

博时量化多策略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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	5
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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.....	13
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	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71

7.12 投资组合报告附注.....	71
§8 基金份额持有人信息.....	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
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.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
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.....	76
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	78
12.3 查阅方式.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化多策略股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化多策略股票	
基金主代码	005635	
交易代码	005635	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	133,313,474.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
下属分级基金的交易代码	005635	005636
报告期末下属分级基金的份额总额	123,287,370.25 份	10,026,104.63 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张燕
	联系电话	0755-83169999	0755-83199084
	电子邮箱	service@bosera.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		江向阳	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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）	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	-19,288,159.21	-1,296,157.96
本期利润	-12,581,797.32	-822,647.21
加权平均基金份额本期利润	-0.1073	-0.0896
本期加权平均净值利润率	-7.17%	-6.16%
本期基金份额净值增长率	-6.23%	-6.62%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
期末可供分配利润	56,318,103.24	4,088,445.03
期末可供分配基金份额利润	0.4568	0.4078
期末基金资产净值	189,322,838.69	14,875,456.01
期末基金份额净值	1.5356	1.4837
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金份额累计净值增长率	53.56%	48.37%

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

博时量化多策略股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.20%	1.02%	7.04%	0.96%	-0.84%	0.06%
过去三个月	4.32%	1.27%	4.27%	1.36%	0.05%	-0.09%
过去六个月	-6.23%	1.28%	-7.76%	1.39%	1.53%	-0.11%
过去一年	-5.57%	1.08%	-10.18%	1.15%	4.61%	-0.07%
过去三年	58.60%	1.13%	16.73%	1.11%	41.87%	0.02%
自基金合同生效起至今	53.56%	1.21%	9.64%	1.15%	43.92%	0.06%

博时量化多策略股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	6.13%	1.02%	7.04%	0.96%	-0.91%	0.06%
过去三个月	4.12%	1.27%	4.27%	1.36%	-0.15%	-0.09%
过去六个月	-6.62%	1.28%	-7.76%	1.39%	1.14%	-0.11%
过去一年	-6.34%	1.08%	-10.18%	1.15%	3.84%	-0.07%
过去三年	54.78%	1.13%	16.73%	1.11%	38.05%	0.02%
自基金合同生效起至今	48.37%	1.21%	9.64%	1.15%	38.73%	0.06%

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

用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

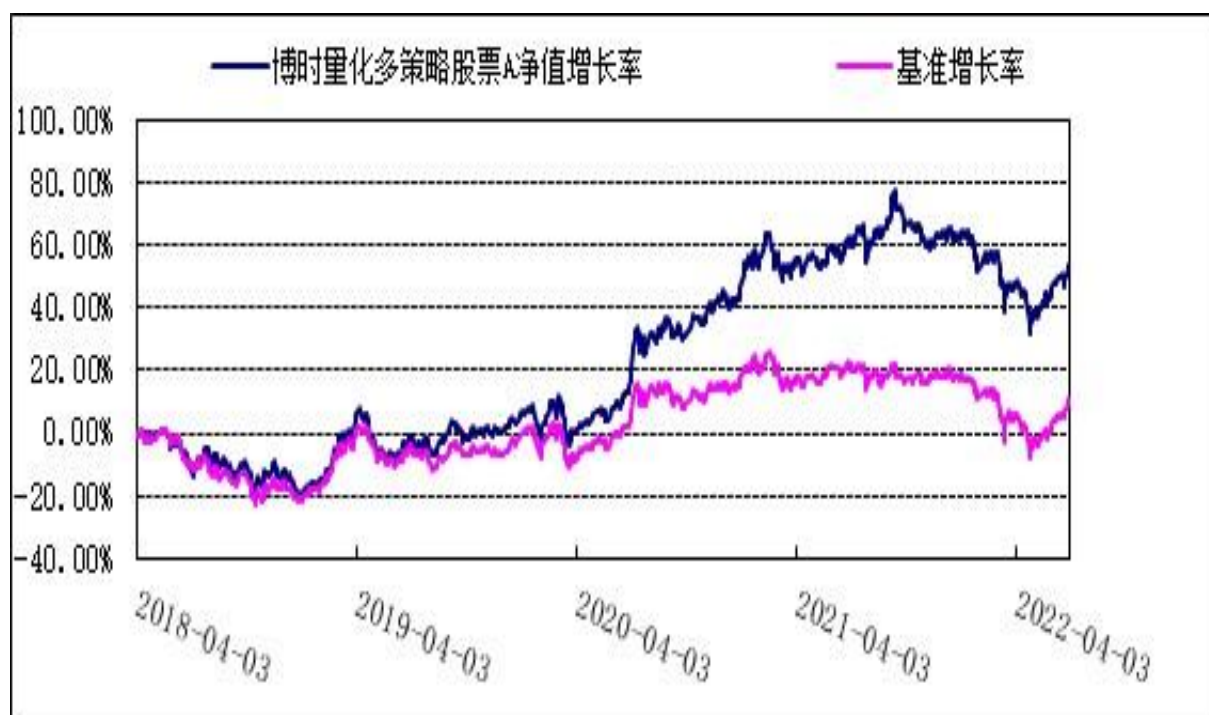
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化多策略股票型证券投资基金

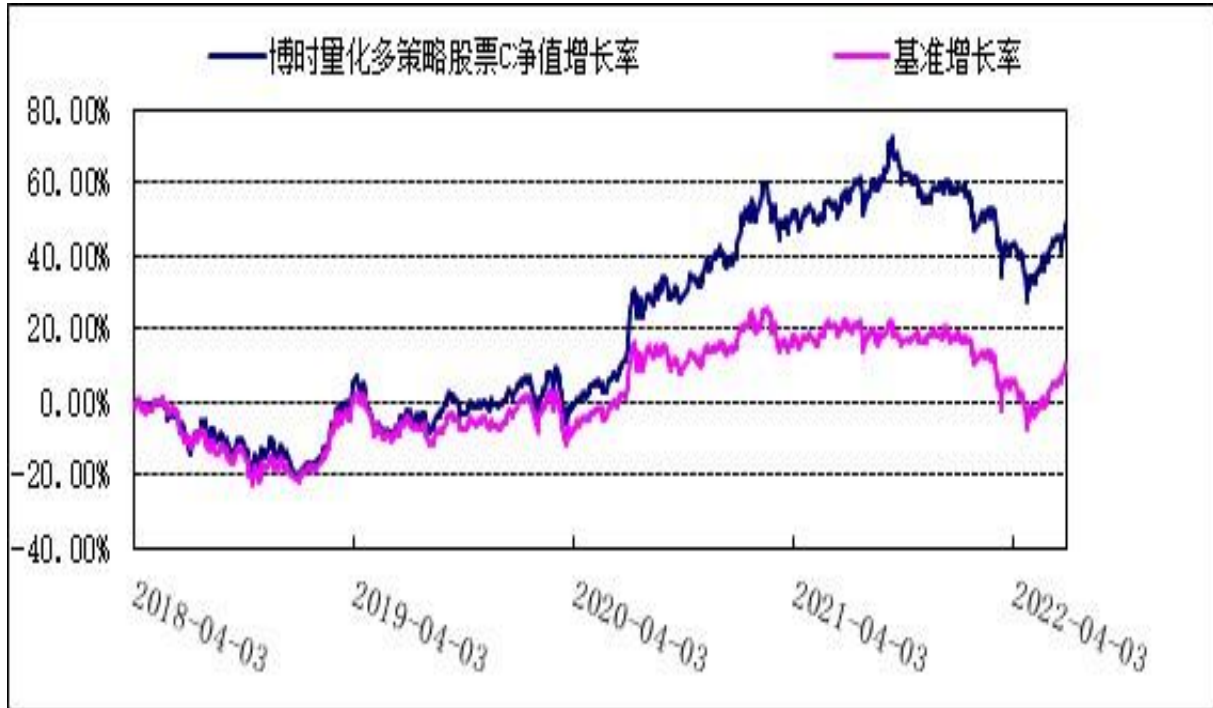
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 4 月 3 日至 2022 年 6 月 30 日)

博时量化多策略股票 A



博时量化多策略股票 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	2018-04-03	-	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

					<p>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。</p>
黄瑞庆	指数与量化投资部 总经理/基金经理	2018-04-03	-	19.9	<p>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</p>

					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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 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 年上半年全市场波动水平相比去年同期有所上升, 成交量持续增长。市场在 4 月触底后开

始了一轮持续反弹，但仍未修复年初以来的跌幅。在本轮行情中，各主要指数走势比较一致，当中以上证 50 跌幅最少，科创 50 表现最差，但科创 50 在反弹行情中表现较好，仅次于中证 1000 和创业板。

市场风格方面，对于大小盘来说，一二季度风格切换比较剧烈，一季度小盘较好而二季度大盘较好。对于价值成长来说，一季度走强的价值风格在二季度出现回落，特别在 6 月份显著弱于成长风格。具体到指数上，大盘价值和小盘价值在整个区间内表现较好，但在反弹行情中大幅落后于小盘成长和大盘成长。动量风格则在 6 月前维持强势，后续进入震荡调整。

在行业层面，周期板块表现较好，科技板块较弱。具体而言，煤炭、消费者服务、交通运输实现了正收益，且煤炭涨幅远高于其它行业，电子、传媒、计算机、军工跌幅较大。

本基金在 2022 年上半年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了较高的股票仓位。在量化策略的配置上，整体上以趋势跟踪为主，但及时对风格变化做出响应，超配小盘，同时阶段性地布局了大盘价值，获取了一定的超额收益。此外，组合参与新股申购也获取了一定的收益。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求为投资者获取长期稳健的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.5356 元，份额累计净值为 1.5356 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.4837 元，份额累计净值为 1.4837 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-6.23%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-6.62%，同期业绩基准增长率为-7.76%。

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，外部环境不确定性依然较大，俄乌冲突持续冲击能源、粮食等供应，推高全球滞胀风险，美国等主要经济体货币政策进一步紧缩，全球金融市场波动或有所加大。国内虽然面临多重压力，但随着疫情冲击趋缓，中国经济已彰显出了快速探底企稳的韧性，从资本市场角度看，下半年中国经济复苏的确定性较高，同时通胀压力显著小于其他主要经济体，政策空间相对充裕，人民币资产有望在美元加息周期中凸显独特配置价值。

在此背景下，市场或更多以结构性机会为主，我们将密切关注基本面变化，挖掘在成本挑战下仍能实现稳健利润的企业，挑选前景相对明确、估值和业绩匹配度较好的板块和公司。我们将更为注重投资性价比和安全边际，使用科学的量化投资策略平滑市场波动的影响，综合考虑选股模型、风险模型、交易成本模型做出更加有效的投资决策，力求实现组合业绩的稳步增长。

