

博时量化多策略股票型证券投资基金
2023 年中期报告
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	74
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74

7.12 投资组合报告附注.....	74
§8 基金份额持有人信息.....	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	76
§9 开放式基金份额变动.....	76
§10 重大事件揭示.....	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4 基金投资策略的改变.....	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
10.8 其他重大事件.....	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
§12 备查文件目录.....	80
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点.....	81
12.3 查阅方式.....	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化多策略股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化多策略股票	
基金主代码	005635	
交易代码	005635	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	205,019,322.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
下属分级基金的交易代码	005635	005636
报告期末下属分级基金的份额总额	173,094,448.35 份	31,924,874.61 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	博时基金管理有限公司		招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张姗
	联系电话	0755-83169999	0755-83077987
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	95105568		95555
传真	0755-83195140		0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	518040		518040
法定代表人	江向阳		缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	12,409,296.20	-908,257.80
本期利润	11,992,676.38	-2,104,994.18
加权平均基金份额本期利润	0.0677	-0.0480
本期加权平均净值利润率	4.42%	-3.28%
本期基金份额净值增长率	4.62%	4.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
期末可供分配利润	87,300,562.77	14,114,687.29

期末可供分配基金份额利润	0.5044	0.4421
期末基金资产净值	264,027,314.79	46,675,253.53
期末基金份额净值	1.5253	1.4620
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金份额累计净值增长率	52.53%	46.20%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时量化多策略股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.38%	0.83%	1.76%	0.83%	0.62%	0.00%
过去三个月	-0.48%	0.75%	-3.36%	0.74%	2.88%	0.01%
过去六个月	4.62%	0.72%	1.54%	0.74%	3.08%	-0.02%
过去一年	-0.67%	0.83%	-7.27%	0.90%	6.60%	-0.07%
过去三年	33.20%	1.03%	-0.99%	1.04%	34.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	52.53%	1.14%	1.67%	1.10%	50.86%	0.04%

博时量化多策略股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.31%	0.83%	1.76%	0.83%	0.55%	0.00%
过去三个月	-0.67%	0.75%	-3.36%	0.74%	2.69%	0.01%
过去六个月	4.21%	0.72%	1.54%	0.74%	2.67%	-0.02%
过去一年	-1.46%	0.83%	-7.27%	0.90%	5.81%	-0.07%
过去三年	30.00%	1.03%	-0.99%	1.04%	30.99%	-0.01%
自基金合同生效起至今	46.20%	1.14%	1.67%	1.10%	44.53%	0.04%

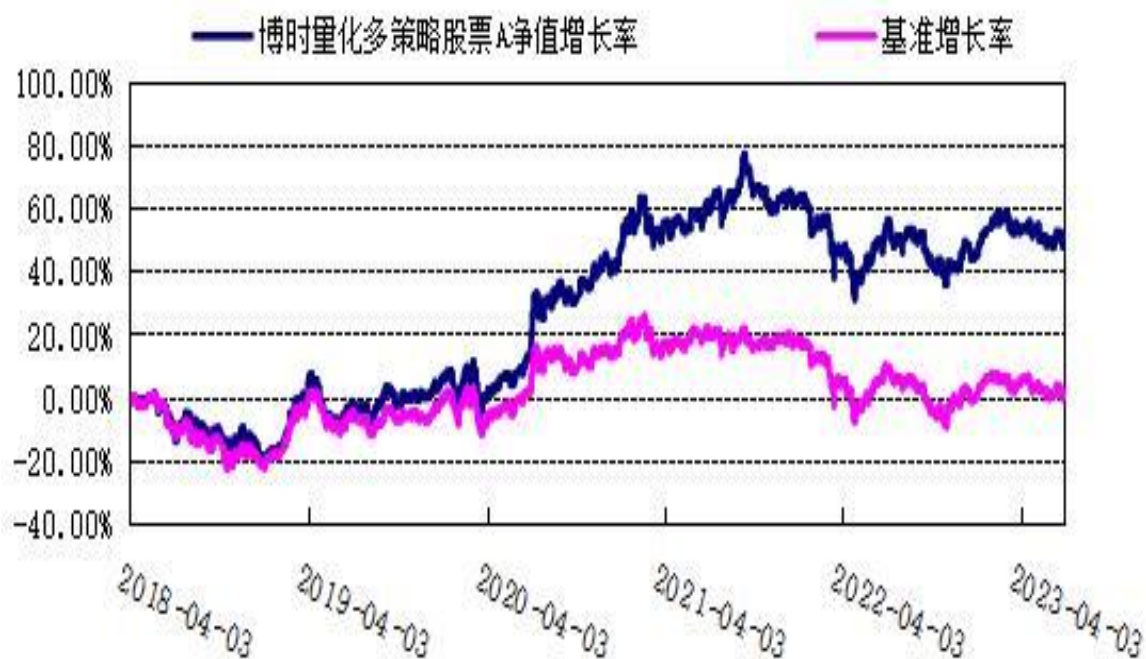
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化多策略股票型证券投资基金

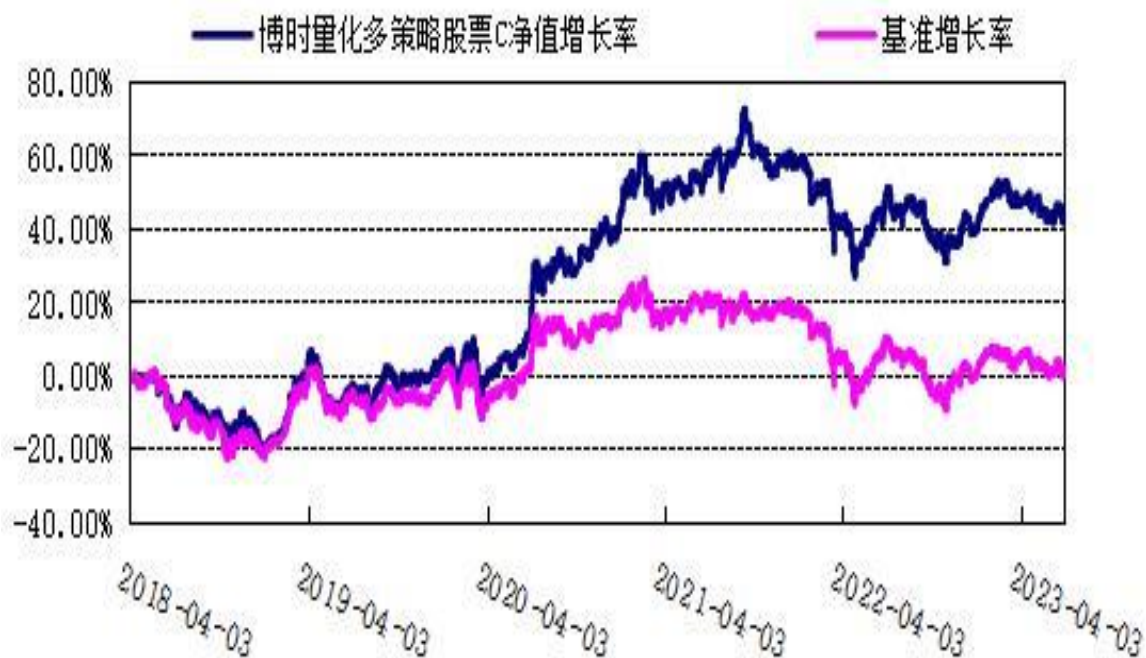
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 4 月 3 日至 2023 年 6 月 30 日)

博时量化多策略股票 A



博时量化多策略股票 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林景艺	基金经理	2018-04-03	2023-03-08	12.9	林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理、博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015 年 5 月 20 日-2021 年 5 月 18 日)、博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日-2023 年 3 月 8 日)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日-2023 年 3 月 8 日)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2022 年 2 月 28 日-2023 年 3 月 8 日)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部投资总监/基金经理	2018-04-03	-	20.9	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、

					股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长贰号证券投资基金(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日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日一至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	12.9	李庆阳先生，硕士。2010年从华南理工大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级系统运维经理。2016年调任博时资本，任投资经理。2018年再次加入博时基金管理有限公司，现任基金经理助理。
王萌	基金经理助理	2023-01-20	-	6.9	王萌先生，博士。2016年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信

于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 89 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

回顾 2023 年上半年，海外市场和国内市场，均一定程度的出现了现实与市场预期均相背离的情况。年初市场预期“欧美经济步入衰退，股票市场承压”，但发达市场股票集体走强。国内方面，整个上半年呈现出前高后低的典型“脉冲式复苏”特征。第一季度在“信贷+基建+消费”的合力电击脉冲下，各项经济活动有迅速恢复和报复性反弹的趋势。但是到了第二季度，随着投资和消费的脉冲回落，加上出口也开始走弱，整个经济的复苏陷入不稳定状态。具体到 A 股市场上，呈现出震荡的走势，而且权益市场存量博弈加剧，整体收益欠佳。

市场风格方面，大小盘风格切换比较剧烈，1 月份前半段大盘强势，后半段小盘迅速反弹，4 月份大盘略微占优，之后又迅速重新回到小盘趋势。动量风格在 1 月下跌后持续震荡上行。价值风格基本维持震荡向上，而成长风格则表现平平。

在行业层面，一个较为明显的特征就是“分化”，一边是人工智能和“中特估”等概念此起彼伏，TMT 板块一路狂飙；另一边是新能源、医药等新兴产业集聚的创业板一度陷入调整。具体而言，通信、传媒、计算机涨幅较大，房地产、消费者服务则跌幅较大。

本基金在 2023 年上半年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了较高的股票仓位。在量化策略的配置上，整体上以趋势跟踪为主，但及时对风格变化做出响应，超配小盘，且在

小盘中更偏重价值风格。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求为投资者获取长期稳健的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.5253 元，份额累计净值为 1.5253 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.4620 元，份额累计净值为 1.4620 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 4.62%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 4.21%，同期业绩基准增长率为 1.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，虽然目前复苏进展偏弱，但在经济活动的逐步恢复下，中国企业实现双位数的盈利增长仍是大概率事件。此外，从经济活动本身看，基本面的连续改善显示出复苏正在持续发生，经济复苏的方向是确定的。估值层面，经历了 2021 年以来的充分调整，不少板块的估值已经到达了很具吸引力的位置。泛消费板块的不少优质资产在弱现实的抛售下已经被低估，而往往在悲观情绪积压后，一点积极催化即可带来收益的弹性。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，

通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	16,895,791.16	34,315,271.99
结算备付金		6,402,148.95	6,316,058.87
存出保证金		1,340,313.22	1,305,728.22
交易性金融资产	6.4.3.2	288,335,898.71	207,072,296.69
其中：股票投资		279,732,578.80	207,071,073.69
基金投资		-	-
债券投资		8,603,319.91	1,223.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		154,161.56	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,751.05	19,638.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		313,135,064.65	249,028,994.56
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	14,957,876.83
应付赎回款		3,507.24	9,526.01
应付管理人报酬		405,438.45	289,492.17
应付托管费		67,573.06	48,248.68
应付销售服务费		56,362.69	7,535.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.90	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	1,899,611.99	1,254,631.46
负债合计		2,432,496.33	16,567,311.01
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	205,019,322.96	159,874,747.07
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	105,683,245.36	72,586,936.48
净资产合计		310,702,568.32	232,461,683.55
负债和净资产总计		313,135,064.65	249,028,994.56

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 205,019,322.96 份。其中 A 类基金份额净值 1.5253 元，基金份额总额 173,094,448.35 份；C 类基金份额净值 1.4620 元，基金份额总额 31,924,874.61 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,132,305.82	-11,613,212.08
1. 利息收入		113,652.41	63,110.56
其中：存款利息收入	6.4.3.10	113,652.41	63,110.56
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,328,926.50	-18,921,467.06
其中：股票投资收益	6.4.3.11	9,648,037.39	-21,271,981.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	118,285.94	242,929.31
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	210,622.72	-136,936.99
股利收益	6.4.3.15	4,351,980.45	2,244,522.03
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-1,613,356.20	7,179,872.64

