

博时量化价值股票型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	91
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	91
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	91
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	92
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	92
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	92
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	92
8.12 投资组合报告附注	92
§9 基金份额持有人信息	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	93
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	94
§10 开放式基金份额变动	94
§11 重大事件揭示	94
11.1 基金份额持有人大会决议	94
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	94
11.4 基金投资策略的改变	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	95
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	95
11.8 其他重大事件	97
§12 影响投资者决策的其他重要信息	100
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	100
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	101
§13 备查文件目录	101
13.1 备查文件目录	101
13.2 存放地点	102
13.3 查阅方式	102

§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	96,723,213.72 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	79,420,487.76 份	17,302,725.96 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	姓名	孙麒清	秦一楠

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	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	1,391,622.53	-2,855,152.41	1,634,821.09	57,673,028.41	1,944,888.49	112,871,189.65
本期利润	2,675,906.40	-3,057,675.79	725,174.68	27,492,744.43	2,296,689.84	125,423,200.83
加权平均基金份额本期利润	0.1386	-0.1664	0.1780	0.1599	0.3273	0.3104
本期加权平均净值利润率	10.56%	-12.36%	11.88%	11.22%	27.60%	25.94%
本期基金	-12.32%	-13.02%	11.13%	10.21%	30.26%	29.22%

份额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	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	13,754,787.99	2,594,278.55	2,245,257.25	1,540,780.14	2,073,914.28	151,304,831.63
期末可供分配基金份额利润	0.1732	0.1499	0.5579	0.5142	0.4019	0.3739
期末基金资产净值	93,175,275.75	19,897,004.51	6,269,506.73	4,537,144.86	7,234,418.78	556,024,152.03
期末基金份额净值	1.1732	1.1499	1.5579	1.5142	1.4019	1.3739
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	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	36.60%	31.71%	55.79%	51.42%	40.19%	37.39%

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

1. 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
过去三个月	2.44%	1.04%	4.24%	1.31%	-1.80%	-0.27%
过去六个月	-6.51%	0.95%	-10.57%	1.09%	4.06%	-0.14%
过去一年	-12.32%	1.11%	-16.82%	1.23%	4.50%	-0.12%
过去三年	26.93%	1.15%	-6.41%	1.17%	33.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	36.60%	1.17%	5.44%	1.15%	31.16%	0.02%

2. 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

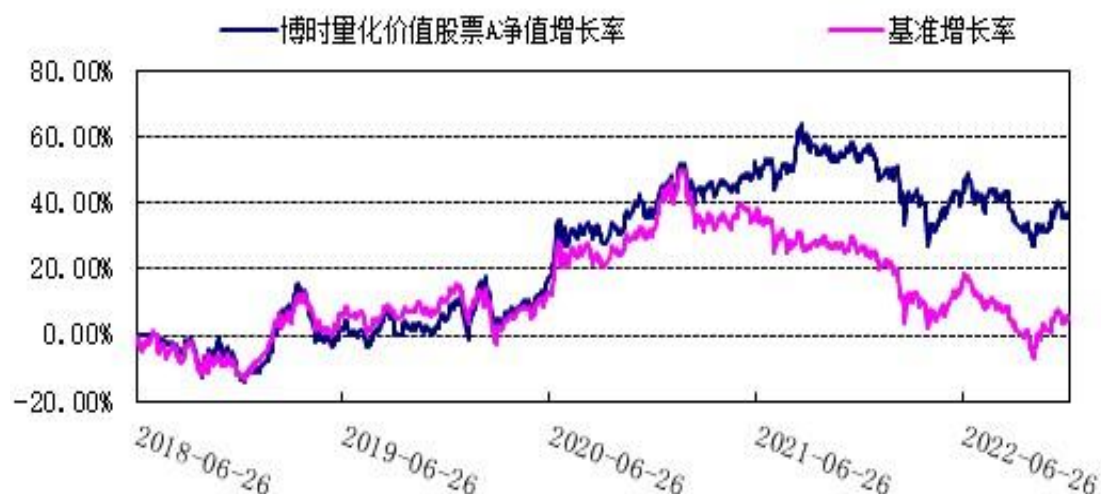
过去三个月	2.24%	1.04%	4.24%	1.31%	-2.00%	-0.27%
过去六个月	-6.87%	0.95%	-10.57%	1.09%	3.70%	-0.14%
过去一年	-13.02%	1.11%	-16.82%	1.23%	3.80%	-0.12%
过去三年	23.88%	1.14%	-6.41%	1.17%	30.29%	-0.03%
自基金合同生效起至今	31.71%	1.17%	5.44%	1.15%	26.27%	0.02%

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

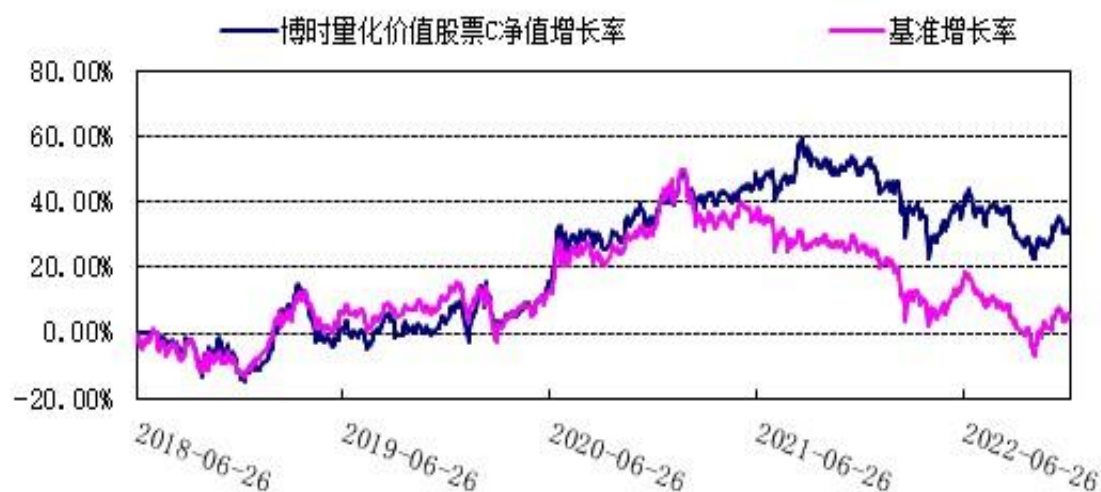
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 6 月 26 日至 2022 年 12 月 31 日)

1、博时量化价值股票 A



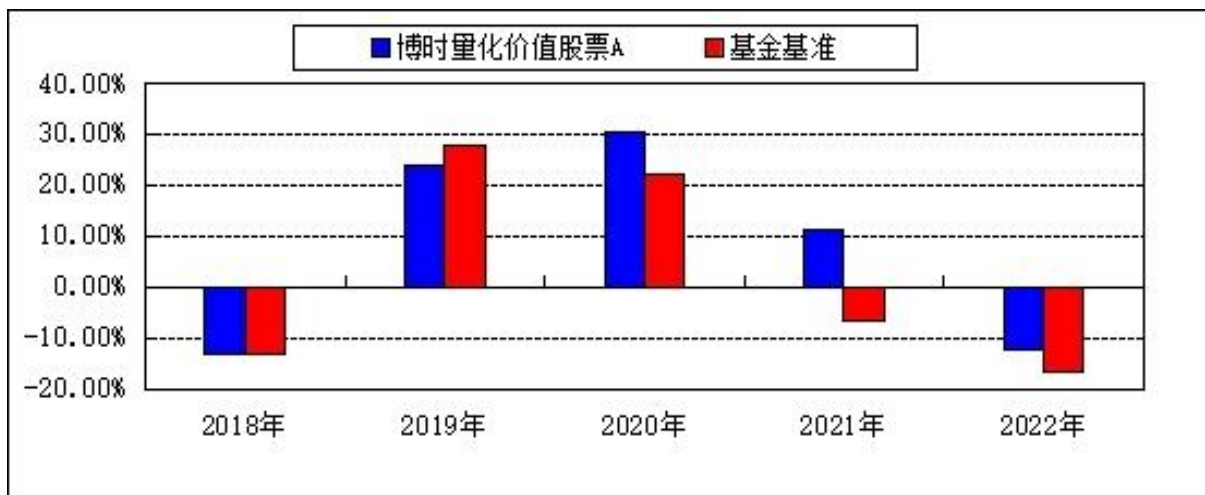
2、博时量化价值股票 C



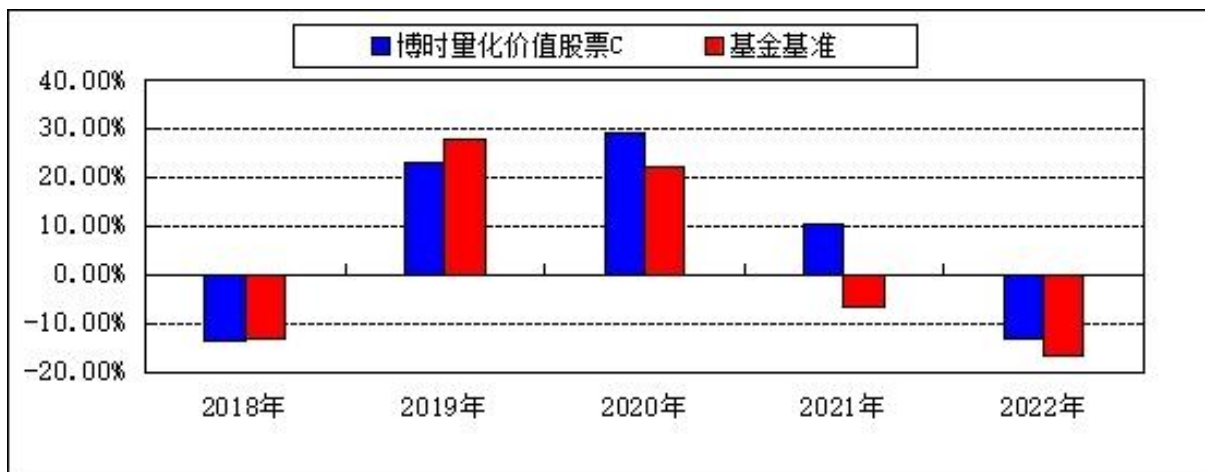
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时量化价值股票 A



2、博时量化价值股票 C



注：本基金的基金合同于 2018 年 6 月 26 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、博时量化价值股票 A：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	1.9070	6,565,967.12	7,581,507.61	14,147,474.73	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	1.9070	6,565,967.12	7,581,507.61	14,147,474.73	-

2、博时量化价值股票 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	1.6550	2,745,269.91	91,632.86	2,836,902.77	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	1.6550	2,745,269.91	91,632.86	2,836,902.77	-

§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 12 月 31 日，博时基金公司共管理 341 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 15141 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 5227 亿元人民币，累计分红逾 1778 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

其他大事件

深圳证券交易所发布 2022 年度基金市场优秀机构和个人评选结果，博时基金荣获“优秀 ETF 基金管理人”奖，博时国开 ETF 荣获“ETF 产品创新奖”。

2022 年 12 月，深圳市地方金融监管局公布 2021 年度深圳市金融创新奖颁奖仪式暨深圳市金融创新奖成果。博时基金及子公司申报或与外部机构联合申报了多个项目，其中“跨境(境外)回购投资交易支持系统”项目荣获贡献奖（深港金融创新合作类）二等奖，“基于深度学习的基金营销内容智能审核系统”项目和“博时招商蛇口产业园封闭式基础设施证券投资基金”项目荣获贡献奖三等奖。

12 月 26 日，由中国基金报主办的第九届中国基金业英华奖、第四届中国公募基金英华奖揭晓，博时基金荣获 2022 年度优秀 ESG 发展基金公司等多个奖项。

11 月 14 日，由上海证券报主办的第十九届“金基金”奖出炉，博时基金凭借优秀的资产管理能力荣获“金基金”债券投资回报基金管理公司奖。

博时基金聘请了第三方机构对其 2021 年碳排放量进行盘查，实现 2021 年度自身运营活动的碳中和，包含范围一（直接温室气体排放）和范围二（电力产生的间接温室气体排放），积极践行绿色

金融与责任投资。

9月27日，第十七届中国基金业明星基金奖出炉，博时基金荣获四项大奖。博时基金管理有限公司荣获“十大明星基金公司”；博时安盈债券荣获“五年持续回报普通债券型明星基金奖”；博时鑫泽灵活配置混合荣获“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”；博时富瑞纯债荣获“三年持续回报普通债券型明星基金奖”。

8月12日，全国社会保障基金境内委托投资及基本养老保险基金委托投资 2021 年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，3 个社保委托组合获评“综合评级 A 档”，2 个养老组合获评“综合评级 A 档”。在公司基本面单项考评中，博时基金评级 A 档；在业务支持单项考评中，博时基金因提供专业的研究服务支持获评 A 档，为社保考评结果的最高档。博时基金桂征辉荣获 2021 年度“3 年贡献社保表彰奖”、“3 年贡献养老表彰奖”，赵云阳荣获 2021 年度“3 年贡献养老表彰奖”。

1月，深圳证券交易所发布 2021 年度深圳证券交易所基金市场优秀机构和个人评选结果，博时基金荣获深交所 2021 年度“优秀 REITs 基金管理人”。

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	-	12.4	林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理、博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015 年 5 月 20 日-2021 年 5 月 18 日)基金经理。现任博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日—至今)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2022 年 2 月 28 日—至今)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部投资总监/ 基金经理	2018-06-26	-	20.4	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入

					博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监、博时价值增长贰号证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、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、指数与量化投资部总经理。现任指数与量化投资部投资总监兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017年5月4日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日—至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	12.4	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。管理人于 2023 年 3 月 8 日发布公告称，林景艺女士不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 66 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

面对新冠疫情对经济的冲击，在 2020 和 2021 年全球多个经济体实行量化宽松的货币政策。但是全球供给端的恢复相对缓慢，短期的供需错配带来了全球性通胀，而俄乌冲突进一步恶化这一局面。美联储在 2022 年开启了加息步伐，美元流动性收紧，冲击着之前因量化宽松而上涨的全球大类资产。国内方面，疫情的反复和扩散冲击着消费场景。居民面对收入预期的不稳定性，主动削减开支、降低消费。虽然国家出台了利好房地产行业的调控政策，但是仍需时间去改善地产销售低迷、房企资金紧张的局面。

A 股市场在 2022 年走势震荡下行，整体呈现 W 型走势，主要宽基指数全年收益为负：沪深 300 指数收益-21.63%，中证 1000 指数收益-21.58%，创业板指收益-29.37%，红利指数相对表现较好，全年收益-2.42%。从风格结构上看，2022 年价值风格表现优于成长风格，大盘和小盘在年中经历了多次风格切换。年初至 4 月下旬，大盘风格优于小盘风格，价值风格优于成长风格；4 月下旬至 8 月市场迎来触底反弹，风格也发生了切换，小盘和成长风格在此期间发力；在此后的时间里市场回