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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化多策略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	11,827,286.01	14,002,379.60
结算备付金		4,630,842.59	6,181,764.16
存出保证金		104,521.64	130,696.28
交易性金融资产	6.4.4.2	188,541,738.53	228,718,141.08
其中：股票投资		188,541,738.53	227,748,048.18
基金投资		-	-
债券投资		-	970,092.90
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		207,402.15	155,658.44
应收股利		-	-
应收申购款		7,339.99	17,431.52
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.4.5	-	4,939.57
资产总计		205,319,130.91	249,211,010.65
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 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		0.03	-
应付赎回款		33,748.09	5,461.38
应付管理人报酬		239,432.39	320,075.02
应付托管费		39,905.42	53,345.82
应付销售服务费		9,629.28	21,937.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.6	798,120.66	1,502,689.19
负债合计		1,120,836.21	1,903,508.78
净资产:			
实收基金	6.4.4.7	133,313,474.88	151,413,892.69
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.4.8	70,884,819.82	95,893,609.18
净资产合计		204,198,294.70	247,307,501.87
负债和净资产总计		205,319,130.91	249,211,010.65

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 133,313,474.88 份。其中 A 类基金份额净值 1.5356 元，基金份额 123,287,370.25 份；C 类基金份额净值 1.4837 元，基金份额 10,026,104.63 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：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		-11,613,212.08	25,972,893.16
1. 利息收入		63,110.56	84,242.11
其中：存款利息收入	6.4.4.9	63,110.56	83,248.57
债券利息收入		-	993.54
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）		-18,921,467.06	36,834,951.83
其中：股票投资收益	6.4.4.10	-21,271,981.41	34,011,546.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.4.11	242,929.31	941,608.69
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	-136,936.99	450,565.82
股利收益	6.4.4.14	2,244,522.03	1,431,231.04
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	7,179,872.64	-10,981,006.43
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	65,271.78	34,705.65
减：二、营业总支出		1,791,232.45	5,152,507.67
1. 管理人报酬		1,408,711.21	1,606,751.81
2. 托管费		234,785.25	267,791.89
3. 销售服务费		53,238.21	130,483.50
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		0.16	1,685.46
8. 其他费用	6.4.4.18	94,497.62	3,145,795.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,404,444.53	20,820,385.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,404,444.53	20,820,385.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,404,444.53	20,820,385.49

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：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)	151,413,892.69	-	95,893,609.18	247,307,501.87
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)	151,413,892.69	-	95,893,609.18	247,307,501.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,100,417.81	-	-25,008,789.36	-43,109,207.17
(一)、综合收益总额	-	-	-13,404,444.53	-13,404,444.53
(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)	-18,100,417.81	-	-11,604,344.83	-29,704,762.64
其中: 1. 基金申购款	81,978,454.81	-	40,995,361.61	122,973,816.42
2. 基金赎回款	-100,078,872.62	-	-52,599,706.44	-152,678,579.06
(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)	133,313,474.88	-	70,884,819.82	204,198,294.70
		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
项目	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)	173,528,789.84	-	80,507,391.78	254,036,181.62
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)	173,528,789.84	-	80,507,391.78	254,036,181.62

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-77,872,746.40	-	-20,791,467.95	-98,664,214.35
(一)、综合收益总额	-	-	20,820,385.49	20,820,385.49
(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)	-77,872,746.40	-	-41,611,853.44	-119,484,599.84
其中: 1. 基金申购款	106,575,845.82	-	57,225,335.97	163,801,181.79
2. 基金赎回款	-184,448,592.22	-	-98,837,189.41	-283,285,781.63
(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)	95,656,043.44	-	59,715,923.83	155,371,967.27

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 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

除下述会计政策和会计估计外, 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.1.1 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商业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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

(2) 金融负债的分类

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

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

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。

6.4.1.3 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。

6.4.2 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

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、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 14,002,379.60 元、6,181,764.16 元、130,696.28 元、4,939.57 元、155,658.44 元和 17,431.52 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、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 14,003,929.99 元、6,184,820.39 元、130,760.96 元、0.00 元、155,658.44 元和 17,431.52 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 228,718,141.08 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 228,718,409.35 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,461.38 元、320,075.02 元、53,345.82 元、21,937.02 元、1,333,182.67 元和 6.52 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,461.38 元、320,075.02 元、53,345.82 元、21,937.02 元、1,333,182.67 元和 6.52 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。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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。

6.4.4 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	11,827,286.01
等于: 本金	11,826,153.48
加: 应计利息	1,132.53
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	11,827,286.01

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	177,241,412.81	-	188,541,738.53	11,300,325.72
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	177,241,412.81	-	188,541,738.53	11,300,325.72

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	0.97
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	711,796.83
其中：交易所市场	711,796.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,322.86
合计	798,120.66

6.4.4.7 实收基金

博时量化多策略股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	137,957,614.05	137,957,614.05
本期申购	75,392,422.08	75,392,422.08
本期赎回（以“-”号填列）	-90,062,665.88	-90,062,665.88
本期末	123,287,370.25	123,287,370.25

博时量化多策略股票 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	13,456,278.64	13,456,278.64
本期申购	6,586,032.73	6,586,032.73
本期赎回（以“-”号填列）	-10,016,206.74	-10,016,206.74
本期末	10,026,104.63	10,026,104.63

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

博时量化多策略股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	86,288,960.75	1,680,070.04	87,969,030.79
本期利润	-19,288,159.21	6,706,361.89	-12,581,797.32
本期基金份额交易产生的变动数	-10,682,698.30	1,330,933.27	-9,351,765.03
其中：基金申购款	40,622,714.60	-2,402,661.72	38,220,052.88
基金赎回款	-51,305,412.90	3,733,594.99	-47,571,817.91

本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,318,103.24	9,717,365.20	66,035,468.44

博时量化多策略股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,767,628.80	156,949.59	7,924,578.39
本期利润	-1,296,157.96	473,510.75	-822,647.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,383,025.81	130,446.01	-2,252,579.80
其中：基金申购款	2,974,715.66	-199,406.93	2,775,308.73
基金赎回款	-5,357,741.47	329,852.94	-5,027,888.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,088,445.03	760,906.35	4,849,351.38

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	24,664.79
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	37,333.71
其他	1,112.06
合计	63,110.56

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	1,208,117,444.30
减：卖出股票成本总额	1,226,193,254.01
减：交易费用	3,196,171.70
买卖股票差价收入	-21,271,981.41

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	8,994.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及	233,934.90

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	242,929.31

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	7,628,257.97
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	7,260,277.99
减: 应计利息总额	134,034.36
减: 交易费用	10.72
买卖债券差价收入	233,934.90

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

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-136,936.99

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	2,244,522.03
其中: 证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,244,522.03

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	7,179,872.64
——股票投资	7,236,187.55
——债券投资	-56,314.91
——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	7,179,872.64

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	63,499.10
基金转换费收入	1,772.68
合计	65,271.78

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	55.10
银行汇划费	3,619.66
中债登账户维护费	9,000.00
合计	94,497.62

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

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	1,518,805,884.31	63.76%	603,953,592.94	27.04%

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

		额的比例		比例
招商证券	6,420,891.88	85.65%	469,022.00	10.50%

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	1,110,687.90	63.70%	711,793.06	100.00%
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	441,678.09	27.04%	441,477.39	54.04%

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	1,408,711.21	1,606,751.81
其中：支付销售机构的客户维护费	72,255.23	65,504.20

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。

6.4.7.2.2 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	234,785.25	267,791.89

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.7.2.3 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		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	10,869.62	10,869.62
招商银行	-	920.90	920.90
招商证券	-	69.79	69.79
合计	-	11,860.31	11,860.31
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		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	102,091.50	102,091.50
招商银行	-	1,290.46	1,290.46
招商证券	-	73.20	73.20
合计	-	103,455.16	103,455.16

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：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 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

无。

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
招商银行-活期存款	11,827,286.01	24,664.79	9,692,233.03	36,869.65

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	30,540.00	97,728.00
招商证券	301123	奕东电子	网下发行	1,710.00	63,663.30
招商证券	600030	中信证券	配股	5,565.00	80,302.95
招商证券	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89
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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
600941	中国移动	2021-12-24	6个月	首次公开发行限售	57.58	60.26	87,363.00	5,030,361.54	5,264,494.38	-
688120	华海清科	2022-05-30	6个月	首次公开发行限售	136.66	217.12	603.00	82,405.98	130,923.36	-
688197	首药控股	2022-03-16	6个月	首次公开发行限售	39.90	23.20	5,545.00	221,245.50	128,644.00	-
688322	奥比中光	2022-06-30	5个交易日	新股未上市	30.99	30.99	3,805.00	117,916.95	117,916.95	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	2,187.00	84,112.02	84,112.02	-
688400	凌云光	2022-06-27	6个月	首次公开发行限售	21.93	21.93	3,074.00	67,412.82	67,412.82	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418.00	58,875.36	58,875.36	-
688150	莱特光电	2022-03-10	6个月	首次公开发行限售	22.05	19.60	2,893.00	63,790.65	56,702.80	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	首次公开发行限售	19.18	32.07	525.00	10,069.50	16,836.75	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	首次公开发行限售	27.53	45.04	262.00	7,212.86	11,800.48	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	首次公开发行限售	45.13	54.11	217.00	9,793.21	11,741.87	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	首次公开发行限售	35.98	39.15	285.00	10,254.30	11,157.75	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	首次公开发行	21.33	22.54	473.00	10,089.09	10,661.42	-

				限售						
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	首次公开发行限售	16.91	19.79	502.00	8,488.82	9,934.58	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	首次公开发行限售	33.68	43.98	224.00	7,544.32	9,851.52	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6个月	首次公开发行限售	46.80	54.44	180.00	8,424.00	9,799.20	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	首次公开发行限售	38.46	38.46	243.00	9,345.78	9,345.78	-
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	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	首次公开发行限售	18.39	24.94	353.00	6,491.67	8,803.82	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月	首次公开发行限售	50.31	70.37	124.00	6,238.44	8,725.88	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	首次公开发行限售	52.03	56.42	154.00	8,012.62	8,688.68	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	首次公开发行限售	19.09	19.98	424.00	8,094.16	8,471.52	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	首次公开发行限售	29.67	33.28	245.00	7,269.15	8,153.60	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	首次公开发行限售	8.05	10.08	790.00	6,359.50	7,963.20	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	首次公开发行限售	108.47	82.76	95.00	10,304.28	7,862.20	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	首次公开发行限售	52.37	47.83	164.00	8,588.68	7,844.12	-
301217	铜冠	2022-	6个月	首次公	17.27	14.83	526.00	9,084.02	7,800.58	-

	铜箔	01-20	月	开发行 限售						
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	首次公开发 行限售	28.50	34.87	220.00	6,270.00	7,671.40	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	首次公开发 行限售	15.64	20.38	366.00	5,724.24	7,459.08	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6个月	首次公开发 行限售	38.39	23.90	290.00	11,133.10	6,931.00	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	首次公开发 行限售	15.37	15.99	412.00	6,332.44	6,587.88	-
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	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月	首次公开发 行限售	20.08	20.34	319.00	6,405.52	6,488.46	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	首次公开发 行限售	48.46	31.38	188.00	9,110.00	5,899.44	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	首次公开发 行限售	31.98	26.26	224.00	7,163.52	5,882.24	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	首次公开发 行限售	35.68	29.84	187.00	6,672.16	5,580.08	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	首次公开发 行限售	72.56	45.69	119.00	8,634.70	5,437.11	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	首次公开发 行限售	76.56	51.92	103.00	7,885.68	5,347.76	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	首次公开发 行限售	39.88	31.09	165.00	6,580.20	5,129.85	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	首次公开发 行限售	48.30	41.68	122.00	5,892.60	5,084.96	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	首次公开发 行限售	56.88	56.42	88.00	5,005.44	4,964.96	-