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	303,083.11	65,271.78
减：二、营业总支出		3,244,623.62	1,791,232.45
1. 管理人报酬		2,479,995.65	1,408,711.21
2. 托管费		413,332.61	234,785.25
3. 销售服务费		250,377.59	53,238.21
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,773.67	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,773.67	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		3,250.11	0.16
8. 其他费用	6.4.3.19	95,893.99	94,497.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,887,682.20	-13,404,444.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,887,682.20	-13,404,444.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,887,682.20	-13,404,444.53

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	159,874,747.07	-	72,586,936.48	232,461,683.55
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）	159,874,747.07	-	72,586,936.48	232,461,683.55
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	45,144,575.89	-	33,096,308.88	78,240,884.77
（一）、综合收益总额	-	-	9,887,682.20	9,887,682.20
（二）、本期基金份	45,144,575.89	-	23,208,626.68	68,353,202.5

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				7
其中：1. 基金申购款	171,395,662.29	-	87,044,408.57	258,440,070.86
2. 基金赎回款	-126,251,086.40	-	-63,835,781.89	-190,086,868.29
（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）	205,019,322.96	-	105,683,245.36	310,702,568.32
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	151,413,892.69	-	95,893,609.18	247,307,501.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	151,413,892.69	-	95,893,609.18	247,307,501.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,100,417.81	-	-25,008,789.36	-43,109,207.17
（一）、综合收益总额	-	-	-13,404,444.53	-13,404,444.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-18,100,417.81	-	-11,604,344.83	-29,704,762.64
其中：1. 基金申购款	81,978,454.81	-	40,995,361.61	122,973,816.42
2. 基金赎回款	-100,078,872.62	-	-52,599,706.44	-152,678,579.06
（三）、本期向基金份额持有人分配利	-	-	-	-

润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	133,313,474.88	-	70,884,819.82	204,198,294.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：侣方方

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生

的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	16,895,791.16
等于: 本金	16,892,103.53
加: 应计利息	3,687.63
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	16,895,791.16

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	277,985,320.94	-	279,732,578.80	1,747,257.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	78,169.91	8,603,319.91	12,245.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	78,169.91	8,603,319.91	12,245.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	286,498,225.94	78,169.91	288,335,898.71	1,759,502.86

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,720,900.00	-	-	-
---股指期货	9,720,900.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,720,900.00	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融

资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IH2307	IH2307	13.00	9,665,760.00	-55,140.00
合计	-	-	-	-55,140.00
减:可抵销期货暂收款	-	-	-	-55,140.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30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	1,810,809.43
其中：交易所市场	1,810,809.43
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	88,802.56
合计	1,899,611.99

6.4.3.8 实收基金

博时量化多策略股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	148,516,527.87	148,516,527.87
本期申购	94,100,656.37	94,100,656.37
本期赎回（以“-”号填列）	-69,522,735.89	-69,522,735.89
本期末	173,094,448.35	173,094,448.35

博时量化多策略股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	11,358,219.20	11,358,219.20
本期申购	77,295,005.92	77,295,005.92
本期赎回（以“-”号填列）	-56,728,350.51	-56,728,350.51
本期末	31,924,874.61	31,924,874.61

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

6.4.3.9 未分配利润

博时量化多策略股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,419,680.50	2,590,505.82	68,010,186.32
本期利润	12,409,296.20	-416,619.82	11,992,676.38
本期基金份额交易产生的变动数	9,471,586.07	1,458,417.67	10,930,003.74
其中：基金申购款	46,074,704.29	2,773,203.01	48,847,907.30
基金赎回款	-36,603,118.22	-1,314,785.34	-37,917,903.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,300,562.77	3,632,303.67	90,932,866.44

博时量化多策略股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,389,286.06	187,464.10	4,576,750.16
本期利润	-908,257.80	-1,196,736.38	-2,104,994.18
本期基金份额交易产生的变动数	10,633,659.03	1,644,963.91	12,278,622.94
其中：基金申购款	36,094,299.55	2,102,201.72	38,196,501.27

基金赎回款	-25,460,640.52	-457,237.81	-25,917,878.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,114,687.29	635,691.63	14,750,378.92

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入		50,354.59
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		62,248.86
其他		1,048.96
合计		113,652.41

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额		2,891,762,018.24
减：卖出股票成本总额		2,874,495,693.36
减：交易费用		7,618,287.49
买卖股票差价收入		9,648,037.39

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
债券投资收益——利息收入		22,426.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		95,859.73
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		118,285.94

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额		3,599,747.83

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,488,743.53
减：应计利息总额	14,867.87
减：交易费用	276.70
买卖债券差价收入	95,859.73

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 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。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	210,622.72

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,351,980.45
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	4,351,980.45

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,730,842.52
——股票投资	-1,742,864.82
——债券投资	12,022.30
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	117,486.32

——权证投资	-
——股指期货	117,486.32
4. 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	-1,613,356.20

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	251,049.55
基金转换费收入	52,033.56
合计	303,083.11

6.4.3.18 信用减值损失

无。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
银行汇划费	2,591.43
合计	95,893.99

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	2,364,935,770.88	40.55%	1,518,805,884.31	63.76%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	5,542,690.15	36.00%	6,420,891.88	85.65%

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	1,729,477.22	40.55%	1,007,909.87	55.66%
关联方名称	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	1,110,687.90	63.70%	711,793.06	100.00%

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,479,995.65	1,408,711.21
其中：支付销售机构的客户维护费	109,133.14	72,255.23

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	413,332.61	234,785.25

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	117,730.95	117,730.95
招商证券	-	98,733.56	98,733.56
招商银行	-	993.30	993.30
合计	-	217,457.81	217,457.81

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	10,869.62	10,869.62
招商银行	-	920.90	920.90
招商证券	-	69.79	69.79
合计	-	11,860.31	11,860.31

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

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

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	16,895,791.16	50,354.59	11,827,286.01	24,664.79

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

6.4.6.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	4,806.00	121,351.50
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	002948	青岛银行	网下发行	30,540.00	97,728.00
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	1,710.00	63,663.30
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	5,565.00	80,302.95
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明
6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券
6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 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
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上	26.68	26.68	4,559.00	121,634.12	121,634.12	-

601916	浙商银行	2023-06-27	7 个交易日	配股未上市	2.02	2.64	44,700.00	90,294.00	118,008.00	-
688522	纳睿雷达	2023-02-22	6 个月	首次公开发行限售	46.68	51.50	2,149.00	100,315.32	110,673.50	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	1,616.00	93,178.56	93,178.56	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	4,612.00	92,193.88	92,193.88	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7 个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775.00	65,497.50	65,497.50	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	2,172.00	43,135.92	39,226.32	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	首次公开发行限售	29.60	71.42	333.00	9,856.80	23,782.86	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	1,364.00	15,140.40	23,242.56	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	首次公开发行限售	76.80	107.95	196.00	15,052.80	21,158.20	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	首次公开发行限售	5.69	5.41	3,864.00	21,986.16	20,904.24	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	23.60	64.67	319.00	7,528.40	20,629.73	-

688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	首次公开发行限售	32.52	42.37	386.00	12,552.72	16,354.82	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	首次公开发行限售	135.80	120.41	132.00	17,925.60	15,894.12	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	12.68	22.31	711.00	9,015.48	15,862.41	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	首次公开发行限售	5.00	8.96	1,685.00	8,425.00	15,097.60	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	首次公开发行限售	37.88	29.49	503.00	19,053.64	14,833.47	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	首次公开发行限售	24.80	43.85	330.00	8,184.00	14,470.50	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	38.13	31.03	459.00	17,501.67	14,242.77	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	首次公开发行限售	23.77	42.89	329.00	7,820.33	14,110.81	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	26.74	40.68	334.00	8,931.16	13,587.12	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	26.68	26.68	507.00	13,526.76	13,526.76	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	首次公开发行限售	32.34	31.86	422.00	13,647.48	13,444.92	-

301320	豪江智能	2023-06-01	6 个月	首次公开发行限售	13.06	20.62	642.00	8,384.52	13,238.04	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发行限售	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	首次公开发行限售	36.15	38.13	342.00	12,363.30	13,040.46	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	首次公开发行限售	39.99	36.71	353.00	14,116.47	12,958.63	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	首次公开发行限售	43.67	53.05	239.00	10,437.13	12,678.95	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	首次公开发行限售	71.88	92.60	134.00	9,631.92	12,408.40	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	首次公开发行限售	23.80	32.84	369.00	8,782.20	12,117.96	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	首次公开发行限售	152.38	135.97	87.00	13,257.06	11,829.39	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	57.88	49.17	239.00	13,833.32	11,751.63	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	首次公开发行限售	58.32	45.36	258.00	15,046.56	11,702.88	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	首次公开发行限售	75.00	90.76	127.00	9,525.00	11,526.52	-

688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	首次公开发行限售	10.68	12.34	929.00	9,921.72	11,463.86	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	首次公开发行限售	46.16	35.72	319.00	14,725.04	11,394.68	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	首次公开发行限售	21.86	23.85	472.00	10,317.92	11,257.20	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	首次公开发行限售	16.24	16.95	663.00	10,767.12	11,237.85	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	首次公开发行限售	21.17	23.50	471.00	9,971.07	11,068.50	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	首次公开发行限售	11.18	14.59	747.00	8,351.46	10,898.73	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	首次公开发行限售	12.10	12.07	898.00	10,865.80	10,838.86	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	首次公开发行限售	14.16	16.21	659.00	9,331.44	10,682.39	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	125.80	118.03	89.00	11,196.20	10,504.67	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	首次公开发行限售	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	首次公开发行限售	57.66	57.66	180.00	10,378.80	10,378.80	-

30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	19.99	19.99	513.0 0	10,25 4.87	10,25 4.87	-
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开发 行 限售	20.92	19.16	534.0 0	11,17 1.28	10,23 1.44	-
30130 3	真兰 仪表	2023- 02-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.80	22.32	455.0 0	12,19 4.00	10,15 5.60	-
00128 7	中电 港	2023- 03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	11.88	21.02	480.0 0	5,702 .40	10,08 9.60	-
30133 2	德尔 玛	2023- 05-09	6 个月	首次 公开发 行 限售	14.81	13.73	713.0 0	10,55 9.53	9,789 .49	-
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.66	31.50	304.0 0	8,104 .64	9,576 .00	-
30124 6	宏源 药业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	50.00	30.71	311.0 0	15,55 0.00	9,550 .81	-
30130 5	朗坤 环境	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.25	19.69	481.0 0	12,14 5.25	9,470 .89	-
30135 5	南王 科技	2023- 06-02	6 个月	首次 公开发 行 限售	17.55	16.75	563.0 0	9,880 .65	9,430 .25	-
30114 1	中科 磁业	2023- 03-27	6 个月	首次 公开发 行 限售	41.20	42.69	218.0 0	8,981 .60	9,306 .42	-
30135 7	北方 长龙	2023- 04-11	6 个月	首次 公开发 行 限售	50.00	48.39	187.0 0	9,350 .00	9,048 .93	-

301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	首次公开发行限售	72.50	58.42	152.00	11,020.00	8,879.84	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	首次公开发行限售	39.06	39.36	214.00	8,358.84	8,423.04	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	首次公开发行限售	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发行限售	34.00	34.93	228.00	7,752.00	7,964.04	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	首次公开发行限售	25.28	29.87	264.00	6,673.92	7,885.68	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	首次公开发行限售	33.99	29.49	266.00	9,041.34	7,844.34	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	首次公开发行限售	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	首次公开发行限售	33.73	31.85	242.00	8,162.66	7,707.70	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	首次公开发行限售	87.10	53.24	143.00	12,455.45	7,613.32	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	首次公开发行限售	36.90	36.90	198.00	7,306.20	7,306.20	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	首次公开发行限售	46.13	34.40	210.00	9,687.30	7,224.00	-

301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	首次公开发售	29.99	23.79	299.00	8,967.01	7,113.21	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	首次公开发售	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	首次公开发售	6.58	7.58	911.00	5,994.38	6,905.38	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	首次公开发售	19.99	16.90	355.00	7,096.45	5,999.50	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	首次公开发售	17.80	17.89	322.00	5,731.60	5,760.58	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	首次公开发售	28.84	30.78	170.00	4,902.80	5,232.60	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	首次公开发售	73.45	46.64	103.00	7,565.35	4,803.92	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	首次公开发售	11.66	12.26	297.00	3,463.02	3,641.22	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	首次公开发售	27.93	33.03	105.00	2,932.65	3,468.15	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	首次公开发售	20.68	25.49	135.00	2,791.80	3,441.15	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	首次公开发售	10.36	11.84	289.00	2,994.04	3,421.76	-

