

博时量化价值股票型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
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.....	68
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.....	69
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.....	69
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.....	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69

7.12 投资组合报告附注.....	69
§8 基金份额持有人信息.....	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
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.....	70
§9 开放式基金份额变动.....	71
§10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	73
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
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.....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§12 备查文件目录.....	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化价值股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化价值股票	
基金主代码	005960	
交易代码	005960	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,163,202.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
下属分级基金的交易代码	005960	005961
报告期末下属分级基金的份额总额	4,167,810.51 份	16,995,391.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。
投资策略	本基金投资策略主要由 A 股投资策略、港股投资策略和其他投资策略三部分组成。A 股投资策略：本基金运用量化方法进行价值型投资，本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础，对其中的价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。港股投资策略：本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。其他投资策略主要包括：存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于中高风险/收益的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	秦一楠
	联系电话	0755-83169999	010-66060069

电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	95105568	95599
传真	0755-83195140	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518040	100031
法定代表人	江向阳	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
本期已实现收益	-57,211.10	-1,467,037.02
本期利润	-395,041.58	-249,939.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0957	-0.0149
本期加权平均净值利润率	-6.67%	-1.08%
本期基金份额净值增长率	-6.21%	-6.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期末可供分配利润	1,921,816.80	7,041,986.89
期末可供分配基金份额利润	0.4611	0.4143
期末基金资产净值	6,089,627.31	24,037,378.38
期末基金份额净值	1.4611	1.4143

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金份额累计净值增长率	46.11%	41.43%

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

博时量化价值股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.47%	1.08%	7.35%	1.00%	-2.88%	0.08%
过去三个月	2.73%	1.27%	5.63%	1.28%	-2.90%	-0.01%
过去六个月	-6.21%	1.27%	-6.99%	1.37%	0.78%	-0.10%
过去一年	-3.01%	1.09%	-14.30%	1.16%	11.29%	-0.07%
过去三年	43.03%	1.14%	10.81%	1.12%	32.22%	0.02%
自基金合同生效起至今	46.11%	1.20%	17.90%	1.16%	28.21%	0.04%

博时量化价值股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.38%	1.08%	7.35%	1.00%	-2.97%	0.08%
过去三个月	2.52%	1.27%	5.63%	1.28%	-3.11%	-0.01%
过去六个月	-6.60%	1.27%	-6.99%	1.37%	0.39%	-0.10%
过去一年	-3.80%	1.09%	-14.30%	1.16%	10.50%	-0.07%
过去三年	39.59%	1.14%	10.81%	1.12%	28.78%	0.02%
自基金合同生效起至今	41.43%	1.20%	17.90%	1.16%	23.53%	0.04%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、20%和 10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

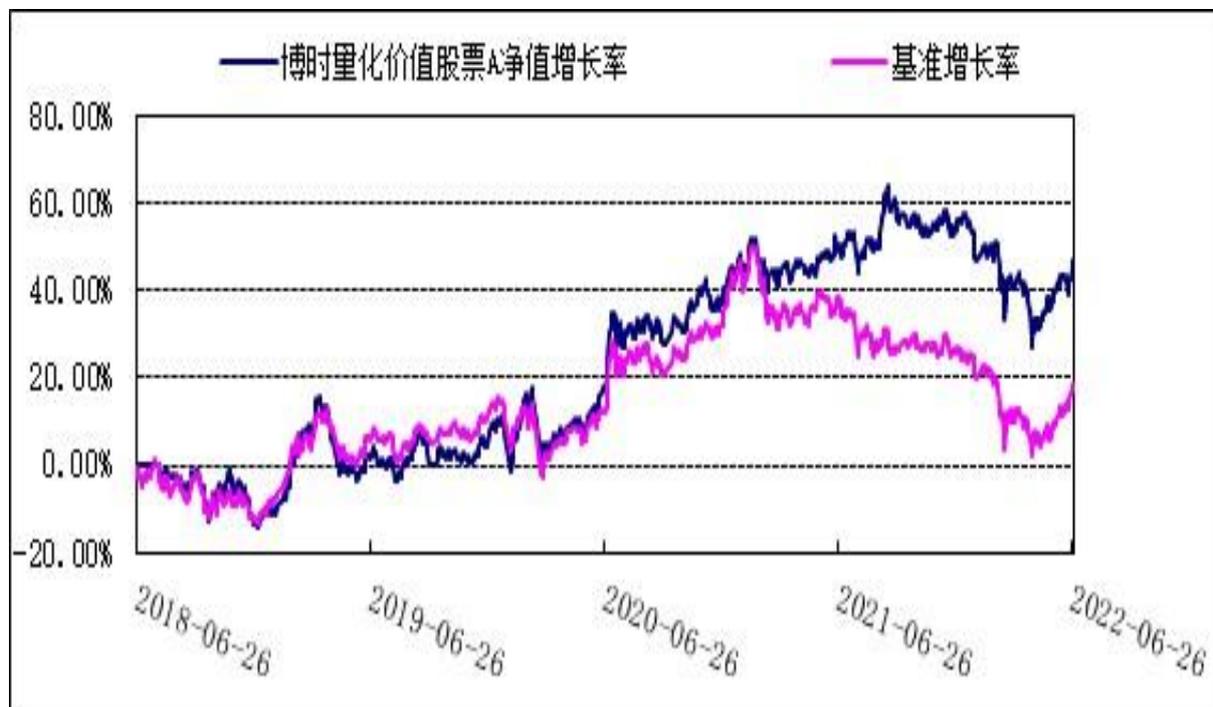
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化价值股票型证券投资基金

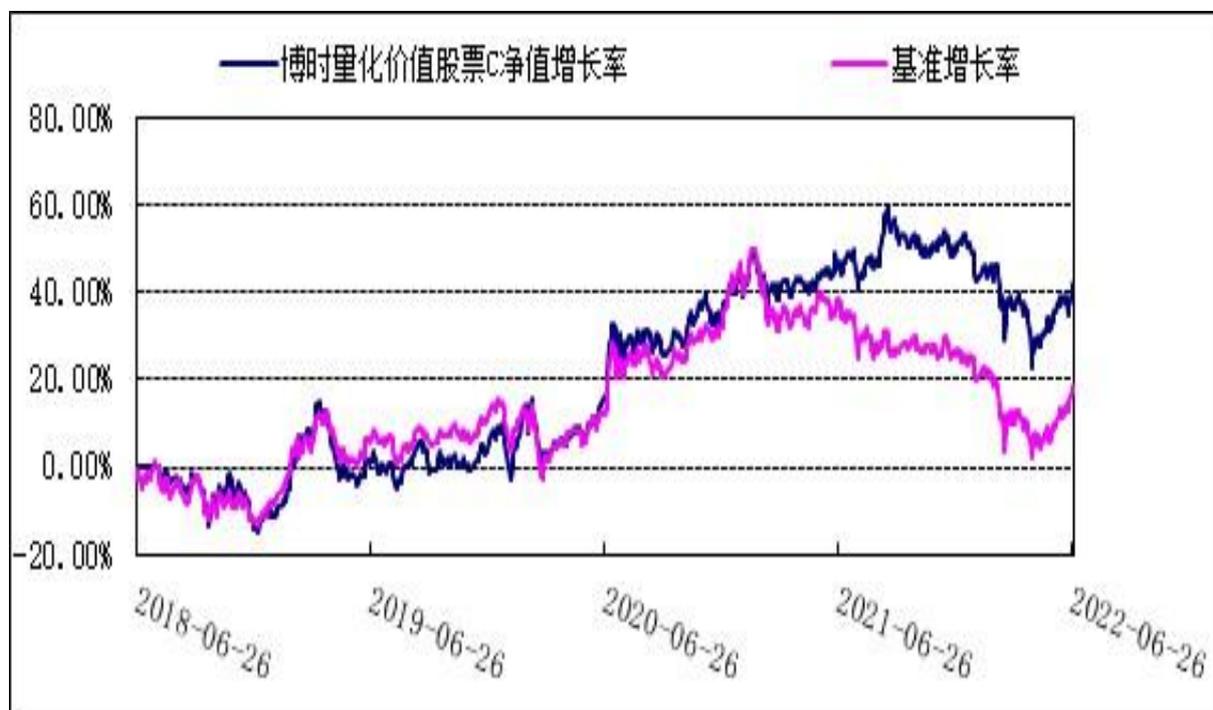
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 6 月 26 日至 2022 年 6 月 30 日)

博时量化价值股票 A



博时量化价值股票 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 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		
林景艺	基金经理	2018-06-26	-	11.9	林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理、博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015 年 5 月 20 日-2021 年 5 月 18 日)基金经理。现任博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日一至今)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2022 年 2 月 28 日一至今)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/ 基金经理	2018-06-26	-	19.9	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管

					理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、博时价值增长贰号证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2015年2月9日-2018年6月21日)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017年5月4日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日一至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	11.9	李庆阳先生，硕士。2010年从华南理工大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级系统运维经理。2016年调任博时资本，任投资经理。2018年再次加入博时基金管理有限公司，现任基金经理助理。

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遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动

等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 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 A 股市场整体经历了触底反弹的过程。在经历了 2022 年一月到四月的下跌后，于 4 月底股市开始回暖，主要指数进入了上涨通道。红利指数在上半年翻红，实现正收益。多数宽基指数，例如创业板指、沪深 300、中证 500 等仍未修复年初以来的跌幅。在风格方面，市场经历了从价值风格向成长风格的显著变化。在 2022 年 1 季度，价值股的表现整体优于成长股。随着 4 月底市场进入反弹阶段，成长风格表现出较强进攻性，优于价值风格。在行业层面，周期板块表现较好，科技板块较弱。根据中信一级行业指数表现，上半年煤炭行业涨幅一骑绝尘，远超其他行业。煤炭、消费者服务、交通运输实现了正收益，电子、传媒、计算机、国防军工等行业跌幅较大。2022 年上半年，全部 A 股约 4800 只股票，涨跌幅中位数是-13.25%，涨跌幅均值是-9.38%，只有约 24% 的股票实现了正收益。港股市场经历了一轮下跌后，逐渐进入震荡盘整阶段，恒生指数在上半年下跌 6.57%。从行业上看，能源、电信服务、金融板块涨幅靠前，工业、医疗保健、公用事业板块涨幅靠后。

本基金是风格鲜明的运用量化方法进行价值型投资的产品。我们以自主研发的量化多策略体系为基础，从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格等多个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资。2022 年上半年，本基金维持价值风格暴露，对小盘价值风格予以适度倾斜，实现了对沪深 300 基准的超越。当前，市场整体估值维持震荡，而

低估值板块与其他板块的估值差开始修复，未来还有较大的结构性估值修复空间。我们认为未来两年内，大盘价值具有良好的基本面和极低的估值，具有更高的安全性和性价比。我们将持续对价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。

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 1.4611 元，份额累计净值为 1.4611 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.4143 元，份额累计净值为 1.4143 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-6.21%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-6.60%，同期业绩基准增长率为-6.99%。

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 年下半年，影响国际经济环境的风险因素较多。俄乌军事冲突仍在继续，短期内局势改善的可能性不大。由于俄罗斯和乌克兰分别是能源、农产品出口大国，战争以及制裁加剧了油气和农产品的短缺，推高全球通胀、压低经济增长。虽然海外生产端持续修复，但是通胀高企对消费、投资的抑制效应逐步加深，叠加美欧央行加速紧缩货币，预计下半年海外经济增长将面临较大下行压力。国内经济恢复主要受到疫情反复的影响。随着疫情冲击趋缓，以及稳增长政策的落实，国内经济下行压力有望得到缓解。人民币更高的国际地位和国内较低的通货膨胀为中国货币政策提供了更加灵活的空间。预计未来一段时间，国内将处于稳信用、宽货币的状态。积极的财政和货币政策将成为经济恢复的重要支撑，有利于 A 股市场的长期表现。

