

博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混
合型证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 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	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43

7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.4 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	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	博时研究优选混合	
场内简称	研究优选	
基金主代码	160527	
交易代码	160527	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 20 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,127,289,243.57 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2020 年 6 月 19 日	
下属分级基金的基金简称	博时研究优选混合 A	博时研究优选混合 C
下属分级基金的交易代码	160527	160528
报告期末下属分级基金的份额总额	2,054,177,183.06 份	73,112,060.51 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持价值投资理念，充分发挥专业研究与精选个股能力，力争组合资产实现长期稳健的增值。
投资策略	本基金为灵活配置混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，资产配置策略主要是通过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，股票投资策略包括行业选择和个股选择，在行业选择层面，主要是结合宏观和政策环境判断，形成行业配置思路。在个股投资层面，本基金将坚持估值与成长相结合，对企业基本面和长期竞争力进行严格评判。其他资产投资策略有债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资业务的投资策略、流通受限证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times$ 60% + 恒生指数收益率 $\times$ 20% + 中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。 本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	许俊
	联系电话	0755-83169999	010-66594319
	电子邮箱	service@bosera.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594942
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		江向阳	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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、基金托管人住所

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	北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

§ 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	博时研究优选混合 A	博时研究优选混合 C
本期已实现收益	120,670,009.07	3,930,433.89
本期利润	84,274,278.05	2,636,418.56
加权平均基金份额本期利润	0.0410	0.0361
本期加权平均净值利润率	3.51%	3.10%
本期基金份额净值增长率	3.63%	3.22%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时研究优选混合 A	博时研究优选混合 C
期末可供分配利润	125,496,108.72	3,803,277.31
期末可供分配基金份额利润	0.0611	0.0520
期末基金资产净值	2,387,601,053.64	84,278,245.62
期末基金份额净值	1.1623	1.1527
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	博时研究优选混合 A	博时研究优选混合 C
基金份额累计净值增长率	16.45%	15.27%

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

博时研究优选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.77%	1.15%	-1.10%	0.58%	2.87%	0.57%
过去三个月	4.05%	1.33%	2.40%	0.70%	1.65%	0.63%
过去六个月	3.63%	1.74%	1.75%	0.94%	1.88%	0.80%
过去一年	14.57%	1.38%	17.52%	0.94%	-2.95%	0.44%
自基金合同生效起至今	16.45%	1.23%	31.96%	0.95%	-15.51%	0.28%

博时研究优选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.70%	1.15%	-1.10%	0.58%	2.80%	0.57%
过去三个月	3.84%	1.33%	2.40%	0.70%	1.44%	0.63%
过去六个月	3.22%	1.74%	1.75%	0.94%	1.47%	0.80%
过去一年	13.67%	1.38%	17.52%	0.94%	-3.85%	0.44%
自基金合同生效起至今	15.27%	1.23%	31.96%	0.95%	-16.69%	0.28%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合财富(总值)指数收益率×20%。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 60%、20%、20%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。

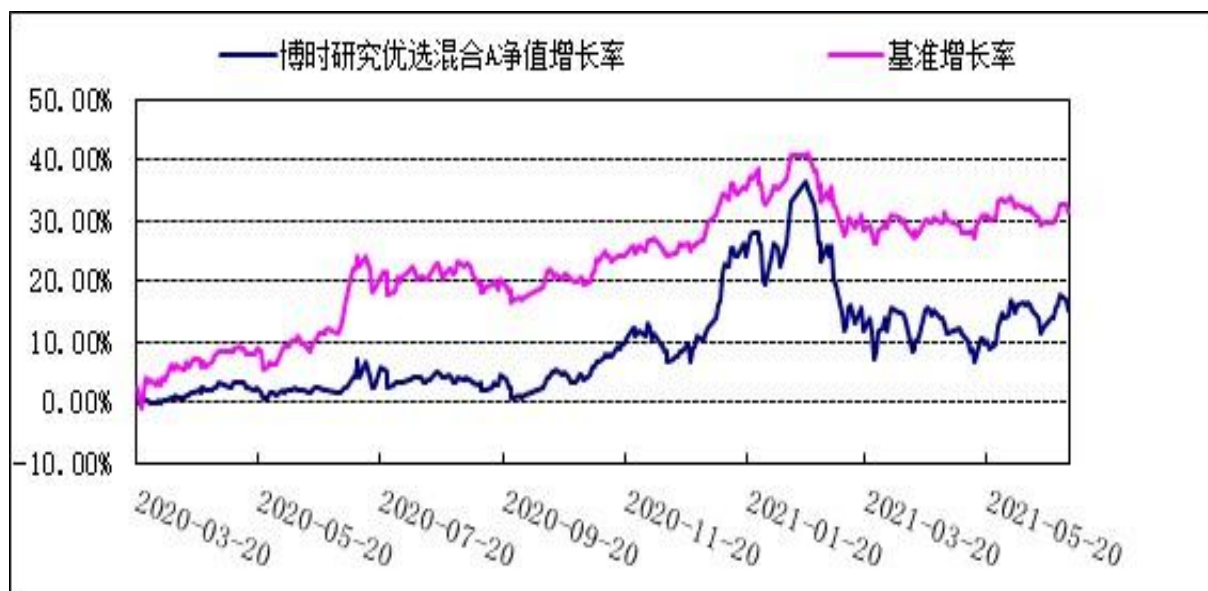
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

