

博时量化价值股票型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 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：二〇二二年三月三十日

§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 2022 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。

本报告中财务资料已经审计。为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	62
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	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
§9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§10 开放式基金份额变动	65
§11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§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	7,020,614.20 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	4,024,249.48 份	2,996,364.72 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	本基金投资策略主要由 A 股投资策略、港股投资策略和其他投资策略三部分组成。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。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。其他投资策略主要包括：存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。
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	姓名	孙麒清	秦一楠

责人	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		江向阳	谷澍

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

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	2021 年		2020 年		2019 年	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	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	1,634,821.09	57,673,028.41	1,944,888.49	112,871,189.65	16,827,220.28	11,509,590.93
本期利润	725,174.68	27,492,744.43	2,296,689.84	125,423,200.83	20,550,542.61	28,875,140.37
加权平均基金份额本期利润	0.1780	0.1599	0.3273	0.3104	0.3963	0.1704
本期加权平均净值利润率	11.88%	11.22%	27.60%	25.94%	39.79%	16.81%

本期基金份额净值增长率	11.13%	10.21%	30.26%	29.22%	24.07%	23.08%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	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	2,245,257.25	1,540,780.14	2,073,914.28	151,304,831.63	1,934,808.63	25,507,069.98
期末可供分配基金份额利润	0.5579	0.5142	0.4019	0.3739	0.0762	0.0632
期末基金资产净值	6,269,506.73	4,537,144.86	7,234,418.78	556,024,152.03	27,339,265.76	429,398,047.94
期末基金份额净值	1.5579	1.5142	1.4019	1.3739	1.0762	1.0632
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	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	55.79%	51.42%	40.19%	37.39%	7.62%	6.32%

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	-0.64%	0.74%	-0.16%	0.69%	-0.48%	0.05%
过去六个月	3.42%	0.90%	-7.86%	0.93%	11.28%	-0.03%
过去一年	11.13%	0.93%	-6.63%	1.02%	17.76%	-0.09%
过去三年	79.61%	1.18%	44.24%	1.10%	35.37%	0.08%
自基金合同生效起至今	55.79%	1.19%	26.76%	1.13%	29.03%	0.06%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-0.84%	0.74%	-0.16%	0.69%	-0.68%	0.05%
过去六个月	2.99%	0.90%	-7.86%	0.93%	10.85%	-0.03%
过去一年	10.21%	0.93%	-6.63%	1.02%	16.84%	-0.09%
过去三年	75.30%	1.18%	44.24%	1.10%	31.06%	0.08%
自基金合同生效起至今	51.42%	1.19%	26.76%	1.13%	24.66%	0.06%

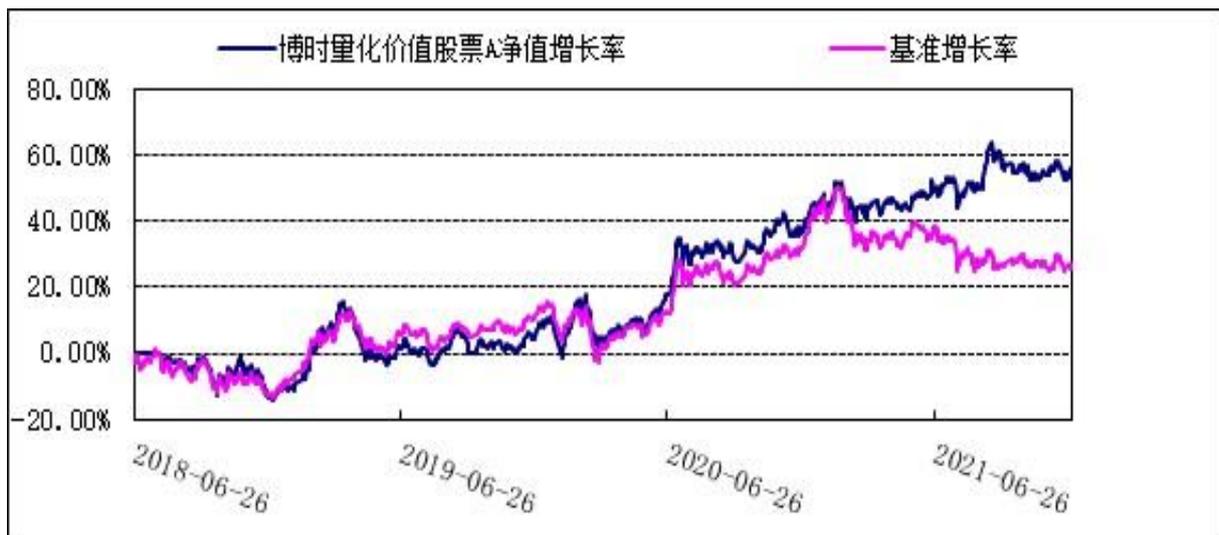
本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 70%、20%、10% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

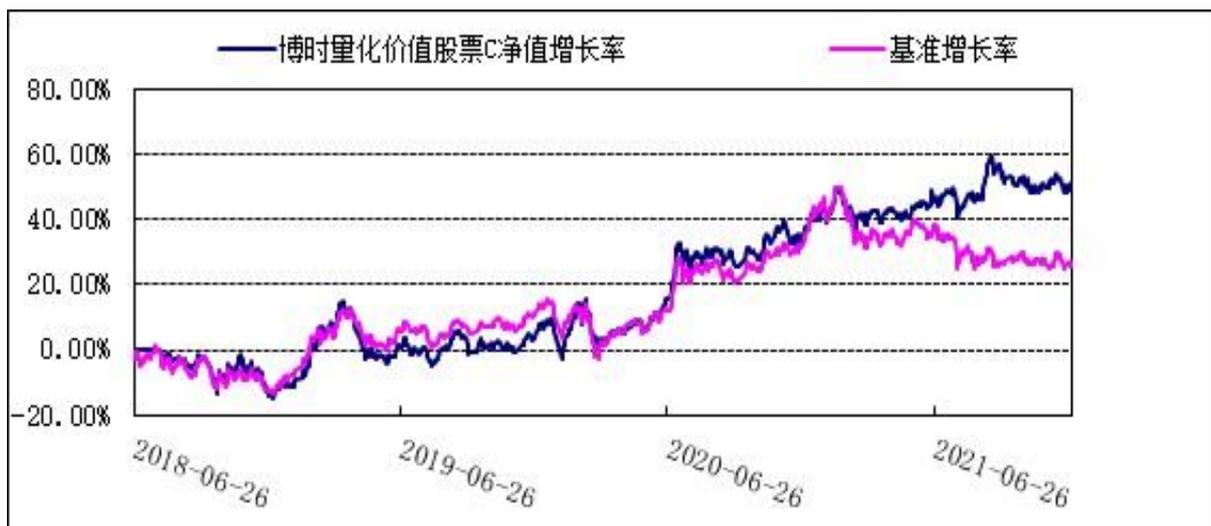
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 6 月 26 日至 2021 年 12 月 31 日)