301279	金道科技	2022-04-06	6个月	首次公开发行限售	31.20	22.81	198.00	6,177.60	4,516.38	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	首次公开发行限售	37.23	25.39	171.00	6,366.33	4,341.69	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	首次公开发行限售	56.69	41.86	100.00	5,669.00	4,186.00	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	首次公开发行限售	97.11	87.82	43.00	4,175.52	3,776.26	-

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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
03333	中国恒大	2022-06-30	重大事项停牌	1.41	-	-	65,000.00	89,056.70	91,719.13	-

注：本基金截至 2022 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。

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

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

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

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	-	877,376.00
AAA 以下	-	92,716.90
未评级	-	-
合计	-	970,092.90

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（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。

6.4.10.3.1 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	11,827,286.01	-	-	-	11,827,286.01
结算备付金	4,630,842.59	-	-	-	4,630,842.59
存出保证金	104,521.64	-	-	-	104,521.64
交易性金融资产	-	-	-	188,541,738.53	188,541,738.53
应收证券清算款	-	-	-	207,402.15	207,402.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,339.99	7,339.99
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,562,650.24	-	-	188,756,480.67	205,319,130.91
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	33,748.09	33,748.09
应付证券清算款	-	-	-	0.03	0.03

应付管理人报酬	-	-	-	239,432.39	239,432.39
应付托管费	-	-	-	39,905.42	39,905.42
应付销售服务费	-	-	-	9,629.28	9,629.28
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	798,120.66	798,120.66
负债总计	-	-	-	1,120,836.21	1,120,836.21
利率敏感度缺口	16,562,650.24	-	-	187,635,644.46	204,198,294.70
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	14,002,379.60	-	-	-	14,002,379.60
结算备付金	6,181,764.16	-	-	-	6,181,764.16
存出保证金	130,696.28	-	-	-	130,696.28
交易性金融资产	-	55,287.68	914,805.22	227,748,048.18	228,718,141.08
应收证券清算款	-	-	-	155,658.44	155,658.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	17,431.52	17,431.52
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	4,939.57	4,939.57
资产总计	20,314,840.04	55,287.68	914,805.22	227,926,077.71	249,211,010.65
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,461.38	5,461.38
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	320,075.02	320,075.02
应付托管费	-	-	-	53,345.82	53,345.82
应付销售服务费	-	-	-	21,937.02	21,937.02
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,502,689.19	1,502,689.19
负债总计	-	-	-	1,903,508.78	1,903,508.78
利率敏感度缺口	20,314,840.04	55,287.68	914,805.22	226,022,568.93	247,307,501.87

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

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。

6.4.10.4.2.1 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	-	91,719.13	91,719.13
资产合计	-	91,719.13	91,719.13
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	91,719.13	91,719.13

6.4.10.4.2.2 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 0	-
	2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	增加约 0	-

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	上年度末

	2022 年 6 月 30 日		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	188,541,738.53	92.33	227,748,048.18	92.09
交易性金融资产—债券投资	-	-	970,092.90	0.39
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	188,541,738.53	92.33	228,718,141.08	92.48

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 1,137	增加约 943
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,137	减少约 943

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	182,245,759.74
第二层次	435,942.22
第三层次	5,860,036.57
合计	188,541,738.53

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

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;“交易费用”项目与“其他费用”项目的上年度可比期间金额合并列示在利润表“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	188,541,738.53	91.83
	其中:股票	188,541,738.53	91.83
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	16,458,128.60	8.02
8	其他各项资产	319,263.78	0.16
9	合计	205,319,130.91	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 91,719.13 元，净值占比 0.04%。

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	587,522.00	0.29
B	采矿业	7,763,572.00	3.80
C	制造业	142,731,575.49	69.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,350,768.60	0.66
E	建筑业	1,809,675.20	0.89
F	批发和零售业	1,431,315.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	3,157,028.00	1.55
H	住宿和餐饮业	38,739.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,661,537.19	5.71
J	金融业	11,886,739.13	5.82
K	房地产业	2,543,707.68	1.25
L	租赁和商务服务业	607,985.45	0.30
M	科学研究和技术服务业	596,657.14	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	314,939.02	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	877,669.50	0.43
R	文化、体育和娱乐业	865,839.00	0.42
S	综合	224,750.00	0.11
	合计	188,450,019.40	92.29

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（%）
房地产	91,719.13	0.04
合计	91,719.13	0.04

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	002304	洋河股份	31,957	5,852,924.55	2.87
2	600519	贵州茅台	2,600	5,317,000.00	2.60
3	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	2.58
4	300390	天华超净	44,100	3,854,340.00	1.89
5	002460	赣锋锂业	22,800	3,390,360.00	1.66
6	002466	天齐锂业	26,800	3,344,640.00	1.64
7	000568	泸州老窖	12,900	3,180,366.00	1.56
8	002709	天赐材料	49,638	3,080,534.28	1.51
9	600809	山西汾酒	8,740	2,838,752.00	1.39
10	300769	德方纳米	6,120	2,501,121.60	1.22
11	300316	晶盛机电	37,000	2,500,830.00	1.22
12	603392	万泰生物	15,890	2,467,717.00	1.21
13	600873	梅花生物	215,000	2,425,200.00	1.19
14	002756	永兴材料	14,900	2,267,929.00	1.11
15	002192	融捷股份	13,800	2,121,060.00	1.04
16	300661	圣邦股份	10,800	1,965,816.00	0.96
17	000792	盐湖股份	63,000	1,887,480.00	0.92
18	600438	通威股份	30,700	1,837,702.00	0.90
19	000933	神火股份	131,900	1,725,252.00	0.84
20	002594	比亚迪	5,100	1,700,799.00	0.83
21	600893	航发动力	37,100	1,688,421.00	0.83
22	600030	中信证券	75,760	1,640,961.60	0.80
23	688575	亚辉龙	77,500	1,621,300.00	0.79
24	603599	广信股份	56,140	1,580,341.00	0.77
25	600919	江苏银行	213,700	1,521,544.00	0.75
26	000625	长安汽车	87,620	1,517,578.40	0.74
27	601899	紫金矿业	155,300	1,448,949.00	0.71
28	000733	振华科技	10,600	1,441,282.00	0.71
29	600389	江山股份	23,600	1,433,228.00	0.70
30	601088	中国神华	42,850	1,426,905.00	0.70
31	600760	中航沈飞	22,600	1,366,170.00	0.67
32	688123	聚辰股份	12,600	1,342,152.00	0.66
33	002240	盛新锂能	22,100	1,333,956.00	0.65
34	003019	宸展光电	52,210	1,317,780.40	0.65
35	300171	东富龙	37,900	1,285,189.00	0.63
36	688516	奥特维	4,600	1,227,970.00	0.60
37	000596	古井贡酒	4,800	1,198,368.00	0.59
38	601318	中国平安	25,500	1,190,595.00	0.58
39	300833	浩洋股份	13,600	1,185,376.00	0.58
40	300041	回天新材	67,900	1,179,423.00	0.58
41	688981	中芯国际	25,177	1,137,245.09	0.56

42	300820	英杰电气	17,600	1,136,080.00	0.56
43	603868	飞科电器	14,964	1,133,523.00	0.56
44	300268	佳沃食品	37,900	1,127,525.00	0.55
45	300768	迪普科技	69,006	1,114,446.90	0.55
46	002738	中矿资源	12,000	1,111,320.00	0.54
47	603799	华友钴业	11,550	1,104,411.00	0.54
48	000858	五粮液	5,400	1,090,422.00	0.53
49	600064	南京高科	97,700	1,074,700.00	0.53
50	601838	成都银行	64,519	1,069,725.02	0.52
51	300750	宁德时代	2,000	1,068,000.00	0.52
52	002884	凌霄泵业	51,900	1,063,431.00	0.52
53	000553	安道麦 A	87,600	1,060,836.00	0.52
54	300639	凯普生物	49,500	1,058,310.00	0.52
55	688019	安集科技	4,900	1,043,308.00	0.51
56	300803	指南针	16,700	981,626.00	0.48
57	601012	隆基绿能	14,694	979,061.22	0.48
58	002352	顺丰控股	17,400	971,094.00	0.48
59	002176	江特电机	37,800	946,512.00	0.46
60	600176	中国巨石	53,584	932,897.44	0.46
61	300601	康泰生物	20,580	929,804.40	0.46
62	603217	元利科技	31,480	925,826.80	0.45
63	002841	视源股份	11,600	873,712.00	0.43
64	603898	好莱客	80,500	830,760.00	0.41
65	601919	中远海控	59,280	823,992.00	0.40
66	601900	南方传媒	99,700	808,567.00	0.40
67	688008	澜起科技	13,041	790,023.78	0.39
68	603986	兆易创新	5,500	782,155.00	0.38
69	688037	芯源微	5,300	768,341.00	0.38
70	600089	特变电工	27,200	745,008.00	0.36
71	600639	浦东金桥	53,452	726,412.68	0.36
72	601166	兴业银行	36,000	716,400.00	0.35
73	002947	恒铭达	38,500	708,400.00	0.35
74	600546	山煤国际	35,500	690,830.00	0.34
75	300037	新宙邦	12,580	661,204.80	0.32
76	600499	科达制造	31,900	658,416.00	0.32
77	603989	艾华集团	23,000	648,600.00	0.32
78	600018	上港集团	109,900	640,717.00	0.31
79	688099	晶晨股份	6,300	636,300.00	0.31
80	601677	明泰铝业	26,000	618,800.00	0.30
81	600702	舍得酒业	3,000	611,970.00	0.30
82	688298	东方生物	5,235	597,575.25	0.29
83	002920	德赛西威	3,900	577,200.00	0.28
84	600256	广汇能源	54,000	569,160.00	0.28

