.00
672	603290	斯达半导	100	38,100.00	0.00
673	600537	亿晶光电	8,000	37,840.00	0.00
674	600570	恒生电子	600	37,290.00	0.00
675	603396	金辰股份	300	36,900.00	0.00
676	300627	华测导航	800	36,800.00	0.00
677	688138	清溢光电	1,900	36,518.00	0.00
678	600875	东方电气	1,700	36,414.00	0.00
679	603218	日月股份	1,100	36,245.00	0.00
680	300091	金通灵	5,700	35,967.00	0.00
681	300569	天能重工	2,400	35,856.00	0.00
682	002610	爱康科技	7,600	35,720.00	0.00
683	300118	东方日升	1,100	35,717.00	0.00
684	002059	云南旅游	5,900	35,459.00	0.00

685	002580	圣阳股份	4,300	35,174.00	0.00
686	002218	拓日新能	5,200	35,152.00	0.00
687	300080	易成新能	6,000	34,920.00	0.00
688	300185	通裕重工	9,700	34,920.00	0.00
689	688017	绿的谐波	200	34,912.00	0.00
690	002531	天顺风能	1,800	34,902.00	0.00
691	300443	金雷股份	600	34,656.00	0.00
692	300149	睿智医药	2,500	34,525.00	0.00
693	601727	上海电气	7,100	34,506.00	0.00
694	300083	创世纪	2,400	34,272.00	0.00
695	600163	中闽能源	3,900	34,203.00	0.00
696	603043	广州酒家	1,400	33,684.00	0.00
697	601218	吉鑫科技	6,100	33,611.00	0.00
698	603628	清源股份	2,500	33,425.00	0.00
699	601908	京运通	3,600	33,012.00	0.00
700	603507	振江股份	800	32,720.00	0.00
701	000887	中鼎股份	1,500	32,715.00	0.00
702	002506	协鑫集成	8,600	32,680.00	0.00
703	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
704	601689	拓普集团	600	31,800.00	0.00
705	688368	晶丰明源	99	31,689.90	0.00
706	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.00
707	300623	捷捷微电	1,000	31,460.00	0.00
708	600577	精达股份	4,200	31,248.00	0.00
709	600703	三安光电	806	30,273.36	0.00
710	600733	北汽蓝谷	3,000	30,060.00	0.00
711	603305	旭升股份	600	29,928.00	0.00
712	600885	宏发股份	400	29,856.00	0.00
713	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
714	600196	复星医药	600	29,364.00	0.00
715	002212	天融信	1,500	28,755.00	0.00
716	600588	用友网络	800	28,704.00	0.00
717	002966	苏州银行	4,200	28,434.00	0.00
718	603239	浙江仙通	1,600	28,000.00	0.00
719	688095	福昕软件	200	27,602.00	0.00
720	002906	华阳集团	500	27,480.00	0.00
721	002623	亚玛顿	800	27,328.00	0.00
722	600079	人福医药	1,200	27,024.00	0.00
723	300294	博雅生物	700	26,845.00	0.00
724	688180	君实生物	400	26,792.00	0.00
725	688561	奇安信	300	26,376.00	0.00
726	300636	同和药业	1,000	26,360.00	0.00
727	002276	万马股份	2,900	26,129.00	0.00

728	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
729	603319	湘油泵	1,000	25,720.00	0.00
730	603730	岱美股份	1,100	25,652.00	0.00
731	300776	帝尔激光	100	25,590.00	0.00
732	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
733	688008	澜起科技	300	25,161.00	0.00
734	603089	正裕工业	2,700	25,137.00	0.00
735	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
736	002441	众业达	2,400	24,480.00	0.00
737	688157	松井股份	200	24,340.00	0.00
738	600406	国电南瑞	600	24,018.00	0.00
739	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
740	300434	金石亚药	2,200	23,892.00	0.00
741	600664	哈药股份	6,700	23,785.00	0.00
742	300406	九强生物	1,200	23,784.00	0.00
743	300416	苏试试验	700	23,765.00	0.00
744	300639	凯普生物	800	23,608.00	0.00
745	605222	起帆电缆	900	23,391.00	0.00
746	300138	晨光生物	1,400	23,380.00	0.00
747	600009	上海机场	500	23,345.00	0.00
748	002729	好利科技	500	23,320.00	0.00
749	600563	法拉电子	100	23,240.00	0.00
750	603816	顾家家居	300	23,148.00	0.00
751	600380	健康元	1,800	23,112.00	0.00
752	600718	东软集团	1,700	23,052.00	0.00
753	300110	华仁药业	4,800	23,040.00	0.00
754	300401	花园生物	1,600	23,008.00	0.00
755	688299	长阳科技	700	22,890.00	0.00
756	300413	芒果超媒	400	22,888.00	0.00
757	300453	三鑫医疗	1,800	22,734.00	0.00
758	002824	和胜股份	500	22,685.00	0.00
759	603666	亿嘉和	300	22,536.00	0.00
760	603112	华翔股份	1,700	22,440.00	0.00
761	600267	海正药业	1,600	22,384.00	0.00
762	300470	中密控股	500	22,335.00	0.00
763	300268	佳沃食品	1,200	22,248.00	0.00
764	002595	豪迈科技	800	22,208.00	0.00
765	000514	渝开发	5,600	22,176.00	0.00
766	688101	三达膜	1,100	22,110.00	0.00
767	002408	齐翔腾达	2,100	22,050.00	0.00
768	600803	新奥股份	1,200	22,032.00	0.00
769	605009	豪悦护理	400	21,996.00	0.00
770	600273	嘉化能源	1,900	21,983.00	0.00