归到价值这条主线上，小盘风格仅在 10 月分阶段性有所表现，其余时间大盘更为强势。行业板块方面，在市场整体震荡下行背景下，各行业在全年表现普遍不佳。行业之间呈现结构性差异，在不同阶段领涨的行业有所不同，全年缺乏比较清晰的投资主线。随着基本面供需偏紧，煤炭价格高企，煤炭板块在 2022 年一枝独秀；而在稳增长政策持续发力背景下，市场对银行、房地产板块预期升温，对应行业在 2022 年也表现相对较好；受市场关注的电子、国防军工、电力设备及新能源等高贝塔行业在震荡下行市场中受伤较大。根据中信一级行业指数显示，2022 年实现正收益的行业有三个：煤炭、消费者服务、交通运输，跌幅最大的三个行业是：电子、综合金融、计算机。2022 年港股市场在 1 月到 10 月震荡下跌，但是在最后两个月触底反弹，最终恒生指数全年收益-15.46%。港股行业方面：能源、消费者服务、媒体和电信服务业涨幅领先，汽车与汽车零部件、商业与专业服务、技术硬件与设备等行业跌幅最大。

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。当前，市场整体估值有所提升，而低估值板块与其他板块的估值差已经达到历史高位，未来具有较大的结构性估值修复空间。大盘价值市盈率从 18 年底的 8.14 倍到现在 6.06 倍，指数涨了 4.88%，业绩驱动上升为主；大盘成长从 2018 年底的 15 倍市盈率已经到 19 倍，指数上涨 74.68%，受到估值驱动。我们认为未来两年内，价值风格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。大盘价值对应的金融和周期行业在复苏预期下更加具有业绩改善和估值修复的可能。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，力争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 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1732 元，份额累计净值为 1.3639 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1499 元，份额累计净值为 1.3154 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-12.32%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-13.02%，同期业绩基准增长率为-16.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

造成 2022 年全球股票市场表现不佳的诸多因素在 2023 年均有望迎来转机。疫情对全球经济的影响会逐步淡化，市场供需之间的错配问题有望得到逐步修复。随着美国通胀水平得到降温，美元加息步伐会逐步趋缓，美元流动性拐点有望看到。国内方面，随着疫情高峰的结束，叠加中央稳增长政策的持续落地，国内消费将迎来复苏，企业盈利也会逐步修复。房地产金融政策的变化有助于行业度过难关，行业高质量发展有较好的政策基础，随着行业风险的逐步下降，房地产业平稳健康

发展值得期待。

在国际市场结束量化宽松周期、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 2023 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 年底，恒生指数的市盈率(TTM)为 9.71，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

报告期内，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步完善投资管理相关的管理机制，制定了《公募基金池管理办法》、《金融工具分类制度》、《金融工具减值制度》等，修订了《债券池管理办法》、《股票池管理办法》、《科创板投资管理制度》、《流动性风险管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“博时产品管理系统”、“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“金手指估值系统”、“统一风险管理平台”等管理平台进行迭代更新，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照法规及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专

业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金管理人于 2022 年 11 月 10 日发布公告，以 2022 年 11 月 3 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5890 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5030 元人民币；

本基金管理人于 2022 年 12 月 22 日发布公告，以 2022 年 12 月 19 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 1.3180 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 1.1520 元人民币。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 08 月 22 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 12 月 31 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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年度报告中的财务指标、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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60669135_A09 号

博时量化价值股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时量化价值股票型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的博时量化价值股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了博时量化价值股票型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时量化价值股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

博时量化价值股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估博时量化价值股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督博时量化价值股票型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

王珊珊 朱燕

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2023 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	7.4.7.1	11,292,908.20	975,573.86
结算备付金		1,295,066.28	248,064.58
存出保证金		53,752.33	67,337.85
交易性金融资产	7.4.7.2	105,401,229.87	9,780,554.20
其中：股票投资		105,401,229.87	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	7.4.7.5	-	-
应收清算款		-	72,783.87
应收股利		-	-
应收申购款		7,286.49	13,623.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	428.39
资产总计		118,050,243.17	11,158,366.16
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,836,553.06	-
应付赎回款		15,374.92	7,912.92
应付管理人报酬		90,945.48	19,741.63
应付托管费		25,262.64	5,483.76
应付销售服务费		14,658.34	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	7.4.7.7	995,168.47	305,299.27
负债合计		4,977,962.91	351,714.57
净资产：			

实收基金	7.4.7.8	96,723,213.72	7,020,614.20
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	16,349,066.54	3,786,037.39
净资产合计		113,072,280.26	10,806,651.59
负债和净资产总计		118,050,243.17	11,158,366.16

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 96,723,213.72 份。其中 A 类基金份额净值 1.1732 元，基金份额 79,420,487.76 份；C 类基金份额净值 1.1499 元，基金份额 17,302,725.96 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		484,417.46	40,244,192.20
1.利息收入		46,334.77	270,139.63
其中：存款利息收入	7.4.7.10	46,334.77	261,323.21
债券利息收入		-	8,816.42
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）		-875,478.95	71,029,845.99
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-1,638,232.99	66,466,134.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	28,193.92	190,877.71
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	1,694,970.87
股利收益	7.4.7.15	734,560.12	2,677,862.80
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）	7.4.7.16	1,081,760.49	-31,089,930.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	231,801.15	34,136.97
减：二、营业总支出		866,186.85	12,026,273.09
1. 管理人报酬		435,629.63	2,330,304.27
2. 托管费		121,008.37	647,306.71
3. 销售服务费		193,462.60	2,022,618.88

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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.04	6,132.59
8. 其他费用	7.4.7.19	116,086.21	7,019,910.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-381,769.39	28,217,919.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-381,769.39	28,217,919.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-381,769.39	28,217,919.11

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	7,020,614.20	3,786,037.39	10,806,651.59
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）	89,702,599.52	12,563,029.15	102,265,628.67
（一）、综合收益总额	-	-381,769.39	-381,769.39
（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）	89,702,599.52	29,929,176.04	119,631,775.56
其中：1.基金申购款	141,164,757.07	49,213,451.98	190,378,209.05
2.基金赎回款	-51,462,157.55	-19,284,275.94	-70,746,433.49
（三）、本期向基	-	-16,984,377.50	-16,984,377.50

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)	96,723,213.72	16,349,066.54	113,072,280.26
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	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)	-402,859,210.70	-149,592,708.52	-552,451,919.22
(一)、综合收益总额	-	28,217,919.11	28,217,919.11
(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)	-402,859,210.70	-177,810,627.63	-580,669,838.33
其中: 1.基金申购款	29,340,155.86	13,763,402.13	43,103,557.99
2.基金赎回款	-432,199,366.56	-191,574,029.76	-623,773,396.32
(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)	7,020,614.20	3,786,037.39	10,806,651.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：侣方方

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时量化价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]344号《关于准予博时量化价值股票型证券投资基金注册的批复》的注册，由博时基金管理有限公司于 2018 年 6 月 1 日至 2018 年 6 月 22 日向社会公开募集。基金合同于 2018 年 6 月 26 日生效，首次设立募集规模为 341,191,900.59 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的 80%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2023 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会

会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有

在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(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) 交易性金融资产在买入/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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《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）。

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。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(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。

(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。

（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。

（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。

（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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	11,292,908.20	975,573.86
等于：本金	11,290,546.17	975,573.86
加：应计利息	2,362.03	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	11,292,908.20	975,573.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	103,819,028.29	-	105,401,229.87	1,582,201.58
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	103,819,028.29	-	105,401,229.87	1,582,201.58
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	9,194,013.11	-	9,679,762.19	485,749.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	86,100.00	-	100,792.01
				14,692.01

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	86,100.00	-	100,792.01	14,692.01
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,280,113.11	-	9,780,554.20	500,441.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他权益工具投资

7.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	428.39
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	428.39

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	900,668.47	180,799.27

其中：交易所市场	900,668.47	180,799.27
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	94,500.00	124,500.00
合计	995,168.47	305,299.27

7.4.7.8 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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,024,249.48	4,024,249.48
本期申购	76,933,057.61	76,933,057.61
本期赎回（以“-”号填列）	-1,536,819.33	-1,536,819.33
本期末	79,420,487.76	79,420,487.76

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 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,996,364.72	2,996,364.72
本期申购	64,231,699.46	64,231,699.46
本期赎回（以“-”号填列）	-49,925,338.22	-49,925,338.22
本期末	17,302,725.96	17,302,725.96

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

7.4.7.9 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	1,391,622.53	1,284,283.87	2,675,906.40
本期基金份额交易产生的变动数	60,158,350.17	-37,177,251.10	22,981,099.07
其中：基金申购款	61,523,492.20	-37,866,785.66	23,656,706.54
基金赎回款	-1,365,142.03	689,534.56	-675,607.47
本期已分配利润	-14,147,474.73	-	-14,147,474.73
本期末	50,939,367.83	-37,184,579.84	13,754,787.99

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	-2,855,152.41	-202,523.38	-3,057,675.79
本期基金份额交易产生的变动数	13,720,278.61	-6,772,201.64	6,948,076.97
其中：基金申购款	54,207,010.29	-28,650,264.85	25,556,745.44
基金赎回款	-40,486,731.68	21,878,063.21	-18,608,668.47
本期已分配利润	-2,836,902.77	-	-2,836,902.77
本期末	10,511,996.22	-7,917,717.67	2,594,278.55

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	36,010.84	158,893.03
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	9,731.66	99,369.61
其他	592.27	3,060.57
合计	46,334.77	261,323.21

7.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	876,829,406.63	2,441,909,223.74
减：卖出股票成本总额	875,727,869.75	2,375,443,089.13
减：交易费用	2,739,769.87	-
买卖股票差价收入	-1,638,232.99	66,466,134.61

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	21.12	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,172.80	190,877.71
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	28,193.92	190,877.71

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	159,974.62	6,768,947.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	131,700.00	6,575,602.75
减：应计利息总额	101.66	2,466.80
减：交易费用	0.16	-
买卖债券差价收入	28,172.80	190,877.71

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-	1,694,970.87

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	734,560.12	2,677,862.80
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	734,560.12	2,677,862.80
----	------------	--------------

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	1,081,760.49	-29,145,690.39
——股票投资	1,096,452.50	-29,160,382.40
——债券投资	-14,692.01	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	-	-1,944,240.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-	-1,944,240.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,081,760.49	-31,089,930.39

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	228,423.69	15,333.24
基金转换费收入	3,377.46	18,803.73
合计	231,801.15	34,136.97

7.4.7.18 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	50,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
交易费用	-	6,870,354.20
其他	12.99	-

中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费	8,073.22	11,556.44
合计	116,086.21	7,019,910.64

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

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

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	404,646,032.57	21.91%	521,791,403.12	12.02%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	55,278.27	34.55%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	376,838.70	22.12%	171,646.49	19.06%
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	486,139.93	12.10%	-	-

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	435,629.63

其中：支付销售机构的客户维护费	62,274.14	31,696.55
-----------------	-----------	-----------

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,008.37	647,306.71

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	152,547.89	152,547.89
中国农业银行	-	8,167.40	8,167.40
招商证券	-	32.06	32.06
合计	-	160,747.35	160,747.35
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 12 月 31 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	-	1,996,419.60	1,996,419.60
中国农业银行	-	6,144.86	6,144.86
合计	-	2,002,564.46	2,002,564.46

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

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

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
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 12 月 31 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	14.22%	-	-

注：1.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。
2.持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	11,292,908.20	36,010.84	975,573.86	158,893.03

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	002948	青岛银行	配股	900.00	2,880.00
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	345.00	4,978.35
招商证券股份有限公司	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 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券股份有限公司	001288	运机集团	网下发行	458.00	6,663.90

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

博时量化价值股票 A

单位:人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022-11-14	-	2022-11-14	0.5890	2,013,276.28	2,265,943.16	4,279,219.44	-
2	2022-12-26	-	2022-12-26	1.3180	4,552,690.84	5,315,564.45	9,868,255.29	-
合计				1.9070	6,565,967.12	7,581,507.61	14,147,474.73	-

博时量化价值股票 C

单位:人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022-11-14	-	2022-11-14	0.5030	831,541.83	26,587.51	858,129.34	-
2	2022-12-26	-	2022-12-26	1.1520	1,913,728.08	65,045.35	1,978,773.43	-
合计				1.6550	2,745,269.91	91,632.86	2,836,902.77	-

7.4.12 期末(2022年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
688525	佰维存储	2022-12-23	6个月	首次公开发售	13.99	15.27	1,938.00	27,112.62	29,593.26	-

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

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

3、基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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

5、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的

市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	11,292,908.20	-	-	-	11,292,908.20
结算备付金	1,295,066.28	-	-	-	1,295,066.28
存出保证金	53,752.33	-	-	-	53,752.33
交易性金融资产	-	-	-	105,401,229.87	105,401,229.87
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	7,286.49	7,286.49
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,641,726.81	-	-	105,408,516.36	118,050,243.17
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	15,374.92	15,374.92
应付清算款	-	-	-	3,836,553.06	3,836,553.06
应付管理人报酬	-	-	-	90,945.48	90,945.48
应付托管费	-	-	-	25,262.64	25,262.64
应付销售服务费	-	-	-	14,658.34	14,658.34
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	995,168.47	995,168.47
负债总计	-	-	-	4,977,962.91	4,977,962.91
利率敏感度缺口	12,641,726.81	-	-	100,430,553.45	113,072,280.26
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	105,401,229.87	93.22	9,679,762.19	89.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	105,401,229.87	93.22	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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 556	增加约 33
业绩比较基准下降 5%	减少约 556	减少约 33	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	105,371,636.61	9,283,670.54
第二层次	-	496,883.66
第三层次	29,593.26	-
合计	105,401,229.87	9,780,554.20

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	27,112.62	27,112.62
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	2,480.64	2,480.64
其中：计入损益的利得或损失	-	2,480.64	2,480.64
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	29,593.26	29,593.26
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,480.64	2,480.64
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

(若有)			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	29,593.26	平均价格亚式期权模型	预期波动率	30.76%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“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 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	105,401,229.87	89.29
	其中：股票	105,401,229.87	89.29
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	12,587,974.48	10.66
8	其他各项资产	61,038.82	0.05
9	合计	118,050,243.17	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,282,058.00	2.90
B	采矿业	2,242,215.00	1.98
C	制造业	48,576,489.87	42.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,449,647.00	3.05
E	建筑业	686,265.00	0.61
F	批发和零售业	313,956.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,792,817.00	1.59
H	住宿和餐饮业	483,990.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	880,526.00	0.78
J	金融业	37,119,736.00	32.83
K	房地产业	2,126,306.00	1.88
L	租赁和商务服务业	2,333,124.00	2.06
M	科学研究和技术服务业	2,114,100.00	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	105,401,229.87	93.22
----	----------------	-------

