

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	68
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	68
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	70
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息	74
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时智选量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	博时智选量化多因子股票	
基金主代码	013465	
交易代码	013465	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 2 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	300,125,298.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
下属分级基金的交易代码	013465	013466
报告期末下属分级基金的份额总额	56,559,750.21 份	243,565,548.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金。投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，大类资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。其次，股票投资策略以“量化投资”为主要投资策略，通过多因子模型进行股票选择并构建股票投资组合。其他资产投资策略包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、流通受限证券投资策略、参与融资业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*90%+中债综合财富（总值）指数收益率*5%+活期存款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	林彬
	联系电话	0755-83169999	0571-88269636
	电子邮箱	service@bosera.com	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		95105568	95527
传真		0755-83195140	0571-88268688

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	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码	518040	310006
法定代表人	江向阳	陆建强

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
本期已实现收益	7,136,816.48	28,362,444.16	-3,441,049.43	-20,835,153.35	-4,526,025.29	-31,119,660.61
本期利润	11,901,585.39	52,965,645.37	-1,756,023.77	-15,531,157.63	-8,897,425.07	-37,745,823.95
加权平均基金份额本期利润	0.2364	0.2202	-0.0279	-0.0543	-0.2134	-0.1093
本期加权平均净值利润率	26.91%	25.53%	-3.02%	-5.97%	-22.70%	-11.70%
本期基金份额净值增长率	28.60%	27.97%	-4.50%	-4.97%	-12.04%	-12.49%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C

期末可供分配利润	-323,585.51	-5,197,244.19	-7,966,871.51	-43,231,613.87	-8,694,707.38	-30,739,990.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0057	-0.0213	-0.1545	-0.1636	-0.1147	-0.1199
期末基金资产净值	61,498,625.72	260,679,151.60	43,612,089.47	221,060,365.72	67,118,652.52	225,725,012.51
期末基金份额净值	1.0873	1.0703	0.8455	0.8364	0.8853	0.8801
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
基金份额累计净值增长率	8.73%	7.03%	-15.45%	-16.36%	-11.47%	-11.99%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 博时智选量化多因子股票 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.54%	2.30%	4.23%	2.16%	9.31%	0.14%
过去六个月	29.67%	2.15%	19.88%	2.02%	9.79%	0.13%
过去一年	28.60%	1.86%	1.96%	1.90%	26.64%	-0.04%
过去三年	8.03%	1.44%	-22.09%	1.46%	30.12%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.73%	1.41%	-16.82%	1.43%	25.55%	-0.02%

2. 博时智选量化多因子股票 C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.42%	2.30%	4.23%	2.16%	9.19%	0.14%
过去六个月	29.34%	2.15%	19.88%	2.02%	9.46%	0.13%
过去一年	27.97%	1.86%	1.96%	1.90%	26.01%	-0.04%
过去三年	6.42%	1.44%	-22.09%	1.46%	28.51%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.03%	1.41%	-16.82%	1.43%	23.85%	-0.02%

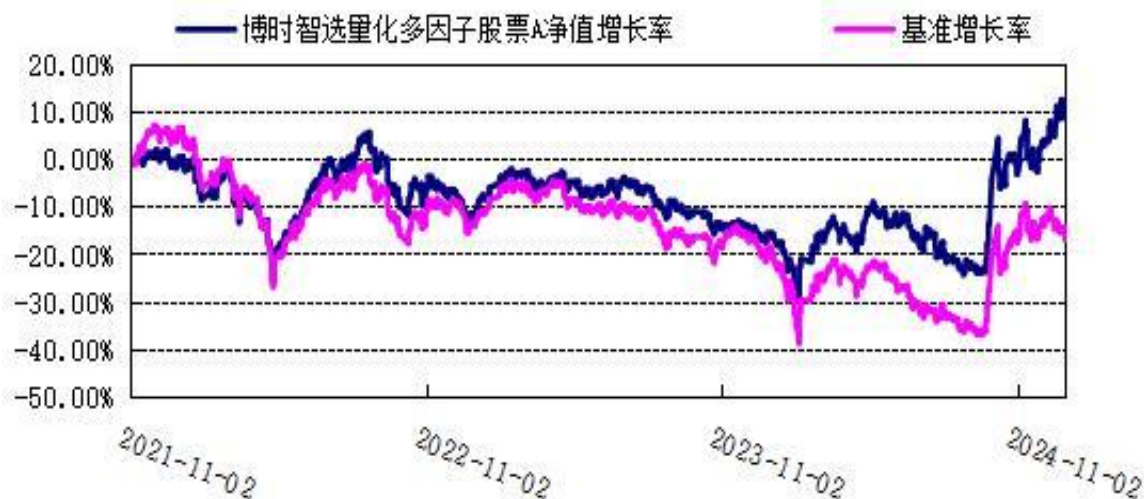
效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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

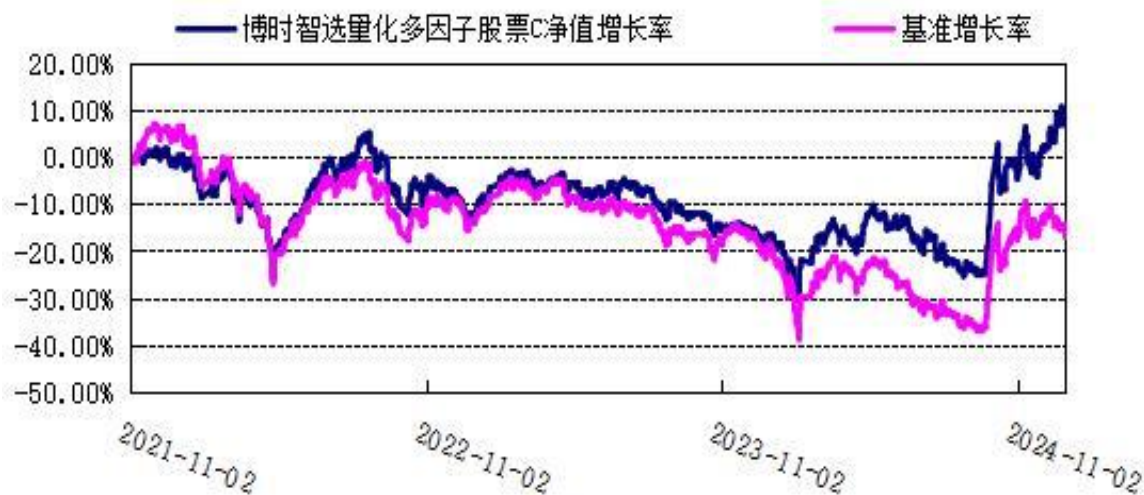
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 11 月 2 日至 2024 年 12 月 31 日)