在欧美主要经济体进入加息周期、国内货币政策以“稳”为主的大背景下，A 股的驱动力势必要从估值扩张向盈利增长转变，基于当前极致的估值差异，我们认为下半年 A 股市场大概率上会呈现风格轮动加快，节奏变化加剧，估值低且盈利情况改善的个股和板块将更有机会。

港股方面，经济增长回升有望继续驱动港股盈利不断修复；AH 股溢价指数当前处于过去 10 年的较高位置，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显著增大，香港市场已成为内地资金的重要资产配置市场。截止 2022 年 6 月 30 日，恒生指数的市盈率 (TTM) 为 9.96，处在 2003 年以来的中位数以下。综合考虑，我们认为在一年维度上港股具有较强的配置价值。

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

本基金曾于 2022 年 01 月 04 日至 2022 年 02 月 08 日及 2022 年 02 月 24 日至 2022 年 05 月 24 日及 2022 年 06 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日出现连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—博时基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；

在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

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	6.4.4.1	1,860,922.56	975,573.86
结算备付金		588,162.14	248,064.58
存出保证金		37,345.83	67,337.85
交易性金融资产	6.4.4.2	28,123,893.76	9,780,554.20
其中：股票投资		28,123,893.76	9,679,762.19
基金投资		-	-
债券投资		-	100,792.01
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收清算款		-	72,783.87
应收股利		-	-
应收申购款		1,088.38	13,623.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.5	-	428.39
资产总计		30,611,412.67	11,158,366.16
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		112,996.07	7,912.92
应付管理人报酬		22,549.04	19,741.63
应付托管费		6,263.64	5,483.76
应付销售服务费		16,135.12	13,276.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.6	326,463.11	305,299.27
负债合计		484,406.98	351,714.57
净资产:			
实收基金	6.4.4.7	21,163,202.00	7,020,614.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.4.8	8,963,803.69	3,786,037.39
净资产合计		30,127,005.69	10,806,651.59
负债和净资产总计		30,611,412.67	11,158,366.16

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 21,163,202.00 份。其中 A 类基金份额净值 1.4611 元，基金份额 4,167,810.51 份；C 类基金份额净值 1.4143 元，基金份额 16,995,391.49 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-339,874.57	36,923,217.02
1. 利息收入		16,066.95	248,058.95
其中：存款利息收入	6.4.4.9	16,066.95	239,324.74
债券利息收入		-	8,734.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,464,282.13	63,175,067.59

其中：股票投资收益	6.4.4.10	-1,825,063.00	59,285,622.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.11	27,979.49	186,761.61
资产支持证券投资收益	6.4.4.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.13	-	1,694,970.87
股利收益	6.4.4.14	332,801.38	2,007,712.97
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）	6.4.4.15	879,267.02	-26,520,888.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	229,073.59	20,978.63
减：二、营业总支出		305,106.53	10,845,646.04
1. 管理人报酬		125,401.05	2,086,908.83
2. 托管费		34,833.68	579,696.91
3. 销售服务费		87,927.97	1,831,881.75
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	6.4.4.17	-	-
7. 税金及附加		0.04	6,132.37
8. 其他费用	6.4.4.18	56,943.79	6,341,026.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-644,981.10	26,077,570.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-644,981.10	26,077,570.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-644,981.10	26,077,570.98

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

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	7,020,614.20	-	3,786,037.39	10,806,651.59

(基金净值)				
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)	7,020,614.20	-	3,786,037.39	10,806,651.59
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	14,142,587.80	-	5,177,766.30	19,320,354.10
(一)、综合收益总额	-	-	-644,981.10	-644,981.10
(二)、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)	14,142,587.80	-	5,822,747.40	19,965,335.20
其中：1. 基金申购款	48,127,134.08	-	19,375,074.17	67,502,208.25
2. 基金赎回款	-33,984,546.28	-	-13,552,326.77	-47,536,873.05
(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)	21,163,202.00	-	8,963,803.69	30,127,005.69
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	409,879,824.90	-	153,378,745.91	563,258,570.81
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)	409,879,824.90	-	153,378,745.91	563,258,570.81
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-362,806,440.01	-	-131,101,883.88	-493,908,323.89
(一)、综合收益总额	-	-	26,077,570.98	26,077,570.98

(二)、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)	-362,806,440.01	-	-157,179,454.86	-519,985,894.87
其中: 1. 基金申购款	25,384,893.95	-	11,641,558.86	37,026,452.81
2. 基金赎回款	-388,191,333.96	-	-168,821,013.72	-557,012,347.68
(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)	47,073,384.89	-	22,276,862.03	69,350,246.92

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：侣方方

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在购买/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

新金融工具准则

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求,本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理,根据衔接规定,对可比期间信息不予调整,首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式,确定了三个主要的计量类别:摊余成本;以公允价值计量且其变动计入其他综合收益;以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式,以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”,适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中,并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中,不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目,反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中,其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日(2022 年 1 月 1 日),原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述:

以摊余成本计量的金融资产:

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 975,573.86 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 192.01 元,重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后,银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 975,765.87 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 248,064.58 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 122.76 元,重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后,结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值

为人民币 248,187.34 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,337.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 33.33 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,371.18 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 428.39 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 192.01 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 122.76 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 33.33 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 80.29 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,780,554.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 80.29 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,780,634.49 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 税项

6.4.3.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.3.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.3.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，

对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.3.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.3.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 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	1,860,922.56
等于：本金	1,860,521.93
加：应计利息	400.63
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	1,860,922.56

6.4.4.2 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	26,744,185.65	-	28,123,893.76	1,379,708.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,744,185.65	-	28,123,893.76	1,379,708.11

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

6.4.4.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.4.5 其他资产

无余额。

6.4.4.6 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	0.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	237,331.89
其中：交易所市场	237,331.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,130.98
合计	326,463.11

6.4.4.7 实收基金
博时量化价值股票 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	4,024,249.48	4,024,249.48
本期申购	1,193,131.01	1,193,131.01
本期赎回（以“-”号填列）	-1,049,569.98	-1,049,569.98
本期末	4,167,810.51	4,167,810.51

博时量化价值股票 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	2,996,364.72	2,996,364.72
本期申购	46,934,003.07	46,934,003.07
本期赎回（以“-”号填列）	-32,934,976.30	-32,934,976.30
本期末	16,995,391.49	16,995,391.49

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

6.4.4.8 未分配利润
博时量化价值股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,536,869.86	-1,291,612.61	2,245,257.25
本期利润	-57,211.10	-337,830.48	-395,041.58

本期基金份额交易产生的变动数	124,902.66	-53,301.53	71,601.13
其中：基金申购款	1,067,725.23	-512,047.38	555,677.85
基金赎回款	-942,822.57	458,745.85	-484,076.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,604,561.42	-1,682,744.62	1,921,816.80

博时量化价值股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,483,772.79	-942,992.65	1,540,780.14
本期利润	-1,467,037.02	1,217,097.50	-249,939.52
本期基金份额交易产生的变动数	12,743,351.03	-6,992,204.76	5,751,146.27
其中：基金申购款	39,378,090.70	-20,558,694.38	18,819,396.32
基金赎回款	-26,634,739.67	13,566,489.62	-13,068,250.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,760,086.80	-6,718,099.91	7,041,986.89

6.4.4.9 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	11,938.20
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	3,848.50
其他	280.25
合计	16,066.95

6.4.4.10 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	273,737,794.74
减：卖出股票成本总额	274,712,292.90
减：交易费用	850,564.84
买卖股票差价收入	-1,825,063.00

6.4.4.11 债券投资收益
6.4.4.11.1 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	20.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	27,958.99
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	27,979.49

6.4.4.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	159,160.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	131,100.00
减：应计利息总额	101.04
减：交易费用	0.12
买卖债券差价收入	27,958.99

6.4.4.12 资产支持证券投资收益

6.4.4.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.4.12.2 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。

6.4.4.13 衍生工具收益

6.4.4.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.4.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.4.14 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	332,801.38
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	332,801.38

6.4.4.15 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	879,267.02
——股票投资	893,959.03
——债券投资	-14,692.01
——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	879,267.02

6.4.4.16 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	227,868.47
基金转换费收入	1,205.12
合计	229,073.59

6.4.4.17 信用减值损失

无。

6.4.4.18 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	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
其他	12.99
银行汇划费	3,299.82
中债登账户维护费	9,000.00
合计	56,943.79

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.5.2 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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 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		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	196,842,889.83	34.78%	521,791,403.12	13.23%

6.4.7.1.2 权证交易

无。

6.4.7.1.3 债券交易

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		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券

		券成交总 额的比例		成交总额的 比例
招商证券	54,463.80	34.22%	-	-

6.4.7.1.4 债券回购交易

无。

6.4.7.1.5 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	183,311.18	35.35%	134,313.78	56.59%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	486,139.93	13.29%	-	-

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	125,401.05	2,086,908.83
其中：支付销售机构的客户维护费	17,544.41	15,627.35

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 0.90% 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 × 0.90% / 当年天数。

6.4.7.2.2 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	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,833.68	579,696.91

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：

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

6.4.7.2.3 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		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
博时基金	-	63,206.63	63,206.63
中国农业银行	-	4,070.29	4,070.29
合计	-	67,276.92	67,276.92
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
博时基金	-	1,819,569.08	1,819,569.08
中国农业银行	-	2,601.40	2,601.40
合计	-	1,822,170.48	1,822,170.48

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

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

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.7.4 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

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.7.5.2 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

博时量化价值股票 C

份额单位：份

关联方名称	博时量化价值股票 C 本期末 2022 年 6 月 30 日		博时量化价值股票 C 上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例
博时资本管理有限 公司	13,754,212.23	64.99%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.7.6 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		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国农业银行-活 期存款	1,860,922.56	11,938.20	33,113,002.95	141,285.91

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。

6.4.7.7 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	002948	青岛银行	网下发行	900.00	2,880.00
招商证券	600030	中信证券	配股	345.00	4,978.35
招商证券	001323	慕思股份	网下发行	267.00	10,394.31
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
-	-	-	-	-	-

6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

无。

6.4.9 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.10.2 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。

6.4.10.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.10.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.10.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.10.2.4 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	-	68,877.60
AAA 以下	-	31,914.41
未评级	-	-
合计	-	100,792.01

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。

6.4.10.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.10.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.10.3 流动性风险

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

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.10.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透

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

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,860,922.56	-	-	-	1,860,922.56
结算备付金	588,162.14	-	-	-	588,162.14
存出保证金	37,345.83	-	-	-	37,345.83
交易性金融资产	-	-	-	28,123,893.76	28,123,893.76
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,088.38	1,088.38
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,486,430.53	-	-	28,124,982.14	30,611,412.67
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	112,996.07	112,996.07
应付证券清算款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	22,549.04	22,549.04
应付托管费	-	-	-	6,263.64	6,263.64
应付销售服务费	-	-	-	16,135.12	16,135.12
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	326,463.11	326,463.11
负债总计	-	-	-	484,406.98	484,406.98
利率敏感度缺口	2,486,430.53	-	-	27,640,575.16	30,127,005.69
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	975,573.86	-	-	-	975,573.86
结算备付金	248,064.58	-	-	-	248,064.58
存出保证金	67,337.85	-	-	-	67,337.85
交易性金融资产	-	22,954.26	77,837.75	9,679,762.19	9,780,554.20
应收证券清算款	-	-	-	72,783.87	72,783.87
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,623.41	13,623.41
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	428.39	428.39
资产总计	1,290,976.29	22,954.26	77,837.75	9,766,597.86	11,158,366.16
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,912.92	7,912.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	19,741.63	19,741.63
应付托管费	-	-	-	5,483.76	5,483.76
应付销售服务费	-	-	-	13,276.64	13,276.64
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	305,299.27	305,299.27
负债总计	-	-	-	351,714.57	351,714.57
利率敏感度缺口	1,290,976.29	22,954.26	77,837.75	9,414,883.29	10,806,651.59

