

博时量化价值股票型证券投资基金

2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月二十九日

§ 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2018 年 6 月 26 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	5
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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	45
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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	57
§ 9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 10 开放式基金份额变动.....	58
§ 11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 13 备查文件目录.....	62
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化价值股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化价值股票	
基金主代码	005960	
交易代码	005960	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	104,140,587.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
下属分级基金的交易代码	005960	005961
报告期末下属分级基金的份额总额	93,825,753.15 份	10,314,834.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。
投资策略	<p>1、A 股投资策略：本基金运用量化方法进行价值型投资，本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础，对其中的价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。</p> <p>2、港股投资策略：本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。</p> <p>3、债券投资策略：由于流动性管理及策略性投资的需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券以及可转换债券的投资。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略：本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，在力争本金安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。</p> <p>5、权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金现阶段主要通过股指期货合约调节整体组合的市场风险。</p> <p>7、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富

	(总值) 指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于中高风险/收益的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	贺倩
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张光华	周慕冰

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C

本期已实现收益	-10,809,797.98	-970,463.20
本期利润	-12,913,536.95	-1,269,037.05
加权平均基金份额本期利润	-0.1142	-0.0452
本期加权平均净值利润率	-11.83%	-4.58%
本期基金份额净值增长率	-13.26%	-13.62%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期末可供分配利润	-12,436,991.25	-1,405,043.67
期末可供分配基金份额利润	-0.1326	-0.1362
期末基金资产净值	81,388,761.90	8,909,790.58
期末基金份额净值	0.8674	0.8638
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金份额累计净值增长率	-13.26%	-13.62%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 博时量化价值股票 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.84%	1.69%	-10.08%	1.42%	-1.76%	0.27%
过去六个月	-13.29%	1.25%	-12.19%	1.28%	-1.10%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-13.26%	1.23%	-13.12%	1.28%	-0.14%	-0.05%

2. 博时量化价值股票 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.01%	1.69%	-10.08%	1.42%	-1.93%	0.27%
过去六个月	-13.65%	1.25%	-12.19%	1.28%	-1.46%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-13.62%	1.23%	-13.12%	1.28%	-0.50%	-0.05%

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、20%、10%的比例采取再平衡，再用

每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

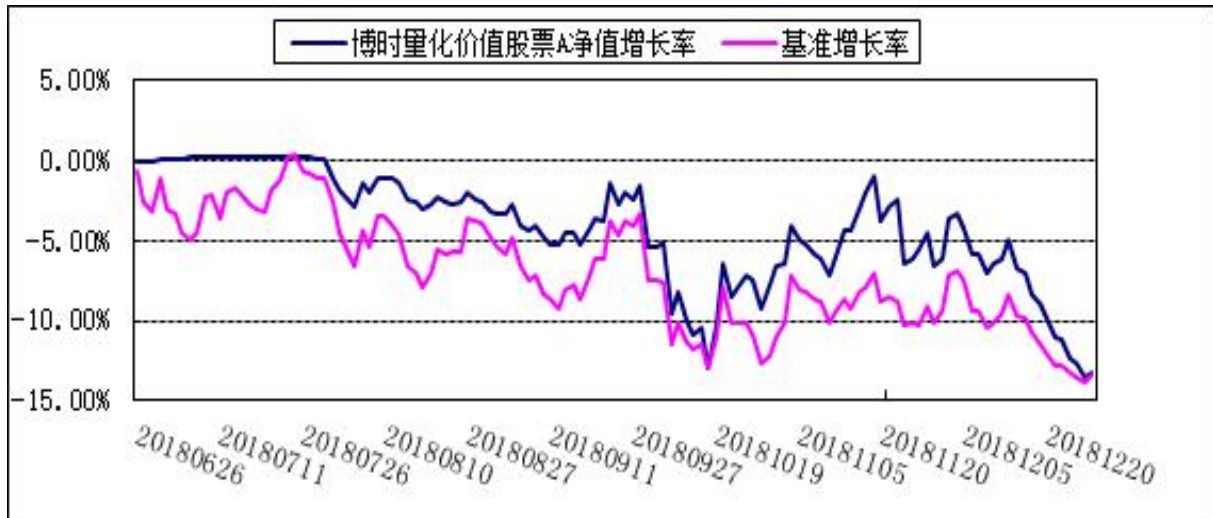
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化价值股票型证券投资基金

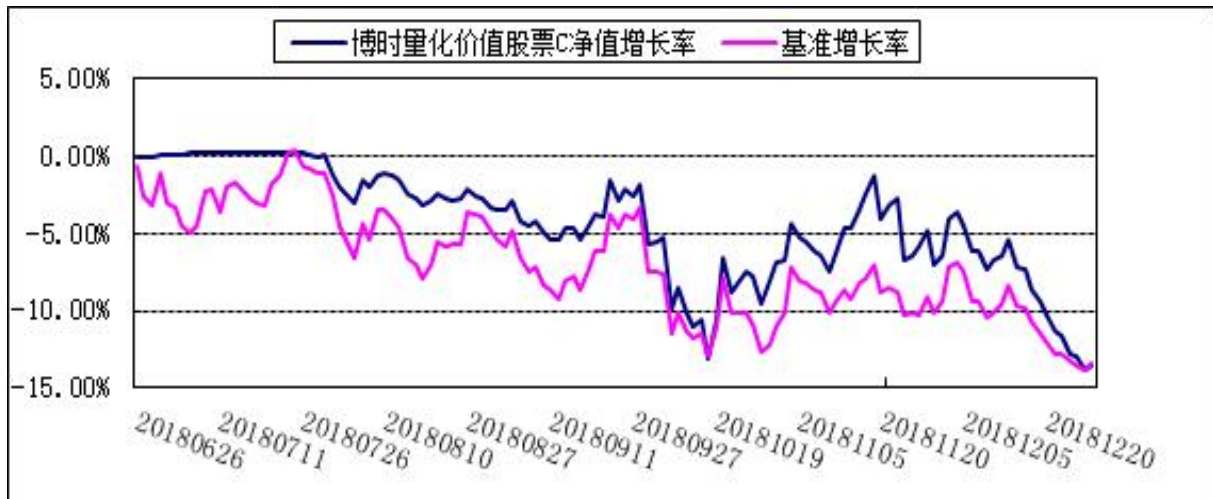
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 6 月 26 日至 2018 年 12 月 31 日)

1、博时量化价值股票 A



2、博时量化价值股票 C



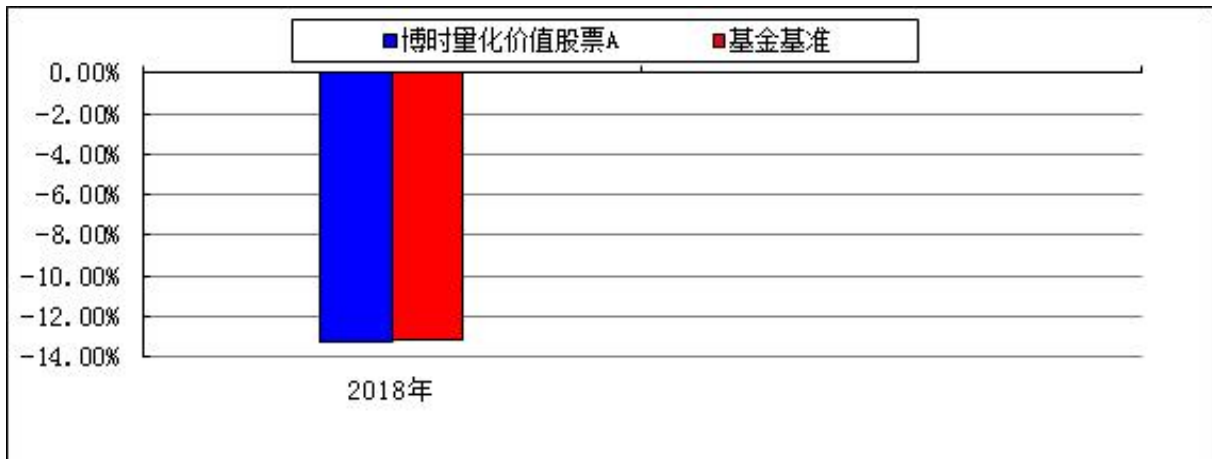
注：本基金的基金合同于 2018 年 06 月 26 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