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	165,800	7,792,600.00	6.89
2	600519	贵州茅台	3,900	6,735,300.00	5.96
3	600036	招商银行	178,200	6,639,732.00	5.87
4	601166	兴业银行	212,100	3,730,839.00	3.30
5	600900	长江电力	149,200	3,133,200.00	2.77
6	000858	五粮液	16,500	2,981,385.00	2.64
7	300750	宁德时代	6,796	2,673,682.32	2.36
8	601398	工商银行	592,500	2,571,450.00	2.27
9	000651	格力电器	76,500	2,472,480.00	2.19
10	601328	交通银行	496,600	2,353,884.00	2.08
11	600887	伊利股份	75,700	2,346,700.00	2.08
12	600016	民生银行	679,200	2,343,240.00	2.07
13	300059	东方财富	120,300	2,333,820.00	2.06
14	601888	中国中免	10,800	2,333,124.00	2.06
15	600030	中信证券	114,000	2,269,740.00	2.01
16	600000	浦发银行	308,600	2,246,608.00	1.99
17	000333	美的集团	41,400	2,144,520.00	1.90
18	600276	恒瑞医药	55,300	2,130,709.00	1.88
19	000568	泸州老窖	9,500	2,130,660.00	1.88
20	603259	药明康德	26,100	2,114,100.00	1.87
21	600309	万华化学	22,600	2,093,890.00	1.85
22	002475	立讯精密	63,700	2,022,475.00	1.79
23	300760	迈瑞医疗	6,400	2,022,208.00	1.79
24	300124	汇川技术	28,700	1,994,650.00	1.76
25	002714	牧原股份	39,000	1,901,250.00	1.68
26	000001	平安银行	143,900	1,893,724.00	1.67
27	601012	隆基绿能	30,880	1,304,988.80	1.15
28	002594	比亚迪	4,600	1,182,062.00	1.05
29	000002	万科 A	57,200	1,041,040.00	0.92
30	600048	保利发展	64,300	972,859.00	0.86
31	601899	紫金矿业	78,700	787,000.00	0.70
32	002352	顺丰控股	13,100	756,656.00	0.67
33	002415	海康威视	20,900	724,812.00	0.64
34	601816	京沪高铁	140,500	691,260.00	0.61
35	300298	三诺生物	17,000	573,410.00	0.51
36	300910	瑞丰新材	4,600	567,226.00	0.50
37	688112	鼎阳科技	5,892	549,429.00	0.49
38	605077	华康股份	18,100	549,154.00	0.49

39	300575	中旗股份	24,450	534,721.50	0.47
40	300761	立华股份	15,000	513,750.00	0.45
41	301004	嘉益股份	17,100	509,238.00	0.45
42	300502	新易盛	21,400	508,250.00	0.45
43	002938	鹏鼎控股	18,500	507,640.00	0.45
44	605060	联德股份	19,600	505,876.00	0.45
45	002959	小熊电器	8,300	500,656.00	0.44
46	601699	潞安环能	29,700	500,445.00	0.44
47	000913	钱江摩托	26,600	491,568.00	0.43
48	003040	楚天龙	28,100	490,064.00	0.43
49	300532	今天国际	33,600	486,528.00	0.43
50	688123	聚辰股份	4,800	485,760.00	0.43
51	605108	同庆楼	13,000	483,990.00	0.43
52	002085	万丰奥威	81,200	483,140.00	0.43
53	002982	湘佳股份	10,900	468,918.00	0.41
54	000895	双汇发展	17,800	461,554.00	0.41
55	603035	常熟汽饰	21,700	461,125.00	0.41
56	002582	好想你	42,600	405,126.00	0.36
57	603156	养元饮品	17,400	387,498.00	0.34
58	000048	京基智农	20,300	362,355.00	0.32
59	000725	京东方 A	95,400	322,452.00	0.29
60	601668	中国建筑	54,600	296,478.00	0.26
61	603886	元祖股份	14,200	278,604.00	0.25
62	601601	中国太保	11,100	272,172.00	0.24
63	600919	江苏银行	34,500	251,505.00	0.22
64	600837	海通证券	26,800	232,892.00	0.21
65	601857	中国石油	46,800	232,596.00	0.21
66	601088	中国神华	8,400	232,008.00	0.21
67	600050	中国联通	49,600	222,208.00	0.20
68	300741	华宝股份	9,300	218,829.00	0.19
69	603697	有友食品	17,500	217,700.00	0.19
70	601688	华泰证券	16,400	208,936.00	0.18
71	601988	中国银行	65,100	205,716.00	0.18
72	601169	北京银行	46,700	201,277.00	0.18
73	600873	梅花生物	19,300	196,474.00	0.17
74	601225	陕西煤业	10,400	193,232.00	0.17
75	300146	汤臣倍健	8,000	182,560.00	0.16
76	601211	国泰君安	13,300	180,747.00	0.16
77	600585	海螺水泥	6,600	180,708.00	0.16
78	601919	中远海控	17,500	180,075.00	0.16
79	600028	中国石化	40,900	178,324.00	0.16
80	601628	中国人寿	4,800	178,176.00	0.16
81	003006	百亚股份	12,900	178,149.00	0.16

82	601728	中国电信	41,000	171,790.00	0.15
83	600104	上汽集团	11,500	165,715.00	0.15
84	601229	上海银行	27,900	164,889.00	0.15
85	601818	光大银行	52,500	161,175.00	0.14
86	601939	建设银行	28,400	159,892.00	0.14
87	000019	深粮控股	21,100	158,461.00	0.14
88	601766	中国中车	30,600	156,366.00	0.14
89	603589	口子窖	2,700	155,709.00	0.14
90	601116	三江购物	13,700	155,495.00	0.14
91	601390	中国中铁	27,900	155,124.00	0.14
92	601658	邮储银行	33,400	154,308.00	0.14
93	002299	圣农发展	6,500	153,985.00	0.14
94	601009	南京银行	14,300	149,006.00	0.13
95	600019	宝钢股份	26,200	146,458.00	0.13
96	603866	桃李面包	9,400	144,760.00	0.13
97	601985	中国核电	23,900	143,400.00	0.13
98	600346	恒力石化	8,700	135,111.00	0.12
99	000776	广发证券	8,600	133,214.00	0.12
100	600598	北大荒	9,400	129,344.00	0.11
101	002626	金达威	6,200	128,464.00	0.11
102	300858	科拓生物	4,000	123,680.00	0.11
103	605009	豪悦护理	2,300	119,301.00	0.11
104	601006	大秦铁路	17,400	116,232.00	0.10
105	603696	安记食品	10,700	115,774.00	0.10
106	600097	开创国际	10,700	114,811.00	0.10
107	002216	三全食品	6,200	114,762.00	0.10
108	001979	招商蛇口	8,900	112,407.00	0.10
109	601186	中国铁建	14,300	110,539.00	0.10
110	002661	克明食品	8,900	104,842.00	0.09
111	601138	工业富联	10,800	99,144.00	0.09
112	003000	劲仔食品	8,300	97,857.00	0.09
113	601952	苏垦农发	8,000	94,720.00	0.08
114	600300	维维股份	26,300	93,628.00	0.08
115	000529	广弘控股	10,500	92,085.00	0.08
116	002746	仙坛股份	9,800	89,768.00	0.08
117	600015	华夏银行	16,100	83,559.00	0.07
118	601998	中信银行	16,400	81,672.00	0.07
119	002304	洋河股份	500	80,250.00	0.07
120	600886	国投电力	7,300	79,059.00	0.07
121	600188	兖矿能源	2,300	77,234.00	0.07
122	600741	华域汽车	4,100	71,053.00	0.06
123	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.06
124	601618	中国中冶	20,300	64,554.00	0.06

125	601800	中国交建	7,400	59,570.00	0.05
126	003816	中国广核	21,200	57,028.00	0.05
127	601319	中国人保	9,600	50,112.00	0.04
128	600018	上港集团	9,100	48,594.00	0.04
129	000708	中信特钢	2,500	42,900.00	0.04
130	601898	中煤能源	4,800	41,376.00	0.04
131	601881	中国银河	4,100	38,089.00	0.03
132	600025	华能水电	5,600	36,960.00	0.03
133	000617	中油资本	6,600	36,762.00	0.03
134	000877	天山股份	4,200	35,784.00	0.03
135	688525	佰维存储	1,938	29,593.26	0.03
136	300800	力合科技	12	139.68	0.00
137	002217	合力泰	45	114.75	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	23,237,613.27	215.03
2	601318	中国平安	16,365,914.16	151.44
3	600036	招商银行	14,605,290.00	135.15
4	601166	兴业银行	12,166,686.00	112.59
5	000333	美的集团	11,668,640.00	107.98
6	300750	宁德时代	11,620,051.68	107.53
7	000651	格力电器	8,628,468.00	79.84
8	601398	工商银行	8,382,025.00	77.56
9	601012	隆基绿能	8,056,632.64	74.55
10	000858	五粮液	7,481,694.00	69.23
11	000001	平安银行	7,186,683.00	66.50
12	600900	长江电力	7,105,103.00	65.75
13	603259	药明康德	6,927,114.22	64.10
14	601328	交通银行	6,476,158.00	59.93
15	000568	泸州老窖	6,242,661.00	57.77
16	600887	伊利股份	6,147,338.00	56.88
17	000002	万科A	6,095,908.00	56.41
18	600030	中信证券	6,090,164.50	56.36
19	002594	比亚迪	5,500,803.00	50.90
20	000898	鞍钢股份	5,471,393.00	50.63
21	601888	中国中免	5,183,302.00	47.96
22	601919	中远海控	5,098,506.00	47.18
23	000627	天茂集团	4,832,531.00	44.72
24	000725	京东方A	4,691,203.00	43.41

25	600438	通威股份	4,628,362.00	42.83
26	601939	建设银行	4,567,849.86	42.27
27	601699	潞安环能	4,433,699.00	41.03
28	300059	东方财富	4,408,392.52	40.79
29	600016	民生银行	4,251,636.00	39.34
30	600000	浦发银行	4,219,886.00	39.05
31	600276	恒瑞医药	4,148,490.84	38.39
32	601601	中国太保	4,092,155.00	37.87
33	600309	万华化学	4,045,566.00	37.44
34	600089	特变电工	4,003,281.00	37.04
35	600019	宝钢股份	3,999,447.00	37.01
36	601077	渝农商行	3,965,411.00	36.69
37	601899	紫金矿业	3,950,791.00	36.56
38	601577	长沙银行	3,948,429.00	36.54
39	000789	万年青	3,943,349.11	36.49
40	688123	聚辰股份	3,932,168.51	36.39
41	000932	华菱钢铁	3,850,618.00	35.63
42	601628	中国人寿	3,825,925.00	35.40
43	600997	开滦股份	3,825,100.00	35.40
44	600985	淮北矿业	3,722,950.00	34.45
45	601319	中国人保	3,696,165.00	34.20
46	300760	迈瑞医疗	3,652,388.00	33.80
47	600546	山煤国际	3,642,396.01	33.71
48	601857	中国石油	3,602,092.00	33.33
49	600048	保利发展	3,524,169.00	32.61
50	002475	立讯精密	3,516,316.00	32.54
51	601988	中国银行	3,496,730.00	32.36
52	601668	中国建筑	3,393,416.00	31.40
53	002352	顺丰控股	3,358,003.00	31.07
54	300014	亿纬锂能	3,346,970.00	30.97
55	002938	鹏鼎控股	3,288,568.22	30.43
56	601997	贵阳银行	3,276,665.00	30.32
57	002714	牧原股份	3,273,711.20	30.29
58	600015	华夏银行	3,213,892.00	29.74
59	000830	鲁西化工	3,162,000.66	29.26
60	600028	中国石化	3,117,899.00	28.85
61	601229	上海银行	3,097,698.00	28.66
62	002415	海康威视	3,064,660.00	28.36
63	600782	新钢股份	3,059,256.00	28.31
64	300124	汇川技术	3,005,219.00	27.81
65	601088	中国神华	2,988,598.00	27.66
66	603659	璞泰来	2,885,456.00	26.70
67	605060	联德股份	2,863,926.00	26.50

68	002311	海大集团	2,842,363.00	26.30
69	002807	江阴银行	2,838,365.00	26.26
70	000906	浙商中拓	2,837,899.20	26.26
71	000069	华侨城 A	2,826,253.00	26.15
72	601898	中煤能源	2,821,614.00	26.11
73	000959	首钢股份	2,794,931.00	25.86
74	002966	苏州银行	2,790,945.30	25.83
75	002936	郑州银行	2,778,808.00	25.71
76	002304	洋河股份	2,769,036.00	25.62
77	002133	广宇集团	2,758,037.00	25.52
78	002948	青岛银行	2,719,598.00	25.17
79	000717	中南股份	2,622,933.00	24.27
80	000937	冀中能源	2,599,691.00	24.06
81	002466	天齐锂业	2,594,932.00	24.01
82	002839	张家港行	2,592,755.40	23.99
83	000617	中油资本	2,582,331.53	23.90
84	600809	山西汾酒	2,523,700.00	23.35
85	000666	经纬纺机	2,495,531.00	23.09
86	000761	本钢板材	2,493,777.00	23.08
87	000926	福星股份	2,483,063.00	22.98
88	601666	平煤股份	2,439,030.00	22.57
89	002821	凯莱英	2,305,352.00	21.33
90	001872	招商港口	2,299,224.00	21.28
91	601998	中信银行	2,271,105.00	21.02
92	002709	天赐材料	2,268,294.62	20.99
93	002310	东方园林	2,247,064.00	20.79
94	000960	锡业股份	2,217,464.30	20.52
95	601618	中国中冶	2,188,995.00	20.26
96	600919	江苏银行	2,161,143.00	20.00
97	601678	滨化股份	2,142,256.00	19.82
98	000039	中集集团	2,130,812.40	19.72
99	000560	我爱我家	2,089,741.00	19.34
100	600097	开创国际	2,061,717.00	19.08
101	300450	先导智能	2,053,422.00	19.00
102	002460	赣锋锂业	2,046,860.00	18.94
103	603799	华友钴业	1,990,838.00	18.42
104	603392	万泰生物	1,985,618.60	18.37
105	002085	万丰奥威	1,978,521.00	18.31
106	600050	中国联通	1,913,867.00	17.71
107	002142	宁波银行	1,903,487.70	17.61
108	601766	中国中车	1,901,473.00	17.60
109	300316	晶盛机电	1,894,088.55	17.53
110	600808	马钢股份	1,864,219.00	17.25