1、博时智选量化多因子股票 A



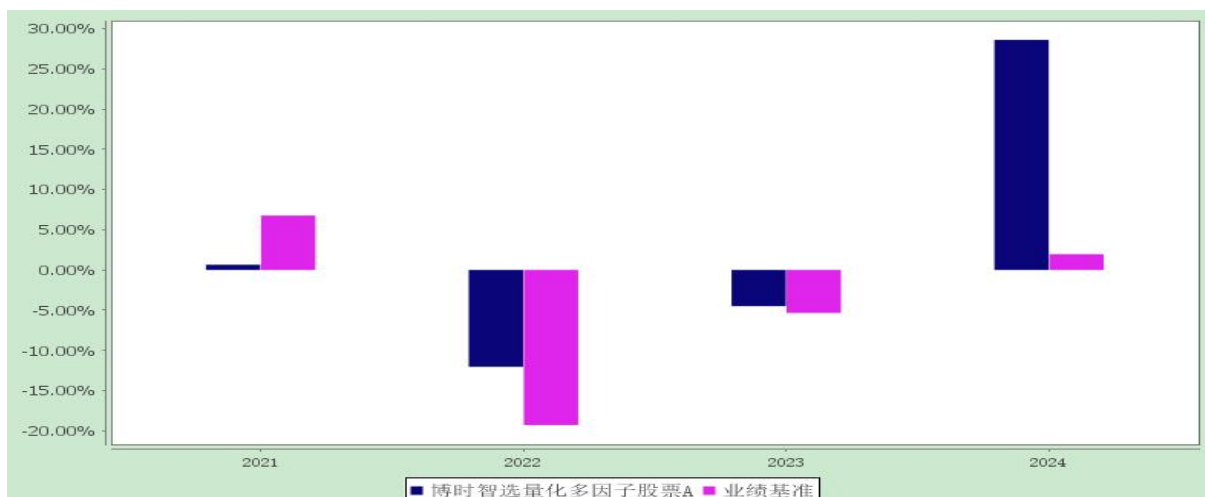
2、博时智选量化多因子股票 C



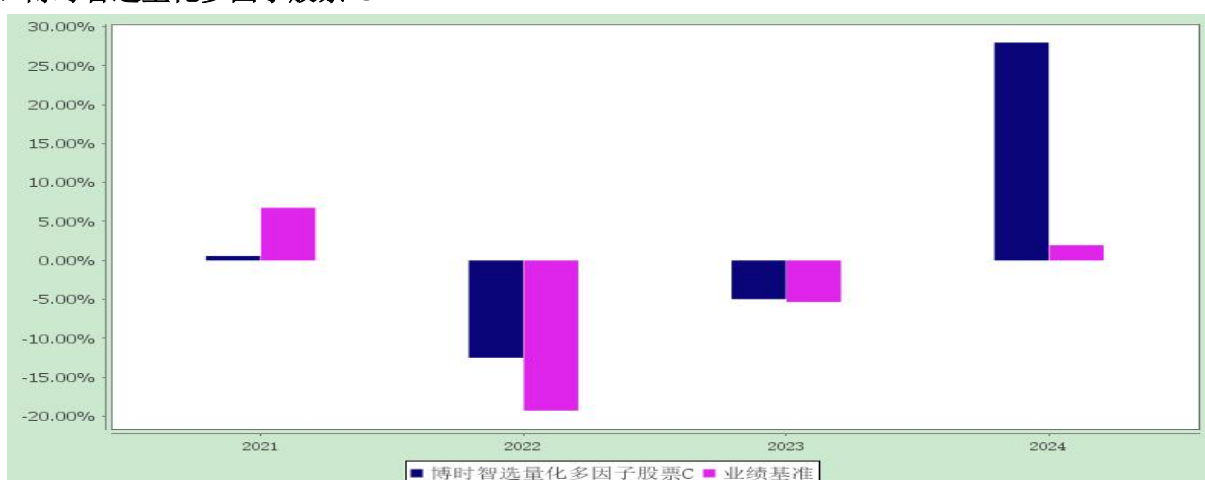
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时智选量化多因子股票 A



2、博时智选量化多因子股票 C



注：本基金的基金合同于 2021 年 11 月 2 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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 2024 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 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 16089 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 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

12 月，国家开发银行授予博时基金“优秀投资机构合作奖”，表彰公司在国家开发银行 2024 年银行间市场金融债券投资工作中表现突出。

11 月，深证投资者服务中心联合全景投教基地召开《股东来了》（2024）投资者权益知识竞赛深圳片区总结交流会，授予博时基金《股东来了》（2024）深圳片区突出贡献团体奖。

10 月，中国人民银行 2023 年度金融科技发展奖获奖项目名单出炉，博时基金“新一代资管业务资金清算系统”荣获三等奖。

4 月，深圳市人工智能学会公布 2023 年度第三届“深圳人工智能奖”获奖名单，博时基金“智能量化因子投研系统”荣获人工智能行业应用奖。

1 月，中国人民银行公布 2022 年度金融科技发展奖获奖项目名单，博时基金“陪伴服务平台项目”荣获三等奖。

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		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2021-11-02	-	18.3	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日-2024 年 7 月 10 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日—至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日—至今)、博时稳合一年持有

					期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 132 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

2024 年，在政策刺激力度不断加码、经济结构调整持续改善、外围利率水平掉头向下等因素的影响下，A 股市场触底反弹，迎来了收获的一年。

首先是货币政策，2024 年总共下调了三次 LPR、两次存款准备金率，5 年期 LPR 从 4.2%降至

3.6%，存款准备金率从平均 7.6% 降至 6.6%，释放长期流动性超过 2 万亿元。同时，央行对货币政策的表述也发生了重要变化，从“稳健”调整为“适度宽松”，流动性目标从“合理充裕”调整为“充裕”，并明确提出“引导金融机构加大货币信贷投放力度”，更加重视从“宽货币”到“宽信用”的传导。伴随着政策的调整，10 年期国债利率大幅下行，从年初的 2.56% 下降至年末的 1.6% 左右。

其次是经济基本面，物价水平有所回升，核心 CPI 涨幅连续回升；企业效益改善，规模以上工业企业利润降幅收窄；以新能源汽车为代表的出口增长强劲，国际市场份额提升；企业居民收入好转，全国居民人均可支配收入比上年实际增长 5.1%。全年 4 个季度，GDP 增速分别是 5.3%、4.7%、4.6% 和 5.4%，触底反弹。

外围方面，美联储于 9 月份宣布降息 50bp，随后又连续两次降息，全年累计降幅为 100 个基点。外围市场利率水平的下降，为国内宏观政策的进一步调整打开了空间。

在上述背景下，A 股触底反弹，主要宽基均以阳线报收，且大盘指数涨幅居前，小盘指数涨幅居后。全年沪深 300 指数上涨 14.68%，中证 500 指数上涨 5.46%，本基金业绩基准跟踪的中证 1000 指数小幅上涨 1.2%。

站在量化投资的角度，2024 年 A 股市场还有三个特点，一是结构性行情，二是风格及风险偏好的快速切换，三是博弈强度的加大。

首先，A 股市场延续了 2023 年以来的结构性行情，表现为个股和行业的较大差异。个股层面，一些科技成长股在 AI、人形机器人等概念的带动下，表现极为出色，个别个股全年涨幅超过 3 倍；行业层面，31 个申万一级行业有 21 个上涨，10 个下跌，首尾差异超过 47%。部分主动型公募基金差异化的配置了行业和个股，基金业绩形成了明显分化。

其次，2024 年 A 股市场经历了两次较大的波动，一是春节前，因小市值个股积累了较多涨幅，随着风险偏好快速下行及部分产品去杠杆，集中释放了流动性风险。另一次是 9 月中下旬，在一系列宏观政策颁布、且外围金融环境有所好转之后，A 股迎来一段快速上涨行情，市场单日成交额逾 2.6 万亿，创历史新高。这两次大幅波动，都伴随着投资者风险偏好的迅速转向，提高了风格择时与仓位择时的难度。

最后，随着信息技术的发展，AI 辅助编程得到普及，量化投资的门槛持续降低，A 股博弈难度明显增大。传统量化投资框架下，量价和基本面信息被充分挖掘，alpha 因子的超额收益越来越窄，一些投资团队主动转向大数据等另类信息，“预判量化的预判”成为了一种可能的尝试，进一步加大了市场竞争的强度。

在上述市场环境变化的背景下，我们一直在思考公募主动量化基金投资方法论的改进，包括但不限于放大行业的暴露、量化结合主观分析放大个股暴露、使用人工智能技术挖掘增量信息、强化

投资模型和投资经验的相互印证等。从全年来看，我们主动暴露新质生产力相关行业、暴露得到主观研究印证的个股、基于投资经验切换风格因子、借助 AI 模型提供投资决策依据等操作，均取得了一定的效果。

特别需要指出的是行业暴露的放大。传统的量化投资实践中，有一条很重要的原则，就是行业中性。一般情况下，量化因子都进行了行业中性的处理。也正是因为这个原因，量化投资框架下的成长股和普通投资者眼中的成长股存在较大差异。但在国民经济结构转型的宏观背景下，严格限制行业暴露会降低量化模型获取超额收益的能力。基于这一逻辑，我们认为，改进传统方法、适当放大行业暴露，是有利于基金持有人利益的。

量化分析工具和主观分析方法并无明显的界限，所有的工具方法都只为找到有投资价值的公司，并为基金持有人带来合理的投资回报。量化投资的本质是科学投资，投资策略没有禁区，所有符合科学思想的工具和逻辑均可为我所用。本基金也会坚持这一大的原则，及时学习包括 AI 在内的方法论的演进，跟踪分析市场的新变化，检讨应对思路，小心认真的调整策略组合。我们相信，随着时间的推延，科学投资方法论会在基金投资管理业务上越走越顺，越走越远。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0873 元，份额累计净值为 1.0873 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0703 元，份额累计净值为 1.0703 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 28.60%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 27.97%，同期业绩基准增长率为 1.96%。

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 2025 年，我们认为 A 股市场仍将延续结构性行情，但市场环境将更加复杂，投资机会与挑战并存。

国内宏观环境将持续改善。经济基本面仍处于温和复苏过程中，宏观数据和 PMI 数据逐步向好，稳增长政策将持续发力，央行货币政策保持宽松。国际方面，美联储降息的节奏放缓，但方向不变。国际局势仍不稳定，各地的冲突和紧张局势对全球安全和地区稳定构成了挑战。世界经济逆全球化的趋势也还在延续，为接下去来的全球宏观经济走势增加了颇多不确定性。

但不管大的环境如何波动，中国经济结构转型的步伐不会停滞。需要特别指出的是，2025 年春节假期，两家非上市企业——DeepSeek 和宇树科技——分别发布了革命性的产品，在中国以 AI、人形机器人为代表的新质生产力行业发展蓝图上留下了浓墨重彩的一笔。我们认为，人工智能技术的发展将不仅仅造福科技产业链，还会对全社会生产效率和服务质量的提升起到有重要帮助。AI 技术的进步将为整个国民经济的持续增长提供强而有力的支撑。