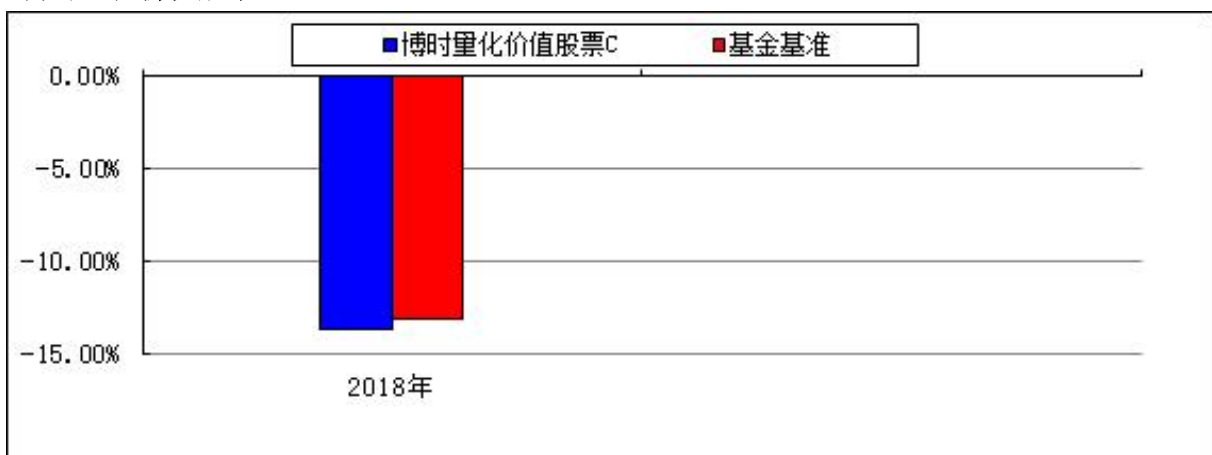
博时量化价值股票型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时量化价值股票 A



2、博时量化价值股票 C



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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 2018 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 181 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，管理资产总规模逾 8638 亿元人民币，剔除货币基金与短期理财债券基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 2439 亿元人民币，累计分红逾 916 亿元人民币，是目前我国资产管理规模

最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2018 年 4 季末：

博时固定收益类基金业绩表现亮眼。在参与银河排名的 107 只固收产品（各类份额分开计算）中，有 54 只产品银河同类排名前 1/2。债券型基金中，博时宏观回报债券 A/B 类、博时宏观回报债券 C 类 2018 年全年净值增长率均分别在 200 只、142 只同类基金中排名第 1，博时天颐债券 A 类 2018 年全年净值增长率在 200 只同类基金中排名第 4，博时天颐债券 C 类 2018 年全年净值增长率在 142 只同类基金中排名第 5，博时富华纯债债券、博时富瑞纯债债券、博时裕康纯债债券、博时双月薪定期支付债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/10，博时富发纯债债券、博时裕利纯债债券、博时富益纯债债券 2018 年全年净值增长率排名均在银河同类前 1/8；货币型基金中，博时合惠货币 B 类、博时现金宝货币 B 类 2018 年全年净值增长率分别在 291 只同类基金中排名第 8、第 29，博时合惠货币 A 类 2018 年全年净值增长率在 311 只同类基金中排名第 11。

博时旗下权益类基金业绩表现稳健。2018 年 A 股市场震荡下行，博时旗下参与银河排名的 83 只权益产品（各类份额分开计算）中，56 只银河同类排名在前 1/2。其中，股票型基金里，博时工业 4.0 主题、博时丝路主题业绩排名均在银河同类前 1/4；混合型基金中，博时乐臻定开混合 2018 年全年净值增长率在 44 只同类基金中均排名第 4，博时新兴消费主题、博时汇智回报、博时新策略 A 类、博时新收益等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时逆向投资、博时战略新兴产业、博时裕隆、博时鑫泰 A 类等基金业绩排名在银河同类前 1/4；指数基金中，博时上证超大盘 ETF 及其联接基金等基金业绩排名在银河同类前 1/10，博时上证 50ETF 及其联接基金 A 类业绩排名在银河同类前 1/6，博时沪深 300 指数业绩排名在银河同类前 1/3。

商品型基金当中，博时黄金 ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率同类排名第 1。

QDII 基金方面，博时标普 500ETF、博时标普 500ETF 联接 A 类 2018 年全年净值增长率银河同类排名均位于前 1/3。

2、其他大事件

2018 年 12 月 28 日，由新华网主办的第十一届“中国企业社会责任峰会”暨 2018 中国社会责任公益盛典在京隆重举行。凭借多年来对责任投资的始终倡导和企业公民义务的切实履行，老牌公募巨头博时基金在本次公益盛典上荣获“2018 中国社会责任杰出企业奖”。

2018 年 12 月 22 日，东方财富在南京举办的“2018 东方财富风云榜暨基情 20 年”颁奖典礼上，博时基金喜获两项大奖，博时基金江向阳总经理获得“基情 20 周年最受尊敬行业领袖”奖；博时主题行业混合（LOF）荣登“天天基金年度产品热销榜”。

2018 年 12 月 21 日，由华夏时报社主办的“华夏机构投资者年会暨第十二届金蝉奖颁奖盛典”在北京召开，本次年会的主题是“金融业 2019 年：突破与回归”，博时基金荣获“2018 年度基金管理公司”。

2018 年 12 月 21 日，由北京商报社、北京品牌协会主办的“科技赋能与金融生态再造”——2018 年度（第四届）北京金融论坛在京成功举办，博时基金荣获“技术领先价值奖”。

2018 年 12 月 15 日，第二届腾讯理财通金企鹅奖暨财富高峰论坛在深圳举行。会上揭晓了第二届金企鹅奖获奖名单，其中博时安盈债券基金（A 类：000084、C 类：000085）凭借年内出色的业绩表现以及在 90 后用户中的超高人气，一举斩获“最受 90 后用户喜爱的产品奖”。

2018 年 11 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2018 公募基金高峰论坛暨金鼎奖颁奖典礼”在成都举行，凭借突出的资管实力和对价值投资的坚守，博时基金一举摘得“公募 20 年特别贡献奖——创造收益”这一重磅奖项，同时，旗下专户板块获“专户业务最具竞争力基金公司”奖。

2018 年 11 月 1 日，博时基金正式加入联合国责任投资原则组织（简称 UN PRI），成为中国较早加入 UN PRI 国际组织的资产管理机构之一。

2018 年 10 月 17 日，由南方财经全媒体集团和 21 世纪传媒举办的 21 世纪国际财经峰会暨“金帆奖”评选在深圳举行，凭借对价值投资理念的坚守和出色的综合资管能力，博时基金一举斩获“2018 年度基金管理公司金帆奖”这一重磅奖项。

2018 年 9 月 7 日，由证券时报主办的“2018 中国 AI 金融探路者峰会暨第二届中国金融科技先锋”榜颁奖典礼在深圳举行，凭借长期的敬业精神和沉淀的创新思维，博时基金副总裁王德英获得了“2018 中国金融科技领军人物先锋”的荣誉。