111	600160	巨化股份	1,852,662.40	17.14
112	300910	瑞丰新材	1,848,806.00	17.11
113	000825	太钢不锈	1,844,887.00	17.07
114	601238	广汽集团	1,840,631.00	17.03
115	000776	广发证券	1,797,117.00	16.63
116	600256	广汇能源	1,788,981.00	16.55
117	601818	光大银行	1,764,747.00	16.33
118	300502	新易盛	1,755,107.00	16.24
119	605077	华康股份	1,738,585.00	16.09
120	300761	立华股份	1,729,055.00	16.00
121	000913	钱江摩托	1,724,647.00	15.96
122	600585	海螺水泥	1,716,009.00	15.88
123	301004	嘉益股份	1,699,894.00	15.73
124	603565	中谷物流	1,696,741.56	15.70
125	300532	今天国际	1,694,468.00	15.68
126	600176	中国巨石	1,694,378.00	15.68
127	300575	中旗股份	1,684,768.00	15.59
128	000895	双汇发展	1,684,337.07	15.59
129	603035	常熟汽饰	1,681,755.00	15.56
130	002959	小熊电器	1,680,868.00	15.55
131	605108	同庆楼	1,672,026.40	15.47
132	002982	湘佳股份	1,668,914.00	15.44
133	688298	东方生物	1,665,922.20	15.42
134	601816	京沪高铁	1,658,517.00	15.35
135	300298	三诺生物	1,644,883.68	15.22
136	600141	兴发集团	1,640,688.00	15.18
137	603933	睿能科技	1,633,897.00	15.12
138	600273	嘉化能源	1,616,497.00	14.96
139	688800	瑞可达	1,593,438.07	14.74
140	300150	世纪瑞尔	1,587,827.00	14.69
141	300514	友讯达	1,587,691.00	14.69
142	603006	黎明股份	1,569,779.00	14.53
143	603773	沃格光电	1,544,741.00	14.29
144	603986	兆易创新	1,527,770.00	14.14
145	600854	春兰股份	1,521,538.00	14.08
146	601390	中国中铁	1,521,213.00	14.08
147	002129	TCL 中环	1,517,426.00	14.04
148	600406	国电南瑞	1,508,933.80	13.96
149	000983	山西焦煤	1,505,712.00	13.93
150	603527	众源新材	1,497,937.00	13.86
151	601225	陕西煤业	1,492,610.00	13.81
152	603926	铁流股份	1,484,029.20	13.73
153	003040	楚天龙	1,465,587.84	13.56

154	300856	科思股份	1,448,715.00	13.41
155	605183	确成股份	1,447,988.00	13.40
156	002132	恒星科技	1,444,354.00	13.37
157	002615	哈尔斯	1,435,432.00	13.28
158	600966	博汇纸业	1,432,176.13	13.25
159	001979	招商蛇口	1,427,998.00	13.21
160	603288	海天味业	1,424,315.00	13.18
161	603706	东方环宇	1,414,682.00	13.09
162	600389	江山股份	1,411,608.00	13.06
163	000625	长安汽车	1,401,465.00	12.97
164	002049	紫光国微	1,391,655.80	12.88
165	600104	上汽集团	1,383,784.00	12.80
166	600153	建发股份	1,376,309.00	12.74
167	603214	爱婴室	1,374,925.00	12.72
168	601825	沪农商行	1,374,041.00	12.71
169	603696	安记食品	1,373,725.00	12.71
170	601688	华泰证券	1,373,055.00	12.71
171	600282	南钢股份	1,366,385.00	12.64
172	601985	中国核电	1,361,639.00	12.60
173	688112	鼎阳科技	1,356,702.58	12.55
174	600018	上港集团	1,336,311.00	12.37
175	000048	京基智农	1,333,037.00	12.34
176	002394	联发股份	1,332,068.00	12.33
177	001206	依依股份	1,330,792.60	12.31
178	600761	安徽合力	1,328,045.00	12.29
179	300390	天华超净	1,319,317.00	12.21
180	601669	中国电建	1,316,064.00	12.18
181	600031	三一重工	1,293,805.00	11.97
182	601186	中国铁建	1,286,469.00	11.90
183	000707	双环科技	1,266,998.12	11.72
184	600188	兖矿能源	1,266,658.00	11.72
185	600873	梅花生物	1,248,856.00	11.56
186	300275	梅安森	1,246,947.00	11.54
187	601009	南京银行	1,222,247.00	11.31
188	688518	联赢激光	1,221,641.59	11.30
189	688005	容百科技	1,213,713.62	11.23
190	601086	国芳集团	1,213,595.00	11.23
191	600697	欧亚集团	1,207,471.28	11.17
192	300515	三德科技	1,206,865.00	11.17
193	605117	德业股份	1,189,830.00	11.01
194	601211	国泰君安	1,189,673.00	11.01
195	002340	格林美	1,176,537.00	10.89
196	300498	温氏股份	1,166,465.00	10.79

197	300073	当升科技	1,160,730.00	10.74
198	600033	福建高速	1,157,583.00	10.71
199	000951	中国重汽	1,156,263.00	10.70
200	600928	西安银行	1,156,238.00	10.70
201	300371	汇中股份	1,149,426.00	10.64
202	002722	物产金轮	1,146,663.00	10.61
203	601928	凤凰传媒	1,142,412.00	10.57
204	600508	上海能源	1,139,421.00	10.54
205	300769	德方纳米	1,138,632.00	10.54
206	600596	新安股份	1,135,291.00	10.51
207	002179	中航光电	1,135,004.00	10.50
208	601728	中国电信	1,133,847.00	10.49
209	002381	双箭股份	1,131,544.00	10.47
210	003019	宸展光电	1,122,959.10	10.39
211	601658	邮储银行	1,105,495.00	10.23
212	603156	养元饮品	1,104,913.00	10.22
213	600909	华安证券	1,100,909.40	10.19
214	003816	中国广核	1,099,773.00	10.18
215	002855	捷荣技术	1,099,634.00	10.18
216	002649	博彦科技	1,097,440.00	10.16
217	600893	航发动力	1,095,038.00	10.13
218	000422	湖北宜化	1,079,001.99	9.98
219	002270	华明装备	1,076,487.00	9.96
220	000100	TCL 科技	1,057,767.00	9.79
221	000166	申万宏源	1,057,402.00	9.78
222	300268	佳沃食品	1,049,465.00	9.71
223	688590	新致软件	1,046,299.81	9.68
224	600436	片仔癀	1,038,728.00	9.61
225	603368	柳药集团	1,032,987.00	9.56
226	603937	丽岛新材	1,026,159.00	9.50
227	601991	大唐发电	1,022,981.84	9.47
228	603788	宁波高发	1,020,194.00	9.44
229	002869	金溢科技	1,002,916.00	9.28
230	688019	安集科技	996,882.18	9.22
231	301042	安联锐视	990,515.53	9.17
232	002582	好想你	983,244.00	9.10
233	002811	郑中设计	982,811.00	9.09
234	600233	圆通速递	976,362.00	9.03
235	600623	华谊集团	969,905.00	8.98
236	603290	斯达半导	964,367.00	8.92
237	301035	润丰股份	964,247.00	8.92
238	688335	复洁环保	963,921.67	8.92
239	601838	成都银行	960,076.00	8.88

240	600057	厦门象屿	959,446.00	8.88
241	600075	新疆天业	956,918.00	8.85
242	002756	永兴材料	951,827.00	8.81
243	688025	杰普特	950,286.06	8.79
244	300568	星源材质	942,950.48	8.73
245	688981	中芯国际	942,256.17	8.72
246	002920	德赛西威	938,265.00	8.68
247	300833	浩洋股份	935,671.00	8.66
248	300274	阳光电源	934,391.00	8.65
249	600690	海尔智家	934,176.00	8.64
250	603086	先达股份	933,014.00	8.63
251	000933	神火股份	919,545.00	8.51
252	000425	徐工机械	915,905.00	8.48
253	600449	宁夏建材	915,117.00	8.47
254	603129	春风动力	912,182.00	8.44
255	002497	雅化集团	911,549.00	8.44
256	601339	百隆东方	908,929.00	8.41
257	000519	中兵红箭	899,687.00	8.33
258	002405	四维图新	891,365.00	8.25
259	603327	福蓉科技	891,143.00	8.25
260	603928	兴业股份	887,913.00	8.22
261	000792	盐湖股份	883,224.00	8.17
262	002687	乔治白	882,655.00	8.17
263	603886	元祖股份	881,786.00	8.16
264	603080	新疆火炬	877,770.00	8.12
265	600581	八一钢铁	875,283.60	8.10
266	600547	山东黄金	871,650.00	8.07
267	300505	川金诺	864,390.00	8.00
268	603767	中马传动	857,006.00	7.93
269	601117	中国化学	855,674.00	7.92
270	600308	华泰股份	851,306.00	7.88
271	603871	嘉友国际	848,942.90	7.86
272	603379	三美股份	846,395.00	7.83
273	600073	上海梅林	843,408.00	7.80
274	601800	中国交建	838,297.00	7.76
275	002738	中矿资源	834,946.20	7.73
276	600064	南京高科	834,414.00	7.72
277	300557	理工光科	833,261.00	7.71
278	600750	江中药业	830,352.00	7.68
279	603139	康惠制药	827,734.00	7.66
280	600232	金鹰股份	824,343.00	7.63
281	002066	瑞泰科技	823,216.00	7.62
282	002371	北方华创	821,914.00	7.61

283	688099	晶晨股份	820,268.75	7.59
284	300041	回天新材	820,237.00	7.59
285	002240	盛新锂能	819,696.00	7.59
286	688685	迈信林	816,415.54	7.55
287	600111	北方稀土	812,588.00	7.52
288	300363	博腾股份	812,477.00	7.52
289	002636	金安国纪	803,801.00	7.44
290	688260	昀冢科技	803,088.39	7.43
291	301020	密封科技	802,135.00	7.42
292	688079	美迪凯	801,406.31	7.42
293	002410	广联达	792,703.00	7.34
294	603529	爱玛科技	790,661.00	7.32
295	601900	南方传媒	790,207.00	7.31
296	002696	百洋股份	787,027.00	7.28
297	601158	重庆水务	786,929.00	7.28
298	600328	中盐化工	785,362.00	7.27
299	000733	振华科技	784,978.00	7.26
300	605399	晨光新材	781,743.00	7.23
301	601231	环旭电子	780,373.00	7.22
302	300639	凯普生物	778,819.00	7.21
303	603599	广信股份	778,486.00	7.20
304	002459	晶澳科技	772,093.00	7.14
305	000880	潍柴重机	771,725.00	7.14
306	603093	南华期货	768,218.00	7.11
307	603515	欧普照明	766,161.00	7.09
308	002963	豪尔赛	761,754.00	7.05
309	600356	恒丰纸业	758,778.00	7.02
310	300800	力合科技	753,734.68	6.97
311	600168	武汉控股	753,112.00	6.97
312	000828	东莞控股	750,501.00	6.94
313	002927	泰永长征	750,219.00	6.94
314	600939	重庆建工	749,948.00	6.94
315	603256	宏和科技	747,612.10	6.92
316	000685	中山公用	747,212.00	6.91
317	300122	智飞生物	746,949.00	6.91
318	002217	合力泰	746,082.85	6.90
319	002110	三钢闽光	743,433.00	6.88
320	601138	工业富联	738,597.00	6.83
321	300604	长川科技	733,933.00	6.79
322	300192	科德教育	732,836.00	6.78
323	688010	福光股份	732,309.05	6.78
324	002812	恩捷股份	731,444.00	6.77
325	300398	飞凯材料	730,283.00	6.76

326	603017	中衡设计	727,649.00	6.73
327	300294	博雅生物	727,048.00	6.73
328	300389	艾比森	725,569.00	6.71
329	600236	桂冠电力	721,962.00	6.68
330	600183	生益科技	721,210.50	6.67
331	601001	晋控煤业	720,768.00	6.67
332	601006	大秦铁路	718,330.00	6.65
333	600741	华域汽车	717,358.00	6.64
334	002826	易明医药	714,983.00	6.62
335	600128	弘业股份	707,966.00	6.55
336	000921	海信家电	707,727.00	6.55
337	688399	硕世生物	707,369.26	6.55
338	688329	艾隆科技	705,733.32	6.53
339	000402	金融街	704,411.00	6.52
340	002202	金风科技	700,838.00	6.49
341	601169	北京银行	696,003.00	6.44
342	603613	国联股份	693,469.00	6.42
343	002774	快意电梯	693,360.11	6.42
344	000498	山东路桥	692,381.00	6.41
345	300196	长海股份	682,439.00	6.31
346	603355	莱克电气	682,390.00	6.31
347	688599	天合光能	681,905.80	6.31
348	603217	元利科技	673,977.00	6.24
349	002367	康力电梯	672,724.00	6.23
350	002271	东方雨虹	671,227.00	6.21
351	600694	大商股份	661,844.00	6.12
352	300438	鹏辉能源	655,781.00	6.07
353	601916	浙商银行	655,016.00	6.06
354	600958	东方证券	654,523.64	6.06
355	600662	外服控股	650,630.00	6.02
356	002192	融捷股份	649,729.00	6.01
357	600837	海通证券	649,261.00	6.01
358	000063	中兴通讯	649,154.00	6.01
359	603198	迎驾贡酒	648,712.00	6.00
360	002705	新宝股份	648,233.00	6.00
361	603501	韦尔股份	647,548.00	5.99
362	603026	胜华新材	642,609.00	5.95
363	600746	江苏索普	640,032.00	5.92
364	000553	安道麦 A	637,931.00	5.90
365	600863	内蒙华电	634,865.00	5.87
366	600481	双良节能	630,643.00	5.84
367	002624	完美世界	628,109.00	5.81
368	300015	爱尔眼科	627,448.00	5.81

369	688268	华特气体	626,288.30	5.80
370	000596	古井贡酒	625,819.00	5.79
371	603790	雅运股份	624,968.27	5.78
372	603516	淳中科技	623,584.00	5.77
373	000708	中信特钢	623,436.00	5.77
374	600039	四川路桥	622,488.00	5.76
375	603903	中持股份	618,607.00	5.72
376	600507	方大特钢	616,121.00	5.70
377	600060	海信视像	615,135.00	5.69
378	002057	中钢天源	614,815.00	5.69
379	603968	醋化股份	614,274.00	5.68
380	603289	泰瑞机器	609,166.00	5.64
381	300601	康泰生物	606,273.20	5.61
382	688196	卓越新能	605,760.42	5.61
383	603993	洛阳钼业	605,055.00	5.60
384	002322	理工能科	600,558.00	5.56
385	000716	黑芝麻	598,124.00	5.53
386	600271	航天信息	597,715.00	5.53
387	603127	昭衍新药	597,312.00	5.53
388	000985	大庆华科	595,553.00	5.51
389	603920	世运电路	592,495.00	5.48
390	300260	新莱应材	590,366.32	5.46
391	300661	圣邦股份	584,268.00	5.41
392	600639	浦东金桥	584,246.00	5.41
393	002166	莱茵生物	584,078.00	5.40
394	300650	太龙股份	581,496.00	5.38
395	600740	山西焦化	579,860.00	5.37
396	600148	长春一东	578,536.00	5.35
397	600926	杭州银行	578,371.00	5.35
398	301045	天禄科技	571,931.00	5.29
399	300741	华宝股份	570,954.00	5.28
400	600905	三峡能源	566,663.00	5.24
401	601872	招商轮船	564,478.00	5.22
402	600833	第一医药	564,044.00	5.22
403	002566	益盛药业	562,149.00	5.20
404	600710	苏美达	559,369.00	5.18
405	002597	金禾实业	559,029.00	5.17
406	002557	洽洽食品	558,557.00	5.17
407	300106	西部矿业	556,297.00	5.15
408	300970	华绿生物	546,903.00	5.06
409	600760	中航沈飞	543,788.00	5.03
410	000538	云南白药	542,886.00	5.02
411	600901	江苏金租	541,144.00	5.01

