

博时量化平衡混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64

7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	66
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化平衡混合型证券投资基金
基金简称	博时量化平衡混合
基金主代码	004495
交易代码	004495
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 4 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	556, 523, 613. 43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用平衡型配置，严格控制最大回撤，基于多个逻辑不同的量化择时策略，最大程度地去过滤下跌，减少回撤，力争获取长期相对稳定的收益。
投资策略	本基金的量化多策略体系是在大类资产配置策略的基础之上，基于多因子模型、事件驱动类策略以及量化择时模型等多种量化策略进行择时和选股，并同时运用股指期货进行适量系统性风险对冲的绝对收益策略体系。主要包括：1、大类资产配置策略，本基金的大类资产配置策略主要是基于对宏观经济周期运行规律的研究予以决策，根据经济周期决定股票资产和债券资产的投资比例，以实现股债的平衡配置；2、量化择时策略，博时基金的量化多策略择时体系以择时策略的多逻辑、多期限以及多品种为目标进行设计和开发，在各品种上综合考虑基本面和市场面的择时模型，从而形成对品种的长、中、短期趋势和方向的判断。基金经理根据市场的实际情况，综合前瞻性地运用各种择时策略进行操作；3、量化选股策略，博时的量化选股策略体系包括基本面策略、市场面策略以及基本面和市场面结合的策略，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特征；4、其他投资策略包括：债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券的投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资融券交易策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数（总财富）收益率×80%。
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产品和货币市场基金，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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799

电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	95105568	95588
传真	0755-83195140	010-66105798
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55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55号
邮政编码	518040	100140
法定代表人	江向阳	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市建国门内大街 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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-34,929,972.26
本期利润	-51,788,341.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0701
本期加权平均净值利润率	-4.74%
本期基金份额净值增长率	-2.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	254,455,833.15
期末可供分配基金份额利润	0.4572
期末基金资产净值	810,979,446.58
期末基金份额净值	1.4572
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	56.64%

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

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

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

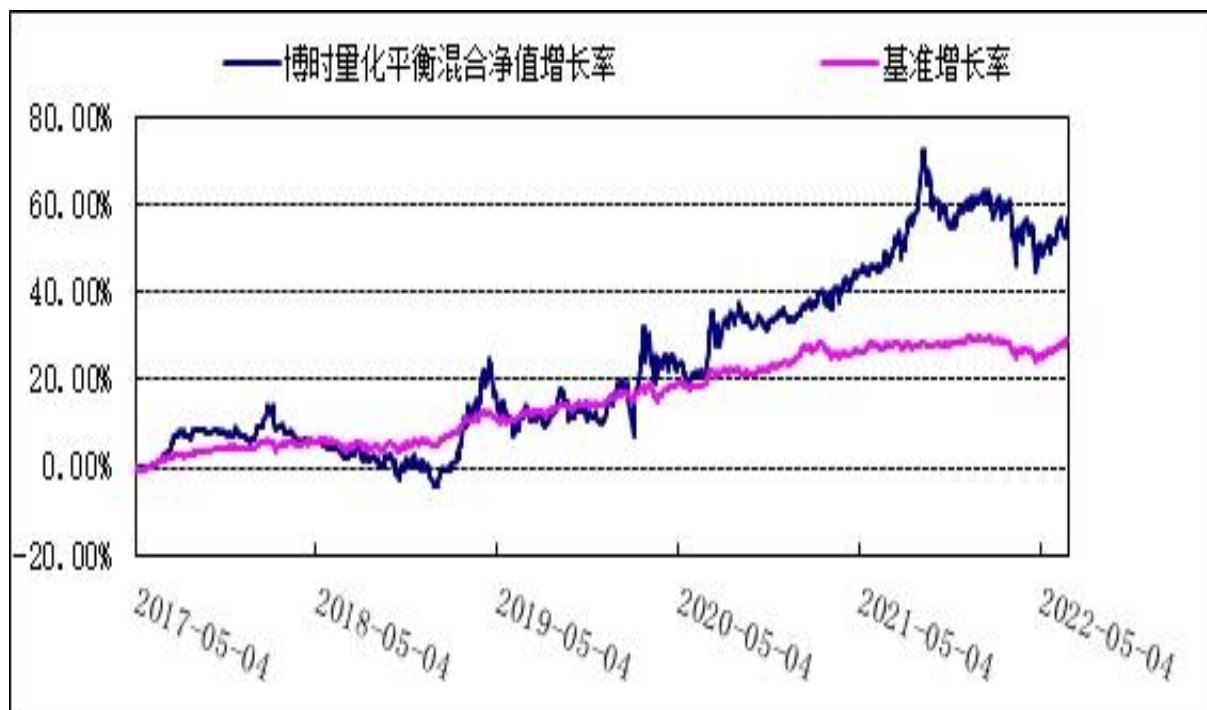
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.32%	0.68%	1.87%	0.21%	1.45%	0.47%
过去三个月	1.92%	0.98%	2.16%	0.28%	-0.24%	0.70%
过去六个月	-2.56%	0.99%	-0.29%	0.29%	-2.27%	0.70%
过去一年	5.47%	0.92%	0.99%	0.25%	4.48%	0.67%
过去三年	39.57%	0.94%	15.10%	0.25%	24.47%	0.69%
自基金合同生效起至今	56.64%	0.86%	29.34%	0.25%	27.30%	0.61%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*20%+中债综合指数（总财富）收益率*80%。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 80%、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