2018 年 9 月 6-9 日，在阿拉善生态基金会主办，深圳证券信息、全景网协办，深交所、证券业协会、基金业协会、期货业协会、上市公司协会等单位支持的“2018 第三届绿色行走公益长征暨沙漠穿越挑战·赛”中，由 4 名博时员工朱盟（信息技术部）、过钧（固定收益总部）、王飞（信息技术部）、王盼（信息技术部）组成的代表队，成功穿越内蒙古阿拉善盟腾格里沙漠，率先全员抵达终点获得团体冠军，其中王飞更获得个人第一。

2018 年 8 月，全国社会保障基金境内委托投资管理人 2017 年度考评结果出炉，博时基金投研能力获得高度认可，在公司基本面单项考评中获 A 档，三个社保委托组合获评“综合考评 A 档”，此为社保考评结果的最高档。同时，在社保投资经理的考评中，博时基金共收获 3 项个人奖项。博时基金副总裁兼高级投资经理董良泓独揽社保理事会特别颁发的“10 年长期贡献社保表彰”，用于肯定其过去十年在同一家公司管理社保组合，含金量极高。同时，董良泓本人还摘得“10 年贡

献社保表彰”的殊荣，该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人，本次仅授予 2 人。此外，博时基金董事总经理兼年金投资部总经理欧阳凡获评“3 年贡献社保表彰”。

2018 年 7 月 19 日，由中国证券投资基金业协会主办的“中国基金业 20 周年——发展中的思考与启示”主题论坛在深圳隆重举行。博时基金凭借雄厚的资管实力、出色的投研业绩、锐意创新的拼搏精神获得基金业协会的高度认可，一举摘得“优秀基金管理人”大奖；副总经理王德英此次荣获“杰出专业人士”的殊荣。同时，博时主题行业混合（LOF）（160505）更是以长期优异的业绩上榜“优秀基金产品”。

2018 年 6 月 8 日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017 年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018 年 5 月 24 日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业 20 年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾 23 年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业 20 年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有 20 人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继 2016 年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018 年 5 月 23 日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募 20 年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金（000277）获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券（QDII）（人民币 050030：，美元现汇：050202，美元现钞：050203）获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018 年 5 月 17 日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖（DevOps 统一研发平台）、三等奖（证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试）以及优秀奖（新一代基金理财综合业务接入平台）三项大奖，成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018 年 5 月 10 日，由《上海证券报》主办的“2018 中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上，博时基金揽获“金基金 TOP 基金公司”这一最具份量的公司大奖；博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报

基金经理奖”。在第 15 届金基金奖评选中，旗下价值投资典范产品博时主题行业（160505）获得“三年期金基金分红奖”。

2018 年 3 月 26 日，第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业 20 年卓越贡献公司”大奖。同时，旗下绩优产品博时主题行业混合（LOF）（160505）荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018 年 3 月 22 日，由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金 20 周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼”在北京举办，本次评选中，博时基金一举斩获本届“20 周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金 20 年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖，同时，旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金（二级债）”奖双双收入囊中，博时聚润纯债债券则获得“2017 年度普通债券型明星基金”奖。

2018 年 2 月 2 日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018 年 1 月 11 日，由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业 20 年最佳创新产品奖颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”，旗下产品博时主题行业混合基金（160505）和博时黄金 ETF 分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”，成为当天最大赢家之一。

2018 年 1 月 9 日，由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017 年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

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		
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理 /基金经理	2018-06-26	-	16.5	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有

					<p>限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监、博时价值增长证券投资基金（2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日）、博时价值增长贰号证券投资基金（2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日）、博时特许价值混合型证券投资基金（2015 年 2 月 9 日-2018 年 6 月 21 日）的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合型证券投资基金（2017 年 5 月 4 日一至今）、博时量化多策略股票型证券投资基金（2018 年 4 月 3 日一至今）、博时量化价值股票型证券投资基金（2018 年 6 月 26 日一至今）的基金经理。</p>
林景艺	基金经理	2018-06-26	-	8.5	<p>林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理。现任博时国企改革主题股票型证券投资基金（2015 年 5 月 20 日一至今）、博时量化平衡混合型证券投资基金（2017 年 5 月 4 日一至今）、博时量化多策略股票型证券投资基金（2018 年 4 月 3 日一至今）、博时量化价值股票型证券</p>

					投资基金 (2018 年 6 月 26 日一至今) 的基金经理。
周江	高级研究员兼 基金经理助理	2018-06- 26	-	3.7	2014 年 1 月至 2015 年 4 月在平安磐海资本工作。2015 年 4 月加入博时基金管理有限公司, 曾任研究员, 现任高级研究员兼基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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, 基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定, 没有损害基金持有人利益的行为。

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《公平交易管理制度》, 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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2018 年, 在国内宏观经济弱势寻底、国际中美贸易摩擦不确定性事件频发的环境下, A 股全年四个季度连续收跌, 主要股指跌幅均在 20% 以上。风格方面, 虽然年内有几次较为剧烈的风格转换, 但是全年 A 股所有风格普遍下跌, 结构差异不大, 其中大盘、低估值风格跌幅略小, 小盘成长风格

跌幅相对较大。上证 50 指数全年收益为-19.83%，中证 1000 指数收益为-36.87%，全部 A 股中位数跌幅超过 33%。行业层面，从中信行业指数上看，29 个一级行业全部下跌，餐饮旅游、银行跌幅在 15%以内，其他行业跌幅均在 20%以上，电子元器件、有色金属、传媒、机械和基础化工等行业跌幅普遍大于 30%。梳理下来，受增长和行业政策压制较小、股权质押影响不大的行业，走出了部分超额收益。

本基金是风格鲜明的运用量化方法进行价值型投资的产品，成立于 2018 年年中，我们以自主研发的量化多策略体系为基础，从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资。三季度我们逐步建仓完毕，仓位基本维持在 80%以上，四季度由于市场的普遍下跌，本基金的净值也有所回撤。当前，大盘指数的估值处于历史最低区域，中小盘指数的估值已经创了新低，在这个估值基础上我们对于未来中长期的市场并不悲观，历史数据也验证了在市场底部区域布局低估值投资是一个非常可行的投资策略。未来我们将持续对价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.8674 元，份额累计净值为 0.8674 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.8638 元，份额累计净值为 0.8638 元。报告期内，本基金 A 基金份额净值增长率为-13.26%，本基金 C 基金份额净值增长率为-13.62%，同期业绩基准增长率-13.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，随着美联储加息海外流动性依然为转紧态势，中美贸易摩擦的不确定性也依然存在，国际环境暂无明显改善迹象。国内方面，经济增长依然面对一些下行压力，但是没有大幅下滑风险。A 股的盈利状况受到宏观环境的影响，在经济增长走弱、通胀下行和流动性小幅改善的宏观背景下，预计 2019 年 A 股非金融行业的利润增速将继续下行。投资者对于经济的悲观预期已经在市场定价中反应的较为充分。

政策方面，国内宏观政策的总基调是加强“逆周期调节”，通过减税降费、改革和开放等手段来稳定预期和激活微观经济活力。监管环境转变和科创板、回购等制度改革为 A 股带来政策红利，股权质押风险的释放则进一步逼近市场底部。预计 2019 年资金面略有好转，当前大盘指数估值处于历史低位，小盘指数估值已经创历史新低，市场情绪再次处于历史低位，任何的边际改善都有可能带来市场的显著反弹，总体而言，当前的政策面与交易面对 A 股而言都处于较为积极的阶段。业绩增长稳健、逆周期性较强或者有政策对冲性质的行业更容易有良好表现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