412	002315	焦点科技	536,623.00	4.97
413	002913	奥士康	527,443.00	4.88
414	688567	孚能科技	526,455.91	4.87
415	600346	恒力石化	525,499.00	4.86
416	605100	华丰股份	525,462.60	4.86
417	603011	合锻智能	525,037.00	4.86
418	002441	众业达	524,532.00	4.85
419	603050	科林电气	523,824.00	4.85
420	688008	澜起科技	517,219.68	4.79
421	002241	歌尔股份	512,644.00	4.74
422	600522	中天科技	511,477.00	4.73
423	000338	潍柴动力	509,398.00	4.71
424	603517	绝味食品	509,298.00	4.71
425	002045	国光电器	508,406.00	4.70
426	002841	视源股份	506,459.00	4.69
427	603882	金域医学	506,103.00	4.68
428	600392	盛和资源	504,496.00	4.67
429	603578	三星新材	502,296.80	4.65
430	002027	分众传媒	502,283.13	4.65
431	300432	富临精工	499,491.00	4.62
432	688118	普元信息	498,656.49	4.61
433	300861	美畅股份	497,405.00	4.60
434	000030	富奥股份	496,286.00	4.59
435	603676	卫信康	496,058.00	4.59
436	002806	华锋股份	494,407.00	4.58
437	603079	圣达生物	493,790.00	4.57
438	300583	赛托生物	492,250.00	4.56
439	603868	飞科电器	491,816.00	4.55
440	000020	深华发A	491,710.00	4.55
441	002884	凌霄泵业	491,104.00	4.54
442	300570	太辰光	490,564.00	4.54
443	300462	华铭智能	489,609.00	4.53
444	603444	吉比特	489,319.00	4.53
445	688004	博汇科技	487,334.48	4.51
446	300768	迪普科技	484,146.62	4.48
447	688617	惠泰医疗	482,126.23	4.46
448	002159	三特索道	481,746.00	4.46
449	688575	亚辉龙	481,186.80	4.45
450	600570	恒生电子	480,369.00	4.45
451	600150	中国船舶	475,801.00	4.40
452	300142	沃森生物	474,945.00	4.39
453	601336	新华保险	473,786.00	4.38
454	603876	鼎胜新材	473,715.00	4.38

455	600745	闻泰科技	473,237.00	4.38
456	600319	亚星化学	469,311.00	4.34
457	002555	三七互娱	466,973.00	4.32
458	002337	赛象科技	466,478.00	4.32
459	002955	鸿合科技	465,283.00	4.31
460	000415	渤海租赁	464,821.00	4.30
461	603037	凯众股份	460,298.20	4.26
462	000910	大亚圣象	459,754.00	4.25
463	600010	包钢股份	458,580.00	4.24
464	002230	科大讯飞	458,294.00	4.24
465	300820	英杰电气	457,311.50	4.23
466	603906	龙蟠科技	456,193.00	4.22
467	300628	亿联网络	455,799.22	4.22
468	000719	中原传媒	452,639.00	4.19
469	600426	华鲁恒升	452,126.00	4.18
470	000548	湖南投资	451,441.00	4.18
471	600582	天地科技	451,135.00	4.17
472	000421	南京公用	450,114.00	4.17
473	603677	奇精机械	448,695.00	4.15
474	600886	国投电力	446,861.00	4.14
475	002601	龙佰集团	446,540.00	4.13
476	002493	荣盛石化	446,030.00	4.13
477	300640	德艺文创	445,939.00	4.13
478	600051	宁波联合	445,239.00	4.12
479	300025	华星创业	444,959.66	4.12
480	603369	今世缘	444,627.00	4.11
481	600202	哈空调	442,901.00	4.10
482	300003	乐普医疗	442,648.00	4.10
483	601633	长城汽车	440,824.00	4.08
484	600348	华阳股份	439,844.00	4.07
485	002815	崇达技术	439,074.00	4.06
486	002591	恒大高新	438,798.00	4.06
487	601717	郑煤机	437,866.00	4.05
488	688111	金山办公	436,437.00	4.04
489	603115	海星股份	436,077.00	4.04
490	300652	雷迪克	435,809.00	4.03
491	000012	南玻A	433,072.00	4.01
492	002737	葵花药业	428,863.00	3.97
493	000153	丰原药业	427,877.00	3.96
494	000157	中联重科	423,816.00	3.92
495	600196	复星医药	421,774.00	3.90
496	600875	东方电气	420,394.00	3.89
497	600085	同仁堂	418,433.00	3.87

498	300239	东宝生物	417,132.00	3.86
499	601066	中信建投	411,739.00	3.81
500	688393	安必平	410,420.71	3.80
501	688012	中微公司	409,688.31	3.79
502	600096	云天化	408,077.00	3.78
503	300635	中达安	407,602.00	3.77
504	600235	民丰特纸	406,864.00	3.76
505	000963	华东医药	406,234.00	3.76
506	601600	中国铝业	406,084.00	3.76
507	300399	天利科技	405,433.00	3.75
508	601377	兴业证券	405,257.00	3.75
509	688669	聚石化学	404,865.86	3.75
510	300992	泰福泵业	404,697.00	3.74
511	300231	银信科技	403,964.00	3.74
512	000408	藏格矿业	403,380.00	3.73
513	603456	九洲药业	402,733.00	3.73
514	300035	中科电气	402,504.00	3.72
515	603260	合盛硅业	401,395.00	3.71
516	002608	江苏国信	399,973.69	3.70
517	002718	友邦吊顶	399,670.00	3.70
518	600444	国机通用	398,421.00	3.69
519	000630	铜陵有色	397,770.00	3.68
520	300668	杰恩设计	395,689.00	3.66
521	1928	金沙中国有 限公司	395,506.89	3.66
522	000521	长虹美菱	395,063.00	3.66
523	300349	金卡智能	392,546.00	3.63
524	600678	四川金顶	385,849.00	3.57
525	601901	方正证券	384,516.00	3.56
526	000661	长春高新	383,578.00	3.55
527	300387	富邦股份	382,570.00	3.54
528	300042	朗科科技	382,080.00	3.54
529	600660	福耀玻璃	380,541.00	3.52
530	000019	深粮控股	379,590.00	3.51
531	300763	锦浪科技	378,473.00	3.50
532	300703	创源股份	378,031.00	3.50
533	688516	奥特维	377,143.52	3.49
534	300461	田中精机	376,130.00	3.48
535	002376	新北洋	373,637.00	3.46
536	603929	亚翔集成	371,529.00	3.44
537	603612	索通发展	371,111.48	3.43
538	300782	卓胜微	370,415.00	3.43
539	000786	北新建材	370,409.00	3.43

540	603668	天马科技	368,898.00	3.41
541	603656	泰禾智能	368,853.00	3.41
542	300347	泰格医药	368,058.00	3.41
543	002921	联诚精密	366,999.00	3.40
544	002278	神开股份	365,742.00	3.38
545	000768	中航西飞	365,245.00	3.38
546	000552	靖远煤电	364,388.00	3.37
547	603585	苏利股份	363,803.00	3.37
548	301006	迈拓股份	363,640.00	3.36
549	605358	立昂微	362,153.00	3.35
550	300146	汤臣倍健	361,229.00	3.34
551	301022	海泰科	359,813.43	3.33
552	603697	有友食品	359,665.00	3.33
553	605081	太和水	359,324.50	3.33
554	600243	青海华鼎	358,384.00	3.32
555	603077	和邦生物	358,294.00	3.32
556	300611	美力科技	357,931.00	3.31
557	000090	天健集团	357,286.00	3.31
558	002521	齐峰新材	356,198.00	3.30
559	6818	中国光大银行	355,880.47	3.29
560	688556	高测股份	354,146.67	3.28
561	002545	东方铁塔	353,712.00	3.27
562	000997	新大陆	353,539.00	3.27
563	601958	金钼股份	353,272.00	3.27
564	603908	牧高笛	349,127.00	3.23
565	300327	中颖电子	348,936.00	3.23
566	603518	锦泓集团	348,474.00	3.22
567	603866	桃李面包	348,087.00	3.22
568	002895	川恒股份	347,032.00	3.21
569	301007	德迈仕	345,328.00	3.20
570	2007	碧桂园	344,940.84	3.19
571	002835	同为股份	344,274.00	3.19
572	600584	长电科技	343,464.00	3.18
573	002539	云图控股	343,316.00	3.18
574	601116	三江购物	342,232.00	3.17
575	300896	爱美客	341,145.00	3.16
576	002105	信隆健康	340,915.00	3.15
577	002484	江海股份	340,294.00	3.15
578	603161	科华控股	338,504.00	3.13
579	002091	江苏国泰	337,098.00	3.12
580	600261	阳光照明	336,601.98	3.11
581	605178	时空科技	335,040.00	3.10

582	000729	燕京啤酒	333,848.00	3.09
583	600888	新疆众和	331,308.00	3.07
584	603238	诺邦股份	331,183.95	3.06
585	002865	钧达股份	330,952.00	3.06
586	300037	新宙邦	330,637.00	3.06
587	600551	时代出版	330,553.00	3.06
588	600588	用友网络	329,152.00	3.05
589	600598	北大荒	329,085.00	3.05
590	603700	宁水集团	328,219.00	3.04
591	002080	中材科技	327,707.00	3.03
592	000970	中科三环	325,169.00	3.01
593	300716	国立科技	321,928.50	2.98
594	002236	大华股份	321,336.00	2.97
595	002881	美格智能	320,996.00	2.97
596	603589	口子窖	320,497.00	2.97
597	300017	网宿科技	320,472.00	2.97
598	000096	广聚能源	318,307.00	2.95
599	603300	华铁应急	317,932.00	2.94
600	300890	翔丰华	316,365.00	2.93
601	600615	丰华股份	315,897.00	2.92
602	300242	佳云科技	314,446.00	2.91
603	002188	中天服务	313,462.00	2.90
604	600795	国电电力	311,947.00	2.89
605	688122	西部超导	311,580.51	2.88
606	000656	金科股份	311,210.00	2.88
607	603116	红蜻蜓	310,416.80	2.87
608	603819	神力股份	310,307.00	2.87
609	600536	中国软件	310,131.00	2.87
610	002299	圣农发展	306,722.00	2.84
611	000050	深天马 A	305,108.00	2.82
612	601788	光大证券	303,743.00	2.81
613	600368	五洲交通	303,386.00	2.81
614	688598	金博股份	303,311.00	2.81
615	688069	德林海	303,236.64	2.81
616	603258	电魂网络	302,258.00	2.80
617	300496	中科创达	302,182.00	2.80
618	600035	楚天高速	301,268.00	2.79
619	000526	学大教育	300,344.00	2.78
620	600499	科达制造	298,122.00	2.76
621	000822	山东海化	298,111.00	2.76
622	605009	豪悦护理	298,041.00	2.76
623	600452	涪陵电力	297,845.00	2.76
624	603839	安正时尚	297,001.00	2.75

625	603030	全筑股份	296,152.00	2.74
626	601886	江河集团	295,607.00	2.74
627	300069	金利华电	295,013.00	2.73
628	600132	重庆啤酒	293,440.00	2.72
629	600998	九州通	293,323.00	2.71
630	002809	红墙股份	291,911.00	2.70
631	600009	上海机场	291,809.00	2.70
632	002850	科达利	290,395.00	2.69
633	603486	科沃斯	290,352.00	2.69
634	600780	通宝能源	290,077.00	2.68
635	002024	ST 易购	288,052.00	2.67
636	300211	亿通科技	287,285.13	2.66
637	000667	美好置业	286,860.00	2.65
638	600409	三友化工	286,801.00	2.65
639	600027	华电国际	285,344.00	2.64
640	300562	乐心医疗	284,668.00	2.63
641	000046	泛海控股	283,033.00	2.62
642	603898	好莱客	282,935.00	2.62
643	600778	友好集团	280,273.00	2.59
644	601566	九牧王	280,272.00	2.59
645	300433	蓝思科技	280,094.00	2.59
646	600571	信雅达	278,898.00	2.58
647	000877	天山股份	278,653.00	2.58
648	603757	大元泵业	273,977.00	2.54
649	600295	鄂尔多斯	273,904.00	2.53
650	000066	中国长城	272,889.00	2.53
651	000301	东方盛虹	272,878.13	2.53
652	603661	恒林股份	272,810.00	2.52
653	300625	三雄极光	270,613.00	2.50
654	688396	华润微	269,309.23	2.49
655	002746	仙坛股份	268,798.00	2.49
656	603003	龙宇燃油	268,757.00	2.49
657	300170	汉得信息	268,532.00	2.48
658	002605	姚记科技	267,875.00	2.48
659	300803	指南针	267,424.00	2.47
660	300789	唐源电气	266,818.00	2.47
661	002661	克明食品	266,650.00	2.47
662	002013	中航机电	266,383.00	2.46
663	002258	利尔化学	264,121.00	2.44
664	601881	中国银河	261,976.00	2.42
665	603328	依顿电子	261,395.00	2.42
666	600791	京能置业	260,884.00	2.41
667	600011	华能国际	260,218.00	2.41