603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	首次公开发行限售	25.98	24.53	104.00	2,701.92	2,551.12	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	首次公开发行限售	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	首次公开发行限售	15.38	14.87	155.00	2,383.90	2,304.85	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	首次公开发行限售	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	首次公开发行限售	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	首次公开发行限售	14.58	16.13	122.00	1,778.76	1,967.86	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118036	力合转债	2023-06-28	16 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	90.00	9,000.00	9,000.18	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
03333	中国恒大	2023-06-30	重大事项停牌	1.52	2023-08-28	0.20	65,000.00	89,056.70	98,882.36	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。

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

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

6.4.9.2 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。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,594,319.73	-
合计	8,594,319.73	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 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 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	9,000.18	1,223.00
未评级	-	-
合计	9,000.18	1,223.00

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

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

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

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进

行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,895,791.16	-	-	-	16,895,791

					.16
结算备付金	6,402,148.95	-	-	-	6,402,148.95
存出保证金	180,422.02	-	-	1,159,891.20	1,340,313.22
交易性金融资产	8,594,319.73	-	9,000.18	279,732,578.80	288,335,898.71
应收清算款	-	-	-	154,161.56	154,161.56
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	6,751.05	6,751.05
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,072,681.86	-	9,000.18	281,053,382.61	313,135,064.65
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,507.24	3,507.24
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	405,438.45	405,438.45
应付托管费	-	-	-	67,573.06	67,573.06
应付销售服务费	-	-	-	56,362.69	56,362.69
应交税费	-	-	-	2.90	2.90
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,899,611.99	1,899,611.99
负债总计	-	-	-	2,432,496.33	2,432,496.33
利率敏感度缺口	32,072,681.86	-	9,000.18	278,620,886.28	310,702,568.32
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	34,315,271.99	-	-	-	34,315,271.99
结算备付金	6,316,058.87	-	-	-	6,316,058.87
存出保证金	65,153.82	-	-	1,240,574.40	1,305,728.22
交易性金融资产	-	-	1,223.00	207,071,073.69	207,072,296.69
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	19,638.79	19,638.79
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	40,696,484.68	-	1,223.00	208,331,286.88	249,028,994.56
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9,526.01	9,526.01
应付清算款	-	-	-	14,957,876.83	14,957,876.83
应付管理人报酬	-	-	-	289,492.17	289,492.17
应付托管费	-	-	-	48,248.68	48,248.68
应付销售服务费	-	-	-	7,535.86	7,535.86
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,254,631.46	1,254,631.46
负债总计	-	-	-	16,567,311.01	16,567,311.01
利率敏感度缺口	40,696,484.68	-	1,223.00	191,763,975.87	232,461,683.55

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 1	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 1	-

注：上年度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。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	98,882.36	98,882.36
资产合计	-	98,882.36	98,882.36
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	98,882.36	98,882.36
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	95,803.21	95,803.21
资产合计	-	95,803.21	95,803.21
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	95,803.21	95,803.21

6.4.9.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1. 所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 0	增加约 0
2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 0	减少约 0	

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

响。

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	279,732,578.80	90.03	207,071,073.69	89.08
交易性金融资产—债券投资	9,000.18	0.00	1,223.00	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	279,741,578.98	90.04	207,072,296.69	89.08

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为0。

6.4.9.4.3.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约1,371	增加约1,040
	业绩比较基准下降5%	减少约1,371	减少约1,040

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 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 2023年6月30日
第一层次	278,107,701.96
第二层次	9,338,325.00
第三层次	889,871.75
合计	288,335,898.71

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	279,732,578.80	89.33
	其中：股票	279,732,578.80	89.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,603,319.91	2.75
	其中：债券	8,603,319.91	2.75
	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	23,297,940.11	7.44
8	其他各项资产	1,501,225.83	0.48
9	合计	313,135,064.65	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 98,882.36 元，净值占比 0.03%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,429,305.00	0.46
B	采矿业	8,523,582.00	2.74
C	制造业	165,366,249.98	53.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,879,098.08	4.15
E	建筑业	9,895,802.53	3.18
F	批发和零售业	6,281,380.77	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	11,147,206.40	3.59
H	住宿和餐饮业	37,488.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,500,482.19	6.92
J	金融业	30,337,425.70	9.76
K	房地产业	1,190,480.00	0.38
L	租赁和商务服务业	4,224,199.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	1,887,783.04	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	2,372,869.89	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	753,886.86	0.24
R	文化、体育和娱乐业	1,806,457.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	279,633,696.44	90.00

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	98,882.36	0.03
合计	98,882.36	0.03

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	370,600	5,799,890.00	1.87
2	600519	贵州茅台	2,200	3,720,200.00	1.20
3	601318	中国平安	78,300	3,633,120.00	1.17
4	600060	海信视像	141,900	3,512,025.00	1.13
5	002011	盾安环境	250,302	3,461,676.66	1.11
6	600011	华能国际	357,500	3,310,450.00	1.07
7	600900	长江电力	143,918	3,174,831.08	1.02
8	603345	安井食品	19,700	2,891,960.00	0.93
9	600028	中国石化	440,200	2,799,672.00	0.90
10	002027	分众传媒	394,900	2,689,269.00	0.87
11	600050	中国联通	532,800	2,557,440.00	0.82
12	601336	新华保险	67,500	2,481,975.00	0.80
13	300274	阳光电源	20,900	2,437,567.00	0.78
14	000063	中兴通讯	53,400	2,431,836.00	0.78
15	600015	华夏银行	436,800	2,363,088.00	0.76
16	601728	中国电信	416,600	2,345,458.00	0.75
17	601668	中国建筑	396,100	2,273,614.00	0.73
18	300750	宁德时代	9,920	2,269,596.80	0.73
19	603338	浙江鼎力	40,300	2,257,203.00	0.73
20	688630	芯碁微装	26,700	2,243,334.00	0.72
21	603298	杭叉集团	89,900	2,117,145.00	0.68
22	688556	高测股份	39,200	2,083,088.00	0.67
23	300771	智莱科技	185,900	2,024,451.00	0.65
24	600612	老凤祥	28,900	2,019,532.00	0.65
25	603197	保隆科技	36,900	2,001,825.00	0.64
26	601857	中国石油	259,200	1,936,224.00	0.62
27	002568	百润股份	53,200	1,933,820.00	0.62
28	300811	铂科新材	32,100	1,908,024.00	0.61
29	002555	三七互娱	54,600	1,904,448.00	0.61
30	002959	小熊电器	22,300	1,862,050.00	0.60
31	000858	五粮液	11,200	1,831,984.00	0.59
32	603027	千禾味业	86,400	1,824,768.00	0.59
33	301003	江苏博云	78,590	1,816,214.90	0.58
34	301042	安联锐视	53,300	1,809,535.00	0.58
35	300743	天地数码	115,000	1,807,800.00	0.58
36	300896	爱美客	4,000	1,779,800.00	0.57
37	601816	京沪高铁	330,600	1,738,956.00	0.56
38	300543	朗科智能	172,928	1,710,257.92	0.55
39	000333	美的集团	28,565	1,683,049.80	0.54
40	301101	明月镜片	40,600	1,665,818.00	0.54
41	002603	以岭药业	64,200	1,649,298.00	0.53

42	600419	天润乳业	95,800	1,553,876.00	0.50
43	603657	春光科技	85,200	1,495,260.00	0.48
44	600919	江苏银行	200,642	1,474,718.70	0.47
45	300532	今天国际	71,100	1,461,816.00	0.47
46	002352	顺丰控股	32,000	1,442,880.00	0.46
47	002415	海康威视	43,200	1,430,352.00	0.46
48	603706	东方环宇	95,000	1,429,750.00	0.46
49	000548	湖南投资	295,300	1,429,252.00	0.46
50	601390	中国中铁	178,400	1,352,272.00	0.44
51	600941	中国移动	14,400	1,343,520.00	0.43
52	002105	信隆健康	225,200	1,339,940.00	0.43
53	600356	恒丰纸业	170,000	1,331,100.00	0.43
54	002136	安纳达	116,900	1,330,322.00	0.43
55	603102	百合股份	30,700	1,325,933.00	0.43
56	601818	光大银行	427,800	1,313,346.00	0.42
57	002722	物产金轮	94,500	1,310,715.00	0.42
58	605088	冠盛股份	75,900	1,301,685.00	0.42
59	603585	苏利股份	86,500	1,287,120.00	0.41
60	603810	丰山集团	92,600	1,275,102.00	0.41
61	601229	上海银行	219,900	1,264,425.00	0.41
62	601825	沪农商行	227,300	1,238,785.00	0.40
63	603600	永艺股份	127,700	1,214,427.00	0.39
64	600089	特变电工	53,000	1,181,370.00	0.38
65	601997	贵阳银行	222,800	1,149,648.00	0.37
66	601077	渝农商行	319,700	1,147,723.00	0.37
67	603788	宁波高发	92,880	1,144,281.60	0.37
68	601288	农业银行	322,400	1,138,072.00	0.37
69	002230	科大讯飞	16,600	1,128,136.00	0.36
70	002475	立讯精密	33,900	1,100,055.00	0.35
71	000725	京东方 A	254,000	1,038,860.00	0.33
72	601186	中国铁建	102,300	1,007,655.00	0.32
73	603767	中马传动	64,360	995,005.60	0.32
74	601985	中国核电	135,200	953,160.00	0.31
75	601398	工商银行	197,500	951,950.00	0.31
76	000651	格力电器	25,500	931,005.00	0.30
77	300413	芒果超媒	26,400	903,144.00	0.29
78	601328	交通银行	153,123	888,113.40	0.29
79	603757	大元泵业	28,600	853,424.00	0.27
80	002594	比亚迪	3,300	852,291.00	0.27
81	688569	铁科轨道	19,868	835,846.76	0.27
82	600016	民生银行	221,800	831,750.00	0.27
83	300314	戴维医疗	38,800	820,232.00	0.26
84	000997	新大陆	42,400	801,360.00	0.26

85	688305	科德数控	7,984	800,475.84	0.26
86	601899	紫金矿业	70,000	795,900.00	0.26
87	603926	铁流股份	76,500	782,595.00	0.25
88	601669	中国电建	135,600	778,344.00	0.25
89	300951	博硕科技	14,200	775,746.00	0.25
90	601333	广深铁路	194,700	771,012.00	0.25
91	603676	卫信康	55,400	765,628.00	0.25
92	600905	三峡能源	142,300	764,151.00	0.25
93	002478	常宝股份	101,700	757,665.00	0.24
94	600858	银座股份	125,300	756,812.00	0.24
95	300970	华绿生物	32,200	752,192.00	0.24
96	600276	恒瑞医药	15,400	737,660.00	0.24
97	301103	何氏眼科	17,400	730,104.00	0.23
98	603199	九华旅游	21,000	725,550.00	0.23
99	600197	伊力特	26,500	720,005.00	0.23
100	601138	工业富联	28,400	715,680.00	0.23
101	600030	中信证券	35,920	710,497.60	0.23
102	300515	三德科技	43,500	701,220.00	0.23
103	601012	隆基绿能	24,300	696,681.00	0.22
104	301257	普蕊斯	12,300	691,260.00	0.22
105	300058	蓝色光标	70,400	680,768.00	0.22
106	300059	东方财富	47,140	669,388.00	0.22
107	600887	伊利股份	23,500	665,520.00	0.21
108	601618	中国中冶	166,800	662,196.00	0.21
109	600000	浦发银行	90,300	653,772.00	0.21
110	300121	阳谷华泰	68,400	653,220.00	0.21
111	601919	中远海控	68,200	641,080.00	0.21
112	002493	荣盛石化	53,600	623,904.00	0.20
113	603071	物产环能	37,300	618,807.00	0.20
114	601117	中国化学	74,200	614,376.00	0.20
115	300389	艾比森	29,500	600,915.00	0.19
116	300624	万兴科技	5,100	597,465.00	0.19
117	000822	山东海化	87,300	594,513.00	0.19
118	300639	凯普生物	59,300	594,186.00	0.19
119	300787	海能实业	29,800	587,060.00	0.19
120	000568	泸州老窖	2,800	586,796.00	0.19
121	300815	玉禾田	39,000	580,320.00	0.19
122	600309	万华化学	6,600	579,744.00	0.19
123	000906	浙商中拓	64,100	571,772.00	0.18
124	300760	迈瑞医疗	1,900	569,620.00	0.18
125	688111	金山办公	1,200	566,664.00	0.18
126	000301	东方盛虹	47,200	557,904.00	0.18
127	301150	中一科技	11,050	552,610.50	0.18