2018 年，我公司根据法律、法规的规定，制定了《合规管理制度》、《养老目标证券投资基金子基金选择标准与制度》等制度。修订了《合规考核管理制度》、《投资决策委员会制度》、《债券型基金投资股票管理流程》等制度文件，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断建设及完善“新一代投资决策支持系统”、“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。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《证券投资基金销售管理办法》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副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—博时基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人

利益的行为。

§ 6 审计报告

安永华明（2019）审字第 60669135_A01 号

博时量化价值股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时量化价值股票型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

我们认为，后附的博时量化价值股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了博时量化价值股票型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

6.3 其他信息

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

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

治理层负责监督博时量化价值股票型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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（续）：

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

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师 王珊珊

中国注册会计师 贺 耀

中国 北京

2019年3月28日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	6,284,948.55
结算备付金		1,137,395.57
存出保证金		65,326.95
交易性金融资产	7.4.7.2	83,997,416.65
其中：股票投资		83,805,431.05
基金投资		-
债券投资		191,985.60
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-

应收利息	7.4.7.5	2,097.97
应收股利		-
应收申购款		23,518.93
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		91,510,704.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		260,343.99
应付管理人报酬		121,504.10
应付托管费		20,250.69
应付销售服务费		6,089.03
应付交易费用	7.4.7.7	613,960.81
应交税费		2.09
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	190,001.43
负债合计		1,212,152.14
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	104,140,587.40
未分配利润	7.4.7.10	-13,842,034.92
所有者权益合计		90,298,552.48
负债和所有者权益总计		91,510,704.62

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额为 104,140,587.40 份，其中 A 类基金份额净值为人民币 0.8674 元，份额总额为 93,825,753.15 份；C 类基金份额净值为人民币 0.8638 元，份额总额为 10,314,834.25 份。

2、本财务报表的实际编制期间系 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至
----	-----	----------------------------

		2018 年 12 月 31 日
一、收入		-11,292,828.59
1. 利息收入		544,151.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	204,263.52
债券利息收入		601.40
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		339,286.57
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-10,355,717.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,592,028.98
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	39,531.41
资产支持证券投资		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	196,779.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,402,312.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		921,050.51
减：二、费用		2,889,745.41
1. 管理人报酬		1,019,479.75
2. 托管费		169,913.31
3. 销售服务费		101,139.00
4. 交易费用		1,398,949.45
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.31
7. 其他费用		200,263.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,182,574.00
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,182,574.00

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	341,191,900.59	-	341,191,900.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,182,574.00	-14,182,574.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-237,051,313.19	340,539.08	-236,710,774.11
其中：1. 基金申购款	5,253,609.05	-233,057.71	5,020,551.34
2. 基金赎回款	-242,304,922.24	573,596.79	-241,731,325.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	104,140,587.40	-13,842,034.92	90,298,552.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 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：成江

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时量化价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]344号《关于准予博时量化价值股票型证券投资基金注册的批复》的注册，由博时基金管理有限公司于2018年6月1日至2018年6月22日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2018）验字第60669135_A01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2018年6月26日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币341,152,945.00元，有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币38,955.59元，以上实收基金合计为人民币341,191,900.59元，折合341,191,900.59份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据认购、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，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%—50%；权证投资比例为基金资产净值的 0—3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值

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

本期财务报表的实际编制期间系 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差

异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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份额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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

(1) 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；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别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；

(3) 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；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简

称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2018 年 12 月 31 日	
活期存款	6,284,948.55	
定期存款	-	
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	-	
合计	6,284,948.55	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	86,211,729.47	83,805,431.05	-2,406,298.42	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	188,000.00	191,985.60	3,985.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	188,000.00	191,985.60	3,985.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	86,399,729.47	83,997,416.65	-2,402,312.82	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,416.12
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	562.98
应收债券利息	86.53
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	32.34
合计	2,097.97

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	613,960.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	613,960.81

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.43
其他应付款	-
预提费用	190,000.00
合计	190,001.43

7.4.7.9 实收基金
博时量化价值股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	177,981,219.30	177,981,219.30
本期申购	2,717,520.10	2,717,520.10
本期赎回（以“-”号填列）	-86,872,986.25	-86,872,986.25
本期末	93,825,753.15	93,825,753.15

博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	163,210,681.29	163,210,681.29
本期申购	2,536,088.95	2,536,088.95
本期赎回（以“-”号填列）	-155,431,935.99	-155,431,935.99
本期末	10,314,834.25	10,314,834.25

注：1、如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额；
 2、本基金合同生效日为2018年6月26日；
 3、本基金设立时募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币341,152,945.00元，折合341,152,945.00份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币38,955.59元，折合38,955.59份基金份额；以上收到的实收基金共计为人民币341,191,900.59元，折合341,191,900.59份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润
博时量化价值股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日			
本期利润	-10,809,797.98	-2,103,738.97	-12,913,536.95
本期基金份额交易产生的变动数	226,123.74	250,421.96	476,545.70
其中：基金申购款	-81,275.78	-19,684.10	-100,959.88
基金赎回款	307,399.52	270,106.06	577,505.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,583,674.24	-1,853,317.01	-12,436,991.25

博时量化价值股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日			
本期利润	-970,463.20	-298,573.85	-1,269,037.05
本期基金份额交易产生的变动数	-231,526.99	95,520.37	-136,006.62
其中：基金申购款	-126,243.58	-5,854.25	-132,097.83
基金赎回款	-105,283.41	101,374.62	-3,908.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,201,990.19	-203,053.48	-1,405,043.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
活期存款利息收入	194,822.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,187.35
其他	253.49
合计	204,263.52

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出股票成交总额	429,089,263.86
减：卖出股票成本总额	439,681,292.84
买卖股票差价收入	-10,592,028.98

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	854,048.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	814,000.00
减：应收利息总额	517.39
买卖债券差价收入	39,531.41

7.4.7.14 衍生工具收益

无发生额。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	196,779.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	196,779.80

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,402,312.82
——股票投资	-2,406,298.42
——债券投资	3,985.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	-2,402,312.82

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
基金赎回费收入	920,847.35
基金转换费收入	203.16
合计	921,050.51

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
交易所市场交易费用	1,398,949.45
银行间市场交易费用	-
合计	1,398,949.45

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	150,000.00
银行汇划费	6,863.59

中债登帐户维护费	3,000.00
其他	400.00
合计	200,263.59

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人股东
博时资本管理有限公司	基金管理人子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	55,570,713.48	5.82%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	51,755.18	5.85%	51,755.18	8.43%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,019,479.75
其中：支付销售机构的客户维护费	410,676.39

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月26日（基金合同生效日）至2018年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	169,913.31

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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		
	2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
中国农业银行	-	7,545.87	7,545.87
博时基金	-	1,775.69	1,775.69
招商证券	-	6,964.12	6,964.12
合计	-	16,285.68	16,285.68

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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	
	2018 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	6,284,948.55	194,822.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 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（2018 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

无。

7.4.12.2 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
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项停牌	16.01	2019-01-10	17.15	13,800.00	233,687.48	220,938.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止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股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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行农业银行，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均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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.21%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

本基金主要投资于上市交易的证券除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期

日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,284,948.55	-	-	-	6,284,948.55
结算备付金	1,137,395.57	-	-	-	1,137,395.57
存出保证金	65,326.95	-	-	-	65,326.95
交易性金融资产	-	-	191,985.60	83,805,431.05	83,997,416.65
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,097.97	2,097.97
应收申购款	-	-	-	23,518.93	23,518.93
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,487,671.07	-	191,985.60	83,831,047.95	91,510,704.62
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	260,343.99	260,343.99
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	121,504.10	121,504.10