668	300127	银河磁体	259,274.00	2.40
669	300259	新天科技	258,931.00	2.40
670	600821	金开新能	255,739.00	2.37
671	603508	思维列控	254,804.00	2.36
672	002482	ST 广田	254,320.00	2.35
673	002216	三全食品	253,830.00	2.35
674	603001	奥康国际	252,992.00	2.34
675	600352	浙江龙盛	251,627.00	2.33
676	002048	宁波华翔	251,502.00	2.33
677	002407	多氟多	250,897.00	2.32
678	600004	白云机场	250,771.00	2.32
679	600398	海澜之家	249,712.00	2.31
680	603090	宏盛股份	249,470.00	2.31
681	300130	新国都	248,738.00	2.30
682	300759	康龙化成	247,306.92	2.29
683	000400	许继电气	246,880.00	2.28
684	601868	中国能建	246,435.00	2.28
685	000629	钒钛股份	244,707.00	2.26
686	000988	华工科技	244,179.00	2.26
687	002787	华源控股	241,769.00	2.24
688	600729	重庆百货	241,075.00	2.23
689	002576	通达动力	241,001.00	2.23
690	601989	中国重工	240,944.00	2.23
691	300158	振东制药	240,067.00	2.22
692	603806	福斯特	239,382.00	2.22
693	002563	森马服饰	239,249.00	2.21
694	688200	华峰测控	238,958.20	2.21
695	600421	华嵘控股	238,461.00	2.21
696	601995	中金公司	238,418.00	2.21
697	003006	百亚股份	237,314.00	2.20
698	600929	雪天盐业	237,001.00	2.19
699	600810	神马股份	236,009.00	2.18
700	600486	扬农化工	235,703.00	2.18
701	300112	万讯自控	234,859.00	2.17
702	600742	一汽富维	233,685.00	2.16
703	002577	雷柏科技	232,541.00	2.15
704	000977	浪潮信息	232,087.00	2.15
705	300223	北京君正	231,292.00	2.14
706	002932	明德生物	231,135.00	2.14
707	000810	创维数字	231,067.00	2.14
708	600720	祁连山	229,175.00	2.12
709	601877	正泰电器	228,827.00	2.12
710	002947	恒铭达	228,723.00	2.12

711	603002	宏昌电子	226,686.00	2.10
712	300118	东方日升	226,442.00	2.10
713	603185	上机数控	225,176.00	2.08
714	600879	航天电子	225,082.00	2.08
715	002843	泰嘉股份	224,469.00	2.08
716	002050	三花智控	223,714.00	2.07
717	603688	石英股份	222,460.00	2.06
718	000938	紫光股份	222,144.00	2.06
719	000657	中钨高新	221,610.00	2.05
720	002008	大族激光	221,578.00	2.05
721	002281	光迅科技	220,625.00	2.04
722	003015	日久光电	220,557.00	2.04
723	600600	青岛啤酒	220,176.00	2.04
724	002001	新 和 成	220,027.00	2.04
725	688668	鼎通科技	219,578.60	2.03
726	600845	宝信软件	218,618.48	2.02
727	002176	江特电机	218,548.00	2.02
728	000968	蓝焰控股	217,946.00	2.02
729	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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	17,182,228.00	159.00
2	601318	中国平安	9,335,606.00	86.39
3	000333	美的集团	9,322,556.00	86.27
4	300750	宁德时代	8,806,522.26	81.49
5	601166	兴业银行	8,419,778.00	77.91
6	600036	招商银行	8,347,028.00	77.24
7	601012	隆基绿能	6,343,394.80	58.70
8	000651	格力电器	6,192,508.00	57.30
9	601398	工商银行	5,828,071.00	53.93
10	000898	鞍钢股份	5,502,380.00	50.92
11	000001	平安银行	5,439,024.78	50.33
12	000002	万 科 A	5,069,396.00	46.91
13	603259	药明康德	4,974,717.86	46.03
14	000627	天茂集团	4,942,279.00	45.73
15	601919	中远海控	4,884,840.50	45.20
16	000858	五 粮 液	4,837,070.20	44.76
17	600438	通威股份	4,559,201.18	42.19
18	601939	建设银行	4,449,978.00	41.18
19	000725	京东方 A	4,341,216.00	40.17

20	000568	泸州老窖	4,318,578.10	39.96
21	002594	比亚迪	4,304,486.00	39.83
22	601328	交通银行	4,292,313.00	39.72
23	601601	中国太保	4,090,013.00	37.85
24	601628	中国人寿	4,055,659.85	37.53
25	600089	特变电工	4,010,143.00	37.11
26	601577	长沙银行	3,993,707.00	36.96
27	000789	万年青	3,991,315.10	36.93
28	600900	长江电力	3,937,526.00	36.44
29	000932	华菱钢铁	3,932,734.00	36.39
30	601699	潞安环能	3,929,697.00	36.36
31	601077	渝农商行	3,926,820.00	36.34
32	600019	宝钢股份	3,904,506.00	36.13
33	600997	开滦股份	3,852,062.00	35.65
34	601319	中国人保	3,842,906.00	35.56
35	600887	伊利股份	3,825,806.00	35.40
36	600030	中信证券	3,719,117.15	34.42
37	600985	淮北矿业	3,700,886.00	34.25
38	600546	山煤国际	3,614,535.00	33.45
39	688123	聚辰股份	3,507,282.11	32.45
40	601857	中国石油	3,408,645.00	31.54
41	601988	中国银行	3,359,506.00	31.09
42	300014	亿纬锂能	3,351,788.00	31.02
43	000830	鲁西化工	3,238,097.00	29.96
44	601997	贵阳银行	3,230,831.00	29.90
45	601668	中国建筑	3,216,069.00	29.76
46	600015	华夏银行	3,160,699.00	29.25
47	600782	新钢股份	3,117,204.00	28.85
48	000617	中油资本	3,083,163.00	28.53
49	000069	华侨城 A	3,081,119.00	28.51
50	601899	紫金矿业	3,053,249.00	28.25
51	601888	中国中免	3,036,162.00	28.10
52	600028	中国石化	3,025,604.00	28.00
53	002133	广宇集团	3,024,981.00	27.99
54	601898	中煤能源	2,942,967.00	27.23
55	603659	璞泰来	2,926,888.00	27.08
56	002807	江阴银行	2,924,106.00	27.06
57	601229	上海银行	2,901,456.00	26.85
58	002966	苏州银行	2,896,589.00	26.80
59	002948	青岛银行	2,882,746.00	26.68
60	601088	中国神华	2,810,491.00	26.01
61	000906	浙商中拓	2,809,316.00	26.00
62	002936	郑州银行	2,801,402.00	25.92

63	000959	首钢股份	2,798,165.80	25.89
64	002311	海大集团	2,774,357.00	25.67
65	002938	鹏鼎控股	2,768,713.00	25.62
66	000926	福星股份	2,734,941.70	25.31
67	002304	洋河股份	2,725,626.00	25.22
68	000666	经纬纺机	2,703,518.00	25.02
69	002839	张家港行	2,647,044.60	24.49
70	000717	中南股份	2,633,975.00	24.37
71	002466	天齐锂业	2,622,126.00	24.26
72	002352	顺丰控股	2,591,237.00	23.98
73	600809	山西汾酒	2,577,174.00	23.85
74	000937	冀中能源	2,570,503.70	23.79
75	000761	本钢板材	2,507,198.00	23.20
76	002415	海康威视	2,506,298.00	23.19
77	600048	保利发展	2,428,382.00	22.47
78	605060	联德股份	2,380,058.00	22.02
79	001872	招商港口	2,328,513.00	21.55
80	601666	平煤股份	2,327,569.00	21.54
81	002709	天赐材料	2,316,214.00	21.43
82	002821	凯莱英	2,291,732.80	21.21
83	002310	东方园林	2,268,146.00	20.99
84	000960	锡业股份	2,242,169.00	20.75
85	000560	我爱我家	2,203,114.00	20.39
86	000039	中集集团	2,182,548.09	20.20
87	601998	中信银行	2,167,659.00	20.06
88	601678	滨化股份	2,155,019.99	19.94
89	300450	先导智能	2,121,755.60	19.63
90	601618	中国中冶	2,115,134.00	19.57
91	300059	东方财富	2,107,033.80	19.50
92	002460	赣锋锂业	2,053,080.00	19.00
93	600000	浦发银行	2,007,327.00	18.57
94	603392	万泰生物	2,001,345.00	18.52
95	300316	晶盛机电	1,998,514.50	18.49
96	600309	万华化学	1,996,165.00	18.47
97	600276	恒瑞医药	1,971,274.00	18.24
98	600097	开创国际	1,952,097.18	18.06
99	002142	宁波银行	1,932,684.50	17.88
100	603799	华友钴业	1,928,594.20	17.85
101	600919	江苏银行	1,926,993.00	17.83
102	600160	巨化股份	1,892,472.20	17.51
103	600808	马钢股份	1,881,273.00	17.41
104	601238	广汽集团	1,876,780.00	17.37
105	600016	民生银行	1,856,251.00	17.18

106	688298	东方生物	1,855,853.74	17.17
107	000825	太钢不锈	1,832,051.00	16.95
108	600050	中国联通	1,813,486.00	16.78
109	601766	中国中车	1,752,211.00	16.21
110	600141	兴发集团	1,686,670.00	15.61
111	600256	广汇能源	1,680,033.00	15.55
112	601818	光大银行	1,664,805.80	15.41
113	600176	中国巨石	1,624,832.44	15.04
114	603773	沃格光电	1,611,545.34	14.91
115	000625	长安汽车	1,610,529.20	14.90
116	600273	嘉化能源	1,609,688.00	14.90
117	000776	广发证券	1,607,201.00	14.87
118	300514	友讯达	1,598,228.00	14.79
119	603933	睿能科技	1,594,066.00	14.75
120	300150	世纪瑞尔	1,591,125.00	14.72
121	603006	黎明股份	1,582,958.00	14.65
122	002475	立讯精密	1,577,020.00	14.59
123	603565	中谷物流	1,572,749.60	14.55
124	300760	迈瑞医疗	1,561,784.00	14.45
125	600153	建发股份	1,554,837.18	14.39
126	600585	海螺水泥	1,533,058.00	14.19
127	000983	山西焦煤	1,521,868.00	14.08
128	600854	春兰股份	1,506,443.00	13.94
129	600406	国电南瑞	1,499,154.00	13.87
130	603527	众源新材	1,495,351.00	13.84
131	603986	兆易创新	1,488,929.00	13.78
132	002129	TCL 中环	1,487,827.00	13.77
133	002085	万丰奥威	1,476,992.00	13.67
134	002615	哈尔斯	1,462,485.50	13.53
135	603288	海天味业	1,454,723.40	13.46
136	603706	东方环宇	1,450,116.00	13.42
137	600966	博汇纸业	1,438,930.00	13.32
138	688800	瑞可达	1,437,694.83	13.30
139	603926	铁流股份	1,436,539.80	13.29
140	002049	紫光国微	1,420,820.00	13.15
141	601390	中国中铁	1,412,044.00	13.07
142	600282	南钢股份	1,397,035.00	12.93
143	300856	科思股份	1,387,275.00	12.84
144	002714	牧原股份	1,384,060.00	12.81
145	605183	确成股份	1,377,935.00	12.75
146	601825	沪农商行	1,372,901.00	12.70
147	601225	陕西煤业	1,372,886.93	12.70
148	300390	天华超净	1,359,217.00	12.58

149	000707	双环科技	1,357,825.00	12.56
150	600761	安徽合力	1,356,943.00	12.56
151	601669	中国电建	1,353,697.00	12.53
152	600389	江山股份	1,353,563.00	12.53
153	002394	联发股份	1,335,232.00	12.36
154	600031	三一重工	1,314,246.00	12.16
155	300515	三德科技	1,300,736.00	12.04
156	001979	招商蛇口	1,294,456.00	11.98
157	603214	爱婴室	1,289,930.00	11.94
158	300275	梅安森	1,282,792.00	11.87
159	603696	安记食品	1,281,662.00	11.86
160	300910	瑞丰新材	1,269,293.36	11.75
161	002132	恒星科技	1,261,641.00	11.67
162	300502	新易盛	1,253,095.00	11.60
163	600697	欧亚集团	1,251,840.00	11.58
164	000951	中国重汽	1,250,707.00	11.57
165	001206	依依股份	1,250,473.82	11.57
166	600018	上港集团	1,249,838.00	11.57
167	601086	国芳集团	1,247,269.00	11.54
168	688005	容百科技	1,234,202.62	11.42
169	601186	中国铁建	1,220,413.00	11.29
170	600104	上汽集团	1,218,047.00	11.27
171	605077	华康股份	1,213,881.20	11.23
172	000895	双汇发展	1,211,314.00	11.21
173	601985	中国核电	1,209,648.00	11.19
174	600188	兖矿能源	1,203,768.72	11.14
175	300761	立华股份	1,202,896.00	11.13
176	301004	嘉益股份	1,185,390.00	10.97
177	600893	航发动力	1,184,980.00	10.97
178	603035	常熟汽饰	1,183,828.00	10.95
179	300532	今天国际	1,183,540.00	10.95
180	688518	联赢激光	1,183,442.61	10.95
181	002959	小熊电器	1,180,171.00	10.92
182	300371	汇中股份	1,179,340.00	10.91
183	000913	钱江摩托	1,175,596.00	10.88
184	300298	三诺生物	1,170,874.00	10.83
185	002982	湘佳股份	1,166,753.00	10.80
186	300575	中旗股份	1,165,906.00	10.79
187	605108	同庆楼	1,163,216.00	10.76
188	603368	柳药集团	1,161,571.00	10.75
189	002340	格林美	1,161,132.00	10.74
190	002722	物产金轮	1,152,455.00	10.66
191	002381	双箭股份	1,149,969.00	10.64

192	300498	温氏股份	1,148,425.00	10.63
193	600508	上海能源	1,147,794.00	10.62
194	300769	德方纳米	1,140,811.80	10.56
195	002179	中航光电	1,139,769.00	10.55
196	601688	华泰证券	1,137,877.00	10.53
197	600596	新安股份	1,137,516.00	10.53
198	605117	德业股份	1,137,115.00	10.52
199	600033	福建高速	1,136,442.00	10.52
200	600873	梅花生物	1,111,848.00	10.29
201	003019	宸展光电	1,110,518.55	10.28
202	600928	西安银行	1,106,929.00	10.24
203	002855	捷荣技术	1,102,926.00	10.21
204	002649	博彦科技	1,101,472.00	10.19
205	300268	佳沃食品	1,083,793.00	10.03
206	601009	南京银行	1,082,710.00	10.02
207	600436	片仔癀	1,080,987.00	10.00
208	000422	湖北宜化	1,076,002.00	9.96
209	000100	TCL 科技	1,075,467.00	9.95
210	300073	当升科技	1,066,076.00	9.86
211	688590	新致软件	1,065,763.31	9.86
212	601838	成都银行	1,054,146.00	9.75
213	603937	丽岛新材	1,053,321.00	9.75
214	002869	金溢科技	1,050,518.00	9.72
215	601928	凤凰传媒	1,049,341.00	9.71
216	002270	华明装备	1,048,999.00	9.71
217	003816	中国广核	1,044,231.00	9.66
218	600909	华安证券	1,043,291.00	9.65
219	603788	宁波高发	1,039,373.00	9.62
220	301042	安联锐视	1,033,444.00	9.56
221	000166	申万宏源	1,030,621.00	9.54
222	002811	郑中设计	1,025,278.00	9.49
223	000048	京基智农	1,023,863.00	9.47
224	300124	汇川技术	1,019,137.00	9.43
225	688335	复洁环保	1,015,601.93	9.40
226	688019	安集科技	1,013,061.25	9.37
227	603290	斯达半导	1,012,631.00	9.37
228	600057	厦门象屿	1,011,781.00	9.36
229	601728	中国电信	997,395.00	9.23
230	600233	圆通速递	991,747.00	9.18
231	601211	国泰君安	990,559.00	9.17
232	002756	永兴材料	973,449.00	9.01
233	300568	星源材质	972,533.03	9.00
234	600075	新疆天业	972,117.00	9.00

