

博时量化平衡混合型证券投资基金

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：中国工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。

基金托管人中国工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	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56

7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化平衡混合型证券投资基金
基金简称	博时量化平衡混合
基金主代码	004495
交易代码	004495
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 4 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	221,990,998.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用平衡型配置，严格控制最大回撤，基于多个逻辑不同的量化择时策略，最大程度地去过滤下跌，减少回撤，力争获取长期相对稳定的收益。
投资策略	本基金的量化多策略体系是在大类资产配置策略的基础之上，基于多因子模型、事件驱动类策略以及量化择时模型等多种量化策略进行择时和选股，并同时运用股指期货进行适量系统性风险对冲的绝对收益策略体系。主要包括：1、大类资产配置策略，本基金的大类资产配置策略主要是基于对宏观经济周期运行规律的研究予以决策，根据经济周期决定股票资产和债券资产的投资比例，以实现股债的平衡配置；2、量化择时策略，博时基金的量化多策略择时体系以择时策略的多逻辑、多期限以及多品种为目标进行设计和开发，在各品种上综合考虑基本面和市场面的择时模型，从而形成对品种的长、中、短期趋势和方向的判断。基金经理根据市场的实际情况，综合前瞻性地运用各种择时策略进行操作；3、量化选股策略，博时的量化选股策略体系包括基本面策略、市场面策略以及基本面和市场面结合的策略，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特征；4、其他投资策略包括：债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券的投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资融券交易策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数（总财富）收益率×80%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799

电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95105568	95588
传真	0755-83195140	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦21层	北京市西城区复兴门内大街55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55号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	江向阳	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市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）
本期已实现收益	8,857,016.63
本期利润	6,426,291.37
加权平均基金份额本期利润	0.0274
本期加权平均净值利润率	1.97%
本期基金份额净值增长率	1.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	80,737,011.76
期末可供分配基金份额利润	0.3637
期末基金资产净值	302,728,010.15
期末基金份额净值	1.3637
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	46.59%

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。

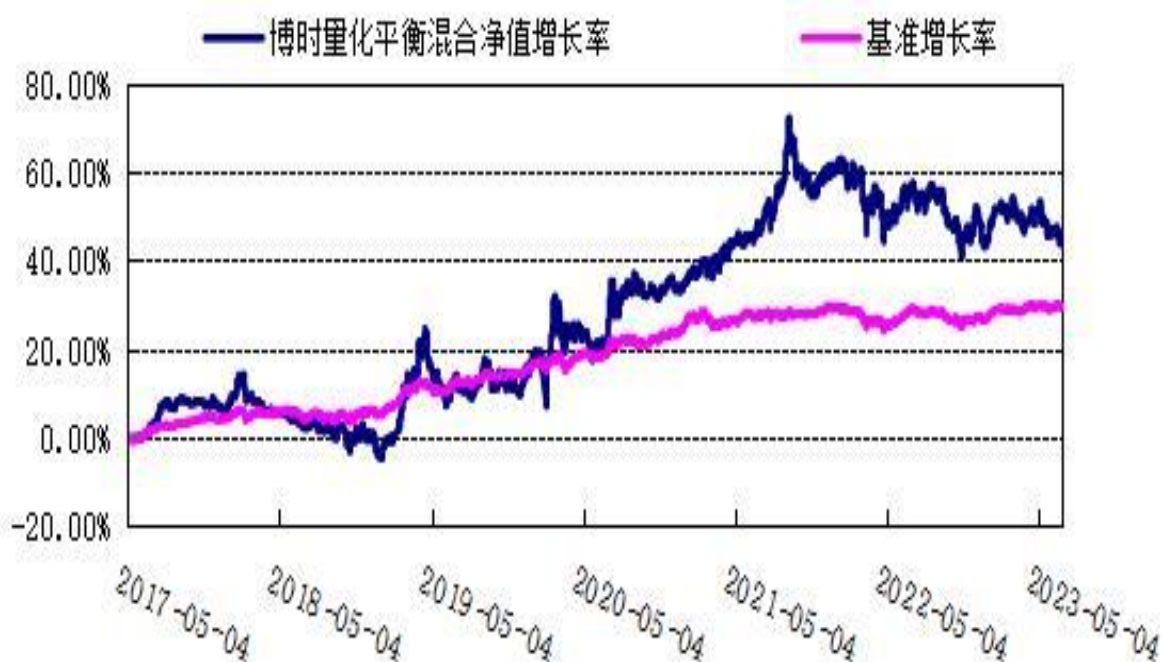
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	0.34%	0.51%	0.58%	0.16%	-0.24%	0.35%
过去三个月	-0.81%	0.58%	0.31%	0.16%	-1.12%	0.42%
过去六个月	1.59%	0.59%	2.02%	0.17%	-0.43%	0.42%
过去一年	-6.42%	0.68%	0.34%	0.19%	-6.76%	0.49%
过去三年	20.68%	0.78%	8.76%	0.24%	11.92%	0.54%
自基金合同生效起至今	46.59%	0.83%	29.77%	0.24%	16.82%	0.59%

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



§ 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	2017-05-04	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	2017-05-04	-	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、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长贰

					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	-	12.9	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

2023 年上半年，我国经济社会全面恢复常态化运行，但内外部环境仍然较为复杂。从外部看，全球经济增长趋缓，通胀水平仍处高位，主要央行保持紧缩的货币政策；从内部看，我国疫情防控取得重大决定性胜利，经济社会全面恢复常态化运行。二季度整体经济指标虽然一定程度上弱化，增长内生动能依然不足，需求端较为疲弱，但应看到上半年经济增长是恢复性的，消费、出口、投资都还有很大潜力，配合国家适时精准的刺激政策，经济增长韧性依然强劲。但在现实与预期的反复拉扯中，上半年的 A 股经历了来回的波折。

上半年的市场表现呈现愈演愈烈的结构性行情，从宽基指数来看，A 股各个核心宽基指数经历了普涨、分化到普跌，其中小盘风格的国证 2000 表现最好，而在春节前表现领先的创业板则是震荡收跌。从大类风格来开，仅有科技板块在人工智能热潮的催化下大幅上涨，先进制造也收益于汽车和机器人概念，而医药医疗和消费则出现不同程度的下跌。

市场风格方面，上半年整体上小盘风格好于大盘风格，价值风格好于成长风格，但是其中的结构分化和轮动也较为频繁，尚未形成中长期的显著趋势。动量风格则处于较强的趋势当中。

债券市场方面，经济基本面触底回暖，信用扩张速度先快后慢，资金面前紧后松，债券市场走势与经济环比动能变化整体一致，上半年的行情呈现震荡走强的态势，当中以信用债和长久期利率债表现更优。而转债则经历了平价驱动到估值驱动的切换过程，收益不算突出，但波动幅度低于股票，具有较好的投资性价比。

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，维持了较高水平的股票平均仓位。选股方面，出于绝对收益的考虑组合超配小盘价值风格，获得了一定效果；基金也维持了较高仓位的中低风险转债的配置，对市场波动下的回撤控制也有一定效果。未来本基金将持续通过量化多策略体系充分挖掘和利用股票及债券市场的规律，注重资产本身的收益能力和空间，保持在追求稳健收益的同时，注重回撤风险的控制，力争获得平稳的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.3637 元，份额累计净值为 1.4678 元。报告期内，

本基金基金份额净值增长率为 1.59%，同期业绩基准增长率为 2.02%。

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，随着经济内生再平衡，滞后效应和新的政策蓄力，中国经济复苏的进程在下半年会比上半年更好一些，通缩的压力会有一定的缓解。在复苏大方向不变的情况下，处于企业盈利上行期的 A 股的确在一个向下空间有限、向上反弹可期的位置。另一方面，当前利率中枢已经是历史低位，对 A 股估值也比较友好。

债券市场方面，当前的宏观环境具有经济增长斜率磨底、通胀压力较小、海外存在衰退风险的特征，有关逆周期政策的市场预期逐步提升。展望未来，宏观政策预计仍将保持战略定力，财政、货币、产业政策或将在短期增长和长期结构改善之间寻求平衡，持续性的大规模扩张落地可能性不高。在总需求偏弱和政策力度温和的组合下，长期来看，债券利率中枢下行的确定性较高；短期来看，受到市场预期、微观结构变化等影响，收益率或维持震荡波动态势。转债在下半年的估值或继续稳定在当前的较高水平，上半年转债新券无论是数量还是规模，都处于近几年偏低水平，但全面注册制实行之后过会速度加快，下半年供给压力有望缓解，从量化策略的角度，转债资产中依然存在较多的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：博时量化平衡混合型证券投资基金

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	20,801,687.72	22,133,061.57