85	002497	雅化集团	16,900	551,785.00	0.27
86	300696	爱乐达	12,500	549,375.00	0.27
87	688200	华峰测控	1,500	534,600.00	0.26
88	002459	晶澳科技	6,740	531,786.00	0.26
89	688819	天能股份	15,200	525,616.00	0.26
90	300196	长海股份	27,500	519,475.00	0.25
91	600276	恒瑞医药	13,650	506,278.50	0.25
92	002555	三七互娱	23,800	505,274.00	0.25
93	300122	智飞生物	4,400	488,444.00	0.24
94	000970	中科三环	26,000	488,280.00	0.24
95	600887	伊利股份	12,300	479,085.00	0.23
96	002545	东方铁塔	42,000	477,960.00	0.23
97	603613	国联股份	5,345	473,567.00	0.23
98	300073	当升科技	5,000	451,700.00	0.22
99	601668	中国建筑	84,500	449,540.00	0.22
100	002371	北方华创	1,600	443,392.00	0.22
101	000651	格力电器	13,100	441,732.00	0.22
102	603882	金域医学	5,310	438,340.50	0.21
103	601288	农业银行	144,900	437,598.00	0.21
104	000989	九芝堂	47,900	435,890.00	0.21
105	002821	凯莱英	1,500	433,500.00	0.21
106	002533	金杯电工	60,500	428,945.00	0.21
107	000333	美的集团	6,920	417,898.80	0.20
108	601225	陕西煤业	19,700	417,246.00	0.20
109	600481	双良节能	24,600	414,510.00	0.20
110	601398	工商银行	85,849	409,499.73	0.20
111	600096	云天化	12,700	399,796.00	0.20
112	300568	星源材质	13,700	397,848.00	0.19
113	300130	新国都	32,000	392,320.00	0.19
114	600233	圆通速递	19,100	389,449.00	0.19
115	300059	东方财富	15,218	386,537.20	0.19
116	000408	藏格矿业	11,500	378,810.00	0.19
117	601615	明阳智能	11,200	378,560.00	0.19
118	600863	内蒙华电	101,500	370,475.00	0.18
119	603327	福蓉科技	26,500	364,375.00	0.18
120	688005	容百科技	2,700	349,488.00	0.17
121	000001	平安银行	22,700	340,046.00	0.17
122	002405	四维图新	22,400	337,568.00	0.17
123	000725	京东方 A	85,400	336,476.00	0.16
124	300363	博腾股份	4,300	335,357.00	0.16
125	603288	海天味业	3,609	326,109.24	0.16
126	600596	新安股份	14,940	323,451.00	0.16
127	603259	药明康德	3,072	319,457.28	0.16

128	600900	长江电力	13,700	316,744.00	0.16
129	603369	今世缘	6,200	316,200.00	0.15
130	601328	交通银行	63,100	314,238.00	0.15
131	002049	紫光国微	1,600	303,552.00	0.15
132	300613	富瀚微	3,470	294,256.00	0.14
133	601567	三星医疗	21,400	284,192.00	0.14
134	601390	中国中铁	46,000	282,440.00	0.14
135	002432	九安医疗	4,700	282,282.00	0.14
136	002759	天际股份	10,200	277,236.00	0.14
137	300244	迪安诊断	8,800	273,680.00	0.13
138	688556	高测股份	3,380	272,766.00	0.13
139	002475	立讯精密	8,000	270,320.00	0.13
140	600141	兴发集团	6,100	268,339.00	0.13
141	300170	汉得信息	29,700	267,597.00	0.13
142	002410	广联达	4,915	267,572.60	0.13
143	600867	通化东宝	25,800	266,772.00	0.13
144	002645	华宏科技	11,900	259,658.00	0.13
145	300423	昇辉科技	23,400	253,188.00	0.12
146	300482	万孚生物	6,100	248,331.00	0.12
147	601186	中国铁建	31,400	248,060.00	0.12
148	002142	宁波银行	6,850	245,298.50	0.12
149	600028	中国石化	60,100	245,208.00	0.12
150	002182	云海金属	9,600	240,768.00	0.12
151	002365	永安药业	19,500	240,240.00	0.12
152	300218	安利股份	16,700	238,309.00	0.12
153	300721	怡达股份	6,600	238,062.00	0.12
154	600426	华鲁恒升	8,140	237,688.00	0.12
155	603227	雪峰科技	26,100	236,205.00	0.12
156	601888	中国中免	1,000	232,930.00	0.11
157	000629	攀钢钒钛	59,800	227,240.00	0.11
158	688111	金山办公	1,150	226,688.00	0.11
159	002407	多氟多	4,600	224,986.00	0.11
160	600673	东阳光	25,000	224,750.00	0.11
161	605198	德利股份	12,300	224,352.00	0.11
162	300450	先导智能	3,500	221,130.00	0.11
163	300487	蓝晓科技	3,600	219,600.00	0.11
164	002415	海康威视	5,900	213,580.00	0.10
165	300160	秀强股份	26,000	211,380.00	0.10
166	002815	崇达技术	16,500	211,365.00	0.10
167	601601	中国太保	8,900	209,417.00	0.10
168	300480	光力科技	11,565	207,476.10	0.10
169	603659	璞泰来	2,440	205,936.00	0.10
170	600060	海信视像	16,300	203,750.00	0.10

171	000617	中油资本	41,300	198,653.00	0.10
172	002258	利尔化学	8,380	197,935.60	0.10
173	600888	新疆众和	21,500	197,800.00	0.10
174	601985	中国核电	28,600	196,196.00	0.10
175	601818	光大银行	63,101	189,934.01	0.09
176	688033	天宜上佳	8,900	189,036.00	0.09
177	688012	中微公司	1,600	186,800.00	0.09
178	601857	中国石油	35,200	186,560.00	0.09
179	600987	航民股份	34,900	186,017.00	0.09
180	000799	酒鬼酒	1,000	185,810.00	0.09
181	688521	芯原股份	3,760	185,744.00	0.09
182	002027	分众传媒	27,500	185,075.00	0.09
183	601958	金铂股份	20,700	182,988.00	0.09
184	600926	杭州银行	12,200	182,756.00	0.09
185	300896	爱美客	300	180,003.00	0.09
186	688388	嘉元科技	2,100	178,227.00	0.09
187	002539	云图控股	11,100	177,489.00	0.09
188	600585	海螺水泥	5,000	176,400.00	0.09
189	603619	中曼石油	8,400	172,788.00	0.08
190	600160	巨化股份	13,100	172,265.00	0.08
191	601998	中信银行	35,900	170,525.00	0.08
192	688559	海目星	2,300	167,210.00	0.08
193	601231	环旭电子	11,600	166,576.00	0.08
194	688589	力合微	3,700	165,834.00	0.08
195	300015	爱尔眼科	3,700	165,649.00	0.08
196	600309	万华化学	1,700	164,883.00	0.08
197	000002	万科A	8,000	164,000.00	0.08
198	002484	江海股份	7,000	163,380.00	0.08
199	600048	保利发展	9,300	162,378.00	0.08
200	601628	中国人寿	5,200	161,616.00	0.08
201	002927	泰永长征	13,800	160,770.00	0.08
202	002394	联发股份	21,900	160,089.00	0.08
203	600282	南钢股份	50,800	160,020.00	0.08
204	603026	石大胜华	1,100	159,885.00	0.08
205	002615	哈尔斯	25,700	159,854.00	0.08
206	688329	艾隆科技	4,900	158,515.00	0.08
207	300760	迈瑞医疗	500	156,600.00	0.08
208	002129	TCL 中环	2,600	153,114.00	0.07
209	600050	中国联通	43,900	151,894.00	0.07
210	601933	永辉超市	35,400	151,512.00	0.07
211	002517	恺英网络	27,100	151,218.00	0.07
212	601618	中国中冶	43,000	150,500.00	0.07
213	300327	中颖电子	3,000	149,430.00	0.07

214	600097	开创国际	15,200	149,416.00	0.07
215	300498	温氏股份	7,000	149,030.00	0.07
216	300595	欧普康视	2,600	148,694.00	0.07
217	601988	中国银行	45,500	148,330.00	0.07
218	002436	兴森科技	13,100	147,637.00	0.07
219	600486	扬农化工	1,100	146,608.00	0.07
220	688606	奥泰生物	1,200	145,944.00	0.07
221	603993	洛阳钼业	25,400	145,542.00	0.07
222	600584	长电科技	5,300	143,100.00	0.07
223	002597	金禾实业	3,300	142,989.00	0.07
224	000935	四川双马	5,900	142,898.00	0.07
225	002869	金溢科技	9,400	141,752.00	0.07
226	603260	合盛硅业	1,200	141,552.00	0.07
227	000789	万年青	13,000	140,920.00	0.07
228	300861	美畅股份	1,500	139,035.00	0.07
229	001979	招商蛇口	10,300	138,329.00	0.07
230	002714	牧原股份	2,500	138,175.00	0.07
231	002083	孚日股份	29,000	136,880.00	0.07
232	603308	应流股份	8,400	136,752.00	0.07
233	601117	中国化学	14,500	136,445.00	0.07
234	601669	中国电建	17,300	136,151.00	0.07
235	600415	小商品城	24,400	135,908.00	0.07
236	000878	云南铜业	11,800	134,402.00	0.07
237	000403	派林生物	6,100	133,956.00	0.07
238	002085	万丰奥威	24,400	131,028.00	0.06
239	688120	华海清科	603	130,923.36	0.06
240	600019	宝钢股份	21,631	130,218.62	0.06
241	601689	拓普集团	1,900	130,017.00	0.06
242	601965	中国汽研	8,000	129,680.00	0.06
243	600779	水井坊	1,400	129,556.00	0.06
244	688197	首药控股	5,545	128,644.00	0.06
245	603983	丸美股份	4,800	128,640.00	0.06
246	600027	华电国际	32,700	128,511.00	0.06
247	600179	安通控股	33,500	127,970.00	0.06
248	603668	天马科技	6,200	127,038.00	0.06
249	000729	燕京啤酒	13,000	125,580.00	0.06
250	603708	家家悦	8,800	125,312.00	0.06
251	300124	汇川技术	1,900	125,153.00	0.06
252	603099	长白山	13,100	124,974.00	0.06
253	002268	卫士通	2,900	124,439.00	0.06
254	600273	嘉化能源	11,400	123,804.00	0.06
255	002805	丰元股份	2,000	123,800.00	0.06
256	600690	海尔智家	4,500	123,570.00	0.06