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

6.4.10.4.1.2 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）。

6.4.10.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.10.4.3 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。

6.4.10.4.3.1 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	28,123,893.76	93.35	9,679,762.19	89.57
交易性金融资产—债券投资	—	—	100,792.01	0.93
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
合计	28,123,893.76	93.35	9,780,554.20	90.50

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。

6.4.10.4.3.2 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172	增加约33
	业绩比较基准下降5%	减少约172	减少约33

6.4.11 公允价值

6.4.11.1 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。

6.4.11.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.11.2.1 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	28,123,893.76
第二层次	-
第三层次	-
合计	28,123,893.76

6.4.11.2.2 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。

6.4.11.3 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）。

6.4.11.4 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。

6.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

资产负债表的以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

利润表的以下比较数据已根据本年《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》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

§ 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	28,123,893.76	91.87
	其中：股票	28,123,893.76	91.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,449,084.70	8.00
8	其他各项资产	38,434.21	0.13
9	合计	30,611,412.67	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	77,565.00	0.26
B	采矿业	1,026,679.00	3.41
C	制造业	22,340,451.60	74.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	188,421.00	0.63
E	建筑业	108,374.00	0.36
F	批发和零售业	179,841.00	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	417,525.00	1.39
H	住宿和餐饮业	2,148.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	981,286.96	3.26
J	金融业	1,845,961.00	6.13

K	房地产业	446,799.00	1.48
L	租赁和商务服务业	92,958.20	0.31
M	科学研究和技术服务业	69,826.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	35,053.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	101,940.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	196,479.00	0.65
S	综合	12,586.00	0.04
	合计	28,123,893.76	93.35

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	002304	洋河股份	6,200	1,135,530.00	3.77
2	600519	贵州茅台	500	1,022,500.00	3.39
3	000568	泸州老窖	2,600	641,004.00	2.13
4	300390	天华超净	7,300	638,020.00	2.12
5	002460	赣锋锂业	3,700	550,190.00	1.83
6	002466	天齐锂业	4,100	511,680.00	1.70
7	002709	天赐材料	7,500	465,450.00	1.54
8	600873	梅花生物	39,600	446,688.00	1.48
9	300316	晶盛机电	6,095	411,961.05	1.37
10	300769	德方纳米	1,000	408,680.00	1.36
11	600809	山西汾酒	1,200	389,760.00	1.29
12	603392	万泰生物	2,400	372,720.00	1.24
13	002756	永兴材料	2,300	350,083.00	1.16
14	002192	融捷股份	2,200	338,140.00	1.12
15	002594	比亚迪	1,000	333,490.00	1.11
16	300661	圣邦股份	1,800	327,636.00	1.09
17	000933	神火股份	24,900	325,692.00	1.08
18	600030	中信证券	14,900	322,734.00	1.07
19	600438	通威股份	5,200	311,272.00	1.03
20	000792	盐湖股份	9,400	281,624.00	0.93
21	688575	亚辉龙	13,200	276,144.00	0.92
22	000733	振华科技	2,000	271,940.00	0.90
23	603599	广信股份	9,380	264,047.00	0.88
24	600893	航发动力	5,700	259,407.00	0.86
25	601318	中国平安	5,100	238,119.00	0.79
26	688123	聚辰股份	2,200	234,344.00	0.78
27	003019	宸展光电	9,085	229,305.40	0.76
28	600036	招商银行	5,400	227,880.00	0.76

29	002240	盛新锂能	3,700	223,332.00	0.74
30	000625	长安汽车	12,350	213,902.00	0.71
31	300639	凯普生物	10,000	213,800.00	0.71
32	300171	东富龙	6,300	213,633.00	0.71
33	600389	江山股份	3,400	206,482.00	0.69
34	601088	中国神华	6,000	199,800.00	0.66
35	603898	好莱客	19,000	196,080.00	0.65
36	600760	中航沈飞	3,200	193,440.00	0.64
37	688019	安集科技	900	191,628.00	0.64
38	300041	回天新材	11,000	191,070.00	0.63
39	601900	南方传媒	23,400	189,774.00	0.63
40	688516	奥特维	700	186,865.00	0.62
41	300833	浩洋股份	2,100	183,036.00	0.61
42	300768	迪普科技	11,122	179,620.30	0.60
43	300268	佳沃食品	6,000	178,500.00	0.59
44	300820	英杰电气	2,750	177,512.50	0.59
45	300803	指南针	3,000	176,340.00	0.59
46	002738	中矿资源	1,900	175,959.00	0.58
47	000596	古井贡酒	700	174,762.00	0.58
48	603868	飞科电器	2,300	174,225.00	0.58
49	002841	视源股份	2,300	173,236.00	0.58
50	600064	南京高科	15,700	172,700.00	0.57
51	600639	浦东金桥	12,600	171,234.00	0.57
52	002884	凌霄泵业	8,300	170,067.00	0.56
53	601838	成都银行	10,100	167,458.00	0.56
54	002947	恒铭达	9,100	167,440.00	0.56
55	000553	安道麦 A	13,800	167,118.00	0.55
56	600089	特变电工	6,100	167,079.00	0.55
57	000858	五粮液	800	161,544.00	0.54
58	300750	宁德时代	300	160,200.00	0.53
59	603986	兆易创新	1,100	156,431.00	0.52
60	603989	艾华集团	5,500	155,100.00	0.51
61	601899	紫金矿业	16,500	153,945.00	0.51
62	601012	隆基绿能	2,280	151,916.40	0.50
63	603217	元利科技	5,100	149,991.00	0.50
64	002176	江特电机	5,900	147,736.00	0.49
65	688008	澜起科技	2,400	145,392.00	0.48
66	601919	中远海控	9,600	133,440.00	0.44
67	300696	爱乐达	3,000	131,850.00	0.44
68	600256	广汇能源	11,900	125,426.00	0.42
69	688819	天能股份	3,600	124,488.00	0.41
70	002352	顺丰控股	2,200	122,782.00	0.41
71	603799	华友钴业	1,280	122,393.60	0.41

72	601677	明泰铝业	5,100	121,380.00	0.40
73	600919	江苏银行	16,600	118,192.00	0.39
74	688037	芯源微	800	115,976.00	0.38
75	688981	中芯国际	2,500	112,925.00	0.37
76	688099	晶晨股份	1,100	111,100.00	0.37
77	600887	伊利股份	2,800	109,060.00	0.36
78	601166	兴业银行	5,400	107,460.00	0.36
79	603613	国联股份	1,200	106,320.00	0.35
80	002920	德赛西威	700	103,600.00	0.34
81	300601	康泰生物	2,260	102,106.80	0.34
82	000989	九芝堂	11,200	101,920.00	0.34
83	002533	金杯电工	14,300	101,387.00	0.34
84	688298	东方生物	880	100,452.00	0.33
85	600176	中国巨石	5,600	97,496.00	0.32
86	600546	山煤国际	5,000	97,300.00	0.32
87	000651	格力电器	2,800	94,416.00	0.31
88	002545	东方铁塔	8,200	93,316.00	0.31
89	000333	美的集团	1,500	90,585.00	0.30
90	002497	雅化集团	2,600	84,890.00	0.28
91	603327	福蓉科技	6,100	83,875.00	0.28
92	002371	北方华创	300	83,136.00	0.28
93	002555	三七互娱	3,800	80,674.00	0.27
94	600499	科达制造	3,900	80,496.00	0.27
95	000725	京东方 A	20,400	80,376.00	0.27
96	002459	晶澳科技	980	77,322.00	0.26
97	300196	长海股份	4,000	75,560.00	0.25
98	300037	新宙邦	1,400	73,584.00	0.24
99	300130	新国都	5,900	72,334.00	0.24
100	600233	圆通速递	3,500	71,365.00	0.24
101	688200	华峰测控	200	71,280.00	0.24
102	600276	恒瑞医药	1,900	70,471.00	0.23
103	600900	长江电力	3,000	69,360.00	0.23
104	601567	三星医疗	5,000	66,400.00	0.22
105	300059	东方财富	2,500	63,500.00	0.21
106	300073	当升科技	700	63,238.00	0.21
107	600096	云天化	2,000	62,960.00	0.21
108	600018	上港集团	10,600	61,798.00	0.21
109	600702	舍得酒业	300	61,197.00	0.20
110	002645	华宏科技	2,800	61,096.00	0.20
111	601398	工商银行	12,600	60,102.00	0.20
112	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.19
113	603882	金域医学	700	57,785.00	0.19
114	600863	内蒙华电	15,600	56,940.00	0.19

115	002049	紫光国微	300	56,916.00	0.19
116	000408	藏格矿业	1,700	55,998.00	0.19
117	300122	智飞生物	500	55,505.00	0.18
118	300568	星源材质	1,900	55,176.00	0.18
119	002759	天际股份	2,000	54,360.00	0.18
120	603259	药明康德	500	51,995.00	0.17
121	600141	兴发集团	1,100	48,389.00	0.16
122	002815	崇达技术	3,700	47,397.00	0.16
123	300363	博腾股份	600	46,794.00	0.16
124	601888	中国中免	200	46,586.00	0.15
125	600060	海信视像	3,700	46,250.00	0.15
126	601328	交通银行	8,900	44,322.00	0.15
127	688388	嘉元科技	500	42,435.00	0.14
128	601225	陕西煤业	2,000	42,360.00	0.14
129	000002	万科A	2,000	41,000.00	0.14
130	002405	四维图新	2,700	40,689.00	0.14
131	600031	三一重工	2,100	40,026.00	0.13
132	688111	金山办公	200	39,424.00	0.13
133	002407	多氟多	800	39,128.00	0.13
134	600596	新安股份	1,800	38,970.00	0.13
135	688005	容百科技	300	38,832.00	0.13
136	600585	海螺水泥	1,100	38,808.00	0.13
137	600309	万华化学	400	38,796.00	0.13
138	600481	双良节能	2,300	38,755.00	0.13
139	601668	中国建筑	7,200	38,304.00	0.13
140	000970	中科三环	2,000	37,560.00	0.12
141	002484	江海股份	1,600	37,344.00	0.12
142	002475	立讯精密	1,100	37,169.00	0.12
143	300487	蓝晓科技	600	36,600.00	0.12
144	688606	奥泰生物	300	36,486.00	0.12
145	002517	恺英网络	6,500	36,270.00	0.12
146	603288	海天味业	400	36,144.00	0.12
147	002432	九安医疗	600	36,036.00	0.12
148	688589	力合微	800	35,856.00	0.12
149	601601	中国太保	1,500	35,295.00	0.12
150	300423	昇辉科技	3,200	34,624.00	0.11
151	300170	汉得信息	3,800	34,238.00	0.11
152	601689	拓普集团	500	34,215.00	0.11
153	300613	富瀚微	400	33,920.00	0.11
154	000935	四川双马	1,400	33,908.00	0.11
155	002714	牧原股份	600	33,162.00	0.11
156	300218	安利股份	2,300	32,821.00	0.11
157	002410	广联达	600	32,664.00	0.11