结算备付金		2,402,049.07	4,253,646.56
存出保证金		95,547.81	320,028.22
交易性金融资产	6.4.3.2	280,291,858.30	317,851,946.46
其中：股票投资		116,642,830.88	127,990,567.37
基金投资		-	-
债券投资		163,649,027.42	189,861,379.09
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		138,201.50	142,260.46
应收股利		-	-
应收申购款		5,900.19	21,331.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		303,735,244.59	344,722,275.15
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		-	-
应付赎回款		60,401.84	69,590.10
应付管理人报酬		373,581.55	453,599.34
应付托管费		62,263.61	75,599.89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,595.26	3,503.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	509,392.18	902,189.57
负债合计		1,007,234.44	1,504,482.52
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	221,990,998.39	255,686,366.79
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.3.9	80,737,011.76	87,531,425.84
净资产合计		302,728,010.15	343,217,792.63
负债和净资产总计		303,735,244.59	344,722,275.15

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3637 元，基金份额总额 221,990,998.39 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

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		9,364,821.60	-42,146,721.57
1. 利息收入		71,388.56	196,968.54
其中：存款利息收入	6.4.3.10	71,388.56	196,968.54
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）		11,682,993.04	-26,031,295.30
其中：股票投资收益	6.4.3.11	5,824,581.85	-48,514,608.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	3,449,201.58	16,095,532.71
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	26,870.14	-
股利收益	6.4.3.15	2,382,339.47	6,387,780.17
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	-2,430,725.26	-16,858,369.10
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	41,165.26	545,974.29
减：二、营业总支出		2,938,530.23	9,641,619.79
1. 管理人报酬		2,436,318.93	8,177,503.87
2. 托管费		406,053.21	1,362,917.32
3. 销售服务费		-	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		1,095.57	2,206.56
8. 其他费用	6.4.3.19	95,062.52	98,992.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,426,291.37	-51,788,341.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,426,291.37	-51,788,341.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,426,291.37	-51,788,341.36

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

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）	255,686,366.79	-	87,531,425.84	343,217,792.63
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）	255,686,366.79	-	87,531,425.84	343,217,792.63
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	-33,695,368.40	-	-6,794,414.08	-40,489,782.48
（一）、综合收益总 额	-	-	6,426,291.37	6,426,291.37
（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）	-33,695,368.40	-	-13,220,705.45	-46,916,073.85
其中：1. 基金申购款	12,409,854.67	-	5,050,156.76	17,460,011.43

2. 基金赎回款	-46,105,223.07	-	-18,270,862.21	-64,376,085.28
(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)	221,990,998.39	-	80,737,011.76	302,728,010.15
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)	747,145,531.52	-	417,757,722.59	1,164,903,254.11
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)	747,145,531.52	-	417,757,722.59	1,164,903,254.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-190,621,918.09	-	-163,301,889.44	-353,923,807.53
(一)、综合收益总额	-	-	-51,788,341.36	-51,788,341.36
(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)	-190,621,918.09	-	-67,823,146.92	-258,445,065.01
其中: 1. 基金申购款	151,521,802.71	-	85,425,754.18	236,947,556.89
2. 基金赎回款	-342,143,720.80	-	-153,248,901.10	-495,392,621.90
(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)	-	-	-43,690,401.16	-43,690,401.16
(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)	556,523,613.43	-	254,455,833.15	810,979,446.58
---------------------	----------------	---	----------------	----------------

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：佴方方

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[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]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(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。

(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	20,801,687.72
等于：本金	20,799,842.09
加：应计利息	1,845.63
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	20,801,687.72

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		123,327,446.45	-	116,642,830.88	-6,684,615.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	165,675,973.29	701,280.52	163,649,027.42	-2,728,226.39
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	165,675,973.29	701,280.52	163,649,027.42	-2,728,226.39
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		289,003,419.74	701,280.52	280,291,858.30	-9,412,841.96

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

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。

6.4.3.4 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	128.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	420,461.30
其中：交易所市场	420,461.30
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	88,802.56
合计	509,392.18

6.4.3.8 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	255,686,366.79	255,686,366.79
本期申购	12,409,854.67	12,409,854.67
本期赎回（以“-”号填列）	-46,105,223.07	-46,105,223.07
本期末	221,990,998.39	221,990,998.39

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

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	105,282,717.03	-17,751,291.19	87,531,425.84
本期利润	8,857,016.63	-2,430,725.26	6,426,291.37
本期基金份额交易产生的变动数	-14,756,992.29	1,536,286.84	-13,220,705.45
其中：基金申购款	5,472,706.38	-422,549.62	5,050,156.76
基金赎回款	-20,229,698.67	1,958,836.46	-18,270,862.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,382,741.37	-18,645,729.61	80,737,011.76

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	39,248.86
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	31,430.60	
其他	709.10	
合计	71,388.56	

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	843,125,400.46
减：卖出股票成本总额	834,961,869.70
减：交易费用	2,338,948.91
买卖股票差价收入	5,824,581.85

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	975,131.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,474,069.97
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	3,449,201.58

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	131,800,825.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	128,802,189.14
减：应计利息总额	517,688.85
减：交易费用	6,877.55
买卖债券差价收入	2,474,069.97

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	26,870.14

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	2,382,339.47
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,382,339.47

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	-2,452,085.26
——股票投资	-6,789,373.75
——债券投资	4,337,288.49
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	21,360.00
——权证投资	-
——股指期货	21,360.00
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	-2,430,725.26

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	40,581.61
基金转换费收入	583.65
合计	41,165.26

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		1,759.96
合计		95,062.52

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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		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	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股票成交总

		票成交总 额的比例		额的比例
招商证券	-	-	656,287,258.47	17.27%

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	-	-	136,302,383.33	15.34%

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
-	-	-	-	-
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	611,203.49	18.66%	265,349.05	19.62%

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	2,436,318.93	8,177,503.87
其中：支付销售机构的客户维护费	110,455.60	130,421.78

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 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	406,053.21	1,362,917.32

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

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

6.4.6.3 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	20,801,687.72	39,248.86	73,792,111.33	145,966.45

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
-	-	-	-	-	-
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	6,780.00	21,696.00
招商证券股份有限公司	301123	奕东电子	网下发行	6,551.00	243,893.73
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	12,660.00	182,683.80
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
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	1,753.00	34,814.58	31,659.18	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	首次公开发行限售	5.00	8.96	2,614.00	13,070.00	23,421.44	-
601916	浙商银行	2023-06-27	7 个交易日	配股未上市	2.02	2.64	8,070.00	16,301.40	21,304.80	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	1,176.00	13,053.60	20,039.04	-

688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	首次公开发售	23.60	64.67	276.00	6,513.60	17,848.92	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	首次公开发售	5.69	5.41	3,174.00	18,060.06	17,171.34	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	首次公开发售	32.52	42.37	354.00	11,512.08	14,998.98	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	首次公开发售	12.68	22.31	618.00	7,836.24	13,787.58	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	首次公开发售	135.80	120.41	114.00	15,481.20	13,726.74	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	首次公开发售	37.88	29.49	451.00	17,083.88	13,299.99	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	首次公开发售	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	首次公开发售	152.38	135.97	93.00	14,171.34	12,645.21	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	首次公开发售	39.99	36.71	335.00	13,396.65	12,297.85	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	首次公开发售	26.74	40.68	300.00	8,022.00	12,204.00	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	首次公开发售	16.24	16.95	717.00	11,644.08	12,153.15	-
68814	中船	2023-	6 个月	首次	36.15	38.13	311.0	11,24	11,85	-

6	特气	04-13		公开发 行 限售			0	2.65	8.43	
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次公 开发 行 限售	43.67	53.05	215.0 0	9,389 .05	11,40 5.75	-
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次公 开发 行 限售	21.86	23.85	458.0 0	10,01 1.88	10,92 3.30	-
30124 6	宏源 药业	2023- 03-10	6 个月	首次公 开发 行 限售	50.00	30.71	354.0 0	17,70 0.00	10,87 1.34	-
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次公 开发 行 限售	10.68	12.34	841.0 0	8,981 .88	10,37 7.94	-
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次公 开发 行 限售	75.00	90.76	111.0 0	8,325 .00	10,07 4.36	-
68835 2	颀中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次公 开发 行 限售	12.10	12.07	811.0 0	9,813 .10	9,788 .77	-
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次公 开发 行 限售	11.18	14.59	652.0 0	7,289 .36	9,512 .68	-
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次公 开发 行 限售	14.16	16.21	581.0 0	8,226 .96	9,418 .01	-
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次公 开发 行 限售	21.17	23.50	393.0 0	8,319 .81	9,235 .50	-
68858 1	安杰 思	2023- 05-12	6 个月	首次公 开发 行 限售	125.8 0	118.0 3	75.00	9,435 .00	8,852 .25	-
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次公 开发	26.66	31.50	275.0 0	7,331 .50	8,662 .50	-

