

博时品质生活混合型证券投资基金
2022 年中期报告
2022 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53

7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时品质生活混合型证券投资基金	
基金简称	博时品质生活混合	
基金主代码	014107	
交易代码	014107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 22 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	442,268,866.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时品质生活混合 A	博时品质生活混合 C
下属分级基金的交易代码	014107	014108
报告期末下属分级基金的份额总额	427,119,696.26 份	15,149,170.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入研究的基础上，精选中国经济可持续发展过程中最能够满足人们品质生活需求的上市公司股票进行投资，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，大类资产配置策略即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例。其次，股票投资策略包括品质生活主题界定与行业选择、个股投资策略、港股通标的股票投资策略和存托凭证投资策略。其他资产投资策略有债券投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资业务的投资策略、流通受限证券投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数 (CNY) 收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	李申
	联系电话	0755-83169999	021-60637102

电子邮箱	service@bosera.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话	95105568	021-60637111
传真	0755-83195140	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	江向阳	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	博时品质生活混合 A	博时品质生活混合 C
本期已实现收益	-13,239,867.48	-518,469.15
本期利润	-18,260,483.37	-749,933.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0410	-0.0470
本期加权平均净值利润率	-4.54%	-5.21%
本期基金份额净值增长率	-3.51%	-3.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	博时品质生活混合 A	博时品质生活混合 C
期末可供分配利润	-18,263,477.81	-692,843.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0428	-0.0457
期末基金资产净值	408,856,218.45	14,456,326.62
期末基金份额净值	0.9572	0.9543

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
	博时品质生活混合 A	博时品质生活混合 C
基金份额累计净值增长率	-4.28%	-4.57%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时品质生活混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.90%	1.06%	6.98%	0.85%	1.92%	0.21%
过去三个月	8.00%	1.34%	5.21%	1.11%	2.79%	0.23%
过去六个月	-3.51%	1.15%	-6.47%	1.17%	2.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-4.28%	1.12%	-5.90%	1.14%	1.62%	-0.02%

博时品质生活混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.85%	1.06%	6.98%	0.85%	1.87%	0.21%
过去三个月	7.84%	1.34%	5.21%	1.11%	2.63%	0.23%
过去六个月	-3.78%	1.15%	-6.47%	1.17%	2.69%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-4.57%	1.12%	-5.90%	1.14%	1.33%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数（CNY）收益率×10%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、10%、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。

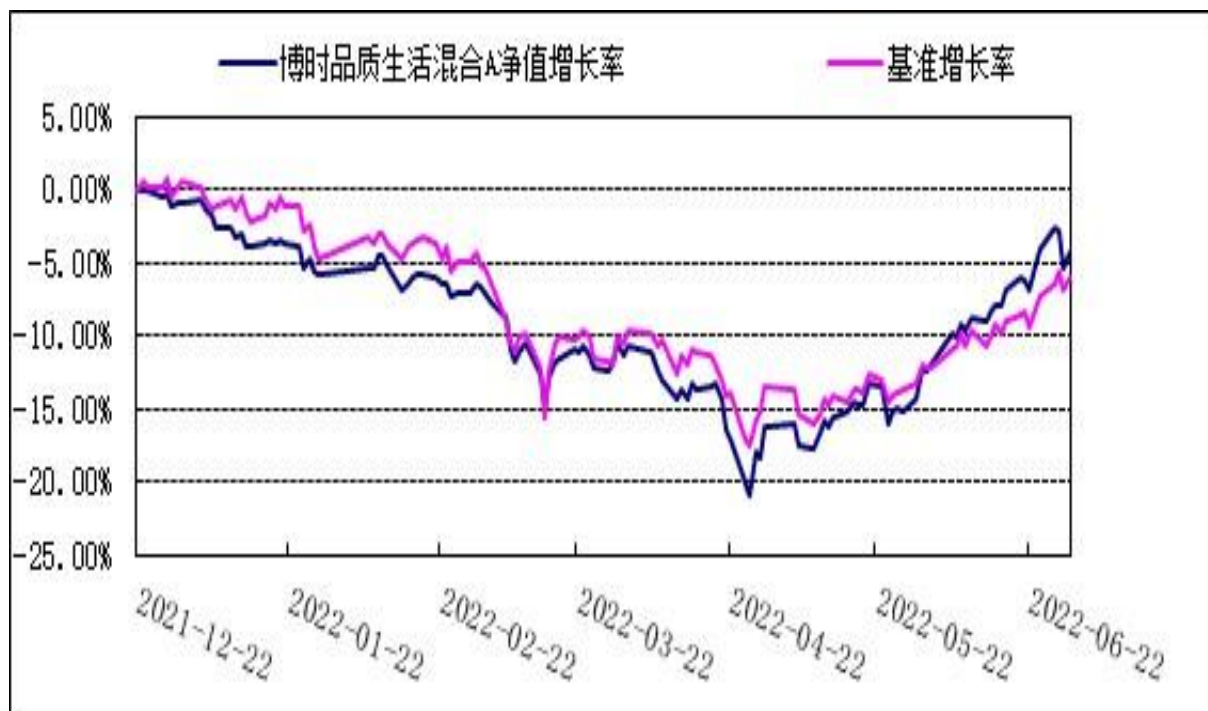
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时品质生活混合型证券投资基金