在政策环境稳定、经济复苏预期增强的背景下，A 股市场的投资机会大于风险。从流动性与估值视角看，2025 年 A 股流动性有望继续改善，内外均有望迎来增量资金。具体表现为：一是市场回暖有望推动居民储蓄持续入市；二是机构投资者仓位水平与入市规模仍有提升空间；三是新型货币政策工具实施或为市场带来更多增量资金；四是海外主动资金对 A 股低配情况有较大改善空间。

综上所述，2025 年 A 股市场充满了机会和挑战。本基金将继续坚持以跑赢业绩基准和基金业同行行为投资目标，以量化模型为立足之本，强调模型的投资逻辑或行为金融学含义；以主观修正为破局助力，强调投资经验在模型比例配置中不可或缺的地位；坚持以维护持有人利益为价值导向，做好收益与风险的平衡；坚持以长期主义为决策目标，避免短期的过度投机，最终为基金持有人赚取合理的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《制度管理规范》、《合规管理制度》、《全面风险管理制度》、《内部稽核审计制度》、《投资者适当性管理制度》、《公募基金证券交易佣金分配管理办法》、《货币市场基金投资管理制度》、《对外信息发布管理制度》、《公募基金法定信息披露管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，完善“博时合规管理及审计系统”中制度库应用、合规报告生成等模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金默认收益分配基准日为每个自然月的第一个工作日，当每月默认收益分配基准日的每份基金份额可供分配利润为正时，且在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以按月进行收益分配。基金管理人可根据基金运作的实际情况对上述规则进行调整，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 年年度报告中财务指标、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复核，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2025）审字第 70019484_A52 号

博时智选量化多因子股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时智选量化多因子股票型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的博时智选量化多因子股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企

业会计准则的规定编制，公允反映了博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

6.3 其他信息

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

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

治理层负责监督博时智选量化多因子股票型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来

可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

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

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

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

楼坚 朱燕

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

2025年3月27日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	11,699,651.82	10,583,896.53
结算备付金		6,528,035.23	6,226,140.27
存出保证金		536,022.00	-
交易性金融资产	7.4.7.2	304,443,272.15	248,981,034.67
其中：股票投资		297,052,082.20	243,311,981.30
基金投资		-	-
债券投资		7,391,189.95	5,669,053.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,932,776.14	274,060.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		331,139,757.34	266,065,132.39
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,464,106.66	820,533.58
应付管理人报酬		304,273.66	272,083.89
应付托管费		50,712.27	45,347.30
应付销售服务费		102,323.87	94,711.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	40,563.56	160,000.97
负债合计		8,961,980.02	1,392,677.20
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	300,125,298.34	315,870,940.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	22,052,478.98	-51,198,485.38
净资产合计		322,177,777.32	264,672,455.19
负债和净资产总计		331,139,757.34	266,065,132.39

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 300,125,298.34 份。其中 A 类基金份额净值 1.0873 元，基金份额总额 56,559,750.21 份；C 类基金份额净值 1.0703 元，基金份额总额 243,565,548.13 份。

7.2 利润表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		69,583,502.48	-10,698,555.86
1.利息收入		36,671.91	194,499.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	35,872.96	125,617.44
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		798.95	68,881.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,840,271.57	-18,290,691.28
其中：股票投资收益	7.4.7.10	36,817,122.24	-22,571,093.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	156,745.15	21,603.43
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-87,979.67	-621,264.89
股利收益	7.4.7.14	2,954,383.85	4,880,063.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	29,367,970.12	6,989,021.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	338,588.88	408,614.66

减：二、营业总支出		4,716,271.72	6,588,625.54
1. 管理人报酬		3,017,016.81	4,325,398.77
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		502,836.22	806,772.89
3. 销售服务费		1,036,418.58	1,296,058.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.11	194.90
8. 其他费用	7.4.7.18	160,000.00	160,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,867,230.76	-17,287,181.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,867,230.76	-17,287,181.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,867,230.76	-17,287,181.40

7.3 净资产变动表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	315,870,940.57	-51,198,485.38	264,672,455.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	315,870,940.57	-51,198,485.38	264,672,455.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,745,642.23	73,250,964.36	57,505,322.13
（一）、综合收益总额	-	64,867,230.76	64,867,230.76
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号	-15,745,642.23	8,383,733.60	-7,361,908.63

填列)			
其中：1.基金申购款	218,677,269.36	-7,880,114.24	210,797,155.12
2.基金赎回款	-234,422,911.59	16,263,847.84	-218,159,063.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	300,125,298.34	22,052,478.98	322,177,777.32
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	332,278,363.14	-39,434,698.11	292,843,665.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	332,278,363.14	-39,434,698.11	292,843,665.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,407,422.57	-11,763,787.27	-28,171,209.84
(一)、综合收益总额	-	-17,287,181.40	-17,287,181.40
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-16,407,422.57	5,523,394.13	-10,884,028.44
其中：1.基金申购款	326,572,792.88	-22,463,145.08	304,109,647.80
2.基金赎回款	-342,980,215.45	27,986,539.21	-314,993,676.24
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	315,870,940.57	-51,198,485.38	264,672,455.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时智选量化多因子股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]1517 号《关于准予博时智选量化多因子股票型证券投资基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 473,405,857.94 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60669135_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》于 2021 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 473,529,308.34 份基金份额，其中认购资金利息折合 123,450.40 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债、次级债等）、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权、信用

衍生品等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。本基金的投资组合比例:本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)的比例不低于基金资产的 80%,每个交易日日终在扣除国债期货、股票期权、股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率*90%+中债综合财富(总值)指数收益率*5%+活期存款收益率*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违

约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基

金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

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

交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2） 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

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

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

（3） 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	11,699,651.82	10,583,896.53
等于：本金	11,699,426.87	10,583,346.56
加：应计利息	224.95	549.97
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
合计	11,699,651.82	10,583,896.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		272,033,127.82	-	297,052,082.20	25,018,954.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,311,579.00	74,749.95	7,391,189.95	4,861.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,311,579.00	74,749.95	7,391,189.95	4,861.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		279,344,706.82	74,749.95	304,443,272.15	25,023,815.38
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		247,645,863.04	-	243,311,981.30	-4,333,881.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,586,353.00	74,373.37	5,669,053.37	8,327.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,586,353.00	74,373.37	5,669,053.37	8,327.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		253,232,216.04	74,373.37	248,981,034.67	-4,325,554.74

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,554,880.00	-	-	-
---股指期货	3,554,880.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,554,880.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

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。

7.4.7.3.2 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
IM2501	IM2501	3.00	3,573,480.00	18,600.00
合计	-	-	-	18,600.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	18,600.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	563.56	0.97
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	40,000.00	160,000.00
合计	40,563.56	160,000.97

7.4.7.7 实收基金

博时智选量化多因子股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	51,578,960.98	51,578,960.98
本期申购	19,525,389.09	19,525,389.09
本期赎回（以“-”号填列）	-14,544,599.86	-14,544,599.86
本期末	56,559,750.21	56,559,750.21

博时智选量化多因子股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	264,291,979.59	264,291,979.59
本期申购	199,151,880.27	199,151,880.27
本期赎回（以“-”号填列）	-219,878,311.73	-219,878,311.73
本期末	243,565,548.13	243,565,548.13

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

7.4.7.8 未分配利润

博时智选量化多因子股票 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	-7,405,601.50	-561,270.01	-7,966,871.51
本期期初	-7,405,601.50	-561,270.01	-7,966,871.51
本期利润	7,136,816.48	4,764,768.91	11,901,585.39
本期基金份额交易产生的变动数	-54,800.49	1,058,962.12	1,004,161.63
其中：基金申购款	-1,524,401.20	2,070,152.75	545,751.55
基金赎回款	1,469,600.71	-1,011,190.63	458,410.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-323,585.51	5,262,461.02	4,938,875.51

博时智选量化多因子股票 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	-40,360,935.91	-2,870,677.96	-43,231,613.87

本期期初	-40,360,935.91	-2,870,677.96	-43,231,613.87
本期利润	28,362,444.16	24,603,201.21	52,965,645.37
本期基金份额交易产生的变动数	6,801,247.56	578,324.41	7,379,571.97
其中：基金申购款	-21,317,386.34	12,891,520.55	-8,425,865.79
基金赎回款	28,118,633.90	-12,313,196.14	15,805,437.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,197,244.19	22,310,847.66	17,113,603.47

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	11,240.53	31,879.89
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	24,632.43	93,737.55
其他	-	-
合计	35,872.96	125,617.44

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,630,085,944.97	3,461,365,773.71
减：卖出股票成本总额	1,590,399,504.94	3,475,596,276.11
减：交易费用	2,869,317.79	8,340,591.27
买卖股票差价收入	36,817,122.24	-22,571,093.67

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	101,700.62	18,533.02
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	55,044.53	3,070.41
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	156,745.15	21,603.43

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,201,272.92	14,079.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,961,683.00	11,000.00
减：应计利息总额	184,512.37	2.39
减：交易费用	33.02	6.20
买卖债券差价收入	55,044.53	3,070.41

