

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

2025 年中期报告
2025 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：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

§ 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61

7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 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	1,334,734,721.08 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	193,476,722.80 份	1,141,257,998.28 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	陈海强（代为履行法定代表人职责）

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	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	5,637,060.50	26,446,085.15
本期利润	12,618,972.17	57,443,410.42
加权平均基金份额本期利润	0.0943	0.0856
本期加权平均净值利润率	8.44%	7.70%
本期基金份额净值增长率	13.22%	12.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	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	-4,630,003.73	-28,758,740.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0239	-0.0252
期末基金资产净值	219,495,172.33	1,290,126,410.89
期末基金份额净值	1.1345	1.1304
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

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。

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。

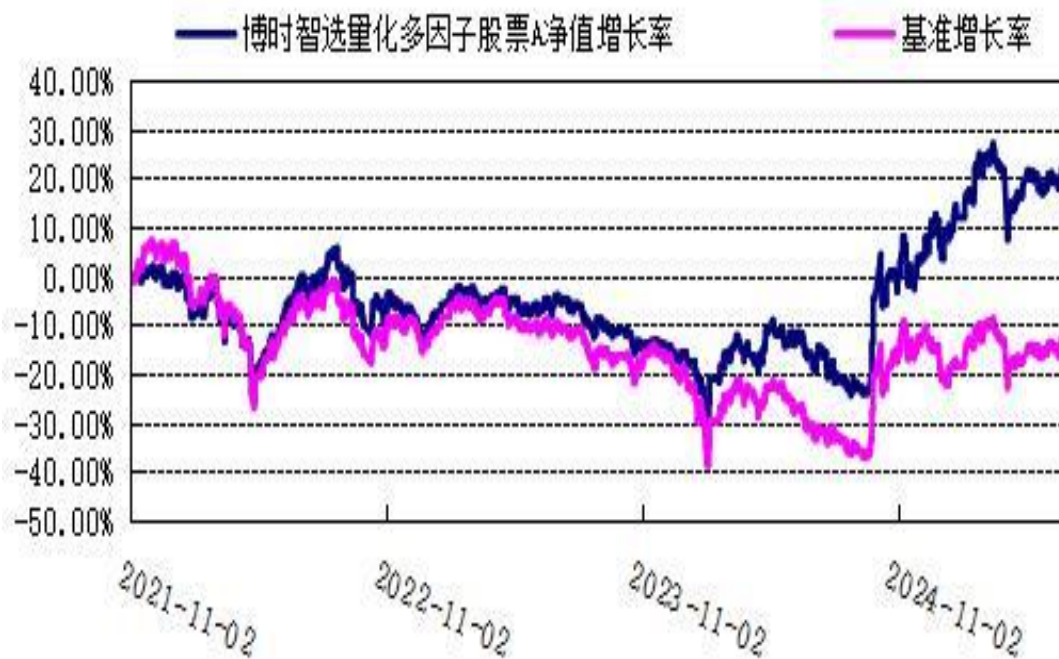
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.92%	0.91%	4.95%	0.84%	-0.03%	0.07%
过去三个月	1.27%	1.65%	2.06%	1.64%	-0.79%	0.01%
过去六个月	13.22%	1.53%	6.23%	1.48%	6.99%	0.05%
过去一年	46.81%	1.88%	27.35%	1.77%	19.46%	0.11%
过去三年	25.78%	1.41%	-6.77%	1.42%	32.55%	-0.01%
自基金合同生效起至今	23.10%	1.42%	-11.64%	1.44%	34.74%	-0.02%

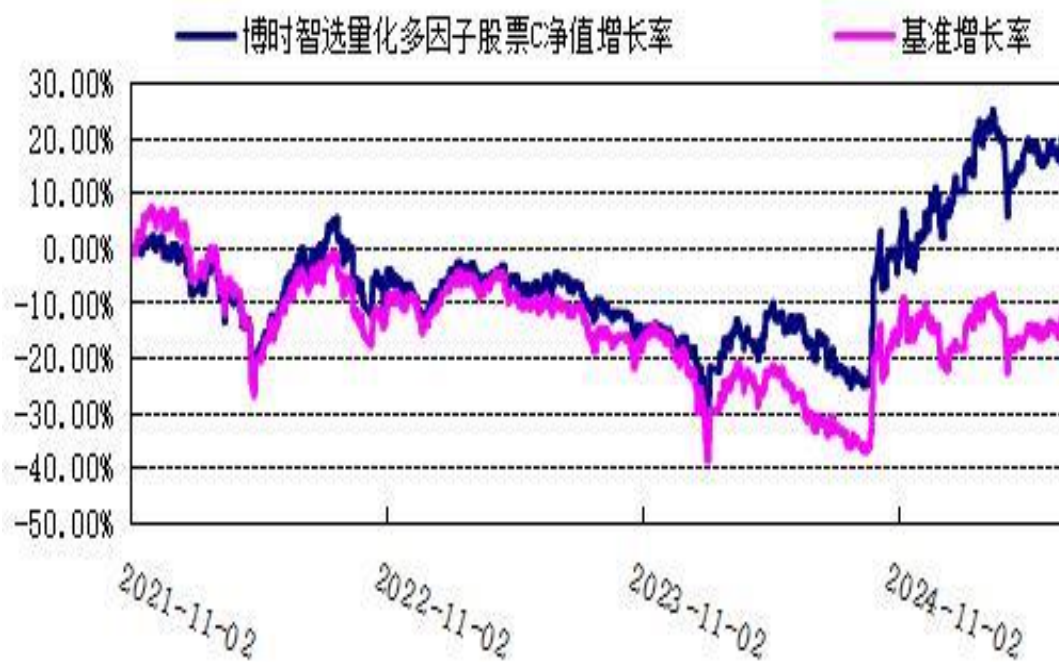
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	4.87%	0.91%	4.95%	0.84%	-0.08%	0.07%
过去三个月	1.15%	1.65%	2.06%	1.64%	-0.91%	0.01%
过去六个月	12.93%	1.53%	6.23%	1.48%	6.70%	0.05%
过去一年	46.06%	1.88%	27.35%	1.77%	18.71%	0.11%
过去三年	23.90%	1.41%	-6.77%	1.42%	30.67%	-0.01%
自基金合同生效起至今	20.86%	1.42%	-11.64%	1.44%	32.50%	-0.02%

(2021 年 11 月 2 日至 2025 年 6 月 30 日)

6



博时智选量化多因子股票 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 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。

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	-	18.8	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 日一至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日一至今)、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 日一至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日一至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日一至今)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 23 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

2025 年上半年，A 股市场虽经历了一波贸易战冲击，但在新质生产力产业链发力、宏观政策持续呵护之下，延续了 2024 年下半年以来的上涨行情。

具体来看，春节前后，两家非上市企业——DeepSeek 和宇树科技——分别发布创新性产品，为相关行业及产业链企业提供了强大的技术支撑与信心提振，引领了当季科技行情。但二季度初始，国际贸易环境出现波动，尽管多方努力后中美达成临时性关税协议，但整体贸易环境的不确定性有所升高，导致不少企业推迟或调整资本开支计划，出口型制造业的上游环节面临阶段性调整。在股票市场波动加大的背景下，宏观政策更为积极。市场流动性充裕，交易情绪较为活跃，A 股市场风格顺势转向结构性行情，中小市值相关个股表现相对突出。

整个上半年，沪深 300 指数微涨 0.03%，中证 500 指数上涨 3.31%，本基金业绩基准关联的权益指数——中证 1000 指数上涨 6.69%。

A 股市场结构性博弈程度增强，进一步加大了选股难度。在此背景下，本基金的投资操作选择

更为审慎。一季度，我们随市场上涨逐步降低个股风险暴露，持股进一步分散，投资组合更贴近业绩基准。但在行业和风格配置上，我们延续了去年以来的整体风格，超配了新质生产力、AI 产业链相关领域，低配了小市值因子。这使得我们在二季度以交易氛围主导的行情中，略微跑输业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1345 元，份额累计净值为 1.2297 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1304 元，份额累计净值为 1.2075 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 13.22%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 12.93%，同期业绩基准增长率为 6.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们对 A 股市场的乐观判断不变。国内方面，政策持续发力：7 月以来，先是年内第三批以旧换新补贴资金到账，随后国务院印发《育儿补贴制度实施方案》，开启新一波财政刺激。微观层面，陆续披露的半年报显示，AI 产业链景气度持续，大语言模型日益成熟，也为诸多传统行业提升生产率提供了助力。海外市场方面，美联储 9 月重启降息的预期升温，中美经贸会谈持续推进，双方正共同推动已暂停的对等关税及反制措施延续实施。市场对整体宏观基本面的担忧有限。值得关注的是，上证指数自 5 月以来连续数月上涨，市场内生的向上趋势正在形成，近十年高点 3732 点的压力区间已然松动。我们期待行情的进一步演绎。本基金将继续适当控制小市值因子的风险敞口，坚持配置长期有效的因子（包括但不限于成长、分析师预期等核心基本面因子），在经济结构转型背景下主动超配景气行业，坚持量化与主观相结合的科学分析方法，力争持续取得相对基准的超额收益，为投资者创造稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2025 年 2 月 22 日发布公告，以 2025 年 2 月 5 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.2310 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0660 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 3 月 7 日发布公告，以 2025 年 3 月 3 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.4800 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.4690 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 4 月 10 日发布公告，以 2025 年 4 月 1 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.2410 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.2360 元人民币。