158	002415	海康威视	900	32,580.00	0.11
159	300721	怡达股份	900	32,463.00	0.11
160	688556	高测股份	400	32,280.00	0.11
161	002142	宁波银行	900	32,229.00	0.11
162	000001	平安银行	2,100	31,458.00	0.10
163	300760	迈瑞医疗	100	31,320.00	0.10
164	603668	天马科技	1,500	30,735.00	0.10
165	603369	今世缘	600	30,600.00	0.10
166	601818	光大银行	10,100	30,401.00	0.10
167	000617	中油资本	6,300	30,303.00	0.10
168	600028	中国石化	7,200	29,376.00	0.10
169	002927	泰永长征	2,500	29,125.00	0.10
170	688559	海目星	400	29,080.00	0.10
171	600019	宝钢股份	4,800	28,896.00	0.10
172	603619	中曼石油	1,400	28,798.00	0.10
173	300482	万孚生物	700	28,497.00	0.09
174	600104	上汽集团	1,600	28,496.00	0.09
175	002539	云图控股	1,700	27,183.00	0.09
176	300432	富临精工	1,200	26,400.00	0.09
177	300124	汇川技术	400	26,348.00	0.09
178	002286	保龄宝	2,300	26,335.00	0.09
179	002615	哈尔斯	4,200	26,124.00	0.09
180	002869	金溢科技	1,700	25,636.00	0.09
181	603659	璞泰来	300	25,320.00	0.08
182	300450	先导智能	400	25,272.00	0.08
183	002812	恩捷股份	100	25,045.00	0.08
184	600050	中国联通	7,200	24,912.00	0.08
185	002805	丰元股份	400	24,760.00	0.08
186	688590	新致软件	1,702	24,389.66	0.08
187	000807	云铝股份	2,400	23,712.00	0.08
188	603260	合盛硅业	200	23,592.00	0.08
189	600426	华鲁恒升	800	23,360.00	0.08
190	688012	中微公司	200	23,350.00	0.08
191	601390	中国中铁	3,800	23,332.00	0.08
192	601958	金铂股份	2,600	22,984.00	0.08
193	000063	中兴通讯	900	22,977.00	0.08
194	600273	嘉化能源	2,100	22,806.00	0.08
195	688329	艾隆科技	700	22,645.00	0.08
196	300015	爱尔眼科	500	22,385.00	0.07
197	002027	分众传媒	3,300	22,209.00	0.07
198	000039	中集集团	1,600	22,160.00	0.07
199	603529	爱玛科技	420	21,999.60	0.07
200	300244	迪安诊断	700	21,770.00	0.07

201	300782	卓胜微	160	21,600.00	0.07
202	000630	铜陵有色	6,600	21,516.00	0.07
203	601766	中国中车	4,100	21,320.00	0.07
204	600160	巨化股份	1,600	21,040.00	0.07
205	600097	开创国际	2,100	20,643.00	0.07
206	002394	联发股份	2,800	20,468.00	0.07
207	601615	明阳智能	600	20,280.00	0.07
208	300327	中颖电子	400	19,924.00	0.07
209	603308	应流股份	1,200	19,536.00	0.06
210	000830	鲁西化工	1,100	19,019.00	0.06
211	601988	中国银行	5,800	18,908.00	0.06
212	603983	丸美股份	700	18,760.00	0.06
213	000338	潍柴动力	1,500	18,705.00	0.06
214	000799	酒鬼酒	100	18,581.00	0.06
215	600779	水井坊	200	18,508.00	0.06
216	600027	华电国际	4,700	18,471.00	0.06
217	002085	万丰奥威	3,400	18,258.00	0.06
218	000100	TCL 科技	3,800	18,202.00	0.06
219	002436	兴森科技	1,600	18,032.00	0.06
220	601965	中国汽研	1,100	17,831.00	0.06
221	000403	派林生物	800	17,568.00	0.06
222	601933	永辉超市	4,100	17,548.00	0.06
223	000729	燕京啤酒	1,800	17,388.00	0.06
224	000789	万年青	1,600	17,344.00	0.06
225	002597	金禾实业	400	17,332.00	0.06
226	002013	中航机电	1,400	17,290.00	0.06
227	300776	帝尔激光	100	17,280.00	0.06
228	603115	海星股份	700	17,199.00	0.06
229	603099	长白山	1,800	17,172.00	0.06
230	002268	卫士通	400	17,164.00	0.06
231	600782	新钢股份	3,400	17,136.00	0.06
232	603708	家家悦	1,200	17,088.00	0.06
233	601089	N 福元	810	17,050.50	0.06
234	300707	威唐工业	1,000	16,910.00	0.06
235	300818	耐普矿机	400	16,224.00	0.05
236	600415	小商品城	2,900	16,153.00	0.05
237	603773	沃格光电	1,000	16,000.00	0.05
238	000878	云南铜业	1,400	15,946.00	0.05
239	002850	科达利	100	15,900.00	0.05
240	601857	中国石油	3,000	15,900.00	0.05
241	300650	太龙股份	1,200	15,864.00	0.05
242	300583	赛托生物	700	15,820.00	0.05
243	601939	建设银行	2,600	15,756.00	0.05

244	600048	保利发展	900	15,714.00	0.05
245	603903	中持股份	1,600	15,712.00	0.05
246	600153	建发股份	1,200	15,684.00	0.05
247	300935	盈建科	500	15,640.00	0.05
248	002648	卫星化学	600	15,510.00	0.05
249	603926	铁流股份	1,500	15,405.00	0.05
250	002150	通润装备	2,300	15,341.00	0.05
251	300515	三德科技	1,500	15,300.00	0.05
252	603933	睿能科技	1,400	15,288.00	0.05
253	603328	依顿电子	2,400	15,240.00	0.05
254	002322	理工能科	1,700	15,215.00	0.05
255	601006	大秦铁路	2,300	15,157.00	0.05
256	300970	华绿生物	800	15,136.00	0.05
257	300074	华平股份	4,000	15,040.00	0.05
258	601186	中国铁建	1,900	15,010.00	0.05
259	300150	世纪瑞尔	3,700	14,911.00	0.05
260	300077	国民技术	800	14,864.00	0.05
261	603938	三孚股份	300	14,829.00	0.05
262	688521	芯原股份	300	14,820.00	0.05
263	002365	永安药业	1,200	14,784.00	0.05
264	601138	工业富联	1,500	14,760.00	0.05
265	603026	石大胜华	100	14,535.00	0.05
266	600867	通化东宝	1,400	14,476.00	0.05
267	600559	老白干酒	500	14,345.00	0.05
268	002649	博彦科技	1,400	14,294.00	0.05
269	600352	浙江龙盛	1,400	14,252.00	0.05
270	300373	扬杰科技	200	14,250.00	0.05
271	600111	北方稀土	400	14,064.00	0.05
272	600714	金瑞矿业	1,100	13,805.00	0.05
273	603006	黎明股份	1,500	13,665.00	0.05
274	002895	川恒股份	400	13,524.00	0.04
275	600584	长电科技	500	13,500.00	0.04
276	600170	上海建工	4,400	13,332.00	0.04
277	600486	扬农化工	100	13,328.00	0.04
278	600623	华谊集团	1,600	13,280.00	0.04
279	600123	兰花科创	800	13,160.00	0.04
280	603080	新疆火炬	1,000	13,080.00	0.04
281	601717	郑煤机	900	12,969.00	0.04
282	601231	环旭电子	900	12,924.00	0.04
283	605399	晨光新材	300	12,765.00	0.04
284	688033	天宜上佳	600	12,744.00	0.04
285	603227	雪峰科技	1,400	12,670.00	0.04
286	300349	金卡智能	1,300	12,662.00	0.04

287	600282	南钢股份	4,000	12,600.00	0.04
288	600673	东阳光	1,400	12,586.00	0.04
289	605111	新洁能	100	12,581.00	0.04
290	300562	乐心医疗	1,300	12,571.00	0.04
291	002182	云海金属	500	12,540.00	0.04
292	300308	中际旭创	400	12,420.00	0.04
293	002092	中泰化学	1,600	12,416.00	0.04
294	300552	万集科技	400	12,296.00	0.04
295	000717	韶钢松山	3,500	12,250.00	0.04
296	000898	鞍钢股份	3,800	12,236.00	0.04
297	600901	江苏租赁	2,300	11,799.00	0.04
298	000895	双汇发展	400	11,720.00	0.04
299	002110	三钢闽光	1,900	11,571.00	0.04
300	600741	华域汽车	500	11,500.00	0.04
301	300595	欧普康视	200	11,438.00	0.04
302	300773	拉卡拉	600	11,436.00	0.04
303	300160	秀强股份	1,400	11,382.00	0.04
304	600808	马钢股份	3,000	11,370.00	0.04
305	603156	养元饮品	500	11,360.00	0.04
306	000762	西藏矿业	200	11,186.00	0.04
307	600547	山东黄金	600	11,136.00	0.04
308	300748	金力永磁	300	11,040.00	0.04
309	605198	德利股份	600	10,944.00	0.04
310	300480	光力科技	600	10,764.00	0.04
311	000629	攀钢钒钛	2,800	10,640.00	0.04
312	300533	冰川网络	400	10,520.00	0.03
313	601600	中国铝业	2,200	10,450.00	0.03
314	300357	我武生物	200	10,406.00	0.03
315	603920	世运电路	600	10,380.00	0.03
316	000825	太钢不锈	1,900	10,355.00	0.03
317	000893	亚钾国际	300	10,323.00	0.03
318	601985	中国核电	1,500	10,290.00	0.03
319	601658	邮储银行	1,900	10,241.00	0.03
320	601678	滨化股份	1,700	10,183.00	0.03
321	300529	健帆生物	200	10,178.00	0.03
322	600888	新疆众和	1,100	10,120.00	0.03
323	300332	天壕环境	900	10,080.00	0.03
324	000959	首钢股份	2,100	9,996.00	0.03
325	601688	华泰证券	700	9,940.00	0.03
326	600179	安通控股	2,600	9,932.00	0.03
327	300652	雷迪克	400	9,788.00	0.03
328	300014	亿纬锂能	100	9,750.00	0.03
329	000932	华菱钢铁	1,900	9,671.00	0.03