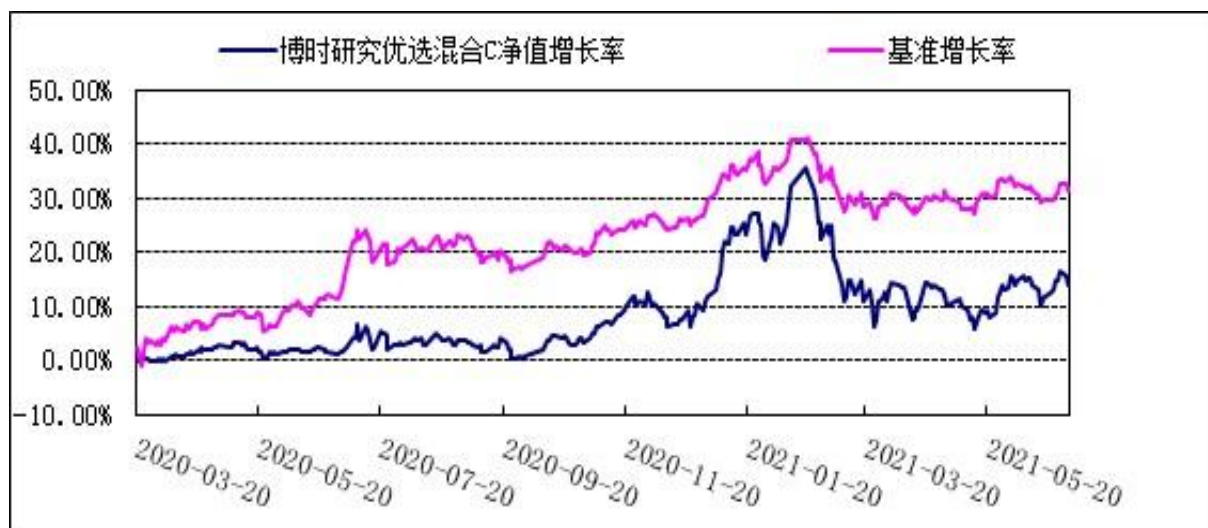
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 3 月 20 日至 2021 年 6 月 30 日)

博时研究优选混合 A



博时研究优选混合 C



注：本基金的基金合同于 2020 年 3 月 20 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“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。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。

§ 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 2021 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 276 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 15482 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 4383 亿元人民币，累计分红逾 1465 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许少波	基金经理	2021-01-20	-	16.6	许少波先生，硕士。1998 年起先后在宏仁企业集团、丰达电机有限公司、中邮创业基金、嘉实基金工作。2015 年加入博时基金管理有限公司。曾任投资经理。现任博时研究精选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金（2021 年 1 月 20 日一至今）、博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（2021 年 1 月 20 日一至今）的基金经理。
王俊	研究部研究总监/基金经理	2020-03-20	2021-01-20	13.2	王俊先生，硕士。2008 年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、金融地产与公用事业组组长、研究部副总经理兼金融地产与公用事业组组长、研究部总经理兼金融地产与公用事业组组长、博时国企改革主题股票型证券投资基金（2015 年 5 月 20 日-2016 年 6 月 8 日）、博时丝路主题股票型证券投资基金（2015 年 5 月 22 日-2016 年 6 月 8 日）、博时沪