1、博时量化价值股票 A



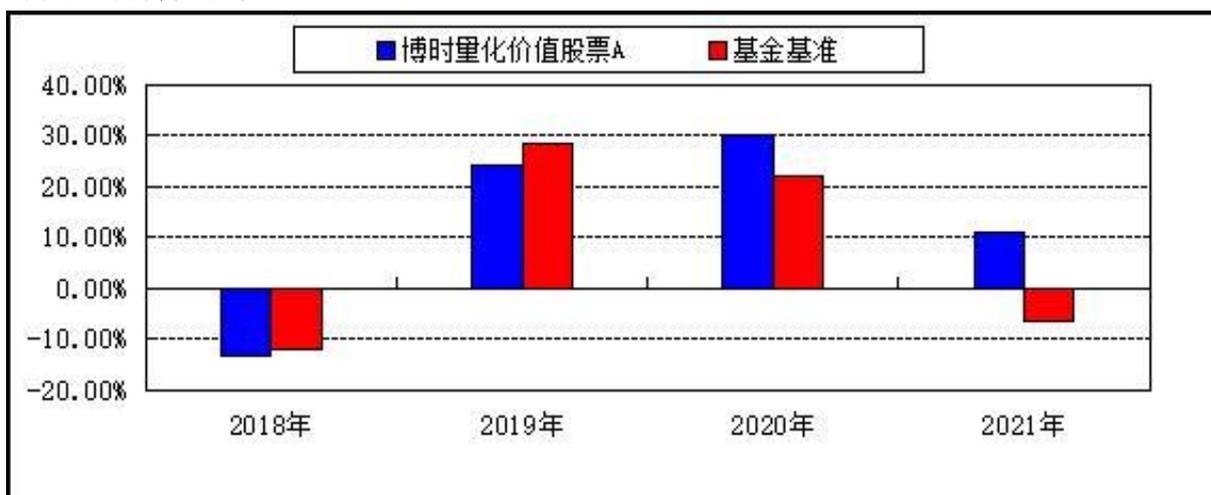
2、博时量化价值股票 C



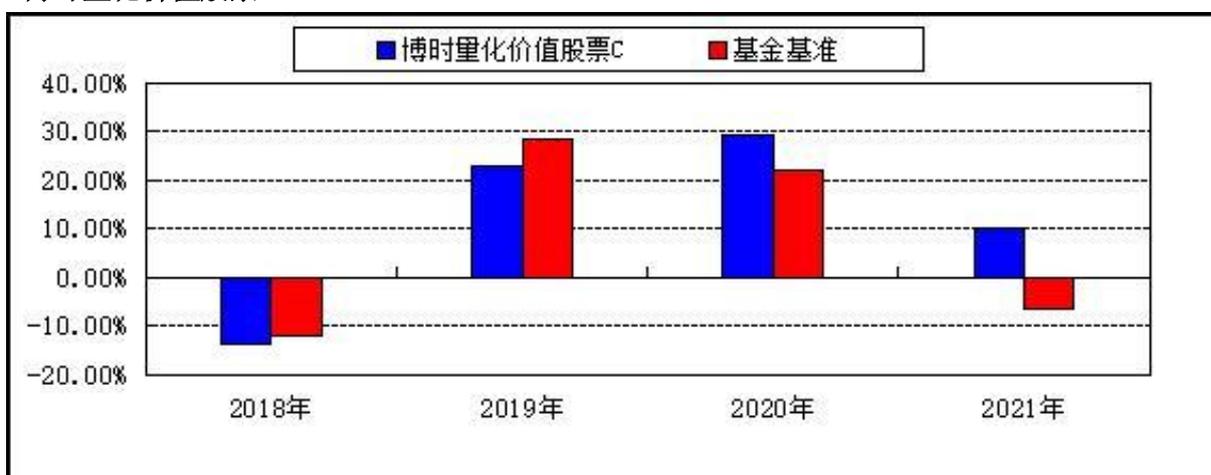
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时量化价值股票 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 2021 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 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 16687 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 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 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。

其他大事件

2021 年 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021 年 9 月 28 日，由中国证券报社有限公司主办的第十八届中国基金业金牛奖评选结果正式揭晓，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时信用债纯债债券一举荣获了“五年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2021 年 9 月 27 日，由证券时报报社有限公司主办的第十六届中国基金业明星基金奖正式公布，凭借出色的业绩以及卓越的投资实力，博时天颐债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。

2021 年 9 月，由北京济安金信科技有限公司主办的第三届济安“群星汇”评选结果揭晓，凭借卓越的综合管理实力和旗下基金产品出色的长期业绩，博时基金一举获得了“济安众星奖”、“济安五星奖”两项重量级的公司奖项。博时旗下产品博时合惠货币(004841)获得了“基金产品单项奖-货币型”，博时合惠货币基金基金经理魏桢则荣获了“五星基金明星奖”奖。

2021 年 7 月 6 日，由上海证券报社有限公司主办的第十七届“金基金”奖的评选结果揭晓。凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获 2021 年度“金基金”债券投资回报基金管理公

司奖，博时富瑞纯债债券荣获 2021 年度“金基金”债券基金三年期奖。

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		
林景艺	基金经理	2018-06-26	-	11.4	林景艺女士，硕士。2010 年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任量化分析师、高级研究员兼基金经理助理、博时国企改革主题股票型证券投资基金(2015 年 5 月 20 日-2021 年 5 月 18 日)基金经理。现任博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日—至今)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/基金经理	2018-06-26	-	19.4	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资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—至

					今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018年4月3日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018年6月26日—至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	11.6	2010年7月加入博时基金管理有限公司,历任程序员、系统运维经理。2016年1月调任博时资本,任投资经理。2018年2月再次加入博时基金管理有限公司,现任基金经理助理。
周江	资深研究员兼基金经理助理	2018-07-27	2021-06-03	6.3	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,历任研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员兼基金经理助理。2021年6月3日离职。

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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 41 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

2021 年，随着后疫情时代的复工复产，全球经济整体向好，市场流动性充裕。我国高度重视新冠疫情，并实施了一系列有效的防控措施，凭借供应链优势，维持较高的出口景气度。在强外需的背景下，出口型行业的景气度偏高，经济形势相对较好，国内就业压力得到一定缓解。服务业受到疫情带来的较大冲击；受出口的拉动，工业、制造业在 GDP 中的比重得到提升，为 GDP 单位能耗超标埋下伏笔。在国家发布的“能耗双控”限电限产的政策背景下，三季度制造业受到一定影响。A 股市场在 2021 年呈现明显的结构化行情：国证 2000 指数上涨 29.19%，创成长指数上涨 20.71%，创业板指上涨 12.02%，中证 500 指数上涨 15.58%，沪深 300 下跌 5.20%，上证 50 下跌 10.06%。从风格结构上看，全年小盘风格占优，风格之间的切换显著：春节前大盘成长风格延续了 2019 年的强势行情，价值风格震荡走弱，成长和价值的估值差进一步放大，并且屡创历史新高。但是春节后，市场风格发生反转，大盘成长遇到大幅回撤，虽然后续有所反弹，但整体上全年表现一般；相对而言，小盘价值和小盘成长风格在二、三季度持续发力，整体表现优异。根据巨潮编制的风格指数，2021 年大盘价值指数收益-8.29%，大盘成长指数收益 0.29%，小盘价值指数收益 20.51%，小盘成长指数收益 23.62%。行业板块方面，行业之间的差异进一步加大，板块轮动速度明显加快。在双碳目标的大背景下，实体经济大规模向低碳、零碳转型，新能源产业链面临前所未有的发展机遇。根据中信一级行业显示，2021 年电力设备及新能源行业指数涨幅达 50.41%。得益于国内较高的复工复产率以及海外较高的出口需求，周期板块基本面向好，尤其是周期上游行业，涨幅居于各行业前列：基础化工、有色金属、钢铁、煤炭行业指数涨幅在 40% 以上。2021 年跌幅靠前的三个行业是：消费者服务、非银行金融、家电。全部 A 股约 4700 只股票，涨幅的中位数是 8.46%，涨幅的均值是 23.10%，个股涨幅集中度较高。有超 2200 只股票涨幅在 10% 以上，有约 1800 只股票在 2021 年整体下跌。港股市场整体表现欠佳，恒生指数在 2021 年初冲高后回落，进入震荡下行趋势，最终恒生指数下跌 14.08%。港股消费板块和科技板块表现不佳：恒生资讯科技业指数下跌 32.26%，恒生医疗保健业指数下跌 27.79%；相对而言，能源板块表现较优，恒生能源业指数上涨 20.53%。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。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等多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。当前，市场整体估值有所提升，而低估值板块与其他板块的估值差已经达到历史高位，未来具有较大的结构性估值修复空间。大盘价值市盈率从 18 年底的 8.1 倍到现在 6.85 倍，指数涨了 19.52%，业绩驱动上升为主；大盘成长从 2018 年底的 15 倍市盈率已经到 35.42 倍，指数上涨 143.35%，基本上都是估值驱动的。我们认为未来两年内，价值风格具有良好的基本面和极低的估值，具有更高的安全性和性价比。大盘价值对应的金融和周期行业在复苏预期下更加具有业绩改善和估值修复的可能。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，争取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 2021 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.5579 元，份额累计净值为 1.5579 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.5142 元，份额累计净值为 1.5142 元。报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 11.13%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 10.21%，同期业绩基准增长率为-6.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，美国经济面临较大的通胀压力，美联储货币政策收紧渐行渐近，其他各国央行已有提前行动，主要以加快收紧货币政策为主。人民币更高的国际地位和国内较低的通货膨胀为中国货币政策提供了更加灵活的空间，货币政策的目标将会由之前侧重于外部均衡转向以内部均衡为主。近期货币会议传递出积极的财政信号，货币政策基调以“稳”为主，适度宽松，这将有利于 A 股市场的长期表现。全球经济总体处于复苏态势中，但是诸多风险依然不容乐观。新冠病毒的变异加大了全球经济复苏的不确定性。而得益于中国政权的强大执行力，我国有效控制了疫情传播，在此基础上，宏观政策可以更加灵活精确，我们预期中国经济将保持复苏，复苏动能也将逐步由外需拉动向更多内需驱动转换。中国在保持经济增长的同时，消费有望继续回暖。房地产调控将持续，稳市场、稳预期是核心政策目标。数字化转型、医疗创新和可持续发展这三大趋势将继续推动研发和投资，创造更多价值。一些新技术与应用场景的融合将提速，助力中国经济高质量发展。在此背景下，景气程度高、产业前景相对明确、估值和业绩匹配度较好的具有成长潜力的公司更具有配置价值。在国际市场结束量化宽松周期、国内货币政策以“稳”为主的大背景下，A 股的驱动力势必要从估值扩张向盈利增长转变，基于当前极致的估值差异，我们认为 2022 年 A 股市场大概率上会呈现风格轮动加快，节奏变化加剧，估值低且盈利情况改善的个股和板块将更有机会。港股方面，经济增长回升有望继续驱动港股盈利不断修复；AH 股溢价指数当前处于过去 10 年的较高位置，意味着两地上