771	002105	信隆健康	2,200	21,978.00	0.00
772	688516	奥特维	89	21,869.08	0.00
773	603366	日出东方	4,300	21,801.00	0.00
774	600592	龙溪股份	2,100	21,735.00	0.00
775	300193	佳士科技	1,700	21,675.00	0.00
776	603160	汇顶科技	200	21,554.00	0.00
777	688001	华兴源创	600	21,522.00	0.00
778	300012	华测检测	800	21,496.00	0.00
779	300067	安诺其	4,900	21,364.00	0.00
780	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
781	688308	欧科亿	300	21,204.00	0.00
782	603087	甘李药业	300	21,102.00	0.00
783	600650	锦江在线	2,200	21,098.00	0.00
784	300705	九典制药	600	21,084.00	0.00
785	600105	永鼎股份	3,900	20,943.00	0.00
786	000657	中钨高新	1,300	20,904.00	0.00
787	603950	长源东谷	1,200	20,880.00	0.00
788	603429	集友股份	800	20,880.00	0.00
789	002698	博实股份	1,600	20,864.00	0.00
790	603617	君禾股份	1,700	20,859.00	0.00
791	600383	金地集团	1,600	20,752.00	0.00
792	300352	北信源	3,400	20,740.00	0.00
793	300445	康斯特	1,400	20,734.00	0.00
794	600346	恒力石化	900	20,673.00	0.00
795	002266	浙富控股	2,900	20,648.00	0.00
796	002434	万里扬	1,400	20,636.00	0.00
797	300620	光库科技	400	20,604.00	0.00
798	603298	杭叉集团	1,200	20,580.00	0.00
799	603220	中贝通信	1,300	20,527.00	0.00
800	688015	交控科技	557	20,497.60	0.00
801	601965	中国汽研	1,100	20,471.00	0.00
802	603277	银都股份	1,100	20,350.00	0.00
803	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
804	688586	江航装备	600	20,340.00	0.00
805	300226	上海钢联	500	20,325.00	0.00
806	688036	传音控股	129	20,240.10	0.00
807	603855	华荣股份	800	20,224.00	0.00
808	600060	海信视像	1,500	20,175.00	0.00
809	600829	人民同泰	3,000	20,160.00	0.00
810	002877	智能自控	2,900	20,068.00	0.00
811	002743	富煌钢构	2,800	20,048.00	0.00
812	002593	日上集团	4,900	20,041.00	0.00
813	603020	爱普股份	1,400	19,908.00	0.00

814	000913	钱江摩托	1,400	19,866.00	0.00
815	688335	复洁环保	600	19,860.00	0.00
816	600888	新疆众和	2,400	19,848.00	0.00
817	603859	能科科技	500	19,845.00	0.00
818	600066	宇通客车	1,800	19,836.00	0.00
819	688298	东方生物	86	19,823.00	0.00
820	300395	菲利华	300	19,722.00	0.00
821	600824	益民集团	5,100	19,686.00	0.00
822	002808	恒久科技	2,400	19,656.00	0.00
823	000403	派林生物	700	19,621.00	0.00
824	300825	阿尔特	700	19,607.00	0.00
825	300792	壹网壹创	400	19,600.00	0.00
826	603199	九华旅游	900	19,548.00	0.00
827	002150	通润装备	3,100	19,530.00	0.00
828	603915	国茂股份	500	19,450.00	0.00
829	002833	弘亚数控	600	19,308.00	0.00
830	002472	双环传动	700	19,306.00	0.00
831	300454	深信服	100	19,100.00	0.00
832	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
833	688312	燕麦科技	700	18,900.00	0.00
834	600660	福耀玻璃	400	18,856.00	0.00
835	002236	大华股份	800	18,784.00	0.00
836	002690	美亚光电	500	18,730.00	0.00
837	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
838	603022	新通联	1,500	18,600.00	0.00
839	601188	龙江交通	5,300	18,550.00	0.00
840	002282	博深股份	2,000	18,380.00	0.00
841	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
842	600814	杭州解百	2,800	18,284.00	0.00
843	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
844	300748	金力永磁	400	17,956.00	0.00
845	300211	亿通科技	1,400	17,920.00	0.00
846	600459	贵研铂业	700	17,815.00	0.00
847	600148	长春一东	1,000	17,520.00	0.00
848	603357	设计总院	1,900	17,518.00	0.00
849	603797	联泰环保	2,500	17,450.00	0.00
850	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
851	603129	春风动力	100	17,300.00	0.00
852	000573	粤宏远 A	5,400	17,172.00	0.00
853	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
854	600547	山东黄金	900	16,938.00	0.00
855	300142	沃森生物	300	16,860.00	0.00
856	002428	云南锗业	1,400	16,800.00	0.00