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博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 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复核，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：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	38,092,708.48	11,699,651.82
结算备付金		38,841,798.23	6,528,035.23
存出保证金		377,364.00	536,022.00
交易性金融资产	6.4.6.2	1,375,243,417.56	304,443,272.15
其中：股票投资		1,371,700,834.88	297,052,082.20
基金投资		—	—
债券投资		3,542,582.68	7,391,189.95
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
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		66,259,974.11	7,932,776.14
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.5	—	—
资产总计		1,518,815,262.38	331,139,757.34

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		7,036,573.64	8,464,106.66
应付管理人报酬		1,332,873.55	304,273.66
应付托管费		222,145.56	50,712.27
应付销售服务费		469,187.42	102,323.87
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	6.4.6.6	132,898.99	40,563.56
负债合计		9,193,679.16	8,961,980.02
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	1,334,734,721.08	300,125,298.34
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	174,886,862.14	22,052,478.98
净资产合计		1,509,621,583.22	322,177,777.32
负债和净资产总计		1,518,815,262.38	331,139,757.34

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,334,734,721.08 份。其中 A 类基金份额净值 1.1345 元，基金份额总额 193,476,722.80 份；C 类基金份额净值 1.1304 元，基金份额总额 1,141,257,998.28 份。

6.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		78,068,562.18	-778,279.50
1. 利息收入		65,460.02	18,373.69
其中：存款利息收入	6.4.6.9	65,460.02	18,373.69
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		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		39,353,457.75	-2,711,529.57
其中：股票投资收益	6.4.6.10	28,889,344.80	-4,829,570.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	34,464.34	58,135.97
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	-58,532.96	-
股利收益	6.4.6.14	10,488,181.57	2,059,904.79
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）	6.4.6.15	37,979,236.94	1,765,200.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	670,407.47	149,676.16
减：二、营业总支出		8,006,179.59	2,319,038.95
1. 管理人报酬		5,236,731.85	1,480,580.78
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		872,788.64	246,763.52
3. 销售服务费		1,817,302.36	512,131.53
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	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		13.58	-
8. 其他费用	6.4.6.18	79,343.16	79,563.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,062,382.59	-3,097,318.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,062,382.59	-3,097,318.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		70,062,382.59	-3,097,318.45

6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025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	300,125,298.34	-	22,052,478.98	322,177,777.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	300,125,298.34	-	22,052,478.98	322,177,777.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,034,609,422.74	-	152,834,383.16	1,187,443,805.90
（一）、综合收益总额	-	-	70,062,382.59	70,062,382.59
（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）	1,034,609,422.74	-	139,383,086.71	1,173,992,509.45
其中：1. 基金申购款	1,386,092,283.09	-	177,928,797.45	1,564,021,080.54
2. 基金赎回款	-351,482,860.35	-	-38,545,710.74	-390,028,571.09
（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）	-	-	-56,611,086.14	-56,611,086.14
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,334,734,721.08	-	174,886,862.14	1,509,621,583.22
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	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）	-37,436,286.96	-	3,703,550.77	-33,732,736.19

填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-3,097,318.45	-3,097,318.45
(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)	-37,436,286.96	-	6,800,869.22	-30,635,417.74
其中: 1. 基金申购款	57,592,744.85	-	-10,204,905.75	47,387,839.10
2. 基金赎回款	-95,029,031.81	-	17,005,774.97	-78,023,256.84
(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	278,434,653.61	-	-47,494,934.61	230,939,719.00

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：王德英，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 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 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 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。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；

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	38,092,708.48
等于：本金	38,092,222.35
加：应计利息	486.13
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	38,092,708.48

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,308,680,618.56	-	1,371,700,834.88	63,020,216.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,505,404.00	38,862.68	3,542,582.68	-1,684.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,505,404.00	38,862.68	3,542,582.68	-1,684.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,312,186,022.56	38,862.68	1,375,243,417.56	63,018,532.32

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	2,512,640.00	-	-	-
---股指期货	2,512,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,512,640.00	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.6.3.2 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
IM2507	IM2507	2.00	2,515,760.00	3,120.00
合计	-	-	-	3,120.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	3,120.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,120.83

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	-
其他应付款	8,435.00
预提费用	119,343.16
合计	132,898.99

6.4.6.7 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	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	56,559,750.21	56,559,750.21
本期申购	192,785,568.48	192,785,568.48
本期赎回（以“-”号填列）	-55,868,595.89	-55,868,595.89
本期末	193,476,722.80	193,476,722.80

博时智选量化多因子股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	243,565,548.13	243,565,548.13
本期申购	1,193,306,714.61	1,193,306,714.61
本期赎回（以“-”号填列）	-295,614,264.46	-295,614,264.46
本期末	1,141,257,998.28	1,141,257,998.28

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)。

6.4.6.8 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	-323,585.51	5,262,461.02	4,938,875.51
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-323,585.51	5,262,461.02	4,938,875.51
本期利润	5,637,060.50	6,981,911.67	12,618,972.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,270,207.95	18,404,080.57	19,674,288.52

其中：基金申购款	1,080,015.20	25,271,603.54	26,351,618.74
基金赎回款	190,192.75	-6,867,522.97	-6,677,330.22
本期已分配利润	-11,213,686.67	-	-11,213,686.67
本期末	-4,630,003.73	30,648,453.26	26,018,449.53

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	-5,197,244.19	22,310,847.66	17,113,603.47
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-5,197,244.19	22,310,847.66	17,113,603.47
本期利润	26,446,085.15	30,997,325.27	57,443,410.42
本期基金份额交易产生的变动数	-4,610,182.04	124,318,980.23	119,708,798.19
其中：基金申购款	-5,503,145.94	157,080,324.65	151,577,178.71
基金赎回款	892,963.90	-32,761,344.42	-31,868,380.52
本期已分配利润	-45,397,399.47	-	-45,397,399.47
本期末	-28,758,740.55	177,627,153.16	148,868,412.61

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,169.41
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	33,108.10
其他	22,182.51
合计	65,460.02

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	2,465,253,747.93
减：卖出股票成本总额	2,432,106,067.36
减：交易费用	4,258,335.77
买卖股票差价收入	28,889,344.80

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	35,266.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-802.51
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	34,464.34

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,925,529.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,855,175.00
减：应计利息总额	71,154.33
减：交易费用	2.18
买卖债券差价收入	-802.51

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-58,532.96

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	10,488,181.57
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	10,488,181.57

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	37,994,716.94
——股票投资	38,001,261.94
——债券投资	-6,545.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-15,480.00
——权证投资	-
——股指期货	-15,480.00
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	37,979,236.94

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	596,473.47
基金转换费收入	73,934.00
合计	670,407.47

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	79,343.16

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

1. 财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

2. 本基金的基金管理人于 2025 年 08 月 06 日宣告 2025 年度第 4 次分红，向截至 2025 年 08 月 08 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 0.1760 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.1560 元。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
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
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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	5,236,731.85	1,480,580.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,044,791.94	301,164.81
应支付基金管理人的净管理费	4,191,939.91	1,179,415.97

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 1.20% 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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	872,788.64	246,763.52

注：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。

6.4.9.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	-	24,750.97	24,750.97
招商证券	-	1,103.63	1,103.63
博时基金	-	661,260.25	661,260.25
合计	-	687,114.85	687,114.85
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	-	22,898.92	22,898.92
博时基金	-	16,907.03	16,907.03
合计	-	39,805.95	39,805.95

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。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 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。

6.4.9.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
浙商银行-活期存款	38,092,708.48	10,169.41	4,723,046.45	6,335.87

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。

6.4.9.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688692	达梦数据	网下发行	802.00	69,741.92

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

博时智选量化多因子股票 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
1	2025-02-25	2025-02-25	0.2310	1,850,260.68	389,609.77	2,239,870.45	-
2	2025-03-11	2025-03-11	0.4800	3,939,745.36	1,194,979.50	5,134,724.86	-
3	2025-04-14	2025-04-14	0.2410	2,908,901.20	930,190.16	3,839,091.36	-
合计			0.9520	8,698,907.24	2,514,779.43	11,213,686.67	-