市的股票 H 股价格显著低于 A 股；港股通资金占用比例显著增大，香港市场已成为内地资金的重要资产配置市场。截止 2021 年底，恒生指数的市盈率(TTM)为 10.7，处在 2003 年以来的中位数以下。综合考虑，我们认为在一年维度上港股具有较强的配置价值。

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、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司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。

2021 年，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步完善投资管理相关的管理机制，修订了《股票池管理办法》、《债券池管理办法》、《信用风险处置制度》等制度文件。系统建设方面，对“金手指估值系统”进行升级改造，对“博时产品管理系统”、“新一代决策支持系统”等管理平台进行持续迭代更新，同时上线了“统一风险管理平台”，提升了公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，制定了《销售机构管理规范》，日常业务中按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，

通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金曾于 2021 年 11 月 12 日至 2021 年 12 月 31 日出现连续 20 个工作日资产净值低于五千万元的情形。

§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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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《中华人民共和国证券投资基金法》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《公开募集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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60669135_A09 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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时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。

（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（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

王珊珊 朱燕

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

2022 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	975,573.86	42,990,560.16
结算备付金		248,064.58	14,706,899.75
存出保证金		67,337.85	2,879,468.28
交易性金融资产	7.4.7.2	9,780,554.20	503,963,225.09
其中：股票投资		9,679,762.19	503,152,225.09
基金投资		-	-
债券投资		100,792.01	811,000.00
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		72,783.87	642,769.31
应收利息	7.4.7.5	428.39	16,893.65
应收股利		-	1,620.12

应收申购款		13,623.41	68,433.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		11,158,366.16	565,269,869.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	4.18
应付赎回款		7,912.92	42,740.63
应付管理人报酬		19,741.63	422,157.89
应付托管费		5,483.76	117,266.09
应付销售服务费		13,276.64	370,308.22
应付交易费用	7.4.7.7	180,799.27	894,319.88
应交税费		0.35	2.11
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	124,500.00	164,500.00
负债合计		351,714.57	2,011,299.00
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	7,020,614.20	409,879,824.90
未分配利润	7.4.7.10	3,786,037.39	153,378,745.91
所有者权益合计		10,806,651.59	563,258,570.81
负债和所有者权益总计		11,158,366.16	565,269,869.81

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 7,020,614.20 份。其中 A 类基金份额净值 1.5579 元，基金份额 4,024,249.48 份；C 类基金份额净值 1.5142 元，基金份额 2,996,364.72 份。

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		40,244,192.20	149,326,666.56
1.利息收入		270,139.63	461,525.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	261,323.21	455,573.33
债券利息收入		8,816.42	5,952.37

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		71,029,845.99	135,933,269.51
其中：股票投资收益	7.4.7.12	66,466,134.61	119,637,965.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13.1	190,877.71	306,786.93
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,694,970.87	7,361,877.29
股利收益	7.4.7.15	2,677,862.80	8,626,639.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-31,089,930.39	12,903,812.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	34,136.97	28,058.82
减：二、费用		12,026,273.09	21,606,775.89
1. 管理人报酬		2,330,304.27	4,407,940.77
2. 托管费		647,306.71	1,224,427.96
3. 销售服务费		2,022,618.88	3,851,071.07
4. 交易费用	7.4.7.18	6,870,354.20	11,901,801.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6,132.59	26,509.52
7. 其他费用	7.4.7.19	149,556.44	195,025.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		28,217,919.11	127,719,890.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		28,217,919.11	127,719,890.67

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	409,879,824.90	153,378,745.91	563,258,570.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	28,217,919.11	28,217,919.11

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）	-402,859,210.70	-177,810,627.63	-580,669,838.33
其中：1.基金申购款	29,340,155.86	13,763,402.13	43,103,557.99
2.基金赎回款	-432,199,366.56	-191,574,029.76	-623,773,396.32
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）	7,020,614.20	3,786,037.39	10,806,651.59
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	429,295,435.09	27,441,878.61	456,737,313.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	127,719,890.67	127,719,890.67
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）	-19,415,610.19	-1,783,023.37	-21,198,633.56
其中：1.基金申购款	10,125,857.25	2,216,323.58	12,342,180.83
2.基金赎回款	-29,541,467.44	-3,999,346.95	-33,540,814.39
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）	409,879,824.90	153,378,745.91	563,258,570.81

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：孙献，会计机构负责人：侣方方

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。基金合

同于 2018 年 6 月 26 日生效，首次设立募集规模为 341,191,900.59 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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、存托凭证）、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（含存托凭证）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%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》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

本基金本报告期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本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或

者（3）该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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）当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同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

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

实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债

券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不

再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	975,573.86	42,990,560.16
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	975,573.86	42,990,560.16
----	------------	---------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,194,013.11	9,679,762.19	485,749.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	86,100.00	100,792.01
	银行间市场	-	-
	合计	86,100.00	100,792.01
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,280,113.11	9,780,554.20	500,441.09
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	473,506,093.61	503,152,225.09	29,646,131.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	811,000.00	811,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	811,000.00	811,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	474,317,093.61	503,963,225.09	29,646,131.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	19,004,880.00	-	-	-
股指期货	19,004,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	19,004,880.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有股指期货合约。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码 名称 持仓量（买/卖） 合约市值 公允价值变动

IC2103 中证 500 期货 2103 合约 3 3,750,840.00 21,240.00

IF2103 沪深 300 期货 2103 合约 11 17,198,280.00 1,923,000.00

总额合计 - 14 20,949,120.00 1,944,240.00

减：可抵销期货暂收款 -- - 1,944,240.00

股指/商品期货投资净额 -- --

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	192.01	9,602.81
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	122.76	7,093.42
应收债券利息	80.29	63.99
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	33.33	133.43
合计	428.39	16,893.65

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	180,799.27	894,319.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	180,799.27	894,319.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	124,500.00	164,500.00
合计	124,500.00	164,500.00

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,160,504.50	5,160,504.50
本期申购	4,318,911.06	4,318,911.06
本期赎回（以“-”号填列）	-5,455,166.08	-5,455,166.08
本期末	4,024,249.48	4,024,249.48

博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	404,719,320.40	404,719,320.40
本期申购	25,021,244.80	25,021,244.80
本期赎回（以“-”号填列）	-426,744,200.48	-426,744,200.48
本期末	2,996,364.72	2,996,364.72

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

7.4.7.10 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
上年度末	2,363,520.74	-289,606.46	2,073,914.28
本期利润	1,634,821.09	-909,646.41	725,174.68
本期基金份额交易产生的变动数	-461,471.97	-92,359.74	-553,831.71
其中：基金申购款	2,841,224.09	-669,607.00	2,171,617.09
基金赎回款	-3,302,696.06	577,247.26	-2,725,448.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,536,869.86	-1,291,612.61	2,245,257.25

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
上年度末	174,179,375.03	-22,874,543.40	151,304,831.63
本期利润	57,673,028.41	-30,180,283.98	27,492,744.43
本期基金份额交易产生的变动数	-229,368,630.65	52,111,834.73	-177,256,795.92
其中：基金申购款	15,502,352.60	-3,910,567.56	11,591,785.04
基金赎回款	-244,870,983.25	56,022,402.29	-188,848,580.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,483,772.79	-942,992.65	1,540,780.14

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	158,893.03	290,765.70
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	99,369.61	159,207.80
其他	3,060.57	5,599.83
合计	261,323.21	455,573.33

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,441,909,223.74	4,012,838,749.39
减：卖出股票成本总额	2,375,443,089.13	3,893,200,783.78

买卖股票差价收入	66,466,134.61	119,637,965.61
----------	---------------	----------------

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,768,947.26	9,794,776.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,575,602.75	9,315,260.00
减：应收利息总额	2,466.80	172,729.12
买卖债券差价收入	190,877.71	306,786.93

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无发生额。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	1,694,970.87	7,361,877.29

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,677,862.80	8,626,639.68
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,677,862.80	8,626,639.68

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-29,145,690.39	10,959,572.53
——股票投资	-29,160,382.40	10,962,292.53
——债券投资	14,692.01	-2,720.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-1,944,240.00	1,944,240.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-1,944,240.00	1,944,240.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-31,089,930.39	12,903,812.53

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	15,333.24	17,614.96
基金转换费收入	18,803.73	10,443.86
合计	34,136.97	28,058.82

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	6,870,354.20	11,901,801.13
银行间市场交易费用	-	-
合计	6,870,354.20	11,901,801.13