				发行 限售							
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开发 行 限售	20.92	19.16	447.0 0	9,351 .24	8,564 .52	-	
30132 2	绿通 科技	2023- 02-27	6 个月	首次 公开发 行 限售	87.41	53.24	156.0 0	13,63 5.44	8,305 .44	-	
68853 5	华海 诚科	2023- 03-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	35.00	51.23	161.0 0	5,635 .00	8,248 .03	-	
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.28	29.87	238.0 0	6,016 .64	7,109 .06	-	
30143 9	泓淋 电力	2023- 03-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	19.99	16.90	405.0 0	8,095 .95	6,844 .50	-	
68847 9	友车 科技	2023- 05-04	6 个月	首次 公开发 行 限售	33.99	29.49	222.0 0	7,545 .78	6,546 .78	-	
60106 1	中信 金属	2023- 03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	6.58	7.58	856.0 0	5,632 .48	6,488 .48	-	
30134 5	涛涛 车业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开发 行 限售	73.45	46.64	120.0 0	8,814 .00	5,596 .80	-	
60313 5	中重 科技	2023- 03-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	17.80	17.89	306.0 0	5,446 .80	5,474 .34	-	
60113 3	柏诚 股份	2023- 03-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	11.66	12.26	304.0 0	3,544 .64	3,727 .04	-	
60106 5	江盐 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开发 行	10.36	11.84	296.0 0	3,066 .56	3,504 .64	-	

				限售						
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	首次公开发行限售	25.98	24.53	97.00	2,520.06	2,379.41	-
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	-
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	2023-06-29	15 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	20.00	2,000.00	2,000.04	-

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

无。

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流

动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

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

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

6.4.9.2 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	606,657.86	3,060,628.77
合计	606,657.86	3,060,628.77

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	87,724,622.81	122,450,347.00
AAA 以下	75,317,746.75	64,350,403.32
未评级	-	-
合计	163,042,369.56	186,800,750.32

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	20,801,687.72	-	-	-	20,801,687.72
结算备付金	2,402,049.07	-	-	-	2,402,049.07
存出保证金	95,547.81	-	-	-	95,547.81
交易性金融资产	31,664,528.55	131,982,498.83	2,000.04	116,642,830.88	280,291,858.30
应收清算款	-	-	-	138,201.50	138,201.50
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,900.19	5,900.19
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	54,963,813.15	131,982,498.83	2,000.04	116,786,932.57	303,735,244.59
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	60,401.84	60,401.84
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	373,581.55	373,581.55
应付托管费	-	-	-	62,263.61	62,263.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,595.26	1,595.26
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	509,392.18	509,392.18
负债总计	-	-	-	1,007,234.44	1,007,234.44
利率敏感度缺口	54,963,813.15	131,982,498.83	2,000.04	115,779,698.13	302,728,010.15
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	22,133,061.57	-	-	-	22,133,061.57
结算备付金	4,253,646.56	-	-	-	4,253,646.56
存出保证金	97,361.02	-	-	222,667.20	320,028.22
交易性金融资产	33,372,298.17	147,917,933.35	8,571,147.57	127,990,567.37	317,851,946.46

应收清算款	-	-	-	142,260.46	142,260.46
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	21,331.88	21,331.88
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	59,856,367.32	147,917,933.35	8,571,147.57	128,376,826.91	344,722,275.15
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	69,590.10	69,590.10
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	453,599.34	453,599.34
应付托管费	-	-	-	75,599.89	75,599.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,503.62	3,503.62
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	902,189.57	902,189.57
负债总计	-	-	-	1,504,482.52	1,504,482.52
利率敏感度缺口	59,856,367.32	147,917,933.35	8,571,147.57	126,872,344.39	343,217,792.63

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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0	减少约0
	市场利率下降25个基点	增加约0	增加约0

注：以上金额为四舍五入的结果。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 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

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	116,642,830.88	38.53	127,990,567.37	37.29
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	163,042,369.56	53.86	186,800,750.32	54.43
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	279,685,200.44	92.39	314,791,317.69	91.72

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 833	增加约 1,021
	业绩比较基准下降 5%	减少约 833	减少约 1,021

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	279,235,367.22
第二层次	629,962.70
第三层次	426,528.38
合计	280,291,858.30

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	116,642,830.88	38.40
	其中：股票	116,642,830.88	38.40

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	163,649,027.42	53.88
	其中：债券	163,649,027.42	53.88
	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	23,203,736.79	7.64
8	其他各项资产	239,649.50	0.08
9	合计	303,735,244.59	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	374,016.00	0.12
B	采矿业	2,156,689.00	0.71
C	制造业	41,571,817.69	13.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,470,503.00	0.82
E	建筑业	17,211,478.51	5.69
F	批发和零售业	12,252,714.95	4.05
G	交通运输、仓储和邮政业	4,431,012.00	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,335,998.62	1.76
J	金融业	25,092,989.45	8.29
K	房地产业	2,943,519.00	0.97
L	租赁和商务服务业	892,032.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	417,385.66	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	547,353.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	96,508.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	848,814.00	0.28
S	综合	-	-
	合计	116,642,830.88	38.53

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	601117	中国化学	1,609,467	13,326,386.76	4.40
2	600153	建发股份	773,800	8,442,158.00	2.79
3	000001	平安银行	652,366	7,326,070.18	2.42
4	600036	招商银行	133,400	4,370,184.00	1.44
5	601318	中国平安	81,700	3,790,880.00	1.25
6	601166	兴业银行	217,661	3,406,394.65	1.13
7	600048	保利发展	212,500	2,768,875.00	0.91
8	601668	中国建筑	421,400	2,418,836.00	0.80
9	601919	中远海控	235,950	2,217,930.00	0.73
10	600755	厦门国贸	192,776	1,492,086.24	0.49
11	600782	新钢股份	385,937	1,431,826.27	0.47
12	601009	南京银行	160,900	1,287,200.00	0.43
13	000932	华菱钢铁	237,400	1,132,398.00	0.37
14	600519	贵州茅台	500	845,500.00	0.28
15	600050	中国联通	167,400	803,520.00	0.27
16	601728	中国电信	125,400	706,002.00	0.23
17	600900	长江电力	31,100	686,066.00	0.23
18	600015	华夏银行	125,001	676,255.41	0.22
19	601336	新华保险	15,500	569,935.00	0.19
20	002027	分众传媒	82,400	561,144.00	0.19
21	600028	中国石化	85,600	544,416.00	0.18
22	601857	中国石油	70,800	528,876.00	0.17
23	000063	中兴通讯	11,200	510,048.00	0.17
24	600060	海信视像	20,100	497,475.00	0.16
25	300750	宁德时代	2,160	494,186.40	0.16
26	300771	智莱科技	42,300	460,647.00	0.15
27	002555	三七互娱	12,900	449,952.00	0.15
28	600089	特变电工	19,000	423,510.00	0.14
29	600011	华能国际	44,900	415,774.00	0.14
30	000858	五粮液	2,500	408,925.00	0.14
31	002011	盾安环境	28,200	390,006.00	0.13
32	301042	安联锐视	11,400	387,030.00	0.13
33	300543	朗科智能	38,900	384,721.00	0.13
34	301003	江苏博云	16,600	383,626.00	0.13
35	300743	天地数码	24,400	383,568.00	0.13
36	300274	阳光电源	3,200	373,216.00	0.12
37	601231	环旭电子	24,900	372,504.00	0.12
38	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.12
39	601816	京沪高铁	69,800	367,148.00	0.12
40	601997	贵阳银行	71,000	366,360.00	0.12
41	601229	上海银行	62,400	358,800.00	0.12
42	000333	美的集团	6,000	353,520.00	0.12
43	605088	冠盛股份	19,800	339,570.00	0.11
44	603345	安井食品	2,300	337,640.00	0.11

45	688630	芯碁微装	4,000	336,080.00	0.11
46	603338	浙江鼎力	5,800	324,858.00	0.11
47	603600	永艺股份	33,900	322,389.00	0.11
48	601825	沪农商行	58,300	317,735.00	0.10
49	600941	中国移动	3,400	317,220.00	0.10
50	600528	中铁工业	30,800	304,304.00	0.10
51	002352	顺丰控股	6,700	302,103.00	0.10
52	603298	杭叉集团	12,800	301,440.00	0.10
53	002415	海康威视	9,100	301,301.00	0.10
54	601390	中国中铁	39,400	298,652.00	0.10
55	300532	今天国际	14,500	298,120.00	0.10
56	600741	华域汽车	16,000	295,360.00	0.10
57	603657	春光科技	16,800	294,840.00	0.10
58	603197	保隆科技	5,400	292,950.00	0.10
59	688556	高测股份	5,500	292,270.00	0.10
60	600655	豫园股份	42,600	292,236.00	0.10
61	600438	通威股份	8,300	284,773.00	0.09
62	688289	圣湘生物	16,878	284,225.52	0.09
63	002959	小熊电器	3,400	283,900.00	0.09
64	002568	百润股份	7,800	283,530.00	0.09
65	603102	百合股份	6,500	280,735.00	0.09
66	603810	丰山集团	20,360	280,357.20	0.09
67	600612	老凤祥	4,000	279,520.00	0.09
68	600356	恒丰纸业	35,600	278,748.00	0.09
69	600373	中文传媒	20,900	278,388.00	0.09
70	000548	湖南投资	57,300	277,332.00	0.09
71	002136	安纳达	24,300	276,534.00	0.09
72	002105	信隆健康	46,200	274,890.00	0.09
73	603706	东方环宇	18,200	273,910.00	0.09
74	002722	物产金轮	19,700	273,239.00	0.09
75	603788	宁波高发	21,900	269,808.00	0.09
76	600919	江苏银行	36,703	269,767.05	0.09
77	300811	铂科新材	4,500	267,480.00	0.09
78	300896	爱美客	600	266,970.00	0.09
79	603585	苏利股份	17,700	263,376.00	0.09
80	603027	千禾味业	12,300	259,776.00	0.09
81	601818	光大银行	83,600	256,652.00	0.08
82	600873	梅花生物	28,400	253,612.00	0.08
83	003019	宸展光电	12,360	253,380.00	0.08
84	603926	铁流股份	24,600	251,658.00	0.08
85	601168	西部矿业	23,400	245,934.00	0.08
86	601288	农业银行	68,100	240,393.00	0.08
87	301101	明月镜片	5,800	237,974.00	0.08
88	002230	科大讯飞	3,500	237,860.00	0.08