235	601816	京沪高铁	972,086.00	9.00
236	600449	宁夏建材	968,676.00	8.96
237	601658	邮储银行	964,947.00	8.93
238	600623	华谊集团	959,439.00	8.88
239	300041	回天新材	958,166.00	8.87
240	688981	中芯国际	952,002.80	8.81
241	300833	浩洋股份	949,183.00	8.78
242	000933	神火股份	947,692.00	8.77
243	003040	楚天龙	944,454.00	8.74
244	002920	德赛西威	939,694.00	8.70
245	600581	八一钢铁	933,208.80	8.64
246	000425	徐工机械	931,642.00	8.62
247	301035	润丰股份	929,704.00	8.60
248	600690	海尔智家	928,949.00	8.60
249	601117	中国化学	908,453.70	8.41
250	603086	先达股份	907,756.00	8.40
251	603767	中马传动	905,227.00	8.38
252	600308	华泰股份	902,762.00	8.35
253	600073	上海梅林	899,065.00	8.32
254	603327	福蓉科技	896,750.00	8.30
255	603928	兴业股份	893,499.00	8.27
256	002687	乔治白	887,475.45	8.21
257	002066	瑞泰科技	886,046.00	8.20
258	603080	新疆火炬	880,264.00	8.15
259	300274	阳光电源	874,570.00	8.09
260	688099	晶晨股份	870,204.10	8.05
261	688025	杰普特	864,948.70	8.00
262	603129	春风动力	863,330.00	7.99
263	000792	盐湖股份	862,600.00	7.98
264	600232	金鹰股份	860,717.00	7.96
265	600750	江中药业	860,179.00	7.96
266	600547	山东黄金	859,070.00	7.95
267	002371	北方华创	858,020.00	7.94
268	002405	四维图新	856,179.00	7.92
269	601991	大唐发电	855,513.00	7.92
270	000519	中兵红箭	849,703.00	7.86
271	300557	理工光科	849,199.00	7.86
272	002497	雅化集团	845,438.00	7.82
273	601231	环旭电子	840,176.00	7.77
274	603139	康惠制药	838,349.00	7.76
275	002738	中矿资源	834,843.00	7.73
276	601339	百隆东方	832,406.00	7.70
277	688112	鼎阳科技	829,198.58	7.67

278	603871	嘉友国际	828,609.40	7.67
279	600064	南京高科	825,096.20	7.64
280	300363	博腾股份	822,118.00	7.61
281	300505	川金诺	820,873.50	7.60
282	600111	北方稀土	817,022.00	7.56
283	002240	盛新锂能	814,571.00	7.54
284	688685	迈信林	810,022.42	7.50
285	603599	广信股份	808,524.00	7.48
286	002696	百洋股份	808,183.00	7.48
287	603379	三美股份	804,314.00	7.44
288	688260	昀冢科技	802,227.09	7.42
289	002410	广联达	798,219.00	7.39
290	000733	振华科技	797,780.00	7.38
291	601900	南方传媒	796,281.00	7.37
292	601800	中国交建	794,084.00	7.35
293	605399	晨光新材	791,750.00	7.33
294	300639	凯普生物	788,811.44	7.30
295	603529	爱玛科技	784,162.00	7.26
296	002459	晶澳科技	777,415.70	7.19
297	002927	泰永长征	772,223.00	7.15
298	601158	重庆水务	771,377.00	7.14
299	300398	飞凯材料	770,343.00	7.13
300	603017	中衡设计	765,409.00	7.08
301	601001	晋控煤业	761,380.00	7.05
302	002812	恩捷股份	758,116.00	7.02
303	002636	金安国纪	755,353.00	6.99
304	000880	潍柴重机	750,895.00	6.95
305	300122	智飞生物	747,708.00	6.92
306	600356	恒丰纸业	746,368.00	6.91
307	603156	养元饮品	745,676.00	6.90
308	000921	海信家电	745,099.00	6.89
309	600183	生益科技	743,151.70	6.88
310	688079	美迪凯	741,081.44	6.86
311	000498	山东路桥	736,775.00	6.82
312	603217	元利科技	735,296.00	6.80
313	002826	易明医药	727,110.00	6.73
314	600168	武汉控股	724,971.00	6.71
315	300192	科德教育	723,654.00	6.70
316	002963	豪尔赛	723,159.00	6.69
317	603093	南华期货	722,848.00	6.69
318	300389	艾比森	722,814.00	6.69
319	603515	欧普照明	722,673.00	6.69
320	600328	中盐化工	719,653.00	6.66

321	000685	中山公用	719,640.00	6.66
322	002202	金风科技	716,364.00	6.63
323	000828	东莞控股	716,038.00	6.63
324	002110	三钢闽光	715,447.00	6.62
325	688399	硕世生物	713,882.41	6.61
326	301020	密封科技	711,360.10	6.58
327	600939	重庆建工	708,707.00	6.56
328	000402	金融街	708,403.00	6.56
329	002774	快意电梯	707,748.23	6.55
330	603516	淳中科技	707,469.00	6.55
331	000063	中兴通讯	704,349.00	6.52
332	300196	长海股份	704,057.00	6.52
333	603613	国联股份	701,942.20	6.50
334	300800	力合科技	701,095.00	6.49
335	688329	艾隆科技	700,017.93	6.48
336	002217	合力泰	699,467.00	6.47
337	600236	桂冠电力	696,438.00	6.44
338	300294	博雅生物	695,587.26	6.44
339	300260	新莱应材	695,348.00	6.43
340	603256	宏和科技	692,760.00	6.41
341	600694	大商股份	691,266.00	6.40
342	600128	弘业股份	690,962.00	6.39
343	002367	康力电梯	688,879.00	6.37
344	688599	天合光能	683,308.93	6.32
345	600481	双良节能	679,068.00	6.28
346	300604	长川科技	677,940.00	6.27
347	603355	莱克电气	676,165.80	6.26
348	000985	大庆华科	675,613.00	6.25
349	600060	海信视像	675,351.00	6.25
350	002322	理工能科	673,587.00	6.23
351	688010	福光股份	672,910.39	6.23
352	600833	第一医药	670,186.00	6.20
353	603501	韦尔股份	669,653.00	6.20
354	002624	完美世界	668,752.00	6.19
355	300015	爱尔眼科	665,161.45	6.16
356	603127	昭衍新药	663,783.00	6.14
357	600662	外服控股	662,845.00	6.13
358	600039	四川路桥	661,785.00	6.12
359	002271	东方雨虹	660,070.00	6.11
360	600741	华域汽车	656,835.00	6.08
361	603790	雅运股份	653,592.00	6.05
362	601916	浙商银行	649,247.00	6.01
363	000553	安道麦 A	645,683.00	5.97

364	601138	工业富联	645,665.90	5.97
365	600958	东方证券	641,916.12	5.94
366	600507	方大特钢	639,456.00	5.92
367	601872	招商轮船	638,256.00	5.91
368	000596	古井贡酒	634,522.00	5.87
369	603920	世运电路	631,094.00	5.84
370	300601	康泰生物	629,739.00	5.83
371	002582	好想你	627,734.00	5.81
372	600863	内蒙华电	627,669.00	5.81
373	600271	航天信息	627,097.00	5.80
374	002192	融捷股份	626,418.00	5.80
375	603968	醋化股份	624,497.00	5.78
376	600746	江苏索普	618,853.00	5.73
377	601006	大秦铁路	615,837.00	5.70
378	603903	中持股份	613,527.04	5.68
379	300438	鹏辉能源	610,639.00	5.65
380	603289	泰瑞机器	608,770.00	5.63
381	002566	益盛药业	608,005.00	5.63
382	603993	洛阳钼业	607,826.00	5.62
383	600740	山西焦化	601,021.00	5.56
384	603198	迎驾贡酒	600,907.00	5.56
385	603886	元祖股份	597,783.00	5.53
386	688196	卓越新能	597,081.78	5.53
387	300661	圣邦股份	596,096.00	5.52
388	688268	华特气体	593,187.68	5.49
389	000716	黑芝麻	592,007.00	5.48
390	002705	新宝股份	585,542.00	5.42
391	300650	太龙股份	585,018.00	5.41
392	600639	浦东金桥	582,122.00	5.39
393	600926	杭州银行	582,072.00	5.39
394	002315	焦点科技	581,439.00	5.38
395	002057	中钢天源	577,474.00	5.34
396	600710	苏美达	577,430.00	5.34
397	600901	江苏金租	577,202.00	5.34
398	600148	长春一东	572,388.00	5.30
399	000708	中信特钢	571,372.00	5.29
400	000538	云南白药	567,123.00	5.25
401	600905	三峡能源	560,796.00	5.19
402	301045	天禄科技	559,939.00	5.18
403	603026	胜华新材	556,510.00	5.15
404	300106	西部牧业	555,522.00	5.14
405	002441	众业达	554,834.00	5.13
406	600760	中航沈飞	554,494.00	5.13

407	002045	国光电器	553,628.00	5.12
408	002597	金禾实业	550,313.00	5.09
409	300970	华绿生物	548,192.00	5.07
410	002027	分众传媒	543,818.00	5.03
411	603868	飞科电器	541,334.00	5.01
412	002913	奥士康	536,978.00	4.97
413	002241	歌尔股份	536,750.00	4.97
414	002166	莱茵生物	534,312.00	4.94
415	300583	赛托生物	527,856.00	4.88
416	600522	中天科技	525,389.00	4.86
417	688008	澜起科技	525,330.55	4.86
418	000020	深华发 A	518,124.00	4.79
419	603444	吉比特	517,603.00	4.79
420	000030	富奥股份	516,921.00	4.78
421	603050	科林电气	516,416.00	4.78
422	600392	盛和资源	515,682.00	4.77
423	000338	潍柴动力	513,465.00	4.75
424	603676	卫信康	512,490.00	4.74
425	603011	合锻智能	508,485.00	4.71
426	603079	圣达生物	508,335.00	4.70
427	002841	视源股份	506,139.00	4.68
428	601169	北京银行	505,250.00	4.68
429	605100	华丰股份	501,039.88	4.64
430	002955	鸿合科技	498,884.00	4.62
431	002557	洽洽食品	498,711.00	4.61
432	300768	迪普科技	497,713.78	4.61
433	603578	三星新材	497,470.80	4.60
434	000910	大亚圣象	495,228.00	4.58
435	300432	富临精工	494,600.00	4.58
436	603882	金域医学	490,226.00	4.54
437	002884	凌霄泵业	489,313.06	4.53
438	300820	英杰电气	489,284.50	4.53
439	688004	博汇科技	485,164.44	4.49
440	000548	湖南投资	484,414.00	4.48
441	600570	恒生电子	483,038.80	4.47
442	603929	亚翔集成	482,023.00	4.46
443	688118	普元信息	481,191.61	4.45
444	300570	太辰光	481,066.00	4.45
445	601336	新华保险	476,237.00	4.41
446	300462	华铭智能	475,711.00	4.40
447	688111	金山办公	475,244.80	4.40
448	603115	海星股份	475,145.00	4.40
449	600319	亚星化学	473,389.00	4.38

450	603517	绝味食品	472,548.00	4.37
451	688617	惠泰医疗	471,413.27	4.36
452	002230	科大讯飞	471,377.00	4.36
453	002806	华锋股份	470,695.00	4.36
454	600582	天地科技	470,694.00	4.36
455	002555	三七互娱	468,520.00	4.34
456	300142	沃森生物	466,091.00	4.31
457	603037	凯众股份	464,777.00	4.30
458	300861	美畅股份	463,347.80	4.29
459	600202	哈空调	461,114.00	4.27
460	300628	亿联网络	461,009.00	4.27
461	002337	赛象科技	461,007.00	4.27
462	600426	华鲁恒升	459,505.40	4.25
463	002737	葵花药业	459,451.00	4.25
464	300640	德艺文创	458,634.00	4.24
465	002815	崇达技术	458,036.00	4.24
466	600051	宁波联合	456,449.00	4.22
467	000415	渤海租赁	456,418.00	4.22
468	600150	中国船舶	455,723.00	4.22
469	688567	孚能科技	454,255.44	4.20
470	601600	中国铝业	454,108.00	4.20
471	300025	华星创业	453,104.00	4.19
472	603369	今世缘	453,096.00	4.19
473	000719	中原传媒	452,342.00	4.19
474	603677	奇精机械	452,321.00	4.19
475	000421	南京公用	450,404.00	4.17
476	600010	包钢股份	450,255.00	4.17
477	688575	亚辉龙	449,728.29	4.16
478	600444	国机通用	446,195.00	4.13
479	002591	恒大高新	445,347.00	4.12
480	603906	龙蟠科技	443,976.00	4.11
481	002601	龙佰集团	443,909.00	4.11
482	002159	三特索道	443,713.00	4.11
483	600745	闻泰科技	443,511.00	4.10
484	300652	雷迪克	443,197.00	4.10
485	688012	中微公司	442,381.25	4.09
486	300003	乐普医疗	442,236.00	4.09
487	601633	长城汽车	442,228.00	4.09
488	000157	中联重科	441,811.00	4.09
489	600348	华阳股份	438,319.00	4.06
490	601717	郑煤机	438,195.00	4.05
491	603876	鼎胜新材	436,731.00	4.04
492	002493	荣盛石化	434,821.00	4.02