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	11,556.44	17,025.44

中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	149,556.44	195,025.44

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 根据中国证券监督管理委员会《关于核准博时基金管理有限公司设立子公司的批复》（证监许可[2021]2709号），博时基金管理有限公司获准设立子公司博时财富基金销售有限公司，注册地为深圳市，注册资本为人民币5,000万元，业务范围为证券投资基金销售业务以及中国证监会许可的其他业务。博时财富基金销售有限公司于2021年9月7日获得深圳市市场监督管理局颁发的企业法人营业执照。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	521,791,403.12	12.02%	1,656,441,615.70	20.87%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	-	-	64,381.00	0.94%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 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	486,139.93	12.10%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,542,665.70	21.83%	412,208.07	46.09%

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,330,304.27

其中：支付销售机构的客户维护费	31,696.55	55,461.62
-----------------	-----------	-----------

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 0.90% 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 × 0.90% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	647,306.71	1,224,427.96

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。

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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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
博时基金	-	1,996,419.60	1,996,419.60
中国农业银行	-	6,144.86	6,144.86
合计	-	2,002,564.46	2,002,564.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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
博时基金	-	3,833,569.39	3,833,569.39
中国农业银行	-	1,650.60	1,650.60
招商证券	-	3.09	3.09
合计	-	3,835,223.08	3,835,223.08

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.80% 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 类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况
7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	975,573.86	158,893.03	42,990,560.16	290,765.70

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券	001288	运机集团	网下发行	458.00	6,663.90
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	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
688499	利元亨	2021-06-23	2022-01-04	首次公开发行股票限售	38.85	293.00	1,356.00	52,680.60	397,308.00	-
688768	容知日新	2021-07-16	2022-01-26	首次公开发行股票限售	18.23	108.54	489.00	8,914.47	53,076.06	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行股票限售	10.64	30.44	421.00	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	首次公开发行股票限售	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	222.00	3,669.66	3,669.66	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	180.00	18,000.00	18,000.00	-

注：1、基金作为特定投资者认购的由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为特定投资者认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让；发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期；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。

3、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。

4、基金通过询价转让受让的科创板上市公司股东首次公开发行前已发行股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行

的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	68,877.60	811,000.00
AAA 以下	31,914.41	-
未评级	-	-
合计	100,792.01	811,000.00

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

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

的价格变现。

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	975,573.86	-	-	-	975,573.86
结算备付金	248,064.58	-	-	-	248,064.58
存出保证金	67,337.85	-	-	-	67,337.85
交易性金融资产	-	22,954.26	77,837.75	9,679,762.19	9,780,554.20
应收证券清算款	-	-	-	72,783.87	72,783.87
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	428.39	428.39
应收申购款	-	-	-	13,623.41	13,623.41
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,290,976.29	22,954.26	77,837.75	9,766,597.86	11,158,366.16
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	7,912.92	7,912.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	19,741.63	19,741.63
应付托管费	-	-	-	5,483.76	5,483.76
应付销售服务费	-	-	-	13,276.64	13,276.64
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
应付交易费用	-	-	-	180,799.27	180,799.27
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	124,500.00	124,500.00
负债总计	-	-	-	351,714.57	351,714.57

利率敏感度缺口	1,290,976.29	22,954.26	77,837.75	9,414,883.29	10,806,651.59
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	42,990,560.16	-	-	-	42,990,560.16
结算备付金	14,706,899.75	-	-	-	14,706,899.75
存出保证金	269,607.96	-	-	2,609,860.32	2,879,468.28
交易性金融资产	-	-	811,000.00	503,152,225.09	503,963,225.09
应收证券清算款	-	-	-	642,769.31	642,769.31
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	16,893.65	16,893.65
应收申购款	-	-	-	68,433.45	68,433.45
应收股利	-	-	-	1,620.12	1,620.12
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	57,967,067.87	-	811,000.00	506,491,801.94	565,269,869.81
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	42,740.63	42,740.63
应付证券清算款	-	-	-	4.18	4.18
应付管理人报酬	-	-	-	422,157.89	422,157.89
应付托管费	-	-	-	117,266.09	117,266.09
应付销售服务费	-	-	-	370,308.22	370,308.22
应交税费	-	-	-	2.11	2.11
应付交易费用	-	-	-	894,319.88	894,319.88
应付利息	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,500.00	164,500.00
负债总计	-	-	-	2,011,299.00	2,011,299.00
利率敏感度缺口	57,967,067.87	-	811,000.00	504,480,502.94	563,258,570.81

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

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债与可交换债)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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

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	-	9,566,711.47	9,566,711.47
应收股利	-	1,620.12	1,620.12
资产合计	-	9,568,331.59	9,568,331.59
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	-	9,568,331.59	9,568,331.59

7.4.13.4.2.2 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12月31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 48
2.所有港币均相对人民币贬值 5%	-	减少约 48	

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	9,679,762.19	89.57	503,152,225.09	89.33
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	100,792.01	0.93	811,000.00	0.14
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,780,554.20	90.50	503,963,225.09	89.47

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 33	增加约 2,339
	业绩比较基准下降 5%	减少约 33	减少约 2,339

7.4.14 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

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。

(a) 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 9,283,670.54 元，属于第二层次的余额为人民币 496,883.66 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元(上年度末：第一层次人民币 498,748,908.64 元，第二层次人民币 5,214,316.45 元，第三层次人民币 0.00 元)。

(b) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。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。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生转换(上年度：无)。

(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。

§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	9,679,762.19	86.75
	其中：股票	9,679,762.19	86.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,792.01	0.90
	其中：债券	100,792.01	0.90
	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	1,223,638.44	10.97
8	其他各项资产	154,173.52	1.38
9	合计	11,158,366.16	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	28,726.00	0.27
B	采矿业	224,939.00	2.08
C	制造业	5,548,463.87	51.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,502.00	1.11
E	建筑业	431,778.00	4.00
F	批发和零售业	295,331.00	2.73
G	交通运输、仓储和邮政业	153,836.00	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	591,223.36	5.47
J	金融业	1,667,643.40	15.43
K	房地产业	291,649.36	2.70
L	租赁和商务服务业	147,484.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	29,945.20	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	21,538.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,241.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	75,172.00	0.70
S	综合	43,290.00	0.40

合计	9,679,762.19	89.57
----	--------------	-------

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	688499	利元亨	1,356	397,308.00	3.68
2	000333	美的集团	3,200	236,192.00	2.19
3	600519	贵州茅台	100	205,000.00	1.90
4	600036	招商银行	4,200	204,582.00	1.89
5	601318	中国平安	3,600	181,476.00	1.68
6	601328	交通银行	37,100	171,031.00	1.58
7	601166	兴业银行	7,500	142,800.00	1.32
8	000651	格力电器	3,600	133,308.00	1.23
9	601398	工商银行	23,900	110,657.00	1.02
10	601838	成都银行	8,800	105,600.00	0.98
11	601988	中国银行	33,700	102,785.00	0.95
12	601939	建设银行	17,500	102,550.00	0.95
13	601577	长沙银行	12,500	97,625.00	0.90
14	000725	京东方 A	18,000	90,900.00	0.84
15	601668	中国建筑	17,200	86,000.00	0.80
16	300316	晶盛机电	1,100	76,450.00	0.71
17	688188	柏楚电子	197	75,935.62	0.70
18	000002	万科 A	3,300	65,208.00	0.60
19	601669	中国电建	7,800	63,024.00	0.58
20	002415	海康威视	1,200	62,784.00	0.58
21	600057	厦门象屿	6,800	57,732.00	0.53
22	600141	兴发集团	1,500	56,820.00	0.53
23	600308	华泰股份	9,000	55,710.00	0.52
24	601600	中国铝业	9,100	55,419.00	0.51
25	688768	容知日新	489	53,076.06	0.49
26	688111	金山办公	200	53,000.00	0.49
27	601919	中远海控	2,800	52,332.00	0.48
28	000789	万年青	4,200	51,324.00	0.47
29	600887	伊利股份	1,200	49,752.00	0.46
30	000039	中集集团	2,891	49,609.56	0.46
31	600449	宁夏建材	4,100	49,323.00	0.46
32	601117	中国化学	4,100	49,200.00	0.46
33	600089	特变电工	2,300	48,691.00	0.45
34	000100	TCL 科技	7,800	48,126.00	0.45
35	600039	四川路桥	3,800	45,752.00	0.42
36	000498	山东路桥	7,200	44,496.00	0.41
37	600019	宝钢股份	6,200	44,392.00	0.41
38	601888	中国中免	200	43,882.00	0.41