§ 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 2022 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 327 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 16491 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 5557 亿元人民币，累计分红逾 1678 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		
林景艺	基金经理	2017-05-04	-	11.9	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 日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日一至今)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2022 年 2 月 28 日一至今)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部总经理/基金经理	2017-05-04	-	19.9	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总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016

					年 10 月 24 日)、博时价值增长贰号证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2018 年 6 月 21 日)的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日一至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日一至今)的基金经理。
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	-	11.9	李庆阳先生, 硕士。2010 年从华南理工大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司, 历任高级程序员、高级系统运维经理。2016 年调任博时资本, 任投资经理。2018 年再次加入博时基金管理有限公司, 现任基金经理助理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 10 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

2022 年上半年，海外经济重启和俄乌冲突地缘政治因素推升大宗商品价格上行，引致通胀高企，由此进一步带来美欧等发达经济体货币政策收紧和增长预期下行，因此上半年国际股票市场呈现较大的波动，主要市场指数都出现下跌。国内，稳增长政策持续推进，叠加疫情反复，地产行业情况尚未显著改善，部分消费和成长行业景气有所下降，导致市场整体的风险偏好显著下降。A 股市场呈现先跌后涨的走势，开年之后上证综指一度跌到 2900 点以下，5 月份，随着动态清零政策有效控制住疫情蔓延，国务院召开全国稳住经济大盘电视电话会议，国常会决定实施多方面措施推动经济回归正常轨道，市场信心显著提升，A 股才进入一段显著的底部反弹。但是整个上半年，A 股市场整体表现还是以下跌告终，主要市场指数跌幅都在 5% 以上，只有红利指数获得正收益。风格方面，上半年整体上大盘风格好于小盘风格，价值风格好于成长风格，但是其中的结构分化和轮动也较为频繁，尚未形成中长期的显著趋势。行业方面，分化也显著加大，中信一级行业指数中，煤炭、消费者服务和交通运输三个行业获得正收益，计算机、综合金融、传媒和电子行业跌幅超过 20%。

债券市场方面，利率债较为平稳，在稳增长政策持续发力的情况下，国内的信用环境有所改善，信用利差下行，信用债在宽信用的政策环境中普遍获得正收益，但是地产债的风险依然还在不断释放中，转债受到股票市场的影响出现回撤，估值显著下修。