博时智选量化多因子股票 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
1	2025-02-25	2025-02-25	0.0660	1,956,758.74	917,348.11	2,874,106.85	-
2	2025-03-11	2025-03-11	0.4690	16,559,824.41	8,249,751.93	24,809,576.34	-
3	2025-04-14	2025-04-14	0.2360	9,414,349.34	8,299,366.94	17,713,716.28	-
合计			0.7710	27,930,932.49	17,466,466.98	45,397,399.47	-

6.4.11 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	首次公开发 行限售	47.27	124.16	573.00	27,085.71	71,143.68	-
688411	海博	2025-01-20	6 个月	首次公开	19.38	83.49	560.00	10,852.80	46,754.40	-

	思创			发行限售						
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	首次公开发行限售	11.68	26.95	990.00	11,563.20	26,680.50	-
301458	钧崑电子	2025-01-02	6 个月	首次公开发行限售	10.40	34.11	701.00	7,290.40	23,911.11	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	首次公开发行限售	46.50	42.85	512.00	23,808.00	21,939.20	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	首次公开发行限售	27.50	56.19	362.00	9,955.00	20,340.78	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	首次公开发行限售	25.80	79.68	227.00	5,855.50	18,087.36	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	首次公开发行限售	12.80	44.54	382.00	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	首次公开发行限售	6.70	24.80	658.00	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	首次公开发行限售	27.51	45.22	341.00	9,381.20	15,420.02	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	首次公开发行限售	29.93	77.87	182.00	5,447.00	14,172.34	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	首次公开发行限售	4.92	18.99	734.00	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科	2025-03-18	6 个月	首次公开	9.08	25.94	536.00	4,866.88	13,903.84	-

	纳			发行						
	米			限售						
001388	信通电子	2025-06-24	5 个交易日	新股未上市	16.42	16.42	843.00	13,842.06	13,842.06	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	首次公开发行限售	4.32	16.97	777.00	3,356.64	13,185.69	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	首次公开发行限售	93.50	90.66	142.00	13,277.00	12,873.72	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	首次公开发行限售	12.30	54.45	226.00	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	首次公开发行限售	26.60	82.50	143.00	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	首次公开发行限售	11.80	33.85	342.00	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	首次公开发行限售	5.30	14.44	709.00	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	首次公开发行限售	89.60	139.48	73.00	6,540.80	10,182.04	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	首次公开发行限售	11.80	22.98	437.00	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	首次公开发行限售	10.27	22.39	393.00	4,036.11	8,799.27	-
688755	汉邦	2025-05-09	6 个月	首次公开	22.77	39.33	203.00	4,622.31	7,983.99	-

	科技			发行 限售						
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	首次 公开发 行 限售	28.33	44.98	173.00	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电 缆	2025-03-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	7.40	20.21	366.00	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血 净	2025-05-12	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.50	32.68	205.00	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新 能	2025-04-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	33.06	47.46	128.00	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科 技	2025-05-12	6 个月	首次 公开发 行 限售	17.05	29.10	196.00	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽 车	2025-04-17	6 个月	首次 公开发 行 限售	16.50	27.45	190.00	3,135.00	5,215.50	-
603271	永杰新 材	2025-03-04	6 个月	首次 公开发 行 限售	20.60	35.08	126.00	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新 材	2025-03-12	6 个月	首次 公开发 行 限售	10.54	46.31	88.00	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机 械	2025-01-20	6 个月	首次 公开发 行 限售	19.08	47.25	80.00	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控 股	2025-02-25	6 个月	首次 公开发 行 限售	24.18	33.32	100.00	2,418.00	3,332.00	-
001390	古麒	2025-05-21	6 个月	首次公 开	12.08	18.12	178.00	2,150.24	3,225.36	-

	绒材			发行限售						
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	首次公开发行限售	20.52	37.47	78.00	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	首次公开发行限售	19.88	43.81	57.00	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	首次公开发行限售	11.50	22.39	105.00	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	首次公开发行限售	12.80	28.05	80.00	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	首次公开发行限售	15.00	33.43	65.00	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	首次公开发行限售	16.42	16.42	94.00	1,543.48	1,543.48	-

6.4.11.1.2 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
111022	锡振转债	2025-06-18	18 个交易日	新债未上市	100.00	100.01	20.00	2,000.00	2,000.11	-

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。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	334,600.00	9,368,874.89	12,731,530.00	-

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.2.1 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 2025 年 6 月 30 日	上年末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,623,330.19	6,478,175.46
合计	2,623,330.19	6,478,175.46

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。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 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 2025 年 6 月 30 日	上年末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,000.11	-
未评级	917,252.38	913,014.49
合计	919,252.49	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。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 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半月以内且不计息，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。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	38,092,708.48	-	-	-	38,092,708.48
结算备付金	38,841,798.23	-	-	-	38,841,798.23
存出保证金	-	-	-	377,364.00	377,364.00
交易性金融资产	3,540,582.57	-	2,000.11	1,371,700,834.88	1,375,243,417.56
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	66,259,974.11	66,259,974.11
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	80,475,089.28	-	2,000.11	1,438,338,172.99	1,518,815,262.38
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,036,573.64	7,036,573.64
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,332,873.55	1,332,873.55
应付托管费	-	-	-	222,145.56	222,145.56
应付销售服务费	-	-	-	469,187.42	469,187.42
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	132,898.99	132,898.99
负债总计	-	-	-	9,193,679.16	9,193,679.16
利率敏感度缺口	80,475,089.28	-	2,000.11	1,429,144,493.83	1,509,621,583.22
上年度末 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

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

6.4.12.4.1.2 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 0	减少约 1
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0	增加约 1

注：以上金额为四舍五入的结果。

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风

险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	1,371,700,834.88	90.86	297,052,082.20	92.20
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,000.11	0.00	—	—
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	1,371,702,834.99	90.86	297,052,082.20	92.20

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。

6.4.12.4.3.2 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 7,523	增加约 1,326
	业绩比较基准下降 5%	减少约 7,523	减少约 1,326

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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 2025年6月30日
第一层次	1,358,455,417.71
第二层次	16,289,498.22
第三层次	498,501.63
合计	1,375,243,417.56

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	1,371,700,834.88	90.31
	其中：股票	1,371,700,834.88	90.31
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,542,582.68	0.23
	其中：债券	3,542,582.68	0.23

	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	76,934,506.71	5.07
8	其他各项资产	66,637,338.11	4.39
9	合计	1,518,815,262.38	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	570,748.00	0.04
B	采矿业	14,041,226.00	0.93
C	制造业	1,032,757,939.13	68.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,777,633.00	0.78
E	建筑业	979,289.00	0.06
F	批发和零售业	13,006,672.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	19,097,888.65	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	119,855,377.17	7.94
J	金融业	50,897,639.60	3.37
K	房地产业	3,518,055.00	0.23
L	租赁和商务服务业	59,817,515.93	3.96
M	科学研究和技术服务业	9,051,097.80	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	6,367,675.60	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	70,560.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	29,889,991.00	1.98
S	综合	1,527.00	0.00
	合计	1,371,700,834.88	90.86

7.2.2 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。

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	688008	澜起科技	1,308,632	107,307,824.00	7.11
2	603986	兆易创新	558,008	70,604,752.24	4.68
3	688220	翱捷科技	737,872	57,775,377.60	3.83
4	002027	分众传媒	6,211,800	45,346,140.00	3.00
5	600036	招商银行	857,200	39,388,340.00	2.61
6	300750	宁德时代	131,600	33,192,152.00	2.20
7	688775	影石创新	146,227	24,605,103.44	1.63
8	002311	海大集团	375,120	21,978,280.80	1.46
9	688018	乐鑫科技	130,353	19,044,573.30	1.26
10	688766	普冉股份	296,769	18,755,800.80	1.24
11	000553	安道麦 A	2,523,700	18,221,114.00	1.21
12	600866	星湖科技	2,619,300	18,099,363.00	1.20
13	603612	索通发展	983,400	18,074,892.00	1.20
14	300850	新强联	503,626	18,039,883.32	1.19
15	603380	易德龙	673,000	17,901,800.00	1.19
16	002352	顺丰控股	337,800	16,471,128.00	1.09
17	603379	三美股份	340,400	16,380,048.00	1.09
18	301196	唯科科技	240,100	16,247,567.00	1.08
19	603236	移远通信	184,900	15,864,420.00	1.05
20	002597	金禾实业	625,827	14,738,225.85	0.98
21	603766	隆鑫通用	1,150,000	14,674,000.00	0.97
22	002284	亚太股份	1,218,700	13,466,635.00	0.89
23	688297	中无人机	250,357	13,369,063.80	0.89
24	300113	顺网科技	670,100	13,241,176.00	0.88
25	603809	豪能股份	854,330	13,071,249.00	0.87
26	300984	金沃股份	226,120	12,945,370.00	0.86
27	603508	思维列控	485,500	12,856,040.00	0.85
28	002442	龙星科技	2,008,668	12,815,301.84	0.85
29	600633	浙数文化	921,400	12,752,176.00	0.84
30	688313	仕佳光子	334,600	12,731,530.00	0.84
31	688629	华丰科技	222,000	12,698,400.00	0.84
32	300777	中简科技	350,000	12,687,500.00	0.84
33	688668	鼎通科技	203,103	12,685,813.38	0.84
34	300373	扬杰科技	244,400	12,684,360.00	0.84
35	688095	福昕软件	186,744	12,681,785.04	0.84
36	600482	中国动力	546,600	12,610,062.00	0.84
37	600114	东睦股份	619,500	12,600,630.00	0.83
38	688258	卓易信息	260,117	12,597,466.31	0.83
39	002983	芯瑞达	591,578	12,535,537.82	0.83
40	003022	联泓新科	791,600	12,531,028.00	0.83
41	600499	科达制造	1,276,700	12,511,660.00	0.83
42	300228	富瑞特装	1,605,800	12,509,182.00	0.83