39	600436	片仔癀	100	43,715.00	0.40
40	600546	山煤国际	5,300	43,513.00	0.40
41	000009	中国宝安	3,000	43,290.00	0.40
42	600096	云天化	2,200	43,164.00	0.40
43	000898	鞍钢股份	11,400	42,750.00	0.40
44	600884	杉杉股份	1,300	42,601.00	0.39
45	000717	韶钢松山	8,900	42,275.00	0.39
46	002199	东晶电子	5,000	41,000.00	0.38
47	600309	万华化学	400	40,400.00	0.37
48	600522	中天科技	2,300	39,008.00	0.36
49	600031	三一重工	1,700	38,760.00	0.36
50	600507	方大特钢	4,900	38,220.00	0.35
51	600282	南钢股份	10,300	38,110.00	0.35
52	300760	迈瑞医疗	100	38,080.00	0.35
53	600985	淮北矿业	3,400	38,012.00	0.35
54	601898	中煤能源	6,000	37,740.00	0.35
55	600997	开滦股份	5,300	37,736.00	0.35
56	601319	中国人保	7,900	37,130.00	0.34
57	600808	马钢股份	10,000	36,900.00	0.34
58	601818	光大银行	11,070	36,752.40	0.34
59	600581	八一钢铁	5,900	36,639.00	0.34
60	000830	鲁西化工	2,400	36,624.00	0.34
61	000932	华菱钢铁	7,100	36,281.00	0.34
62	601012	隆基股份	420	36,204.00	0.34
63	000825	太钢不锈	5,100	35,904.00	0.33
64	600271	航天信息	2,600	34,814.00	0.32
65	688298	东方生物	147	33,883.50	0.31
66	600028	中国石化	8,000	33,840.00	0.31
67	600027	华电国际	6,300	33,705.00	0.31
68	000063	中兴通讯	1,000	33,500.00	0.31
69	000959	首钢股份	5,700	32,661.00	0.30
70	002869	金溢科技	2,100	32,634.00	0.30
71	600585	海螺水泥	800	32,240.00	0.30
72	000666	经纬纺机	3,700	32,153.00	0.30
73	603115	海星股份	1,200	31,440.00	0.29
74	000050	深天马 A	2,400	31,248.00	0.29
75	002322	理工环科	2,600	31,174.00	0.29
76	603501	韦尔股份	100	31,077.00	0.29
77	600894	广日股份	4,100	30,914.00	0.29
78	600883	博闻科技	3,600	30,672.00	0.28
79	002092	中泰化学	3,200	30,528.00	0.28
80	000776	广发证券	1,200	29,508.00	0.27
81	603920	世运电路	1,300	28,990.00	0.27

82	300059	东方财富	780	28,945.80	0.27
83	000965	天保基建	10,900	28,340.00	0.26
84	600273	嘉化能源	2,400	27,768.00	0.26
85	000069	华侨城 A	3,900	27,456.00	0.25
86	601601	中国太保	1,000	27,120.00	0.25
87	002594	比亚迪	100	26,812.00	0.25
88	601390	中国中铁	4,400	25,476.00	0.24
89	600153	建发股份	2,800	25,396.00	0.24
90	000568	泸州老窖	100	25,387.00	0.23
91	601086	国芳集团	6,400	25,344.00	0.23
92	603706	东方环宇	1,700	25,143.00	0.23
93	002812	恩捷股份	100	25,040.00	0.23
94	000715	中兴商业	5,100	24,939.00	0.23
95	300122	智飞生物	200	24,920.00	0.23
96	000900	现代投资	5,900	24,898.00	0.23
97	600050	中国联通	6,300	24,759.00	0.23
98	600269	赣粤高速	7,200	24,696.00	0.23
99	600675	中华企业	8,200	24,682.00	0.23
100	601019	山东出版	4,000	24,600.00	0.23
101	002107	沃华医药	3,300	24,420.00	0.23
102	300625	三雄极光	1,600	24,304.00	0.22
103	002315	焦点科技	1,400	23,772.00	0.22
104	300553	集智股份	600	23,286.00	0.22
105	688099	晶晨股份	177	23,045.40	0.21
106	002394	联发股份	2,800	22,988.00	0.21
107	000157	中联重科	3,200	22,944.00	0.21
108	002709	天赐材料	200	22,930.00	0.21
109	603880	南卫股份	3,200	22,912.00	0.21
110	600104	上汽集团	1,100	22,693.00	0.21
111	603839	安正时尚	2,600	22,646.00	0.21
112	300521	爱司凯	1,600	22,544.00	0.21
113	600287	江苏舜天	4,800	22,512.00	0.21
114	002049	紫光国微	100	22,500.00	0.21
115	600697	欧亚集团	1,800	22,428.00	0.21
116	002014	永新股份	2,600	22,308.00	0.21
117	300749	顶固集创	2,300	22,287.00	0.21
118	000429	粤高速 A	3,000	22,200.00	0.21
119	603226	菲林格尔	3,000	22,170.00	0.21
120	603790	雅运股份	2,100	22,113.00	0.20
121	000895	双汇发展	700	22,085.00	0.20
122	600846	同济科技	2,700	22,032.00	0.20
123	000951	中国重汽	1,300	21,957.00	0.20
124	002381	双箭股份	2,700	21,816.00	0.20

125	603679	华体科技	1,600	21,760.00	0.20
126	600987	航民股份	3,900	21,684.00	0.20
127	600724	宁波富达	5,900	21,653.00	0.20
128	600232	金鹰股份	4,000	21,640.00	0.20
129	300637	扬帆新材	2,600	21,606.00	0.20
130	002861	瀛通通讯	1,700	21,590.00	0.20
131	603196	日播时尚	2,700	21,546.00	0.20
132	002887	绿茵生态	2,200	21,538.00	0.20
133	603322	超讯通信	1,700	21,437.00	0.20
134	600665	天地源	6,900	21,390.00	0.20
135	600183	生益科技	900	21,195.00	0.20
136	300626	华瑞股份	2,100	21,168.00	0.20
137	601857	中国石油	4,300	21,113.00	0.20
138	300270	中威电子	3,300	21,087.00	0.20
139	601566	九牧王	1,700	21,012.00	0.19
140	000538	云南白药	200	20,930.00	0.19
141	603328	依顿电子	2,600	20,800.00	0.19
142	600647	同达创业	1,600	20,560.00	0.19
143	000701	厦门信达	3,800	20,558.00	0.19
144	300130	新国都	1,400	20,552.00	0.19
145	300349	金卡智能	1,700	20,485.00	0.19
146	300773	拉卡拉	700	20,314.00	0.19
147	600276	恒瑞医药	400	20,284.00	0.19
148	300552	万集科技	500	20,145.00	0.19
149	000858	五粮液	90	20,039.40	0.19
150	600353	旭光电子	2,700	19,899.00	0.18
151	000617	中油资本	3,800	19,684.00	0.18
152	002475	立讯精密	400	19,680.00	0.18
153	600586	金晶科技	2,100	19,446.00	0.18
154	601336	新华保险	500	19,440.00	0.18
155	600893	航发动力	300	19,038.00	0.18
156	603288	海天味业	180	18,919.80	0.18
157	600030	中信证券	700	18,487.00	0.17
158	600900	长江电力	800	18,160.00	0.17
159	000528	柳工	2,300	17,733.00	0.16
160	603986	兆易创新	100	17,585.00	0.16
161	601138	工业富联	1,470	17,522.40	0.16
162	601899	紫金矿业	1,800	17,460.00	0.16
163	001979	招商蛇口	1,300	17,342.00	0.16
164	300583	赛托生物	700	17,276.00	0.16
165	002961	瑞达期货	700	17,248.00	0.16
166	601186	中国铁建	2,200	17,160.00	0.16
167	601766	中国中车	2,800	17,052.00	0.16