128	300968	格林精密	61,600	547,624.00	0.18
129	300109	新开源	21,700	539,679.00	0.17
130	600346	恒力石化	37,200	533,076.00	0.17
131	002533	金杯电工	64,100	523,056.00	0.17
132	300231	银信科技	58,100	517,671.00	0.17
133	600406	国电南瑞	22,280	514,668.00	0.17
134	601916	浙商银行	193,700	511,368.00	0.16
135	600438	通威股份	14,800	507,788.00	0.16
136	300909	汇创达	19,200	507,264.00	0.16
137	605258	协和电子	19,500	506,610.00	0.16
138	301160	翔楼新材	14,400	506,160.00	0.16
139	600009	上海机场	11,100	504,162.00	0.16
140	300230	永利股份	141,700	501,618.00	0.16
141	600570	恒生电子	11,300	500,477.00	0.16
142	688981	中芯国际	9,800	495,096.00	0.16
143	300976	达瑞电子	9,700	491,790.00	0.16
144	600073	上海梅林	66,900	488,370.00	0.16
145	000972	中基健康	143,600	486,804.00	0.16
146	003019	宸展光电	23,530	482,365.00	0.16
147	601006	大秦铁路	64,100	476,263.00	0.15
148	300124	汇川技术	7,400	475,154.00	0.15
149	603259	药明康德	7,500	467,325.00	0.15
150	002952	亚世光电	26,100	462,753.00	0.15
151	600741	华域汽车	24,500	452,270.00	0.15
152	300155	安居宝	89,000	448,560.00	0.14
153	002938	鹏鼎控股	18,400	446,936.00	0.14
154	300162	雷曼光电	63,600	446,472.00	0.14
155	601868	中国能建	190,100	444,834.00	0.14
156	601168	西部矿业	41,900	440,369.00	0.14
157	002394	联发股份	51,600	439,116.00	0.14
158	603326	我乐家居	55,200	431,112.00	0.14
159	605189	富春染织	26,200	429,942.00	0.14
160	600273	嘉化能源	45,500	428,610.00	0.14
161	001218	丽臣实业	18,900	427,329.00	0.14
162	000938	紫光股份	13,400	426,790.00	0.14
163	601601	中国太保	16,300	423,474.00	0.14
164	688511	天微电子	12,371	421,851.10	0.14
165	600886	国投电力	33,000	417,450.00	0.13
166	603095	越剑智能	27,000	417,150.00	0.13
167	601766	中国中车	64,100	416,650.00	0.13
168	600051	宁波联合	56,800	413,504.00	0.13
169	003816	中国广核	131,500	408,965.00	0.13
170	601888	中国中免	3,700	408,961.00	0.13

171	002179	中航光电	8,940	405,429.00	0.13
172	603178	圣龙股份	32,700	402,864.00	0.13
173	603368	柳药集团	15,800	390,418.00	0.13
174	603898	好莱客	39,400	382,968.00	0.12
175	300295	三六五网	30,900	382,233.00	0.12
176	000885	城发环境	28,700	381,997.00	0.12
177	688393	安必平	11,400	381,900.00	0.12
178	600795	国电电力	99,400	380,702.00	0.12
179	002106	莱宝高科	44,500	378,250.00	0.12
180	601231	环旭电子	25,200	376,992.00	0.12
181	003015	日久光电	39,800	376,906.00	0.12
182	601699	潞安环能	23,000	375,360.00	0.12
183	300818	耐普矿机	15,500	368,125.00	0.12
184	003008	开普检测	12,800	367,744.00	0.12
185	000933	神火股份	28,100	365,300.00	0.12
186	300650	太龙股份	26,900	362,074.00	0.12
187	603266	天龙股份	25,900	360,269.00	0.12
188	000625	长安汽车	27,800	359,454.00	0.12
189	002410	广联达	11,060	359,339.40	0.12
190	688069	德林海	16,900	358,956.00	0.12
191	301032	新柴股份	39,900	357,105.00	0.11
192	301107	瑜欣电子	10,300	356,998.00	0.11
193	600218	全柴动力	39,800	356,608.00	0.11
194	688303	大全能源	8,800	355,960.00	0.11
195	688011	新光光电	13,700	353,734.00	0.11
196	002748	世龙实业	38,600	352,804.00	0.11
197	603937	丽岛新材	30,400	352,336.00	0.11
198	002981	朝阳科技	14,600	351,860.00	0.11
199	601717	郑煤机	28,200	351,090.00	0.11
200	002998	优彩资源	49,400	350,740.00	0.11
201	603321	梅轮电梯	45,000	350,550.00	0.11
202	600035	楚天高速	85,800	350,064.00	0.11
203	301002	崧盛股份	16,900	348,816.00	0.11
204	002787	华源控股	48,100	348,725.00	0.11
205	688571	杭华股份	55,200	348,312.00	0.11
206	600284	浦东建设	56,900	348,228.00	0.11
207	002774	快意电梯	43,800	348,210.00	0.11
208	688026	洁特生物	19,000	347,130.00	0.11
209	603036	如通股份	32,800	347,024.00	0.11
210	600269	赣粤高速	94,500	346,815.00	0.11
211	002809	红墙股份	32,100	346,680.00	0.11
212	600894	广日股份	46,000	346,380.00	0.11
213	300889	爱克股份	23,100	345,807.00	0.11

214	301106	骏成科技	9,700	345,514.00	0.11
215	600033	福建高速	110,300	345,239.00	0.11
216	300371	汇中股份	26,300	344,530.00	0.11
217	002479	富春环保	73,900	344,374.00	0.11
218	600368	五洲交通	94,600	344,344.00	0.11
219	002566	益盛药业	41,300	343,616.00	0.11
220	300808	久量股份	25,400	342,900.00	0.11
221	603150	万朗磁塑	13,000	342,680.00	0.11
222	002743	富煌钢构	59,500	342,125.00	0.11
223	603928	兴业股份	28,300	341,581.00	0.11
224	300932	三友联众	22,100	341,224.00	0.11
225	001219	青岛食品	18,700	341,088.00	0.11
226	002696	百洋股份	54,600	340,704.00	0.11
227	000705	浙江震元	42,300	340,515.00	0.11
228	300789	唐源电气	16,500	340,230.00	0.11
229	605177	东亚药业	13,800	340,032.00	0.11
230	301182	凯旺科技	14,800	339,956.00	0.11
231	300519	新光药业	21,200	339,624.00	0.11
232	600128	弘业股份	41,300	339,486.00	0.11
233	000731	四川美丰	41,600	339,040.00	0.11
234	000498	山东路桥	52,800	338,976.00	0.11
235	600971	恒源煤电	43,500	338,865.00	0.11
236	688335	复洁环保	13,779	338,136.66	0.11
237	688288	鸿泉物联	13,300	338,086.00	0.11
238	600513	联环药业	34,900	337,134.00	0.11
239	601666	平煤股份	44,700	337,038.00	0.11
240	600969	郴电国际	45,100	336,897.00	0.11
241	600742	一汽富维	41,100	336,609.00	0.11
242	000707	双环科技	39,600	336,600.00	0.11
243	002462	嘉事堂	24,600	336,528.00	0.11
244	002702	海欣食品	64,100	336,525.00	0.11
245	600097	开创国际	35,300	336,409.00	0.11
246	603903	中持股份	37,600	336,144.00	0.11
247	000619	海螺新材	55,100	336,110.00	0.11
248	002049	紫光国微	3,600	335,700.00	0.11
249	603681	永冠新材	23,500	335,580.00	0.11
250	605567	春雪食品	26,100	334,863.00	0.11
251	300462	华铭智能	28,500	334,590.00	0.11
252	603726	朗迪集团	26,400	334,224.00	0.11
253	600985	淮北矿业	29,000	334,080.00	0.11
254	600830	香溢融通	54,600	333,606.00	0.11
255	603214	爱婴室	20,500	333,535.00	0.11
256	688217	睿昂基因	8,300	333,245.00	0.11

257	002492	恒基达鑫	57,900	332,925.00	0.11
258	002133	广宇集团	97,900	331,881.00	0.11
259	002091	江苏国泰	43,900	331,006.00	0.11
260	603019	中科曙光	6,500	330,850.00	0.11
261	600502	安徽建工	62,300	328,944.00	0.11
262	000823	超声电子	34,600	328,008.00	0.11
263	002910	庄园牧场	29,800	327,800.00	0.11
264	605151	西上海	18,000	327,600.00	0.11
265	600674	川投能源	21,700	326,585.00	0.11
266	603602	纵横通信	26,400	324,456.00	0.10
267	601088	中国神华	10,500	322,875.00	0.10
268	301218	华是科技	13,800	322,782.00	0.10
269	300242	佳云科技	93,300	321,885.00	0.10
270	300076	GQY 视讯	63,100	321,810.00	0.10
271	000529	广弘控股	50,500	321,180.00	0.10
272	600039	四川路桥	32,680	320,590.80	0.10
273	605287	德才股份	13,400	317,580.00	0.10
274	600873	梅花生物	35,000	312,550.00	0.10
275	000421	南京公用	57,400	309,960.00	0.10
276	688329	艾隆科技	9,466	306,698.40	0.10
277	600845	宝信软件	5,900	299,779.00	0.10
278	600029	南方航空	47,680	287,510.40	0.09
279	300363	博腾股份	9,700	287,023.00	0.09
280	002371	北方华创	900	285,885.00	0.09
281	600115	中国东航	59,900	285,124.00	0.09
282	601360	三六零	22,200	278,388.00	0.09
283	000977	浪潮信息	5,700	276,450.00	0.09
284	603501	韦尔股份	2,800	274,512.00	0.09
285	600271	航天信息	20,000	273,800.00	0.09
286	300454	深信服	2,400	271,800.00	0.09
287	601111	中国国航	30,800	253,792.00	0.08
288	600019	宝钢股份	44,800	251,776.00	0.08
289	002811	郑中设计	31,300	248,209.00	0.08
290	600588	用友网络	12,000	246,000.00	0.08
291	002887	绿茵生态	26,900	244,521.00	0.08
292	603986	兆易创新	2,300	244,375.00	0.08
293	600582	天地科技	41,700	243,111.00	0.08
294	300621	维业股份	24,100	241,241.00	0.08
295	300628	亿联网络	6,840	239,878.80	0.08
296	002789	建艺集团	16,300	236,839.00	0.08
297	300117	嘉寓股份	75,800	234,980.00	0.08
298	688012	中微公司	1,500	234,675.00	0.08
299	002365	永安药业	23,900	232,786.00	0.07