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-87,979.67	-621,264.89

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,954,383.85	4,880,063.85
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	2,954,383.85	4,880,063.85

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	29,349,370.12	6,989,021.38
——股票投资	29,352,836.12	6,980,694.38
——债券投资	-3,466.00	8,327.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	18,600.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货	18,600.00	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	29,367,970.12	6,989,021.38

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	318,824.97	404,823.27
基金转换费收入	19,763.91	3,791.39
合计	338,588.88	408,614.66

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	-	200.00

合计	160,000.00	160,200.00
----	------------	------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2025 年 02 月 22 日宣告 2025 年度第 1 次分红，向截至 2025 年 02 月 25 日止在本基金注册登记人博时基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.2310 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.0660 元。

本基金的基金管理人于 2025 年 03 月 07 日宣告 2025 年度第 2 次分红，向截至 2025 年 03 月 11 日止在本基金注册登记人博时基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.4800 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.4690 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
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
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议，股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2%的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的基金管理人 2%的股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。于 2024 年 12 月 24 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，上述股东变更完成后，基金管理人股权结构为：招商证券股份有限公司 49%，中国长城资产管理股份有限公司 25%，上海汇华实业有限公司 12%，天津港(集团)有限公司 6%，上海盛业股权投资基金有限公司 6%和浙江省国际贸易集团有限公司 2%。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,017,016.81	4,325,398.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	630,855.77	878,736.00
应支付基金管理人的净管理费	2,386,161.04	3,446,662.77

注：于本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，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。

自 2023 年 7 月 10 日起，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 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	502,836.22	806,772.89

注：于本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	合计

浙商银行	-	45,514.20	45,514.20
招商证券	-	3.64	3.64
博时基金	-	18,865.71	18,865.71
合计	-	64,383.55	64,383.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	合计
博时基金	-	80,814.63	80,814.63
浙商银行	-	55,585.37	55,585.37
合计	-	136,400.00	136,400.00

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 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行-活期存款	11,699,651.82	11,240.53	10,583,896.53	31,879.89

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	802.00	69,741.92
招商证券股份有限公司	301631	壹连科技	网下发行	1,050.00	76,639.50
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	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	4,179.00	105,519.75
招商证券股份有限公司	001378	德冠新材	网下发行	1,862.00	58,988.16
招商证券股份有限公司	688653	康希通信	网下发行	5,212.00	54,726.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	首次公开发行限售	21.23	65.78	957.00	20,317.11	62,951.46	-
301611	珂玛	2024-08-07	6 个月	首次公开	8.00	56.10	759.00	6,072.00	42,579.90	-

	科技			发行限售						
688449	联芸科技	2024-11-20	6 个月	首次公开发行限售	11.25	29.44	1,074.00	12,082.50	31,618.56	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6 个月	首次公开发行限售	17.58	33.06	919.00	16,156.02	30,382.14	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6 个月	首次公开发行限售	9.40	43.23	652.00	6,128.80	28,185.96	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6 个月	首次公开发行限售	7.16	15.44	1,680.00	12,028.80	25,939.20	-
603072	天和磁材	2024-12-24	7 个交易日	新股未上市	12.30	12.30	2,029.00	24,956.70	24,956.70	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	首次公开发行限售	27.08	48.95	473.00	12,808.84	23,153.35	-
688615	合合信息	2024-09-19	6 个月	首次公开发行限售	55.18	165.78	132.00	7,283.76	21,882.96	-
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	首次公开发行限售	6.88	24.84	790.00	5,435.20	19,623.60	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6 个月	首次公开发行限售	18.50	56.85	279.00	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024-10-10	6 个月	首次公开发行限售	14.50	59.05	267.00	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科	2024-08-14	6 个月	首次公开	11.14	40.83	350.00	3,899.00	14,290.50	-

	天成			发行 限售						
001391	国 货 航	2024-12-23	6 个 月	首次 公开 发行 限售	2.30	6.80	2,037.00	4,685.10	13,851.60	-
301622	英 思 特	2024-11-26	6 个 月	首次 公开 发行 限售	22.36	44.92	306.00	6,842.16	13,745.52	-
301586	佳 力 奇	2024-08-21	6 个 月	首次 公开 发行 限售	18.09	53.14	215.00	3,889.35	11,425.10	-
688710	益 诺 思	2024-08-27	6 个 月	首次 公开 发行 限售	19.06	33.58	329.00	6,270.74	11,047.82	-
301631	壹 连 科 技	2024-11-12	6 个 月	首次 公开 发行 限售	72.99	101.96	105.00	7,663.95	10,705.80	-
301617	博 苑 股 份	2024-12-03	6 个 月	首次 公开 发行 限售	27.76	39.79	253.00	7,023.28	10,066.87	-
301607	富 特 科 技	2024-08-28	6 个 月	首次 公开 发行 限售	14.00	36.14	257.00	3,598.00	9,287.98	-
301606	绿 联 科 技	2024-07-17	6 个 月	首次 公开 发行 限售	21.21	36.49	253.00	5,366.13	9,231.97	-
301608	博 实 结	2024-07-25	6 个 月	首次 公开 发行 限售	44.50	65.38	132.00	5,874.00	8,630.16	-
301552	科 力 装 备	2024-07-15	6 个 月	首次 公开 发行 限售	30.00	56.87	143.00	4,290.00	8,132.41	-
301603	乔 锋	2024-07-03	6 个 月	首次 公开	26.50	41.98	192.00	5,088.00	8,060.16	-

	智能			发行限售						
001279	强邦新材	2024-09-27	6 个月	首次公开发行限售	9.68	27.91	265.00	2,565.20	7,396.15	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	首次公开发行限售	20.32	28.13	209.00	4,246.88	5,879.17	-
603395	红四方	2024-11-19	6 个月	首次公开发行限售	7.98	35.77	154.00	1,228.92	5,508.58	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6 个月	首次公开发行限售	26.50	44.43	94.00	2,491.00	4,176.42	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	首次公开发行限售	20.56	36.17	106.00	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	6 个月	首次公开发行限售	14.65	27.35	128.00	1,875.20	3,500.80	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6 个月	首次公开发行限售	40.00	41.35	80.00	3,200.00	3,308.00	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	首次公开发行限售	12.30	12.30	226.00	2,779.80	2,779.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	首次公开发行限售	18.65	22.61	114.00	2,126.10	2,577.54	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	首次公开发行限售	17.39	17.95	114.00	1,982.46	2,046.30	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金,理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过多因子量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

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、法律合规部、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;法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助,使公司在一种风险管理和控制的环境

中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,478,175.46	5,669,053.37
合计	6,478,175.46	5,669,053.37

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	913,014.49	-
合计	913,014.49	-

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

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,699,651.82	-	-	-	11,699,651.82
结算备付金	6,528,035.23	-	-	-	6,528,035.23
存出保证金	-	-	-	536,022.00	536,022.00
交易性金融资产	7,391,189.95	-	-	297,052,082.20	304,443,272.15
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,932,776.14	7,932,776.14
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,618,877.00	-	-	305,520,880.34	331,139,757.34
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,464,106.66	8,464,106.66
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	304,273.66	304,273.66
应付托管费	-	-	-	50,712.27	50,712.27
应付销售服务费	-	-	-	102,323.87	102,323.87
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	40,563.56	40,563.56
负债总计	-	-	-	8,961,980.02	8,961,980.02
利率敏感度缺口	25,618,877.00	-	-	296,558,900.32	322,177,777.32
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,583,896.53	-	-	-	10,583,896.53
结算备付金	6,226,140.27	-	-	-	6,226,140.27
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	5,669,053.37	-	-	243,311,981.30	248,981,034.67
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	274,060.92	274,060.92
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,479,090.17	-	-	243,586,042.22	266,065,132.39
负债					
卖出回购金融资	-	-	-	-	-

产款					
应付赎回款	-	-	-	820,533.58	820,533.58
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	272,083.89	272,083.89
应付托管费	-	-	-	45,347.30	45,347.30
应付销售服务费	-	-	-	94,711.46	94,711.46
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	160,000.97	160,000.97
负债总计	-	-	-	1,392,677.20	1,392,677.20
利率敏感度缺口	22,479,090.17	-	-	242,193,365.02	264,672,455.19

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 1	减少约 0
	市场利率下降 25 个基点	增加约 1	增加约 0

注：以上金额为四舍五入的结果。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2024 年 12 月 31 日		2023 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	297,052,082.20	92.20	243,311,981.30	91.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	297,052,082.20	92.20	243,311,981.30	91.93

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,326	增加约 891
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,326	减少约 891

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	296,539,698.20	242,542,660.08
第二层次	7,418,926.45	5,669,053.37

第三层次	484,647.50	769,321.22
合计	304,443,272.15	248,981,034.67

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	769,321.22	769,321.22
当期购买	-	344,144.96	344,144.96
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	928,975.98	928,975.98
当期利得或损失总额	-	300,157.30	300,157.30
其中：计入损益的利得或损失	-	300,157.30	300,157.30
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	484,647.50	484,647.50
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	290,916.64	290,916.64
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,638,257.03	4,638,257.03
当期购买	-	1,268,631.27	1,268,631.27
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,101,574.29	6,101,574.29