168	603156	养元饮品	600	17,046.00	0.16
169	300231	银信科技	1,900	17,024.00	0.16
170	002817	黄山胶囊	1,400	16,884.00	0.16
171	000590	启迪药业	1,700	16,796.00	0.16
172	002244	滨江集团	3,600	16,776.00	0.16
173	600613	神奇制药	2,600	16,692.00	0.15
174	600582	天地科技	3,800	16,644.00	0.15
175	603259	药明康德	140	16,601.20	0.15
176	002304	洋河股份	100	16,473.00	0.15
177	002027	分众传媒	2,000	16,380.00	0.15
178	300450	先导智能	220	16,361.40	0.15
179	600998	九州通	1,100	16,192.00	0.15
180	600573	惠泉啤酒	1,600	16,176.00	0.15
181	002449	国星光电	1,500	16,170.00	0.15
182	600097	开创国际	1,400	16,128.00	0.15
183	002732	燕塘乳业	600	16,104.00	0.15
184	000031	大悦城	4,300	16,039.00	0.15
185	002605	姚记科技	700	15,911.00	0.15
186	601985	中国核电	1,900	15,770.00	0.15
187	002142	宁波银行	410	15,694.80	0.15
188	002024	苏宁易购	3,800	15,656.00	0.14
189	002133	广宇集团	5,000	15,650.00	0.14
190	600720	祁连山	1,500	15,600.00	0.14
191	002482	广田集团	6,400	15,552.00	0.14
192	603117	万林物流	3,900	15,522.00	0.14
193	000933	神火股份	1,700	15,453.00	0.14
194	603380	易德龙	400	15,320.00	0.14
195	000926	福星股份	3,600	15,300.00	0.14
196	000627	天茂集团	4,600	15,226.00	0.14
197	603933	睿能科技	1,000	15,180.00	0.14
198	603168	莎普爱思	1,600	15,168.00	0.14
199	002815	崇达技术	900	15,165.00	0.14
200	000667	美好置业	8,714	15,162.36	0.14
201	300127	银河磁体	600	15,150.00	0.14
202	600132	重庆啤酒	100	15,132.00	0.14
203	600251	冠农股份	1,600	15,120.00	0.14
204	002495	佳隆股份	5,600	15,120.00	0.14
205	601717	郑煤机	1,300	15,067.00	0.14
206	000521	长虹美菱	4,100	15,047.00	0.14
207	000046	泛海控股	8,000	15,040.00	0.14
208	603685	晨丰科技	1,200	15,024.00	0.14
209	600426	华鲁恒升	480	15,024.00	0.14
210	002807	江阴银行	3,900	15,015.00	0.14

211	002106	莱宝高科	1,300	14,963.00	0.14
212	600186	莲花健康	4,900	14,749.00	0.14
213	000402	金融街	2,600	14,716.00	0.14
214	002958	青农商行	3,800	14,668.00	0.14
215	002382	蓝帆医疗	900	14,661.00	0.14
216	000020	深华发 A	1,600	14,656.00	0.14
217	000997	新大陆	800	14,496.00	0.13
218	002660	茂硕电源	1,800	14,490.00	0.13
219	002231	奥维通信	2,400	14,472.00	0.13
220	601231	环旭电子	900	14,454.00	0.13
221	002839	张家港行	2,500	14,400.00	0.13
222	603773	沃格光电	700	14,364.00	0.13
223	603696	安记食品	1,500	14,355.00	0.13
224	601678	滨化股份	1,800	14,346.00	0.13
225	600066	宇通客车	1,300	14,326.00	0.13
226	002460	赣锋锂业	100	14,285.00	0.13
227	603889	新澳股份	2,300	14,237.00	0.13
228	688369	致远互联	200	14,230.00	0.13
229	003816	中国广核	4,500	14,085.00	0.13
230	000678	襄阳轴承	3,000	14,010.00	0.13
231	000415	渤海租赁	4,800	13,968.00	0.13
232	002948	青岛银行	3,000	13,890.00	0.13
233	002352	顺丰控股	200	13,784.00	0.13
234	688399	硕世生物	100	13,750.00	0.13
235	600111	北方稀土	300	13,740.00	0.13
236	603323	苏农银行	2,800	13,636.00	0.13
237	002636	金安国纪	900	13,545.00	0.13
238	600966	博汇纸业	1,300	13,442.00	0.12
239	000800	一汽解放	1,300	13,377.00	0.12
240	603260	合盛硅业	100	13,197.00	0.12
241	600176	中国巨石	716	13,031.20	0.12
242	000633	合金投资	2,200	13,024.00	0.12
243	002048	宁波华翔	600	12,978.00	0.12
244	301020	密封科技	421	12,815.24	0.12
245	300112	万讯自控	900	12,708.00	0.12
246	600809	山西汾酒	40	12,631.20	0.12
247	688366	昊海生科	100	12,589.00	0.12
248	000425	徐工机械	2,100	12,579.00	0.12
249	002726	龙大美食	1,200	12,552.00	0.12
250	688168	安博通	200	12,414.00	0.11
251	603327	福蓉科技	700	12,320.00	0.11
252	600571	信雅达	1,000	12,240.00	0.11
253	000921	海信家电	800	12,120.00	0.11

254	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.11
255	001296	长江材料	202	11,974.56	0.11
256	600742	一汽富维	1,000	11,960.00	0.11
257	600967	内蒙一机	1,000	11,950.00	0.11
258	300014	亿纬锂能	100	11,818.00	0.11
259	300677	英科医疗	200	11,568.00	0.11
260	002601	龙佰集团	400	11,436.00	0.11
261	603368	柳药股份	600	11,424.00	0.11
262	600741	华域汽车	400	11,320.00	0.10
263	300037	新宙邦	100	11,300.00	0.10
264	300559	佳发教育	1,200	10,872.00	0.10
265	002388	新亚制程	1,900	10,697.00	0.10
266	002714	牧原股份	200	10,672.00	0.10
267	002952	亚世光电	800	10,616.00	0.10
268	600880	博瑞传播	1,400	10,514.00	0.10
269	601006	大秦铁路	1,600	10,240.00	0.09
270	002380	科远智慧	700	10,213.00	0.09
271	688398	赛特新材	200	10,160.00	0.09
272	002876	三利谱	160	9,996.80	0.09
273	688981	中芯国际	188	9,962.12	0.09
274	601607	上海医药	500	9,935.00	0.09
275	600373	中文传媒	800	9,888.00	0.09
276	300601	康泰生物	100	9,854.00	0.09
277	601225	陕西煤业	800	9,760.00	0.09
278	600073	上海梅林	1,200	9,708.00	0.09
279	300417	南华仪器	800	9,696.00	0.09
280	600335	国机汽车	1,100	9,548.00	0.09
281	000823	超声电子	700	9,534.00	0.09
282	688181	八亿时空	200	9,480.00	0.09
283	600048	保利发展	600	9,378.00	0.09
284	601555	东吴证券	1,040	9,214.40	0.09
285	300433	蓝思科技	400	9,192.00	0.09
286	601088	中国神华	400	9,008.00	0.08
287	300408	三环集团	200	8,920.00	0.08
288	603566	普莱柯	400	8,840.00	0.08
289	002043	兔宝宝	700	8,456.00	0.08
290	300015	爱尔眼科	200	8,456.00	0.08
291	603186	华正新材	200	8,358.00	0.08
292	002064	华峰化学	800	8,352.00	0.08
293	000708	中信特钢	400	8,192.00	0.08
294	300628	亿联网络	100	8,145.00	0.08
295	603516	淳中科技	400	8,112.00	0.08
296	000893	亚钾国际	300	7,995.00	0.07

297	688508	芯朋微	69	7,994.34	0.07
298	600835	上海机电	500	7,960.00	0.07
299	300299	富春股份	1,200	7,932.00	0.07
300	603025	大豪科技	300	7,917.00	0.07
301	603599	广信股份	200	7,800.00	0.07
302	600011	华能国际	800	7,752.00	0.07
303	002989	中天精装	300	7,587.00	0.07
304	600352	浙江龙盛	600	7,578.00	0.07
305	002222	福晶科技	400	7,572.00	0.07
306	002233	塔牌集团	700	7,406.00	0.07
307	000028	国药一致	200	7,396.00	0.07
308	603938	三孚股份	200	7,358.00	0.07
309	002949	华阳国际	400	7,320.00	0.07
310	300465	高伟达	600	7,302.00	0.07
311	002367	康力电梯	900	7,227.00	0.07
312	002648	卫星化学	180	7,205.40	0.07
313	002558	巨人网络	600	7,182.00	0.07
314	603383	顶点软件	200	7,180.00	0.07
315	601211	国泰君安	400	7,156.00	0.07
316	600348	华阳股份	600	7,110.00	0.07
317	601688	华泰证券	400	7,104.00	0.07
318	002396	星网锐捷	300	7,071.00	0.07
319	688258	卓易信息	200	7,056.00	0.07
320	002738	中矿资源	100	7,036.00	0.07
321	688004	博汇科技	200	7,032.00	0.07
322	300196	长海股份	400	7,012.00	0.06
323	002281	光迅科技	300	6,987.00	0.06
324	300667	必创科技	300	6,849.00	0.06
325	600332	白云山	200	6,840.00	0.06
326	603517	绝味食品	100	6,833.00	0.06
327	002925	盈趣科技	200	6,806.00	0.06
328	601168	西部矿业	500	6,805.00	0.06
329	600760	中航沈飞	100	6,804.00	0.06
330	601699	潞安环能	600	6,786.00	0.06
331	300380	安硕信息	400	6,784.00	0.06
332	600714	金瑞矿业	500	6,770.00	0.06
333	601001	晋控煤业	700	6,727.00	0.06
334	603118	共进股份	700	6,692.00	0.06
335	002109	兴化股份	1,100	6,655.00	0.06
336	002066	瑞泰科技	600	6,648.00	0.06
337	300515	三德科技	500	6,635.00	0.06
338	002539	云图控股	500	6,635.00	0.06
339	300548	博创科技	200	6,608.00	0.06