本基金在 2022 年上半年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了中高水平的股票平均仓位。选股方面，出于绝对收益的考虑组合超配价值风格，获得一定超额收益；基金也维持了较高仓位的中低风险转债的配置，所以上半年净值在股票和转债市场集体下挫的环境中有所回撤。5 月份以来市场底部反弹的积极情绪是否能持续全年尚待更多时间的验证，投资者较为担忧的比如疫情反复、俄乌冲突、通胀和美联储加息等问题都还具有较大的不确定性，所以未来市场的波动性也会一直维持在较高的位置。但是考虑到当前市场估值已经显著下调，价值型股票和转债的估值又到相对底部区域，叠加稳增长政策持续发力，在这样的位置上，我们对于未来的市场特别是低估值板块并不悲观。未来本基金将持续通过量化多策略体系充分挖掘和利用股票及债券市场的规律，注重资产本身的收益能力和空间，保持在追求稳健收益的同时，注重回撤风险的控制，力争获得平稳的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.4572 元，份额累计净值为 1.5613 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为-2.56%，同期业绩基准增长率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，在宏观经济层面，海外环境仍然不佳，俄乌冲突局势无改善，通胀仍处高位，加息预期易上难下，但是从二季度开始，海外市场对于中国 A 股的影响显著减弱，A 股市场的主要驱动力还是来自于国内的经济和政策基本面。国内方面，经济需求端的影响因素主要是疫情和地产下行，但疫情影响最严重的时候已经过去，消费需求将环比恢复，政策方面未来一段时间大概率处于稳信用、宽货币的状态，地产政策也边际开始放松，从经济周期看，我们认为国内先于海外进入衰退，也将率先进入复苏阶段，新冠疫情防控形势依然还会是影响下半年经济复苏的主要约束。

股票市场层面，尽管多数行业的盈利仍处于底部阶段，但当前市场估值也处于较低水平，中小盘股票的估值处于过去十年底部，白马成长股票的估值也回落至中值以下水平，在经济没有完全复苏之前，整体流动性也会保持相对宽松状态。从股债相对估值来看，目前整体处在历史底部区域，股票资产的性价比很高，所以我们对权益市场并不悲观。风格上下半年大概率还是会持续震荡，这给策略配置带来一定的难度，我们需要从更加长期的逻辑出发，提高对于策略短期波动的耐心。大盘成长相对大盘价值的估值差异在 2021 年春节前达到历史顶点之后开始震荡回归，当前依然位于历史较高的位置，价值策略的超额收益位于中长期的底部，因此相比前几年大家追逐的成长股，价值风格的性价比更高。大小盘方面，当前仍处于流动性充裕的环境下，叠加中证 1000 股指期货和期权的推出进一步激发小盘股的配置需求，小盘板块依然会有一些的机会。板块方面，当前从盈利增长和稳定性上看，周期和消费依然相对具有优势，同时金融板块的估值位于历史底部，可能随着价值风格的变化而有所表现。同时，港股市场当前仍然相对低迷，受到海外的影响今年以来估值进一步受到压制，AH 股溢价指数当前依然处于过去 10 年的高位，意味着两地上市 H 股价格显著低于 A 股。港股通资金占用比例还在持续增大，表明香港市场已成为内地资金的重要资产配置市场，因此我们认为长期来看港股性价比好于 A 股，但是需要在其中进行板块和股票的精选，避免个股层面的价值陷阱。

债券市场方面，当前已经处于货币政策的宽松时期，距离十年期国债利率的底部不远，未来流动性边际宽松的空间也较为有限，利率债的胜率相比年初有所降低。信用债方面，信用宽松下半年大概率会维持，但是高风险信用债特别是地产债的风险释放还未结束。权益市场的下行也降低了转债估值系统性下挫风险，估值的阶段调整提供配置机会。转债市场的持续扩容给我们提供了足够的投资广度，虽然当前整体转债的估值不如前几年低，但是从量化策略的角度，转债资产中依然存在较多的投资机会。

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 2022 年 3 月 24 日发布公告，以 2022 年 3 月 18 日可分配利润为基准，每 10 份基金份额发放红利 0.6010 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.4.1	73,792,111.33	84,670,868.17
结算备付金		5,878,364.76	8,277,369.95
存出保证金		202,975.22	182,868.13
交易性金融资产	6.4.4.2	760,217,088.43	1,073,754,589.84
其中：股票投资		314,962,738.56	457,159,483.75
基金投资		-	-
债券投资		445,254,349.87	616,595,106.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.4.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.4.4	-	-
应收清算款		-	195,968.08
应收股利		-	-
应收申购款		50,487.54	185,851.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.4.5	-	1,903,450.65
资产总计		840,141,027.28	1,169,170,966.52
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.4.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,086,875.26	-
应付赎回款		21,336,881.69	167,537.65
应付管理人报酬		1,072,368.32	1,479,828.17
应付托管费		178,728.06	246,638.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,221.09	7,794.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.4.6	1,484,506.28	2,365,914.09
负债合计		29,161,580.70	4,267,712.41
净资产：			
实收基金	6.4.4.7	556,523,613.43	747,145,531.52
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.4.8	254,455,833.15	417,757,722.59
净资产合计		810,979,446.58	1,164,903,254.11
负债和净资产总计		840,141,027.28	1,169,170,966.52