					港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金(2017 年 1 月 25 日-2018 年 3 月 14 日)、博时沪港深成长企业混合型证券投资基金(2016 年 11 月 9 日-2019 年 6 月 10 日)的基金经理、研究部总经理、博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)(2015 年 1 月 22 日-2021 年 1 月 20 日)、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金(2016 年 11 月 9 日-2021 年 1 月 20 日)、博时新兴消费主题混合型证券投资基金(2017 年 6 月 5 日-2021 年 1 月 20 日)、博时优势企业 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2019 年 6 月 3 日-2021 年 1 月 20 日)、博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2021 年 1 月 20 日)、博时研究精选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 6 月 24 日-2021 年 1 月 20 日)、博时研究臻选三年持有期灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 6 月 30 日-2021 年 1 月 20 日)、博时价值臻选两年持有期灵活配置混合型证券投资基金(2020 年 7 月 29 日-2021 年 1 月 20 日)的基金经理、研究部研究总监。
吴鹏	基金经理	2020-10-28	-	5.2	吴鹏先生，硕士。2011 年至 2012 年参加大学生西部计划支教。2016 年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员兼基金经理助理。现任博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2020 年

					10 月 28 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 24 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

报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，A 股市场宽幅震荡，沪深 300 指数上涨 0.24%，上证指数上涨 3.40%，创业板指数上涨 17.22%，香港市场同样上涨，恒生指数下跌 5.86%，恒生中国企业指数下跌 0.70%。

从上半年来看，货币政策保持宽松，虽然局部区域偶发疫情，但是企业的经营活动及居民的日常出行活动都趋于正常，随着疫苗的接种，全球大部分国家的疫情得到控制，市场表现分化明显，新能源、半导体及医药等行业表现较好，而房地产、农林牧渔及家电行业表现落后。

我们上半年仓位保持稳定，结构上小幅调整，减持了家电行业，增加了半导体及消费电子等行业的配置，我们仍然坚持低换手率，优选具有竞争力的优质企业，在金融、可选消费、周期制造业

及电子行业等领域布局较多，行业方面，主要超配了化工、电子、有色及汽车行业，我们认为从性价比来看，这些行业可以挑选出较多的投资标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1623 元，份额累计净值为 1.1647 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1527 元，份额累计净值为 1.1527 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 3.63%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 3.22%，同期业绩基准增长率为 1.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，我们认为诸如地方政府、房地产以及一些大企业的风险暴露存在持续暴露压力，同时小微等微观个体仍旧有一定经营压力，整体政策仍旧会被该等压力而掣肘。而下半年的经济尽管仍具备一定韧性，但势头预计将有所放缓，前期处于弱势的消费、基建等领域目前仍旧不具备明显修复动力，而前期强势的出口、地产等方面持续性需要进一步观察，这些因素都会使得政策很难转向甚至在某些阶段可能重新有进一步放松的迹象。当然，尽管政策和经济的预期会不断反复，但我们认为政策及经济在该等环境下弹性在下降，因此后续投资重点方向仍旧是需要关注具体行业及公司，结合其自身产业和经营趋势的短中长期综合判断下，寻找其中的投资机会。

我们相信从长远来看，宏观经济带来的波动不会影响企业的长期价值，我们相信每一轮周期底部都是优秀管理层带领企业拉开与竞争对手的机会。我们也希望坚持我们的投资理念，因为在周期后期大多数人的投资行为容易发生变形，容易放弃以往的信念而去跟风，我们会抵抗市场因为情绪化造成的杀跌，并敢于在下跌中逐步买入。我们也做了一些仓位和结构的调整，虽然我们对我们持有公司的基本面有充足的信心，但部分公司的安全边际或预期收益空间已经不能满足我们的要求，我们减持了部分受成本影响较大的中游制造业，我们同时也在高端制造领域积极寻找投资机会，主要是机械制造及电子制造等行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好

的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2021 年 1 月 15 日发布公告，以 2020 年 12 月 31 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 0.0240 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	145,562,559.55	292,016,211.40
结算备付金		39,593,768.11	54,713,917.45
存出保证金		461,646.74	1,893,932.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,247,140,062.76	2,136,462,205.57
其中：股票投资		2,247,140,062.76	2,131,746,600.57
基金投资		-	-
债券投资		-	4,715,605.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		43,555,247.58	-
应收利息	6.4.7.5	38,722.20	54,887.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,476,352,006.94	2,485,141,154.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	89,619,882.16
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,016,521.22	2,957,361.56
应付托管费		502,753.53	492,893.57
应付销售服务费		54,870.09	53,910.06
应付交易费用	6.4.7.7	760,234.50	2,497,460.23
应交税费		96.61	13.54
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	138,231.73	97,700.00
负债合计		4,472,707.68	95,719,221.12
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	2,127,289,243.57	2,126,905,780.43
未分配利润	6.4.7.10	344,590,055.69	262,516,153.31
所有者权益合计		2,471,879,299.26	2,389,421,933.74
负债和所有者权益总计		2,476,352,006.94	2,485,141,154.86