257	002087	新野纺织	37,100	123,172.00	0.06
258	002013	中航机电	9,900	122,265.00	0.06
259	300707	威唐工业	7,200	121,752.00	0.06
260	603928	兴业股份	9,200	120,796.00	0.06
261	300935	盈建科	3,860	120,740.80	0.06
262	002843	泰嘉股份	8,600	120,400.00	0.06
263	002286	保龄宝	10,500	120,225.00	0.06
264	601997	贵阳银行	20,400	118,524.00	0.06
265	300515	三德科技	11,616	118,483.20	0.06
266	601718	际华集团	38,200	118,420.00	0.06
267	688322	奥比中光	3,805	117,916.95	0.06
268	600104	上汽集团	6,600	117,546.00	0.06
269	600448	华纺股份	31,400	117,436.00	0.06
270	000063	中兴通讯	4,560	116,416.80	0.06
271	603773	沃格光电	7,230	115,680.00	0.06
272	002952	亚世光电	9,400	115,056.00	0.06
273	300432	富临精工	5,200	114,400.00	0.06
274	601939	建设银行	18,771	113,752.26	0.06
275	601066	中信建投	3,900	112,749.00	0.06
276	300650	太龙股份	8,500	112,370.00	0.06
277	601868	中国能建	47,200	111,864.00	0.05
278	002150	通润装备	16,700	111,389.00	0.05
279	603933	睿能科技	10,200	111,384.00	0.05
280	601138	工业富联	11,300	111,192.00	0.05
281	300583	赛托生物	4,900	110,740.00	0.05
282	000938	紫光股份	5,700	110,580.00	0.05
283	600741	华域汽车	4,800	110,400.00	0.05
284	600123	兰花科创	6,700	110,215.00	0.05
285	603926	铁流股份	10,700	109,889.00	0.05
286	000717	韶钢松山	31,300	109,550.00	0.05
287	600559	老白干酒	3,800	109,022.00	0.05
288	603605	珀莱雅	660	109,018.80	0.05
289	603903	中持股份	11,100	109,002.00	0.05
290	300782	卓胜微	800	108,000.00	0.05
291	300074	华平股份	28,700	107,912.00	0.05
292	300150	世纪瑞尔	26,600	107,198.00	0.05
293	300970	华绿生物	5,600	105,952.00	0.05
294	600782	新钢股份	20,700	104,328.00	0.05
295	000898	鞍钢股份	32,300	104,006.00	0.05
296	603938	三孚股份	2,100	103,803.00	0.05
297	688590	新致软件	7,200	103,176.00	0.05
298	600808	马钢股份	27,100	102,709.00	0.05
299	600597	光明乳业	8,100	102,303.00	0.05

300	002110	三钢闽光	16,700	101,703.00	0.05
301	002895	川恒股份	3,000	101,430.00	0.05
302	000959	首钢股份	21,200	100,912.00	0.05
303	601658	邮储银行	18,700	100,793.00	0.05
304	000807	云铝股份	10,200	100,776.00	0.05
305	000762	西藏矿业	1,800	100,674.00	0.05
306	002812	恩捷股份	400	100,180.00	0.05
307	600623	华谊集团	12,000	99,600.00	0.05
308	600111	北方稀土	2,800	98,448.00	0.05
309	603486	科沃斯	800	97,512.00	0.05
310	603080	新疆火炬	7,400	96,792.00	0.05
311	603006	黎明股份	10,600	96,566.00	0.05
312	000825	太钢不锈	17,700	96,465.00	0.05
313	002865	钧达股份	1,000	95,360.00	0.05
314	688396	华润微	1,600	94,512.00	0.05
315	688063	派能科技	300	93,660.00	0.05
316	000932	华菱钢铁	18,400	93,656.00	0.05
317	301139	元道通信	2,430	93,457.80	0.05
318	000661	长春高新	400	93,368.00	0.05
319	603328	依顿电子	14,700	93,345.00	0.05
320	300621	维业股份	10,200	92,412.00	0.05
321	3333	中国恒大	65,000	91,719.13	0.04
322	300628	亿联网络	1,200	91,380.00	0.04
323	600547	山东黄金	4,900	90,944.00	0.04
324	603115	海星股份	3,700	90,909.00	0.04
325	300562	乐心医疗	9,400	90,898.00	0.04
326	300332	天壕环境	8,000	89,600.00	0.04
327	601816	京沪高铁	17,800	89,356.00	0.04
328	600153	建发股份	6,800	88,876.00	0.04
329	603529	爱玛科技	1,680	87,998.40	0.04
330	600406	国电南瑞	3,240	87,480.00	0.04
331	600295	鄂尔多斯	4,800	86,640.00	0.04
332	601688	华泰证券	6,100	86,620.00	0.04
333	603790	雅运股份	8,000	85,040.00	0.04
334	002241	歌尔股份	2,500	84,000.00	0.04
335	300308	中际旭创	2,700	83,835.00	0.04
336	300077	国民技术	4,500	83,610.00	0.04
337	600714	金瑞矿业	6,600	82,830.00	0.04
338	002322	理工能科	9,200	82,340.00	0.04
339	300818	耐普矿机	2,000	81,120.00	0.04
340	002648	卫星化学	3,096	80,031.60	0.04
341	600156	华升股份	16,300	79,544.00	0.04
342	002850	科达利	500	79,500.00	0.04

343	300461	田中精机	5,100	79,203.00	0.04
344	300689	澄天伟业	4,500	77,895.00	0.04
345	002796	世嘉科技	10,000	77,600.00	0.04
346	600689	上海三毛	8,400	77,112.00	0.04
347	002855	捷荣技术	9,800	76,930.00	0.04
348	601009	南京银行	7,352	76,607.84	0.04
349	605399	晨光新材	1,800	76,590.00	0.04
350	002921	联诚精密	5,300	76,585.00	0.04
351	605298	必得科技	5,590	76,024.00	0.04
352	000893	亚钾国际	2,200	75,702.00	0.04
353	300553	集智股份	2,400	75,576.00	0.04
354	601319	中国人保	14,900	75,394.00	0.04
355	600243	青海华鼎	17,300	74,909.00	0.04
356	300992	泰福泵业	3,500	74,585.00	0.04
357	300557	理工光科	2,700	73,440.00	0.04
358	300652	雷迪克	3,000	73,410.00	0.04
359	688418	震有科技	7,800	73,320.00	0.04
360	601211	国泰君安	4,800	72,960.00	0.04
361	300084	海默科技	15,800	72,680.00	0.04
362	002875	安奈儿	8,200	72,488.00	0.04
363	600507	方大特钢	10,300	71,997.00	0.04
364	000983	山西焦煤	5,300	70,967.00	0.03
365	300022	吉峰科技	15,000	70,500.00	0.03
366	601600	中国铝业	14,600	69,350.00	0.03
367	300349	金卡智能	7,100	69,154.00	0.03
368	601728	中国电信	18,500	69,005.00	0.03
369	688202	美迪西	200	67,922.00	0.03
370	300832	新产业	1,500	67,665.00	0.03
371	300357	我武生物	1,300	67,639.00	0.03
372	688400	凌云光	3,074	67,412.82	0.03
373	300775	三角防务	1,400	67,410.00	0.03
374	600188	兖矿能源	1,700	67,116.00	0.03
375	601898	中煤能源	6,400	66,432.00	0.03
376	600352	浙江龙盛	6,500	66,170.00	0.03
377	300529	健帆生物	1,300	66,157.00	0.03
378	601077	渝农商行	17,800	65,860.00	0.03
379	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.03
380	300373	扬杰科技	900	64,125.00	0.03
381	601238	广汽集团	4,200	64,008.00	0.03
382	601577	长沙银行	8,000	63,440.00	0.03
383	600128	弘业股份	7,500	63,300.00	0.03
384	603032	德新交运	800	63,200.00	0.03
385	605111	新洁能	500	62,905.00	0.03

386	600031	三一重工	3,300	62,898.00	0.03
387	300777	中简科技	1,300	62,660.00	0.03
388	000039	中集集团	4,500	62,325.00	0.03
389	300552	万集科技	2,000	61,480.00	0.03
390	300573	兴齐眼药	400	61,328.00	0.03
391	600845	宝信软件	1,100	60,060.00	0.03
392	000822	山东海化	5,900	59,944.00	0.03
393	300275	梅安森	4,500	59,715.00	0.03
394	603279	景津装备	1,900	58,919.00	0.03
395	300358	楚天科技	3,300	58,707.00	0.03
396	002649	博彦科技	5,700	58,197.00	0.03
397	000776	广发证券	3,100	57,970.00	0.03
398	000768	中航西飞	1,900	57,551.00	0.03
399	002624	完美世界	4,000	57,480.00	0.03
400	002521	齐峰新材	10,700	57,459.00	0.03
401	300773	拉卡拉	3,000	57,180.00	0.03
402	603920	世运电路	3,300	57,090.00	0.03
403	688399	硕世生物	500	57,010.00	0.03
404	688150	莱特光电	2,893	56,702.80	0.03
405	603379	三美股份	2,500	55,625.00	0.03
406	300533	冰川网络	2,100	55,230.00	0.03
407	300748	金力永磁	1,500	55,200.00	0.03
408	300224	正海磁材	3,600	55,080.00	0.03
409	601717	郑煤机	3,800	54,758.00	0.03
410	002538	司尔特	4,900	54,684.00	0.03
411	000719	中原传媒	7,300	54,385.00	0.03
412	300068	南都电源	3,500	53,690.00	0.03
413	601877	正泰电器	1,500	53,670.00	0.03
414	000895	双汇发展	1,800	52,740.00	0.03
415	000707	双环科技	3,100	52,669.00	0.03
416	002252	上海莱士	8,800	52,184.00	0.03
417	300776	帝尔激光	300	51,840.00	0.03
418	001914	招商积余	2,800	50,316.00	0.02
419	000631	顺发恒业	13,300	50,008.00	0.02
420	002741	光华科技	2,500	49,825.00	0.02
421	300505	川金诺	1,600	49,536.00	0.02
422	600901	江苏租赁	9,600	49,248.00	0.02
423	002809	红墙股份	4,900	49,000.00	0.02
424	002376	新北洋	6,300	48,699.00	0.02
425	688669	聚石化学	1,900	48,697.00	0.02
426	300033	同花顺	500	48,075.00	0.02
427	601766	中国中车	9,200	47,840.00	0.02
428	300195	长荣股份	8,500	47,685.00	0.02

429	003816	中国广核	17,000	47,600.00	0.02
430	603919	金徽酒	1,400	47,586.00	0.02
431	688335	复洁环保	1,657	47,572.47	0.02
432	300920	润阳科技	2,200	46,992.00	0.02
433	603185	上机数控	300	46,797.00	0.02
434	603516	淳中科技	3,760	46,548.80	0.02
435	603456	九洲药业	900	46,530.00	0.02
436	600051	宁波联合	6,800	46,444.00	0.02
437	002743	富煌钢构	7,700	46,431.00	0.02
438	002381	双箭股份	7,200	46,224.00	0.02
439	002326	永太科技	1,400	46,102.00	0.02
440	300226	上海钢联	2,000	45,300.00	0.02
441	301006	迈拓股份	2,400	45,120.00	0.02
442	600011	华能国际	6,400	45,056.00	0.02
443	603906	龙蟠科技	1,200	44,328.00	0.02
444	600183	生益科技	2,600	44,174.00	0.02
445	002388	新亚制程	7,600	43,548.00	0.02
446	605100	华丰股份	2,996	43,292.20	0.02
447	000830	鲁西化工	2,400	41,496.00	0.02
448	002449	国星光电	5,100	41,259.00	0.02
449	300433	蓝思科技	3,700	40,959.00	0.02
450	002687	乔治白	9,135	40,833.45	0.02
451	603387	基蛋生物	2,860	40,783.60	0.02
452	300127	银河磁体	2,100	40,089.00	0.02
453	600489	中金黄金	5,400	39,906.00	0.02
454	600340	华夏幸福	12,300	39,360.00	0.02
455	000877	天山股份	3,200	39,360.00	0.02
456	688016	心脉医疗	200	38,962.00	0.02
457	603444	吉比特	100	38,800.00	0.02
458	000968	蓝焰控股	3,700	38,665.00	0.02
459	300739	明阳电路	2,400	38,448.00	0.02
460	300303	聚飞光电	7,900	37,920.00	0.02
461	300586	美联新材	2,200	37,818.00	0.02
462	601089	N福元	1,749	36,816.45	0.02
463	002414	高德红外	2,840	36,550.80	0.02
464	300112	万讯自控	3,600	36,324.00	0.02
465	600271	航天信息	3,300	36,102.00	0.02
466	002601	龙佰集团	1,800	36,090.00	0.02
467	603300	华铁应急	4,480	35,705.60	0.02
468	600436	片仔癀	100	35,673.00	0.02
469	600367	红星发展	1,600	35,104.00	0.02
470	000069	华侨城A	5,400	35,046.00	0.02
471	300735	光弘科技	3,300	34,485.00	0.02