89	002603	以岭药业	9,200	236,348.00	0.08
90	002938	鹏鼎控股	9,700	235,613.00	0.08
91	002475	立讯精密	7,100	230,395.00	0.08
92	600419	天润乳业	14,100	228,702.00	0.08
93	601077	渝农商行	62,300	223,657.00	0.07
94	601601	中国太保	8,600	223,428.00	0.07
95	000906	浙商中拓	24,300	216,756.00	0.07
96	000725	京东方 A	52,800	215,952.00	0.07
97	600985	淮北矿业	18,700	215,424.00	0.07
98	601717	郑煤机	17,300	215,385.00	0.07
99	600582	天地科技	36,500	212,795.00	0.07
100	600998	九州通	19,966	207,247.08	0.07
101	601186	中国铁建	20,200	198,970.00	0.07
102	000651	格力电器	5,400	197,154.00	0.07
103	300413	芒果超媒	5,600	191,576.00	0.06
104	601985	中国核电	26,700	188,235.00	0.06
105	601328	交通银行	32,400	187,920.00	0.06
106	603071	物产环能	11,300	187,467.00	0.06
107	002533	金杯电工	22,700	185,232.00	0.06
108	002594	比亚迪	700	180,789.00	0.06
109	600016	民生银行	46,600	174,750.00	0.06
110	603767	中马传动	11,300	174,698.00	0.06
111	601699	潞安环能	10,500	171,360.00	0.06
112	601800	中国交建	15,500	169,105.00	0.06
113	600894	广日股份	22,400	168,672.00	0.06
114	300363	博腾股份	5,700	168,663.00	0.06
115	601319	中国人保	28,112	164,174.08	0.05
116	600742	一汽富维	19,900	162,981.00	0.05
117	600030	中信证券	8,000	158,240.00	0.05
118	600276	恒瑞医药	3,300	158,070.00	0.05
119	601669	中国电建	27,400	157,276.00	0.05
120	600905	三峡能源	28,700	154,119.00	0.05
121	601138	工业富联	6,100	153,720.00	0.05
122	000933	神火股份	11,800	153,400.00	0.05
123	002952	亚世光电	8,600	152,478.00	0.05
124	601012	隆基绿能	5,300	151,951.00	0.05
125	002056	横店东磁	8,300	151,143.00	0.05
126	300059	东方财富	10,400	147,680.00	0.05
127	300951	博硕科技	2,700	147,501.00	0.05
128	300155	安居宝	29,200	147,168.00	0.05
129	603368	柳药集团	5,900	145,789.00	0.05
130	300162	雷曼光电	20,700	145,314.00	0.05
131	600887	伊利股份	5,100	144,432.00	0.05
132	603787	新日股份	8,400	141,204.00	0.05

133	688393	安必平	4,200	140,700.00	0.05
134	601899	紫金矿业	12,300	139,851.00	0.05
135	688303	大全能源	3,447	139,431.15	0.05
136	600000	浦发银行	19,137	138,551.88	0.05
137	603178	圣龙股份	11,100	136,752.00	0.05
138	003015	日久光电	14,400	136,368.00	0.05
139	601618	中国中冶	34,200	135,774.00	0.04
140	003008	开普检测	4,600	132,158.00	0.04
141	600511	国药股份	3,400	132,090.00	0.04
142	300121	阳谷华泰	13,700	130,835.00	0.04
143	300818	耐普矿机	5,500	130,625.00	0.04
144	300650	太龙股份	9,700	130,562.00	0.04
145	300389	艾比森	6,400	130,368.00	0.04
146	605258	协和电子	5,000	129,900.00	0.04
147	603266	天龙股份	9,300	129,363.00	0.04
148	688011	新光光电	5,000	129,100.00	0.04
149	301032	新柴股份	14,400	128,880.00	0.04
150	300889	爱克股份	8,600	128,742.00	0.04
151	600180	瑞茂通	21,500	128,570.00	0.04
152	300970	华绿生物	5,500	128,480.00	0.04
153	603886	元祖股份	7,000	128,380.00	0.04
154	002787	华源控股	17,700	128,325.00	0.04
155	301107	瑜欣电子	3,700	128,242.00	0.04
156	002493	荣盛石化	11,000	128,040.00	0.04
157	301002	崧盛股份	6,200	127,968.00	0.04
158	603321	梅轮电梯	16,400	127,756.00	0.04
159	002981	朝阳科技	5,300	127,730.00	0.04
160	002394	联发股份	15,000	127,650.00	0.04
161	603937	丽岛新材	11,000	127,490.00	0.04
162	300515	三德科技	7,900	127,348.00	0.04
163	300371	汇中股份	9,700	127,070.00	0.04
164	301160	翔楼新材	3,600	126,540.00	0.04
165	605189	富春染织	7,700	126,357.00	0.04
166	000568	泸州老窖	600	125,742.00	0.04
167	002998	优彩资源	17,700	125,670.00	0.04
168	300462	华铭智能	10,700	125,618.00	0.04
169	688571	杭华股份	19,900	125,569.00	0.04
170	300808	久量股份	9,300	125,550.00	0.04
171	603928	兴业股份	10,400	125,528.00	0.04
172	002809	红墙股份	11,600	125,280.00	0.04
173	002748	世龙实业	13,700	125,218.00	0.04
174	603326	我乐家居	16,000	124,960.00	0.04
175	603036	如通股份	11,800	124,844.00	0.04
176	301106	骏成科技	3,500	124,670.00	0.04

177	688288	鸿泉物联	4,900	124,558.00	0.04
178	001218	丽臣实业	5,500	124,355.00	0.04
179	688026	洁特生物	6,800	124,236.00	0.04
180	002743	富煌钢构	21,600	124,200.00	0.04
181	301182	凯旺科技	5,400	124,038.00	0.04
182	002774	快意电梯	15,600	124,020.00	0.04
183	002566	益盛药业	14,900	123,968.00	0.04
184	300789	唐源电气	6,000	123,720.00	0.04
185	002696	百洋股份	19,800	123,552.00	0.04
186	300932	三友联众	8,000	123,520.00	0.04
187	605287	德才股份	5,200	123,240.00	0.04
188	605177	东亚药业	5,000	123,200.00	0.04
189	688069	德林海	5,800	123,192.00	0.04
190	603095	越剑智能	7,960	122,982.00	0.04
191	600309	万华化学	1,400	122,976.00	0.04
192	603726	朗迪集团	9,700	122,802.00	0.04
193	688511	天微电子	3,600	122,760.00	0.04
194	600073	上海梅林	16,800	122,640.00	0.04
195	000705	浙江震元	15,200	122,360.00	0.04
196	002702	海欣食品	23,300	122,325.00	0.04
197	600051	宁波联合	16,800	122,304.00	0.04
198	001219	青岛食品	6,700	122,208.00	0.04
199	603214	爱婴室	7,500	122,025.00	0.04
200	600097	开创国际	12,800	121,984.00	0.04
201	300519	新光药业	7,600	121,752.00	0.04
202	000972	中基健康	35,900	121,701.00	0.04
203	600128	弘业股份	14,800	121,656.00	0.04
204	301218	华是科技	5,200	121,628.00	0.04
205	600830	香溢融通	19,900	121,589.00	0.04
206	603903	中持股份	13,600	121,584.00	0.04
207	000619	海螺新材	19,900	121,390.00	0.04
208	603150	万朗磁塑	4,600	121,256.00	0.04
209	002133	广宇集团	35,700	121,023.00	0.04
210	300058	蓝色光标	12,500	120,875.00	0.04
211	600513	联环药业	12,500	120,750.00	0.04
211	002492	恒基达鑫	21,000	120,750.00	0.04
212	605567	春雪食品	9,400	120,602.00	0.04
213	605151	西上海	6,600	120,120.00	0.04
214	603681	永冠新材	8,400	119,952.00	0.04
215	300760	迈瑞医疗	400	119,920.00	0.04
216	603185	弘元绿能	1,600	119,280.00	0.04
217	300242	佳云科技	34,500	119,025.00	0.04
218	002910	庄园牧场	10,800	118,800.00	0.04
219	300295	三六五网	9,600	118,752.00	0.04