当期利得或损失总额	-	964,007.21	964,007.21
其中：计入损益的利得或损失	-	964,007.21	964,007.21
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	769,321.22	769,321.22
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	116,283.88	116,283.88

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	484,647.50	平均价格亚式期权模型	预期波动率	26.65%-574.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	769,321.22	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.55%-217.52%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	297,052,082.20	89.71
	其中：股票	297,052,082.20	89.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,391,189.95	2.23
	其中：债券	7,391,189.95	2.23
	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	18,227,687.05	5.50
8	其他各项资产	8,468,798.14	2.56
9	合计	331,139,757.34	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	24,123.00	0.01
B	采矿业	6,409,428.00	1.99
C	制造业	186,741,712.68	57.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,060,326.00	3.74
E	建筑业	419,502.00	0.13
F	批发和零售业	606,773.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	3,279,120.07	1.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,515,354.63	18.78
J	金融业	26,081,399.00	8.10
K	房地产业	225,985.00	0.07
L	租赁和商务服务业	130,679.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	179,348.82	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	312,776.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,320.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	29,235.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	297,052,082.20	92.20

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	44652	29,381,016.00	9.12
2	688008	澜起科技	369886	25,115,259.40	7.80
3	688279	峰岬科技	149456	23,569,211.20	7.32
4	601288	农业银行	3150400	16,823,136.00	5.22
5	600872	中炬高新	488600	10,758,972.00	3.34
6	688220	翱捷科技	193643	10,474,149.87	3.25
7	605499	东鹏饮料	40970	10,181,864.40	3.16
8	601658	邮储银行	1538500	8,738,680.00	2.71
9	601857	中国石油	691400	6,181,116.00	1.92
10	003816	中国广核	1444500	5,965,785.00	1.85
11	600025	华能水电	596100	5,668,911.00	1.76
12	002050	三花智控	218500	5,136,935.00	1.59
13	603986	兆易创新	44600	4,763,280.00	1.48
14	001965	招商公路	218700	3,050,865.00	0.95
15	600600	青岛啤酒	37200	3,010,224.00	0.93
16	688123	聚辰股份	51321	3,003,304.92	0.93
17	600887	伊利股份	98400	2,969,712.00	0.92
18	000651	格力电器	64500	2,931,525.00	0.91
19	300750	宁德时代	11000	2,926,000.00	0.91
20	000858	五粮液	20600	2,884,824.00	0.90
21	603288	海天味业	62200	2,854,980.00	0.89
22	000895	双汇发展	106100	2,754,356.00	0.85
23	000538	云南白药	45060	2,701,347.00	0.84
24	688766	普冉股份	19737	1,998,568.62	0.62
25	000768	中航西飞	69000	1,948,560.00	0.60
26	001301	尚太科技	25700	1,761,735.00	0.55
27	300002	神州泰岳	152000	1,761,680.00	0.55
28	605333	沪光股份	53800	1,755,494.00	0.54
29	001380	华纬科技	80094	1,754,058.60	0.54
30	002273	水晶光电	78300	1,739,826.00	0.54
31	002850	科达利	17800	1,738,704.00	0.54
32	603786	科博达	28100	1,736,580.00	0.54
33	002970	锐明技术	36400	1,733,732.00	0.54
34	600487	亨通光电	100100	1,723,722.00	0.54
35	301327	华宝新能	22450	1,722,139.50	0.53
36	688049	炬芯科技	38347	1,720,629.89	0.53
37	603766	隆鑫通用	188700	1,717,170.00	0.53
38	002837	英维克	42400	1,712,960.00	0.53
39	601179	中国西电	224200	1,701,678.00	0.53

40	002202	金风科技	164500	1,699,285.00	0.53
41	002281	光迅科技	32500	1,695,525.00	0.53
42	601127	赛力斯	12700	1,694,053.00	0.53
43	300433	蓝思科技	77300	1,692,870.00	0.53
44	300866	安克创新	17300	1,689,172.00	0.52
45	300113	顺网科技	100200	1,684,362.00	0.52
46	300628	亿联网络	43600	1,682,960.00	0.52
47	300926	博俊科技	76400	1,681,564.00	0.52
48	688698	伟创电气	38213	1,681,372.00	0.52
49	688550	瑞联新材	53700	1,680,273.00	0.52
50	688543	国科军工	33500	1,679,020.00	0.52
51	002906	华阳集团	54600	1,678,950.00	0.52
52	688025	杰普特	35300	1,676,750.00	0.52
53	688533	上声电子	48100	1,674,842.00	0.52
54	688313	仕佳光子	101962	1,671,157.18	0.52
55	603508	思维列控	70200	1,669,356.00	0.52
56	688183	生益电子	42500	1,668,550.00	0.52
57	300001	特锐德	76000	1,668,200.00	0.52
58	300684	中石科技	74200	1,664,306.00	0.52
59	600418	江淮汽车	44300	1,661,250.00	0.52
60	301011	华立科技	64600	1,659,574.00	0.52
61	003021	兆威机电	22400	1,655,584.00	0.51
62	300054	鼎龙股份	63600	1,654,872.00	0.51
63	300502	新易盛	14300	1,652,794.00	0.51
64	300674	宇信科技	84600	1,651,392.00	0.51
65	688798	艾为电子	23600	1,647,752.00	0.51
66	001339	智微智能	45000	1,646,550.00	0.51
67	300666	江丰电子	23700	1,645,965.00	0.51
68	688195	腾景科技	40821	1,640,187.78	0.51
69	688019	安集科技	11750	1,637,480.00	0.51
70	603893	瑞芯微	14800	1,628,888.00	0.51
71	002311	海大集团	33200	1,628,460.00	0.51
72	300870	欧陆通	15200	1,623,056.00	0.50
73	300570	太辰光	22200	1,613,940.00	0.50
74	300474	景嘉微	16900	1,579,981.00	0.49
75	301165	锐捷网络	19758	1,426,527.60	0.44
76	300857	协创数据	12800	1,368,192.00	0.42
77	600893	航发动力	31400	1,301,530.00	0.40
78	600685	中船防务	53500	1,267,950.00	0.39
79	688017	绿的谐波	7947	858,752.82	0.27
80	601689	拓普集团	12262	600,838.00	0.19
81	688582	芯动联科	10855	546,115.05	0.17
82	300428	立中集团	7900	128,770.00	0.04

83	300755	华致酒行	6900	123,096.00	0.04
84	600096	云天化	4600	102,580.00	0.03
85	601399	国机重装	31000	95,480.00	0.03
86	601168	西部矿业	5500	88,385.00	0.03
87	600008	首创环保	26900	88,232.00	0.03
88	002385	大北农	20300	87,899.00	0.03
89	002534	西子洁能	7900	87,769.00	0.03
90	600827	百联股份	7900	86,347.00	0.03
91	000060	中金岭南	18300	85,827.00	0.03
92	002517	恺英网络	6300	85,743.00	0.03
93	002266	浙富控股	27200	84,864.00	0.03
94	000401	冀东水泥	16100	84,203.00	0.03
95	002500	山西证券	13400	84,152.00	0.03
96	300604	长川科技	1800	79,434.00	0.02
97	600583	海油工程	14500	79,315.00	0.02
98	002557	洽洽食品	2700	78,435.00	0.02
99	000927	中国铁物	27100	71,273.00	0.02
100	601886	江河集团	13100	70,740.00	0.02
101	603197	保隆科技	1700	64,175.00	0.02
102	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.02
103	002550	千红制药	9900	61,380.00	0.02
104	601555	东吴证券	7600	59,280.00	0.02
105	603596	伯特利	1300	57,967.00	0.02
106	002961	瑞达期货	4000	57,480.00	0.02
107	605080	浙江自然	2400	56,400.00	0.02
108	688281	华秦科技	600	55,860.00	0.02
109	002249	大洋电机	9500	55,765.00	0.02
110	688122	西部超导	1300	55,666.00	0.02
111	688578	艾力斯	900	53,910.00	0.02
112	000997	新大陆	2700	53,865.00	0.02
113	688005	容百科技	1700	53,635.00	0.02
114	600428	中远海特	7300	53,290.00	0.02
115	688772	珠海冠宇	3300	53,064.00	0.02
116	002432	九安医疗	1300	53,014.00	0.02
117	600380	健康元	4700	52,969.00	0.02
118	600208	衢州发展	17800	52,688.00	0.02
119	601966	玲珑轮胎	2900	52,316.00	0.02
120	002507	涪陵榨菜	3700	52,281.00	0.02
121	600325	华发股份	9000	51,840.00	0.02
122	688538	和辉光电	22300	51,736.00	0.02
123	688002	睿创微纳	1100	51,711.00	0.02
124	688248	南网科技	1600	51,344.00	0.02
125	603609	禾丰股份	5900	50,858.00	0.02