330	300777	中简科技	200	9,640.00	0.03
331	300775	三角防务	200	9,630.00	0.03
332	300033	同花顺	100	9,615.00	0.03
333	002865	钧达股份	100	9,536.00	0.03
334	002258	利尔化学	400	9,448.00	0.03
335	001979	招商蛇口	700	9,401.00	0.03
336	601009	南京银行	900	9,378.00	0.03
337	601628	中国人寿	300	9,324.00	0.03
338	002376	新北洋	1,200	9,276.00	0.03
339	300861	美畅股份	100	9,269.00	0.03
340	000157	中联重科	1,500	9,240.00	0.03
341	600295	鄂尔多斯	500	9,025.00	0.03
342	300832	新产业	200	9,022.00	0.03
343	300358	楚天科技	500	8,895.00	0.03
344	601077	渝农商行	2,400	8,880.00	0.03
345	601997	贵阳银行	1,500	8,715.00	0.03
346	000707	双环科技	500	8,495.00	0.03
347	600183	生益科技	500	8,495.00	0.03
348	600128	弘业股份	1,000	8,440.00	0.03
349	002388	新亚制程	1,400	8,022.00	0.03
350	002601	龙佰集团	400	8,020.00	0.03
351	600987	航民股份	1,500	7,995.00	0.03
352	300275	梅安森	600	7,962.00	0.03
353	603032	德新交运	100	7,900.00	0.03
354	000631	顺发恒业	2,100	7,896.00	0.03
355	300433	蓝思科技	700	7,749.00	0.03
356	688669	聚石化学	300	7,689.00	0.03
357	300068	南都电源	500	7,670.00	0.03
358	300127	银河磁体	400	7,636.00	0.03
359	300628	亿联网络	100	7,615.00	0.03
360	601211	国泰君安	500	7,600.00	0.03
361	000425	徐工机械	1,400	7,546.00	0.03
362	603906	龙蟠科技	200	7,388.00	0.02
363	002952	亚世光电	600	7,344.00	0.02
364	002449	国星光电	900	7,281.00	0.02
365	300303	聚飞光电	1,500	7,200.00	0.02
366	600582	天地科技	1,500	7,170.00	0.02
367	000069	华侨城 A	1,100	7,139.00	0.02
368	000822	山东海化	700	7,112.00	0.02
369	300112	万讯自控	700	7,063.00	0.02
370	002809	红墙股份	700	7,000.00	0.02
371	600507	方大特钢	1,000	6,990.00	0.02
372	300226	上海钢联	300	6,795.00	0.02

373	300195	长荣股份	1,200	6,732.00	0.02
374	000719	中原传媒	900	6,705.00	0.02
375	603379	三美股份	300	6,675.00	0.02
376	002605	姚记科技	400	6,660.00	0.02
377	002743	富煌钢构	1,100	6,633.00	0.02
378	002326	永太科技	200	6,586.00	0.02
379	002521	齐峰新材	1,200	6,444.00	0.02
380	300354	东华测试	200	6,430.00	0.02
381	002381	双箭股份	1,000	6,420.00	0.02
382	300920	润阳科技	300	6,408.00	0.02
383	300739	明阳电路	400	6,408.00	0.02
384	600340	华夏幸福	2,000	6,400.00	0.02
385	601577	长沙银行	800	6,344.00	0.02
386	601669	中国电建	800	6,296.00	0.02
387	300735	光弘科技	600	6,270.00	0.02
388	300505	川金诺	200	6,192.00	0.02
389	603516	淳中科技	500	6,190.00	0.02
390	600051	宁波联合	900	6,147.00	0.02
391	300224	正海磁材	400	6,120.00	0.02
392	603300	华铁应急	760	6,057.20	0.02
393	300231	银信科技	800	6,056.00	0.02
394	605100	华丰股份	416	6,011.20	0.02
395	002741	光华科技	300	5,979.00	0.02
396	002252	上海莱士	1,000	5,930.00	0.02
397	002129	TCL 中环	100	5,889.00	0.02
398	002687	乔治白	1,305	5,833.35	0.02
399	688335	复洁环保	200	5,742.00	0.02
400	603993	洛阳钼业	1,000	5,730.00	0.02
401	301006	迈拓股份	300	5,640.00	0.02
402	000776	广发证券	300	5,610.00	0.02
403	002538	司尔特	500	5,580.00	0.02
404	600845	宝信软件	100	5,460.00	0.02
405	600362	江西铜业	300	5,349.00	0.02
406	600489	中金黄金	700	5,173.00	0.02
407	603456	九洲药业	100	5,170.00	0.02
408	300586	美联新材	300	5,157.00	0.02
409	002271	东方雨虹	100	5,147.00	0.02
410	601216	君正集团	1,000	4,880.00	0.02
411	300142	沃森生物	100	4,839.00	0.02
412	600988	赤峰黄金	300	4,785.00	0.02
413	600367	红星发展	200	4,388.00	0.01
414	600570	恒生电子	100	4,354.00	0.01
415	603279	景津装备	140	4,341.40	0.01

416	002624	完美世界	300	4,311.00	0.01
417	002128	电投能源	300	4,296.00	0.01
418	601998	中信银行	900	4,275.00	0.01
419	300498	温氏股份	200	4,258.00	0.01
420	000968	蓝焰控股	400	4,180.00	0.01
421	000915	华特达因	100	4,135.00	0.01
422	002230	科大讯飞	100	4,122.00	0.01
423	600188	兖矿能源	100	3,948.00	0.01
424	000975	银泰黄金	400	3,896.00	0.01
425	000848	承德露露	400	3,872.00	0.01
426	002414	高德红外	300	3,861.00	0.01
427	001914	招商积余	200	3,594.00	0.01
428	000726	鲁泰A	500	3,575.00	0.01
429	000735	罗牛山	500	3,410.00	0.01
430	603919	金徽酒	100	3,399.00	0.01
431	002064	华峰化学	400	3,376.00	0.01
432	002241	歌尔股份	100	3,360.00	0.01
433	600685	中船防务	200	3,298.00	0.01
434	002378	章源钨业	400	3,232.00	0.01
435	600886	国投电力	300	3,150.00	0.01
436	002885	京泉华	100	3,028.00	0.01
437	002677	浙江美大	200	2,934.00	0.01
438	601066	中信建投	100	2,891.00	0.01
439	000560	我爱我家	1,000	2,880.00	0.01
440	603387	基蛋生物	200	2,852.00	0.01
441	601618	中国中冶	800	2,800.00	0.01
442	601800	中国交建	300	2,784.00	0.01
443	600690	海尔智家	100	2,746.00	0.01
444	603806	福斯特	40	2,620.80	0.01
445	600597	光明乳业	200	2,526.00	0.01
446	000928	中钢国际	400	2,508.00	0.01
447	603959	百利科技	200	2,424.00	0.01
448	000402	金融街	400	2,380.00	0.01
449	000926	福星股份	500	2,375.00	0.01
450	600328	中盐化工	100	2,355.00	0.01
451	600746	江苏索普	200	2,316.00	0.01
452	002379	宏创控股	600	2,250.00	0.01
453	003816	中国广核	800	2,240.00	0.01
454	600346	恒力石化	100	2,224.00	0.01
455	002133	广宇集团	600	2,178.00	0.01
456	002948	青岛银行	600	2,172.00	0.01
457	002310	东方园林	900	2,169.00	0.01
458	000428	华天酒店	400	2,148.00	0.01

459	002839	张家港行	400	2,116.00	0.01
460	600011	华能国际	300	2,112.00	0.01
461	601882	海天精工	100	2,061.00	0.01
462	601319	中国人保	400	2,024.00	0.01
463	000708	中信特钢	100	2,015.00	0.01
464	000415	渤海租赁	900	1,953.00	0.01
465	000938	紫光股份	100	1,940.00	0.01
466	601881	中国银河	200	1,934.00	0.01
467	000517	荣安地产	600	1,908.00	0.01
468	002966	苏州银行	300	1,830.00	0.01
469	002807	江阴银行	400	1,812.00	0.01
470	000666	经纬纺机	200	1,796.00	0.01
471	600710	苏美达	300	1,770.00	0.01
472	002550	千红制药	300	1,719.00	0.01
473	002936	郑州银行	600	1,614.00	0.01
474	600606	绿地控股	400	1,584.00	0.01
475	600971	恒源煤电	200	1,580.00	0.01
476	601788	光大证券	100	1,576.00	0.01
477	001872	招商港口	100	1,560.00	0.01
478	002493	荣盛石化	100	1,539.00	0.01
479	601728	中国电信	400	1,492.00	0.00
480	600004	白云机场	100	1,491.00	0.00
481	002167	东方锆业	200	1,464.00	0.00
482	300831	派瑞股份	100	1,412.00	0.00
483	601377	兴业证券	200	1,410.00	0.00
484	600025	华能水电	200	1,398.00	0.00
485	000627	天茂集团	400	1,364.00	0.00
486	300607	拓斯达	100	1,322.00	0.00
487	002608	江苏国信	200	1,300.00	0.00
488	002562	兄弟科技	200	1,296.00	0.00
489	000728	国元证券	200	1,244.00	0.00
490	000877	天山股份	100	1,230.00	0.00
491	601118	海南橡胶	200	956.00	0.00
492	600758	辽宁能源	200	880.00	0.00
493	002658	雪迪龙	100	703.00	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	600519	贵州茅台	5,407,455.00	50.04

2	600036	招商银行	3,955,184.00	36.60
3	601318	中国平安	3,711,705.00	34.35
4	000333	美的集团	3,042,060.00	28.15
5	300750	宁德时代	2,967,116.00	27.46
6	601166	兴业银行	2,828,498.00	26.17
7	601328	交通银行	2,208,082.00	20.43
8	000651	格力电器	2,017,837.00	18.67
9	601398	工商银行	1,913,564.00	17.71
10	601919	中远海控	1,846,880.00	17.09
11	601668	中国建筑	1,677,947.00	15.53
12	600019	宝钢股份	1,627,888.00	15.06
13	002466	天齐锂业	1,554,676.00	14.39
14	002304	洋河股份	1,485,779.00	13.75
15	601077	渝农商行	1,485,607.00	13.75
16	601577	长沙银行	1,483,768.00	13.73
17	601939	建设银行	1,464,584.00	13.55
18	603527	众源新材	1,430,342.00	13.24
19	600141	兴发集团	1,416,895.00	13.11
20	600097	开创国际	1,400,939.00	12.96
21	000898	鞍钢股份	1,378,495.00	12.76
22	601012	隆基绿能	1,372,329.64	12.70
23	603933	睿能科技	1,348,632.00	12.48
24	603926	铁流股份	1,343,807.20	12.44
25	601088	中国神华	1,343,384.00	12.43
26	000002	万科 A	1,330,372.00	12.31
27	600900	长江电力	1,323,317.00	12.25
28	603706	东方环宇	1,291,961.00	11.96
29	002615	哈尔斯	1,252,716.00	11.59
30	000568	泸州老窖	1,242,083.00	11.49
31	000932	华菱钢铁	1,238,956.00	11.46
32	000858	五粮液	1,236,445.00	11.44
33	002460	赣锋锂业	1,226,632.00	11.35
34	000825	太钢不锈	1,212,124.00	11.22
35	002709	天赐材料	1,210,007.62	11.20
36	000959	首钢股份	1,203,091.00	11.13
37	601898	中煤能源	1,196,887.00	11.08
38	603696	安记食品	1,185,381.00	10.97
39	600985	淮北矿业	1,174,942.00	10.87
40	002594	比亚迪	1,165,272.00	10.78
41	600808	马钢股份	1,164,803.00	10.78
42	600030	中信证券	1,156,608.35	10.70
43	603259	药明康德	1,154,869.00	10.69
44	600997	开滦股份	1,154,091.00	10.68