220	688335	复洁环保	4,829	118,503.66	0.04
221	603602	纵横通信	9,600	117,984.00	0.04
222	300076	GQY 视讯	23,100	117,810.00	0.04
223	600969	郴电国际	15,700	117,279.00	0.04
224	688217	睿昂基因	2,900	116,435.00	0.04
225	600008	首创环保	40,400	116,352.00	0.04
226	600704	物产中大	23,400	115,596.00	0.04
227	300639	凯普生物	11,450	114,729.00	0.04
228	600096	云天化	6,700	114,369.00	0.04
229	300787	海能实业	5,800	114,260.00	0.04
230	603757	大元泵业	3,800	113,392.00	0.04
231	000301	东方盛虹	9,500	112,290.00	0.04
232	600570	恒生电子	2,500	110,725.00	0.04
233	601019	山东出版	11,900	109,123.00	0.04
234	000822	山东海化	15,900	108,279.00	0.04
235	600475	华光环能	9,100	108,108.00	0.04
236	000997	新大陆	5,700	107,730.00	0.04
237	300968	格林精密	12,100	107,569.00	0.04
238	600346	恒力石化	7,500	107,475.00	0.04
239	688329	艾隆科技	3,311	107,276.40	0.04
240	688305	科德数控	1,059	106,175.34	0.04
241	301150	中一科技	2,110	105,521.10	0.03
242	603115	海星股份	6,800	104,516.00	0.03
243	600009	上海机场	2,300	104,466.00	0.03
244	300109	新开源	4,200	104,454.00	0.03
245	002600	领益智造	15,100	104,341.00	0.03
246	601038	一拖股份	8,800	103,312.00	0.03
247	300909	汇创达	3,900	103,038.00	0.03
248	300124	汇川技术	1,600	102,736.00	0.03
249	603385	惠达卫浴	13,600	102,408.00	0.03
250	605006	山东玻纤	13,600	102,000.00	0.03
251	002152	广电运通	8,700	101,964.00	0.03
252	600370	三房巷	38,000	101,840.00	0.03
253	600551	时代出版	9,200	101,660.00	0.03
254	000768	中航西飞	3,800	101,650.00	0.03
255	300815	玉禾田	6,800	101,184.00	0.03
256	601333	广深铁路	25,500	100,980.00	0.03
257	603676	卫信康	7,300	100,886.00	0.03
258	605507	国邦医药	4,700	99,969.00	0.03
259	600273	嘉化能源	10,600	99,852.00	0.03
260	600406	国电南瑞	4,320	99,792.00	0.03
261	603259	药明康德	1,600	99,696.00	0.03
262	688981	中芯国际	1,967	99,372.84	0.03
263	603360	百傲化学	9,800	99,372.00	0.03

264	601916	浙商银行	37,470	98,920.80	0.03
265	603589	口子窖	2,000	98,700.00	0.03
266	600858	银座股份	16,300	98,452.00	0.03
267	300231	银信科技	11,000	98,010.00	0.03
268	300230	永利股份	27,600	97,704.00	0.03
269	601006	大秦铁路	13,100	97,333.00	0.03
270	300314	戴维医疗	4,600	97,244.00	0.03
271	601598	中国外运	20,800	96,928.00	0.03
272	688569	铁科轨道	2,300	96,761.00	0.03
273	301103	何氏眼科	2,300	96,508.00	0.03
274	300976	达瑞电子	1,900	96,330.00	0.03
275	600183	生益科技	6,700	95,140.00	0.03
276	600197	伊力特	3,500	95,095.00	0.03
277	688111	金山办公	200	94,444.00	0.03
278	603199	九华旅游	2,700	93,285.00	0.03
279	002478	常宝股份	12,500	93,125.00	0.03
280	000938	紫光股份	2,900	92,365.00	0.03
281	601868	中国能建	38,800	90,792.00	0.03
282	301257	普蕊斯	1,600	89,920.00	0.03
283	601888	中国中免	800	88,424.00	0.03
284	600566	济川药业	2,900	84,216.00	0.03
285	603529	爱玛科技	2,600	83,772.00	0.03
286	600886	国投电力	6,600	83,490.00	0.03
287	300624	万兴科技	700	82,005.00	0.03
288	601766	中国中车	12,600	81,900.00	0.03
289	002432	九安医疗	2,300	80,983.00	0.03
290	003816	中国广核	26,000	80,860.00	0.03
291	002179	中航光电	1,700	77,095.00	0.03
292	603019	中科曙光	1,500	76,350.00	0.03
293	000878	云南铜业	6,900	76,245.00	0.03
294	600795	国电电力	19,900	76,217.00	0.03
295	002410	广联达	2,300	74,727.00	0.02
296	603898	好莱客	7,600	73,872.00	0.02
297	000895	双汇发展	3,000	73,470.00	0.02
298	600218	全柴动力	7,700	68,992.00	0.02
299	002955	鸿合科技	2,900	68,295.00	0.02
300	600035	楚天高速	16,600	67,728.00	0.02
301	000625	长安汽车	5,200	67,236.00	0.02
302	600368	五洲交通	18,450	67,158.00	0.02
303	600033	福建高速	21,400	66,982.00	0.02
304	600269	赣粤高速	18,200	66,794.00	0.02
305	600284	浦东建设	10,900	66,708.00	0.02
306	000707	双环科技	7,800	66,300.00	0.02
306	002106	莱宝高科	7,800	66,300.00	0.02

307	600674	川投能源	4,400	66,220.00	0.02
308	600971	恒源煤电	8,500	66,215.00	0.02
309	002462	嘉事堂	4,800	65,664.00	0.02
310	601666	平煤股份	8,700	65,598.00	0.02
311	000823	超声电子	6,900	65,412.00	0.02
312	002049	紫光国微	700	65,275.00	0.02
313	002479	富春环保	14,000	65,240.00	0.02
314	000885	城发环境	4,900	65,219.00	0.02
315	000731	四川美丰	8,000	65,200.00	0.02
316	600039	四川路桥	6,620	64,942.20	0.02
317	002091	江苏国泰	8,600	64,844.00	0.02
318	002022	科华生物	6,100	64,660.00	0.02
319	600502	安徽建工	12,100	63,888.00	0.02
320	000498	山东路桥	9,900	63,558.00	0.02
321	002371	北方华创	200	63,530.00	0.02
322	603369	今世缘	1,200	63,360.00	0.02
323	000977	浪潮信息	1,300	63,050.00	0.02
324	600845	宝信软件	1,240	63,004.40	0.02
325	000529	广弘控股	9,900	62,964.00	0.02
326	601360	三六零	5,000	62,700.00	0.02
327	688012	中微公司	400	62,580.00	0.02
328	000421	南京公用	11,500	62,100.00	0.02
329	601088	中国神华	2,000	61,500.00	0.02
330	000408	藏格矿业	2,700	60,939.00	0.02
331	600029	南方航空	9,900	59,697.00	0.02
332	600115	中国东航	12,400	59,024.00	0.02
333	603501	韦尔股份	600	58,824.00	0.02
334	300433	蓝思科技	5,000	58,800.00	0.02
335	300454	深信服	500	56,625.00	0.02
336	603986	兆易创新	500	53,125.00	0.02
337	601111	中国国航	6,400	52,736.00	0.02
338	300033	同花顺	300	52,584.00	0.02
339	600588	用友网络	2,500	51,250.00	0.02
340	600271	航天信息	3,700	50,653.00	0.02
341	300628	亿联网络	1,420	49,799.40	0.02
342	603444	吉比特	100	49,111.00	0.02
343	600019	宝钢股份	8,700	48,894.00	0.02
344	600233	圆通速递	3,200	46,592.00	0.02
345	002737	葵花药业	1,900	46,246.00	0.02
346	603688	石英股份	400	45,536.00	0.02
347	688036	传音控股	300	44,100.00	0.01
348	002249	大洋电机	7,700	43,890.00	0.01
349	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.01
350	002543	万和电气	5,300	41,923.00	0.01