340	600219	南山铝业	1,400	6,594.00	0.06
341	600123	兰花科创	700	6,559.00	0.06
342	600756	浪潮软件	500	6,555.00	0.06
343	002955	鸿合科技	300	6,546.00	0.06
344	000550	江铃汽车	400	6,524.00	0.06
345	688579	山大地纬	500	6,500.00	0.06
346	688313	仕佳光子	500	6,445.00	0.06
347	603232	格尔软件	400	6,440.00	0.06
348	002116	中国海诚	900	6,426.00	0.06
349	300891	惠云钛业	400	6,404.00	0.06
350	002517	恺英网络	1,100	6,402.00	0.06
351	002410	广联达	100	6,398.00	0.06
352	300621	维业股份	700	6,391.00	0.06
353	002545	东方铁塔	700	6,384.00	0.06
354	600623	华谊集团	700	6,370.00	0.06
355	300740	水羊股份	400	6,356.00	0.06
356	601233	桐昆股份	300	6,354.00	0.06
357	002642	荣联科技	1,100	6,303.00	0.06
358	002811	郑中设计	700	6,293.00	0.06
359	600810	神马股份	500	6,225.00	0.06
360	603496	恒为科技	400	6,200.00	0.06
361	600831	广电网络	1,000	6,190.00	0.06
362	603602	纵横通信	600	6,168.00	0.06
363	600299	安迪苏	500	6,160.00	0.06
364	603612	索通发展	300	6,156.00	0.06
365	300042	朗科科技	400	6,152.00	0.06
366	600819	耀皮玻璃	1,100	6,138.00	0.06
367	002161	远望谷	1,200	6,096.00	0.06
368	002469	三维化学	900	6,093.00	0.06
369	603106	恒银科技	1,000	6,090.00	0.06
370	603929	亚翔集成	500	6,080.00	0.06
371	002401	中远海科	600	6,072.00	0.06
372	603616	韩建河山	1,000	6,050.00	0.06
373	002137	实益达	1,000	6,050.00	0.06
374	603999	读者传媒	1,100	6,028.00	0.06
375	003013	地铁设计	300	6,024.00	0.06
376	002296	辉煌科技	800	6,016.00	0.06
377	002325	洪涛股份	2,100	6,006.00	0.06
378	601969	海南矿业	500	6,005.00	0.06
379	601900	南方传媒	700	5,992.00	0.06
380	600497	驰宏锌锗	1,200	5,988.00	0.06
381	688009	中国通号	1,200	5,976.00	0.06
382	000636	风华高科	200	5,960.00	0.06

383	002152	广电运通	500	5,950.00	0.06
384	603225	新风鸣	400	5,940.00	0.05
385	688030	山石网科	200	5,932.00	0.05
386	000156	华数传媒	700	5,922.00	0.05
387	300747	锐科激光	100	5,911.00	0.05
388	600958	东方证券	400	5,896.00	0.05
389	002254	泰和新材	300	5,883.00	0.05
390	000761	本钢板材	1,400	5,880.00	0.05
391	000960	锡业股份	300	5,859.00	0.05
392	601666	平煤股份	700	5,859.00	0.05
393	601949	中国出版	1,000	5,840.00	0.05
394	600728	佳都科技	700	5,831.00	0.05
395	600853	龙建股份	2,100	5,817.00	0.05
396	600502	安徽建工	1,400	5,810.00	0.05
397	300504	天邑股份	300	5,802.00	0.05
398	002421	达实智能	1,500	5,790.00	0.05
399	300595	欧普康视	100	5,737.00	0.05
400	603003	龙宇燃油	800	5,712.00	0.05
401	002062	宏润建设	1,400	5,684.00	0.05
402	300592	华凯创意	300	5,616.00	0.05
403	300493	润欣科技	700	5,586.00	0.05
404	600231	凌钢股份	2,100	5,586.00	0.05
405	600551	时代出版	700	5,579.00	0.05
406	300711	广哈通信	400	5,572.00	0.05
407	002065	东华软件	700	5,460.00	0.05
408	002241	歌尔股份	100	5,410.00	0.05
409	002555	三七互娱	200	5,404.00	0.05
410	000851	高鸿股份	900	5,382.00	0.05
411	002541	鸿路钢构	100	5,354.00	0.05
412	300529	健帆生物	100	5,330.00	0.05
413	600919	江苏银行	900	5,247.00	0.05
414	300550	和仁科技	400	5,140.00	0.05
415	601636	旗滨集团	300	5,130.00	0.05
416	603217	元利科技	100	5,068.00	0.05
417	000949	新乡化纤	900	5,049.00	0.05
418	300721	怡达股份	100	5,010.00	0.05
419	688118	普元信息	200	4,884.00	0.05
420	601216	君正集团	900	4,707.00	0.04
421	688055	龙腾光电	675	4,623.75	0.04
422	601658	邮储银行	900	4,590.00	0.04
423	600438	通威股份	100	4,496.00	0.04
424	300596	利安隆	100	4,476.00	0.04
425	002978	安宁股份	100	4,228.00	0.04

426	600010	包钢股份	1,500	4,185.00	0.04
427	002129	中环股份	100	4,175.00	0.04
428	300768	迪普科技	100	4,125.00	0.04
429	600406	国电南瑞	100	4,003.00	0.04
430	001234	泰慕士	222	3,669.66	0.03
431	002493	荣盛石化	200	3,632.00	0.03
432	601009	南京银行	400	3,584.00	0.03
433	000001	平安银行	200	3,296.00	0.03
434	601628	中国人寿	100	3,009.00	0.03
435	600690	海尔智家	100	2,989.00	0.03
436	002007	华兰生物	100	2,914.00	0.03
437	601155	新城控股	100	2,913.00	0.03
438	601800	中国交建	300	2,574.00	0.02
439	600926	杭州银行	200	2,564.00	0.02
440	601618	中国中冶	600	2,298.00	0.02
441	600886	国投电力	200	2,294.00	0.02
442	601816	京沪高铁	400	1,932.00	0.02
443	300498	温氏股份	100	1,926.00	0.02
444	000338	潍柴动力	100	1,789.00	0.02
445	600327	大东方	300	1,785.00	0.02
446	002533	金杯电工	200	1,722.00	0.02
447	002202	金风科技	100	1,647.00	0.02
448	600018	上港集团	300	1,644.00	0.02
449	000166	申万宏源	300	1,536.00	0.01
450	000876	新希望	100	1,521.00	0.01
451	000625	长安汽车	100	1,519.00	0.01
452	601238	广汽集团	100	1,519.00	0.01
453	600707	彩虹股份	200	1,364.00	0.01
454	600025	华能水电	200	1,318.00	0.01
455	600606	绿地控股	300	1,302.00	0.01
456	600383	金地集团	100	1,297.00	0.01
457	601360	三六零	100	1,272.00	0.01
458	601989	中国重工	300	1,266.00	0.01
459	300639	凯普生物	42	1,239.42	0.01
460	002111	威海广泰	100	1,224.00	0.01
461	002736	国信证券	100	1,148.00	0.01
462	600109	国金证券	100	1,133.00	0.01
463	601881	中国银河	100	1,119.00	0.01
464	603993	洛阳钼业	200	1,116.00	0.01
465	601108	财通证券	100	1,112.00	0.01
466	000703	恒逸石化	100	1,062.00	0.01
467	601916	浙商银行	300	1,050.00	0.01
468	600655	豫园股份	100	1,030.00	0.01

469	600918	中泰证券	100	997.00	0.01
470	601990	南京证券	100	991.00	0.01
471	601377	兴业证券	100	988.00	0.01
472	601111	中国国航	100	913.00	0.01
473	600409	三友化工	100	870.00	0.01
474	002602	世纪华通	100	839.00	0.01
475	600489	中金黄金	100	823.00	0.01
476	600061	国投资本	100	822.00	0.01
477	600939	重庆建工	200	818.00	0.01
478	601928	凤凰传媒	100	809.00	0.01
479	002044	美年健康	100	785.00	0.01
480	601901	方正证券	100	784.00	0.01
481	000783	长江证券	100	754.00	0.01
482	688595	芯海科技	6	746.70	0.01
483	002600	领益智造	100	736.00	0.01
484	002252	上海莱士	100	682.00	0.01
485	600029	南方航空	100	681.00	0.01
486	601158	重庆水务	100	641.00	0.01
487	600795	国电电力	200	634.00	0.01
488	600115	中国东航	100	516.00	0.00
489	601933	永辉超市	100	405.00	0.00
490	601162	天风证券	100	405.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	35,362,087.17	6.28
2	601318	中国平安	27,030,247.95	4.80
3	600519	贵州茅台	24,340,972.00	4.32
4	000725	京东方 A	21,519,848.00	3.82
5	601818	光大银行	20,768,796.30	3.69
6	300124	汇川技术	17,803,084.22	3.16
7	000001	平安银行	16,951,355.88	3.01
8	002714	牧原股份	16,069,338.73	2.85
9	600887	伊利股份	15,994,856.27	2.84
10	600900	长江电力	15,904,878.62	2.82
11	601166	兴业银行	15,834,188.13	2.81
12	002027	分众传媒	15,275,614.67	2.71
13	002460	赣锋锂业	13,735,485.34	2.44
14	300059	东方财富	12,981,122.70	2.30
15	002142	宁波银行	12,063,012.20	2.14