300	600096	云天化	13,500	230,445.00	0.07
301	600233	圆通速递	15,800	230,048.00	0.07
302	002056	横店东磁	12,300	223,983.00	0.07
303	600180	瑞茂通	37,300	223,054.00	0.07
304	601567	三星医疗	17,200	217,236.00	0.07
305	603886	元祖股份	11,700	214,578.00	0.07
306	600998	九州通	20,413	211,886.94	0.07
307	300033	同花顺	1,200	210,336.00	0.07
308	600131	国网信通	10,400	209,976.00	0.07
309	000100	TCL 科技	52,000	204,880.00	0.07
310	002432	九安医疗	5,700	200,697.00	0.06
311	688289	圣湘生物	11,802	198,745.68	0.06
312	600460	士兰微	6,500	196,755.00	0.06
313	601021	春秋航空	3,400	195,398.00	0.06
314	600662	外服控股	34,000	194,480.00	0.06
315	600153	建发股份	17,700	193,107.00	0.06
316	600141	兴发集团	8,600	191,092.00	0.06
317	300433	蓝思科技	16,100	189,336.00	0.06
318	000034	神州数码	7,100	188,789.00	0.06
319	603185	弘元绿能	2,500	186,375.00	0.06
320	600879	航天电子	21,700	184,233.00	0.06
321	300496	中科创达	1,900	183,065.00	0.06
322	603360	百傲化学	18,020	182,722.80	0.06
323	603556	海兴电力	7,200	181,728.00	0.06
324	001696	宗申动力	25,300	179,124.00	0.06
325	601872	招商轮船	29,800	172,542.00	0.06
326	603290	斯达半导	800	172,160.00	0.06
327	600048	保利发展	13,200	171,996.00	0.06
328	600803	新奥股份	9,000	170,820.00	0.05
329	000002	万科 A	12,000	168,240.00	0.05
330	300747	锐科激光	5,500	167,640.00	0.05
331	603758	秦安股份	15,700	167,048.00	0.05
332	600704	物产中大	33,800	166,972.00	0.05
333	601808	中海油服	12,000	166,560.00	0.05
334	002025	航天电器	2,500	159,500.00	0.05
335	600018	上港集团	30,300	159,075.00	0.05
336	300927	江天化学	9,500	155,515.00	0.05
337	688396	华润微	2,967	155,500.47	0.05
338	600587	新华医疗	4,400	155,452.00	0.05
339	688008	澜起科技	2,700	155,034.00	0.05
340	603506	南都物业	13,000	153,790.00	0.05
341	002737	葵花药业	6,300	153,342.00	0.05
342	002955	鸿合科技	6,500	153,075.00	0.05

343	688085	三友医疗	5,790	152,045.40	0.05
344	603508	思维列控	8,900	151,745.00	0.05
345	301119	正强股份	5,700	151,620.00	0.05
346	603787	新日股份	9,000	151,290.00	0.05
347	600082	海泰发展	48,000	151,200.00	0.05
348	000014	沙河股份	13,200	151,008.00	0.05
349	600584	长电科技	4,800	149,616.00	0.05
350	002932	明德生物	5,772	149,437.08	0.05
351	301291	明阳电气	4,589	148,880.77	0.05
352	300509	新美星	19,700	148,735.00	0.05
353	605033	美邦股份	7,900	147,730.00	0.05
354	002192	融捷股份	2,200	147,026.00	0.05
355	688036	传音控股	1,000	147,000.00	0.05
356	600745	闻泰科技	3,000	146,700.00	0.05
357	600837	海通证券	15,900	146,598.00	0.05
358	688299	长阳科技	9,347	146,467.49	0.05
359	001210	金房能源	6,500	145,990.00	0.05
360	601988	中国银行	37,300	145,843.00	0.05
361	002241	歌尔股份	8,200	145,550.00	0.05
362	002063	远光软件	16,700	144,956.00	0.05
363	002022	科华生物	13,400	142,040.00	0.05
364	603171	税友股份	3,500	139,930.00	0.05
365	000852	石化机械	19,300	138,767.00	0.04
366	688060	云涌科技	2,484	136,868.40	0.04
367	002543	万和电气	17,300	136,843.00	0.04
368	300523	辰安科技	5,700	136,002.00	0.04
369	000830	鲁西化工	12,800	135,168.00	0.04
370	301395	仁信新材	5,066	135,160.88	0.04
371	300408	三环集团	4,600	135,010.00	0.04
372	601688	华泰证券	9,700	133,569.00	0.04
373	603967	中创物流	14,600	133,444.00	0.04
374	688138	清溢光电	6,300	132,993.00	0.04
375	600320	振华重工	35,300	131,669.00	0.04
376	002929	润建股份	3,000	130,230.00	0.04
377	603950	长源东谷	8,700	130,152.00	0.04
378	600875	东方电气	6,900	128,685.00	0.04
379	603220	中贝通信	7,500	127,875.00	0.04
380	000049	德赛电池	3,600	127,008.00	0.04
381	300782	卓胜微	1,300	125,619.00	0.04
382	600025	华能水电	17,600	125,488.00	0.04
383	002120	韵达股份	13,000	124,280.00	0.04
384	002139	拓邦股份	9,500	123,975.00	0.04
385	603118	共进股份	9,300	123,597.00	0.04

386	688080	映翰通	2,520	123,228.00	0.04
387	600755	厦门国贸	15,900	123,066.00	0.04
388	002660	茂硕电源	12,700	122,301.00	0.04
389	301210	金杨股份	2,381	121,700.49	0.04
390	002180	纳思达	3,500	119,875.00	0.04
391	000400	许继电气	5,200	119,860.00	0.04
392	601658	邮储银行	24,500	119,805.00	0.04
393	301086	鸿富瀚	2,350	119,145.00	0.04
394	601169	北京银行	25,600	118,528.00	0.04
395	600498	烽火通信	5,800	118,146.00	0.04
396	601600	中国铝业	21,500	118,035.00	0.04
397	301050	雷电微力	1,800	116,874.00	0.04
398	688093	世华科技	5,800	116,348.00	0.04
399	300667	必创科技	5,900	116,171.00	0.04
400	603369	今世缘	2,200	116,160.00	0.04
401	300127	银河磁体	6,400	116,032.00	0.04
402	002389	航天彩虹	5,200	115,492.00	0.04
403	600517	国网英大	20,200	115,140.00	0.04
404	601225	陕西煤业	6,300	114,597.00	0.04
405	605378	野马电池	4,900	114,219.00	0.04
406	002141	贤丰控股	34,600	113,834.00	0.04
407	002402	和而泰	6,700	113,766.00	0.04
408	002724	海洋王	13,100	113,708.00	0.04
409	300627	华测导航	3,500	113,645.00	0.04
410	002635	安洁科技	8,200	113,160.00	0.04
411	688188	柏楚电子	600	113,136.00	0.04
412	002609	捷顺科技	9,700	113,102.00	0.04
413	002893	京能热力	10,500	113,085.00	0.04
414	002484	江海股份	5,300	112,837.00	0.04
415	603529	爱玛科技	3,500	112,770.00	0.04
416	002600	领益智造	16,300	112,633.00	0.04
417	603859	能科科技	2,200	112,486.00	0.04
418	002017	东信和平	8,560	112,221.60	0.04
419	002976	瑞玛精密	4,000	111,880.00	0.04
420	002782	可立克	7,300	111,617.00	0.04
421	600702	舍得酒业	900	111,555.00	0.04
422	600363	联创光电	3,000	111,300.00	0.04
423	600580	卧龙电驱	7,600	111,036.00	0.04
424	002937	兴瑞科技	4,500	110,700.00	0.04
425	688522	纳睿雷达	2,149	110,673.50	0.04
426	601211	国泰君安	7,900	110,521.00	0.04
427	300219	鸿利智汇	15,000	110,250.00	0.04
428	300032	金龙机电	17,400	109,968.00	0.04

429	301117	佳缘科技	1,700	109,854.00	0.04
430	688516	奥特维	582	109,648.80	0.04
431	000048	京基智农	5,600	109,312.00	0.04
432	002322	理工能科	10,501	109,210.40	0.04
433	300718	长盛轴承	4,900	109,025.00	0.04
434	688007	光峰科技	5,225	108,941.25	0.04
435	002273	水晶光电	9,100	108,654.00	0.03
436	605123	派克新材	1,000	108,650.00	0.03
437	002583	海能达	18,700	108,647.00	0.03
438	600288	大恒科技	9,000	108,630.00	0.03
439	300136	信维通信	5,400	108,432.00	0.03
440	002947	恒铭达	5,200	108,368.00	0.03
441	600373	中文传媒	8,100	107,892.00	0.03
442	688002	睿创微纳	2,400	107,520.00	0.03
443	002512	达华智能	26,800	107,468.00	0.03
444	603989	艾华集团	5,100	107,406.00	0.03
445	000020	深华发 A	9,200	106,444.00	0.03
446	603103	横店影视	6,300	106,092.00	0.03
447	600596	新安股份	9,700	106,021.00	0.03
448	002851	麦格米特	2,900	105,763.00	0.03
449	000786	北新建材	4,300	105,393.00	0.03
450	688568	中科星图	1,300	104,754.00	0.03
451	002236	大华股份	5,300	104,675.00	0.03
452	002131	利欧股份	45,500	104,650.00	0.03
453	600353	旭光电子	12,760	104,632.00	0.03
454	605111	新洁能	2,400	104,448.00	0.03
455	300319	麦捷科技	12,200	104,432.00	0.03
456	300352	北信源	20,700	104,328.00	0.03
457	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
458	600637	东方明珠	13,300	104,006.00	0.03
459	301486	致尚科技	1,796	103,557.36	0.03
460	300300	海峡创新	24,100	103,389.00	0.03
461	601939	建设银行	16,500	103,290.00	0.03
462	002990	盛视科技	2,800	103,040.00	0.03
463	002467	二六三	20,700	102,879.00	0.03
464	688711	宏微科技	1,760	102,678.40	0.03
465	300872	天阳科技	6,600	102,564.00	0.03
466	000570	苏常柴 A	18,400	102,488.00	0.03
467	301292	海科新源	5,125	102,448.75	0.03
468	600571	信雅达	11,200	102,368.00	0.03
469	002421	达实智能	29,000	102,080.00	0.03
470	600576	祥源文旅	12,800	102,016.00	0.03
471	603096	新经典	5,000	101,800.00	0.03

472	600215	派斯林	11,900	101,745.00	0.03
473	300941	创识科技	5,000	101,700.00	0.03
474	600761	安徽合力	5,100	101,643.00	0.03
475	600132	重庆啤酒	1,100	101,376.00	0.03
476	002912	中新赛克	2,300	101,223.00	0.03
477	300724	捷佳伟创	900	101,115.00	0.03
478	603040	新坐标	3,800	101,042.00	0.03
479	002829	星网宇达	2,300	101,039.00	0.03
480	002212	天融信	10,400	100,880.00	0.03
481	002987	京北方	4,600	100,832.00	0.03
482	600760	中航沈飞	2,240	100,800.00	0.03
483	002152	广电运通	8,600	100,792.00	0.03
484	600229	城市传媒	11,800	100,536.00	0.03
485	688208	道通科技	3,300	100,023.00	0.03
486	603319	湘油泵	5,900	99,887.00	0.03
487	002698	博实股份	5,700	99,693.00	0.03
488	688033	天宜上佳	5,200	99,424.00	0.03
489	000811	冰轮环境	6,300	99,288.00	0.03
490	300316	晶盛机电	1,400	99,260.00	0.03
491	3333	中国恒大	65,000	98,882.36	0.03
492	603488	展鹏科技	12,300	98,769.00	0.03
493	603466	风语筑	7,100	98,690.00	0.03
494	002284	亚太股份	11,000	98,670.00	0.03
494	600372	中航电子	6,500	98,670.00	0.03
495	688508	芯朋微	1,700	98,583.00	0.03
496	002434	万里扬	11,000	98,450.00	0.03
497	688551	科威尔	1,500	98,370.00	0.03
498	688126	沪硅产业	4,700	98,230.00	0.03
499	603158	腾龙股份	12,800	98,048.00	0.03
500	002916	深南电路	1,300	97,981.00	0.03
501	688239	航宇科技	1,400	97,930.00	0.03
502	301039	中集车辆	7,400	97,902.00	0.03
503	603283	赛腾股份	2,200	97,900.00	0.03
504	600481	双良节能	7,000	97,860.00	0.03
505	688589	力合微	2,400	97,776.00	0.03
506	605167	利柏特	10,100	97,768.00	0.03
507	002526	山东矿机	39,100	97,750.00	0.03
508	002727	一心堂	3,700	97,680.00	0.03
509	000738	航发控制	4,000	97,600.00	0.03
510	002249	大洋电机	17,100	97,470.00	0.03
511	002073	软控股份	14,700	97,314.00	0.03
512	603279	景津装备	3,100	97,216.00	0.03
513	603129	春风动力	600	97,140.00	0.03