45	000789	万年青	1,149,058.00	10.63
46	603392	万泰生物	1,142,464.60	10.57
47	600697	欧亚集团	1,139,795.68	10.55
48	600282	南钢股份	1,138,898.00	10.54
49	000717	韶钢松山	1,130,643.00	10.46
50	002142	宁波银行	1,117,069.70	10.34
51	300514	友讯达	1,098,534.00	10.17
52	600546	山煤国际	1,093,736.00	10.12
53	000725	京东方 A	1,091,268.00	10.10
54	600028	中国石化	1,089,014.00	10.08
55	601086	国芳集团	1,077,659.00	9.97
56	603006	黎明股份	1,074,790.00	9.95
57	002722	物产金轮	1,074,210.00	9.94
58	600887	伊利股份	1,040,346.00	9.63
59	002049	紫光国微	1,034,239.00	9.57
60	603937	丽岛新材	1,026,159.00	9.50
61	300316	晶盛机电	1,024,061.55	9.48
62	601988	中国银行	1,012,747.00	9.37
63	002394	联发股份	1,011,530.00	9.36
64	603986	兆易创新	1,003,919.00	9.29
65	600809	山西汾酒	1,000,787.00	9.26
66	603799	华友钴业	995,399.00	9.21
67	600057	厦门象屿	957,762.00	8.86
68	600854	春兰股份	956,332.00	8.85
69	688025	杰普特	950,286.06	8.79
70	600966	博汇纸业	938,342.13	8.68
71	601857	中国石油	935,815.00	8.66
72	600438	通威股份	928,923.00	8.60
73	600623	华谊集团	927,423.00	8.58
74	300059	东方财富	900,196.00	8.33
75	601601	中国太保	881,398.00	8.16
76	600581	八一钢铁	875,283.60	8.10
77	600089	特变电工	866,827.00	8.02
78	600048	保利发展	853,501.00	7.90
79	600308	华泰股份	851,306.00	7.88
80	002920	德赛西威	847,621.00	7.84
81	002869	金溢科技	828,292.00	7.66
82	603379	三美股份	822,961.00	7.62
83	600585	海螺水泥	820,619.00	7.59
84	002405	四维图新	819,348.00	7.58
85	002129	TCL 中环	804,747.00	7.45
86	002855	捷荣技术	799,007.00	7.39
87	601997	贵阳银行	798,457.00	7.39

88	601158	重庆水务	786,929.00	7.28
89	600160	巨化股份	776,554.40	7.19
90	600309	万华化学	774,842.00	7.17
91	601319	中国人保	772,011.00	7.14
92	000880	潍柴重机	771,725.00	7.14
93	600356	恒丰纸业	755,264.00	6.99
94	605399	晨光新材	752,609.00	6.96
95	000627	天茂集团	751,082.00	6.95
96	000425	徐工机械	747,851.00	6.92
97	601899	紫金矿业	746,414.00	6.91
98	603017	中衡设计	727,649.00	6.73
99	300398	飞凯材料	723,503.00	6.69
100	688099	晶晨股份	721,126.75	6.67
101	601001	晋控煤业	720,768.00	6.67
102	688005	容百科技	715,806.87	6.62
103	601339	百隆东方	709,240.00	6.56
104	603080	新疆火炬	707,861.00	6.55
105	300390	天华超净	703,201.00	6.51
106	300760	迈瑞医疗	701,357.00	6.49
107	601818	光大银行	700,909.00	6.49
108	000933	神火股份	692,466.00	6.41
109	600031	三一重工	687,623.00	6.36
110	000001	平安银行	680,689.00	6.30
111	600176	中国巨石	677,256.00	6.27
112	000498	山东路桥	675,914.00	6.25
113	002756	永兴材料	674,407.00	6.24
114	600276	恒瑞医药	669,194.00	6.19
115	300769	德方纳米	662,490.00	6.13
116	002811	郑中设计	660,215.00	6.11
117	002497	雅化集团	656,925.00	6.08
118	601888	中国中免	647,059.00	5.99
119	600233	圆通速递	642,826.00	5.95
120	603026	石大胜华	642,609.00	5.95
121	300192	科德教育	631,241.00	5.84
122	603198	迎驾贡酒	627,584.00	5.81
123	002371	北方华创	610,163.00	5.65
124	603289	泰瑞机器	609,166.00	5.64
125	002415	海康威视	600,774.00	5.56
126	000716	黑芝麻	598,124.00	5.53
127	600188	兖矿能源	594,512.00	5.50
128	603599	广信股份	588,614.00	5.45
129	601838	成都银行	580,916.00	5.38
130	000039	中集集团	568,513.00	5.26

131	603127	昭衍新药	568,201.00	5.26
132	603773	沃格光电	564,742.00	5.23
133	600389	江山股份	563,826.00	5.22
134	002475	立讯精密	560,037.00	5.18
135	002557	洽洽食品	558,557.00	5.17
136	603288	海天味业	556,752.00	5.15
137	300106	西部牧业	556,297.00	5.15
138	002966	苏州银行	556,098.00	5.15
139	601628	中国人寿	556,091.00	5.15
140	300515	三德科技	555,561.00	5.14
141	600050	中国联通	554,843.00	5.13
142	002826	易明医药	552,294.00	5.11
143	600436	片仔癀	550,622.00	5.10
144	002807	江阴银行	548,126.00	5.07
145	002410	广联达	546,847.00	5.06
146	002936	郑州银行	545,611.00	5.05
147	002948	青岛银行	542,845.00	5.02
148	600104	上汽集团	539,956.00	5.00
149	300601	康泰生物	534,794.00	4.95
150	601916	浙商银行	530,759.00	4.91
151	000776	广发证券	530,299.00	4.91
152	000625	长安汽车	525,450.00	4.86
153	603050	科林电气	523,824.00	4.85
154	002687	乔治白	522,784.00	4.84
155	000895	双汇发展	515,479.00	4.77
156	603928	兴业股份	510,776.00	4.73
157	603517	绝味食品	509,298.00	4.71
158	688329	艾隆科技	504,411.28	4.67
159	600893	航发动力	500,997.00	4.64
160	002582	好想你	498,783.00	4.62
161	002806	华锋股份	494,407.00	4.58
162	000100	TCL 科技	493,864.00	4.57
163	688981	中芯国际	489,929.32	4.53
164	300462	华铭智能	489,609.00	4.53
165	000069	华侨城 A	489,016.00	4.53
166	688004	博汇科技	487,334.48	4.51
167	688123	聚辰股份	482,766.74	4.47
168	002159	三特索道	481,746.00	4.46
169	603903	中持股份	480,884.00	4.45
170	688118	普元信息	480,034.49	4.44
171	000733	振华科技	479,117.00	4.43
172	601336	新华保险	473,786.00	4.38
173	600919	江苏银行	473,672.00	4.38

174	002927	泰永长征	470,098.00	4.35
175	002337	赛象科技	466,478.00	4.32
176	603217	元利科技	466,107.00	4.31
177	003019	宸展光电	463,147.00	4.29
178	002714	牧原股份	461,493.00	4.27
179	600639	浦东金桥	461,030.00	4.27
180	603037	凯众股份	460,298.20	4.26
181	601390	中国中铁	457,694.00	4.24
182	300768	迪普科技	454,720.62	4.21
183	603086	先达股份	454,682.00	4.21
184	000666	经纬纺机	453,934.00	4.20
185	002884	凌霄泵业	453,299.00	4.19
186	601678	滨化股份	452,168.00	4.18
187	603886	元祖股份	451,349.00	4.18
188	000421	南京公用	450,114.00	4.17
189	000719	中原传媒	448,884.00	4.15
190	300041	回天新材	448,767.00	4.15
191	002271	东方雨虹	448,504.00	4.15
192	000617	中油资本	446,759.00	4.13
193	601669	中国电建	438,225.00	4.06
194	601225	陕西煤业	437,155.00	4.05
195	600348	华阳股份	435,189.00	4.03
196	600111	北方稀土	433,285.00	4.01
197	688019	安集科技	432,791.00	4.00
198	000415	渤海租赁	431,952.00	4.00
199	002812	恩捷股份	429,800.00	3.98
200	300833	浩洋股份	428,523.00	3.97
201	300122	智飞生物	427,659.00	3.96
202	600406	国电南瑞	426,160.00	3.94
203	603868	飞科电器	420,570.00	3.89
204	001979	招商蛇口	419,969.00	3.89
205	600183	生益科技	417,102.50	3.86
206	601766	中国中车	416,311.00	3.85
207	600064	南京高科	415,994.00	3.85
208	603882	金城医学	415,766.00	3.85
209	601688	华泰证券	413,086.00	3.82
210	000553	安道麦 A	412,342.00	3.82
211	002240	盛新锂能	411,647.00	3.81
212	300150	世纪瑞尔	410,785.00	3.80
213	601699	潞安环能	408,309.00	3.78
214	300450	先导智能	407,570.00	3.77
215	300820	英杰电气	405,390.50	3.75
216	300268	佳沃食品	402,967.00	3.73

217	600873	梅花生物	402,657.00	3.73
218	000538	云南白药	400,640.00	3.71
219	600481	双良节能	400,111.00	3.70
220	002133	广宇集团	398,057.00	3.68
221	300073	当升科技	397,838.00	3.68
222	1928	金沙中国有限公司	395,506.89	3.66
223	603156	养元饮品	391,820.00	3.63
224	600096	云天化	391,417.00	3.62
225	002566	益盛药业	391,232.00	3.62
226	603993	洛阳钼业	386,083.00	3.57
227	600039	四川路桥	384,782.00	3.56
228	603290	斯达半导	383,522.00	3.55
229	002459	晶澳科技	383,463.00	3.55
230	000521	长虹美菱	379,416.00	3.51
231	300650	太龙股份	378,996.00	3.51
232	002839	张家港行	374,620.00	3.47
233	002352	顺丰控股	372,866.00	3.45
234	300661	圣邦股份	369,331.00	3.42
235	000830	鲁西化工	367,075.61	3.40
236	601211	国泰君安	365,597.00	3.38
237	605358	立昂微	362,153.00	3.35
238	688590	新致软件	361,521.03	3.35
239	000090	天健集团	357,286.00	3.31
240	002608	江苏国信	357,281.00	3.31
241	6818	中国光大银行	355,880.47	3.29
242	300124	汇川技术	355,426.00	3.29
243	688669	聚石化学	353,825.10	3.27
244	002601	龙佰集团	352,103.00	3.26
245	000402	金融街	349,427.00	3.23
246	601985	中国核电	349,180.00	3.23
247	000926	福星股份	347,869.00	3.22
248	2007	碧桂园	344,940.84	3.19
249	000552	靖远煤电	342,979.00	3.17
250	600760	中航沈飞	337,743.00	3.13
251	601618	中国中冶	337,402.00	3.12
252	300498	温氏股份	337,044.00	3.12
253	002192	融捷股份	336,555.00	3.11
254	600449	宁夏建材	336,348.00	3.11
255	600958	东方证券	336,202.64	3.11
256	605100	华丰股份	335,959.40	3.11
257	002241	歌尔股份	332,724.00	3.08
258	600018	上港集团	329,260.00	3.05
259	600690	海尔智家	329,017.00	3.04