857	002149	西部材料	900	16,668.00	0.00
858	603663	三祥新材	600	16,650.00	0.00
859	600655	豫园股份	1,600	16,480.00	0.00
860	600330	天通股份	1,000	16,230.00	0.00
861	601877	正泰电器	300	16,167.00	0.00
862	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
863	000969	安泰科技	1,500	16,065.00	0.00
864	002182	云海金属	700	16,058.00	0.00
865	002977	火箭科技	200	16,012.00	0.00
866	688981	中芯国际	301	15,949.99	0.00
867	300656	民德电子	300	15,945.00	0.00
868	000762	西藏矿业	300	15,939.00	0.00
869	002842	翔鹭钨业	1,700	15,929.00	0.00
870	600549	厦门钨业	700	15,841.00	0.00
871	002378	章源钨业	1,900	15,808.00	0.00
872	000975	银泰黄金	1,800	15,804.00	0.00
873	002271	东方雨虹	300	15,804.00	0.00
874	002167	东方锆业	2,000	15,800.00	0.00
875	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
876	688599	天合光能	200	15,780.00	0.00
877	601958	金钼股份	2,300	15,755.00	0.00
878	002230	科大讯飞	300	15,753.00	0.00
879	600392	盛和资源	800	15,696.00	0.00
880	300650	太龙股份	500	15,615.00	0.00
881	000062	深圳华强	900	15,507.00	0.00
882	603045	福达合金	900	15,444.00	0.00
883	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
884	603399	吉翔股份	2,300	15,203.00	0.00
885	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
886	603979	金诚信	700	15,036.00	0.00
887	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
888	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
889	600638	新黄浦	2,600	14,898.00	0.00
890	002286	保龄宝	1,100	14,872.00	0.00
891	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
892	600259	广晟有色	300	14,772.00	0.00
893	601066	中信建投	500	14,625.00	0.00
894	601633	长城汽车	300	14,562.00	0.00
895	300102	乾照光电	1,600	14,384.00	0.00
896	600456	宝钛股份	200	14,356.00	0.00
897	688009	中国通号	2,866	14,272.68	0.00
898	300566	激智科技	500	14,210.00	0.00
899	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00

900	002937	兴瑞科技	700	14,112.00	0.00
901	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
902	300131	英唐智控	1,700	13,838.00	0.00
903	603936	博敏电子	800	13,760.00	0.00
904	002456	欧菲光	1,400	13,580.00	0.00
905	002197	证通电子	1,500	13,155.00	0.00
906	300305	裕兴股份	700	13,132.00	0.00
907	002192	融捷股份	100	13,015.00	0.00
908	688012	中微公司	102	12,913.20	0.00
909	300708	聚灿光电	700	12,887.00	0.00
910	002881	美格智能	300	12,864.00	0.00
911	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
912	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
913	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
914	600980	北矿科技	700	12,663.00	0.00
915	002528	英飞拓	3,400	12,648.00	0.00
916	000727	冠捷科技	4,200	12,642.00	0.00
917	300602	飞荣达	500	12,555.00	0.00
918	300155	安居宝	1,800	12,546.00	0.00
919	002655	共达电声	700	12,509.00	0.00
920	002782	可立克	700	12,509.00	0.00
921	002130	沃尔核材	1,500	12,375.00	0.00
922	002923	润都股份	500	12,255.00	0.00
923	002132	恒星科技	2,000	12,220.00	0.00
924	002922	伊戈尔	600	12,186.00	0.00
925	002341	新纶新材	2,200	12,122.00	0.00
926	600023	浙能电力	3,000	12,120.00	0.00
927	300007	汉威科技	400	12,088.00	0.00
928	600288	大恒科技	900	12,051.00	0.00
929	002681	奋达科技	3,100	12,028.00	0.00
930	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
931	002369	卓翼科技	1,600	11,904.00	0.00
932	002521	齐峰新材	1,900	11,894.00	0.00
933	002845	同兴达	400	11,820.00	0.00
934	300227	光韵达	1,200	11,808.00	0.00
935	600717	天津港	2,800	11,732.00	0.00
936	002351	漫步者	1,000	11,720.00	0.00
937	002301	齐心集团	1,400	11,718.00	0.00
938	000831	五矿稀土	300	11,706.00	0.00
939	002141	贤丰控股	1,800	11,664.00	0.00
940	300232	洲明科技	1,300	11,622.00	0.00
941	300739	明阳电路	600	11,586.00	0.00
942	300657	弘信电子	700	11,557.00	0.00

943	300069	金利华电	500	11,530.00	0.00
944	300545	联得装备	500	11,500.00	0.00
945	600639	浦东金桥	900	11,493.00	0.00
946	603508	思维列控	500	11,490.00	0.00
947	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
948	600157	永泰能源	6,300	11,466.00	0.00
949	002587	奥拓电子	2,100	11,445.00	0.00
950	300220	金运激光	600	11,370.00	0.00
951	300543	朗科智能	800	11,200.00	0.00
952	000988	华工科技	400	11,144.00	0.00
953	000021	深科技	700	11,088.00	0.00
954	002902	铭普光磁	800	11,048.00	0.00
955	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
956	300516	久之洋	300	10,761.00	0.00
957	300462	华铭智能	800	10,560.00	0.00
958	300679	电连技术	200	10,500.00	0.00
959	300752	隆利科技	300	10,425.00	0.00
960	000822	山东海化	1,500	10,425.00	0.00
961	300681	英搏尔	100	10,220.00	0.00
962	000951	中国重汽	600	10,134.00	0.00
963	600600	青岛啤酒	100	9,900.00	0.00
964	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
965	601377	兴业证券	1,000	9,880.00	0.00
966	300360	炬华科技	800	9,872.00	0.00
967	300491	通合科技	500	9,850.00	0.00
968	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
969	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
970	002001	新和成	300	9,336.00	0.00
971	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
972	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
973	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
974	300660	江苏雷利	300	8,790.00	0.00
975	600699	均胜电子	400	8,788.00	0.00
976	688139	海尔生物	96	8,718.72	0.00
977	603179	新泉股份	200	8,656.00	0.00
978	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
979	300909	汇创达	200	8,610.00	0.00
980	600469	风神股份	1,700	8,483.00	0.00
981	601989	中国重工	2,000	8,440.00	0.00
982	688177	百奥泰	326	8,420.58	0.00
983	603063	禾望电气	200	8,062.00	0.00
984	000963	华东医药	200	8,040.00	0.00
985	603786	科博达	100	8,030.00	0.00