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4572 元，基金份额总额 556,523,613.43 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
一、营业总收入		-42,146,721.57	70,934,679.72
1. 利息收入		196,968.54	2,309,050.15
其中：存款利息收入	6.4.4.9	196,968.54	192,122.02
债券利息收入		-	1,796,444.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	320,484.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-26,031,295.30	43,004,012.52
其中：股票投资收益	6.4.4.10	-48,514,608.18	23,229,640.57
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.4.11	16,095,532.71	17,156,550.37
资产支持证券投资收益	6.4.4.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.4.13	-	47,242.72
股利收益	6.4.4.14	6,387,780.17	2,570,578.86
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.4.15	-16,858,369.10	24,681,819.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.4.16	545,974.29	939,797.49
减：二、营业总支出		9,641,619.79	9,378,352.89
1. 管理人报酬		8,177,503.87	4,835,646.57
2. 托管费		1,362,917.32	805,941.09
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.4.17	-	-
7. 税金及附加		2,206.56	3,313.53
8. 其他费用	6.4.4.18	98,992.04	3,733,451.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-51,788,341.36	61,556,326.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-51,788,341.36	61,556,326.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-51,788,341.36	61,556,326.83

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	747,145,531.52	-	417,757,722.59	1,164,903,25

(基金净值)				4.11
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	747,145,531.52	-	417,757,722.59	1,164,903,254.11
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-190,621,918.09	-	-163,301,889.44	-353,923,807.53
(一)、综合收益总额	-	-	-51,788,341.36	-51,788,341.36
(二)、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)	-190,621,918.09	-	-67,823,146.92	-258,445,065.01
其中: 1. 基金申购款	151,521,802.71	-	85,425,754.18	236,947,556.89
2. 基金赎回款	-342,143,720.80	-	-153,248,901.10	-495,392,621.90
(三)、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)	-	-	-43,690,401.16	-43,690,401.16
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	556,523,613.43	-	254,455,833.15	810,979,446.58
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	585,989,618.97	-	205,865,315.04	791,854,934.01
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	585,989,618.97	-	205,865,315.04	791,854,934.01
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-97,460,166.88	-	9,280,507.16	-88,179,659.72

（一）、综合收益总额	-	-	61,556,326.83	61,556,326.83
（二）、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）	-97,460,166.88	-	-31,716,009.38	-129,176,176.26
其中：1. 基金申购款	153,375,284.67	-	64,878,070.52	218,253,355.19
2. 基金赎回款	-250,835,451.55	-	-96,594,079.90	-347,429,531.45
（三）、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）	-	-	-20,559,810.29	-20,559,810.29
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	488,529,452.09	-	215,145,822.20	703,675,274.29

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：佘方方

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

除下述会计政策和会计估计外，本基金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。

6.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变

动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计

算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及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;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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;于处置时,其处置价格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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外,财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号),中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 84,670,868.17 元、8,277,369.95 元、182,868.13 元、1,903,450.65 元、195,968.08 元和 185,851.70 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 84,680,179.53 元、8,281,467.23 元、182,958.66 元、0.00 元、195,968.08 元和 185,851.70 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,073,754,589.84 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,075,644,541.32 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 167,537.65 元、1,479,828.17 元、246,638.03 元、2,186,246.80 元和 167.29 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 167,537.65 元、1,479,828.17 元、246,638.03 元、2,186,246.80 元和 167.29 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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[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]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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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。

(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。

6.4.4 重要财务报表项目的说明

6.4.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	73,792,111.33
等于：本金	73,785,780.32
加：应计利息	6,331.01
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	73,792,111.33

6.4.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	305,765,741.72	-	314,962,738.56	9,196,996.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	428,171,849.94	1,243,494.36	445,254,349.87	15,839,005.57
交易所市场				

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	428,171,849.94	1,243,494.36	445,254,349.87	15,839,005.57
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		733,937,591.66	1,243,494.36	760,217,088.43	25,036,002.41

6.4.4.3 衍生金融资产/负债

6.4.4.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.4.4 买入返售金融资产

6.4.4.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.4.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.4.5 其他资产