472	300231	银信科技	4,500	34,065.00	0.02
473	002605	姚记科技	2,000	33,300.00	0.02
474	600958	东方证券	3,256	33,243.76	0.02
475	000915	华特达因	800	33,080.00	0.02
476	300999	金龙鱼	600	32,412.00	0.02
477	002378	章源钨业	4,000	32,320.00	0.02
478	600988	赤峰黄金	2,000	31,900.00	0.02
479	601377	兴业证券	4,500	31,725.00	0.02
480	000726	鲁泰A	4,400	31,460.00	0.02
481	600985	淮北矿业	2,100	30,576.00	0.01
482	002128	电投能源	2,100	30,072.00	0.01
483	600685	中船防务	1,800	29,682.00	0.01
484	603277	银都股份	1,400	29,554.00	0.01
485	300014	亿纬锂能	300	29,250.00	0.01
486	300354	东华测试	900	28,935.00	0.01
487	000975	银泰黄金	2,900	28,246.00	0.01
488	688550	瑞联新材	400	27,436.00	0.01
489	002885	京泉华	900	27,252.00	0.01
490	000848	承德露露	2,800	27,104.00	0.01
491	603688	石英股份	200	26,522.00	0.01
492	601006	大秦铁路	4,000	26,360.00	0.01
493	300856	科思股份	600	26,028.00	0.01
494	000928	中钢国际	4,100	25,707.00	0.01
495	601788	光大证券	1,600	25,216.00	0.01
496	002643	万润股份	1,200	25,032.00	0.01
497	000708	中信特钢	1,240	24,986.00	0.01
498	002230	科大讯飞	600	24,732.00	0.01
499	000735	罗牛山	3,600	24,552.00	0.01
500	000166	申万宏源	5,600	24,024.00	0.01
501	600362	江西铜业	1,300	23,179.00	0.01
502	300911	亿田智能	300	23,055.00	0.01
503	603317	天味食品	800	22,776.00	0.01
504	000999	华润三九	500	22,500.00	0.01
505	601995	中金公司	500	22,245.00	0.01
506	600332	白云山	700	22,113.00	0.01
507	300596	利安隆	500	22,055.00	0.01
508	603959	百利科技	1,800	21,816.00	0.01
509	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.01
510	603337	杰克股份	1,000	21,480.00	0.01
511	603348	文灿股份	400	21,440.00	0.01
512	603212	赛伍技术	800	21,288.00	0.01
513	600085	同仁堂	400	21,152.00	0.01
514	002938	鹏鼎控股	700	21,147.00	0.01

515	601126	四方股份	1,300	21,073.00	0.01
516	002801	微光股份	700	20,895.00	0.01
517	002379	宏创控股	5,500	20,625.00	0.01
518	002271	东方雨虹	400	20,588.00	0.01
519	002310	东方园林	8,500	20,485.00	0.01
520	603338	浙江鼎力	400	20,280.00	0.01
521	000630	铜陵有色	6,200	20,212.00	0.01
522	002154	报喜鸟	4,600	19,872.00	0.01
523	000428	华天酒店	3,700	19,869.00	0.01
524	688313	仕佳光子	1,730	19,722.00	0.01
525	000738	航发控制	700	19,670.00	0.01
526	300274	阳光电源	200	19,650.00	0.01
527	603658	安图生物	400	19,556.00	0.01
528	300811	铂科新材	200	19,464.00	0.01
529	300142	沃森生物	400	19,356.00	0.01
530	000778	新兴铸管	4,000	19,280.00	0.01
531	002419	天虹股份	2,700	19,251.00	0.01
532	300009	安科生物	1,900	19,209.00	0.01
533	603087	甘李药业	400	19,188.00	0.01
534	002088	鲁阳节能	910	19,155.50	0.01
535	000402	金融街	3,200	19,040.00	0.01
536	603908	牧高笛	200	19,030.00	0.01
537	600754	锦江酒店	300	18,870.00	0.01
538	002959	小熊电器	300	18,699.00	0.01
539	688586	江航装备	700	18,627.00	0.01
540	300638	广和通	700	18,543.00	0.01
541	600380	健康元	1,500	18,525.00	0.01
542	000560	我爱我家	6,400	18,432.00	0.01
543	603889	新澳股份	2,900	18,328.00	0.01
544	300666	江丰电子	300	18,300.00	0.01
545	600905	三峡能源	2,900	18,241.00	0.01
546	601598	中国外运	4,700	18,236.00	0.01
547	600392	盛和资源	800	18,080.00	0.01
548	000963	华东医药	400	18,064.00	0.01
549	300408	三环集团	600	18,060.00	0.01
550	300604	长川科技	400	18,060.00	0.01
551	300641	正丹股份	2,700	18,009.00	0.01
552	002204	大连重工	4,100	17,917.00	0.01
553	600004	白云机场	1,200	17,892.00	0.01
554	300724	捷佳伟创	200	17,870.00	0.01
555	688596	正帆科技	900	17,838.00	0.01
556	601156	东航物流	900	17,820.00	0.01
557	603588	高能环境	1,540	17,756.20	0.01

558	688378	奥来德	455	17,749.55	0.01
559	002832	比音勒芬	700	17,640.00	0.01
560	002216	三全食品	900	17,631.00	0.01
561	002677	浙江美大	1,200	17,604.00	0.01
562	000338	潍柴动力	1,400	17,458.00	0.01
563	601901	方正证券	2,600	17,446.00	0.01
564	603236	移远通信	130	17,375.80	0.01
565	603501	韦尔股份	100	17,303.00	0.01
566	601799	星宇股份	100	17,100.00	0.01
567	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.01
568	600745	闻泰科技	200	17,022.00	0.01
569	301238	瑞泰新材	525	16,836.75	0.01
570	603809	豪能股份	1,270	16,700.50	0.01
571	000926	福星股份	3,500	16,625.00	0.01
572	601882	海天精工	800	16,488.00	0.01
573	601881	中国银河	1,700	16,439.00	0.01
574	000100	TCL 科技	3,400	16,286.00	0.01
575	600746	江苏索普	1,400	16,212.00	0.01
576	600170	上海建工	5,300	16,059.00	0.01
577	600079	人福医药	1,000	16,000.00	0.01
578	002133	广宇集团	4,400	15,972.00	0.01
579	002839	张家港行	3,000	15,870.00	0.01
580	002978	安宁股份	400	15,452.00	0.01
581	002337	赛象科技	3,200	15,008.00	0.01
582	000517	荣安地产	4,700	14,946.00	0.01
583	002948	青岛银行	4,100	14,842.00	0.01
584	300512	中亚股份	1,800	14,760.00	0.01
585	600132	重庆啤酒	100	14,660.00	0.01
586	300979	华利集团	200	14,616.00	0.01
587	603081	大丰实业	1,300	14,495.00	0.01
588	002372	伟星新材	600	14,424.00	0.01
589	000666	经纬纺机	1,600	14,368.00	0.01
590	002807	江阴银行	3,100	14,043.00	0.01
591	001872	招商港口	900	14,040.00	0.01
592	002050	三花智控	500	13,740.00	0.01
593	002101	广东鸿图	600	13,680.00	0.01
594	601878	浙商证券	1,200	13,656.00	0.01
595	000415	渤海租赁	6,100	13,237.00	0.01
596	300607	拓斯达	1,000	13,220.00	0.01
597	002092	中泰化学	1,700	13,192.00	0.01
598	002966	苏州银行	2,160	13,176.00	0.01
599	600570	恒生电子	300	13,062.00	0.01
600	600918	中泰证券	1,700	13,005.00	0.01

601	002631	德尔未来	2,000	12,900.00	0.01
602	601916	浙商银行	3,800	12,616.00	0.01
603	601118	海南橡胶	2,600	12,428.00	0.01
604	600710	苏美达	2,100	12,390.00	0.01
605	002936	郑州银行	4,600	12,374.00	0.01
606	603515	欧普照明	700	12,215.00	0.01
607	603116	红蜻蜓	2,100	11,970.00	0.01
608	600076	康欣新材	3,600	11,844.00	0.01
609	301112	N 信邦	262	11,800.48	0.01
610	300281	金明精机	2,100	11,760.00	0.01
611	301162	国能日新	217	11,741.87	0.01
612	600527	江南高纤	5,300	11,713.00	0.01
613	300154	瑞凌股份	2,000	11,700.00	0.01
614	603900	莱绅通灵	1,600	11,664.00	0.01
615	603980	吉华集团	2,200	11,594.00	0.01
616	600886	国投电力	1,100	11,550.00	0.01
617	300712	永福股份	200	11,468.00	0.01
618	300347	泰格医药	100	11,445.00	0.01
619	603385	惠达卫浴	1,500	11,355.00	0.01
620	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
621	600894	广日股份	1,700	11,271.00	0.01
622	300422	博世科	1,900	11,229.00	0.01
623	600488	天药股份	2,600	11,180.00	0.01
624	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.01
625	300385	雪浪环境	1,700	11,135.00	0.01
626	600346	恒力石化	500	11,120.00	0.01
627	603321	梅轮电梯	1,700	11,067.00	0.01
628	600971	恒源煤电	1,400	11,060.00	0.01
629	601566	九牧王	1,300	10,998.00	0.01
630	605001	威奥股份	1,700	10,914.00	0.01
631	603367	辰欣药业	900	10,674.00	0.01
632	301187	欧圣电气	473	10,661.42	0.01
633	600061	国投资本	1,656	10,532.16	0.01
634	603839	安正时尚	1,500	10,515.00	0.01
635	600600	青岛啤酒	100	10,392.00	0.01
636	002550	千红制药	1,800	10,314.00	0.01
637	000627	天茂集团	3,000	10,230.00	0.01
638	002932	明德生物	149	10,215.44	0.01
639	601678	滨化股份	1,700	10,183.00	0.00
640	301286	侨源股份	502	9,934.58	0.00
641	301153	中科江南	224	9,851.52	0.00
642	301117	佳缘科技	180	9,799.20	0.00
643	300759	康龙化成	100	9,522.00	0.00