986	600918	中泰证券	800	7,976.00	0.00
987	300733	西菱动力	300	7,884.00	0.00
988	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
989	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
990	603838	四通股份	1,000	7,810.00	0.00
991	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
992	000510	新金路	1,300	7,683.00	0.00
993	688039	当虹科技	100	7,682.00	0.00
994	603286	日盈电子	400	7,664.00	0.00
995	300580	贝斯特	300	7,662.00	0.00
996	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
997	603677	奇精机械	600	7,596.00	0.00
998	002050	三花智控	300	7,590.00	0.00
999	002602	世纪华通	900	7,551.00	0.00
1,000	603001	奥康国际	800	7,544.00	0.00
1,001	002126	银轮股份	600	7,536.00	0.00
1,002	000554	泰山石油	1,400	7,462.00	0.00
1,003	600618	氯碱化工	600	7,446.00	0.00
1,004	600150	中国船舶	300	7,437.00	0.00
1,005	600523	贵航股份	300	7,320.00	0.00
1,006	000768	中航西飞	200	7,300.00	0.00
1,007	002284	亚太股份	700	7,287.00	0.00
1,008	600720	祁连山	700	7,280.00	0.00
1,009	000637	茂化实华	1,500	7,245.00	0.00
1,010	002213	大为股份	400	7,220.00	0.00
1,011	300100	双林股份	700	7,210.00	0.00
1,012	002654	万润科技	1,700	7,208.00	0.00
1,013	300617	安靠智电	100	7,171.00	0.00
1,014	000786	北新建材	200	7,166.00	0.00

1,01 5	603917	合力科技	300	7,140.00	0.00
1,01 6	603728	鸣志电器	300	7,113.00	0.00
1,01 7	603035	常熟汽饰	400	7,088.00	0.00
1,01 8	000559	万向钱潮	1,100	7,007.00	0.00
1,01 9	002865	钧达股份	100	7,000.00	0.00
1,02 0	300742	越博动力	200	6,976.00	0.00
1,02 1	600543	莫高股份	1,000	6,970.00	0.00
1,02 2	603016	新宏泰	300	6,960.00	0.00
1,02 3	603596	伯特利	100	6,960.00	0.00
1,02 4	300473	德尔股份	300	6,948.00	0.00
1,02 5	300507	苏奥传感	500	6,920.00	0.00
1,02 6	600081	东风科技	500	6,835.00	0.00
1,02 7	002921	联诚精密	400	6,832.00	0.00
1,02 8	600847	万里股份	400	6,828.00	0.00
1,02 9	603306	华懋科技	200	6,786.00	0.00
1,03 0	000589	贵州轮胎	1,100	6,765.00	0.00
1,03 1	601696	中银证券	500	6,725.00	0.00
1,03 2	603013	亚普股份	400	6,688.00	0.00
1,03 3	300286	安科瑞	200	6,636.00	0.00
1,03 4	002283	天润工业	700	6,608.00	0.00
1,03 5	603158	腾龙股份	400	6,600.00	0.00
1,03 6	300652	雷迪克	300	6,594.00	0.00

1,03 7	002339	积成电子	800	6,584.00	0.00
1,03 8	002239	奥特佳	1,800	6,570.00	0.00
1,03 9	601567	三星医疗	400	6,524.00	0.00
1,04 0	002516	旷达科技	1,000	6,490.00	0.00
1,04 1	002451	摩恩电气	900	6,489.00	0.00
1,04 2	600379	宝光股份	400	6,484.00	0.00
1,04 3	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
1,04 4	000581	威孚高科	300	6,462.00	0.00
1,04 5	300643	万通智控	500	6,455.00	0.00
1,04 6	603899	晨光文具	100	6,451.00	0.00
1,04 7	603121	华培动力	600	6,444.00	0.00
1,04 8	002121	科陆电子	1,100	6,435.00	0.00
1,04 9	603997	继峰股份	400	6,432.00	0.00
1,05 0	300745	欣锐科技	100	6,420.00	0.00
1,05 1	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
1,05 2	300258	精锻科技	500	6,405.00	0.00
1,05 3	002851	麦格米特	200	6,404.00	0.00
1,05 4	603922	金鸿顺	300	6,378.00	0.00
1,05 5	002715	登云股份	500	6,370.00	0.00
1,05 6	603085	天成自控	800	6,368.00	0.00
1,05 7	601360	三六零	500	6,360.00	0.00
1,05 8	002590	万安科技	600	6,342.00	0.00

1,059	002703	浙江世宝	1,000	6,320.00	0.00
1,060	300999	金龙鱼	100	6,293.00	0.00
1,061	300407	凯发电气	700	6,293.00	0.00
1,062	000656	金科股份	1,400	6,272.00	0.00
1,063	603333	尚纬股份	600	6,264.00	0.00
1,064	603767	中马传动	800	6,264.00	0.00
1,065	603037	凯众股份	300	6,219.00	0.00
1,066	300304	云意电气	900	6,219.00	0.00
1,067	600584	长电科技	200	6,204.00	0.00
1,068	600869	远东股份	900	6,192.00	0.00
1,069	000903	云内动力	1,700	6,188.00	0.00
1,070	603809	豪能股份	300	6,171.00	0.00
1,071	002488	金固股份	700	6,146.00	0.00
1,072	300695	兆丰股份	100	6,144.00	0.00
1,073	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
1,074	300707	威唐工业	300	6,135.00	0.00
1,075	601311	骆驼股份	400	6,132.00	0.00
1,076	000700	模塑科技	1,200	6,120.00	0.00
1,077	002448	中原内配	900	6,093.00	0.00
1,078	603358	华达科技	300	6,084.00	0.00
1,079	000876	新希望	400	6,084.00	0.00
1,080	600845	宝信软件	100	6,083.00	0.00