应付托管费	-	-	-	20,250.69	20,250.69
应付销售服务费	-	-	-	6,089.03	6,089.03
应交税费	-	-	-	2.09	2.09
应付交易费用	-	-	-	613,960.81	613,960.81
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	190,001.43	190,001.43
负债总计	-	-	-	1,212,152.14	1,212,152.14
利率敏感度缺口	7,487,671.07	-	191,985.60	82,618,895.81	90,298,552.48

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资或持有的交易性债券投资占比并不重大，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	83,805,431.05	92.81
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	191,985.60	0.21
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	83,997,416.65	93.02

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 83,776,478.65 元，属于第二层次的余额为人民币 220,938.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期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，在第一层次和第二层次之间无重大转换。本基金本报告期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未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	83,805,431.05	91.58
	其中：股票	83,805,431.05	91.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	191,985.60	0.21
	其中：债券	191,985.60	0.21
	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	7,422,344.12	8.11
8	其他各项资产	90,943.85	0.10
9	合计	91,510,704.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,401,009.00	1.55
C	制造业	58,707,695.08	65.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	781,975.00	0.87
E	建筑业	2,730,056.00	3.02
F	批发和零售业	4,271,359.77	4.73
G	交通运输、仓储和邮政业	1,064,049.00	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,258,343.00	1.39
J	金融业	5,835,233.30	6.46
K	房地产业	6,085,372.90	6.74
L	租赁和商务服务业	525,977.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	487,364.00	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	401,940.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	150,612.00	0.17
Q	卫生和社会工作	104,445.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	83,805,431.05	92.81

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	600782	新钢股份	458,700	2,334,783.00	2.59
2	600282	南钢股份	491,700	1,681,614.00	1.86
3	601003	柳钢股份	254,100	1,669,437.00	1.85

4	600808	马钢股份	481,800	1,667,028.00	1.85
5	600569	安阳钢铁	534,600	1,619,838.00	1.79
6	000789	万年青	133,100	1,449,459.00	1.61
7	600801	华新水泥	84,900	1,419,528.00	1.57
8	600755	厦门国贸	187,700	1,310,146.00	1.45
9	600507	方大特钢	113,300	1,131,867.00	1.25
10	002110	三钢闽光	88,000	1,125,520.00	1.25
11	601318	中国平安	19,800	1,110,780.00	1.23
12	601997	贵阳银行	97,900	1,045,572.00	1.16
13	600966	博汇纸业	325,400	1,021,756.00	1.13
14	600708	光明地产	281,610	982,818.90	1.09
15	600230	沧州大化	59,400	959,310.00	1.06
16	600623	华谊集团	118,500	957,480.00	1.06
17	600585	海螺水泥	27,300	799,344.00	0.89
18	601717	郑煤机	138,000	763,140.00	0.85
19	600376	首开股份	106,100	762,859.00	0.84
20	600426	华鲁恒升	62,700	756,789.00	0.84
21	600019	宝钢股份	112,200	729,300.00	0.81
22	600997	开滦股份	122,000	691,740.00	0.77
23	002233	塔牌集团	68,200	686,092.00	0.76
24	600596	新安股份	61,600	658,504.00	0.73
25	000830	鲁西化工	67,100	657,580.00	0.73
26	000898	鞍钢股份	127,700	655,101.00	0.73
27	600606	绿地控股	106,300	649,493.00	0.72
28	600308	华泰股份	148,500	645,975.00	0.72
29	002078	太阳纸业	112,200	639,540.00	0.71
30	000932	华菱钢铁	104,500	633,270.00	0.70
31	600188	兖州煤业	71,500	627,770.00	0.70
32	002367	康力电梯	112,200	624,954.00	0.69
33	000825	太钢不锈	150,700	623,898.00	0.69
34	600231	凌钢股份	232,100	619,707.00	0.69
35	603355	莱克电气	28,500	612,750.00	0.68
36	600581	八一钢铁	171,600	610,896.00	0.68
37	601166	兴业银行	40,800	609,552.00	0.68
38	600873	梅花生物	137,700	581,094.00	0.64
39	600519	贵州茅台	900	531,009.00	0.59
40	300403	地尔汉宇	105,600	530,112.00	0.59
41	300625	三雄极光	37,400	526,218.00	0.58
42	000631	顺发恒业	176,000	522,720.00	0.58
43	000550	江铃汽车	40,700	519,332.00	0.58
44	600016	民生银行	90,600	519,138.00	0.57
45	000036	华联控股	93,500	515,185.00	0.57
46	601636	旗滨集团	135,300	514,140.00	0.57

47	600664	哈药股份	129,800	512,710.00	0.57
48	600829	人民同泰	86,900	506,627.00	0.56
49	000635	英力特	59,400	504,900.00	0.56
50	002503	搜于特	214,500	504,075.00	0.56
51	300512	中亚股份	41,800	501,600.00	0.56
52	600516	方大炭素	29,700	496,287.00	0.55
53	600816	安信信托	110,000	480,700.00	0.53
54	000981	银亿股份	147,400	459,888.00	0.51
55	000863	三湘印象	114,400	447,304.00	0.50
56	002838	道恩股份	25,300	443,509.00	0.49
57	603617	君禾股份	26,400	438,240.00	0.49
58	000651	格力电器	12,200	435,418.00	0.48
59	300172	中电环保	77,000	401,940.00	0.45
60	300577	开润股份	12,100	377,278.00	0.42
61	002832	比音勒芬	11,000	367,400.00	0.41
62	000633	合金投资	79,500	364,905.00	0.40
63	603326	我乐家居	31,900	357,280.00	0.40
64	300391	康跃科技	36,300	352,836.00	0.39
65	601677	明泰铝业	39,700	348,963.00	0.39
66	300421	力星股份	27,500	347,875.00	0.39
67	603601	再升科技	45,100	344,113.00	0.38
68	600992	贵绳股份	49,500	342,540.00	0.38
69	603388	元成股份	34,100	342,364.00	0.38
70	002576	通达动力	34,100	342,023.00	0.38
71	002587	奥拓电子	70,315	341,730.90	0.38
72	000002	万科 A	14,300	340,626.00	0.38
73	603007	花王股份	42,900	340,626.00	0.38
74	600513	联环药业	57,200	340,340.00	0.38
75	300427	红相股份	30,800	340,032.00	0.38
76	600647	同达创业	28,600	339,768.00	0.38
77	603887	城地股份	24,200	339,284.00	0.38
78	000906	浙商中拓	69,293	338,842.77	0.38
79	000715	中兴商业	58,300	338,723.00	0.38
80	600356	恒丰纸业	61,600	338,184.00	0.37
81	600051	宁波联合	62,700	337,953.00	0.37
82	300492	山鼎设计	17,600	337,744.00	0.37
83	002753	永东股份	37,400	337,348.00	0.37
84	601328	交通银行	58,200	336,978.00	0.37
85	603960	克来机电	12,100	336,138.00	0.37
86	300341	麦迪电气	71,500	336,050.00	0.37
87	000153	丰原药业	64,900	334,235.00	0.37
88	300437	清水源	28,600	334,048.00	0.37
89	300121	阳谷华泰	39,100	333,914.00	0.37