514	002129	TCL 中环	2,925	97,110.00	0.03
515	300251	光线传媒	12,000	97,080.00	0.03
516	300416	苏试试验	4,500	97,020.00	0.03
517	002611	东方精工	16,900	97,006.00	0.03
518	300304	云意电气	17,500	96,950.00	0.03
519	002448	中原内配	13,800	96,600.00	0.03
520	603628	清源股份	6,100	96,563.00	0.03
521	601100	恒立液压	1,500	96,495.00	0.03
522	002048	宁波华翔	7,200	96,480.00	0.03
523	603088	宁波精达	11,500	96,370.00	0.03
524	002283	天润工业	15,000	96,300.00	0.03
525	002885	京泉华	4,400	96,096.00	0.03
526	000951	中国重汽	5,700	96,045.00	0.03
527	600480	凌云股份	12,200	95,892.00	0.03
528	600379	宝光股份	9,400	95,880.00	0.03
529	600528	中铁工业	9,700	95,836.00	0.03
530	002454	松芝股份	11,300	95,711.00	0.03
531	300185	通裕重工	34,300	95,697.00	0.03
532	300861	美畅股份	2,200	95,414.00	0.03
533	300978	东箭科技	7,000	95,410.00	0.03
534	300435	中泰股份	6,600	95,304.00	0.03
535	002438	江苏神通	8,300	95,284.00	0.03
536	601009	南京银行	11,900	95,200.00	0.03
537	603881	数据港	4,200	94,878.00	0.03
538	002158	汉钟精机	3,800	94,848.00	0.03
539	000338	潍柴动力	7,600	94,696.00	0.03
540	603032	德新科技	2,740	94,639.60	0.03
541	603331	百达精工	6,400	94,592.00	0.03
542	688586	江航装备	6,800	94,588.00	0.03
543	300777	中简科技	2,000	94,520.00	0.03
544	002446	盛路通信	10,000	94,500.00	0.03
544	002706	良信股份	8,400	94,500.00	0.03
544	300004	南风股份	17,500	94,500.00	0.03
545	603895	天永智能	3,700	94,461.00	0.03
546	603012	创力集团	15,300	94,401.00	0.03
547	688128	中国电研	3,700	94,350.00	0.03
548	601222	林洋能源	11,500	94,185.00	0.03
549	603768	常青股份	5,300	94,181.00	0.03
550	601877	正泰电器	3,400	94,010.00	0.03
551	600815	厦工股份	34,800	93,960.00	0.03
552	603187	海容冷链	4,700	93,953.00	0.03
553	300354	东华测试	2,100	93,870.00	0.03
554	688257	新锐股份	3,540	93,845.40	0.03

555	301029	怡合达	2,100	93,828.00	0.03
556	000157	中联重科	13,900	93,825.00	0.03
557	603589	口子窖	1,900	93,765.00	0.03
558	002169	智光电气	11,300	93,677.00	0.03
559	688676	金盘科技	3,092	93,656.68	0.03
560	002270	华明装备	8,500	93,075.00	0.03
561	601319	中国人保	15,900	92,856.00	0.03
562	300745	欣锐科技	2,100	92,757.00	0.03
563	002690	美亚光电	3,600	92,700.00	0.03
564	601126	四方股份	6,100	92,659.00	0.03
565	600585	海螺水泥	3,900	92,586.00	0.03
566	301028	东亚机械	8,300	92,545.00	0.03
567	603301	振德医疗	3,100	91,822.00	0.03
568	600312	平高电气	7,400	91,686.00	0.03
569	600031	三一重工	5,500	91,465.00	0.03
570	603507	振江股份	2,500	90,650.00	0.03
571	002046	国机精工	7,100	90,596.00	0.03
572	000982	中银绒业	59,400	90,288.00	0.03
573	300390	天华新能	2,500	89,500.00	0.03
574	688599	天合光能	2,100	89,481.00	0.03
575	688561	奇安信	1,700	88,077.00	0.03
576	300661	圣邦股份	1,070	87,879.10	0.03
577	600482	中国动力	3,700	86,728.00	0.03
578	002335	科华数据	2,400	86,280.00	0.03
579	002649	博彦科技	6,100	86,193.00	0.03
580	300207	欣旺达	5,100	83,232.00	0.03
581	688006	杭可科技	2,720	82,878.40	0.03
582	600104	上汽集团	5,800	82,186.00	0.03
583	600970	中材国际	6,200	79,050.00	0.03
584	601702	华峰铝业	5,600	76,608.00	0.02
585	002351	漫步者	3,700	76,516.00	0.02
586	688009	中国通号	13,100	75,980.00	0.02
587	600057	厦门象屿	8,700	75,690.00	0.02
588	688187	时代电气	1,794	75,096.84	0.02
589	000776	广发证券	5,100	75,021.00	0.02
590	600325	华发股份	7,600	74,860.00	0.02
591	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
592	300223	北京君正	800	70,648.00	0.02
593	002281	光迅科技	1,900	70,471.00	0.02
594	600256	广汇能源	9,700	66,542.00	0.02
595	603551	奥普家居	5,100	65,943.00	0.02
596	002368	太极股份	1,600	65,872.00	0.02
597	600926	杭州银行	5,500	64,625.00	0.02

598	000719	中原传媒	5,500	64,350.00	0.02
599	002080	中材科技	3,100	63,612.00	0.02
600	601038	一拖股份	5,100	59,874.00	0.02
601	600583	海油工程	10,100	59,085.00	0.02
602	601998	中信银行	9,400	56,212.00	0.02
603	600536	中国软件	1,190	55,787.20	0.02
604	600183	生益科技	3,900	55,380.00	0.02
605	600938	中国海油	3,000	54,360.00	0.02
606	000860	顺鑫农业	1,500	50,535.00	0.02
607	600537	亿晶光电	6,600	50,424.00	0.02
608	601019	山东出版	5,400	49,518.00	0.02
609	000895	双汇发展	1,900	46,531.00	0.01
610	002544	普天科技	2,000	45,800.00	0.01
611	603688	石英股份	400	45,536.00	0.01
612	600378	昊华科技	1,200	45,168.00	0.01
613	601179	中国西电	8,300	44,903.00	0.01
614	000066	中国长城	3,200	44,256.00	0.01
615	688519	南亚新材	1,800	43,254.00	0.01
616	601611	中国核建	5,100	43,095.00	0.01
617	600511	国药股份	1,100	42,735.00	0.01
618	002736	国信证券	4,800	41,904.00	0.01
619	600188	兖矿能源	1,400	41,888.00	0.01
620	600968	海油发展	13,500	41,445.00	0.01
621	688399	硕世生物	741	40,903.20	0.01
622	600339	中油工程	9,900	40,293.00	0.01
623	688318	财富趋势	400	39,988.00	0.01
624	600118	中国卫星	1,400	39,494.00	0.01
625	688249	晶合集成	2,172	39,226.32	0.01
626	002739	万达电影	3,100	38,874.00	0.01
627	603823	百合花	3,100	38,440.00	0.01
628	600818	中路股份	1,800	38,088.00	0.01
629	601798	蓝科高新	5,000	37,950.00	0.01
630	002054	德美化工	5,400	37,692.00	0.01
631	603112	华翔股份	3,200	37,632.00	0.01
632	603421	鼎信通讯	3,600	37,620.00	0.01
633	002756	永兴材料	600	37,566.00	0.01
634	601007	金陵饭店	4,400	37,488.00	0.01
635	600207	安彩高科	6,200	37,386.00	0.01
636	000967	盈峰环境	7,400	37,370.00	0.01
637	688135	利扬芯片	1,700	37,281.00	0.01
638	688219	会通股份	3,900	37,245.00	0.01
639	603855	华荣股份	1,400	37,240.00	0.01
640	002377	国创高新	15,400	36,960.00	0.01

641	603385	惠达卫浴	4,900	36,897.00	0.01
642	002866	传艺科技	1,300	36,842.00	0.01
643	000636	风华高科	2,400	36,816.00	0.01
644	603568	伟明环保	2,100	36,771.00	0.01
645	300440	运达科技	5,200	36,764.00	0.01
646	688173	希荻微	1,600	36,608.00	0.01
647	603588	高能环境	3,900	36,543.00	0.01
648	600052	东望时代	8,500	36,465.00	0.01
649	600751	海航科技	15,300	36,261.00	0.01
650	300805	电声股份	4,300	35,905.00	0.01
651	688213	思特威	700	35,798.00	0.01
652	000555	神州信息	2,900	35,670.00	0.01
653	603309	维力医疗	2,300	35,581.00	0.01
654	000726	鲁泰 A	5,200	35,568.00	0.01
655	600936	广西广电	9,200	35,236.00	0.01
656	600718	东软集团	3,300	35,178.00	0.01
657	000688	国城矿业	2,300	34,891.00	0.01
658	300768	迪普科技	2,100	34,797.00	0.01
659	688618	三旺通信	500	33,860.00	0.01
660	001289	龙源电力	1,500	33,750.00	0.01
661	688425	铁建重工	7,000	33,670.00	0.01
662	600871	石化油服	16,900	33,462.00	0.01
663	000778	新兴铸管	8,100	33,048.00	0.01
664	601881	中国银河	2,800	32,508.00	0.01
665	000617	中油资本	4,200	30,366.00	0.01
666	000408	藏格矿业	1,300	29,341.00	0.01
667	688083	中望软件	200	28,978.00	0.01
668	000878	云南铜业	2,600	28,730.00	0.01
669	603697	有友食品	3,100	28,427.00	0.01
670	000910	大亚圣象	3,500	27,335.00	0.01
671	600685	中船防务	900	26,955.00	0.01
672	000657	中钨高新	2,740	26,550.60	0.01
673	600486	扬农化工	300	26,226.00	0.01
674	601898	中煤能源	2,900	24,476.00	0.01
675	000999	华润三九	400	24,264.00	0.01
676	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
677	000708	中信特钢	1,500	23,760.00	0.01
678	002821	凯莱英	200	23,572.00	0.01
679	688472	阿特斯	1,364	23,242.56	0.01
680	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
681	002643	万润股份	1,300	22,633.00	0.01
682	601869	长飞光纤	600	22,206.00	0.01
683	603968	醋化股份	1,200	21,312.00	0.01

684	301325	曼恩斯特	196	21,158.20	0.01
685	000050	深天马 A	2,300	21,114.00	0.01
686	688469	中芯集成	3,864	20,904.24	0.01
687	601965	中国汽研	1,000	20,650.00	0.01
688	688361	中科飞测	319	20,629.73	0.01
689	000877	天山股份	2,500	20,350.00	0.01
690	600764	中国海防	700	19,054.00	0.01
691	601399	国机重装	5,900	18,762.00	0.01
692	600497	驰宏锌锗	3,700	18,574.00	0.01
693	600893	航发动力	400	16,904.00	0.01
694	600500	中化国际	3,000	16,680.00	0.01
695	688478	晶升股份	386	16,354.82	0.01
696	600038	中直股份	400	15,928.00	0.01
697	688576	西山科技	132	15,894.12	0.01
698	688562	航天软件	711	15,862.41	0.01
699	601106	中国一重	4,700	15,792.00	0.01
700	688210	统联精密	800	15,616.00	0.01
701	301301	川宁生物	1,685	15,097.60	0.00
702	688443	智翔金泰	503	14,833.47	0.00
703	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
704	301358	湖南裕能	329	14,110.81	0.00
705	002441	众业达	1,200	13,680.00	0.00
706	688582	芯动联科	334	13,587.12	0.00
707	301307	美利信	422	13,444.92	0.00
708	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
709	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
710	600967	内蒙一机	1,300	13,130.00	0.00
711	688146	中船特气	342	13,040.46	0.00
712	688484	南芯科技	353	12,958.63	0.00
713	688543	国科军工	239	12,678.95	0.00
714	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
715	301382	蜂助手	369	12,117.96	0.00
716	603327	福蓉科技	1,000	11,880.00	0.00
717	600782	新钢股份	3,200	11,872.00	0.00
718	688531	日联科技	87	11,829.39	0.00
719	600206	有研新材	900	11,826.00	0.00
720	301387	光大同创	258	11,702.88	0.00
721	688458	美芯晟	127	11,526.52	0.00
722	688620	安凯微	929	11,463.86	0.00
723	301383	天键股份	319	11,394.68	0.00
724	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
725	301408	华人健康	663	11,237.85	0.00
726	688552	航天南湖	471	11,068.50	0.00