126	601568	北元集团	12100	50,820.00	0.02
127	600739	辽宁成大	4900	50,715.00	0.02
128	601866	中远海发	19400	50,634.00	0.02
129	688425	铁建重工	11500	50,600.00	0.02
130	002019	亿帆医药	4700	50,384.00	0.02
131	001227	兰州银行	20400	50,184.00	0.02
132	600339	中油工程	14000	50,120.00	0.02
133	600580	卧龙电驱	2900	49,851.00	0.02
134	002368	太极股份	2100	49,728.00	0.02
135	000967	盈峰环境	10000	49,700.00	0.02
136	301050	雷电微力	960	49,516.80	0.02
137	601965	中国汽研	2800	49,336.00	0.02
138	000537	中绿电	5400	49,248.00	0.02
139	600219	南山铝业	12500	48,875.00	0.02
140	600959	江苏有线	14500	48,575.00	0.02
141	000541	佛山照明	7400	45,880.00	0.01
142	600143	金发科技	5200	44,928.00	0.01
143	600310	广西能源	9800	44,688.00	0.01
144	603538	美诺华	3500	44,485.00	0.01
145	300529	健帆生物	1500	44,010.00	0.01
146	603618	杭电股份	8100	43,983.00	0.01
147	603799	华友钴业	1500	43,890.00	0.01
148	603408	建霖家居	3500	43,855.00	0.01
149	600419	天润乳业	4700	43,757.00	0.01
150	000885	城发环境	3300	43,263.00	0.01
151	301611	珂玛科技	759	42,579.90	0.01
152	600861	北京人力	2200	42,570.00	0.01
153	600037	歌华有线	5700	42,522.00	0.01
154	600704	物产中大	8400	42,504.00	0.01
155	605305	中际联合	1500	42,495.00	0.01
156	000821	京山轻机	3400	42,330.00	0.01
157	603158	腾龙股份	5100	41,208.00	0.01
158	301028	东亚机械	3800	41,002.00	0.01
159	603109	神驰机电	2300	40,825.00	0.01
160	601311	骆驼股份	4700	38,963.00	0.01
161	688188	柏楚电子	200	38,850.00	0.01
162	603697	有友食品	3800	38,684.00	0.01
163	600665	天地源	12100	37,873.00	0.01
164	603558	健盛集团	3500	37,660.00	0.01
165	002233	塔牌集团	4900	37,583.00	0.01
166	601369	陕鼓动力	4300	37,410.00	0.01
167	000951	中国重汽	2200	37,356.00	0.01
168	002060	广东建工	10200	37,332.00	0.01

169	600320	振华重工	9500	37,240.00	0.01
170	601678	滨化股份	9900	37,224.00	0.01
171	601718	际华集团	13100	37,204.00	0.01
172	002034	旺能环境	2400	37,200.00	0.01
173	301039	中集车辆	4100	37,105.00	0.01
174	600916	中国黄金	4300	37,066.00	0.01
175	002004	华邦健康	8200	37,064.00	0.01
176	600874	创业环保	6200	37,014.00	0.01
177	000090	天健集团	9000	36,990.00	0.01
178	601002	晋亿实业	8500	36,975.00	0.01
179	601778	晶科科技	13100	36,942.00	0.01
180	600475	华光环能	4100	36,941.00	0.01
181	000030	富奥股份	7200	36,936.00	0.01
181	600714	金瑞矿业	3800	36,936.00	0.01
182	002585	双星新材	6900	36,846.00	0.01
182	601992	金隅集团	20700	36,846.00	0.01
183	600502	安徽建工	7700	36,806.00	0.01
184	601200	上海环境	4500	36,765.00	0.01
185	301216	万凯新材	3600	36,720.00	0.01
185	600409	三友化工	6800	36,720.00	0.01
186	002091	江苏国泰	5000	36,600.00	0.01
187	600531	豫光金铅	5700	36,594.00	0.01
188	300253	卫宁健康	5100	36,516.00	0.01
189	300257	开山股份	4000	36,480.00	0.01
189	300685	艾德生物	1600	36,480.00	0.01
190	688779	五矿新能	6830	36,335.60	0.01
191	300244	迪安诊断	3200	36,320.00	0.01
192	603876	鼎胜新材	4100	36,285.00	0.01
193	600330	天通股份	5100	36,210.00	0.01
194	600328	中盐化工	4600	36,202.00	0.01
195	688739	成大生物	1400	36,092.00	0.01
196	000156	华数传媒	5000	36,000.00	0.01
197	603595	东尼电子	2100	35,889.00	0.01
198	002745	木林森	4100	35,752.00	0.01
199	603368	柳药集团	2000	35,720.00	0.01
200	002015	协鑫能科	4600	35,696.00	0.01
201	600643	爱建集团	6900	35,673.00	0.01
202	688007	光峰科技	2400	35,496.00	0.01
203	002212	天融信	5500	35,475.00	0.01
204	300682	朗新集团	2900	35,380.00	0.01
205	600423	柳化股份	12000	35,280.00	0.01
206	603612	索通发展	2600	35,126.00	0.01
207	600017	日照港	10900	34,880.00	0.01

208	600758	辽宁能源	10100	34,744.00	0.01
209	600496	精工钢构	11500	34,730.00	0.01
210	000725	京东方 A	7900	34,681.00	0.01
211	002495	佳隆股份	13600	34,544.00	0.01
212	002548	金新农	8700	34,539.00	0.01
213	002666	德联集团	7900	34,444.00	0.01
214	000698	沈阳化工	10200	34,374.00	0.01
215	002863	今飞凯达	7400	34,336.00	0.01
216	601618	中国中冶	10400	34,320.00	0.01
217	603039	泛微网络	700	34,300.00	0.01
218	603086	先达股份	8000	34,240.00	0.01
219	002969	嘉美包装	11000	34,210.00	0.01
220	002546	新联电子	7900	34,207.00	0.01
221	002228	合兴包装	11400	34,200.00	0.01
222	300475	香农芯创	1200	34,188.00	0.01
222	600064	南京高科	4400	34,188.00	0.01
223	601919	中远海控	2200	34,100.00	0.01
224	300234	开尔新材	7300	34,091.00	0.01
225	002578	闽发铝业	11400	34,086.00	0.01
226	600261	阳光照明	10400	34,008.00	0.01
227	300752	隆利科技	2000	34,000.00	0.01
228	002556	辉隆股份	6100	33,977.00	0.01
229	002671	龙泉股份	7500	33,975.00	0.01
230	600218	全柴动力	4300	33,970.00	0.01
231	603811	诚意药业	4400	33,968.00	0.01
232	603311	金海高科	3400	33,966.00	0.01
233	688006	杭可科技	1900	33,934.00	0.01
234	600477	杭萧钢构	13200	33,924.00	0.01
235	002206	海利得	7900	33,891.00	0.01
236	002483	润邦股份	6500	33,865.00	0.01
237	600610	中毅达	8000	33,840.00	0.01
238	300881	盛德鑫泰	1100	33,814.00	0.01
239	603385	惠达卫浴	5300	33,708.00	0.01
240	002825	纳尔股份	4300	33,626.00	0.01
241	688128	中国电研	1600	33,616.00	0.01
242	002250	联化科技	6100	33,611.00	0.01
243	600248	陕建股份	7500	33,600.00	0.01
244	601319	中国人保	4400	33,528.00	0.01
245	002688	金河生物	7500	33,525.00	0.01
246	301175	中科环保	6200	33,480.00	0.01
247	600058	五矿发展	4700	33,464.00	0.01
248	002928	华夏航空	4300	33,368.00	0.01
249	000498	山东路桥	5600	33,320.00	0.01

250	600073	光明肉业	4800	33,312.00	0.01
251	300048	合康新能	6600	33,264.00	0.01
252	000966	长源电力	7000	33,250.00	0.01
253	600284	浦东建设	5300	33,231.00	0.01
254	601113	华鼎股份	8500	33,150.00	0.01
255	600731	湖南海利	5800	33,060.00	0.01
256	000710	贝瑞基因	3900	32,955.00	0.01
256	002001	新和成	1500	32,955.00	0.01
257	601616	广电电气	7500	32,925.00	0.01
258	002440	闰土股份	4900	32,879.00	0.01
259	603676	卫信康	3300	32,835.00	0.01
260	300196	长海股份	3000	32,670.00	0.01
261	603192	汇得科技	2200	32,648.00	0.01
262	603982	泉峰汽车	4100	32,636.00	0.01
263	002454	松芝股份	4900	32,585.00	0.01
264	002996	顺博合金	4900	32,536.00	0.01
265	300508	维宏股份	1200	32,460.00	0.01
266	603861	白云电器	3600	32,400.00	0.01
267	300275	梅安森	2200	32,340.00	0.01
268	300867	圣元环保	2500	32,325.00	0.01
269	605166	聚合顺	2700	32,319.00	0.01
270	601177	杭齿前进	3900	32,292.00	0.01
271	603115	海星股份	2500	32,275.00	0.01
272	300638	广和通	1600	32,240.00	0.01
273	002852	道道全	3900	32,214.00	0.01
274	300515	三德科技	2700	32,157.00	0.01
275	603600	永艺股份	2700	32,103.00	0.01
276	603317	天味食品	2400	32,016.00	0.01
277	002802	洪汇新材	2700	31,995.00	0.01
278	603166	福达股份	4400	31,988.00	0.01
279	603577	汇金通	4000	31,960.00	0.01
280	603926	铁流股份	3600	31,860.00	0.01
281	600783	鲁信创投	2500	31,675.00	0.01
282	600710	苏美达	3400	31,620.00	0.01
283	688449	联芸科技	1074	31,618.56	0.01
284	300545	联得装备	1000	31,330.00	0.01
285	300777	中简科技	1100	31,119.00	0.01
286	600512	腾达建设	13100	31,047.00	0.01
287	688726	拉普拉斯	919	30,382.14	0.01
288	300673	佩蒂股份	1700	30,141.00	0.01
289	300571	平治信息	1200	30,096.00	0.01
290	601688	华泰证券	1700	29,903.00	0.01
291	601336	新华保险	600	29,820.00	0.01