90	600599	熊猫金控	32,930	332,922.30	0.37
91	002660	茂硕电源	56,100	331,551.00	0.37
92	603725	天安新材	29,700	331,452.00	0.37
93	300721	怡达股份	16,500	331,320.00	0.37
94	603813	原尚股份	17,600	325,600.00	0.36
95	600796	钱江生化	62,700	324,159.00	0.36
96	603028	赛福天	44,000	320,760.00	0.36
97	603737	三棵树	8,800	319,968.00	0.35
98	300345	红宇新材	88,000	306,240.00	0.34
99	600515	海航基础	64,300	302,853.00	0.34
100	600031	三一重工	36,100	301,074.00	0.33
101	000538	云南白药	3,700	273,652.00	0.30
102	002415	海康威视	10,400	267,904.00	0.30
103	600389	江山股份	15,506	261,121.04	0.29
104	601989	中国重工	61,300	260,525.00	0.29
105	002468	申通快递	15,400	253,330.00	0.28
106	603359	东珠生态	15,400	252,252.00	0.28
107	601668	中国建筑	44,200	251,940.00	0.28
108	002313	日海智能	11,000	248,380.00	0.28
109	002318	久立特材	38,600	244,724.00	0.27
110	002546	新联电子	64,900	244,673.00	0.27
111	600900	长江电力	15,300	242,964.00	0.27
112	600104	上汽集团	9,100	242,697.00	0.27
113	002168	深圳惠程	24,200	239,338.00	0.27
114	002230	科大讯飞	9,700	239,008.00	0.26
115	000625	长安汽车	36,100	237,899.00	0.26
116	600248	延长化建	60,100	234,991.00	0.26
117	600582	天地科技	67,100	229,482.00	0.25
118	600030	中信证券	13,800	220,938.00	0.24
119	600926	杭州银行	29,800	220,520.00	0.24
120	600269	赣粤高速	56,400	219,960.00	0.24
121	600919	江苏银行	36,800	219,696.00	0.24
122	600015	华夏银行	29,600	218,744.00	0.24
123	600823	世茂股份	57,700	216,952.00	0.24
124	000926	福星股份	35,400	216,648.00	0.24
125	600657	信达地产	54,600	214,578.00	0.24
126	000521	长虹美菱	71,423	211,412.08	0.23
127	000001	平安银行	22,300	209,174.00	0.23
128	603606	东方电缆	23,400	208,962.00	0.23
129	600050	中国联通	40,300	208,351.00	0.23
130	600000	浦发银行	21,200	207,760.00	0.23
131	002585	双星新材	40,600	207,060.00	0.23
132	000778	新兴铸管	48,000	206,880.00	0.23

133	002387	维信诺	26,975	205,549.50	0.23
134	000980	众泰汽车	46,613	201,834.29	0.22
135	600751	海航科技	73,900	200,269.00	0.22
136	600160	巨化股份	30,000	198,900.00	0.22
137	600436	片仔癀	2,200	190,630.00	0.21
138	000572	海马汽车	84,500	179,985.00	0.20
139	000620	新华联	45,300	177,123.00	0.20
140	002697	红旗连锁	33,100	169,803.00	0.19
141	600811	东方集团	44,700	163,602.00	0.18
142	002608	江苏国信	20,900	159,885.00	0.18
143	600764	中国海防	6,600	157,344.00	0.17
144	600661	昂立教育	7,700	150,612.00	0.17
145	000923	河北宣工	11,000	149,600.00	0.17
146	600167	联美控股	16,500	149,160.00	0.17
147	002621	三垒股份	8,800	149,072.00	0.17
148	603816	顾家家居	3,300	148,500.00	0.16
149	002126	银轮股份	19,800	147,312.00	0.16
150	600675	中华企业	26,400	147,312.00	0.16
151	600388	龙净环保	14,300	145,145.00	0.16
152	600761	安徽合力	16,500	144,375.00	0.16
153	002093	国脉科技	19,800	144,342.00	0.16
154	601766	中国中车	16,000	144,320.00	0.16
155	600567	山鹰纸业	46,200	144,144.00	0.16
156	603558	健盛集团	13,200	143,220.00	0.16
157	603997	继峰股份	18,700	143,055.00	0.16
158	300231	银信科技	22,000	143,000.00	0.16
159	002486	嘉麟杰	37,400	142,868.00	0.16
160	000918	嘉凯城	18,700	142,494.00	0.16
161	600830	香溢融通	29,700	142,263.00	0.16
162	300193	佳士科技	19,800	142,164.00	0.16
163	603008	喜临门	15,400	141,988.00	0.16
164	300207	欣旺达	16,500	141,735.00	0.16
165	600162	香江控股	64,900	141,482.00	0.16
166	002637	赞宇科技	19,800	141,372.00	0.16
167	000723	美锦能源	44,000	141,240.00	0.16
168	300102	乾照光电	24,200	141,086.00	0.16
169	000680	山推股份	42,821	140,024.67	0.16
170	002062	宏润建设	36,300	139,392.00	0.15
171	000703	恒逸石化	12,100	139,392.00	0.15
172	002111	威海广泰	14,300	139,282.00	0.15
173	603777	来伊份	14,300	137,709.00	0.15
174	600172	黄河旋风	45,100	137,555.00	0.15
175	002374	丽鹏股份	45,100	137,104.00	0.15

176	603533	掌阅科技	7,700	136,906.00	0.15
177	600438	通威股份	16,500	136,620.00	0.15
178	002404	嘉欣丝绸	25,300	135,355.00	0.15
179	000065	北方国际	17,600	135,168.00	0.15
180	300219	鸿利智汇	17,600	134,816.00	0.15
181	600028	中国石化	26,600	134,330.00	0.15
182	002536	西泵股份	14,300	132,561.00	0.15
183	002685	华东重机	26,800	131,856.00	0.15
184	600637	东方明珠	12,400	126,976.00	0.14
185	600009	上海机场	2,400	121,824.00	0.13
186	601006	大秦铁路	14,500	119,335.00	0.13
187	600406	国电南瑞	6,400	118,592.00	0.13
188	300676	华大基因	1,900	114,000.00	0.13
189	601899	紫金矿业	33,600	112,224.00	0.12
190	002482	广田集团	19,200	111,168.00	0.12
191	601619	嘉泽新能	23,200	107,880.00	0.12
192	601933	永辉超市	13,700	107,819.00	0.12
193	000158	常山北明	20,600	107,532.00	0.12
194	600079	人福医药	10,600	107,484.00	0.12
195	600466	蓝光发展	19,800	106,524.00	0.12
196	002595	豪迈科技	6,600	105,600.00	0.12
197	000100	TCL 集团	43,100	105,595.00	0.12
198	002372	伟星新材	6,800	105,468.00	0.12
199	002408	齐翔腾达	15,400	105,336.00	0.12
200	000525	红太阳	7,500	105,225.00	0.12
201	002206	海利得	27,500	104,775.00	0.12
202	300657	弘信电子	3,600	104,760.00	0.12
203	000516	国际医学	21,100	104,445.00	0.12
204	002470	金正大	16,500	104,280.00	0.12
205	601155	新城控股	4,400	104,236.00	0.12
206	601238	广汽集团	10,100	103,929.00	0.12
207	002003	伟星股份	14,800	103,896.00	0.12
208	002384	东山精密	9,200	103,868.00	0.12
209	603025	大豪科技	9,300	103,695.00	0.11
210	600535	天士力	5,400	103,680.00	0.11
211	603456	九洲药业	16,260	103,413.60	0.11
212	300415	伊之密	17,000	103,020.00	0.11
213	002138	顺络电子	7,400	102,416.00	0.11
214	603811	诚意药业	6,300	102,249.00	0.11
215	002718	友邦吊顶	3,700	102,120.00	0.11
216	300342	天银机电	14,400	101,952.00	0.11
217	002818	富森美	4,900	101,871.00	0.11
218	300308	中际旭创	2,500	101,725.00	0.11