727	688593	新相微	747	10,898.73	0.00
728	688352	硕中科技	898	10,838.86	0.00
729	688334	西高院	659	10,682.39	0.00
730	600006	东风汽车	1,800	10,638.00	0.00
731	000898	鞍钢股份	3,800	10,564.00	0.00
732	688581	安杰思	89	10,504.67	0.00
733	600335	国机汽车	900	10,260.00	0.00
734	688512	慧智微	534	10,231.44	0.00
735	301303	真兰仪表	455	10,155.60	0.00
736	001287	中电港	480	10,089.60	0.00
737	300212	易华录	300	9,969.00	0.00
738	301332	德尔玛	713	9,789.49	0.00
739	688433	华曙高科	304	9,576.00	0.00
740	301246	宏源药业	311	9,550.81	0.00
741	301305	朗坤环境	481	9,470.89	0.00
742	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
743	301141	中科磁业	218	9,306.42	0.00
744	603115	海星股份	600	9,222.00	0.00
745	301357	北方长龙	187	9,048.93	0.00
746	301232	飞沃科技	152	8,879.84	0.00
747	600808	马钢股份	3,400	8,738.00	0.00
748	301323	新莱福	214	8,423.04	0.00
749	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
750	601005	重庆钢铁	5,700	7,980.00	0.00
751	301170	锡南科技	228	7,964.04	0.00
752	688631	莱斯信息	264	7,885.68	0.00
753	688479	友车科技	266	7,844.34	0.00
754	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
755	000825	太钢不锈	2,000	7,740.00	0.00
756	301373	凌玮科技	242	7,707.70	0.00
757	301322	绿通科技	143	7,613.32	0.00
758	000800	一汽解放	900	7,533.00	0.00
759	301203	国泰环保	210	7,224.00	0.00
760	301386	未来电器	299	7,113.21	0.00
761	600850	电科数字	300	7,077.00	0.00
762	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
763	601061	中信金属	911	6,905.38	0.00
764	601598	中国外运	1,400	6,524.00	0.00
765	301439	泓淋电力	355	5,999.50	0.00
766	300791	仙乐健康	200	5,808.00	0.00
767	603135	中重科技	322	5,760.58	0.00
768	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
769	301345	涛涛车业	103	4,803.92	0.00

770	601133	柏诚股份	297	3,641.22	0.00
771	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
772	001328	登康口腔	135	3,441.15	0.00
773	601065	江盐集团	289	3,421.76	0.00
774	002852	道道全	200	2,586.00	0.00
775	603125	常青科技	104	2,551.12	0.00
776	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
777	001360	南矿集团	155	2,304.85	0.00
778	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
779	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
780	300735	光弘科技	200	2,140.00	0.00
781	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	38,633,412.00	16.62
2	601166	兴业银行	27,791,867.48	11.96
3	300750	宁德时代	26,828,784.08	11.54
4	600519	贵州茅台	26,451,361.00	11.38
5	000333	美的集团	19,578,494.00	8.42
6	601288	农业银行	18,931,609.00	8.14
7	301042	安联锐视	17,981,268.48	7.74
8	000858	五粮液	17,149,066.00	7.38
9	300059	东方财富	14,996,193.89	6.45
10	605108	同庆楼	14,971,401.60	6.44
11	603035	常熟汽饰	14,857,693.00	6.39
12	601818	光大银行	14,770,890.00	6.35
13	603706	东方环宇	14,756,209.00	6.35
14	300532	今天国际	13,753,223.00	5.92
15	601699	潞安环能	13,354,889.74	5.74
16	601398	工商银行	13,127,510.00	5.65
17	600015	华夏银行	12,871,425.00	5.54
18	600048	保利发展	12,767,956.00	5.49
19	688556	高测股份	12,722,117.73	5.47
20	002415	海康威视	12,679,377.00	5.45
21	600030	中信证券	12,656,001.90	5.44
22	605287	德才股份	12,361,762.01	5.32
23	601328	交通银行	12,345,062.47	5.31
24	603937	丽岛新材	12,270,687.00	5.28

25	601668	中国建筑	12,035,679.09	5.18
26	603788	宁波高发	11,945,847.40	5.14
27	603529	爱玛科技	11,830,169.00	5.09
28	605077	华康股份	11,694,328.88	5.03
29	600050	中国联通	11,590,411.00	4.99
30	000651	格力电器	11,460,847.28	4.93
31	600900	长江电力	11,456,874.22	4.93
32	000002	万科 A	11,106,706.00	4.78
33	000001	平安银行	10,972,945.88	4.72
34	002105	信隆健康	10,914,721.44	4.70
35	601012	隆基绿能	10,824,077.36	4.66
36	002959	小熊电器	10,509,998.00	4.52
37	000568	泸州老窖	10,132,250.00	4.36
38	600419	天润乳业	10,092,093.20	4.34
39	300076	GQY 视讯	10,032,475.00	4.32
40	600919	江苏银行	9,907,720.00	4.26
41	603027	千禾味业	9,855,555.80	4.24
42	601229	上海银行	9,685,786.00	4.17
43	300543	朗科智能	9,663,187.32	4.16
44	000725	京东方 A	9,617,973.00	4.14
45	603767	中马传动	9,424,134.54	4.05
46	605009	豪悦护理	9,253,863.00	3.98
47	002142	宁波银行	9,212,461.30	3.96
48	600028	中国石化	9,193,253.70	3.95
49	300789	唐源电气	9,104,148.00	3.92
50	300274	阳光电源	9,037,212.00	3.89
51	003015	日久光电	8,998,404.00	3.87
52	601997	贵阳银行	8,953,650.27	3.85
53	002938	鹏鼎控股	8,943,289.00	3.85
54	300760	迈瑞医疗	8,936,644.00	3.84
55	601390	中国中铁	8,898,137.00	3.83
56	601077	渝农商行	8,564,239.00	3.68
57	300515	三德科技	8,390,133.00	3.61
58	601899	紫金矿业	8,385,906.00	3.61
59	301017	漱玉平民	8,305,554.85	3.57
60	688511	天微电子	8,297,651.10	3.57
61	600016	民生银行	8,188,910.00	3.52
62	600546	山煤国际	7,992,123.58	3.44
63	300575	中旗股份	7,953,702.00	3.42
64	300017	网宿科技	7,932,725.00	3.41
65	601728	中国电信	7,920,057.60	3.41
66	601857	中国石油	7,826,699.00	3.37
67	603019	中科曙光	7,793,391.37	3.35

68	600011	华能国际	7,767,602.00	3.34
69	603926	铁流股份	7,765,089.00	3.34
70	603928	兴业股份	7,758,899.00	3.34
71	002600	领益智造	7,746,819.00	3.33
72	603345	安井食品	7,616,251.00	3.28
73	600985	淮北矿业	7,580,218.44	3.26
74	300218	安利股份	7,572,615.00	3.26
75	600039	四川路桥	7,517,546.00	3.23
76	002011	盾安环境	7,509,258.22	3.23
77	300042	朗科科技	7,494,963.00	3.22
78	603259	药明康德	7,407,879.79	3.19
79	003040	楚天龙	7,385,892.03	3.18
80	600309	万华化学	7,374,952.00	3.17
81	603006	联明股份	7,369,146.00	3.17
82	300910	瑞丰新材	7,345,788.00	3.16
83	600060	海信视像	7,303,432.00	3.14
84	601888	中国中免	7,275,680.00	3.13
85	002982	湘佳股份	7,164,363.00	3.08
86	601766	中国中车	7,126,532.00	3.07
87	601919	中远海控	7,126,475.96	3.07
88	002085	万丰奥威	7,120,698.00	3.06
89	300298	三诺生物	7,118,535.91	3.06
90	600000	浦发银行	7,105,704.92	3.06
91	601998	中信银行	7,072,340.00	3.04
92	300761	立华股份	7,066,482.00	3.04
93	002952	亚世光电	7,064,701.00	3.04
94	603551	奥普家居	7,021,171.00	3.02
95	600559	老白干酒	6,985,610.92	3.01
96	301004	嘉益股份	6,943,919.00	2.99
97	300502	新易盛	6,932,706.00	2.98
98	600600	青岛啤酒	6,851,432.00	2.95
99	601186	中国铁建	6,840,582.66	2.94
100	300583	赛托生物	6,802,681.46	2.93
101	688011	新光光电	6,775,941.43	2.91
102	600438	通威股份	6,768,893.34	2.91
103	300519	新光药业	6,706,009.00	2.88
104	600073	上海梅林	6,673,581.00	2.87
105	688123	聚辰股份	6,655,531.12	2.86
106	601601	中国太保	6,612,927.00	2.84
107	603102	百合股份	6,581,763.00	2.83
108	002475	立讯精密	6,575,852.00	2.83
109	600548	深高速	6,509,411.00	2.80
110	688080	映翰通	6,433,234.22	2.77

111	605088	冠盛股份	6,395,573.00	2.75
112	002594	比亚迪	6,383,671.00	2.75
113	300375	鹏翎股份	6,375,947.00	2.74
114	300771	智莱科技	6,313,857.00	2.72
115	300130	新国都	6,277,375.00	2.70
116	300889	爱克股份	6,261,380.00	2.69
117	002748	世龙实业	6,213,986.00	2.67
118	301003	江苏博云	6,123,105.10	2.63
119	603080	新疆火炬	6,058,214.00	2.61
120	603197	保隆科技	6,048,769.00	2.60
121	002871	伟隆股份	6,045,534.50	2.60
122	000548	湖南投资	6,037,869.71	2.60
123	301002	崧盛股份	6,022,876.50	2.59
124	601816	京沪高铁	6,005,938.00	2.58
125	300141	和顺电气	5,938,561.00	2.55
126	002714	牧原股份	5,822,381.30	2.50
127	600153	建发股份	5,751,839.00	2.47
128	002230	科大讯飞	5,737,909.66	2.47
129	600585	海螺水泥	5,706,795.49	2.45
130	601939	建设银行	5,700,868.20	2.45
131	300124	汇川技术	5,657,184.00	2.43
132	603657	春光科技	5,651,138.00	2.43
133	000028	国药一致	5,615,282.00	2.42
134	000937	冀中能源	5,595,458.00	2.41
135	688329	艾隆科技	5,591,365.40	2.41
136	603676	卫信康	5,551,618.00	2.39
137	600596	新安股份	5,535,155.19	2.38
138	000830	鲁西化工	5,529,246.03	2.38
139	002568	百润股份	5,485,976.00	2.36
140	600809	山西汾酒	5,462,726.92	2.35
141	002271	东方雨虹	5,433,612.00	2.34
142	300932	三友联众	5,427,010.70	2.33
143	300935	盈建科	5,416,722.40	2.33
144	000906	浙商中拓	5,367,575.95	2.31
145	601669	中国电建	5,364,626.00	2.31
146	600702	舍得酒业	5,356,723.00	2.30
147	300314	戴维医疗	5,221,321.00	2.25
148	600887	伊利股份	5,215,338.00	2.24
149	600188	兖矿能源	5,213,641.00	2.24
150	000913	钱江摩托	5,196,956.00	2.24
151	600406	国电南瑞	5,195,920.48	2.24
152	300970	华绿生物	5,190,943.00	2.23
153	688112	鼎阳科技	5,190,048.72	2.23