16	601857	中国石油	12,032,433.00	2.14
17	600015	华夏银行	11,884,182.20	2.11
18	603806	福斯特	11,735,411.90	2.08
19	300408	三环集团	11,702,201.61	2.08
20	600153	建发股份	11,445,814.00	2.03

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	60,308,444.76	10.71
2	000333	美的集团	49,852,159.66	8.85
3	600519	贵州茅台	25,731,102.00	4.57
4	000725	京东方 A	24,509,159.99	4.35
5	601166	兴业银行	23,547,003.05	4.18
6	601857	中国石油	22,562,690.00	4.01
7	000002	万科 A	21,632,662.81	3.84
8	601818	光大银行	20,874,274.00	3.71
9	601328	交通银行	20,787,519.00	3.69
10	600900	长江电力	20,586,460.26	3.65
11	600887	伊利股份	20,251,265.55	3.60
12	600015	华夏银行	19,645,292.14	3.49
13	300124	汇川技术	19,403,009.40	3.44
14	002714	牧原股份	19,072,945.45	3.39
15	601668	中国建筑	19,004,077.00	3.37
16	601398	工商银行	18,702,642.28	3.32
17	600028	中国石化	17,533,787.00	3.11
18	000001	平安银行	17,428,459.43	3.09
19	002460	赣锋锂业	16,389,723.25	2.91
20	002027	分众传媒	16,183,329.00	2.87
21	002142	宁波银行	14,966,905.96	2.66
22	601186	中国铁建	14,301,072.82	2.54
23	601601	中国太保	13,982,731.16	2.48
24	600104	上汽集团	13,848,740.83	2.46
25	601390	中国中铁	13,795,872.00	2.45
26	601088	中国神华	13,744,604.00	2.44
27	600309	万华化学	13,574,818.74	2.41
28	600019	宝钢股份	13,505,715.37	2.40
29	603486	科沃斯	13,420,572.00	2.38
30	300059	东方财富	13,256,616.40	2.35
31	600153	建发股份	12,224,016.19	2.17
32	603806	福斯特	11,968,238.60	2.12
33	600809	山西汾酒	11,809,900.77	2.10

34	601799	星宇股份	11,615,303.11	2.06
35	601888	中国中免	11,582,919.69	2.06
36	600919	江苏银行	11,532,690.10	2.05
37	601838	成都银行	11,524,341.70	2.05
38	000651	格力电器	11,442,953.34	2.03

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,910,900,722.35
卖出股票的收入（成交）总额	2,441,909,223.74

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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）	100,792.01	0.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,792.01	0.93

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	113050	南银转债	430	50,877.60	0.47
2	127041	弘亚转债	186	22,954.26	0.21
3	113052	兴业转债	180	18,000.00	0.17
4	113627	太平转债	50	6,014.00	0.06
5	127038	国微转债	15	2,946.15	0.03

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计					-
股指期货投资本期收益					1,694,970.87
股指期货投资本期公允价值变动					-1,944,240.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本报告期内，本基金投资的前十名证券中除招商银行(600036)、交通银行(601328)、兴业银行(601166)、工商银行(601398)、成都银行(601838)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：2021 年 7 月 16 日，因存在：1、理财业务和同业业务制度不健全；2、理财业务数据与事实不符；3、部分理财业务发展与监管导向不符；4、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；5、理财资金违规投向土地储备项目；6、理财产品相互交易调节收益；7、面向非机构投资者发行的理财产品投资不良资产支持证券；8、公募理财产品投资单只证券超限额；9、理财资金违规投向交易所上市交易的股票；10、理财资金投资非标资产比照贷款管理不到位等违规行为，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021 年 8 月 5 日，因存在 1.违规办理内保外贷业务 2.未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料 3.违反外汇市场交易管理规定 4.未按规定保存交易通讯记录 5.违规办理银行卡业务的违规行为，国家外汇管理局福建省分局对兴业银行股份有限公司处以罚款等行政处罚。2021 年 8 月 20 日，因存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，中国人民银行对兴业银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

主要违规事实：2021 年 1 月 8 日，因存在 1.为虚假并购交易发放信贷资金；2.越权审批；3.未对集团客户授信进行统一管理；4.贷款“三查”严重不尽职；5.违规开展理财业务；6.内部监督检查不到位；7.内部管理存在缺陷等违规行为；中国银行保险监督管理委员会重庆监管局对中国工商银行股份有限公司重庆市分行处以罚款的公开处罚。

主要违规事实：2021 年 9 月 3 日，因存在信贷资产分类不准确；不按项目进度放款；未对集团客户统一授信；违规办理同业投资等违规行为，中国银行保险监督管理委员会重庆监管局对成都银行股份有限公司处以罚款的行政处罚。

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。

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

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	67,337.85
2	应收证券清算款	72,783.87
3	应收股利	-
4	应收利息	428.39
5	应收申购款	13,623.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	154,173.52

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113050	南银转债	50,877.60	0.47
2	127038	国微转债	2,946.15	0.03

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688499	利元亨	397,308.00	3.68	首次公开发行限售

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	675	5,961.85	0.00	0.00%	4,024,249.48	100.00%
博时量化价值股票 C	459	6,528.03	0.00	0.00%	2,996,364.72	100.00%
合计	1,068	6,573.61	0.00	0.00%	7,020,614.20	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	73,153.61	1.82%
	博时量化价值股票 C	50.00	0.00%
	合计	73,203.61	1.04%

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	博时量化价值股票 A	0~10
	博时量化价值股票 C	-

部门负责人持有本 开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持 有本开放式基金	博时量化价值股票 A	0~10
	博时量化价值股票 C	-
	合计	0~10

§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
本报告期期初基金份额总额	5,160,504.50	404,719,320.40
本报告期基金总申购份额	4,318,911.06	25,021,244.80
减：本报告期基金总赎回份额	5,455,166.08	426,744,200.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,024,249.48	2,996,364.72

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人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》，高阳先生任博时基金管理有限公司总经理。

基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内重大人事变动情况：2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

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

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。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	
中信证券	1	26,275,476.67	0.61%	24,471.01	0.61%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	1,880,899.18	0.04%	1,504.75	0.04%	-
国金证券	1	11,085.60	-	10.33	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	521,791,403.12	12.02%	486,139.93	12.10%	-
海通证券	1	76,557,262.09	1.76%	55,989.42	1.39%	新增 1 个
申万宏源	2	2,356,773,042.83	54.28%	2,194,883.57	54.61%	-
中金公司	1	339,613,481.09	7.82%	316,284.41	7.87%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	177,962,587.44	4.10%	165,739.04	4.12%	-
申港证券	2	48,075,632.22	1.11%	35,758.99	0.89%	新增 2 个
国泰君安	1	168,023,363.47	3.87%	156,476.84	3.89%	-
国信证券	2	624,835,571.67	14.39%	581,909.92	14.48%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48 号）的有关规定要求，我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服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能

力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	12,168,095.43	99.99%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	1,610.76	0.01%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	博时基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北京证券交易所股票的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-11-26
2	博时量化价值股票型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-10-27
3	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-30
4	博时量化价值股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基	2021-09-30

		金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
5	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20210928	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-09-28
6	博时量化价值股票型证券投资基金 2021 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-31
7	博时量化价值股票型证券投资基金(博时量化价值股票 A)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-25
8	博时量化价值股票型证券投资基金(博时量化价值股票 C)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-08-25
9	博时量化价值股票型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-21
10	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-07-01
11	博时量化价值股票型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-06-23
12	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-29
13	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-05-26
14	博时基金管理有限公司关于暂停使用通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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-28
15	博时基金管理有限公司关于暂停使用上海银联支付提供	中国证券报、基	2021-04-24

	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	金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
16	博时量化价值股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-04-22
17	博时量化价值股票型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-31
18	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-30
19	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-20
20	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-03-10
21	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-20
22	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-02-06
23	博时量化价值股票型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2021-01-22

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
机构	1	2021-06-30~2021-12-16	-	20,522,643.32	20,522,643.32	-	-
	2	2021-01-01~2021-06-29;2021-09-02~2021-11-11	200,878,839.88	-	200,878,839.88	-	-
	3	2021-01-01~2021-06-29	100,727,585.22	-	100,727,585.22	-	-
	4	2021-01-01~2021-06-21	100,438,839.88	-	100,438,839.88	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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 中国证券监督管理委员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
二〇二二年三月三十日