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,127,289,243.57 份。其中 A 类基金份额净值 1.1623 元，基金份额总额 2,054,177,183.06 份；C 类基金份额净值 1.1527 元，基金份额总额 73,112,060.51 份。

6.2 利润表

会计主体：博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		112,421,682.31	48,421,966.13
1. 利息收入		594,305.06	7,216,671.29
其中：存款利息收入	6.4.3.11	570,746.76	1,374,593.18
债券利息收入		23,558.30	14.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	5,842,063.91
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		149,517,123.60	22,604,785.38
其中：股票投资收益	6.4.3.12	132,467,114.33	13,529,865.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.13.1	-37,399.98	13,653.64

资产支持证券投资收益	6.4.3.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	17,087,409.25	9,061,266.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-37,689,746.35	18,600,371.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	-	137.87
减：二、费用		25,510,985.70	13,802,784.10
1. 管理人报酬		18,556,319.81	9,038,001.01
2. 托管费		3,092,719.98	1,506,333.47
3. 销售服务费		338,029.81	165,518.94
4. 交易费用	6.4.3.18	3,361,566.65	3,040,256.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		84.85	0.05
7. 其他费用	6.4.3.19	162,264.60	52,674.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		86,910,696.61	34,619,182.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		86,910,696.61	34,619,182.03

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	2,126,905,780.43	262,516,153.31	2,389,421,933.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	86,910,696.61	86,910,696.61
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）	383,463.14	92,300.37	475,763.51
其中：1. 基金申购款	383,463.14	92,300.37	475,763.51
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-4,929,094.60	-4,929,094.60

号填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	2, 127, 289, 243. 57	344, 590, 055. 69	2, 471, 879, 299. 26
项目	上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 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）	2, 126, 905, 780. 43	—	2, 126, 905, 780. 43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	34, 619, 182. 03	34, 619, 182. 03
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）	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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）	2, 126, 905, 780. 43	34, 619, 182. 03	2, 161, 524, 962. 46

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：孙献，会计机构负责人：倡方方

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关

税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	145,562,559.55
定期存款	—
其他存款	—
合计	145,562,559.55

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,031,939,359.71	2,247,140,062.76	215,200,703.05
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		2,031,939,359.71	2,247,140,062.76	215,200,703.05

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	16,094.59
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	22,419.43
应收债券利息	—
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	-
应收黄金合约拆借孖息	-
应收出借证券利息	-
其他	208.18
合计	38,722.20

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	760,234.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	760,234.50

6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	138,231.73
合计	138,231.73

6.4.3.9 实收基金

博时研究优选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,053,793,719.92	2,053,793,719.92
本期申购	383,463.14	383,463.14
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,054,177,183.06	2,054,177,183.06

博时研究优选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	73,112,060.51	73,112,060.51

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	73,112,060.51	73,112,060.51

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

6.4.3.10 未分配利润

博时研究优选混合 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	9,752,860.49	244,233,526.27	253,986,386.76
本期利润	120,670,009.07	-36,395,731.02	84,274,278.05
本期基金份额交易产生的变动数	2,333.76	89,966.61	92,300.37
其中：基金申购款	2,333.76	89,966.61	92,300.37
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-4,929,094.60	-	-4,929,094.60
本期末	125,496,108.72	207,927,761.86	333,423,870.58

博时研究优选混合 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	-127,156.58	8,656,923.13	8,529,766.55
本期利润	3,930,433.89	-1,294,015.33	2,636,418.56
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,803,277.31	7,362,907.80	11,166,185.11

6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	134,448.30
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	429,931.99
其他	6,366.47
合计	570,746.76

6.4.3.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

卖出股票成交总额	1,149,856,463.08
减：卖出股票成本总额	1,017,389,348.75
买卖股票差价收入	132,467,114.33

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	141,680,075.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	141,648,205.75
减：应收利息总额	69,270.03
买卖债券差价收入	-37,399.98