43	300681	英搏尔	451,000	12,474,660.00	0.83
44	603166	福达股份	806,100	12,470,367.00	0.83
45	300458	全志科技	313,780	12,453,928.20	0.82
46	002920	德赛西威	121,800	12,439,434.00	0.82
47	600826	兰生股份	1,516,200	12,432,840.00	0.82
48	002683	广东宏大	365,800	12,415,252.00	0.82
49	002595	豪迈科技	209,100	12,382,902.00	0.82
50	603893	瑞芯微	81,500	12,376,590.00	0.82
51	688256	寒武纪	20,501	12,331,351.50	0.82
52	688608	恒玄科技	35,406	12,320,579.88	0.82
53	300100	双林股份	259,280	12,206,902.40	0.81
54	000719	中原传媒	983,000	12,199,030.00	0.81
55	000408	藏格矿业	284,500	12,139,615.00	0.80
56	688279	峰岬科技	40,313	7,478,061.50	0.50
57	601728	中国电信	913,200	7,077,300.00	0.47
58	605499	东鹏饮料	21,670	6,805,463.50	0.45
59	603466	风语筑	639,900	6,456,591.00	0.43
60	603444	吉比特	20,600	6,220,170.00	0.41
61	300666	江丰电子	80,300	5,950,230.00	0.39
62	300990	同飞股份	115,400	5,758,460.00	0.38
63	002701	奥瑞金	966,000	5,747,700.00	0.38
64	601900	南方传媒	359,800	5,627,272.00	0.37
65	600998	九州通	1,051,200	5,403,168.00	0.36
66	003816	中国广核	1,444,500	5,257,980.00	0.35
67	300502	新易盛	40,660	5,164,633.20	0.34
68	002049	紫光国微	76,700	5,051,462.00	0.33
69	002532	天山铝业	561,400	4,665,234.00	0.31
70	605259	绿田机械	231,392	4,537,597.12	0.30
71	000893	亚钾国际	140,300	4,228,642.00	0.28
72	601211	国泰海通	201,960	3,869,553.60	0.26
73	301031	中熔电气	48,304	3,847,413.60	0.25
74	002315	焦点科技	80,000	3,655,200.00	0.24
75	300251	光线传媒	176,300	3,573,601.00	0.24
76	002925	盈趣科技	188,600	3,391,028.00	0.22
77	688123	聚辰股份	41,321	3,346,587.79	0.22
78	600983	惠而浦	311,700	3,235,446.00	0.21
79	300124	汇川技术	50,000	3,228,500.00	0.21
80	603173	福斯达	88,200	3,135,510.00	0.21
81	002050	三花智控	117,400	3,097,012.00	0.21
82	301230	泓博医药	83,800	2,884,396.00	0.19
83	300812	易天股份	120,100	2,775,511.00	0.18
84	600941	中国移动	23,600	2,656,180.00	0.18
85	600600	青岛啤酒	37,200	2,583,912.00	0.17

86	603259	药明康德	37,100	2,580,305.00	0.17
87	300476	胜宏科技	19,200	2,580,096.00	0.17
88	300824	北鼎股份	213,600	2,548,248.00	0.17
89	300972	万辰集团	13,900	2,505,336.00	0.17
90	002266	浙富控股	804,670	2,478,383.60	0.16
91	300360	炬华科技	154,800	2,438,100.00	0.16
92	603916	苏博特	268,700	2,434,422.00	0.16
93	601555	东吴证券	277,500	2,428,125.00	0.16
94	000709	河钢股份	1,092,100	2,358,936.00	0.16
95	603700	宁水集团	196,900	2,358,862.00	0.16
96	000803	山高环能	372,700	2,295,832.00	0.15
97	000959	首钢股份	669,500	2,276,300.00	0.15
98	301080	百普赛斯	30,300	2,167,359.00	0.14
99	603118	共进股份	171,900	1,937,313.00	0.13
100	688311	盟升电子	44,503	1,915,854.15	0.13
101	600025	华能水电	200,100	1,910,955.00	0.13
102	300762	上海瀚讯	83,600	1,891,868.00	0.13
103	301220	亚香股份	42,080	1,889,392.00	0.13
104	603005	晶方科技	66,500	1,887,935.00	0.13
105	000768	中航西飞	69,000	1,886,460.00	0.12
106	603617	君禾股份	262,700	1,883,559.00	0.12
107	300499	高澜股份	105,300	1,874,340.00	0.12
108	600460	士兰微	75,500	1,873,910.00	0.12
109	002741	光华科技	88,800	1,871,904.00	0.12
110	603306	华懋科技	42,900	1,866,150.00	0.12
111	600986	浙文互联	216,300	1,767,171.00	0.12
112	603040	新坐标	43,900	1,763,463.00	0.12
113	301312	智立方	44,120	1,751,564.00	0.12
114	002121	科陆电子	334,500	1,672,500.00	0.11
115	300803	指南针	20,100	1,621,266.00	0.11
116	600389	江山股份	86,500	1,608,900.00	0.11
117	002661	克明食品	154,700	1,548,547.00	0.10
118	300857	协创数据	17,920	1,542,195.20	0.10
119	600685	中船防务	53,500	1,454,665.00	0.10
120	002546	新联电子	258,500	1,419,165.00	0.09
121	300684	中石科技	58,900	1,406,532.00	0.09
122	300548	博创科技	20,300	1,355,431.00	0.09
123	300492	华图山鼎	19,920	1,352,169.60	0.09
124	301286	侨源股份	53,300	1,331,967.00	0.09
125	002351	漫步者	99,200	1,301,504.00	0.09
126	600595	中孚实业	267,000	1,169,460.00	0.08
127	301221	光庭信息	22,300	1,158,931.00	0.08
128	601126	四方股份	67,900	1,104,733.00	0.07

129	300454	深信服	11,600	1,092,488.00	0.07
130	002487	大金重工	31,300	1,029,770.00	0.07
131	300662	科锐国际	34,500	1,024,995.00	0.07
132	300484	蓝海华腾	44,900	1,004,413.00	0.07
133	603109	神驰机电	32,400	905,256.00	0.06
134	300871	回盛生物	42,500	888,250.00	0.06
135	603799	华友钴业	21,400	792,228.00	0.05
136	002454	松芝股份	91,000	702,520.00	0.05
137	002479	富春环保	138,000	691,380.00	0.05
138	600909	华安证券	117,700	686,191.00	0.05
139	600166	福田汽车	250,200	678,042.00	0.04
140	300241	瑞丰光电	118,800	677,160.00	0.04
141	002587	奥拓电子	104,100	671,445.00	0.04
142	300236	上海新阳	17,300	671,240.00	0.04
143	002314	南山控股	254,400	669,072.00	0.04
144	600961	株冶集团	59,700	667,446.00	0.04
145	600578	京能电力	148,500	666,765.00	0.04
146	300869	康泰医学	46,400	665,376.00	0.04
147	600517	国网英大	130,200	664,020.00	0.04
148	600873	梅花生物	62,000	662,780.00	0.04
149	603628	清源股份	54,100	660,561.00	0.04
150	600105	永鼎股份	81,400	658,526.00	0.04
151	603386	骏亚科技	51,800	655,270.00	0.04
152	603113	金能科技	94,400	654,192.00	0.04
153	601200	上海环境	81,500	647,110.00	0.04
154	000783	长江证券	93,200	645,876.00	0.04
155	300140	节能环保	104,300	643,531.00	0.04
156	002083	孚日股份	132,900	641,907.00	0.04
157	300080	易成新能	152,900	639,122.00	0.04
158	000050	深天马 A	74,900	638,148.00	0.04
159	301180	万祥科技	43,300	637,809.00	0.04
160	002803	吉宏股份	44,700	637,422.00	0.04
161	300182	捷成股份	114,900	633,099.00	0.04
162	000885	城发环境	47,500	632,700.00	0.04
163	000825	太钢不锈	175,800	631,122.00	0.04
164	600704	物产中大	119,600	630,292.00	0.04
165	600959	江苏有线	182,490	627,765.60	0.04
166	600269	赣粤高速	123,800	626,428.00	0.04
167	300655	晶瑞电材	62,500	625,625.00	0.04
168	300573	兴齐眼药	12,080	625,623.20	0.04
169	600739	辽宁成大	56,800	624,800.00	0.04
170	002091	江苏国泰	85,700	623,039.00	0.04
171	600106	重庆路桥	101,500	622,195.00	0.04