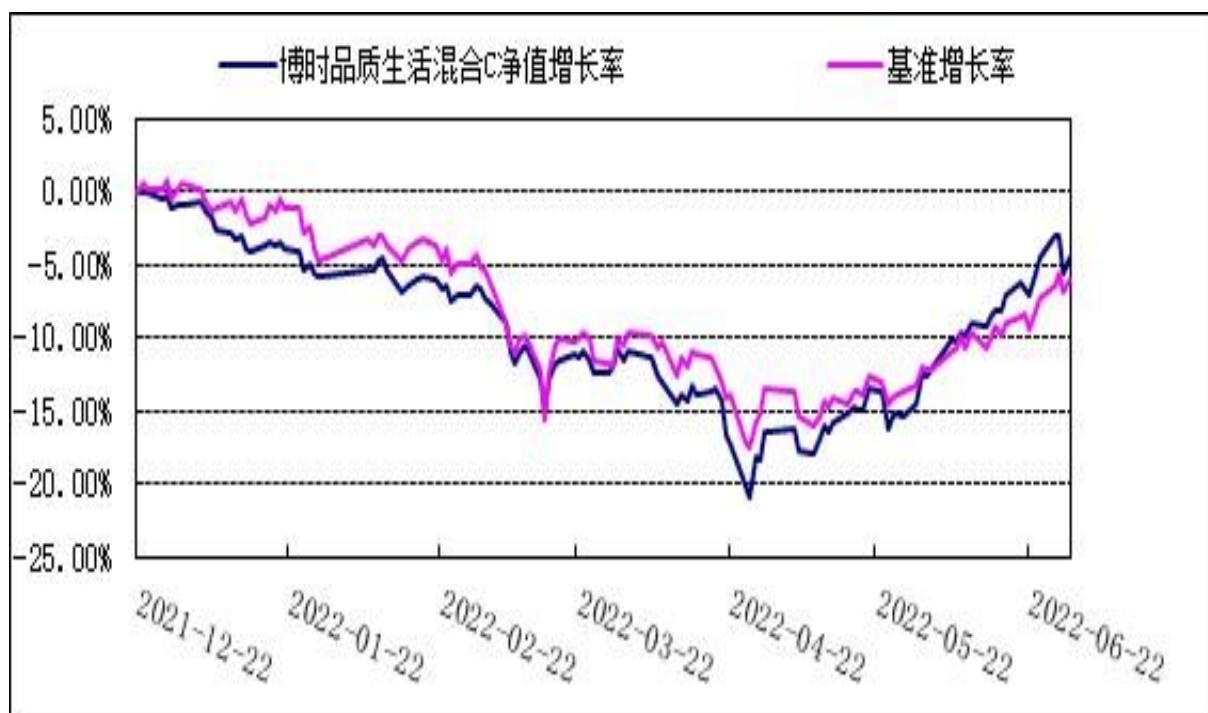
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2021 年 12 月 22 日至 2022 年 6 月 30 日）

博时品质生活混合 A



博时品质生活混合 C



注：本基金的基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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 2022 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 327 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 16491 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 5557 亿元人民币，累计分红逾 1678 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚爽	基金经理	2021-12-22	-	12.8	姚爽先生，硕士。2009 年起先后在中再资产管理股份有限公司、中信产业基金管理有限公司、嘉实基金工作。现任博时国企改革主题股票型证券投资基金（2021 年 5 月 18 日一至今）、博时品质生活混合型证券投资基金（2021 年 12 月 22 日一至今）的基金经理。

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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 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

2022 年上半年，上证指数下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，深圳成指下跌 13.20%，创业板指下跌 15.41%。整个上半年 A 股市场跌宕起伏，俄乌战争及疫情对市场情绪影响巨大。行业板块上，上游资源及新能源为代表的成长板块表现占优；随着疫情逐步受控，消费等板块也有所反弹。上半年国内流动性政策保持宽松，但疫情拖累明显，经济活力持续减弱，地产链风险尚未化解，经济动能不足。

上半年俄乌战争对全球能源、粮食等大宗商品价格带来很大冲击，市场担忧情绪加重，到 4 月到达顶峰。叠加国内部分地区疫情对某些产业链的影响，使得市场情绪降至冰点。宏观政策适时切入逆周期调节，4-5 月财政和货币政策双宽松，政策支持逐步加码。6 月开始，不同行业的生产、需求和物流都出现了不同程度的改善，股票市场的情绪也得到修复。

随着国内疫情及应对方案逐步明朗并愈发科学，以及稳增长政策的不断推进，国内经济最差的时间已经过去。随着动态清零经验的持续积累，国内的疫情防控政策更加科学优化；与此同时，在基建、地产、消费（比如汽车）、新能源等领域的扶持政策持续推出，因此我们期待疫情管控进一步正常化后，诸多政策将继续推动国内经济的逐步修复。