1,08 1	002617	露笑科技	400	6,080.00	0.00
1,08 2	601238	广汽集团	400	6,076.00	0.00
1,08 3	002298	中电兴发	800	6,072.00	0.00
1,08 4	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
1,08 5	603829	洛凯股份	500	6,065.00	0.00
1,08 6	601222	林洋能源	500	6,065.00	0.00
1,08 7	000921	海信家电	400	6,060.00	0.00
1,08 8	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
1,08 9	603040	新坐标	300	6,045.00	0.00
1,09 0	002085	万丰奥威	1,100	6,039.00	0.00
1,09 1	002169	智光电气	500	6,030.00	0.00
1,09 2	300644	南京聚隆	300	6,012.00	0.00
1,09 3	002328	新朋股份	1,000	6,000.00	0.00
1,09 4	600960	渤海汽车	1,500	5,985.00	0.00
1,09 5	002568	百润股份	100	5,983.00	0.00
1,09 6	002730	电光科技	500	5,975.00	0.00
1,09 7	603758	秦安股份	700	5,971.00	0.00
1,09 8	002536	飞龙股份	700	5,971.00	0.00
1,09 9	000599	青岛双星	1,400	5,964.00	0.00
1,10 0	002662	京威股份	1,400	5,964.00	0.00
1,10 1	600480	凌云股份	600	5,946.00	0.00
1,10 2	603701	德宏股份	600	5,946.00	0.00

1,10 3	000030	富奥股份	800	5,936.00	0.00
1,10 4	600973	宝胜股份	1,000	5,930.00	0.00
1,10 5	601058	赛轮轮胎	400	5,916.00	0.00
1,10 6	600841	上柴股份	500	5,915.00	0.00
1,10 7	300222	科大智能	500	5,905.00	0.00
1,10 8	002510	天汽模	1,300	5,902.00	0.00
1,10 9	300283	温州宏丰	800	5,896.00	0.00
1,110	002101	广东鸿图	500	5,890.00	0.00
1,111	002454	松芝股份	700	5,887.00	0.00
1,112	002765	蓝黛科技	700	5,880.00	0.00
1,113	300432	富临精工	200	5,880.00	0.00
1,114	603178	圣龙股份	400	5,872.00	0.00
1,115	603348	文灿股份	100	5,841.00	0.00
1,116	603197	保隆科技	100	5,840.00	0.00
1,117	600517	国网英大	800	5,832.00	0.00
1,118	300670	大烨智能	600	5,826.00	0.00
1,119	300341	麦克奥迪	500	5,825.00	0.00
1,12 0	300018	中元股份	700	5,810.00	0.00
1,12 1	300423	昇辉科技	400	5,804.00	0.00
1,12 2	000301	东方盛虹	300	5,802.00	0.00
1,12 3	603618	杭电股份	800	5,784.00	0.00
1,12 4	300375	鹏翎股份	1,300	5,746.00	0.00
1,12 5	600218	全柴动力	400	5,744.00	0.00
1,12 6	002622	融钰集团	1,300	5,720.00	0.00
1,12 7	603368	柳药股份	300	5,712.00	0.00
1,12 8	603788	宁波高发	400	5,712.00	0.00
1,12 9	002300	太阳电缆	700	5,705.00	0.00

1,13 0	002498	汉缆股份	1,100	5,687.00	0.00
1,13 1	601021	春秋航空	100	5,680.00	0.00
1,13 2	603861	白云电器	500	5,675.00	0.00
1,13 3	601616	广电电气	1,500	5,670.00	0.00
1,13 4	002112	三变科技	700	5,670.00	0.00
1,13 5	300068	南都电源	400	5,664.00	0.00
1,13 6	600468	百利电气	1,100	5,643.00	0.00
1,13 7	300611	美力科技	500	5,640.00	0.00
1,13 8	300477	合纵科技	700	5,635.00	0.00
1,13 9	300062	中能电气	500	5,630.00	0.00
1,14 0	300585	奥联电子	400	5,624.00	0.00
1,14 1	002882	金龙羽	500	5,590.00	0.00
1,14 2	002708	光洋股份	800	5,584.00	0.00
1,14 3	300040	九洲集团	600	5,574.00	0.00
1,14 4	601108	财通证券	500	5,560.00	0.00
1,14 5	601179	中国西电	1,000	5,550.00	0.00
1,14 6	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
1,14 7	603019	中科曙光	200	5,514.00	0.00
1,14 8	603939	益丰药房	100	5,511.00	0.00
1,14 9	603658	安图生物	100	5,506.00	0.00
1,15 0	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
1,15 1	002355	兴民智通	900	5,499.00	0.00

1,15 2	002091	江苏国泰	400	5,492.00	0.00
1,15 3	002334	英威腾	700	5,488.00	0.00
1,15 4	601901	方正证券	700	5,488.00	0.00
1,15 5	002471	中超控股	2,000	5,480.00	0.00
1,15 6	300120	经纬辉开	600	5,478.00	0.00
1,15 7	600312	平高电气	600	5,454.00	0.00
1,15 8	603006	黎明股份	500	5,435.00	0.00
1,15 9	603050	科林电气	300	5,400.00	0.00
1,16 0	300265	通光线缆	500	5,385.00	0.00
1,16 1	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
1,16 2	300141	和顺电气	400	5,360.00	0.00
1,16 3	603586	金麒麟	400	5,352.00	0.00
1,16 4	002553	南方轴承	500	5,350.00	0.00
1,16 5	002706	良信股份	300	5,346.00	0.00
1,16 6	300427	红相股份	400	5,328.00	0.00
1,16 7	300694	蠡湖股份	500	5,320.00	0.00
1,16 8	603320	迪贝电气	400	5,284.00	0.00
1,16 9	600178	东安动力	600	5,280.00	0.00
1,17 0	000551	创元科技	500	5,280.00	0.00
1,17 1	000783	长江证券	700	5,278.00	0.00
1,17 2	000400	许继电气	200	5,220.00	0.00
1,17 3	002885	京泉华	200	5,216.00	0.00