219	002029	七匹狼	16,400	101,680.00	0.11
220	002884	凌霄泵业	4,900	101,577.00	0.11
221	603600	永艺股份	14,500	101,500.00	0.11
222	603877	太平鸟	5,400	101,466.00	0.11
223	603968	醋化股份	8,000	101,120.00	0.11
224	600521	华海药业	9,100	100,646.00	0.11
225	300301	长方集团	27,600	100,464.00	0.11
226	002831	裕同科技	2,500	100,150.00	0.11
227	600387	海越能源	12,700	99,822.00	0.11
228	600512	腾达建设	46,400	99,760.00	0.11
229	002589	瑞康医药	14,300	99,671.00	0.11
230	002583	海能达	12,600	99,414.00	0.11
231	002164	宁波东力	36,400	98,280.00	0.11
232	603843	正平股份	12,600	98,280.00	0.11
233	002004	华邦健康	21,300	98,193.00	0.11
234	600309	万华化学	3,500	97,965.00	0.11
235	300237	美晨生态	26,900	97,647.00	0.11
236	600760	中航沈飞	3,500	96,985.00	0.11
237	601818	光大银行	26,200	96,940.00	0.11
238	600201	生物股份	5,800	96,280.00	0.11
239	300702	天宇股份	4,400	96,140.00	0.11
240	601857	中国石油	13,300	95,893.00	0.11
241	300153	科泰电源	13,300	95,627.00	0.11
242	002541	鸿路钢构	13,500	94,770.00	0.10
243	600340	华夏幸福	3,700	94,165.00	0.10
244	002310	东方园林	13,400	93,264.00	0.10
245	300568	星源材质	4,000	88,760.00	0.10
246	600703	三安光电	7,600	85,956.00	0.10
247	000709	河钢股份	29,500	83,780.00	0.09
248	000425	徐工机械	25,600	82,688.00	0.09
249	601958	金铝股份	13,800	81,696.00	0.09
250	600482	中国动力	3,500	77,945.00	0.09
251	300389	艾比森	4,800	75,024.00	0.08
252	603993	洛阳钼业	19,300	72,568.00	0.08
253	002430	杭氧股份	7,700	71,995.00	0.08
254	000676	智度股份	7,500	71,175.00	0.08
255	300047	天源迪科	6,300	69,993.00	0.08
256	300058	蓝色光标	15,900	69,006.00	0.08
257	601088	中国神华	3,800	68,248.00	0.08
258	000999	华润三九	2,500	62,150.00	0.07
259	600062	华润双鹤	5,000	60,450.00	0.07
260	600415	小商品城	17,300	60,377.00	0.07
261	002419	天虹股份	5,500	60,335.00	0.07

262	603708	家家悦	3,000	60,270.00	0.07
263	600123	兰花科创	9,000	58,680.00	0.06
264	000157	中联重科	16,200	57,672.00	0.06
265	002478	常宝股份	12,500	57,500.00	0.06
266	002391	长青股份	5,400	56,970.00	0.06
267	601117	中国化学	10,600	56,816.00	0.06
268	601888	中国国旅	900	54,180.00	0.06
269	600984	建设机械	8,900	45,123.00	0.05
270	000767	漳泽电力	17,700	43,719.00	0.05
271	002083	孚日股份	8,800	43,384.00	0.05
272	002394	联发股份	4,000	40,320.00	0.04
273	000598	兴蓉环境	9,300	37,479.00	0.04
274	600351	亚宝药业	6,500	36,595.00	0.04
275	002449	国星光电	3,500	36,330.00	0.04
276	002116	中国海诚	5,200	35,620.00	0.04
277	002225	濮耐股份	7,900	34,918.00	0.04
278	600233	圆通速递	2,400	24,000.00	0.03
279	600660	福耀玻璃	1,000	22,780.00	0.03
280	600886	国投电力	2,800	22,540.00	0.02
281	601908	京运通	6,700	21,105.00	0.02
282	601158	重庆水务	3,300	18,348.00	0.02
283	600973	宝胜股份	3,800	13,756.00	0.02
284	601398	工商银行	1,100	5,819.00	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	13,675,003.72	15.14
2	601668	中国建筑	7,811,037.62	8.65
3	601186	中国铁建	7,470,916.35	8.27
4	000001	平安银行	6,972,882.91	7.72
5	601336	新华保险	6,964,503.00	7.71
6	601328	交通银行	6,774,612.00	7.50
7	600028	中国石化	6,718,270.40	7.44
8	601998	中信银行	6,602,771.28	7.31
9	601169	北京银行	6,456,385.02	7.15
10	600048	保利地产	6,193,189.12	6.86
11	002142	宁波银行	6,068,497.11	6.72
12	600585	海螺水泥	6,039,258.94	6.69
13	601166	兴业银行	5,931,347.97	6.57

14	601601	中国太保	5,726,871.00	6.34
15	000002	万科 A	5,641,632.04	6.25
16	600755	厦门国贸	5,226,019.00	5.79
17	600019	宝钢股份	5,008,526.80	5.55
18	600606	绿地控股	4,682,295.00	5.19
19	600782	新钢股份	4,670,029.00	5.17
20	601009	南京银行	4,435,594.00	4.91
21	601857	中国石油	4,404,420.00	4.88
22	600340	华夏幸福	4,400,133.90	4.87
23	600291	西水股份	4,348,983.31	4.82
24	600926	杭州银行	4,329,160.54	4.79
25	600015	华夏银行	4,233,094.00	4.69
26	000627	天茂集团	4,213,065.30	4.67
27	600823	世茂股份	4,099,935.00	4.54
28	600569	安阳钢铁	4,057,979.00	4.49
29	601838	成都银行	3,881,715.50	4.30
30	600801	华新水泥	3,851,241.00	4.27
31	000789	万年青	3,806,684.06	4.22
32	600376	首开股份	3,795,461.00	4.20
33	601997	贵阳银行	3,737,997.00	4.14
34	600743	华远地产	3,702,612.00	4.10
35	600016	民生银行	3,564,772.00	3.95
36	600864	哈投股份	3,487,227.92	3.86
37	000625	长安汽车	3,484,925.00	3.86
38	000830	鲁西化工	3,481,370.23	3.86
39	000926	福星股份	3,436,630.00	3.81
40	600269	赣粤高速	3,431,446.00	3.80
41	601398	工商银行	3,377,950.00	3.74
42	600000	浦发银行	3,345,623.00	3.71
43	600657	信达地产	3,184,670.60	3.53
44	600919	江苏银行	3,179,229.00	3.52
45	000521	长虹美菱	3,112,376.99	3.45
46	600519	贵州茅台	3,060,799.00	3.39
47	002110	三钢闽光	3,050,678.85	3.38
48	601003	柳钢股份	3,038,407.00	3.36
49	601229	上海银行	2,984,851.06	3.31
50	600030	中信证券	2,867,896.00	3.18
51	000572	海马汽车	2,860,830.00	3.17
52	600418	江淮汽车	2,848,985.00	3.16
53	603993	洛阳钼业	2,841,429.00	3.15
54	601390	中国中铁	2,515,686.00	2.79
55	002233	塔牌集团	2,487,564.00	2.75
56	600567	山鹰纸业	2,461,064.00	2.73

57	600515	海航基础	2,452,962.00	2.72
58	600837	海通证券	2,447,441.98	2.71
59	002146	荣盛发展	2,339,041.05	2.59
60	000651	格力电器	2,289,330.00	2.54
61	600808	马钢股份	2,269,091.00	2.51
62	601988	中国银行	2,261,881.00	2.50
63	601211	国泰君安	2,166,367.73	2.40
64	601888	中国国旅	2,130,788.00	2.36
65	601818	光大银行	2,088,186.96	2.31
66	600623	华谊集团	2,041,957.91	2.26
67	600507	方大特钢	2,038,401.00	2.26
68	600751	海航科技	2,017,258.00	2.23
69	600708	光明地产	1,949,238.28	2.16
70	000980	众泰汽车	1,859,609.00	2.06
71	600426	华鲁恒升	1,851,444.92	2.05
72	002387	维信诺	1,831,127.32	2.03
73	000333	美的集团	1,815,848.00	2.01
74	600031	三一重工	1,807,612.67	2.00