由于受俄乌战争、高通胀及货币紧缩政策的影响，对海外衰退的担忧也在逐步提升。而中国具备较完备的制造产业链，同时资源供给相对可控，因此保持货币相对宽松的独立性，以及出现恶性滞涨和经济衰退的风险低于海外，在全球配置中具备相对优势。

上半年，本基金核心配置在大消费、高端制造、新能源等行业的优质企业，并在下跌阶段逐步提高股票仓位，坚定看好中国未来的长期发展空间和优质企业的增长机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9572 元，份额累计净值为 0.9572 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9543 元，份额累计净值为 0.9543 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-3.51%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-3.78%，同期业绩基准增长率为-6.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内经济将大概率在二季度较弱的基础上逐渐恢复。后续重点关注疫情及科学防控节奏的推进和效果，以及对经济增长信心的修复。信心比黄金更重要，对美好生活、优质产品和服务的需求始终存在，品质提升的人性诉求不会开倒车。只要人民对未来发展恢复信心、企业家对未来投资增强信心，投资和消费一定会持续恢复。此外，稳增长政策的推进在过去半年或多或少也受到疫情影响，同时国内房地产行业面临的压力对经济、财政、相关产业链以及居民收入预期，都产生了一些负面影响，这也需要我们重点关注其变化。最坏的时刻大概率已经过去，未来经济恢复的斜率还需要仔细评估。但只要未来少发生黑天鹅，真正优秀的上市公司将会不断体现竞争优势。

在实现共同富裕的过程中，生活品质的提升是必然结果。我们会持续寻找帮助人民生活品质提升的优秀企业，寻找在产品创新、技术变革、品质升级、成本优化、品牌塑造等方面孜孜不倦努力的企业家。无论在大消费、高端制造还是新能源等诸多行业，都存在着产业升级、国产替代和中国品牌出海的大量投资机会，因为品质生活是人类共同的永恒追求。虽然未来在地缘政治、疫情防控、经济增长等方面我们仍面临一些挑战，但长期方向是明确的，且优秀的企业在逆境中往往能表现得更加突出。我们十分看好中国未来的长期发展空间和股票投资机遇。

本基金作为混合型基金在投资范围内保持较高的股票仓位，核心围绕治理优秀、长期增长、估值相对合理的思路进行投资。我们同时应用 ESG 责任投资的方法，持续关注在公司治理、社会责任、环境保护方面成绩领先的企业。某些行业或公司受到疫情或市场情绪的干扰短期波动较大，但长期增长前景明确。未来基金将继续优选具备长期持续增长能力和核心竞争力的优质企业，并在合理估值水平下进行投资，力争获取长期稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时品质生活混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	29,596,468.24	194,847,855.84
结算备付金		9,346,822.81	-
存出保证金		101,923.01	-
交易性金融资产	6.4.7.2	374,462,746.42	93,046,199.00
其中：股票投资		373,529,236.12	93,046,199.00
基金投资		-	-
债券投资		933,510.30	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	185,200,000.00
应收清算款		12,572,777.93	-
应收股利		-	-
应收申购款		43,027.34	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-32,808.62
资产总计		426,123,765.75	473,061,246.22
负债和净资产			
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		276,467.32	2,863,099.30
应付赎回款		1,640,110.20	-
应付管理人报酬		505,419.23	174,721.81
应付托管费		84,236.53	29,120.30
应付销售服务费		6,875.93	2,448.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.02	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	298,108.45	90,058.17
负债合计		2,811,220.68	3,159,447.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	442,268,866.51	473,700,877.44
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-18,956,321.44	-3,799,078.86
净资产合计		423,312,545.07	469,901,798.58
负债和净资产总计		426,123,765.75	473,061,246.22

注：1. 报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 442,268,866.51 份。其中 A 类基金份额净值 0.9572 元，基金份额 427,119,696.26 份；C 类基金份额净值 0.9543 元，基金份额 15,149,170.25 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：博时品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
一、营业总收入			-15,252,075.70
1. 利息收入			1,311,450.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9		488,543.56
债券利息收入			-
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			822,906.75
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2. 投资收益（损失以“-”填列）			-11,375,718.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10		-12,805,097.96
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.11		374.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.12		-
贵金属投资收益			-
衍生工具收益	6.4.7.13		-
股利收益	6.4.7.14		1,429,005.44
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）			-
其他投资收益			-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15		-5,252,080.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	64,272.60
减：二、营业总支出		3,758,341.39
1. 管理人报酬		3,104,622.44
2. 托管费		517,437.08
3. 销售服务费		42,905.05
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		1.37
8. 其他费用	6.4.7.18	93,375.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,010,417.09
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,010,417.09
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-19,010,417.09

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时品质生活混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	473,700,877.44	-	-3,799,078.86	469,901,798.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	473,700,877.44	-	-3,799,078.86	469,901,798.58
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-31,432,010.93	-	-15,157,242.58	-46,589,253.51
（一）、综合收益总额	-	-	-19,010,417.09	-19,010,417.09
（二）、本期基金份额 交易产生的基金	-31,432,010.93	-	3,853,174.51	-27,578,836.42