644	688009	中国通号	2,100	9,513.00	0.00
645	000401	冀东水泥	900	9,468.00	0.00
646	600328	中盐化工	400	9,420.00	0.00
647	002493	荣盛石化	600	9,234.00	0.00
648	603156	养元饮品	400	9,088.00	0.00
649	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
650	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
651	301259	艾布鲁	353	8,803.82	0.00
652	002167	东方锆业	1,200	8,784.00	0.00
653	600395	盘江股份	1,000	8,770.00	0.00
654	301122	采纳股份	124	8,725.88	0.00
655	301302	C 华如	154	8,688.68	0.00
656	000157	中联重科	1,400	8,624.00	0.00
657	301288	清研环境	424	8,471.52	0.00
658	003035	南网能源	1,300	8,255.00	0.00
659	301212	联盛化学	245	8,153.60	0.00
660	301256	华融化学	790	7,963.20	0.00
661	301150	中一科技	95	7,862.20	0.00
662	301097	天益医疗	164	7,844.12	0.00
663	301217	铜冠铜箔	526	7,800.58	0.00
664	002608	江苏国信	1,200	7,800.00	0.00
665	002562	兄弟科技	1,200	7,776.00	0.00
666	603585	苏利股份	400	7,772.00	0.00
667	301268	铭利达	220	7,671.40	0.00
668	600269	赣粤高速	2,200	7,634.00	0.00
669	601611	中国核建	900	7,551.00	0.00
670	301158	德石股份	366	7,459.08	0.00
671	600039	四川路桥	700	7,371.00	0.00
672	000425	徐工机械	1,300	7,007.00	0.00
673	301148	嘉戎技术	290	6,931.00	0.00
674	000728	国元证券	1,100	6,842.00	0.00
675	600063	皖维高新	900	6,822.00	0.00
676	600582	天地科技	1,400	6,692.00	0.00
677	301137	哈焊华通	412	6,587.88	0.00
678	603806	福斯特	100	6,552.00	0.00
679	301228	实朴检测	319	6,488.46	0.00
680	300532	今天国际	500	6,420.00	0.00
681	600606	绿地控股	1,570	6,217.20	0.00
682	601100	恒立液压	100	6,172.00	0.00
683	000422	湖北宜化	300	6,093.00	0.00
684	002311	海大集团	100	6,001.00	0.00
685	600456	宝钛股份	100	5,940.00	0.00
686	301236	软通动力	188	5,899.44	0.00

687	301135	瑞德智能	224	5,882.24	0.00
688	600885	宏发股份	140	5,859.00	0.00
689	600758	辽宁能源	1,300	5,720.00	0.00
690	300457	赢合科技	200	5,682.00	0.00
691	300831	派瑞股份	400	5,648.00	0.00
692	600025	华能水电	800	5,592.00	0.00
693	301216	万凯新材	187	5,580.08	0.00
694	002004	华邦健康	1,000	5,580.00	0.00
695	000090	天健集团	800	5,512.00	0.00
696	688569	铁科轨道	300	5,505.00	0.00
697	002896	中大力德	300	5,484.00	0.00
698	601236	红塔证券	600	5,478.00	0.00
699	301206	三元生物	119	5,437.11	0.00
700	002949	华阳国际	400	5,360.00	0.00
701	301200	大族数控	103	5,347.76	0.00
702	600737	中粮糖业	700	5,264.00	0.00
703	300695	兆丰股份	100	5,256.00	0.00
704	300801	泰和科技	200	5,204.00	0.00
705	000552	靖远煤电	1,200	5,172.00	0.00
706	301102	兆讯传媒	165	5,129.85	0.00
707	601155	新城控股	200	5,086.00	0.00
708	301258	富士莱	122	5,084.96	0.00
709	000902	新洋丰	300	5,067.00	0.00
710	003013	地铁设计	300	5,058.00	0.00
711	600502	安徽建工	700	5,040.00	0.00
712	000960	锡业股份	300	5,031.00	0.00
713	301207	华兰疫苗	88	4,964.96	0.00
714	603681	永冠新材	200	4,916.00	0.00
715	002747	埃斯顿	200	4,900.00	0.00
716	002155	湖南黄金	400	4,856.00	0.00
717	603359	东珠生态	400	4,832.00	0.00
718	000498	山东路桥	500	4,830.00	0.00
719	601369	陕鼓动力	500	4,800.00	0.00
720	300481	濮阳惠成	200	4,700.00	0.00
721	300174	元力股份	300	4,626.00	0.00
722	600997	开滦股份	600	4,572.00	0.00
723	300398	飞凯材料	200	4,572.00	0.00
724	002906	华阳集团	100	4,531.00	0.00
725	301279	金道科技	198	4,516.38	0.00
726	300592	华凯易佰	300	4,473.00	0.00
727	600284	浦东建设	600	4,446.00	0.00
728	603931	格林达	220	4,422.00	0.00
729	300617	安靠智电	100	4,411.00	0.00

730	601216	君正集团	900	4,392.00	0.00
731	002060	粤水电	500	4,345.00	0.00
732	301123	奕东电子	171	4,341.69	0.00
733	002690	美亚光电	200	4,336.00	0.00
734	603977	国泰集团	500	4,335.00	0.00
735	600549	厦门钨业	200	4,324.00	0.00
736	300121	阳谷华泰	400	4,292.00	0.00
737	600545	卓郎智能	1,100	4,290.00	0.00
738	603637	镇海股份	500	4,220.00	0.00
739	002658	雪迪龙	600	4,218.00	0.00
740	002041	登海种业	200	4,218.00	0.00
741	603360	百傲化学	300	4,209.00	0.00
742	301237	和顺科技	100	4,186.00	0.00
743	600452	涪陵电力	360	4,179.60	0.00
744	002307	北新路桥	700	4,165.00	0.00
745	600496	精工钢构	900	4,158.00	0.00
746	300593	新雷能	100	4,151.00	0.00
747	003025	思进智能	200	4,138.00	0.00
748	603909	建发合诚	300	4,131.00	0.00
749	603968	醋化股份	200	4,120.00	0.00
750	603050	科林电气	300	4,107.00	0.00
751	002023	海特高新	400	4,092.00	0.00
752	601666	平煤股份	300	4,077.00	0.00
753	002542	中化岩土	1,400	4,074.00	0.00
754	300447	全信股份	200	4,074.00	0.00
755	002823	凯中精密	400	4,072.00	0.00
756	300813	泰林生物	100	4,069.00	0.00
757	300837	浙矿股份	100	4,055.00	0.00
758	603901	永创智能	300	4,053.00	0.00
759	002488	金固股份	600	4,038.00	0.00
760	600528	中铁工业	500	4,025.00	0.00
761	002225	濮耐股份	1,000	4,010.00	0.00
762	002522	浙江众成	700	3,976.00	0.00
763	601226	华电重工	800	3,968.00	0.00
764	603358	华达科技	200	3,960.00	0.00
765	600846	同济科技	500	3,950.00	0.00
766	002237	恒邦股份	400	3,920.00	0.00
767	600590	泰豪科技	600	3,918.00	0.00
768	688106	金宏气体	200	3,910.00	0.00
769	600970	中材国际	400	3,876.00	0.00
770	002663	普邦股份	2,000	3,860.00	0.00
771	300197	节能铁汉	1,600	3,856.00	0.00
772	603388	元成股份	500	3,830.00	0.00

773	600248	陕西建工	700	3,801.00	0.00
774	301219	腾远钴业	43	3,776.26	0.00
775	002526	山东矿机	1,600	3,776.00	0.00
776	002441	众业达	400	3,768.00	0.00
777	300237	美晨生态	1,500	3,750.00	0.00
778	603788	宁波高发	300	3,738.00	0.00
779	300473	德尔股份	200	3,706.00	0.00
780	002009	天奇股份	200	3,700.00	0.00
781	600853	龙建股份	1,100	3,696.00	0.00
782	600320	振华重工	1,100	3,696.00	0.00
783	603838	四通股份	600	3,678.00	0.00
784	600629	华建集团	500	3,675.00	0.00
785	600820	隧道股份	600	3,672.00	0.00
786	002116	中国海诚	400	3,668.00	0.00
787	002431	棕榈股份	1,100	3,663.00	0.00
788	603187	海容冷链	100	3,655.00	0.00
789	600967	内蒙一机	400	3,648.00	0.00
790	300341	麦克奥迪	400	3,636.00	0.00
791	002662	京威股份	1,000	3,630.00	0.00
792	300522	世名科技	300	3,612.00	0.00
793	688350	富淼科技	200	3,598.00	0.00
794	300263	隆华科技	400	3,584.00	0.00
795	300145	中金环境	1,300	3,575.00	0.00
796	000969	安泰科技	400	3,568.00	0.00
797	300375	鹏翎股份	800	3,568.00	0.00
798	000559	万向钱潮	600	3,564.00	0.00
799	600480	凌云股份	400	3,556.00	0.00
800	002698	博实股份	300	3,549.00	0.00
801	300470	中密控股	100	3,529.00	0.00
802	601068	中铝国际	800	3,528.00	0.00
803	600326	西藏天路	600	3,510.00	0.00
804	002051	中工国际	400	3,496.00	0.00
805	000628	高新发展	200	3,490.00	0.00
806	300284	苏交科	500	3,485.00	0.00
807	002061	浙江交科	500	3,480.00	0.00
808	601789	宁波建工	600	3,468.00	0.00
809	600939	重庆建工	800	3,464.00	0.00
810	603357	设计总院	300	3,444.00	0.00
811	603519	立霸股份	300	3,441.00	0.00
812	300445	康斯特	300	3,438.00	0.00
813	000779	甘咨询	300	3,393.00	0.00
814	603306	华懋科技	100	3,390.00	0.00
815	000301	东方盛虹	200	3,382.00	0.00

816	600163	中闽能源	400	3,380.00	0.00
817	002064	华峰化学	400	3,376.00	0.00
818	300839	博汇股份	250	3,372.50	0.00
819	600875	东方电气	200	3,290.00	0.00
820	002986	宇新股份	140	3,287.20	0.00
821	300675	建科院	200	3,282.00	0.00
822	002250	联化科技	200	3,274.00	0.00
823	603329	上海雅仕	200	3,260.00	0.00
824	300829	金丹科技	100	3,242.00	0.00
825	600475	华光环能	400	3,228.00	0.00
826	600765	中航重机	100	3,218.00	0.00
827	300416	苏试试验	130	3,195.40	0.00
828	002472	双环传动	100	3,184.00	0.00
829	300382	斯莱克	200	3,134.00	0.00
830	000831	五矿稀土	100	3,125.00	0.00
831	002761	浙江建投	100	3,087.00	0.00
832	605077	华康股份	140	3,087.00	0.00
833	002140	东华科技	300	3,039.00	0.00
834	603859	能科科技	100	3,036.00	0.00
835	603305	旭升股份	100	3,022.00	0.00
836	300257	开山股份	200	2,992.00	0.00
837	000937	冀中能源	400	2,984.00	0.00
838	600562	国睿科技	200	2,970.00	0.00
839	300261	雅本化学	200	2,944.00	0.00
840	002789	建艺集团	200	2,934.00	0.00
841	603179	新泉股份	100	2,900.00	0.00
842	600157	永泰能源	1,800	2,862.00	0.00
843	300035	中科电气	100	2,795.00	0.00
844	605006	山东玻纤	240	2,748.00	0.00
845	000906	浙商中拓	300	2,724.00	0.00
846	601069	西部黄金	200	2,716.00	0.00
847	000565	渝三峡 A	400	2,584.00	0.00
848	603203	快克股份	100	2,560.00	0.00
849	300772	运达股份	100	2,544.00	0.00
850	603067	振华股份	200	2,506.00	0.00
851	603399	吉翔股份	100	2,491.00	0.00
852	600895	张江高科	200	2,490.00	0.00
853	002556	辉隆股份	200	2,340.00	0.00
854	300214	日科化学	300	2,322.00	0.00
855	600325	华发股份	300	2,271.00	0.00
856	603000	人民网	200	2,240.00	0.00
857	300733	西菱动力	100	2,214.00	0.00
858	002091	江苏国泰	200	2,150.00	0.00