6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,087,409.25
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	17,087,409.25

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-37,689,746.35
——股票投资	-36,024,141.35
——债券投资	-1,665,605.00

——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——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	-37,689,746.35

6.4.3.17 其他收入

无发生额。

6.4.3.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,361,566.65
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	3,361,566.65

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	14,732.87
上市费	29,752.78
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	162,264.60

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2021 年 7 月 14 日宣告 2021 年度的第 1 次分红，向截至 2021 年 7 月 16 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任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 0.3060 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.2610 元。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	1,431,411,246.51	62.08%	1,005,600,683.60	42.64%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

招商证券	128,714,936.20	45.92%	-	-
------	----------------	--------	---	---

6.4.6.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	9,743,000,000.00	40.62%

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	1,065,468.94	62.22%	701,172.31	92.23%
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	735,409.09	43.44%	735,409.09	49.61%

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,556,319.81	9,038,001.01
其中：支付销售机构的客户维护费	7,297,423.67	3,971,759.53

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,092,719.98	1,506,333.47

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时研究优选混 合 A	博时研究优选混合 C	合计
中国银行	-	5,305.82	5,305.82
博时基金	-	1,823.00	1,823.00
招商证券	-	115.65	115.65
合计	-	7,244.47	7,244.47
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时研究优选混 合 A	博时研究优选混合 C	合计
中国银行	-	2,597.96	2,597.96
招商证券	-	56.68	56.68
博时基金	-	892.47	892.47
合计	-	3,547.11	3,547.11

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

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

博时研究优选混合 A

份额单位：份

关联方名称	博时研究优选混合 A 本期末 2021 年 6 月 30 日		博时研究优选混合 A 上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例
招商证券	-	-	8,000,622.00	0.38%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国银行-活期存款	145,562,559.55	134,448.30	202,644,903.52	563,019.87

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。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

博时研究优选混合 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	2021-01-19	2021-01-19	0.0240	4,453,331.09	475,763.51	4,929,094.60	-
合计			0.0240	4,453,331.09	475,763.51	4,929,094.60	-

博时研究优选混合 C

无。

6.4.8 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券
6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	首次公开发行限售	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	首次公开发行限售	28.82	104.16	3,652.00	105,250.64	380,392.32	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	首次公开发行限售	47.33	251.96	853.00	40,372.49	214,921.88	-
688625	呈和科技	2021-05-31	2021-12-07	首次公开发行限售	16.48	42.63	2,672.00	44,034.56	113,907.36	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	首次公开发行限售	24.60	163.00	610.00	15,006.00	99,430.00	-
688682	霍莱沃	2021-04-13	2021-10-20	首次公开发行限售	45.72	103.85	946.00	43,251.12	98,242.10	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	首次公开发行限售	9.88	27.34	3,412.00	33,710.56	93,284.08	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	首次公开发行限售	7.72	19.11	3,493.00	26,965.96	66,751.23	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926.00	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	48.59	90.39	601.00	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	首次公开发行限售	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-	2021-0-	新股未上市	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-

		28	7-06	市						
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	首次公开发行限售	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	首次公开发行限售	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	首次公开发行限售	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	首次公开发行限售	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	-
300940	南 极 光	2021-01-27	2021-08-03	首次公开发行限售	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	首次公开发行限售	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药 易 购	2021-01-20	2021-07-27	首次公开发行限售	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢 乐 家	2021-05-26	2021-12-02	首次公开发行限售	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	首次公开发行限售	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	首次公开发行限售	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	首次公开发行限售	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	首次公开发行限售	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	首次公开发行限售	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼 卡 龙	2021-02-03	2021-08-10	首次公开发行限售	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	首次公开发行限售	8.67	27.42	324.00	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	首次公开发行限售	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	首次公开发行限售	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
300950	德 固 特	2021-02-02	2021-08-09	首次公开发行限售	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	-

		24	9-03	发行限售						
605162	新 中 港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	首次公开发行限售	8.53	27.22	300.00	2,559.00	8,166.00	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	首次公开发行限售	8.42	13.60	593.00	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	首次公开发行限售	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	首次公开发行限售	13.11	24.48	322.00	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	首次公开发行限售	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	首次公开发行限售	18.24	28.29	245.00	4,468.80	6,931.05	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	首次公开发行限售	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	首次公开发行限售	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	首次公开发行限售	12.13	22.49	283.00	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	首次公开发行限售	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	首次公开发行限售	9.79	23.01	255.00	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	首次公开发行限售	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	首次公开发行限售	7.19	12.65	430.00	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	首次公开发行限售	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	首次公开发行限售	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德 迈 仕	2021-06-04	2021-12-16	首次公开发行限售	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	首次公开发行限售	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	首次公开发行限售	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	首次公开发行限售	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-	2021-1	首次公开	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-