292	001206	依依股份	1800	29,754.00	0.01
293	301309	万得凯	1200	29,004.00	0.01
294	605376	博迁新材	1000	28,950.00	0.01
295	300151	昌红科技	1700	28,900.00	0.01
296	600879	航天电子	3200	28,672.00	0.01
297	300360	炬华科技	1700	28,509.00	0.01
298	301003	江苏博云	1300	28,379.00	0.01
299	600995	南网储能	2800	28,336.00	0.01
300	001230	劲旅环境	1700	28,186.00	0.01
301	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.01
302	301112	信邦智能	1200	28,044.00	0.01
303	603072	天和磁材	2255	27,736.50	0.01
304	002768	国恩股份	1200	27,684.00	0.01
305	603173	福斯达	1200	27,660.00	0.01
306	000897	津滨发展	11400	27,018.00	0.01
307	603680	今创集团	3200	26,560.00	0.01
308	601318	中国平安	500	26,325.00	0.01
309	688750	金天钛业	1680	25,939.20	0.01
310	600361	创新新材	6700	25,862.00	0.01
311	600551	时代出版	3000	25,830.00	0.01
312	600664	哈药股份	6200	25,606.00	0.01
313	601628	中国人寿	600	25,152.00	0.01
314	002891	中宠股份	700	24,990.00	0.01
314	603380	易德龙	1000	24,990.00	0.01
315	002801	微光股份	1000	24,460.00	0.01
316	601137	博威合金	1200	24,360.00	0.01
317	300972	万辰集团	300	24,123.00	0.01
318	601601	中国太保	700	23,856.00	0.01
319	301023	江南奕帆	500	23,600.00	0.01
320	688708	佳驰科技	473	23,153.35	0.01
321	003013	地铁设计	1500	22,680.00	0.01
322	688615	合合信息	132	21,882.96	0.01
323	000783	长江证券	3100	21,142.00	0.01
324	603111	康尼机电	3500	21,105.00	0.01
325	300907	康平科技	1000	21,040.00	0.01
326	301033	迈普医学	500	21,025.00	0.01
327	002420	毅昌科技	3900	20,592.00	0.01
328	000419	通程控股	3600	20,556.00	0.01
329	600533	栖霞建设	8700	20,358.00	0.01
330	301522	上大股份	790	19,623.60	0.01
331	603165	荣晟环保	1600	19,584.00	0.01
332	603020	爱普股份	2500	19,350.00	0.01
333	002560	通达股份	2800	19,096.00	0.01

334	000050	深天马 A	2100	18,963.00	0.01
335	300074	华平股份	4700	18,706.00	0.01
336	688093	世华科技	900	18,171.00	0.01
337	300415	伊之密	900	18,054.00	0.01
338	600216	浙江医药	1100	17,446.00	0.01
339	600578	京能电力	4900	17,248.00	0.01
340	002931	锋龙股份	1000	16,260.00	0.01
341	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
342	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
343	300973	立高食品	400	15,612.00	0.00
344	300181	佐力药业	1000	15,360.00	0.00
345	000603	盛达资源	1200	14,388.00	0.00
346	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
347	001391	国货航	2037	13,851.60	0.00
348	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
349	300018	中元股份	2000	13,540.00	0.00
350	002286	保龄宝	1800	13,284.00	0.00
351	603980	吉华集团	2900	12,673.00	0.00
352	688161	威高骨科	500	12,610.00	0.00
353	688209	英集芯	700	12,369.00	0.00
354	603818	曲美家居	4500	12,240.00	0.00
355	603083	剑桥科技	300	12,180.00	0.00
356	000875	吉电股份	2300	12,098.00	0.00
357	600629	华建集团	1300	11,986.00	0.00
358	688337	普源精电	300	11,700.00	0.00
359	603098	森特股份	1200	11,520.00	0.00
360	603727	博迈科	1000	11,480.00	0.00
361	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
362	002558	巨人网络	900	11,421.00	0.00
363	688207	格灵深瞳	800	11,392.00	0.00
364	002570	贝因美	2700	11,367.00	0.00
365	603628	清源股份	900	11,232.00	0.00
366	002708	光洋股份	1000	11,140.00	0.00
367	688710	益诺思	329	11,047.82	0.00
368	300261	雅本化学	1600	10,960.00	0.00
369	000415	渤海租赁	2900	10,933.00	0.00
370	003005	竞业达	400	10,848.00	0.00
371	688561	奇安信	400	10,732.00	0.00
372	301631	壹连科技	105	10,705.80	0.00
373	000917	电广传媒	1500	10,605.00	0.00
374	688588	凌志软件	767	10,584.60	0.00
375	300800	力合科技	1000	10,430.00	0.00
376	301031	中熔电气	100	10,402.00	0.00

377	600292	远达环保	800	10,392.00	0.00
378	301307	美利信	500	10,165.00	0.00
379	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
380	300656	民德电子	400	9,952.00	0.00
381	301221	光庭信息	200	9,716.00	0.00
382	301030	仕净科技	400	9,656.00	0.00
383	600363	联创光电	200	9,576.00	0.00
384	300850	新强联	500	9,555.00	0.00
385	688233	神工股份	400	9,380.00	0.00
386	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
387	301606	绿联科技	253	9,231.97	0.00
388	688981	中芯国际	95	8,988.90	0.00
389	002599	盛通股份	1200	8,916.00	0.00
390	300925	法本信息	400	8,912.00	0.00
391	000957	中通客车	800	8,800.00	0.00
392	600299	安迪苏	700	8,785.00	0.00
393	300827	上能电气	200	8,780.00	0.00
394	301608	博实结	132	8,630.16	0.00
395	605117	德业股份	100	8,480.00	0.00
396	603638	艾迪精密	500	8,445.00	0.00
397	688392	骄成超声	200	8,160.00	0.00
398	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
399	601021	春秋航空	141	8,131.47	0.00
400	301603	乔锋智能	192	8,060.16	0.00
401	600858	银座股份	1400	7,770.00	0.00
402	300346	南大光电	200	7,718.00	0.00
403	002338	奥普光电	200	7,544.00	0.00
404	603690	至纯科技	300	7,533.00	0.00
405	605358	立昂微	300	7,431.00	0.00
406	000404	长虹华意	1000	7,400.00	0.00
407	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
408	603062	麦加芯彩	200	7,198.00	0.00
409	300083	创世纪	1100	7,161.00	0.00
410	601330	绿色动力	1000	6,560.00	0.00
411	601068	中铝国际	1400	6,174.00	0.00
412	688312	燕麦科技	200	6,160.00	0.00
413	600488	津药药业	1400	5,936.00	0.00
414	300781	因赛集团	100	5,903.00	0.00
415	603194	中力股份	209	5,879.17	0.00
416	000728	国元证券	700	5,852.00	0.00
417	002084	海鸥住工	2000	5,760.00	0.00
418	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
419	603755	日辰股份	200	5,420.00	0.00