净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	3,811,368.14	-	-377,572.09	3,433,796.05
2. 基金赎回款	-35,243,379.07	-	4,230,746.60	-31,012,632.47
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	442,268,866.51	-	-18,956,321.44	423,312,545.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：孙献，会计机构负责人：倡方方

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时品质生活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[2021]2223 号《关于准予博时品质生活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《博时品质生活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 473,500,925.54 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(2021)第 1119 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时品质生活混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 473,700,877.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 199,951.90 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《博时品质生活混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时品质生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港证券市场股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债等)、资产支持证券、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 60%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%。其中，投资于本基金界定的品质生活主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股票期权和股指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的 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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中债综合财富(总值)指数收益率*20%+中证港股通综合指数(CNY)收益率*10%。

6.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《博时品质生活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。

6.4.3 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和上年度末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 22 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重

大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及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相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继

续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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、可交换债券和可分离债券除外)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、可交换债券和可分离债券除外)，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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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 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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号), 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产和应收利息, 金额分别为 194,847,855.84 元、185,200,000.00 元和-32,808.62 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、买入返售金融资产和其他资产-应收利息, 金额分别为 194,879,379.05 元、185,135,668.17 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 93,046,199.00 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 93,046,199.00 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和应付交易费用, 金额分别为 2,863,099.30 元、174,721.81 元、29,120.30 元、2,448.06 元和 90,058.17 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-应付交易费用, 金额分别为 2,863,099.30 元、174,721.81 元、29,120.30 元、2,448.06 元和 90,058.17 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	29,596,468.24
等于：本金	29,593,604.97
加：应计利息	2,863.27
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	29,596,468.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	382,678,520.52	-	373,529,236.12	-9,149,284.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	385.80	933,510.30	240,124.50
	银行间市场	-	-	-
	合计	385.80	933,510.30	240,124.50
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	383,371,520.52	385.80	374,462,746.42	-8,909,159.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	126.92
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	209,178.97
其中：交易所市场	209,178.97
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	88,802.56
合计	298,108.45

6.4.7.7 实收基金

博时品质生活混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	457,106,964.64	457,106,964.64
本期申购	3,544,324.67	3,544,324.67
本期赎回（以“-”号填列）	-33,531,593.05	-33,531,593.05
本期末	427,119,696.26	427,119,696.26

博时品质生活混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	16,593,912.80	16,593,912.80
本期申购	267,043.47	267,043.47
本期赎回（以“-”号填列）	-1,711,786.02	-1,711,786.02
本期末	15,149,170.25	15,149,170.25

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. 基金合同于 2021 年 12 月 22 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 473,700,877.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 199,951.90 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

博时品质生活混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-134,662.99	-3,528,980.81	-3,663,643.80
本期利润	-13,239,867.48	-5,020,615.89	-18,260,483.37
本期基金份额交易产生的变动数	599,818.58	3,060,830.78	3,660,649.36
其中：基金申购款	-87,346.74	-258,932.89	-346,279.63
基金赎回款	687,165.32	3,319,763.67	4,006,928.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,774,711.89	-5,488,765.92	-18,263,477.81

博时品质生活混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,336.43	-128,098.63	-135,435.06
本期利润	-518,469.15	-231,464.57	-749,933.72
本期基金份额交易产生的变动数	30,456.28	162,068.87	192,525.15
其中：基金申购款	-6,448.90	-24,843.56	-31,292.46
基金赎回款	36,905.18	186,912.43	223,817.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-495,349.30	-197,494.33	-692,843.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	91,052.53
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	396,795.30
其他	695.73
合计	488,543.56

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	120,393,847.65
减：卖出股票成本总额	132,530,091.27
减：交易费用	668,854.34
买卖股票差价收入	-12,805,097.96

6.4.7.11 债券投资收益
6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	374.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	374.37

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,429,005.44
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,429,005.44

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,252,080.46
——股票投资	-5,492,204.96
——债券投资	240,124.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	-5,252,080.46
----	---------------

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	64,143.93
基金转换费收入	128.67
合计	64,272.60

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	437.99
银行汇划费	1,134.90
中债登账户维护费	7,500.00
合计	93,375.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	79,486,916.55	15.05%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	74,026.37	16.29%	74,026.37	35.39%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,104,622.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,544,935.34

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	517,437.08

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时品质生活混合 A	博时品质生活混合 C	合计
中国建设银行	-	35,554.97	35,554.97
博时基金	-	20.60	20.60
招商证券	-	16.11	16.11
合计	-	35,591.68	35,591.68

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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
6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

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

无。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	29,596,468.24	91,052.53

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

6.4.10.7 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明
6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券
6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
600938	中国海油	2022-04-14	6 个月	首次公开发行限售	10.80	15.86	84,004.00	907,243.20	1,332,303.44	-
688213	思特威	2022-05-13	6 个月	首次公开发行限售	31.51	49.01	10,863.00	342,293.13	532,395.63	-
68804	长光	2022-	6 个月	首次	80.80	111.9	2,302	186,0	257,7	-