		09	2-20	发行限售						
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行限售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%(根据中国证监会《〈关于修改上市公司证券发行管理办法的决定〉〈关于修改创业板上市公司证券发行管理暂行办法的决定〉〈关于修改上市公司非公开发行股票实施细则的决定〉的立法说明》，基金持有的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，不适用上述减持规则的相关规定)；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，力争为基金份额持有人获取长期持续稳定的投资回报。

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、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。

6.4.9.2 信用风险

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

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

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

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	4,715,605.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	4,715,605.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	145,562,559.55	-	-	-	145,562,559.55
结算备付金	39,593,768.11	-	-	-	39,593,768.11
存出保证金	461,646.74	-	-	-	461,646.74
交易性金融资产	-	-	-	2,247,140,062.76	2,247,140,062.76
应收证券清算款	-	-	-	43,555,247.58	43,555,247.58
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	38,722.20	38,722.20
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	185,617,974.40	-	-	2,290,734,032.54	2,476,352,006.94
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,016,521.22	3,016,521.22
应付托管费	-	-	-	502,753.53	502,753.53
应付销售服务费	-	-	-	54,870.09	54,870.09
应交税费	-	-	-	96.61	96.61
应付交易费用	-	-	-	760,234.50	760,234.50
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	138,231.73	138,231.73
负债总计	-	-	-	4,472,707.68	4,472,707.68
利率敏感度缺口	185,617,974.40	-	-	-2,286,261,324.86	2,471,879,299.26
上年度末 2020 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	292,016,211.40	-	-	-	292,016,211.40
结算备付金	54,713,917.45	-	-	-	54,713,917.45
存出保证金	1,893,932.63	-	-	-	1,893,932.63
交易性金融资产	-	4,715,605.00	-	2,131,746,600.57	2,136,462,205.57
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	54,887.81	54,887.81
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	348,624,061.48	4,715,605.00	-2,131,801,488.38	2,485,141,154.86
负债				
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	89,619,882.16	89,619,882.16
应付管理人报酬	-	-	2,957,361.56	2,957,361.56
应付托管费	-	-	492,893.57	492,893.57
应付销售服务费	-	-	53,910.06	53,910.06
应交税费	-	-	13.54	13.54
应付交易费用	-	-	2,497,460.23	2,497,460.23
应付利息	-	-	-	-
其他负债	-	-	97,700.00	97,700.00
负债总计	-	-	95,719,221.12	95,719,221.12
利率敏感度缺口	348,624,061.48	4,715,605.00	-2,036,082,267.26	2,389,421,933.74

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转换债券、可交换债券）或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	229,737,288.00	229,737,288.00
资产合计	-	229,737,288.00	229,737,288.00
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	229,737,288.00	229,737,288.00
项目	上年度末		

	2020 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	108,040,737.65	108,040,737.65
资产合计	-	108,040,737.65	108,040,737.65
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	108,040,737.65	108,040,737.65

6.4.9.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 1,149	增加约 540
	2. 所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 1,149	减少约 540

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	2,247,140,062.76	90.91	2,131,746,600.57	89.22
交易性金融资产	-	-	4,715,605.00	0.20

一 债券投资				
交易性金融资产	-	-	-	-
一 贵金属投资				
衍生金融资产—	-	-	-	-
权证投资				
合计	2,247,140,062.76	90.91	2,136,462,205.57	89.41

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。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 11,608	增加约 7,757
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 11,608	减少约 7,757

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本期末,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中属于第一层次的余额为 2,240,069,229.06 元,属于第二层次的余额为 7,070,833.70 元,属于第三层次的余额为 0.00 元(上年度末:第一层次 1,994,492,630.82 元,第二层次 141,969,574.75 元,第三层次 0.00 元)。

(ii) 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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	2,247,140,062.76	90.74
	其中：股票	2,247,140,062.76	90.74
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	185,156,327.66	7.48
8	其他各项资产	44,055,616.52	1.78
9	合计	2,476,352,006.94	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 229,737,288.00 元，净值占比 9.29%。