351	000100	TCL 科技	10,600	41,764.00	0.01
352	601021	春秋航空	700	40,229.00	0.01
353	600460	士兰微	1,300	39,351.00	0.01
354	300002	神州泰岳	2,800	39,200.00	0.01
355	300496	中科创达	400	38,540.00	0.01
356	002602	世纪华通	5,000	37,950.00	0.01
357	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.01
358	688516	奥特维	200	37,680.00	0.01
359	002624	完美世界	2,200	37,158.00	0.01
360	300133	华策影视	5,200	36,868.00	0.01
361	600879	航天电子	4,300	36,507.00	0.01
362	601872	招商轮船	6,200	35,898.00	0.01
363	603967	中创物流	3,900	35,646.00	0.01
364	603000	人民网	1,200	35,040.00	0.01
365	688008	澜起科技	600	34,452.00	0.01
366	600803	新奥股份	1,800	34,164.00	0.01
367	002174	游族网络	2,000	33,600.00	0.01
368	601808	中海油服	2,400	33,312.00	0.01
369	600018	上港集团	6,300	33,075.00	0.01
370	600901	江苏金租	7,980	32,957.40	0.01
371	000002	万科 A	2,300	32,246.00	0.01
372	300418	昆仑万维	800	32,224.00	0.01
373	300390	天华新能	900	32,220.00	0.01
374	002025	航天电器	500	31,900.00	0.01
375	688249	晶合集成	1,753	31,659.18	0.01
376	688396	华润微	600	31,446.00	0.01
377	000048	京基智农	1,600	31,232.00	0.01
378	600584	长电科技	1,000	31,170.00	0.01
379	600141	兴发集团	1,400	31,108.00	0.01
380	001696	宗申动力	4,300	30,444.00	0.01
381	002241	歌尔股份	1,700	30,175.00	0.01
382	600745	闻泰科技	600	29,340.00	0.01
383	601988	中国银行	7,500	29,325.00	0.01
384	300782	卓胜微	300	28,989.00	0.01
385	002063	远光软件	3,300	28,644.00	0.01
386	600837	海通证券	3,100	28,582.00	0.01
387	600038	中直股份	700	27,874.00	0.01
388	300408	三环集团	900	26,415.00	0.01
389	688551	科威尔	400	26,232.00	0.01
390	601688	华泰证券	1,900	26,163.00	0.01
391	002120	韵达股份	2,700	25,812.00	0.01
392	600320	振华重工	6,900	25,737.00	0.01
393	603118	共进股份	1,900	25,251.00	0.01
394	601169	北京银行	5,400	25,002.00	0.01

395	600025	华能水电	3,500	24,955.00	0.01
396	002139	拓邦股份	1,900	24,795.00	0.01
397	600875	东方电气	1,300	24,245.00	0.01
398	688568	中科星图	300	24,174.00	0.01
399	688093	世华科技	1,200	24,072.00	0.01
400	002180	纳思达	700	23,975.00	0.01
401	000034	神州数码	900	23,931.00	0.01
402	603220	中贝通信	1,400	23,870.00	0.01
403	300667	必创科技	1,200	23,628.00	0.01
404	600662	外服控股	4,100	23,452.00	0.01
405	301301	川宁生物	2,614	23,421.44	0.01
406	605378	野马电池	1,000	23,310.00	0.01
407	000830	鲁西化工	2,200	23,232.00	0.01
408	688508	芯朋微	400	23,196.00	0.01
409	601600	中国铝业	4,200	23,058.00	0.01
410	000400	许继电气	1,000	23,050.00	0.01
411	688007	光峰科技	1,100	22,935.00	0.01
412	002947	恒铭达	1,100	22,924.00	0.01
413	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
414	301086	鸿富瀚	450	22,815.00	0.01
415	300627	华测导航	700	22,729.00	0.01
416	002916	深南电路	300	22,611.00	0.01
417	300724	捷佳伟创	200	22,470.00	0.01
418	688002	睿创微纳	500	22,400.00	0.01
419	600718	东软集团	2,100	22,386.00	0.01
420	601211	国泰君安	1,600	22,384.00	0.01
421	002976	瑞玛精密	800	22,376.00	0.01
422	002141	贤丰控股	6,800	22,372.00	0.01
423	600363	联创光电	600	22,260.00	0.01
424	300718	长盛轴承	1,000	22,250.00	0.01
425	600517	国网英大	3,900	22,230.00	0.01
426	002389	航天彩虹	1,000	22,210.00	0.01
427	002017	东信和平	1,690	22,155.90	0.01
428	002660	茂硕电源	2,300	22,149.00	0.01
429	002937	兴瑞科技	900	22,140.00	0.01
430	300136	信维通信	1,100	22,088.00	0.01
431	002990	盛视科技	600	22,080.00	0.01
431	002635	安洁科技	1,600	22,080.00	0.01
432	002402	和而泰	1,300	22,074.00	0.01
433	300219	鸿利智汇	3,000	22,050.00	0.01
434	688060	云涌科技	400	22,040.00	0.01
435	002912	中新赛克	500	22,005.00	0.01
436	688299	长阳科技	1,400	21,938.00	0.01
437	002030	达安基因	2,200	21,934.00	0.01

438	600580	卧龙电驱	1,500	21,915.00	0.01
439	002851	麦格米特	600	21,882.00	0.01
440	002322	理工能科	2,100	21,840.00	0.01
441	601225	陕西煤业	1,200	21,828.00	0.01
442	605111	新洁能	500	21,760.00	0.01
443	300127	银河磁体	1,200	21,756.00	0.01
444	605123	派克新材	200	21,730.00	0.01
445	600288	大恒科技	1,800	21,726.00	0.01
446	002236	大华股份	1,100	21,725.00	0.01
447	002929	润建股份	500	21,705.00	0.01
448	002724	海洋王	2,500	21,700.00	0.01
449	002512	达华智能	5,400	21,654.00	0.01
450	002583	海能达	3,700	21,497.00	0.01
451	002273	水晶光电	1,800	21,492.00	0.01
452	300032	金龙机电	3,400	21,488.00	0.01
453	300523	辰安科技	900	21,474.00	0.01
454	002782	可立克	1,400	21,406.00	0.01
455	600215	派斯林	2,500	21,375.00	0.01
456	300661	圣邦股份	260	21,353.80	0.01
457	600229	城市传媒	2,500	21,300.00	0.01
458	002484	江海股份	1,000	21,290.00	0.01
459	603040	新坐标	800	21,272.00	0.01
460	300316	晶盛机电	300	21,270.00	0.01
461	688208	道通科技	700	21,217.00	0.01
462	300352	北信源	4,200	21,168.00	0.01
463	600637	东方明珠	2,700	21,114.00	0.01
464	603989	艾华集团	1,000	21,060.00	0.01
465	600571	信雅达	2,300	21,022.00	0.01
466	300300	海峡创新	4,900	21,021.00	0.01
467	688239	航宇科技	300	20,985.00	0.01
468	002467	二六三	4,200	20,874.00	0.01
469	600353	旭光电子	2,540	20,828.00	0.01
470	002421	达实智能	5,900	20,768.00	0.01
471	688561	奇安信	400	20,724.00	0.01
472	600760	中航沈飞	460	20,700.00	0.01
472	002131	利欧股份	9,000	20,700.00	0.01
473	002932	明德生物	796	20,608.44	0.01
474	688080	映翰通	420	20,538.00	0.01
475	603508	思维列控	1,200	20,460.00	0.01
476	603859	能科科技	400	20,452.00	0.01
477	688589	力合微	500	20,370.00	0.01
477	002212	天融信	2,100	20,370.00	0.01
478	603096	新经典	1,000	20,360.00	0.01
479	300941	创识科技	1,000	20,340.00	0.01

480	603881	数据港	900	20,331.00	0.01
481	603319	湘油泵	1,200	20,316.00	0.01
482	603103	横店影视	1,200	20,208.00	0.01
483	300872	天阳科技	1,300	20,202.00	0.01
484	688472	阿特斯	1,176	20,039.04	0.01
485	601939	建设银行	3,200	20,032.00	0.01
486	603171	税友股份	500	19,990.00	0.01
487	600761	安徽合力	1,000	19,930.00	0.01
488	600576	祥源文旅	2,500	19,925.00	0.01
489	002129	TCL 中环	600	19,920.00	0.01
490	301039	中集车辆	1,500	19,845.00	0.01
491	002987	京北方	900	19,728.00	0.01
492	002434	万里扬	2,200	19,690.00	0.01
493	000020	深华发 A	1,700	19,669.00	0.01
494	002885	京泉华	900	19,656.00	0.01
495	000786	北新建材	800	19,608.00	0.01
496	603768	常青股份	1,100	19,547.00	0.01
497	000738	航发控制	800	19,520.00	0.01
498	000570	苏常柴 A	3,500	19,495.00	0.01
499	301050	雷电微力	300	19,479.00	0.01
500	603466	风语筑	1,400	19,460.00	0.01
501	300251	光线传媒	2,400	19,416.00	0.01
502	300416	苏试试验	900	19,404.00	0.01
503	301117	佳缘科技	300	19,386.00	0.01
504	605167	利柏特	2,000	19,360.00	0.01
505	601877	正泰电器	700	19,355.00	0.01
506	601100	恒立液压	300	19,299.00	0.01
507	603488	展鹏科技	2,400	19,272.00	0.01
508	688711	宏微科技	330	19,252.20	0.01
509	002526	山东矿机	7,700	19,250.00	0.01
510	002698	博实股份	1,100	19,239.00	0.01
511	603331	百达精工	1,300	19,214.00	0.01
512	002073	软控股份	2,900	19,198.00	0.01
513	603158	腾龙股份	2,500	19,150.00	0.01
514	688033	天宜上佳	1,000	19,120.00	0.01
515	300978	东箭科技	1,400	19,082.00	0.01
516	688138	清溢光电	900	18,999.00	0.01
517	603628	清源股份	1,200	18,996.00	0.01
518	600585	海螺水泥	800	18,992.00	0.01
519	300185	通裕重工	6,800	18,972.00	0.01
520	002611	东方精工	3,300	18,942.00	0.01
521	000811	冰轮环境	1,200	18,912.00	0.01
522	300777	中简科技	400	18,904.00	0.01
523	002446	盛路通信	2,000	18,900.00	0.01