260	000063	中兴通讯	326,260.00	3.02
261	002110	三钢闽光	325,040.00	3.01
262	002597	金禾实业	318,401.00	2.95
263	002881	美格智能	318,123.00	2.94
264	300274	阳光电源	316,683.00	2.93
265	688298	东方生物	316,430.87	2.93
266	000656	金科股份	311,210.00	2.88
267	603501	韦尔股份	310,912.00	2.88
268	600271	航天信息	307,624.00	2.85
269	601816	京沪高铁	306,739.00	2.84
270	603300	华铁应急	303,970.00	2.81
271	300014	亿纬锂能	302,977.00	2.80
272	600782	新钢股份	302,671.00	2.80
273	601009	南京银行	302,501.00	2.80
274	601138	工业富联	302,393.00	2.80
275	601186	中国铁建	302,257.00	2.80
276	000526	学大教育	300,344.00	2.78
277	000338	潍柴动力	299,653.00	2.77
278	688599	天合光能	295,860.95	2.74
279	601886	江河集团	295,607.00	2.74
280	002493	荣盛石化	294,428.00	2.72
281	300639	凯普生物	293,841.00	2.72
282	002027	分众传媒	293,313.00	2.71
283	688575	亚辉龙	289,723.24	2.68
284	002024	ST易购	288,052.00	2.67
285	000667	美好置业	286,860.00	2.65
286	002322	理工能科	285,874.00	2.65
287	000792	盐湖股份	285,366.00	2.64
288	000046	泛海控股	283,033.00	2.62
289	600027	华电国际	280,484.00	2.60
290	300652	雷迪克	279,237.00	2.58
291	688111	金山办公	279,185.00	2.58
292	603260	合盛硅业	278,972.00	2.58
293	000157	中联重科	276,840.00	2.56
294	601658	邮储银行	275,083.00	2.55
295	300015	爱尔眼科	274,850.00	2.54
296	002841	视源股份	269,718.00	2.50
297	000048	京基智农	267,301.00	2.47
298	000596	古井贡酒	265,485.00	2.46
299	300782	卓胜微	263,374.00	2.44
300	002850	科达利	262,923.00	2.43
301	688008	澜起科技	257,553.70	2.38
302	600522	中天科技	257,504.00	2.38

303	603819	神力股份	257,440.00	2.38
304	002482	ST 广田	254,320.00	2.35
305	601006	大秦铁路	254,201.00	2.35
306	001872	招商港口	254,102.00	2.35
307	601900	南方传媒	252,398.00	2.34
308	603578	三星新材	252,368.00	2.34
309	300363	博腾股份	251,268.00	2.33
310	600004	白云机场	250,771.00	2.32
311	600128	弘业股份	249,545.00	2.31
312	601117	中国化学	246,367.00	2.28
313	688598	金博股份	244,531.00	2.26
314	600426	华鲁恒升	243,484.00	2.25
315	600926	杭州银行	242,782.00	2.25
316	002576	通达动力	241,001.00	2.23
317	603516	淳中科技	240,964.00	2.23
318	003816	中国广核	240,179.00	2.22
319	300568	星源材质	238,989.48	2.21
320	688200	华峰测控	238,958.20	2.21
321	688516	奥特维	237,225.52	2.20
322	300741	华宝股份	237,208.00	2.20
323	600261	阳光照明	236,739.98	2.19
324	000153	丰原药业	235,208.00	2.18
325	300142	沃森生物	229,199.00	2.12
326	002230	科大讯飞	227,569.00	2.11
327	300118	东方日升	226,442.00	2.10
328	603659	璞泰来	226,349.00	2.09
329	601600	中国铝业	225,544.00	2.09
330	600409	三友化工	225,045.00	2.08
331	002843	泰嘉股份	224,469.00	2.08
332	000629	攀钢钒钛	223,532.00	2.07
333	600745	闻泰科技	222,162.00	2.06
334	002555	三七互娱	221,069.00	2.05
335	603757	大元泵业	220,361.00	2.04
336	601998	中信银行	219,976.00	2.04
337	300347	泰格医药	219,205.00	2.03
338	603486	科沃斯	218,172.00	2.02
339	300803	指南针	217,862.00	2.02
340	600742	一汽富维	216,791.00	2.01
341	002543	万和电气	216,372.00	2.00

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	4,679,048.00	43.30
2	600036	招商银行	3,857,853.00	35.70
3	601318	中国平安	3,597,115.00	33.29
4	000333	美的集团	3,117,513.00	28.85
5	601166	兴业银行	2,853,240.00	26.40
6	300750	宁德时代	2,815,679.00	26.06
7	601328	交通银行	2,325,415.00	21.52
8	000651	格力电器	2,099,011.00	19.42
9	601398	工商银行	1,957,416.00	18.11
10	601668	中国建筑	1,723,719.00	15.95
11	601919	中远海控	1,717,633.00	15.89
12	600019	宝钢股份	1,616,709.00	14.96
13	601577	长沙银行	1,569,452.00	14.52
14	601939	建设银行	1,541,133.00	14.26
15	601077	渝农商行	1,473,384.00	13.63
16	603527	众源新材	1,429,569.00	13.23
17	600141	兴发集团	1,420,754.00	13.15
18	000898	鞍钢股份	1,411,908.00	13.07
19	600097	开创国际	1,377,886.00	12.75
20	601012	隆基绿能	1,335,483.80	12.36
21	603706	东方环宇	1,325,122.00	12.26
22	000002	万科 A	1,318,893.00	12.20
23	603933	睿能科技	1,299,851.00	12.03
24	600900	长江电力	1,298,953.00	12.02
25	601898	中煤能源	1,293,859.00	11.97
26	603926	铁流股份	1,282,817.80	11.87
27	000932	华菱钢铁	1,268,170.00	11.74
28	600985	淮北矿业	1,238,484.00	11.46
29	002615	哈尔斯	1,234,887.50	11.43
30	601088	中国神华	1,224,276.00	11.33
31	000825	太钢不锈	1,214,192.00	11.24
32	600997	开滦股份	1,207,930.00	11.18
33	000959	首钢股份	1,199,535.00	11.10
34	603696	安记食品	1,198,844.00	11.09
35	600808	马钢股份	1,183,486.00	10.95
36	600697	欧亚集团	1,183,483.00	10.95
37	000789	万年青	1,178,502.00	10.91
38	000858	五粮液	1,172,862.20	10.85

39	600282	南钢股份	1,164,942.00	10.78
40	000717	韶钢松山	1,141,462.00	10.56
41	002466	天齐锂业	1,127,315.00	10.43
42	601086	国芳集团	1,107,531.00	10.25
43	603259	药明康德	1,105,818.00	10.23
44	601988	中国银行	1,101,245.00	10.19
45	002142	宁波银行	1,090,411.50	10.09
46	600028	中国石化	1,082,092.00	10.01
47	600546	山煤国际	1,080,743.00	10.00
48	002722	物产金轮	1,077,734.00	9.97
49	000725	京东方 A	1,065,414.00	9.86
50	603937	丽岛新材	1,053,321.00	9.75
51	300514	友讯达	1,043,864.00	9.66
52	603006	黎明股份	1,037,554.00	9.60
53	600057	厦门象屿	1,009,960.00	9.35
54	002049	紫光国微	1,009,955.00	9.35
55	002394	联发股份	991,371.00	9.17
56	600887	伊利股份	975,590.00	9.03
57	601857	中国石油	945,661.00	8.75
58	600854	春兰股份	938,335.00	8.68
59	600581	八一钢铁	933,208.80	8.64
60	600966	博汇纸业	927,296.00	8.58
61	002594	比亚迪	913,882.00	8.46
62	600623	华谊集团	904,813.00	8.37
63	600308	华泰股份	902,762.00	8.35
64	603799	华友钴业	875,224.00	8.10
65	300059	东方财富	875,025.80	8.10
66	600030	中信证券	865,478.15	8.01
67	688025	杰普特	864,948.70	8.00
68	603986	兆易创新	847,400.00	7.84
69	601601	中国太保	845,483.00	7.82
70	002869	金溢科技	839,453.00	7.77
71	600048	保利发展	816,942.00	7.56
72	002855	捷荣技术	814,583.00	7.54
73	002709	天赐材料	809,533.00	7.49
74	600585	海螺水泥	808,319.00	7.48
75	002129	TCL 中环	804,036.00	7.44
76	603392	万泰生物	799,628.00	7.40
77	601319	中国人保	797,497.00	7.38
78	601997	贵阳银行	779,140.00	7.21
79	600309	万华化学	774,378.00	7.17
80	601158	重庆水务	771,377.00	7.14
81	603379	三美股份	767,776.00	7.10

82	600089	特变电工	767,737.00	7.10
83	603017	中衡设计	765,409.00	7.08
84	300398	飞凯材料	763,119.00	7.06
85	601001	晋控煤业	761,380.00	7.05
86	605399	晨光新材	751,346.00	6.95
87	000880	潍柴重机	750,895.00	6.95
88	000425	徐工机械	750,830.00	6.95
89	600356	恒丰纸业	742,846.00	6.87
90	002405	四维图新	742,300.00	6.87
91	002460	赣锋锂业	738,214.00	6.83
92	000627	天茂集团	734,095.00	6.79
93	002920	德赛西威	727,330.00	6.73
94	600160	巨化股份	725,126.20	6.71
95	000498	山东路桥	718,810.00	6.65
96	688005	容百科技	713,414.25	6.60
97	600438	通威股份	704,707.18	6.52
98	601818	光大银行	701,297.80	6.49
99	300316	晶盛机电	700,317.00	6.48
100	000568	泸州老窖	700,285.00	6.48
101	300760	迈瑞医疗	697,171.00	6.45
102	002811	郑中设计	690,680.00	6.39
103	601888	中国中免	689,109.00	6.38
104	600809	山西汾酒	687,555.00	6.36
105	603080	新疆火炬	685,508.00	6.34
106	600031	三一重工	670,237.00	6.20
107	688099	晶晨股份	660,797.10	6.11
108	601339	百隆东方	645,277.00	5.97
109	603127	昭衍新药	632,160.00	5.85
110	000001	平安银行	630,991.00	5.84
111	300192	科德教育	625,567.00	5.79
112	002415	海康威视	618,023.00	5.72
113	600276	恒瑞医药	612,932.00	5.67
114	600188	兖矿能源	609,094.00	5.64
115	603289	泰瑞机器	608,770.00	5.63
116	002475	立讯精密	607,420.00	5.62
117	600233	圆通速递	596,202.00	5.52
118	000716	黑芝麻	592,007.00	5.48
119	601899	紫金矿业	585,290.00	5.42
120	600436	片仔癀	584,936.00	5.41
121	603198	迎驾贡酒	579,715.00	5.36
122	600176	中国巨石	577,118.44	5.34
123	000039	中集集团	575,884.09	5.33
124	002826	易明医药	558,536.00	5.17

125	002807	江阴银行	557,874.00	5.16
126	300106	西部牧业	555,522.00	5.14
127	600050	中国联通	551,286.00	5.10
128	002371	北方华创	550,860.00	5.10
129	002966	苏州银行	548,735.00	5.08
130	603773	沃格光电	542,886.60	5.02
131	603026	石大胜华	541,211.00	5.01
132	603288	海天味业	539,386.30	4.99
133	002948	青岛银行	539,108.00	4.99
134	600104	上汽集团	530,506.00	4.91
135	601628	中国人寿	530,157.00	4.91
136	000776	广发证券	530,078.00	4.91
137	300515	三德科技	528,054.00	4.89
138	002936	郑州银行	527,044.00	4.88
139	601916	浙商银行	525,421.00	4.86
140	002687	乔治白	522,514.00	4.84
141	603050	科林电气	516,416.00	4.78
142	603928	兴业股份	515,193.00	4.77
143	601838	成都银行	512,834.00	4.75
144	000895	双汇发展	512,363.00	4.74
145	002410	广联达	509,751.00	4.72
146	000100	TCL 科技	508,930.00	4.71
147	002497	雅化集团	508,173.00	4.70
148	002557	洽洽食品	498,711.00	4.61
149	002582	好想你	486,490.00	4.50
150	688004	博汇科技	485,164.44	4.49
151	688329	艾隆科技	479,039.93	4.43
152	601669	中国电建	477,700.00	4.42
153	000666	经纬纺机	476,461.00	4.41
154	601336	新华保险	476,237.00	4.41
155	300462	华铭智能	475,711.00	4.40
156	601225	陕西煤业	474,266.00	4.39
157	603517	绝味食品	472,548.00	4.37
158	000069	华侨城 A	471,700.00	4.36
159	002806	华锋股份	470,695.00	4.36
160	002927	泰永长征	468,156.00	4.33
161	603037	凯众股份	464,777.00	4.30
162	688118	普元信息	463,047.61	4.28
163	002337	赛象科技	461,007.00	4.27
164	300601	康泰生物	458,014.00	4.24
165	600406	国电南瑞	455,394.00	4.21
166	601390	中国中铁	455,135.00	4.21
167	603903	中持股份	453,198.04	4.19