493	600096	云天化	434,722.00	4.02
494	000012	南玻A	434,640.00	4.02
495	300635	中达安	432,796.00	4.00
496	300239	东宝生物	426,402.00	3.95
497	300231	银信科技	424,543.00	3.93
498	000153	丰原药业	423,968.00	3.92
499	688393	安必平	421,536.44	3.90
500	600837	海通证券	420,837.00	3.89
501	300349	金卡智能	414,906.00	3.84
502	000963	华东医药	413,674.00	3.83
503	603260	合盛硅业	412,255.00	3.81
504	300703	创源股份	412,010.00	3.81
505	600196	复星医药	411,835.00	3.81
506	600235	民丰特纸	411,693.00	3.81
507	600085	同仁堂	410,231.00	3.80
508	300399	天利科技	409,441.00	3.79
509	300992	泰福泵业	407,398.00	3.77
510	300668	杰恩设计	406,482.00	3.76
511	002718	友邦吊顶	404,970.00	3.75
512	603456	九洲药业	404,875.00	3.75
513	601066	中信建投	404,294.00	3.74
514	000630	铜陵有色	403,964.00	3.74
515	300387	富邦股份	399,923.00	3.70
516	002608	江苏国信	398,173.00	3.68
517	600660	福耀玻璃	397,088.00	3.67
518	600678	四川金顶	397,037.00	3.67
519	601377	兴业证券	395,968.80	3.66
520	000521	长虹美菱	395,150.00	3.66
521	600875	东方电气	393,590.00	3.64
522	300611	美力科技	392,201.00	3.63
523	000408	藏格矿业	391,340.00	3.62
524	688669	聚石化学	389,434.17	3.60
525	300042	朗科科技	387,993.00	3.59
526	688516	奥特维	386,873.80	3.58
527	300035	中科电气	384,773.00	3.56
528	300461	田中精机	383,577.00	3.55
529	000090	天健集团	383,496.00	3.55
530	603668	天马科技	380,375.00	3.52
531	601901	方正证券	379,151.00	3.51
532	000661	长春高新	378,033.00	3.50
533	603612	索通发展	376,133.00	3.48
534	000786	北新建材	375,089.50	3.47
535	300782	卓胜微	374,111.00	3.46

536	002921	联诚精密	373,813.00	3.46
537	002278	神开股份	371,857.00	3.44
538	688499	利元亨	371,313.27	3.44
539	601958	金钼股份	371,190.00	3.43
540	000997	新大陆	369,854.00	3.42
541	000768	中航西飞	369,345.58	3.42
542	600346	恒力石化	368,695.00	3.41
543	603656	泰禾智能	367,268.00	3.40
544	600243	青海华鼎	366,455.00	3.39
545	600886	国投电力	366,006.00	3.39
546	603585	苏利股份	364,300.00	3.37
547	300347	泰格医药	364,273.00	3.37
548	000552	靖远煤电	363,948.00	3.37
549	301022	海泰科	363,567.00	3.36
550	002521	齐峰新材	362,165.00	3.35
551	603518	锦泓集团	361,807.00	3.35
552	1928	金沙中国有限公司	361,566.45	3.35
553	600551	时代出版	360,706.96	3.34
554	002376	新北洋	356,105.00	3.30
555	605081	太和水	354,952.65	3.28
556	000729	燕京啤酒	352,780.00	3.26
557	002539	云图控股	352,402.00	3.26
558	603908	牧高笛	351,999.00	3.26
559	300763	锦浪科技	350,972.00	3.25
560	301007	德迈仕	350,474.00	3.24
561	301006	迈拓股份	350,139.00	3.24
562	002545	东方铁塔	350,058.00	3.24
563	603161	科华控股	348,947.00	3.23
564	300896	爱美客	347,352.00	3.21
565	300037	新宙邦	346,790.00	3.21
566	603077	和邦生物	345,631.00	3.20
567	688556	高测股份	344,773.76	3.19
568	300327	中颖电子	344,588.00	3.19
569	6818	中国光大银行	344,545.14	3.19
570	002895	川恒股份	344,117.00	3.18
571	600584	长电科技	342,838.00	3.17
572	605358	立昂微	342,283.00	3.17
573	002835	同为股份	342,029.00	3.16
574	300741	华宝股份	341,848.00	3.16
575	600888	新疆众和	339,981.13	3.15
576	002091	江苏国泰	337,877.00	3.13

577	002105	信隆健康	337,717.00	3.13
578	300716	国立科技	336,046.00	3.11
579	605178	时空科技	335,516.00	3.10
580	600588	用友网络	334,838.00	3.10
581	603700	宁水集团	334,285.00	3.09
582	603238	诺邦股份	333,549.00	3.09
583	600261	阳光照明	332,414.00	3.08
584	002484	江海股份	331,955.00	3.07
585	000050	深天马 A	330,636.00	3.06
586	2007	碧桂园	329,944.62	3.05
587	000096	广聚能源	327,694.00	3.03
588	002865	钧达股份	326,319.00	3.02
589	600536	中国软件	326,052.00	3.02
590	600571	信雅达	324,293.00	3.00
591	000970	中科三环	324,204.00	3.00
592	603839	安正时尚	323,530.00	2.99
593	002080	中材科技	321,989.00	2.98
594	002236	大华股份	320,407.00	2.96
595	300242	佳云科技	320,372.00	2.96
596	300017	网宿科技	320,274.00	2.96
597	002605	姚记科技	320,268.00	2.96
598	688122	西部超导	319,961.79	2.96
599	600499	科达制造	318,056.00	2.94
600	002188	中天服务	317,258.00	2.94
601	600132	重庆啤酒	316,866.00	2.93
602	601886	江河集团	316,303.00	2.93
603	603258	电魂网络	314,768.00	2.91
604	600009	上海机场	313,020.00	2.90
605	000656	金科股份	312,071.00	2.89
606	600998	九州通	310,193.00	2.87
607	600615	丰华股份	308,546.00	2.86
608	603116	红蜻蜓	308,505.40	2.85
609	600368	五洲交通	306,272.00	2.83
610	600035	楚天高速	305,279.00	2.82
611	600027	华电国际	304,662.00	2.82
612	600780	通宝能源	302,974.00	2.80
613	000822	山东海化	302,430.00	2.80
614	603819	神力股份	301,779.00	2.79
615	600795	国电电力	299,824.00	2.77
616	603898	好莱客	297,277.00	2.75
617	000526	学大教育	297,024.00	2.75
618	300211	亿通科技	296,984.00	2.75
619	300625	三雄极光	296,979.00	2.75

620	300496	中科创达	296,759.39	2.75
621	002809	红墙股份	296,459.00	2.74
622	600778	友好集团	295,532.00	2.73
623	600452	涪陵电力	294,937.00	2.73
624	603300	华铁应急	293,690.00	2.72
625	603486	科沃斯	293,650.00	2.72
626	601788	光大证券	293,604.00	2.72
627	603030	全筑股份	292,859.00	2.71
628	002850	科达利	291,441.00	2.70
629	601566	九牧王	287,918.00	2.66
630	600409	三友化工	286,343.00	2.65
631	603003	龙宇燃油	285,700.00	2.64
632	600295	鄂尔多斯	285,484.50	2.64
633	300890	翔丰华	285,304.00	2.64
634	688069	德林海	284,978.04	2.64
635	688598	金博股份	284,167.00	2.63
636	300433	蓝思科技	283,934.00	2.63
637	300127	银河磁体	281,308.00	2.60
638	300562	乐心医疗	280,774.00	2.60
639	603328	依顿电子	280,328.00	2.59
640	300803	指南针	279,541.00	2.59
641	002881	美格智能	279,339.00	2.58
642	000667	美好置业	278,365.38	2.58
643	603661	恒林股份	276,724.00	2.56
644	603090	宏盛股份	276,205.00	2.56
645	300069	金利华电	275,920.00	2.55
646	688396	华润微	275,848.29	2.55
647	300170	汉得信息	275,745.00	2.55
648	300118	东方日升	273,600.00	2.53
649	002024	ST 易购	272,944.00	2.53
650	000301	东方盛虹	272,813.00	2.52
651	002482	ST 广田	272,682.00	2.52
652	300789	唐源电气	269,135.00	2.49
653	000046	泛海控股	269,106.00	2.49
654	603757	大元泵业	264,319.29	2.45
655	002013	中航机电	263,540.00	2.44
656	300259	新天科技	261,946.00	2.42
657	002258	利尔化学	261,863.00	2.42
658	300130	新国都	261,290.20	2.42
659	600398	海澜之家	259,323.00	2.40
660	688200	华峰测控	257,713.69	2.38
661	600821	金开新能	257,490.00	2.38
662	000066	中国长城	257,069.00	2.38

663	600352	浙江龙盛	256,931.00	2.38
664	600011	华能国际	256,652.00	2.37
665	002407	多氟多	254,722.00	2.36
666	000629	钒钛股份	254,271.00	2.35
667	603508	思维列控	253,840.40	2.35
668	600791	京能置业	252,718.00	2.34
669	300112	万讯自控	251,312.00	2.33
670	300158	振东制药	248,300.00	2.30
671	600720	祁连山	248,232.00	2.30
672	603001	奥康国际	245,155.00	2.27
673	002048	宁波华翔	244,674.00	2.26
674	600486	扬农化工	244,591.00	2.26
675	601989	中国重工	244,422.00	2.26
676	601868	中国能建	243,548.00	2.25
677	300759	康龙化成	242,936.00	2.25
678	002150	通润装备	242,884.00	2.25
679	600729	重庆百货	242,157.00	2.24
680	002787	华源控股	241,924.00	2.24
681	002563	森马服饰	241,913.00	2.24
682	000400	许继电气	241,488.00	2.23
683	600742	一汽富维	241,382.90	2.23
684	002868	绿康生化	241,049.00	2.23
685	600004	白云机场	240,291.00	2.22
686	600421	华嵘控股	240,163.00	2.22
687	603806	福斯特	239,836.40	2.22
688	002947	恒铭达	238,691.00	2.21
689	000800	一汽解放	237,407.00	2.20
690	000988	华工科技	237,256.00	2.20
691	002050	三花智控	235,924.00	2.18
692	600269	赣粤高速	234,921.00	2.17
693	003015	日久光电	234,918.00	2.17
694	002577	雷柏科技	233,963.00	2.16
695	002932	明德生物	233,834.00	2.16
696	000810	创维数字	233,512.00	2.16
697	000977	浪潮信息	233,367.00	2.16
698	601877	正泰电器	233,306.00	2.16
699	601995	中金公司	230,244.00	2.13
700	600600	青岛啤酒	229,357.00	2.12
701	000019	深粮控股	228,242.10	2.11
702	600929	雪天盐业	226,863.00	2.10
703	603586	金麒麟	226,740.09	2.10
704	002176	江特电机	225,534.00	2.09
705	300171	东富龙	225,319.00	2.09

706	601881	中国银河	225,037.00	2.08
707	688680	海优新材	224,786.00	2.08
708	002281	光迅科技	224,490.00	2.08
709	600879	航天电子	224,162.00	2.07
710	000877	天山股份	224,060.00	2.07
711	600665	天地源	223,255.00	2.07
712	600810	神马股份	222,978.00	2.06
713	000938	紫光股份	222,688.00	2.06
714	300223	北京君正	221,589.00	2.05
715	002576	通达动力	221,015.00	2.05
716	1378	中国宏桥	220,625.01	2.04
717	002008	大族激光	220,082.00	2.04
718	603185	上机数控	219,888.00	2.03
719	002106	莱宝高科	219,698.00	2.03
720	002001	新 和 成	219,381.80	2.03
721	600845	宝信软件	218,531.00	2.02
722	300306	远方信息	218,438.01	2.02
723	603688	石英股份	218,007.00	2.02
724	000968	蓝焰控股	217,678.00	2.01
725	603002	宏昌电子	217,532.00	2.01
726	600123	兰花科创	216,198.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	970,352,884.93
卖出股票的收入（成交）总额	876,829,406.63

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行广州分行的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到银保监会及中国人民银行呼和浩特市中心支行的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行长春中心支行及中国人民银行合肥市中心支行的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会及中国人民银行武汉分行的处罚。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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	53,752.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	7,286.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,038.82

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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	718	110,613.49	74,692,427.73	94.05%	4,728,060.03	5.95%
博时量化价 值股票 C	474	36,503.64	13,754,212.23	79.49%	3,548,513.73	20.51%
合计	1,110	87,138.03	88,446,639.96	91.44%	8,276,573.76	8.56%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化价值股 票 A	78,825.87	0.10%
	博时量化价值股 票 C	50.00	0.00%
	合计	78,875.87	0.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	-
	博时量化价值股票 C	-
	合计	-
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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 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	76,933,057.61	64,231,699.46
减：本报告期基金总赎回份额	1,536,819.33	49,925,338.22
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	79,420,487.76	17,302,725.96

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请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。报告期内本基金应付审计费为 40000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	389,812,742.46	21.11%	363,033.68	21.31%	-
中金公司	1	7,229,981.32	0.39%	6,732.38	0.40%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	95,232,369.49	5.16%	88,689.41	5.21%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	272,681,520.47	14.77%	253,949.44	14.91%	-
光大证券	2	103,445,801.28	5.60%	96,340.29	5.66%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	15,145,495.35	0.82%	11,606.97	0.68%	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	69,847,075.13	3.78%	51,079.73	3.00%	-
国金证券	1	82,216,337.39	4.45%	76,569.25	4.49%	-
招商证券	2	404,646,032.57	21.91%	376,838.70	22.12%	-
申万宏源	2	406,549,670.59	22.01%	378,619.96	22.23%	-

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

营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	79,311.20	49.58%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-

投						
国金证 券	25,385.15	15.87%	-	-	-	-
招商证 券	55,278.27	34.55%	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时量化价值股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-12-22
2	博时量化价值股票型证券投资基金分红公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-12-22
3	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-11-16
4	博时基金管理有限公司旗下基金在杭州银行直销银行开展申购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	2022-11-16
5	博时基金管理有限公司关于调整旗下部分基金的申购、赎回、定投、转换起点金额及最低持有数量限制的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-11-16
6	博时量化价值股票型证券投资基金分红公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-11-10
7	博时量化价值股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-11-09
8	博时量化价值股票型证券投资基金 2022 年第 3 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	2022-10-26

9	博时基金管理有限公司关于运用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	2022-10-18
10	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-09-30
11	博时量化价值股票型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-08-31
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通广发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	2022-08-29
13	博时量化价值股票型证券投资基金(博时量化价值股票 A)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-08-25
14	博时量化价值股票型证券投资基金(博时量化价值股票 C)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-08-25
15	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜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	2022-08-22
16	博时量化价值股票型证券投资基金 2022 年第 2 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	2022-07-21
17	博时基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台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	2022-07-18
18	博时基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-07-16
19	博时基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-07-16

20	博时基金管理有限公司关于部分基金在招赢通平台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	2022-07-05
21	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
22	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
23	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-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
24	博时量化价值股票型证券投资基金 2022 年第 1 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	2022-04-22
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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

31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-09-28~2022-12-31	-	44,060,963.41	-	44,060,963.41	45.55%
	2	2022-10-14~2022-12-31	-	30,631,464.32	-	30,631,464.32	31.67%
	3	2022-02-09~2022-10-27	-	13,754,212.23	-	13,754,212.23	14.22%
	4	2022-02-24~2022-02-24	-	6,877,106.11	6,877,106.11	-	-

5	2022-02-09~2022-02-23	-	7,564,816.7 3	7,564,816.7 3	-	-
6	2022-05-25~2022-05-31;2022-08-23~2022-09-21	-	34,299,011. 45	34,299,011. 45	-	-
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>						

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时量化价值股票型证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《博时量化价值股票型证券投资基金托管协议》
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 13.1.5 博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 13.1.6 报告期内博时量化价值股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二三年三月三十日