154	601117	中国化学	5,172,035.00	2.22
155	600057	厦门象屿	5,132,746.70	2.21
156	600202	哈空调	5,077,599.38	2.18
157	600837	海通证券	5,007,076.00	2.15
158	601666	平煤股份	5,005,212.37	2.15
159	300150	世纪瑞尔	5,004,373.00	2.15
160	600782	新钢股份	5,001,542.00	2.15
161	688569	铁科轨道	4,996,020.31	2.15
162	605060	联德股份	4,986,580.00	2.15
163	605258	协和电子	4,959,585.45	2.13
164	002136	安纳达	4,941,260.00	2.13
165	000932	华菱钢铁	4,928,003.00	2.12
166	601169	北京银行	4,916,122.00	2.11
167	002352	顺丰控股	4,898,682.00	2.11
168	002774	快意电梯	4,832,705.91	2.08
169	601898	中煤能源	4,819,081.00	2.07
170	603757	大元泵业	4,800,937.00	2.07
171	600276	恒瑞医药	4,789,317.00	2.06
172	603199	九华旅游	4,751,988.00	2.04
173	601618	中国中冶	4,738,655.00	2.04
174	300896	爱美客	4,732,512.00	2.04
175	300624	万兴科技	4,730,302.00	2.03
176	000983	山西焦煤	4,727,904.00	2.03
177	002027	分众传媒	4,722,040.00	2.03
178	600997	开滦股份	4,715,137.40	2.03
179	600508	上海能源	4,710,188.00	2.03
180	601985	中国核电	4,690,643.00	2.02
181	002835	同为股份	4,682,486.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	43,968,764.18	18.91
2	600519	贵州茅台	41,082,206.29	17.67
3	300750	宁德时代	29,884,977.40	12.86
4	000001	平安银行	28,294,623.55	12.17
5	601166	兴业银行	27,753,075.00	11.94
6	601288	农业银行	22,656,562.00	9.75
7	000858	五粮液	22,283,694.00	9.59

8	000333	美的集团	20,955,497.50	9.01
9	300059	东方财富	19,854,511.85	8.54
10	601398	工商银行	17,613,943.21	7.58
11	600030	中信证券	16,413,823.80	7.06
12	301042	安联锐视	16,323,374.15	7.02
13	601328	交通银行	15,883,495.00	6.83
14	603035	常熟汽饰	14,867,934.64	6.40
15	000651	格力电器	14,839,865.28	6.38
16	000568	泸州老窖	14,700,578.00	6.32
17	605108	同庆楼	14,208,184.58	6.11
18	601699	潞安环能	14,007,113.50	6.03
19	600900	长江电力	13,482,336.00	5.80
20	601818	光大银行	13,186,853.00	5.67
21	300532	今天国际	13,182,257.00	5.67
22	600048	保利发展	13,166,756.00	5.66
23	603706	东方环宇	13,117,829.00	5.64
24	300760	迈瑞医疗	12,712,439.80	5.47
25	002415	海康威视	12,702,687.99	5.46
26	600016	民生银行	12,454,126.00	5.36
27	601012	隆基绿能	12,430,979.73	5.35
28	605287	德才股份	11,894,881.31	5.12
29	601668	中国建筑	11,872,862.00	5.11
30	603259	药明康德	11,819,454.40	5.08
31	000002	万科 A	11,722,841.00	5.04
32	603937	丽岛新材	11,626,157.00	5.00
33	603529	爱玛科技	11,546,871.33	4.97
34	601888	中国中免	11,463,130.78	4.93
35	605077	华康股份	11,322,237.88	4.87
36	600000	浦发银行	11,260,624.00	4.84
37	600309	万华化学	11,242,949.00	4.84
38	603788	宁波高发	10,796,060.52	4.64
39	688556	高测股份	10,688,019.95	4.60
40	600015	华夏银行	10,451,945.30	4.50
41	600887	伊利股份	10,293,244.64	4.43
42	002475	立讯精密	10,161,002.00	4.37
43	002714	牧原股份	9,982,369.99	4.29
44	300124	汇川技术	9,512,180.00	4.09
45	300076	GQY 视讯	9,394,383.00	4.04
46	002959	小熊电器	9,356,435.00	4.02
47	601899	紫金矿业	9,345,973.00	4.02
48	002105	信隆健康	9,299,556.00	4.00
49	603767	中马传动	9,175,475.00	3.95
50	605009	豪悦护理	9,003,109.00	3.87

51	002938	鹏鼎控股	8,845,273.00	3.81
52	002142	宁波银行	8,829,485.00	3.80
53	603019	中科曙光	8,798,554.23	3.78
54	600276	恒瑞医药	8,797,279.93	3.78
55	003015	日久光电	8,659,065.00	3.72
56	300789	唐源电气	8,540,649.80	3.67
57	600050	中国联通	8,526,368.00	3.67
58	300042	朗科科技	8,423,571.00	3.62
59	000725	京东方 A	8,395,954.99	3.61
60	600919	江苏银行	8,291,243.52	3.57
61	601229	上海银行	8,286,953.55	3.56
62	603928	兴业股份	8,265,814.00	3.56
63	003040	楚天龙	8,213,435.00	3.53
64	603006	联明股份	8,190,361.00	3.52
65	300017	网宿科技	8,174,487.00	3.52
66	600419	天润乳业	8,135,952.00	3.50
67	600546	山煤国际	8,093,612.85	3.48
68	300543	朗科智能	8,072,597.98	3.47
69	601390	中国中铁	7,973,978.00	3.43
70	688511	天微电子	7,950,590.79	3.42
71	300515	三德科技	7,869,615.00	3.39
72	002594	比亚迪	7,817,719.71	3.36
73	002600	领益智造	7,748,683.00	3.33
74	301017	漱玉平民	7,738,349.50	3.33
75	601998	中信银行	7,728,722.00	3.32
76	300575	中旗股份	7,704,132.00	3.31
77	300761	立华股份	7,663,743.00	3.30
78	601997	贵阳银行	7,653,160.00	3.29
79	603027	千禾味业	7,627,124.40	3.28
80	300910	瑞丰新材	7,601,883.00	3.27
81	002085	万丰奥威	7,592,139.20	3.27
82	300218	安利股份	7,483,731.00	3.22
83	600039	四川路桥	7,436,042.00	3.20
84	601077	渝农商行	7,427,907.57	3.20
85	002982	湘佳股份	7,378,007.00	3.17
86	600600	青岛啤酒	7,362,226.00	3.17
87	601857	中国石油	7,301,760.00	3.14
88	300502	新易盛	7,278,887.99	3.13
89	600985	淮北矿业	7,129,731.28	3.07
90	301004	嘉益股份	7,068,756.00	3.04
91	601009	南京银行	7,045,509.83	3.03
92	603926	铁流股份	7,032,001.16	3.03
93	300298	三诺生物	6,977,527.00	3.00

94	603551	奥普家居	6,896,669.00	2.97
95	300583	赛托生物	6,861,836.34	2.95
96	600559	老白干酒	6,810,286.00	2.93
97	002952	亚世光电	6,748,649.00	2.90
98	000913	钱江摩托	6,713,232.00	2.89
99	601766	中国中车	6,687,540.00	2.88
100	600028	中国石化	6,670,894.00	2.87
101	688011	新光光电	6,516,752.91	2.80
102	601919	中远海控	6,499,922.00	2.80
103	600548	深高速	6,481,020.00	2.79
104	300274	阳光电源	6,462,421.02	2.78
105	300375	鹏翎股份	6,371,094.00	2.74
106	688123	聚辰股份	6,362,016.28	2.74
107	300519	新光药业	6,341,380.00	2.73
108	600438	通威股份	6,335,483.00	2.73
109	688080	映翰通	6,321,704.72	2.72
110	300130	新国都	6,296,992.00	2.71
111	601186	中国铁建	6,140,219.00	2.64
112	300889	爱克股份	6,080,324.00	2.62
113	002748	世龙实业	6,017,667.40	2.59
114	000028	国药一致	5,980,581.00	2.57
115	601601	中国太保	5,972,306.00	2.57
116	603080	新疆火炬	5,957,101.00	2.56
117	600073	上海梅林	5,945,294.00	2.56
118	002871	伟隆股份	5,828,297.00	2.51
119	300141	和顺电气	5,814,943.00	2.50
120	600809	山西汾酒	5,773,018.20	2.48
121	601939	建设银行	5,667,078.00	2.44
122	600585	海螺水泥	5,623,590.90	2.42
123	300624	万兴科技	5,596,009.00	2.41
124	301002	崧盛股份	5,552,787.10	2.39
125	000937	冀中能源	5,526,958.00	2.38
126	002230	科大讯飞	5,462,957.51	2.35
127	601816	京沪高铁	5,421,525.00	2.33
128	688329	艾隆科技	5,350,309.18	2.30
129	300935	盈建科	5,301,606.60	2.28
130	603102	百合股份	5,285,669.00	2.27
131	600153	建发股份	5,256,028.00	2.26
132	002271	东方雨虹	5,251,171.00	2.26
133	601728	中国电信	5,198,552.00	2.24
134	600702	舍得酒业	5,197,360.00	2.24
135	600596	新安股份	5,186,649.60	2.23
136	600782	新钢股份	5,180,438.00	2.23

137	000830	鲁西化工	5,133,448.00	2.21
138	600202	哈空调	5,128,729.00	2.21
139	300150	世纪瑞尔	5,128,536.00	2.21
140	605088	冠盛股份	5,083,202.00	2.19
141	000932	华菱钢铁	5,055,959.00	2.17
142	600188	兖矿能源	5,037,671.00	2.17
143	300932	三友联众	4,983,626.80	2.14
144	600057	厦门象屿	4,952,431.00	2.13
145	688112	鼎阳科技	4,847,490.13	2.09
146	601898	中煤能源	4,846,246.00	2.08
147	601169	北京银行	4,824,479.00	2.08
148	000983	山西焦煤	4,813,733.00	2.07
149	300970	华绿生物	4,787,297.00	2.06
150	600406	国电南瑞	4,772,225.28	2.05
151	600837	海通证券	4,738,406.00	2.04
152	002774	快意电梯	4,731,043.00	2.04
153	605060	联德股份	4,712,188.72	2.03
154	603676	卫信康	4,700,693.00	2.02
155	600508	上海能源	4,665,300.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,948,900,063.29
卖出股票的收入（成交）总额	2,891,762,018.24

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	8,594,319.73	2.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,000.18	0.00
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	8,603,319.91	2.77

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019694	23 国债 01	85,000	8,594,319.73	2.77
2	118036	力合转债	90	9,000.18	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业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的处罚。中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,340,313.22
2	应收清算款	154,161.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,751.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,501,225.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时量化多策略股票 A	1,378	125,612.81	159,836,984.84	92.34%	13,257,463.51	7.66%
博时量化多策略股票 C	586	54,479.31	26,651,303.62	83.48%	5,273,570.99	16.52%
合计	1,901	107,848.14	186,488,288.46	90.96%	18,531,034.50	9.04%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化多策略股票 A	10,298.49	0.01%
	博时量化多策略股票 C	-	-
	合计	10,298.49	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、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。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 3 日）基金份额总额	146,135,440.46	765,094,981.90
本报告期期初基金份额总额	148,516,527.87	11,358,219.20
本报告期基金总申购份额	94,100,656.37	77,295,005.92
减：本报告期基金总赎回份额	69,522,735.89	56,728,350.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	173,094,448.35	31,924,874.61

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 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》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	700,095,646.88	12.00%	511,975.02	12.00%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	1,074,718,606.01	18.43%	785,926.49	18.43%	-
招商证券	6	2,364,935,770.88	40.55%	1,729,477.22	40.55%	-
德邦证券	2	816,074,060.44	13.99%	596,792.68	13.99%	-
长江证券	2	876,439,956.61	15.03%	640,943.85	15.03%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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，公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	104,501.20	0.68%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	6,744,227.61	43.80%	-	-	-	-
招商证券	5,542,690.15	36.00%	-	-	-	-
德邦证券	3,004,770.00	19.52%	3,010,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17

4	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12
5	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
6	博时量化多策略股票型证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
7	博时量化多策略股票型证券投资基金(博时量化多策略股票 A) 基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
8	博时量化多策略股票型证券投资基金(博时量化多策略股票 C) 基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
9	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
10	博时基金管理有限公司关于博时量化多策略股票型证券投资基金的基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
13	博时量化多策略股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
14	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-20230104	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间 区间					
机构	1	2023-01-01 ~2023-03-05; 2023-03-13~ 2023-04-06; 2023-06-02~ 2023-06-30	39,774,145. 30	6,377,894.0 0	-	46,152,039 .30	22.5 1%

产品特有风险

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

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

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

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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化多策略股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议》

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时量化多策略股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时量化多策略股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日