168	603086	先达股份	452,702.00	4.19
169	000421	南京公用	450,404.00	4.17
170	002304	洋河股份	448,401.00	4.15
171	002133	广宇集团	445,669.00	4.12
172	002159	三特索道	443,713.00	4.11
173	000719	中原传媒	442,000.00	4.09
174	601678	滨化股份	441,994.99	4.09
175	002714	牧原股份	439,864.00	4.07
176	603886	元祖股份	438,175.00	4.05
177	002812	恩捷股份	437,734.00	4.05
178	600348	华阳股份	432,768.00	4.00
179	600111	北方稀土	432,545.00	4.00
180	002271	东方雨虹	431,805.00	4.00
181	600039	四川路桥	426,679.00	3.95
182	000625	长安汽车	425,871.00	3.94
183	002566	益盛药业	425,414.00	3.94
184	000538	云南白药	422,393.00	3.91
185	000415	渤海租赁	421,952.00	3.90
186	600183	生益科技	421,782.70	3.90
187	600481	双良节能	418,915.00	3.88
188	603290	斯达半导	418,238.00	3.87
189	000617	中油资本	417,819.00	3.87
190	001979	招商蛇口	414,080.00	3.83
191	601766	中国中车	404,683.00	3.74
192	601688	华泰证券	403,381.00	3.73
193	300450	先导智能	401,526.60	3.72
194	603156	养元饮品	393,808.00	3.64
195	600449	宁夏建材	393,733.00	3.64
196	300150	世纪瑞尔	393,485.00	3.64
197	000830	鲁西化工	392,308.00	3.63
198	300122	智飞生物	390,389.00	3.61
199	002839	张家港行	384,027.60	3.55
200	000090	天健集团	383,496.00	3.55
201	688981	中芯国际	382,348.05	3.54
202	000933	神火股份	382,317.00	3.54
203	603993	洛阳钼业	381,172.00	3.53
204	000521	长虹美菱	380,048.00	3.52
205	601699	潞安环能	373,131.00	3.45
206	688499	利元亨	371,313.27	3.44
207	300650	太龙股份	362,499.00	3.35
208	002756	永兴材料	361,936.00	3.35
209	1928	金沙中国有限公司	361,566.45	3.35
210	000926	福星股份	360,579.70	3.34

211	601211	国泰君安	358,956.00	3.32
212	600096	云天化	356,186.00	3.30
213	000402	金融街	356,044.00	3.29
214	002241	歌尔股份	355,816.00	3.29
215	603217	元利科技	355,639.00	3.29
216	002608	江苏国信	353,091.00	3.27
217	600919	江苏银行	352,868.00	3.27
218	000063	中兴通讯	350,833.00	3.25
219	601985	中国核电	346,320.00	3.20
220	300124	汇川技术	345,312.00	3.20
221	6818	中国光大银行	344,545.14	3.19
222	603882	金域医学	344,200.00	3.19
223	002459	晶澳科技	343,970.00	3.18
224	300274	阳光电源	343,839.00	3.18
225	000552	靖远煤电	343,045.00	3.17
226	605358	立昂微	342,283.00	3.17
227	600389	江山股份	342,278.00	3.17
228	002601	龙佰集团	339,918.00	3.15
229	603501	韦尔股份	339,373.00	3.14
230	600271	航天信息	338,771.00	3.13
231	603599	广信股份	338,647.00	3.13
232	600958	东方证券	333,310.12	3.08
233	300014	亿纬锂能	332,566.00	3.08
234	688669	聚石化学	331,115.27	3.06
235	2007	碧桂园	329,944.62	3.05
236	300073	当升科技	328,983.00	3.04
237	600690	海尔智家	328,857.00	3.04
238	601618	中国中冶	326,406.00	3.02
239	300498	温氏股份	326,385.00	3.02
240	300041	回天新材	321,062.00	2.97
241	688590	新致软件	316,381.44	2.93
242	601886	江河集团	316,303.00	2.93
243	605100	华丰股份	312,987.00	2.90
244	000656	金科股份	312,071.00	2.89
245	600639	浦东金桥	310,931.00	2.88
246	601816	京沪高铁	310,192.00	2.87
247	688599	天合光能	308,530.15	2.86
248	002027	分众传媒	306,422.00	2.84
249	002597	金禾实业	304,727.00	2.82
250	601138	工业富联	301,147.90	2.79
251	600522	中天科技	299,840.00	2.77
252	002322	理工能科	299,278.00	2.77
253	601186	中国铁建	299,278.00	2.77

254	601009	南京银行	297,539.00	2.75
255	000526	学大教育	297,024.00	2.75
256	300768	迪普科技	292,338.00	2.71
257	000553	安道麦 A	289,456.00	2.68
258	002110	三钢闽光	289,050.00	2.67
259	600893	航发动力	288,419.00	2.67
260	000157	中联重科	288,160.00	2.67
261	002493	荣盛石化	285,027.00	2.64
262	002884	凌霄泵业	284,820.00	2.64
263	000338	潍柴动力	284,795.00	2.64
264	603868	飞科电器	284,535.00	2.63
265	688111	金山办公	284,523.70	2.63
266	601117	中国化学	283,929.00	2.63
267	002352	顺丰控股	282,932.00	2.62
268	600782	新钢股份	281,745.00	2.61
269	300769	德方纳米	281,585.80	2.61
270	300015	爱尔眼科	280,660.00	2.60
271	000667	美好置业	278,365.38	2.58
272	300268	佳沃食品	277,862.00	2.57
273	600027	华电国际	276,368.00	2.56
274	002881	美格智能	276,353.00	2.56
275	603260	合盛硅业	275,907.00	2.55
276	300118	东方日升	273,600.00	2.53
277	002024	ST 易购	272,944.00	2.53
278	002482	ST 广田	272,682.00	2.52
279	603300	华铁应急	272,517.00	2.52
280	000046	泛海控股	269,106.00	2.49
281	600018	上港集团	266,655.00	2.47
282	000048	京基智农	265,573.00	2.46
283	601658	邮储银行	265,459.00	2.46
284	688019	安集科技	265,009.00	2.45
285	300652	雷迪克	262,395.00	2.43
286	300820	英杰电气	261,340.00	2.42
287	300833	浩洋股份	259,596.00	2.40
288	603578	三星新材	258,280.00	2.39
289	601600	中国铝业	255,314.00	2.36
290	603819	神力股份	254,487.00	2.35
291	002850	科达利	250,650.00	2.32
292	600064	南京高科	250,448.00	2.32
293	600926	杭州银行	248,983.00	2.30
294	603516	淳中科技	248,842.00	2.30
295	601006	大秦铁路	248,717.00	2.30
296	003816	中国广核	247,654.00	2.29

297	300782	卓胜微	245,945.00	2.28
298	001872	招商港口	244,900.00	2.27
299	688123	聚辰股份	238,962.60	2.21
300	600004	白云机场	238,859.00	2.21
301	300741	华宝股份	237,047.00	2.19
302	003019	宸展光电	234,828.00	2.17
303	600261	阳光照明	233,366.00	2.16
304	600426	华鲁恒升	233,344.40	2.16
305	002230	科大讯飞	230,604.00	2.13
306	300625	三雄极光	230,484.00	2.13
307	600128	弘业股份	228,636.00	2.12
308	000153	丰原药业	227,311.00	2.10
309	000050	深天马 A	227,105.00	2.10
310	600742	一汽富维	225,928.90	2.09
311	600409	三友化工	222,460.00	2.06
312	000733	振华科技	222,346.00	2.06
313	002576	通达动力	221,015.00	2.05
314	1378	中国宏桥	220,625.01	2.04
315	300142	沃森生物	219,422.00	2.03
316	688598	金博股份	219,139.00	2.03
317	000629	攀钢钒钛	218,777.00	2.02
318	300347	泰格医药	218,528.00	2.02
319	603486	科沃斯	216,649.00	2.00

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

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	292,262,465.44
卖出股票的收入（成交）总额	273,737,794.74

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

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，江西赣锋锂业股份有限公司在本期报告编制期间被中国证券监督管理委员会立案调查。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	37,345.83
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,088.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,434.21

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
博时量化价值股票 A	725	5,748.70	0.00	0.00%	4,167,810.51	100.00%
博时量化价值股票 C	465	36,549.23	13,754,212.23	80.93%	3,241,179.26	19.07%
合计	1,114	18,997.49	13,754,212.23	64.99%	7,408,989.77	35.01%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化价值股票 A	73,121.64	1.75%
	博时量化价值股票 C	50.00	0.00%
	合计	73,171.64	0.35%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	0~10
	博时量化价值股票 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	0~10
	博时量化价值股票 C	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 26 日）基金份额总额	177,981,219.30	163,210,681.29
本报告期期初基金份额总额	4,024,249.48	2,996,364.72
本报告期基金总申购份额	1,193,131.01	46,934,003.07
减：本报告期基金总赎回份额	1,049,569.98	32,934,976.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,167,810.51	16,995,391.49

§ 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，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人在本报告期内重大人事变动情况：任命王霄勇任托管业务部总裁，任命王洪滨任托管业务部高级专家。

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安永华明会计师事务所（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	
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	7,229,981.32	1.28%	6,732.38	1.30%	-
国金证券	1	82,216,337.39	14.53%	76,569.25	14.77%	-
招商证券	2	196,842,889.83	34.78%	183,311.18	35.35%	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	112,438,452.04	19.87%	104,712.21	20.19%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	34,500,930.43	6.10%	32,130.91	6.20%	-
中信建投	1	30,085,445.33	5.32%	22,001.86	4.24%	-
申万宏源	2	87,467,465.21	15.46%	81,458.00	15.71%	-
华泰证券	1	15,145,495.35	2.68%	11,606.97	2.24%	-

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

息服务；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
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	25,385.15	15.95%	-	-	-	-
招商证券	54,463.80	34.22%	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	79,311.20	49.83%	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-18
2	关于博时量化价值股票型证券投资基金开通直销网上交易定期投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-16
3	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-30
4	博时量化价值股票型证券投资基金 2022 年第	中国证券报、基金管理人	2022-04-22

	1 季度报告	网站、证监会基金电子披露网站	
5	博时量化价值股票型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-30
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	中国证券报、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	中国证券报、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	中国证券报、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投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
10	博时量化价值股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-24
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20220121	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-21
12	关于成立博时财富基金销售有限公司的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-20
13	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-06
14	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-04
15	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01
16	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	中国证券报、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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-02-09~ 2022-06-30	-	13,754,212.23	-	13,754,212.23	64.99%
	2	2022-02-24~ 2022-02-24	-	6,877,106.11	6,877,106.11	-	-
	3	2022-02-09~ 2022-02-23	-	7,564,816.73	7,564,816.73	-	-
	4	2022-05-25~ 2022-05-31	-	17,493,154.85	17,493,154.85	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时量化价值股票型证券投资基金设立的文件

- 12.1.2 《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时量化价值股票型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 12.1.5 博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时量化价值股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日