172	000623	吉林敖东	36,700	622,065.00	0.04
173	600582	天地科技	103,800	621,762.00	0.04
174	600179	安通控股	224,500	619,620.00	0.04
175	301195	北路智控	17,300	619,340.00	0.04
176	601311	骆驼股份	68,500	618,555.00	0.04
177	000751	锌业股份	196,100	615,754.00	0.04
178	300088	长信科技	103,300	615,668.00	0.04
179	300317	珈伟新能	148,400	614,376.00	0.04
180	600058	五矿发展	79,300	612,989.00	0.04
181	002081	金螳螂	177,800	609,854.00	0.04
182	300267	尔康制药	194,100	609,474.00	0.04
183	300690	双一科技	25,100	607,671.00	0.04
184	300196	长海股份	49,500	603,900.00	0.04
185	603798	康普顿	55,500	603,840.00	0.04
186	600719	大连热电	93,000	602,640.00	0.04
187	002386	天原股份	121,400	602,144.00	0.04
188	603586	金麒麟	32,800	600,896.00	0.04
189	300259	新天科技	168,700	598,885.00	0.04
190	600496	精工钢构	186,800	597,760.00	0.04
191	002296	辉煌科技	53,600	597,640.00	0.04
192	300066	三川智慧	134,800	595,816.00	0.04
193	002030	达安基因	98,400	595,320.00	0.04
194	600854	春兰股份	114,400	594,880.00	0.04
195	603185	弘元绿能	40,000	594,000.00	0.04
196	603187	海容冷链	50,500	593,880.00	0.04
197	601003	柳钢股份	168,700	593,824.00	0.04
198	600167	联美控股	105,500	592,910.00	0.04
199	301069	凯盛新材	36,800	592,848.00	0.04
200	603311	金海高科	53,600	592,816.00	0.04
201	300420	五洋自控	171,900	591,336.00	0.04
202	301349	信德新材	15,100	589,957.00	0.04
203	301090	华润材料	78,300	589,599.00	0.04
204	300264	佳创视讯	92,300	588,874.00	0.04
205	000016	深康佳 A	114,100	588,756.00	0.04
206	300279	和晶科技	84,900	588,357.00	0.04
207	600251	冠农股份	77,100	588,273.00	0.04
208	002363	隆基机械	77,200	587,492.00	0.04
209	300160	秀强股份	104,500	587,290.00	0.04
210	600675	中华企业	203,800	586,944.00	0.04
211	002228	合兴包装	166,200	586,686.00	0.04
212	600507	方大特钢	134,600	584,164.00	0.04
213	300018	中元股份	73,400	583,530.00	0.04
214	002206	海利得	113,900	582,029.00	0.04

215	002242	九阳股份	61,200	581,400.00	0.04
216	300289	利德曼	111,600	580,320.00	0.04
217	600338	西藏珠峰	52,300	580,007.00	0.04
218	601689	拓普集团	12,262	579,379.50	0.04
219	002491	通鼎互联	102,000	579,360.00	0.04
220	600757	长江传媒	62,400	579,072.00	0.04
221	600266	城建发展	127,400	578,396.00	0.04
222	603989	艾华集团	37,500	577,500.00	0.04
223	300247	融捷健康	147,900	576,810.00	0.04
224	600713	南京医药	113,800	575,828.00	0.04
225	002373	千方科技	61,800	574,740.00	0.04
226	300400	劲拓股份	34,100	574,244.00	0.04
227	002344	海宁皮城	132,100	573,314.00	0.04
228	600728	佳都科技	105,100	572,795.00	0.04
229	000726	鲁泰 A	90,300	572,502.00	0.04
230	601678	滨化股份	138,100	571,734.00	0.04
231	300074	华平股份	117,100	571,448.00	0.04
232	000655	金岭矿业	80,900	571,154.00	0.04
233	002069	獐子岛	147,100	570,748.00	0.04
234	002382	蓝帆医疗	101,900	570,640.00	0.04
235	600668	尖峰集团	40,200	568,830.00	0.04
236	300365	恒华科技	86,200	568,058.00	0.04
237	601901	方正证券	71,700	567,147.00	0.04
238	600219	南山铝业	148,000	566,840.00	0.04
239	603527	众源新材	52,000	565,240.00	0.04
240	600064	南京高科	73,300	565,143.00	0.04
241	600780	通宝能源	95,300	565,129.00	0.04
242	601218	吉鑫科技	137,400	564,714.00	0.04
243	603680	今创集团	49,400	564,642.00	0.04
244	601991	大唐发电	177,600	562,992.00	0.04
245	002976	瑞玛精密	21,600	561,600.00	0.04
246	603325	博隆技术	6,200	559,798.00	0.04
247	601968	宝钢包装	117,000	558,090.00	0.04
248	002516	旷达科技	108,300	557,745.00	0.04
249	603665	康隆达	22,500	557,550.00	0.04
250	000900	现代投资	131,500	556,245.00	0.04
251	603876	鼎胜新材	61,100	555,399.00	0.04
252	601339	百隆东方	117,500	554,600.00	0.04
253	300981	中红医疗	44,390	531,348.30	0.04
254	603816	顾家家居	19,900	507,848.00	0.03
255	002585	双星新材	90,300	493,038.00	0.03
256	600643	爱建集团	66,200	491,204.00	0.03
257	601199	江南水务	92,700	489,456.00	0.03

258	603087	甘李药业	8,900	487,542.00	0.03
259	605305	中际联合	17,500	486,150.00	0.03
260	002624	完美世界	31,600	479,372.00	0.03
261	000720	新能泰山	134,400	469,056.00	0.03
262	688582	芯动联科	6,955	467,376.00	0.03
263	002079	苏州固锴	46,900	457,275.00	0.03
264	600073	光明肉业	61,300	452,394.00	0.03
265	000009	中国宝安	50,500	448,440.00	0.03
266	301178	天亿马	9,600	448,320.00	0.03
267	000688	国城矿业	33,300	443,223.00	0.03
268	600299	安迪苏	45,700	441,005.00	0.03
269	002649	博彦科技	29,700	431,541.00	0.03
270	601566	九牧王	50,400	430,416.00	0.03
271	002215	诺普信	41,100	424,563.00	0.03
272	002029	七匹狼	61,700	415,858.00	0.03
273	300027	华谊兄弟	153,400	411,112.00	0.03
274	300234	开尔新材	72,900	362,313.00	0.02
275	300035	中科电气	20,834	351,677.92	0.02
276	000789	万年青	63,900	348,894.00	0.02
277	600638	新黄浦	59,000	345,740.00	0.02
278	603230	内蒙新华	26,200	338,242.00	0.02
279	000950	重药控股	67,400	336,326.00	0.02
280	002687	乔治白	68,200	316,448.00	0.02
281	300070	碧水源	69,700	313,650.00	0.02
282	600356	恒丰纸业	36,800	296,240.00	0.02
283	301216	万凯新材	22,900	285,563.00	0.02
284	600335	国机汽车	39,700	256,065.00	0.02
285	603811	诚意药业	26,500	244,595.00	0.02
286	300057	万顺新材	44,600	243,070.00	0.02
287	003016	欣贺股份	32,400	243,000.00	0.02
288	600429	三元股份	51,300	231,363.00	0.02
289	600533	栖霞建设	87,900	221,508.00	0.01
290	600075	新疆天业	52,300	221,229.00	0.01
291	600742	富维股份	22,800	216,828.00	0.01
292	000498	山东路桥	36,700	215,796.00	0.01
293	601686	友发集团	35,900	203,912.00	0.01
294	002996	顺博合金	26,800	197,248.00	0.01
295	002202	金风科技	18,200	186,550.00	0.01
296	002840	华统股份	17,800	185,298.00	0.01
297	600861	北京人力	9,500	183,350.00	0.01
298	000060	中金岭南	40,000	183,200.00	0.01
299	601568	北元集团	43,400	180,110.00	0.01
300	000685	中山公用	17,400	152,772.00	0.01