无余额。

6.4.4.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40,709.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,352,516.01
其中：交易所市场	1,352,516.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,280.45
合计	1,484,506.28

6.4.4.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	747,145,531.52	747,145,531.52
本期申购	151,521,802.71	151,521,802.71
本期赎回（以“-”号填列）	-342,143,720.80	-342,143,720.80
本期末	556,523,613.43	556,523,613.43

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）。

6.4.4.8 未分配利润

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	417,443,864.72	313,857.87	417,757,722.59
本期利润	-34,929,972.26	-16,858,369.10	-51,788,341.36
本期基金份额交易产生的变动数	-84,029,640.52	16,206,493.60	-67,823,146.92
其中：基金申购款	83,733,658.62	1,692,095.56	85,425,754.18
基金赎回款	-167,763,299.14	14,514,398.04	-153,248,901.10
本期已分配利润	-43,690,401.16	-	-43,690,401.16
本期末	254,793,850.78	-338,017.63	254,455,833.15

6.4.4.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	145,966.45
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	48,171.71
其他	2,830.38
合计	196,968.54

6.4.4.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	2,014,069,201.51
减：卖出股票成本总额	2,056,911,239.08
减：交易费用	5,672,570.61
买卖股票差价收入	-48,514,608.18

6.4.4.11 债券投资收益

6.4.4.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,152,497.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,943,034.89
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	16,095,532.71

6.4.4.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	579,207,084.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	563,467,303.03
减：应计利息总额	1,780,342.74
减：交易费用	16,403.43
买卖债券差价收入	13,943,034.89

6.4.4.12 资产支持证券投资收益

6.4.4.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.4.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.4.13 衍生工具收益

6.4.4.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.4.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.4.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,387,780.17
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	6,387,780.17

6.4.4.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-16,858,369.10
——股票投资	3,433,441.59
——债券投资	-20,291,810.69
——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	-16,858,369.10

6.4.4.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	542,319.61
基金转换费收入	3,654.68
合计	545,974.29

6.4.4.17 信用减值损失

无。

6.4.4.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,211.59
中债登账户维护费	9,000.00
合计	98,992.04

6.4.5 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.5.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.5.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	656,287,258.47	17.27%	77,120,078.23	3.15%

6.4.7.1.2 权证交易

无。

6.4.7.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	136,302,383.33	15.34%	46,325,864.53	5.71%

6.4.7.1.4 债券回购交易

无。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2022 年 1 月 1 日至 2022 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	611,203.49	18.66%	265,349.05	19.62%
关联方名称	上年度可比期间 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	71,824.37	3.36%	-	-

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。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,177,503.87	4,835,646.57
其中：支付销售机构的客户维护费	130,421.78	22,982.84

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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,362,917.32	805,941.09

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。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.7.4 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

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期初持有的基金份额	-	-	1,856,029.64
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	1,856,029.64	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	0.38%

6.4.7.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.7.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国工商银行-活期存款	73,792,111.33	145,966.45	47,705,415.48	124,358.51

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。

6.4.7.7 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 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	002948	青岛银行	网下发行	6,780.00	21,696.00
招商证券	301123	奕东电子	网下发行	6,551.00	243,893.73
招商证券	600030	中信证券	配股	12,660.00	182,683.80
招商证券	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.7.8 其他关联交易事项的说明

6.4.7.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.8 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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
		场内	场外					
1	2022-03-28	-	2022-03-28	0.6010	34,834,609.60	8,855,791.56	43,690,401.16	-
合计				0.6010	34,834,609.60	8,855,791.56	43,690,401.16	-

6.4.9 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021-12-24	6 个月	首次公开发行限售	57.58	60.26	87,363.00	5,030,361.54	5,264,494.38	-
600938	中国海油	2022-04-14	6 个月	首次公开发行限售	10.80	15.86	84,004.00	907,243.20	1,332,303.44	-
688238	和元生物	2022-03-15	6 个月	首次公开发行限售	13.23	25.32	12,836.00	169,820.28	325,007.52	-
688400	凌云光	2022-06-27	7 个交易日	新股未上	21.93	21.93	12,839.00	281,559.27	281,559.27	-