8	华芯	03-25		公开发 行 限售		7	.00	01.60	54.94	
68832 2	奥比 中光	2022- 06-30	5 个交 易日	新股 未上 市	30.99	30.99	8,201 .00	254,1 48.99	254,1 48.99	-
68829 5	中复 神鹰	2022- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	29.33	34.42	5,849 .00	171,5 51.17	201,3 22.58	-
30113 9	元道 通信	2022- 06-30	6 个交 易日	新股 未上 市	38.46	38.46	4,679 .00	179,9 54.34	179,9 54.34	-
68840 0	凌云 光	2022- 06-27	7 个交 易日	新股 未上 市	21.93	21.93	6,419 .00	140,7 68.67	140,7 68.67	-
30123 3	盛帮 股份	2022- 06-24	8 个交 易日	新股 未上 市	41.52	41.52	1,418 .00	58,87 5.36	58,87 5.36	-
30123 8	瑞泰 新材	2022- 06-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.18	32.07	1,144 .00	21,94 1.92	36,68 8.08	-
30126 6	宇邦 新材	2022- 05-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.86	47.07	517.0 0	13,88 6.62	24,33 5.19	-
30113 9	元道 通信	2022- 06-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	38.46	38.46	520.0 0	19,99 9.20	19,99 9.20	-
30118 7	欧圣 电气	2022- 04-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	21.33	22.54	876.0 0	18,68 5.08	19,74 5.04	-
30126 8	铭利 达	2022- 03-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	28.50	34.87	540.0 0	15,39 0.00	18,82 9.80	-
30130 2	华如 科技	2022- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	52.03	56.42	333.0 0	17,32 5.99	18,78 7.86	-
30125	华融	2022-	6 个月	首次	8.05	10.08	1,831	14,73	18,45	-

6	化学	03-14		公开发 行限 售			.00	9.55	6.48	
30116 2	国能 日新	2022- 04-19	6 个月	首次公 开发 行限 售	45.13	54.11	334.0 0	15,07 3.42	18,07 2.74	-
30111 2	信邦 智能	2022- 06-20	6 个月	首次公 开发 行限 售	27.53	45.04	399.0 0	10,98 4.47	17,97 0.96	-
30115 3	中科 江南	2022- 05-10	6 个月	首次公 开发 行限 售	33.68	43.98	398.0 0	13,40 4.64	17,50 4.04	-
30126 3	泰恩 康	2022- 03-22	6 个月	首次公 开发 行限 售	19.93	31.38	557.0 0	11,10 1.01	17,47 8.66	-
30115 0	中一 科技	2022- 04-14	6 个月	首次公 开发 行限 售	109.0 4	82.76	198.0 0	21,58 9.92	16,38 6.48	-
30128 6	侨源 股份	2022- 06-06	6 个月	首次公 开发 行限 售	16.91	19.79	784.0 0	13,25 7.44	15,51 5.36	-
30123 6	软通 动力	2022- 03-08	6 个月	首次公 开发 行限 售	48.64	31.38	478.0 0	23,24 8.72	14,99 9.64	-
30116 0	翔楼 新材	2022- 05-25	6 个月	首次公 开发 行限 售	31.56	37.66	392.0 0	12,37 1.52	14,76 2.72	-
30121 2	联盛 化学	2022- 04-07	6 个月	首次公 开发 行限 售	29.67	33.28	416.0 0	12,34 2.72	13,84 4.48	-
30120 0	大族 数控	2022- 02-18	6 个月	首次公 开发 行限 售	76.56	51.92	263.0 0	20,13 5.28	13,65 4.96	-
30121	万凯	2022-	6 个月	首次	35.68	29.84	453.0	16,16	13,51	-

6	新材	03-21		公开发 行限售			0	3.04	7.52	
30129 8	东利 机械	2022- 05-27	6 个月	首次公 开发行 限售	12.68	20.83	634.0 0	8,039 .12	13,20 6.22	-
30110 2	兆讯 传媒	2022- 03-15	6 个月	首次公 开发行 限售	39.88	31.09	413.0 0	16,47 0.44	12,84 0.17	-
30114 8	嘉戎 技术	2022- 04-14	6 个月	首次公 开发行 限售	38.39	23.90	516.0 0	19,80 9.24	12,33 2.40	-
30125 8	富士 莱	2022- 03-21	6 个月	首次公 开发行 限售	48.30	41.68	295.0 0	14,24 8.50	12,29 5.60	-
30125 9	艾布 鲁	2022- 04-18	6 个月	首次公 开发行 限售	18.39	24.94	483.0 0	8,882 .37	12,04 6.02	-
30109 7	天益 医疗	2022- 03-25	6 个月	首次公 开发行 限售	52.37	47.83	249.0 0	13,04 0.13	11,90 9.67	-
30120 7	华兰 疫苗	2022- 02-10	6 个月	首次公 开发行 限售	56.88	56.42	201.0 0	11,43 2.88	11,34 0.42	-
30122 0	亚香 股份	2022- 06-15	6 个月	首次公 开发行 限售	35.98	39.15	285.0 0	10,25 4.30	11,15 7.75	-
30123 7	和顺 科技	2022- 03-16	6 个月	首次公 开发行 限售	56.69	41.86	257.0 0	14,56 9.33	10,75 8.02	-
30113 7	哈焊 华通	2022- 03-14	6 个月	首次公 开发行 限售	15.37	15.99	644.0 0	9,898 .28	10,29 7.56	-
30121	腾远	2022-	6 个月	首次	96.82	87.82	115.0	11,13	10,09	-