523	002448	中原内配	2,700	18,900.00	0.01
524	600480	凌云股份	2,400	18,864.00	0.01
525	002284	亚太股份	2,100	18,837.00	0.01
526	603279	景津装备	600	18,816.00	0.01
527	688126	沪硅产业	900	18,810.00	0.01
528	300435	中泰股份	1,300	18,772.00	0.01
529	002048	宁波华翔	1,400	18,760.00	0.01
530	000852	石化机械	2,600	18,694.00	0.01
531	000338	潍柴动力	1,500	18,690.00	0.01
532	002454	松芝股份	2,200	18,634.00	0.01
533	002283	天润工业	2,900	18,618.00	0.01
534	600312	平高电气	1,500	18,585.00	0.01
535	601658	邮储银行	3,800	18,582.00	0.01
536	688257	新锐股份	700	18,557.00	0.01
537	000951	中国重汽	1,100	18,535.00	0.01
538	603012	创力集团	3,000	18,510.00	0.01
539	603088	宁波精达	2,200	18,436.00	0.01
540	600104	上汽集团	1,300	18,421.00	0.01
541	002438	江苏神通	1,600	18,368.00	0.01
542	300004	南风股份	3,400	18,360.00	0.01
542	600379	宝光股份	1,800	18,360.00	0.01
542	600815	厦工股份	6,800	18,360.00	0.01
543	600031	三一重工	1,100	18,293.00	0.01
544	002169	智光电气	2,200	18,238.00	0.01
545	601126	四方股份	1,200	18,228.00	0.01
546	000157	中联重科	2,700	18,225.00	0.01
547	600372	中航电子	1,200	18,216.00	0.01
548	600481	双良节能	1,300	18,174.00	0.01
548	688676	金盘科技	600	18,174.00	0.01
549	603507	振江股份	500	18,130.00	0.01
550	603758	秦安股份	1,700	18,088.00	0.01
551	688586	江航装备	1,300	18,083.00	0.01
552	002690	美亚光电	700	18,025.00	0.01
553	601222	林洋能源	2,200	18,018.00	0.01
554	002706	良信股份	1,600	18,000.00	0.01
555	603187	海容冷链	900	17,991.00	0.01
556	002335	科华数据	500	17,975.00	0.01
557	603032	德新科技	520	17,960.80	0.01
558	603950	长源东谷	1,200	17,952.00	0.01
559	300354	东华测试	400	17,880.00	0.01
560	301029	怡合达	400	17,872.00	0.01
561	603895	天永智能	700	17,871.00	0.01
562	002046	国机精工	1,400	17,864.00	0.01
563	688128	中国电研	700	17,850.00	0.01

564	688361	中科飞测	276	17,848.92	0.01
565	301028	东亚机械	1,600	17,840.00	0.01
566	603283	赛腾股份	400	17,800.00	0.01
567	300304	云意电气	3,200	17,728.00	0.01
568	601567	三星医疗	1,400	17,682.00	0.01
569	300745	欣锐科技	400	17,668.00	0.01
569	603556	海兴电力	700	17,668.00	0.01
570	300223	北京君正	200	17,662.00	0.01
571	002829	星网宇达	400	17,572.00	0.01
572	002270	华明装备	1,600	17,520.00	0.01
573	600596	新安股份	1,600	17,488.00	0.01
574	000982	中银绒业	11,500	17,480.00	0.01
575	002158	汉钟精机	700	17,472.00	0.01
576	300861	美畅股份	400	17,348.00	0.01
577	688469	中芯集成	3,174	17,171.34	0.01
578	688599	天合光能	400	17,044.00	0.01
579	600482	中国动力	700	16,408.00	0.01
580	300207	欣旺达	1,000	16,320.00	0.01
581	600498	烽火通信	800	16,296.00	0.01
582	603129	春风动力	100	16,190.00	0.01
583	002649	博彦科技	1,100	15,543.00	0.01
584	600970	中材国际	1,200	15,300.00	0.01
585	688006	杭可科技	500	15,235.00	0.01
586	688478	晶升股份	354	14,998.98	0.00
587	002281	光迅科技	400	14,836.00	0.00
588	000776	广发证券	1,000	14,710.00	0.00
589	688009	中国通号	2,516	14,592.80	0.00
590	688562	航天软件	618	13,787.58	0.00
591	688576	西山科技	114	13,726.74	0.00
592	688443	智翔金泰	451	13,299.99	0.00
593	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
594	600926	杭州银行	1,100	12,925.00	0.00
595	688531	日联科技	93	12,645.21	0.00
596	002368	太极股份	300	12,351.00	0.00
597	002080	中材科技	600	12,312.00	0.00
598	688484	南芯科技	335	12,297.85	0.00
599	688582	芯动联科	300	12,204.00	0.00
600	600536	中国软件	260	12,188.80	0.00
601	301408	华人健康	717	12,153.15	0.00
602	600131	国网信通	600	12,114.00	0.00
603	688146	中船特气	311	11,858.43	0.00
604	600583	海油工程	2,000	11,700.00	0.00
605	688543	国科军工	215	11,405.75	0.00
606	601998	中信银行	1,900	11,362.00	0.00

607	688523	航天环宇	458	10,923.30	0.00
608	600938	中国海油	600	10,872.00	0.00
609	301246	宏源药业	354	10,871.34	0.00
610	000049	德赛电池	300	10,584.00	0.00
611	000719	中原传媒	900	10,530.00	0.00
612	688620	安凯微	841	10,377.94	0.00
613	688458	美芯晟	111	10,074.36	0.00
614	688352	硕中科技	811	9,788.77	0.00
615	688593	新相微	652	9,512.68	0.00
616	688334	西高院	581	9,418.01	0.00
617	688187	时代电气	224	9,376.64	0.00
618	688552	航天南湖	393	9,235.50	0.00
619	002544	普天科技	400	9,160.00	0.00
620	600188	兖矿能源	300	8,976.00	0.00
621	688581	安杰思	75	8,852.25	0.00
622	600486	扬农化工	100	8,742.00	0.00
623	002736	国信证券	1,000	8,730.00	0.00
624	688433	华曙高科	275	8,662.50	0.00
625	601179	中国西电	1,600	8,656.00	0.00
626	688512	慧智微	447	8,564.52	0.00
627	600118	中国卫星	300	8,463.00	0.00
628	601611	中国核建	1,000	8,450.00	0.00
629	301322	绿通科技	156	8,305.44	0.00
630	000066	中国长城	600	8,298.00	0.00
631	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
632	600968	海油发展	2,600	7,982.00	0.00
633	600339	中油工程	1,900	7,733.00	0.00
634	600378	昊华科技	200	7,528.00	0.00
635	688631	莱斯信息	238	7,109.06	0.00
636	601881	中国银河	600	6,966.00	0.00
637	301439	泓淋电力	405	6,844.50	0.00
638	001289	龙源电力	300	6,750.00	0.00
639	688479	友车科技	222	6,546.78	0.00
640	600871	石化油服	3,300	6,534.00	0.00
641	000778	新兴铸管	1,600	6,528.00	0.00
642	000617	中油资本	900	6,507.00	0.00
643	688425	铁建重工	1,350	6,493.50	0.00
644	601061	中信金属	856	6,488.48	0.00
645	002756	永兴材料	100	6,261.00	0.00
646	000726	鲁泰 A	900	6,156.00	0.00
647	000999	华润三九	100	6,066.00	0.00
648	600685	中船防务	200	5,990.00	0.00
649	301345	涛涛车业	120	5,596.80	0.00
650	603135	中重科技	306	5,474.34	0.00