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	140,505,000.00	5.68
C	制造业	1,506,500,882.75	60.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.21
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,530,575.99	0.26
J	金融业	358,578,774.86	14.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,017,402,774.76	81.61

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	229,737,288.00	9.29
合计	229,737,288.00	9.29

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	2333	长城汽车	11,000,000	229,737,288.00	9.29
2	600036	招商银行	3,999,809	216,749,649.71	8.77
3	600309	万华化学	1,800,039	195,880,243.98	7.92
4	600703	三安光电	5,999,954	192,298,525.70	7.78
5	600426	华鲁恒升	5,148,085	159,333,230.75	6.45
6	601166	兴业银行	6,899,971	141,794,404.05	5.74
7	601899	紫金矿业	14,500,000	140,505,000.00	5.68
8	002241	歌尔股份	3,000,000	128,220,000.00	5.19
9	600031	三一重工	3,999,903	116,277,180.21	4.70
10	300083	创世纪	7,682,554	84,123,966.30	3.40
11	002925	盈趣科技	2,151,520	83,715,643.20	3.39

12	300136	信维通信	2,704,031	83,500,477.28	3.38
13	002078	太阳纸业	6,000,000	80,100,000.00	3.24
14	000725	京东方 A	10,000,000	62,400,000.00	2.52
15	300567	精测电子	1,000,000	61,400,000.00	2.48
16	002938	鹏鼎控股	1,499,945	53,818,026.60	2.18
17	600486	扬农化工	449,842	50,278,840.34	2.03
18	600282	南钢股份	10,000,000	35,600,000.00	1.44
19	603501	韦尔股份	100,000	32,200,000.00	1.30
20	300503	昊志机电	2,500,000	31,025,000.00	1.26
21	002236	大华股份	1,000,000	21,100,000.00	0.85
22	002045	国光电器	1,500,000	18,660,000.00	0.75
23	688656	浩欧博	200,000	14,874,000.00	0.60
24	688369	致远互联	100,000	6,390,000.00	0.26
25	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.21
26	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.02
27	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
28	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.00
29	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
30	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.00
31	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.00
32	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
33	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
34	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
35	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
36	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
37	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
38	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
39	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
40	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
41	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
42	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
43	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
44	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
45	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
46	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
47	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
48	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
49	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
50	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
51	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
52	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
53	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
54	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00

55	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
56	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
57	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
58	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
59	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
60	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
61	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
62	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
63	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
64	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
65	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
66	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
67	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
68	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
69	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
70	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
71	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
72	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
73	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
74	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
75	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
76	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
77	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
78	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
79	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
80	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
81	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
82	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
83	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
84	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
85	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
86	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
87	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
88	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	2333	长城汽车	242,290,864.41	10.14
2	601633	长城汽车	132,972,222.91	5.57

3	600031	三一重工	106,119,413.64	4.44
4	002925	盈趣科技	75,321,860.03	3.15
5	000725	京东方 A	63,296,047.00	2.65
6	300567	精测电子	56,124,284.06	2.35
7	600036	招商银行	50,081,777.36	2.10
8	002241	歌尔股份	44,769,342.42	1.87
9	000651	格力电器	40,886,371.93	1.71
10	600282	南钢股份	38,882,519.77	1.63
11	300503	昊志机电	34,397,512.00	1.44
12	002236	大华股份	33,276,501.36	1.39
13	002938	鹏鼎控股	30,824,653.18	1.29
14	002078	太阳纸业	30,017,073.38	1.26
15	603501	韦尔股份	27,409,393.86	1.15
16	600309	万华化学	24,035,410.00	1.01
17	600486	扬农化工	20,188,591.42	0.84
18	601166	兴业银行	20,088,135.40	0.84
19	600703	三安光电	17,872,242.14	0.75
20	688656	浩欧博	16,769,727.18	0.70

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	603218	日月股份	131,762,699.64	5.51
2	000651	格力电器	120,143,938.25	5.03
3	601633	长城汽车	112,481,165.41	4.71
4	000708	中信特钢	108,070,609.44	4.52
5	2333	长城汽车	103,763,384.95	4.34
6	002236	大华股份	79,036,899.36	3.31
7	002493	荣盛石化	79,028,061.22	3.31
8	600350	山东高速	75,065,936.44	3.14
9	000333	美的集团	67,291,754.14	2.82
10	600167	联美控股	49,459,855.51	2.07
11	000983	山西焦煤	43,413,107.09	1.82
12	601318	中国平安	42,680,785.33	1.79
13	6186	中国飞鹤	36,102,339.74	1.51
14	601899	紫金矿业	20,812,192.50	0.87
15	600409	三友化工	20,073,458.98	0.84
16	300323	华灿光电	16,427,380.02	0.69
17	600426	华鲁恒升	12,007,763.70	0.50