859	603978	深圳新星	100	2,131.00	0.00
860	000912	泸天化	400	2,100.00	0.00
861	603639	海利尔	100	2,085.00	0.00
862	002588	史丹利	300	2,055.00	0.00
863	601200	上海环境	200	2,032.00	0.00
864	600691	阳煤化工	500	2,020.00	0.00
865	300575	中旗股份	100	2,020.00	0.00
866	600118	中国卫星	100	2,008.00	0.00
867	002274	华昌化工	200	1,948.00	0.00
868	603979	金诚信	100	1,931.00	0.00
869	000400	许继电气	100	1,920.00	0.00
870	601098	中南传媒	200	1,888.00	0.00
871	300384	三联虹普	100	1,860.00	0.00
872	000731	四川美丰	200	1,820.00	0.00
873	002549	凯美特气	100	1,810.00	0.00
874	600508	上海能源	100	1,809.00	0.00
875	601001	晋控煤业	100	1,775.00	0.00
876	002281	光迅科技	100	1,758.00	0.00
877	600642	申能股份	300	1,704.00	0.00
878	000065	北方国际	200	1,690.00	0.00
879	300087	荃银高科	100	1,646.00	0.00
880	600717	天津港	400	1,604.00	0.00
881	000736	中交地产	100	1,591.00	0.00
882	600022	山东钢铁	900	1,566.00	0.00
883	002302	西部建设	200	1,552.00	0.00
884	000089	深圳机场	200	1,544.00	0.00
885	601918	新集能源	300	1,530.00	0.00
886	601333	广深铁路	700	1,526.00	0.00
887	600006	东风汽车	200	1,510.00	0.00
888	000657	中钨高新	100	1,500.00	0.00
889	000722	湖南发展	100	1,415.00	0.00
890	002149	西部材料	100	1,360.00	0.00
891	601005	重庆钢铁	700	1,337.00	0.00
892	600572	康恩贝	300	1,329.00	0.00
893	600791	京能置业	300	1,320.00	0.00
894	002758	浙农股份	100	1,317.00	0.00
895	002428	云南锗业	100	1,292.00	0.00
896	002170	芭田股份	200	1,282.00	0.00
897	600366	宁波韵升	100	1,260.00	0.00
898	603299	苏盐井神	100	1,253.00	0.00
899	000701	厦门信达	200	1,250.00	0.00
900	600575	淮河能源	400	1,248.00	0.00
901	002314	南山控股	300	1,242.00	0.00

902	600330	天通股份	100	1,191.00	0.00
903	600313	农发种业	100	1,188.00	0.00
904	601872	招商轮船	200	1,152.00	0.00
905	600982	宁波能源	200	1,134.00	0.00
906	000965	天保基建	200	1,128.00	0.00
907	600908	无锡银行	200	1,126.00	0.00
908	002215	诺普信	200	1,118.00	0.00
909	601228	广州港	300	1,101.00	0.00
910	600796	钱江生化	200	1,084.00	0.00
911	002305	南国置业	400	1,068.00	0.00
912	000680	山推股份	200	1,040.00	0.00
913	600663	陆家嘴	100	1,036.00	0.00
914	600026	中远海能	100	1,033.00	0.00
915	600704	物产中大	200	1,026.00	0.00
916	600021	上海电力	100	1,025.00	0.00
917	600538	国发股份	200	1,022.00	0.00
918	002734	利民股份	100	1,006.00	0.00
919	600373	中文传媒	100	999.00	0.00
920	002749	国光股份	100	995.00	0.00
921	603086	先达股份	100	970.00	0.00
922	000987	越秀金控	135	949.05	0.00
923	600037	歌华有线	100	939.00	0.00
924	002165	红宝丽	200	936.00	0.00
925	000713	丰乐种业	100	917.00	0.00
926	600101	明星电力	100	912.00	0.00
927	000014	沙河股份	100	911.00	0.00
928	002461	珠江啤酒	100	848.00	0.00
929	002716	金贵银业	300	828.00	0.00
930	600727	鲁北化工	100	812.00	0.00
931	300239	东宝生物	100	790.00	0.00
932	600423	柳化股份	200	750.00	0.00
933	600470	六国化工	100	740.00	0.00
934	002999	天禾股份	100	732.00	0.00
935	600731	湖南海利	100	716.00	0.00
936	002391	长青股份	100	710.00	0.00
937	300387	富邦股份	100	688.00	0.00
938	600844	丹化科技	200	630.00	0.00
939	000953	河化股份	100	605.00	0.00
940	600121	郑州煤电	100	588.00	0.00
941	600854	春兰股份	100	571.00	0.00
942	002513	蓝丰生化	100	508.00	0.00
943	600397	安源煤业	100	333.00	0.00
944	688199	久日新材	4	158.44	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	000333	美的集团	16,648,691.90	6.73
2	600519	贵州茅台	12,895,317.00	5.21
3	601318	中国平安	12,258,815.00	4.96
4	601166	兴业银行	12,109,736.20	4.90
5	300750	宁德时代	9,350,535.00	3.78
6	601398	工商银行	8,306,200.00	3.36
7	000651	格力电器	8,034,849.38	3.25
8	002709	天赐材料	7,540,525.71	3.05
9	601288	农业银行	7,430,048.00	3.00
10	600919	江苏银行	7,379,933.00	2.98
11	000002	万科 A	6,990,812.00	2.83
12	002466	天齐锂业	6,608,430.00	2.67
13	002304	洋河股份	6,383,436.00	2.58
14	601838	成都银行	6,185,241.36	2.50
15	601919	中远海控	6,132,068.00	2.48
16	600141	兴发集团	5,757,950.00	2.33
17	600019	宝钢股份	5,515,664.00	2.23
18	601577	长沙银行	5,402,618.00	2.18
19	300316	晶盛机电	5,352,863.00	2.16
20	002460	赣锋锂业	5,351,699.00	2.16
21	601328	交通银行	5,262,945.00	2.13
22	601077	渝农商行	5,211,545.00	2.11
23	601939	建设银行	5,137,281.00	2.08
24	000898	鞍钢股份	5,091,491.00	2.06
25	603392	万泰生物	4,967,087.00	2.01

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	000333	美的集团	17,978,364.47	7.27
2	601166	兴业银行	15,226,121.00	6.16
3	601318	中国平安	15,104,884.17	6.11
4	600519	贵州茅台	12,718,438.00	5.14

5	601398	工商银行	9,433,754.00	3.81
6	000651	格力电器	9,124,083.00	3.69
7	601288	农业银行	8,650,804.00	3.50
8	300750	宁德时代	8,493,157.00	3.43
9	601328	交通银行	7,497,247.00	3.03
10	000002	万科 A	6,939,935.00	2.81
11	601668	中国建筑	6,569,497.00	2.66
12	600019	宝钢股份	6,398,181.00	2.59
13	600919	江苏银行	6,382,381.00	2.58
14	601577	长沙银行	6,359,310.00	2.57
15	600141	兴发集团	6,327,207.00	2.56
16	601919	中远海控	6,250,380.70	2.53
17	601939	建设银行	6,114,157.00	2.47
18	601838	成都银行	5,966,497.81	2.41
19	000898	鞍钢股份	5,891,251.00	2.38
20	000932	华菱钢铁	5,596,428.00	2.26
21	601077	渝农商行	5,495,108.00	2.22
22	000789	万年青	5,415,423.40	2.19
23	600985	淮北矿业	5,239,056.78	2.12
24	000959	首钢股份	5,229,176.00	2.11
25	600997	开滦股份	5,217,341.00	2.11
26	000825	太钢不锈	5,197,040.81	2.10
27	600282	南钢股份	5,112,350.00	2.07
28	600808	马钢股份	5,095,033.00	2.06
29	000717	韶钢松山	5,012,270.00	2.03
30	601898	中煤能源	5,003,002.96	2.02

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	1,179,750,756.81
卖出股票的收入（成交）总额	1,208,117,444.30

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

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

本基金现阶段主要通过股指期货合约调节整体组合的市场风险。基金管理人将根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，以套期保值为主要目的，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，优化股指期货组合，创造额外收益。

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	104,521.64
2	应收清算款	207,402.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,339.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	319,263.78

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	5,264,494.38	2.58	首次公开发行限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
博时量化多策略股票 A	1,301	94,763.54	114,502,253.87	92.87%	8,785,116.38	7.13%
博时量化多策略股票 C	521	19,243.96	6,152,675.72	61.37%	3,873,428.91	38.63%
合计	1,760	75,746.29	120,654,929.59	90.50%	12,658,545.29	9.50%

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	博时量化多策略股票 A	110,604.64	0.09%
	博时量化多策略股票 C	-	-
	合计	110,604.64	0.08%

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	博时量化多策略股票 A	-
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	0~10
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 3 日）基金份额总额	146,135,440.46	765,094,981.90
本报告期期初基金份额总额	137,957,614.05	13,456,278.64
本报告期基金总申购份额	75,392,422.08	6,586,032.73
减：本报告期基金总赎回份额	90,062,665.88	10,016,206.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	123,287,370.25	10,026,104.63

§ 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	
银河证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	134,071,710.85	5.63%	98,042.79	5.62%	-
德邦证券	1	122,296,748.81	5.13%	89,437.55	5.13%	增加 1 个
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	193,767,448.15	8.13%	143,224.51	8.21%	-
中信证券	2	413,087,720.89	17.34%	302,095.33	17.33%	增加 1 个
招商证券	6	1,518,805,884.31	63.76%	1,110,687.90	63.70%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信

息服务；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	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,000,700.00	13.35%	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	75,256.42	1.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	6,420,891.88	85.65%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-18
2	关于博时量化多策略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	上海证券报、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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-30
4	博时量化多策略股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-22
5	博时量化多策略股票型证券投资基金 2021 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
10	博时量化多策略股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、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	上海证券报、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旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-18
14	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-06
15	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-04
16	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01
17	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	上海证券报、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	2022-01-10~ 2022-03-15; 2022-03-23~ 2022-06-30	27,204,522.10	6,769,803.66	-	33,974,325.76	25.48%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

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多策略股票型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《博时量化多策略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 博时量化多策略股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 12.1.6 报告期内博时量化多策略股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

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