651	002643	万润股份	300	5,223.00	0.00
652	601898	中煤能源	600	5,064.00	0.00
653	000708	中信特钢	300	4,752.00	0.00
654	000657	中钨高新	490	4,748.10	0.00
655	000910	大亚圣象	600	4,686.00	0.00
656	002609	捷顺科技	400	4,664.00	0.00
657	600893	航发动力	100	4,226.00	0.00
658	601965	中国汽研	200	4,130.00	0.00
659	000877	天山股份	500	4,070.00	0.00
660	601133	柏诚股份	304	3,727.04	0.00
661	601869	长飞光纤	100	3,701.00	0.00
662	000050	深天马 A	400	3,672.00	0.00
663	600497	驰宏锌锗	700	3,514.00	0.00
664	601065	江盐集团	296	3,504.64	0.00
665	601399	国机重装	1,100	3,498.00	0.00
666	600500	中化国际	600	3,336.00	0.00
667	300212	易华录	100	3,323.00	0.00
668	300747	锐科激光	100	3,048.00	0.00
669	600967	内蒙一机	300	3,030.00	0.00
670	601106	中国一重	900	3,024.00	0.00
671	600764	中国海防	100	2,722.00	0.00
672	600206	有研新材	200	2,628.00	0.00
673	603125	常青科技	97	2,379.41	0.00
674	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
675	600850	电科数字	100	2,359.00	0.00
676	600335	国机汽车	200	2,280.00	0.00
677	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
678	000898	鞍钢股份	700	1,946.00	0.00
679	600808	马钢股份	700	1,799.00	0.00
680	600006	东风汽车	300	1,773.00	0.00
681	000800	一汽解放	200	1,674.00	0.00
682	000825	太钢不锈	400	1,548.00	0.00
683	601005	重庆钢铁	1,100	1,540.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601117	中国化学	28,745,107.02	8.38
2	600153	建发股份	22,427,247.85	6.53
3	000001	平安银行	14,286,218.00	4.16

4	601318	中国平安	13,678,916.00	3.99
5	600036	招商银行	12,084,438.69	3.52
6	300750	宁德时代	8,198,582.52	2.39
7	601166	兴业银行	8,046,503.00	2.34
8	603706	东方环宇	7,351,948.52	2.14
9	601668	中国建筑	7,205,022.60	2.10
10	301042	安联锐视	7,132,629.60	2.08
11	600048	保利发展	7,023,243.00	2.05
12	600519	贵州茅台	6,705,872.00	1.95
13	605287	德才股份	5,757,912.00	1.68
14	000858	五粮液	5,440,798.00	1.59
15	603788	宁波高发	5,308,049.00	1.55
16	603937	丽岛新材	4,926,632.00	1.44
17	300076	GQY 视讯	4,813,041.80	1.40
18	300375	鹏翎股份	4,806,535.00	1.40
19	300218	安利股份	4,494,870.01	1.31
20	688556	高测股份	4,356,785.36	1.27

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	17,615,183.20	5.13
2	601318	中国平安	16,664,659.49	4.86
3	000001	平安银行	14,935,371.00	4.35
4	600153	建发股份	14,021,489.00	4.09
5	600519	贵州茅台	12,742,074.00	3.71
6	601117	中国化学	12,696,912.88	3.70
7	601166	兴业银行	11,647,142.00	3.39
8	300750	宁德时代	11,284,720.00	3.29
9	600048	保利发展	7,639,700.99	2.23
10	601668	中国建筑	7,587,117.00	2.21
11	603706	东方环宇	6,983,611.00	2.03
12	000858	五粮液	6,846,621.00	1.99
13	301042	安联锐视	6,718,875.00	1.96
14	601288	农业银行	6,284,440.00	1.83
15	605287	德才股份	5,560,829.00	1.62
16	000333	美的集团	5,344,990.00	1.56
17	603788	宁波高发	5,070,394.00	1.48
18	601601	中国太保	4,958,221.00	1.44
19	300059	东方财富	4,936,081.00	1.44
20	300375	鹏翎股份	4,793,480.00	1.40

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	830,403,506.96
卖出股票的收入（成交）总额	843,125,400.46

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	606,657.86	0.20
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）	163,042,369.56	53.86
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	163,649,027.42	54.06

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	113044	大秦转债	239,120	27,622,225.23	9.12
2	110053	苏银转债	210,490	26,461,995.44	8.74
3	110043	无锡转债	237,790	25,980,857.22	8.58
4	128081	海亮转债	182,650	23,296,982.48	7.70
5	113050	南银转债	150,530	16,947,352.00	5.60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，杭州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深圳证监局的处罚。江苏银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行的处罚。平安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辽宁监管局、上海监管局的处罚。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	95,547.81
2	应收清算款	138,201.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	5,900.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	239,649.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113044	大秦转债	27,622,225.23	9.12
2	110053	苏银转债	26,461,995.44	8.74
3	110043	无锡转债	25,980,857.22	8.58
4	128081	海亮转债	23,296,982.48	7.70
5	113050	南银转债	16,947,352.00	5.60
6	110079	杭银转债	15,055,440.19	4.97
7	127027	能化转债	9,836,147.66	3.25
8	128034	江银转债	2,770,696.01	0.92
9	128048	张行转债	1,174,901.79	0.39
10	110080	东湖转债	880,847.24	0.29
11	128075	远东转债	872,401.66	0.29
12	113631	皖天转债	856,163.86	0.28
13	128049	华源转债	851,802.95	0.28
14	113619	世运转债	843,823.95	0.28
15	128130	景兴转债	838,270.74	0.28
16	128026	众兴转债	831,426.23	0.27
17	113058	友发转债	829,464.99	0.27
18	110084	贵燃转债	829,073.47	0.27
19	128133	奇正转债	823,632.72	0.27
20	127018	本钢转债	822,598.37	0.27
21	123146	中环转 2	821,401.14	0.27
22	113021	中信转债	815,011.58	0.27
23	123087	明电转债	754,943.84	0.25
24	113549	白电转债	748,017.53	0.25
25	113535	大业转债	740,893.97	0.24
26	113505	杭电转债	733,997.26	0.24

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

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
3,766	58,946.10	196,531,054.52	88.53%	25,459,943.87	11.47%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	22,877.94	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

基金合同生效日（2017年5月4日）基金份额总额	262,251,781.89
本报告期期初基金份额总额	255,686,366.79
本报告期基金总申购份额	12,409,854.67
减：本报告期基金总赎回份额	46,105,223.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	221,990,998.39

§ 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	
广发证	1	66,395,789.34	4.03%	61,827.72	4.54%	-

券							
申万宏源	2	-	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-	-
南京证券	1	83,586,730.09	5.08%	61,127.06	4.49%	增加 1 个	
东吴证券	1	136,245,054.63	8.28%	126,884.30	9.31%	-	
国泰君安	1	-	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	-	
英大证券	1	-	-	-	-	-	
天风证券	1	10,440,842.33	0.63%	7,636.46	0.56%	增加 1 个	
中信建投	1	151,127,691.56	9.18%	110,520.67	8.11%	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	-	
华泰证券	3	-	-	-	-	-	
长江证券	1	90,360,079.01	5.49%	84,153.42	6.18%	-	
方正证券	2	-	-	-	-	-	
西部证券	1	-	-	-	-	-	
开源证券	1	207,463,511.64	12.61%	151,717.04	11.14%	-	
光大证券	3	105,522,201.56	6.41%	98,272.70	7.21%	-	
中金公司	2	43,177,935.87	2.62%	40,209.66	2.95%	-	
国金证券	1	236,529,585.18	14.37%	218,533.92	16.04%	增加 1 个	
银河证券	1	-	-	-	-	-	
东方证	1	63,036,958.10	3.83%	46,098.65	3.38%	-	

券							
诚通证 券	1	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	1	-	-	-	-	-	-
华创证 券	1	-	-	-	-	-	-
招商证 券	2	-	-	-	-	-	-
国元证 券	1	28,537,675.46	1.73%	26,577.33	1.95%	增加 1 个	
东莞证 券	1	-	-	-	-	-	
安信证 券	1	-	-	-	-	-	
华西证 券	3	167,276,486.52	10.16%	127,990.35	9.40%	-	
山西证 券	1	189,243,709.75	11.50%	138,395.32	10.16%	增加 1 个	
中信证 券	1	66,832,745.08	4.06%	62,242.81	4.57%	-	

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，我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；能根据本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
广发证券	10,625,028.72	5.29%	-	-	-	-
申万宏源	19,917,415.86	9.91%	-	-	-	-

宏信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	185,724.38	0.09%	-	-	-	-
中信建投	22,005,376.31	10.95%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	16,813,402.82	8.37%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	3,002,125.02	1.49%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	43,605,323.91	21.70%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	19,047,842.09	9.48%	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	57,583,145.11	28.65%	-	-	-	-
山西证券	7,752.52	-	-	-	-	-
中信证券	8,189,666.36	4.07%	-	-	-	-

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	证券日报、基金管理人网	2023-06-01

	长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	站、证监会基金电子披露网站	
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
3	博时量化平衡混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
4	博时量化平衡混合型证券投资基金 2022 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
5	博时量化平衡混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-09
6	博时量化平衡混合型证券投资基金更新招募说明书	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
7	博时基金管理有限公司关于博时量化平衡混合型证券投资基金的基金经理变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
9	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
10	博时量化平衡混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	证券日报、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 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	2023-01-01~ 2023-06-30	171,032,744. 49	-	-	171,032,74 4.49	77.04%
产品特有風險							
<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。

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平衡混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化平衡混合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、博时量化平衡混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时量化平衡混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日