9	钴业	03-10		公开发 行限售			0	4.72	9.30	
301288	清研环境	2022-04-14	6 个月	首次公开发 行限售	19.09	19.98	452.00	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月	首次公开发 行限售	22.49	27.42	327.00	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6 个月	首次公开发 行限售	26.27	32.33	277.00	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	首次公开发 行限售	22.55	37.70	237.00	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	首次公开发 行限售	31.98	26.26	338.00	10,809.24	8,875.88	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	首次公开发 行限售	31.20	22.81	296.00	9,235.20	6,751.76	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	首次公开发 行限售	41.52	41.52	158.00	6,560.16	6,560.16	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本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。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内

不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，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。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，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。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金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；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。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在深入研究的基础上，精选中国经济可持续发展过程中最能够满足人们品质生活需求的上市公司股票进行投资，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况

进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

6.4.13.2 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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	933,510.30	-
未评级	-	-
合计	933,510.30	-

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日 资产	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
银行存款	29,596,468.24	-	-	-	29,596,468.24
结算备付金	9,346,822.81	-	-	-	9,346,822.81

存出保证金	101,923.01	-	-	-	101,923.01
交易性金融资产	-	-	933,510.30	373,529,236.12	374,462,746.42
应收证券清算款	-	-	-	12,572,777.93	12,572,777.93
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	43,027.34	43,027.34
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,045,214.06	-	933,510.30	386,145,041.39	426,123,765.75
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,640,110.20	1,640,110.20
应付证券清算款	-	-	-	276,467.32	276,467.32
应付管理人报酬	-	-	-	505,419.23	505,419.23
应付托管费	-	-	-	84,236.53	84,236.53
应付销售服务费	-	-	-	6,875.93	6,875.93
应交税费	-	-	-	3.02	3.02
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	298,108.45	298,108.45
负债总计				-2,811,220.68	2,811,220.68
利率敏感度缺口	39,045,214.06	-	933,510.30	383,333,820.71	423,312,545.07
上年度末					
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	194,847,855.84	-	-	-	194,847,855.84
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	93,046,199.00	93,046,199.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	185,200,000.00	-	-	-	185,200,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-32,808.62	-32,808.62
资产总计	380,047,855.84	-	-	-93,013,390.3	473,061,24

				8	6.22
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	2,863,099.30	2,863,099.30
应付管理人报酬	-	-	-	174,721.81	174,721.81
应付托管费	-	-	-	29,120.30	29,120.30
应付销售服务费	-	-	-	2,448.06	2,448.06
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,058.17	90,058.17
负债总计				3,159,447.64	3,159,447.64
利率敏感度缺口	380,047,855.84			89,853,942.74	469,901,798.58

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	20,415,916.66	20,415,916.66
资产合计	-	20,415,916.66	20,415,916.66
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外	-	20,415,916.66	20,415,916.66

汇风险敞口净额			
---------	--	--	--

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变			
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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	1. 所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 102		-
	2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 102		-

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	373,529,236.12	88.24	93,046,199.00	19.80
交易性金融资产—债券投资	933,510.30	0.22	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	374,462,746.42	88.46	93,046,199.00	19.80

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。

6.4.13.4.3.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 90	增加约 21
	业绩比较基准下降 5%	减少约 90	减少约 21

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	370,988,314.72
第二层次	660,306.72
第三层次	2,814,124.98
合计	374,462,746.42

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。其中“应收利息”与“其他资产”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额；“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	373,529,236.12	87.66
	其中：股票	373,529,236.12	87.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	933,510.30	0.22
	其中：债券	933,510.30	0.22
	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	38,943,291.05	9.14
8	其他各项资产	12,717,728.28	2.98
9	合计	426,123,765.75	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 20,415,916.66 元，净值占比 4.82%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	63,090,789.00	14.90
B	采矿业	6,729,812.44	1.59
C	制造业	233,016,440.75	55.05

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,927,131.00	2.35
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,478.66	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	6,390,090.00	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	269,317.82	0.06
J	金融业	29,795,104.00	7.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,155,796.17	0.51
M	科学研究和技术服务业	1,696,981.20	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	24,378.42	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	353,113,319.46	83.42

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
电信业务	9,088,822.49	2.15
非日常生活消费品	6,244,528.96	1.48
日常消费品	5,082,565.21	1.20
合计	20,415,916.66	4.82