420	603728	鸣志电器	100	5,400.00	0.00
421	301121	紫建电子	100	5,306.00	0.00
422	002797	第一创业	600	5,010.00	0.00
423	601016	节能风电	1500	4,755.00	0.00
424	603301	振德医疗	200	4,398.00	0.00
425	688508	芯朋微	100	4,297.00	0.00
426	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
427	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
428	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
429	300699	光威复材	100	3,465.00	0.00
430	601019	山东出版	300	3,405.00	0.00
431	603391	力聚热能	80	3,308.00	0.00
432	002635	安洁科技	200	3,184.00	0.00
433	603920	世运电路	100	2,940.00	0.00
434	002061	浙江交科	700	2,856.00	0.00
435	603285	键邦股份	114	2,577.54	0.00
436	600169	太原重工	1000	2,490.00	0.00
437	002283	天润工业	400	2,128.00	0.00
438	603310	巍华新材	114	2,046.30	0.00
439	600848	上海临港	200	2,020.00	0.00
440	601952	苏垦农发	200	1,958.00	0.00
441	300351	永贵电器	100	1,774.00	0.00
442	000039	中集集团	200	1,554.00	0.00
443	002163	海南发展	100	935.00	0.00
444	000685	中山公用	100	923.00	0.00
445	600223	福瑞达	100	756.00	0.00
446	300453	三鑫医疗	100	746.00	0.00
447	603866	桃李面包	100	660.00	0.00
448	600517	国网英大	100	551.00	0.00
449	002062	宏润建设	100	511.00	0.00
450	002516	旷达科技	100	507.00	0.00
451	601599	浙文影业	100	358.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002050	三花智控	42,123,252.84	15.92
2	688256	寒武纪	29,060,567.28	10.98
3	688008	澜起科技	26,519,496.08	10.02
4	601689	拓普集团	23,012,077.14	8.69
5	688279	峰岬科技	22,451,317.37	8.48

6	688981	中芯国际	22,270,551.96	8.41
7	601288	农业银行	18,344,212.00	6.93
8	603728	鸣志电器	16,195,667.80	6.12
9	605333	沪光股份	14,986,276.00	5.66
10	688123	聚辰股份	11,791,391.26	4.46
11	600872	中炬高新	11,680,464.00	4.41
12	002027	分众传媒	9,680,207.00	3.66
13	601021	春秋航空	9,494,418.20	3.59
14	605499	东鹏饮料	9,458,002.30	3.57
15	601658	邮储银行	8,603,651.00	3.25
16	300002	神州泰岳	8,439,576.00	3.19
17	300001	特锐德	8,263,767.00	3.12
18	600685	中船防务	8,020,448.00	3.03
19	688220	翱捷科技	7,883,486.85	2.98
20	300893	松原股份	7,715,856.23	2.92
21	002906	华阳集团	7,404,705.00	2.80
22	300926	博俊科技	7,331,144.34	2.77
23	300857	协创数据	7,320,866.90	2.77
24	600114	东睦股份	6,990,190.19	2.64
25	603893	瑞芯微	6,893,779.00	2.60
26	603997	继峰股份	6,836,066.00	2.58
27	600066	宇通客车	6,781,377.47	2.56
28	300870	欧陆通	6,706,597.00	2.53
29	688019	安集科技	6,669,253.83	2.52
30	300100	双林股份	6,511,338.00	2.46
31	301327	华宝新能	6,196,919.00	2.34
32	300308	中际旭创	6,132,473.00	2.32
33	300866	安克创新	6,111,093.00	2.31
34	688766	普冉股份	6,083,144.35	2.30
35	603986	兆易创新	6,023,529.00	2.28
36	601127	赛力斯	5,991,461.41	2.26
37	002595	豪迈科技	5,957,658.00	2.25
38	002683	广东宏大	5,871,485.50	2.22
39	300502	新易盛	5,859,109.00	2.21
40	002273	水晶光电	5,857,441.00	2.21
41	300433	蓝思科技	5,839,946.00	2.21
42	601921	浙版传媒	5,735,353.00	2.17
43	601857	中国石油	5,633,086.00	2.13
44	003816	中国广核	5,619,105.00	2.12
45	605111	新洁能	5,614,725.34	2.12
46	600025	华能水电	5,613,534.00	2.12
47	688234	天岳先进	5,523,941.59	2.09
48	300708	聚灿光电	5,514,920.00	2.08

49	688798	艾为电子	5,351,658.99	2.02
50	601717	郑煤机	5,338,973.00	2.02

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002050	三花智控	36,874,806.02	13.93
2	605499	东鹏饮料	31,550,978.09	11.92
3	601689	拓普集团	30,762,155.30	11.62
4	605333	沪光股份	23,160,169.00	8.75
5	688981	中芯国际	20,578,609.96	7.78
6	603728	鸣志电器	15,237,395.00	5.76
7	601288	农业银行	11,089,689.00	4.19
8	002027	分众传媒	9,760,633.00	3.69
9	688123	聚辰股份	9,161,850.01	3.46
10	601021	春秋航空	9,129,066.00	3.45
11	600066	宇通客车	8,944,621.00	3.38
12	300100	双林股份	8,613,642.00	3.25
13	688279	峰岬科技	7,826,236.59	2.96
14	688256	寒武纪	7,818,937.95	2.95
15	300893	松原股份	7,659,524.00	2.89
16	300001	特锐德	7,589,468.54	2.87
17	600114	东睦股份	7,508,479.08	2.84
18	603893	瑞芯微	7,430,698.00	2.81
19	002683	广东宏大	7,388,196.00	2.79
20	601799	星宇股份	7,350,963.00	2.78
21	603997	继峰股份	7,317,337.00	2.76
22	300002	神州泰岳	6,963,185.00	2.63
23	300308	中际旭创	6,839,546.40	2.58
24	600660	福耀玻璃	6,834,799.72	2.58
25	600685	中船防务	6,813,741.00	2.57
26	300857	协创数据	6,786,500.00	2.56
27	002595	豪迈科技	6,689,476.00	2.53
28	300708	聚灿光电	6,460,508.00	2.44
29	605111	新洁能	6,427,761.40	2.43
30	300207	欣旺达	6,424,654.00	2.43
31	002906	华阳集团	6,286,263.00	2.38
32	601988	中国银行	6,191,027.00	2.34
33	601058	赛轮轮胎	6,183,955.00	2.34
34	300866	安克创新	6,179,407.59	2.33
35	300870	欧陆通	6,135,953.00	2.32
36	601398	工商银行	5,926,779.00	2.24

37	000636	风华高科	5,898,545.00	2.23
38	688019	安集科技	5,781,015.16	2.18
39	601717	郑煤机	5,747,570.96	2.17
40	601921	浙版传媒	5,651,605.00	2.14
41	000887	中鼎股份	5,626,470.00	2.13
42	300926	博俊科技	5,560,094.33	2.10
43	688208	道通科技	5,495,437.50	2.08
44	688234	天岳先进	5,320,074.30	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,614,786,769.72
卖出股票的收入（成交）总额	1,630,085,944.97

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	7,391,189.95	2.29
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,391,189.95	2.29

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019733	24 国债 02	29000	2,955,422.58	0.92
2	019758	24 国债 21	26000	2,611,382.30	0.81
3	019723	23 国债 20	9000	913,014.49	0.28
4	019740	24 国债 09	9000	911,370.58	0.28

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银保监会泰安监管分局、中国人民银行赤峰市分行、国家外汇管理局辽宁省分局、国家税务总局那曲市税务局稽查局、国家金融监督管理总局福建监管局、黔西南州兴义市市场监督管理局、海晏县消防救援大队的处罚。中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。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。

8.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	536,022.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,932,776.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,468,798.14

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
博时智选量 化多因子股 票 A	3731	15,159.41	23,751,728.00	41.99%	32,808,022.21	58.01%
博时智选量 化多因子股 票 C	17086	14,255.27	43,764,777.31	17.97%	199,800,770.82	82.03%
合计	20675	14,516.34	67,516,505.31	22.50%	232,608,793.03	77.50%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时智选量化多	1,775,262.15	3.14%

	因子股票 A		
	博时智选量化多因子股票 C	-	-
	合计	1,775,262.15	0.59%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	-
	博时智选量化多因子股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	>100
	博时智选量化多因子股票 C	-
	合计	>100

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
基金合同生效日（2021 年 11 月 2 日）基金份额总额	30,217,799.02	443,311,509.32
本报告期期初基金份额总额	51,578,960.98	264,291,979.59
本报告期基金总申购份额	19,525,389.09	199,151,880.27
减：本报告期基金总赎回份额	14,544,599.86	219,878,311.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	56,559,750.21	243,565,548.13

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2024 年 4 月 13 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》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 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》，

张东先生任公司总经理。

基金管理人于 2024 年 12 月 7 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》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 40000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	3,241,806,234.30	100.00%	1,846,282.16	100.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，

能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；

4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下估值的时效性要求。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	11,728,201.92	100.00%	11,325,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时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	2024-12-07
2	博时基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-18
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	2024-11-14
4	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-20241106	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-06
5	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 年第 3 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	2024-10-25
6	博时智选量化多因子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	2024-09-30

7	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-20240925	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-25
8	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-21
9	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 年中期报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-30
10	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-23
11	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-22
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换等业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-17
13	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-07-20
14	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 年第 2 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	2024-07-19
15	博时智选量化多因子股票型证券投资基金（博时智选量化多因子股票 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	2024-06-26
16	博时智选量化多因子股票型证券投资基金（博时智选量化多因子股票 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	2024-06-26
17	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	2024-06-06

18	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	2024-05-25
19	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
20	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
21	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
22	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 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	2024-04-22
23	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	2024-04-13
24	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2023 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	2024-03-29
25	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2023 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	2024-01-22

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时智选量化多因子股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时智选量化多因子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、博时智选量化多因子股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时智选量化多因子股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日