301	000927	中国铁物	58,300	149,831.00	0.01
302	300755	华致酒行	6,900	133,170.00	0.01
303	000898	鞍钢股份	55,600	128,992.00	0.01
304	000554	泰山石油	18,000	127,260.00	0.01
305	601208	东材科技	12,900	122,292.00	0.01
306	000690	宝新能源	26,600	121,030.00	0.01
307	603196	日播时尚	6,500	117,065.00	0.01
308	300110	华仁药业	36,100	116,603.00	0.01
309	600981	汇鸿集团	40,900	116,156.00	0.01
310	600512	腾达建设	50,800	114,808.00	0.01
311	603787	新日股份	9,300	114,576.00	0.01
312	000757	浩物股份	25,200	114,156.00	0.01
313	300556	丝路视觉	5,700	113,259.00	0.01
314	600653	申华控股	58,100	109,228.00	0.01
315	688128	中国电研	4,400	107,800.00	0.01
316	603601	再升科技	26,000	105,560.00	0.01
317	301291	明阳电气	2,500	102,875.00	0.01
318	600594	益佰制药	26,600	102,410.00	0.01
319	000551	创元科技	7,200	92,520.00	0.01
320	600966	博汇纸业	19,300	85,306.00	0.01
321	000404	长虹华意	11,500	81,650.00	0.01
322	002414	高德红外	7,900	80,975.00	0.01
323	688508	芯朋微	1,400	78,148.00	0.01
324	600771	广誉远	3,800	76,608.00	0.01
325	600550	保变电气	8,900	76,540.00	0.01
326	688717	艾罗能源	1,400	75,362.00	0.00
327	002933	新兴装备	2,100	75,012.00	0.00
328	300541	先进数通	4,600	74,750.00	0.00
329	301566	达利凯普	4,000	74,200.00	0.00
330	000415	渤海租赁	22,200	73,926.00	0.00
331	300848	美瑞新材	4,300	73,874.00	0.00
332	000878	云南铜业	5,800	73,776.00	0.00
333	600325	华发股份	15,100	73,537.00	0.00
334	300785	值得买	2,300	73,209.00	0.00
335	002138	顺络电子	2,600	73,112.00	0.00
336	002730	电光科技	4,300	72,713.00	0.00
337	600216	浙江医药	4,900	72,471.00	0.00
338	301149	隆华新材	6,300	72,072.00	0.00
339	601019	山东出版	7,600	71,972.00	0.00
340	002588	史丹利	8,100	71,361.00	0.00
341	600392	盛和资源	5,400	71,118.00	0.00
342	688588	凌志软件	4,856	70,751.92	0.00
343	002852	道道全	7,400	70,744.00	0.00

344	601636	旗滨集团	14,100	70,641.00	0.00
345	301239	普瑞眼科	1,800	70,560.00	0.00
346	002703	浙江世宝	5,300	69,536.00	0.00
347	688469	芯联集成	14,545	69,379.65	0.00
348	002668	TCL 智家	7,100	69,367.00	0.00
349	688387	信科移动	12,127	68,517.55	0.00
350	600056	中国医药	6,600	68,244.00	0.00
351	002958	青农商行	18,800	67,868.00	0.00
352	300604	长川科技	1,500	67,365.00	0.00
353	002034	旺能环境	4,000	67,160.00	0.00
354	688425	铁建重工	16,429	67,030.32	0.00
355	000920	沃顿科技	6,200	66,960.00	0.00
356	603233	大参林	4,100	66,830.00	0.00
357	300571	平治信息	2,100	66,822.00	0.00
358	300685	艾德生物	3,100	66,743.00	0.00
359	688100	威胜信息	1,800	66,690.00	0.00
360	603858	步长制药	4,100	66,584.00	0.00
361	603197	保隆科技	1,700	66,419.00	0.00
362	688147	微导纳米	2,200	66,396.00	0.00
363	300677	英科医疗	2,800	66,304.00	0.00
364	603868	飞科电器	1,800	64,566.00	0.00
365	600483	福能股份	6,600	63,624.00	0.00
366	603565	中谷物流	6,500	62,075.00	0.00
367	300395	菲利华	1,100	56,210.00	0.00
368	688188	柏楚电子	400	52,664.00	0.00
369	688213	思特威	500	51,110.00	0.00
370	002734	利民股份	2,639	48,293.70	0.00
371	300112	万讯自控	5,300	47,965.00	0.00
372	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
373	603699	纽威股份	1,400	43,638.00	0.00
374	603129	春风动力	200	43,300.00	0.00
375	600435	北方导航	2,600	40,534.00	0.00
376	300737	科顺股份	8,300	40,006.00	0.00
377	603077	和邦生物	22,500	39,375.00	0.00
378	300002	神州泰岳	3,300	38,940.00	0.00
379	605319	无锡振华	1,100	37,576.00	0.00
380	003031	中瓷电子	700	37,247.00	0.00
381	300432	富临精工	2,660	34,766.20	0.00
382	002837	英维克	1,170	34,760.70	0.00
383	002281	光迅科技	700	34,524.00	0.00
384	688591	泰凌微	700	33,530.00	0.00
385	301039	中集车辆	4,100	33,333.00	0.00
386	002444	巨星科技	1,300	33,163.00	0.00

387	603866	桃李面包	6,100	32,940.00	0.00
388	603179	新泉股份	700	32,879.00	0.00
389	300232	洲明科技	4,500	32,580.00	0.00
390	600662	外服控股	6,363	32,514.93	0.00
391	000990	诚志股份	4,300	32,508.00	0.00
392	600572	康恩贝	7,400	32,412.00	0.00
393	002745	木林森	4,100	32,308.00	0.00
394	601609	金田股份	4,600	32,246.00	0.00
395	002249	大洋电机	4,900	32,242.00	0.00
396	600874	创业环保	5,400	32,238.00	0.00
397	000090	天健集团	9,100	32,214.00	0.00
397	600033	福建高速	9,100	32,214.00	0.00
398	002399	海普瑞	2,700	32,157.00	0.00
399	603368	柳药集团	1,900	32,129.00	0.00
400	002004	华邦健康	7,700	32,109.00	0.00
401	002216	三全食品	2,900	32,103.00	0.00
402	688779	五矿新能	5,900	32,096.00	0.00
403	600020	中原高速	6,700	32,026.00	0.00
404	600827	百联股份	3,500	31,990.00	0.00
405	000650	仁和药业	5,900	31,978.00	0.00
406	601326	秦港股份	9,900	31,977.00	0.00
407	600597	光明乳业	3,800	31,958.00	0.00
408	600420	国药现代	3,000	31,950.00	0.00
409	600717	天津港	7,000	31,920.00	0.00
410	000030	富奥股份	5,400	31,806.00	0.00
411	600623	华谊集团	4,200	31,794.00	0.00
412	002139	拓邦股份	2,300	31,763.00	0.00
413	000156	华数传媒	4,000	31,760.00	0.00
414	300596	利安隆	1,100	31,647.00	0.00
415	600508	上海能源	2,700	31,590.00	0.00
416	002396	星网锐捷	1,400	31,430.00	0.00
417	688005	容百科技	1,400	31,248.00	0.00
418	601677	明泰铝业	2,500	31,050.00	0.00
419	300725	药石科技	800	30,960.00	0.00
420	002705	新宝股份	2,100	30,870.00	0.00
421	000680	山推股份	3,400	30,498.00	0.00
422	300001	特锐德	1,200	28,764.00	0.00
423	600487	亨通光电	1,847	28,259.10	0.00
424	600885	宏发股份	1,260	28,110.60	0.00
425	300679	电连技术	600	27,228.00	0.00
426	300408	三环集团	800	26,720.00	0.00
427	688545	兴福电子	990	26,680.50	0.00
428	603529	爱玛科技	730	25,112.00	0.00