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	11,400	23,313,000.00	5.51
2	000876	新希望	1,271,200	19,449,360.00	4.59
3	300750	宁德时代	36,300	19,384,200.00	4.58
4	300059	东方财富	738,960	18,769,584.00	4.43
5	300498	温氏股份	831,600	17,704,764.00	4.18
6	002385	大北农	2,209,834	17,258,803.54	4.08
7	600882	妙可蓝多	333,500	15,607,800.00	3.69
8	300083	创世纪	1,324,100	15,227,150.00	3.60
9	600702	舍得酒业	69,500	14,177,305.00	3.35
10	603799	华友钴业	144,820	13,847,688.40	3.27
11	002714	牧原股份	229,300	12,673,411.00	2.99
12	000998	隆平高科	748,900	12,476,674.00	2.95

13	002041	登海种业	550,400	11,607,936.00	2.74
14	002567	唐人神	1,354,500	11,526,795.00	2.72
15	000776	广发证券	589,600	11,025,520.00	2.60
16	600298	安琪酵母	224,700	10,954,125.00	2.59
17	601012	隆基绿能	161,602	10,767,541.26	2.54
18	600549	厦门钨业	484,200	10,468,404.00	2.47
19	000858	五粮液	49,700	10,035,921.00	2.37
20	1024	快手-W	121,600	9,088,822.49	2.15
21	603477	巨星农牧	359,800	8,628,004.00	2.04
22	600426	华鲁恒升	286,100	8,354,120.00	1.97
23	002311	海大集团	121,800	7,309,218.00	1.73
24	002812	恩捷股份	25,800	6,461,610.00	1.53
25	600009	上海机场	112,700	6,390,090.00	1.51
26	3690	美团-W	37,600	6,244,528.96	1.48
27	600905	三峡能源	936,200	5,888,698.00	1.39
28	000983	山西焦煤	403,100	5,397,509.00	1.28
29	1610	中粮家佳康	1,564,000	5,082,565.21	1.20
30	301101	明月镜片	97,851	5,022,691.83	1.19
31	688169	石头科技	6,728	4,149,157.60	0.98
32	000883	湖北能源	790,300	4,038,433.00	0.95
33	300122	智飞生物	29,800	3,308,098.00	0.78
34	300014	亿纬锂能	24,200	2,359,500.00	0.56
35	002594	比亚迪	6,500	2,167,685.00	0.51
36	601888	中国中免	9,200	2,142,956.00	0.51
37	688105	诺唯赞	19,988	1,696,981.20	0.40
38	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.31
39	688213	思特威	10,863	532,395.63	0.13
40	688048	长光华芯	2,302	257,754.94	0.06
41	688322	奥比中光	8,201	254,148.99	0.06
42	688295	中复神鹰	5,849	201,322.58	0.05
43	301139	元道通信	5,199	199,953.54	0.05
44	688400	凌云光	6,419	140,768.67	0.03
45	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
46	601089	N福元	1,749	36,816.45	0.01
47	301238	瑞泰新材	1,144	36,688.08	0.01
48	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
49	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
50	301268	铭利达	540	18,829.80	0.00
51	301302	C华如	333	18,787.86	0.00
52	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
53	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
54	301112	N信邦	399	17,970.96	0.00
55	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00

56	301263	泰恩康	557	17,478.66	0.00
57	301150	中一科技	198	16,386.48	0.00
58	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
59	301236	软通动力	478	14,999.64	0.00
60	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
61	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
62	301200	大族数控	263	13,654.96	0.00
63	301216	万凯新材	453	13,517.52	0.00
64	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
65	301102	兆讯传媒	413	12,840.17	0.00
66	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
67	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
68	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
69	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
70	301207	华兰疫苗	201	11,340.42	0.00
71	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
72	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
73	301237	和顺科技	257	10,758.02	0.00
74	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
75	301219	腾远钴业	115	10,099.30	0.00
76	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
77	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
78	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
79	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
80	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
81	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	23,100,829.00	4.92
2	002385	大北农	22,105,466.34	4.70
3	000876	新希望	21,487,365.86	4.57
4	300083	创世纪	17,173,831.99	3.65
5	300498	温氏股份	16,286,814.00	3.47
6	002271	东方雨虹	15,639,231.00	3.33
7	603129	春风动力	14,978,747.10	3.19
8	002311	海大集团	14,964,041.00	3.18
9	600882	妙可蓝多	13,832,415.00	2.94
10	603799	华友钴业	11,731,509.11	2.50

11	600905	三峡能源	11,554,842.00	2.46
12	002714	牧原股份	11,430,279.00	2.43
13	002567	唐人神	11,286,183.00	2.40
14	000998	隆平高科	10,873,267.00	2.31
15	688169	石头科技	10,455,584.66	2.23
16	300059	东方财富	10,111,100.00	2.15
17	600549	厦门钨业	9,806,262.00	2.09
18	600298	安琪酵母	9,503,866.36	2.02
19	601012	隆基绿能	9,440,529.80	2.01
20	603477	巨星农牧	9,314,691.84	1.98