1,17 4	002350	北京科锐	600	5,178.00	0.00
1,17 5	002533	金杯电工	600	5,166.00	0.00
1,17 6	688126	沪硅产业	200	5,164.00	0.00
1,17 7	600115	中国东航	1,000	5,160.00	0.00
1,17 8	002227	奥特迅	300	5,127.00	0.00
1,17 9	002074	国轩高科	100	5,125.00	0.00
1,18 0	603606	东方电缆	100	5,116.00	0.00
1,18 1	002953	日丰股份	300	5,112.00	0.00
1,18 2	000682	东方电子	600	5,082.00	0.00
1,18 3	600550	保变电气	900	5,031.00	0.00
1,18 4	300376	易事特	500	5,025.00	0.00
1,18 5	600268	国电南自	500	5,015.00	0.00
1,18 6	300215	电科院	500	5,015.00	0.00
1,18 7	002606	大连电瓷	500	5,000.00	0.00
1,18 8	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
1,18 9	300048	合康新能	700	4,998.00	0.00
1,19 0	603897	长城科技	100	4,984.00	0.00
1,19 1	300001	特锐德	200	4,974.00	0.00
1,19 2	002028	思源电气	100	4,921.00	0.00
1,19 3	601995	中金公司	100	4,903.00	0.00
1,19 4	000922	佳电股份	400	4,884.00	0.00
1,19 5	002414	高德红外	200	4,842.00	0.00

1,19 6	002252	上海莱士	700	4,774.00	0.00
1,19 7	002927	泰永长征	400	4,764.00	0.00
1,19 8	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
1,19 9	002879	长缆科技	200	4,720.00	0.00
1,20 0	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
1,20 1	600188	兖矿能源	200	4,706.00	0.00
1,20 2	603982	泉峰汽车	100	4,700.00	0.00
1,20 3	300387	富邦股份	700	4,690.00	0.00
1,20 4	000548	湖南投资	1,168	4,683.68	0.00
1,20 5	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
1,20 6	300484	蓝海华腾	300	4,638.00	0.00
1,20 7	601111	中国国航	500	4,565.00	0.00
1,20 8	600109	国金证券	400	4,532.00	0.00
1,20 9	300003	乐普医疗	200	4,526.00	0.00
1,21 0	600085	同仁堂	100	4,498.00	0.00
1,211	601788	光大证券	300	4,479.00	0.00
1,21 2	603335	迪生力	700	4,424.00	0.00
1,21 3	300421	力星股份	200	4,384.00	0.00
1,21 4	600335	国机汽车	500	4,340.00	0.00
1,21 5	601700	风范股份	700	4,305.00	0.00
1,21 6	300144	宋城演艺	300	4,296.00	0.00
1,21 7	000066	中国长城	300	4,248.00	0.00
1,21	603233	大参林	100	4,211.00	0.00

8					
1,219	002725	跃岭股份	400	4,200.00	0.00
1,220	601126	四方股份	200	4,180.00	0.00
1,221	600698	湖南天雁	800	4,176.00	0.00
1,222	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
1,223	600489	中金黄金	500	4,115.00	0.00
1,224	600061	国投资本	500	4,110.00	0.00
1,225	300713	英可瑞	200	4,090.00	0.00
1,226	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
1,227	002624	完美世界	200	4,062.00	0.00
1,228	002367	康力电梯	500	4,015.00	0.00
1,229	601990	南京证券	400	3,964.00	0.00
1,230	002044	美年健康	500	3,925.00	0.00
1,231	600872	中炬高新	100	3,797.00	0.00
1,232	600143	金发科技	300	3,774.00	0.00
1,233	688116	天奈科技	25	3,732.25	0.00
1,234	603656	泰禾智能	300	3,732.00	0.00
1,235	002600	领益智造	500	3,680.00	0.00
1,236	300693	盛弘股份	100	3,669.00	0.00
1,237	601966	玲珑轮胎	100	3,655.00	0.00
1,238	000997	新大陆	200	3,624.00	0.00
1,239	688068	热景生物	31	3,600.65	0.00
1,24	600527	江南高纤	1,500	3,600.00	0.00

0					
1,24 1	601866	中远海发	1,100	3,575.00	0.00
1,24 2	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
1,24 3	000550	江铃汽车	200	3,262.00	0.00
1,24 4	000731	四川美丰	300	3,114.00	0.00
1,24 5	600848	上海临港	200	2,974.00	0.00
1,24 6	002157	正邦科技	300	2,898.00	0.00
1,24 7	600161	天坛生物	100	2,896.00	0.00
1,24 8	601162	天风证券	700	2,835.00	0.00
1,24 9	688526	科前生物	100	2,753.00	0.00
1,25 0	600162	香江控股	1,300	2,730.00	0.00
1,25 1	300509	新美星	400	2,552.00	0.00
1,25 2	601137	博威合金	100	2,360.00	0.00
1,25 3	300418	昆仑万维	100	2,315.00	0.00
1,25 4	300460	惠伦晶体	100	1,995.00	0.00
1,25 5	600560	金自天正	200	1,972.00	0.00
1,25 6	688500	慧辰股份	52	1,941.68	0.00
1,25 7	300606	金太阳	100	1,892.00	0.00
1,25 8	300224	正海磁材	100	1,708.00	0.00
1,25 9	688050	爱博医疗	8	1,681.84	0.00
1,26 0	605001	威奥股份	200	1,674.00	0.00
1,26 1	603161	科华控股	100	1,460.00	0.00
1,26	688033	天宜上佳	44	1,454.20	0.00