18	600905	三峡能源	1,760,166.20	0.07
19	600480	凌云股份	1,646,217.00	0.07
20	688538	和辉光电	1,603,612.78	0.07

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	1,168,806,952.29
卖出股票的收入（成交）总额	1,149,856,463.08

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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。

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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、兴业银行(601166)、创世纪(300083)的发行主体外，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。

主要违规事实：2021 年 5 月 21 日，因存在 1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产。2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品。3、理财产品之间风险隔离不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对招商银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2020 年 9 月 11 日，因存在 1、为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2、为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3、违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4、违反银行卡收单外包管理规定；5、未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2020 年 7 月 14 日，因存在未及时履行信息披露的违规行为，深圳证券交易所对广东创世纪智能装备集团股份有限公司处以监管关注的行政处罚。

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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	461,646.74
2	应收证券清算款	43,555,247.58
3	应收股利	-
4	应收利息	38,722.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	44,055,616.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时研究优选混合 A	21,503	95,529.80	6,951,612.00	0.34%	2,047,225,571.06	99.66%
博时研究优选混合 C	9,140	7,999.13	0.00	0.00%	73,112,060.51	100.00%
合计	30,398	69,981.22	6,951,612.00	0.33%	2,120,337,631.57	99.67%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	5,081,958.00	11.19%
2	练伟	2,379,000.00	5.24%
3	孙梅	1,000,019.00	2.20%
4	徐丹雨	910,000.00	2.00%
5	张杰	836,123.00	1.84%
6	费妙琴	800,062.00	1.76%
7	林立红	721,600.00	1.59%
8	惠彬	669,400.00	1.47%

9	梅红	666,700.00	1.47%
10	郭献勤	591,960.00	1.30%

注：上述基金份额持有人为场内持有人。

8.3 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	博时研究优选混合 A	3,744,415.34	0.18%
	博时研究优选混合 C	5,190.48	0.01%
	合计	3,749,605.82	0.18%

8.4 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	博时研究优选混合 A	>100
	博时研究优选混合 C	—
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时研究优选混合 A	—
	博时研究优选混合 C	—
	合计	—

注：本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时研究优选混合 A	博时研究优选混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 20 日）基金份额总额	2,053,793,719.92	73,112,060.51
本报告期期初基金份额总额	2,053,793,719.92	73,112,060.51
本报告期基金总申购份额	383,463.14	—
减：本报告期基金总赎回份额	—	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,054,177,183.06	73,112,060.51

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：基金管理人于 2021 年 2 月 6 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，高阳先生担任公司总经理职务。

本报告期内，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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	2	145,309,129.34	6.30%	106,267.47	6.21%	新增 2 个
方正证券	1	321,761,666.03	13.95%	235,305.36	13.74%	新增 1 个
中信证券	2	62,550,649.85	2.71%	45,743.94	2.67%	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	1	12,077.72	—	8.84	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	5	1,431,411,246.51	62.08%	1,065,468.94	62.22%	新增 3 个
长江证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—

海通证券	2	316,236,394.12	13.71%	238,838.19	13.95%	-
银河证券	2	28,611,933.96	1.24%	20,924.05	1.22%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-

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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	128,714,936.20	45.92%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	151,607,561.30	54.08%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

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直销网上交易开通邮储银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
2	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子	证券时报、基金管理人网	2021-05-26

	支付服务有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	站、证监会基金电子披露网站	
3	博时基金管理有限公司关于暂停使用银联支付提供的交通银行、平安银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
4	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供的兴业银行、广发银行支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-24
5	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
6	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
7	博时基金管理有限公司关于对投资者在直销网上交易申购、认购及定投基金实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
8	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的交通银行快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
9	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-20210310	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
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-20210220	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
11	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
12	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（博时研究优选混合 A）基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-25
13	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（博时研究优选混合 C）基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-25
14	博时基金管理有限公司关于博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理变更的公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22
15	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22
16	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22

17	博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-15
----	---------------------------------	--------------------------	------------

§ 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

12.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.1.5 博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时研究优选 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

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
二〇二一年八月三十一日