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002271	东方雨虹	14,280,364.54	3.04
2	603129	春风动力	12,356,404.13	2.63
3	000998	隆平高科	9,628,287.00	2.05
4	002385	大北农	9,174,520.00	1.95
5	002311	海大集团	7,465,663.00	1.59
6	601668	中国建筑	6,658,145.00	1.42
7	688169	石头科技	6,470,909.24	1.38
8	600905	三峡能源	6,157,281.00	1.31
9	300737	科顺股份	5,777,692.00	1.23
10	688533	上声电子	5,590,968.53	1.19
11	002991	甘源食品	4,523,436.00	0.96
12	300750	宁德时代	4,239,016.00	0.90
13	603348	文灿股份	4,222,685.00	0.90
14	000858	五粮液	3,684,470.00	0.78
15	002009	天奇股份	3,574,786.00	0.76
16	301101	明月镜片	3,478,025.00	0.74
17	601799	星宇股份	2,074,406.41	0.44
18	3690	美团-W	900,979.55	0.19
19	600938	中国海油	678,101.80	0.14
20	688348	昱能科技	604,878.00	0.13

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	418,505,333.35
卖出股票的收入（成交）总额	120,393,847.65

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	933,510.30	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	933,510.30	0.22

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113641	华友转债	6,930	933,510.30	0.22

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，舍得酒业股份有限公司在报告编制前一年受到上海证券交易所的通报批评。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	101,923.01
2	应收清算款	12,572,777.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	43,027.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,717,728.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时品质生活混合 A	4,357	98,030.69	0.00	0.00%	427,119,696.26	100.00%
博时品质生活混合 C	489	30,979.90	0.00	0.00%	15,149,170.25	100.00%
合计	4,806	92,024.32	0.00	0.00%	442,268,866.51	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时品质生活混合 A	50,438.90	0.01%
	博时品质生活混合 C	-	-
	合计	50,438.90	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时品质生活混合 A	博时品质生活混合 C
基金合同生效日(2021年12月22日)基金份额总额	457,106,964.64	16,593,912.80
本报告期期初基金份额总额	457,106,964.64	16,593,912.80
本报告期基金总申购份额	3,544,324.67	267,043.47

减：本报告期基金总赎回份额	33,531,593.05	1,711,786.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	427,119,696.26	15,149,170.25

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	20,991,041.65	3.97%	19,550.04	4.30%	增加 2 个
申万宏源	1	15,576,549.37	2.95%	11,391.35	2.51%	增加 1 个

华创证券	1	46,173,901.91	8.74%	33,766.03	7.43%	增加 1 个
东方财富证券	1	4,818,754.00	0.91%	3,526.28	0.78%	增加 1 个
瑞银证券	1	30,428,480.34	5.76%	28,338.56	6.24%	增加 1 个
广发证券	1	45,923,136.88	8.70%	33,583.66	7.39%	增加 1 个
方正证券	1	4,538,125.61	0.86%	3,318.74	0.73%	增加 1 个
中金公司	1	109,663,929.11	20.77%	102,130.98	22.48%	增加 1 个
招商证券	1	79,486,916.55	15.05%	74,026.37	16.29%	增加 1 个
国盛证券	1	4,601,562.44	0.87%	3,365.28	0.74%	增加 1 个
中信建投	1	6,451,179.48	1.22%	4,718.31	1.04%	增加 1 个
中信证券	1	41,000,335.90	7.76%	38,191.90	8.41%	增加 1 个
东吴证券	2	46,274,722.56	8.76%	33,840.79	7.45%	增加 2 个
国泰君安	2	72,177,296.36	13.67%	64,646.55	14.23%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	116,222,000.00	1.50%	-	-
申万宏源	-	-	86,600,000.00	1.12%	-	-
华创证券	-	-	18,200,000.00	0.24%	-	-
东方财富证券	-	-	28,000,000.00	0.36%	-	-
瑞银证券	-	-	1,158,400,000.00	14.98%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	749,000,000.00	9.68%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	5,350,500,000.00	69.18%	-	-
东吴证券	-	-	42,100,000.00	0.54%	-	-
国泰君安	-	-	185,100,000.00	2.39%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时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	2022-06-18
2	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-20220430	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-30
3	博时品质生活混合型证券投资基金 2022 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	2022-04-22
4	关于博时品质生活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	2022-03-21
5	博时品质生活混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、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	2022-03-17
6	博时基金管理有限公司关于调整直销网上交易定期投资业务影响部分定期投资计划的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-14
7	博时基金管理有限公司关于部分基金在青岛农商银行直销银行开展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	2022-02-11
8	博时基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
9	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-20220121	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-21

10	关于成立博时财富基金销售有限公司的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-20
11	博时基金管理有限公司关于暂停使用交通银行非快捷支付服务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	2022-01-06
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通交通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	2022-01-04
13	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01
14	博时基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时品质生活混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时品质生活混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时品质生活混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 报告期内博时品质生活混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日