2					
1,26 3	601698	中国卫通	100	1,439.00	0.00
1,26 4	600707	彩虹股份	200	1,364.00	0.00
1,26 5	002767	先锋电子	100	1,253.00	0.00
1,26 6	601018	宁波港	300	1,191.00	0.00
1,26 7	688567	孚能科技	35	1,177.75	0.00
1,26 8	002911	佛燃能源	100	1,120.00	0.00
1,26 9	601375	中原证券	200	982.00	0.00
1,27 0	600961	株冶集团	100	930.00	0.00
1,27 1	688378	奥来德	11	881.10	0.00
1,27 2	002443	金洲管道	100	791.00	0.00
1,27 3	600981	汇鸿集团	200	706.00	0.00
1,27 4	603878	武进不锈	100	700.00	0.00
1,27 5	603077	和邦生物	200	682.00	0.00
1,27 6	600006	东风汽车	100	681.00	0.00
1,27 7	000544	中原环保	100	640.00	0.00
1,27 8	688558	国盛智科	14	632.80	0.00
1,27 9	601298	青岛港	100	569.00	0.00
1,28 0	688505	复旦张江	38	535.80	0.00
1,28 1	601872	招商轮船	100	410.00	0.00
1,28 2	600828	茂业商业	100	361.00	0.00
1,28 3	600166	福田汽车	100	344.00	0.00
1,28	600082	海泰发展	100	303.00	0.00

4					
1,285	000012	南玻 A	29	287.97	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	000932	华菱钢铁	100,970,005.12	12.75
2	600755	厦门国贸	70,323,515.26	8.88
3	601318	中国平安	55,418,903.65	7.00
4	600519	贵州茅台	53,735,369.40	6.79
5	000001	平安银行	50,569,661.82	6.39
6	000333	美的集团	48,148,584.62	6.08
7	600036	招商银行	43,239,748.00	5.46
8	600153	建发股份	40,454,068.05	5.11
9	600782	新钢股份	40,134,968.54	5.07
10	601166	兴业银行	35,853,014.13	4.53
11	601818	光大银行	29,193,348.00	3.69
12	601288	农业银行	28,337,480.00	3.58
13	601988	中国银行	22,995,187.00	2.90
14	000002	万科 A	22,494,727.96	2.84
15	601009	南京银行	22,194,643.74	2.80
16	600809	山西汾酒	20,519,323.39	2.59
17	000651	格力电器	20,463,125.00	2.58
18	601939	建设银行	20,173,105.00	2.55
19	601888	中国中免	20,015,115.00	2.53
20	000725	京东方 A	19,534,994.00	2.47
21	601328	交通银行	19,346,179.20	2.44
22	002142	宁波银行	19,219,749.61	2.43
23	601077	渝农商行	18,502,727.00	2.34
24	000858	五粮液	18,348,977.81	2.32
25	600887	伊利股份	17,713,910.53	2.24
26	601012	隆基股份	17,273,289.47	2.18
27	601577	长沙银行	17,045,685.13	2.15

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	000932	华菱钢铁	83,342,629.20	10.52
2	601318	中国平安	60,323,243.91	7.62

3	000001	平安银行	49,317,957.37	6.23
4	000333	美的集团	48,284,362.97	6.10
5	600519	贵州茅台	47,278,224.02	5.97
6	600782	新钢股份	38,938,226.38	4.92
7	600153	建发股份	35,113,191.39	4.43
8	600036	招商银行	34,445,325.00	4.35
9	601818	光大银行	34,240,102.00	4.32
10	601166	兴业银行	33,434,593.00	4.22
11	601288	农业银行	24,907,843.00	3.15
12	000002	万科 A	24,375,528.54	3.08
13	002142	宁波银行	23,321,476.92	2.95
14	600755	厦门国贸	22,969,363.29	2.90
15	601009	南京银行	22,289,520.52	2.81
16	601988	中国银行	21,719,344.00	2.74
17	600809	山西汾酒	18,621,998.00	2.35
18	601857	中国石油	18,351,823.00	2.32
19	000725	京东方 A	17,780,191.63	2.25
20	601077	渝农商行	17,562,515.00	2.22
21	600887	伊利股份	17,523,974.67	2.21
22	601888	中国中免	17,514,735.59	2.21
23	601012	隆基股份	16,860,881.00	2.13
24	601328	交通银行	16,765,331.00	2.12
25	601939	建设银行	16,630,108.00	2.10
26	601601	中国太保	16,566,149.75	2.09
27	000858	五粮液	16,132,627.68	2.04

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	3,236,847,244.41
卖出股票的收入（成交）总额	3,074,518,711.43

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）	616,595,106.09	52.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	616,595,106.09	52.93

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	127027	靖远转债	686,158	87,787,054.52	7.54
2	110043	无锡转债	636,850	76,275,524.50	6.55
3	110079	杭银转债	608,320	75,760,172.80	6.50
4	132017	19 新钢 EB	630,000	70,560,000.00	6.06
5	127020	中金转债	565,803	70,210,494.27	6.03

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

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卖出股指期货合约，对冲持有股票的系统性风险。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，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无锡转债(110043)、杭银转债(110079)、苏银转债(110053)的发行主体外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