429	301458	钧威电子	701	23,911.11	0.00
430	600664	哈药股份	6,200	22,816.00	0.00
431	603049	中策橡胶	512	21,939.20	0.00
432	002558	巨人网络	900	21,195.00	0.00
433	301275	汉朔科技	362	20,340.78	0.00
434	600872	中炬高新	1,000	19,000.00	0.00
435	688017	绿的谐波	147	18,358.83	0.00
436	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
437	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
438	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
439	301501	恒鑫生活	341	15,420.02	0.00
440	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
441	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
442	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
443	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
444	600063	皖维高新	2,900	13,282.00	0.00
445	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
446	301606	绿联科技	253	13,011.79	0.00
447	603202	天有为	142	12,873.72	0.00
448	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
449	600271	航天信息	1,300	12,012.00	0.00
450	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
451	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
452	300866	安克创新	100	11,360.00	0.00
453	300800	力合科技	1,000	11,090.00	0.00
454	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
455	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
456	600267	海正药业	1,100	10,175.00	0.00
457	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
458	002014	永新股份	800	9,696.00	0.00
459	001339	智微智能	200	9,666.00	0.00
460	300570	太辰光	100	9,638.00	0.00
461	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
462	001914	招商积余	700	8,659.00	0.00
463	300151	昌红科技	700	8,617.00	0.00
464	688981	中芯国际	95	8,376.15	0.00
465	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
466	601021	春秋航空	141	7,846.65	0.00
467	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
468	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
469	002084	海鸥住工	2,000	7,100.00	0.00
470	600060	海信视像	300	6,906.00	0.00
471	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00

472	603317	天味食品	600	6,672.00	0.00
473	002250	联化科技	600	6,600.00	0.00
474	002001	新和成	300	6,381.00	0.00
475	001206	依依股份	300	6,300.00	0.00
475	002961	瑞达期货	300	6,300.00	0.00
476	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
477	603357	设计总院	700	6,062.00	0.00
478	603728	鸣志电器	100	5,747.00	0.00
479	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
480	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
481	000776	广发证券	300	5,043.00	0.00
482	002483	润邦股份	800	5,000.00	0.00
483	002658	雪迪龙	600	4,698.00	0.00
484	300752	隆利科技	200	4,496.00	0.00
485	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
486	600380	健康元	400	4,412.00	0.00
487	601107	四川成渝	700	4,214.00	0.00
488	601628	中国人寿	100	4,119.00	0.00
489	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
490	600038	中直股份	100	3,881.00	0.00
491	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
492	000538	云南白药	60	3,347.40	0.00
493	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
494	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
495	300699	光威复材	100	3,167.00	0.00
496	603920	世运电路	100	3,051.00	0.00
497	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
498	603163	圣晖集成	100	2,851.00	0.00
499	002635	安洁科技	200	2,708.00	0.00
500	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
501	600169	太原重工	1,000	2,420.00	0.00
502	601066	中信建投	100	2,405.00	0.00
503	002283	天润工业	400	2,384.00	0.00
504	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
505	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
506	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
507	300703	创源股份	100	2,116.00	0.00
507	600609	金杯汽车	400	2,116.00	0.00
508	002273	水晶光电	100	1,997.00	0.00
509	002061	浙江交科	500	1,980.00	0.00
510	601952	苏垦农发	200	1,974.00	0.00
511	002395	双象股份	100	1,770.00	0.00
512	601319	中国人保	200	1,742.00	0.00

513	300351	永贵电器	100	1,592.00	0.00
514	000532	华金资本	100	1,527.00	0.00
515	003013	地铁设计	100	1,443.00	0.00
516	002457	青龙管业	100	1,252.00	0.00
517	600410	华胜天成	100	959.00	0.00
518	002163	海南发展	100	954.00	0.00
519	603558	健盛集团	100	911.00	0.00
520	002437	誉衡药业	300	855.00	0.00
521	002615	哈尔斯	100	841.00	0.00
522	002469	三维化学	100	831.00	0.00
523	600223	福瑞达	100	822.00	0.00
524	300453	三鑫医疗	100	805.00	0.00
525	600268	国电南自	100	782.00	0.00
526	603718	海利生物	100	744.00	0.00
527	600755	厦门国贸	100	605.00	0.00
528	000593	德龙汇能	100	602.00	0.00
529	002062	宏润建设	100	484.00	0.00
530	601599	浙文影业	100	374.00	0.00
531	002969	嘉美包装	100	351.00	0.00
532	002060	广东建工	100	348.00	0.00
533	002421	达实智能	100	336.00	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	300124	汇川技术	113,266,589.50	35.16
2	600036	招商银行	102,253,087.00	31.74
3	002027	分众传媒	101,672,917.00	31.56
4	688008	澜起科技	83,513,378.41	25.92
5	688256	寒武纪	64,223,479.24	19.93
6	603986	兆易创新	64,210,147.67	19.93
7	688220	翱捷科技	51,105,147.83	15.86
8	300750	宁德时代	35,979,882.00	11.17
9	603766	隆鑫通用	29,488,666.00	9.15
10	603893	瑞芯微	29,425,820.00	9.13
11	002595	豪迈科技	28,748,517.00	8.92
12	300502	新易盛	27,598,978.00	8.57
13	300100	双林股份	26,376,680.60	8.19
14	688018	乐鑫科技	25,851,600.70	8.02
15	688775	影石创新	24,920,874.81	7.74

16	600866	星湖科技	22,956,446.00	7.13
17	301196	唯科科技	22,927,026.00	7.12
18	603612	索通发展	22,689,041.00	7.04
19	688608	恒玄科技	21,841,069.41	6.78
20	300850	新强联	21,550,844.05	6.69
21	000553	安道麦 A	21,161,748.01	6.57
22	603380	易德龙	21,056,746.00	6.54
23	002311	海大集团	20,384,023.20	6.33
24	688766	普冉股份	19,820,017.92	6.15
25	603379	三美股份	19,637,631.01	6.10
26	603508	思维列控	19,575,205.00	6.08
27	002284	亚太股份	18,877,316.00	5.86
28	688297	中无人机	18,862,674.86	5.85
29	300984	金沃股份	18,625,176.00	5.78
30	300035	中科电气	18,598,505.32	5.77
31	002597	金禾实业	18,598,451.03	5.77
32	603166	福达股份	18,539,415.00	5.75
33	300681	英搏尔	18,278,883.00	5.67
34	002920	德赛西威	18,264,977.00	5.67
35	300113	顺网科技	17,959,760.00	5.57
36	600114	东睦股份	17,906,567.00	5.56
37	300926	博俊科技	17,865,662.00	5.55
38	300002	神州泰岳	17,833,053.00	5.54
39	603236	移远通信	17,798,190.50	5.52
40	688313	仕佳光子	17,683,415.32	5.49
41	688591	泰凌微	17,629,448.21	5.47
42	600499	科达制造	17,295,695.00	5.37
43	001339	智微智能	17,162,215.00	5.33
44	603699	纽威股份	17,151,840.53	5.32
45	002352	顺丰控股	17,145,558.00	5.32
46	600482	中国动力	16,926,945.00	5.25
47	000719	中原传媒	16,864,962.00	5.23
48	002683	广东宏大	16,664,983.00	5.17
49	600633	浙数文化	16,609,123.00	5.16
50	300408	三环集团	16,388,429.00	5.09
51	688629	华丰科技	16,387,001.40	5.09
52	603809	豪能股份	16,315,087.80	5.06
53	688258	卓易信息	16,309,202.73	5.06
54	300228	富瑞特装	16,207,192.00	5.03
55	300777	中简科技	16,202,869.00	5.03
56	600826	兰生股份	16,017,680.00	4.97
57	002442	龙星科技	15,979,938.32	4.96
58	300679	电连技术	15,961,354.00	4.95

59	300432	富临精工	15,960,492.00	4.95
60	603179	新泉股份	15,888,335.00	4.93
61	300458	全志科技	15,500,638.83	4.81
62	002734	利民股份	15,498,582.42	4.81
63	002983	芯瑞达	15,366,981.65	4.77
64	688095	福昕软件	15,366,347.68	4.77
65	600299	安迪苏	15,127,859.00	4.70
66	603129	春风动力	15,080,578.00	4.68
67	300373	扬杰科技	15,080,501.00	4.68
68	300476	胜宏科技	15,077,945.00	4.68
69	000408	藏格矿业	15,027,743.00	4.66
70	600435	北方导航	14,778,925.00	4.59
71	002444	巨星科技	14,777,536.00	4.59
72	688668	鼎通科技	14,704,326.17	4.56
73	003022	联泓新科	14,665,560.00	4.55
74	000680	山推股份	14,487,115.00	4.50
75	002281	光迅科技	14,345,650.00	4.45
76	605319	无锡振华	14,303,859.00	4.44
77	002850	科达利	14,280,046.03	4.43
78	688005	容百科技	14,101,727.48	4.38
79	688798	艾为电子	13,932,999.43	4.32
80	600885	宏发股份	13,862,729.20	4.30
81	001380	华纬科技	13,702,874.84	4.25
82	300803	指南针	13,518,171.45	4.20
83	002837	英维克	13,418,822.00	4.17
84	600487	亨通光电	13,222,197.09	4.10
85	300627	华测导航	12,264,281.00	3.81
86	002011	盾安环境	12,194,125.53	3.78
87	000811	冰轮环境	12,054,014.00	3.74
88	603529	爱玛科技	12,044,036.70	3.74
89	600312	平高电气	12,021,733.00	3.73
90	603737	三棵树	11,946,140.00	3.71
91	688800	瑞可达	11,785,373.35	3.66
92	300768	迪普科技	11,769,401.00	3.65
93	300001	特锐德	11,762,763.00	3.65
94	600817	宇通重工	11,693,581.00	3.63
95	002384	东山精密	11,676,207.00	3.62
96	300708	聚灿光电	11,558,506.00	3.59
97	601179	中国西电	11,375,095.00	3.53
98	300570	太辰光	10,744,661.00	3.34
99	002594	比亚迪	10,454,383.00	3.24
100	605020	永和股份	10,206,556.00	3.17
101	601728	中国电信	9,594,701.00	2.98