注：本项的“买入金额”均按成交金额（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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	12,703,079.39	14.07
2	601186	中国铁建	7,341,584.21	8.13
3	601668	中国建筑	7,198,786.24	7.97
4	601336	新华保险	6,820,119.75	7.55
5	000001	平安银行	6,656,837.12	7.37
6	601169	北京银行	6,463,420.00	7.16
7	601998	中信银行	6,429,440.41	7.12
8	601328	交通银行	6,428,590.00	7.12
9	002142	宁波银行	6,151,484.58	6.81
10	600028	中国石化	6,149,578.00	6.81
11	600048	保利地产	5,842,367.32	6.47
12	601601	中国太保	5,409,821.00	5.99
13	601166	兴业银行	5,212,465.56	5.77
14	000002	万科 A	5,026,616.80	5.57
15	600585	海螺水泥	4,890,893.60	5.42
16	601009	南京银行	4,440,708.11	4.92
17	601857	中国石油	4,241,590.40	4.70

18	600019	宝钢股份	4,168,278.00	4.62
19	000627	天茂集团	4,096,996.02	4.54
20	600926	杭州银行	4,052,391.19	4.49
21	600340	华夏幸福	3,926,908.68	4.35
22	600015	华夏银行	3,924,014.44	4.35
23	600606	绿地控股	3,840,231.20	4.25
24	601838	成都银行	3,780,782.01	4.19
25	600755	厦门国贸	3,747,640.47	4.15
26	600291	西水股份	3,727,323.00	4.13
27	600823	世茂股份	3,711,288.00	4.11
28	600743	华远地产	3,623,564.00	4.01
29	600864	哈投股份	3,331,053.54	3.69
30	601398	工商银行	3,305,789.00	3.66
31	600000	浦发银行	3,068,772.77	3.40
32	600269	赣粤高速	3,060,211.00	3.39
33	000625	长安汽车	3,051,147.12	3.38
34	000926	福星股份	3,017,070.57	3.34
35	600376	首开股份	2,994,273.65	3.32
36	600418	江淮汽车	2,914,114.00	3.23
37	600016	民生银行	2,900,224.00	3.21
38	600657	信达地产	2,833,248.75	3.14
39	601229	上海银行	2,830,419.00	3.13
40	600919	江苏银行	2,818,941.00	3.12
41	600030	中信证券	2,785,026.00	3.08
42	000521	长虹美菱	2,782,709.00	3.08
43	601997	贵阳银行	2,699,285.05	2.99
44	000572	海马汽车	2,642,587.00	2.93
45	600837	海通证券	2,582,505.67	2.86
46	000830	鲁西化工	2,579,154.13	2.86
47	603993	洛阳钼业	2,571,144.00	2.85
48	002146	荣盛发展	2,514,432.86	2.78
49	600519	贵州茅台	2,482,899.00	2.75
50	601390	中国中铁	2,418,642.00	2.68
51	601888	中国国旅	2,345,165.83	2.60
52	000789	万年青	2,275,297.78	2.52
53	600567	山鹰纸业	2,258,460.00	2.50
54	601988	中国银行	2,244,296.00	2.49
55	600801	华新水泥	2,227,977.48	2.47
56	601211	国泰君安	2,200,969.96	2.44
57	600569	安阳钢铁	2,126,993.00	2.36
58	600782	新钢股份	2,033,240.00	2.25
59	600515	海航基础	1,951,749.00	2.16
60	601818	光大银行	1,902,179.86	2.11

注：本项的“卖出金额”均按成交金额（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	525,893,022.31
卖出股票的收入（成交）总额	429,089,263.86

注：本项“买入股票成本”“卖出股票成本”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	-	-
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）	191,985.60	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	191,985.60	0.21

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	110046	圆通转债	1,880	191,985.60	0.21

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除三钢闽光（002110）外，没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018年9月26日，福建三钢闽光股份有限公司发布公告称，因违反《上市公司信息披露管理办法》的相关规定，福建证监局对其处以出具警示函的行政监管措施。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	65,326.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,097.97
5	应收申购款	23,518.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,943.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
博时量化价 值股票 A	2,241	41,867.81	-	-	93,825,753.15	100.00%
博时量化价 值股票 C	347	29,725.75	-	-	10,314,834.25	100.00%
合计	2,588	40,239.79	-	-	104,140,587.40	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持 有本基金	博时量化价值股票 A	166,021.51	0.18%
	博时量化价值股票 C	15,145.04	0.15%
	合计	181,166.55	0.17%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	-
	博时量化价值股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开 放式基金	博时量化价值股票 A	10~50
	博时量化价值股票 C	-
	合计	10~50

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开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 26 日）基金份额总额	177,981,219.30	163,210,681.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,717,520.10	2,536,088.95
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	86,872,986.25	155,431,935.99
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	93,825,753.15	10,314,834.25

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。基金托管人中国农业银行总行聘任刘琳同志、李智同志为托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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。本报告期内本基金应付审计费 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

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	
申万宏源	1	282,465,607.16	29.59%	263,065.82	29.72%	新增 1 个
中金公司	1	227,686,990.90	23.85%	212,038.68	23.96%	新增 1 个
银河证券	1	128,112,360.64	13.42%	119,314.68	13.48%	-
光大证券	1	124,044,945.43	12.99%	115,525.17	13.05%	新增 1 个
国信证券	1	116,978,429.03	12.25%	108,949.67	12.31%	新增 1 个
招商证券	1	55,570,713.48	5.82%	51,755.18	5.85%	新增 1 个
华泰证券	1	19,810,577.93	2.08%	14,488.53	1.64%	-

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	854,048.80	100.00%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	678,500,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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	关于博时旗下部分开放式基金增加北京百度百盈基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-28
2	20181228 关于博时旗下部分基金参加工行定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-28
3	关于博时旗下部分开放式基金增加上海联泰资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-12
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司基金业务双十二费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-11
5	关于博时旗下部分开放式基金增加嘉实财富管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-12-10
6	关于博时旗下部分开放式基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-11-26
7	关于博时旗下部分开放式基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-11-21
8	博时量化价值股票型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-10-25
9	关于博时旗下部分开放式基金增加中民财富基金销售（上海）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-09-27
10	关于博时旗下部分开放式基金增加南京途牛金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-08-23
11	20180629 关于工商银行开通办理博时量化价值股票基金定投及转换业务并参加其定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-29
12	博时量化价值股票型证券投资基金 2018 年境外主要市场节假日、非港股通交易日暂停申购赎回等交易类业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-28
13	博时量化价值股票型证券投资基金开放日常转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-28
14	20180628 关于博时量化价值股票型证券投资基金 A 类参加部分代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-28

15	博时量化价值股票型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-28
16	博时量化价值股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-27
17	20180622 关于博时旗下部分基金增加华融湘江银行为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-22
18	20180622 关于博时量化价值股票基金 C 类增加瑞丰农商银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-22
19	关于博时量化价值基金增加部分券商渠道为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-20
20	关于博时量化价值基金新增海通证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-15
21	20180611 关于博时量化价值股票基金增加浙商银行作为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-11
22	关于博时量化价值基金新增光大证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-06
23	20180605 关于博时量化价值股票基金 A 类增加瑞丰农商银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-05
24	20180601 关于博时量化价值股票型基金增加部分渠道为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-01
25	关于博时量化价值基金增加部分券商渠道为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-06-01
26	博时量化价值股票型证券投资基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-11
27	博时量化价值股票型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-11
28	博时量化价值股票型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-11
29	博时量化价值股票型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2018-05-11

§ 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

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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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

客户服务中心电话：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇一九年三月二十九日