主要违规事实：2021 年 7 月 22 日，因存在不正当手段吸收存款的违规行为，中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局对无锡农村商业银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2021 年 5 月 24 日，因存在 1、房地产项目融资业务不审慎；2、流动资金贷款管理不审慎，资金被挪用于支付土地出让金；3、授信投放不审慎，超额投放；4、理财资金管理不审慎，回流借款人母公司挪用于支付土地出让保证金；5、个人经营贷款管理不审慎，资金挪用于购房；6、个人消费贷款管理不审慎，资金挪用于购房等违规行为，中国银行保险监督管理委员会浙江监管局对杭州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 12 月 03 日，因存在 1.采用不正当手段发放贷款，2.固定资产贷款项目审批要件不齐全，3.固定资产贷款管理严重失职，4.贷后管理不审慎导致个人消费贷款资金违规进入投资等限制性领域，5.同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保，6.同业投资业务项目审批要件不齐全且投后管理不到位导致部分资金被挪用，7.同业投资业务资金占比超监管要求等违规行为，中国银行保险监督管理委员会背景监管局对江苏银行股份有限公司北京分行处以罚款的公开处罚。

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

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	182,868.13
2	应收证券清算款	195,968.08
3	应收股利	-
4	应收利息	1,903,450.65
5	应收申购款	185,851.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,468,138.56

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	127027	靖远转债	87,787,054.52	7.54
2	110043	无锡转债	76,275,524.50	6.55
3	110079	杭银转债	75,760,172.80	6.50
4	132017	19 新钢 EB	70,560,000.00	6.06
5	127020	中金转债	70,210,494.27	6.03
6	127018	本钢转债	50,366,181.06	4.32
7	113026	核能转债	47,748,499.50	4.10
8	113009	广汽转债	36,631,600.00	3.14
9	110053	苏银转债	26,889,024.80	2.31
10	113609	永安转债	18,792,266.80	1.61
11	123085	万顺转 2	15,847,153.54	1.36
12	128107	交科转债	15,289,344.00	1.31
13	128119	龙大转债	5,285,252.70	0.45
14	128085	鸿达转债	4,520,246.40	0.39
15	113532	海环转债	3,760,926.00	0.32
16	123080	海波转债	2,510,310.40	0.22
17	113011	光大转债	2,213,515.20	0.19
18	110080	东湖转债	2,210,748.80	0.19
19	110072	广汇转债	1,532,700.00	0.13

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	0.62	新股未上

					市
--	--	--	--	--	---

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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,301	140,944.26	721,612,370.07	96.58%	25,533,161.45	3.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	225,573.61	0.03%

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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年5月4日)基金份额总额	262,251,781.89
本报告期期初基金份额总额	585,989,618.97
本报告期基金总申购份额	509,494,078.99
减：本报告期基金总赎回份额	348,338,166.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	747,145,531.52

§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：本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任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 55000 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	-	-	-	-	-
兴业证券	1	176,772,093.29	2.88%	164,629.35	2.99%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	595,552,243.57	9.70%	554,648.62	10.07%	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	1	164,822,955.72	2.68%	120,535.35	2.19%	新增 1 个
华西证券	3	411,837,042.53	6.71%	301,186.82	5.47%	新增 2 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	200,626,043.83	3.27%	146,652.45	2.66%	新增 1 个
中金公司	2	476,973,569.46	7.77%	444,211.39	8.07%	-
中信证券	1	693,892,277.19	11.30%	646,226.41	11.73%	-
长江证券	1	1,540,965,247.20	25.09%	1,435,108.92	26.06%	-
新时代	1	94,920,649.02	1.55%	69,416.27	1.26%	新增 1 个
东吴证券	1	386,198,068.20	6.29%	359,670.51	6.53%	-
广发证券	1	801,458,453.65	13.05%	746,409.52	13.55%	减少 1 个
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	183,239,654.00	2.98%	134,004.36	2.43%	-
华泰证券	2	140,663,708.79	2.29%	131,001.01	2.38%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	272,851,343.31	4.44%	254,105.35	4.61%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

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	-	-	-	-	-	-
兴业证券	11,169,512.72	0.68%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	91,187,093.78	5.53%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	13,459,923.80	0.82%	-	-	-	-
华西证券	69,011,656.59	4.18%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	64,643,725.01	3.92%	-	-	-	-
中金公司	175,928,391.20	10.66%	-	-	-	-
中信证券	239,711,497.52	14.52%	-	-	-	-
长江证券	456,332,273.00	27.65%	660,000,000.00	42.17%	-	-
新时代	60,293,394.41	3.65%	-	-	-	-
东吴证券	59,132,184.39	3.58%	-	-	-	-
广发证券	148,237,882.47	8.98%	295,000,000.00	18.85%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	73,553,071.04	4.46%	-	-	-	-
华泰证券	15,847,020.11	0.96%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	171,883,143.82	10.41%	610,000,000.00	38.98%	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-11-26

3	博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-10-27
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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-30
5	博时量化平衡混合型证券投资基金更新招募说明书	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-28
7	关于博时量化平衡混合型证券投资基金开通直销网上交易定期投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-08
8	博时量化平衡混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-07
9	博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年中期报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-31
10	博时量化平衡混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-25
11	博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-21
12	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-01
13	博时量化平衡混合型证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-09

14	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
15	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
16	博时基金管理有限公司关于暂停使用通联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
17	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
18	博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
19	关于博时旗下部分开放式基金增加贵州银行股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-02
20	博时量化平衡混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20

25	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
26	博时量化平衡混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22

§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

无。

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平衡混合型证券投资基金设立的文件

13.1.2 《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》

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

13.1.6 报告期内博时量化平衡混合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