102	688279	峰岬科技	9,448,485.99	2.93
103	601211	国泰海通	8,534,131.00	2.65
104	000951	中国重汽	7,971,272.00	2.47
105	600063	皖维高新	7,919,203.00	2.46
106	000039	中集集团	7,891,637.50	2.45
107	603466	风语筑	7,791,658.00	2.42
108	001301	尚太科技	7,727,034.00	2.40
109	002865	钧达股份	7,472,567.10	2.32
110	002906	华阳集团	7,182,814.00	2.23
111	002296	辉煌科技	7,071,295.00	2.19
112	301031	中熔电气	6,868,628.44	2.13
113	300666	江丰电子	6,756,306.00	2.10
114	600066	宇通客车	6,727,259.00	2.09
115	002648	卫星化学	6,676,953.00	2.07
116	603259	药明康德	6,553,034.00	2.03
117	300990	同飞股份	6,552,174.00	2.03
118	002701	奥瑞金	6,551,193.00	2.03
119	600458	时代新材	6,550,471.00	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	103,239,633.00	32.04
2	688256	寒武纪	78,550,118.87	24.38
3	600036	招商银行	67,768,142.00	21.03
4	002027	分众传媒	55,680,744.00	17.28
5	688279	峰岬科技	37,760,311.51	11.72
6	300502	新易盛	27,667,896.83	8.59
7	300926	博俊科技	20,667,160.00	6.41
8	001339	智微智能	20,134,519.93	6.25
9	603893	瑞芯微	19,344,941.16	6.00
10	603699	纽威股份	18,463,266.00	5.73
11	300035	中科电气	18,434,157.00	5.72
12	300100	双林股份	18,321,873.00	5.69
13	300002	神州泰岳	17,302,365.00	5.37
14	603766	隆鑫通用	17,210,292.00	5.34
15	002734	利民股份	16,936,247.50	5.26
16	002595	豪迈科技	16,495,649.00	5.12
17	688798	艾为电子	16,297,405.93	5.06

18	300432	富临精工	16,294,930.50	5.06
19	688591	泰凌微	16,089,841.26	4.99
20	001380	华纬科技	15,947,546.51	4.95
21	601288	农业银行	15,901,112.00	4.94
22	300476	胜宏科技	15,895,582.00	4.93
23	002850	科达利	15,880,353.00	4.93
24	605319	无锡振华	15,546,828.00	4.83
25	300408	三环集团	15,109,892.00	4.69
26	600487	亨通光电	14,728,687.00	4.57
27	600435	北方导航	14,639,559.00	4.54
28	002281	光迅科技	14,474,281.00	4.49
29	000680	山推股份	14,423,388.00	4.48
30	603179	新泉股份	14,338,941.00	4.45
31	600299	安迪苏	14,117,096.00	4.38
32	300001	特锐德	14,106,048.00	4.38
33	688005	容百科技	14,088,521.62	4.37
34	688008	澜起科技	14,029,095.23	4.35
35	603129	春风动力	13,974,413.00	4.34
36	300679	电连技术	13,679,598.00	4.25
37	688800	瑞可达	13,653,813.67	4.24
38	300803	指南针	13,409,584.20	4.16
39	600885	宏发股份	13,400,012.00	4.16
40	002837	英维克	13,083,736.00	4.06
41	300570	太辰光	12,876,581.00	4.00
42	002444	巨星科技	12,824,664.00	3.98
43	300627	华测导航	12,574,910.00	3.90
44	002384	东山精密	12,470,657.00	3.87
45	601179	中国西电	12,122,583.00	3.76
46	600312	平高电气	12,095,188.13	3.75
47	688313	仕佳光子	12,069,907.45	3.75
48	000811	冰轮环境	12,020,137.00	3.73
49	600872	中炬高新	11,777,065.00	3.66
50	603737	三棵树	11,667,089.21	3.62
51	603529	爱玛科技	11,442,160.00	3.55
52	002011	盾安环境	11,265,133.00	3.50
53	600817	宇通重工	11,107,769.80	3.45
54	300768	迪普科技	10,818,487.00	3.36
55	688297	中无人机	10,487,015.56	3.26
56	300708	聚灿光电	10,482,525.00	3.25
57	002594	比亚迪	10,443,555.00	3.24
58	605020	永和股份	9,735,236.00	3.02
59	300984	金沃股份	9,502,535.00	2.95
60	001301	尚太科技	9,314,221.00	2.89

61	603508	思维列控	9,206,297.00	2.86
62	002284	亚太股份	8,785,027.00	2.73
63	000039	中集集团	8,295,768.00	2.57
64	601658	邮储银行	8,247,321.00	2.56
65	688018	乐鑫科技	8,176,324.93	2.54
66	300674	宇信科技	8,093,608.00	2.51
67	688220	翱捷科技	7,890,741.43	2.45
68	300113	顺网科技	7,800,249.00	2.42
69	600063	皖维高新	7,793,447.00	2.42
70	002865	钧达股份	7,784,988.39	2.42
71	300433	蓝思科技	7,778,546.00	2.41
72	000951	中国重汽	7,594,204.00	2.36
73	688608	恒玄科技	7,430,119.83	2.31
74	002906	华阳集团	7,317,514.00	2.27
75	301196	唯科科技	7,230,190.00	2.24
76	603166	福达股份	6,949,027.00	2.16
77	002648	卫星化学	6,921,124.00	2.15
78	300850	新强联	6,893,789.15	2.14
79	600458	时代新材	6,853,753.00	2.13
80	600066	宇通客车	6,752,571.00	2.10
81	002202	金风科技	6,646,415.00	2.06

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,468,753,558.10
卖出股票的收入（成交）总额	2,465,253,747.93

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	3,540,582.57	0.23
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）	2,000.11	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,542,582.68	0.23

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	019758	24 国债 21	26,000	2,623,330.19	0.17
2	019723	23 国债 20	9,000	917,252.38	0.06
3	111022	锡振转债	20	2,000.11	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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，招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外

汇管理局绍兴市分局、国家外汇管理局贵州省分局、国家金融监督管理总局四川监管局、国家金融监督管理总局山东监管局、深圳市市场监督管理局的处罚。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。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。

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	377,364.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,259,974.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,637,338.11

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.00	首次公开发行限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时智选量化多因子股票 A	7,146	27,074.83	70,104,394.23	36.23%	123,372,328.57	63.77%
博时智选量化多因子股票 C	26,407	43,218.01	847,470,903.65	74.26%	293,787,094.63	25.74%
合计	33,054	40,380.43	917,575,297.88	68.75%	417,159,423.20	31.25%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时智选量化多因子股票 A	2,412,047.11	1.25%
	博时智选量化多因子股票 C	191,254.15	0.02%
	合计	2,603,301.26	0.20%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	>100
	博时智选量化多因子股票 C	0~10
	合计	>100
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	50~100
	博时智选量化多因子股票 C	—
	合计	50~100

§ 9 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	56,559,750.21	243,565,548.13
本报告期基金总申购份额	192,785,568.48	1,193,306,714.61
减：本报告期基金总赎回份额	55,868,595.89	295,614,264.46

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	193,476,722.80	1,141,257,998.28

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及本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。

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，本基金托管人及其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	佣金	占当期佣 金总量的	

			额的比例		比例	
华创证券	2	5,931,826,406.63	100.00%	2,645,344.01	100.00%	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

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
华创证券	54,379.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
2	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	2025-06-26
3	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	2025-06-26
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-20250606	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
5	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-20250603	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
6	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 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	2025-04-22

7	博时智选量化多因子股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-10
8	博时智选量化多因子股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-10
9	博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
10	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-20250408	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
11	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
12	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 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	2025-03-31
13	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-20250325	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
14	博时智选量化多因子股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-07
15	博时智选量化多因子股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-07
16	博时智选量化多因子股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-22
17	博时智选量化多因子股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-02-22
18	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 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	2025-01-22

§ 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

无。

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

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
二〇二五年八月二十九日