				市						
688322	奥比中光	2022-06-30	5 个交易日	新股未上市	30.99	30.99	8,529.00	264,313.71	264,313.71	-
301175	中科环保	2022-06-30	6 个交易日	新股未上市	3.82	3.82	57,324.00	218,977.68	218,977.68	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个交易日	新股未上市	38.46	38.46	5,085.00	195,569.10	195,569.10	-
688237	超卓航科	2022-06-24	5 个交易日	新股未上市	41.27	41.27	2,891.00	119,311.57	119,311.57	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6 个月	首次公开发行限售	19.18	32.07	2,670.00	51,210.60	85,626.90	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8 个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418.00	58,875.36	58,875.36	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6 个月	首次公开发行限售	17.27	14.83	3,221.00	55,626.67	47,767.43	-
301236	软通动力	2022-03-08	6 个月	首次公开发行限售	48.57	31.38	1,454.00	70,620.72	45,626.52	-
301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	首次公开发行限售	76.56	51.92	800.00	61,248.00	41,536.00	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	首次公开发行限售	72.82	45.69	743.00	54,103.50	33,947.67	-
301150	中一科技	2022-04-14	6 个月	首次公开发行限售	108.91	82.76	404.00	43,997.64	33,435.04	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6 个月	首次公开发行限售	35.68	29.84	1,120.00	39,961.60	33,420.80	-

301207	华兰疫苗	2022-02-10	6 个月	首次公开发售	56.88	56.42	569.00	32,364.72	32,102.98	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6 个月	首次公开发售	96.60	87.82	353.00	34,100.08	31,000.46	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6 个月	首次公开发售	3.80	6.39	4,743.00	18,023.40	30,307.77	-
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	首次公开发售	52.03	56.42	466.00	24,245.98	26,291.72	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6 个月	首次公开发售	26.86	47.07	517.00	13,886.62	24,335.19	-
301175	中科环保	2022-06-30	6 个月	首次公开发售	3.82	3.82	6,370.00	24,333.40	24,333.40	-
301268	铭利达	2022-03-29	6 个月	首次公开发售	28.50	34.87	641.00	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	首次公开发售	38.46	38.46	566.00	21,768.36	21,768.36	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6 个月	首次公开发售	19.93	31.38	682.00	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	首次公开发售	50.31	70.37	301.00	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月	首次公开发售	39.88	31.09	642.00	25,602.96	19,959.78	-
30118	欧圣	2022-	6 个月	首次	21.33	22.54	876.0	18,68	19,74	-

7	电气	04-13		公开发 行 限售			0	5.08	5.04	
30125 6	华融 化学	2022- 03-14	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	8.05	10.08	1,831 .00	14,73 9.55	18,45 6.48	-
30116 2	国能 日新	2022- 04-19	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	45.13	54.11	334.0 0	15,07 3.42	18,07 2.74	-
30111 2	信邦 智能	2022- 06-20	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	27.53	45.04	399.0 0	10,98 4.47	17,97 0.96	-
30115 3	中科 江南	2022- 05-10	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	33.68	43.98	398.0 0	13,40 4.64	17,50 4.04	-
30112 3	奕东 电子	2022- 01-14	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	37.23	25.39	656.0 0	24,42 2.88	16,65 5.84	-
30128 6	侨源 股份	2022- 06-06	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	16.91	19.79	784.0 0	13,25 7.44	15,51 5.36	-
30116 0	翔楼 新材	2022- 05-25	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	31.56	37.66	392.0 0	12,37 1.52	14,76 2.72	-
30111 7	佳缘 科技	2022- 01-07	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	46.80	54.44	262.0 0	12,26 1.60	14,26 3.28	-
30121 2	联盛 化学	2022- 04-07	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	29.67	33.28	416.0 0	12,34 2.72	13,84 4.48	-
30129 8	东利 机械	2022- 05-27	6 个月	首次 公 开 发 行 限 售	12.68	20.83	634.0 0	8,039 .12	13,20 6.22	-
30114 8	嘉戎 技术	2022- 04-14	6 个月	首次 公 开	38.39	23.90	516.0 0	19,80 9.24	12,33 2.40	-

				发行 限售							
30125 8	富 士 莱	2022- 03-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	48.30	41.68	295.0 0	14,24 8.50	12,29 5.60	-	
30125 9	艾 布 鲁	2022- 04-18	6 个月	首次 公开 发行 限售	18.39	24.94	483.0 0	8,882 .37	12,04 6.02	-	
30109 7	天益 医疗	2022- 03-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	52.37	47.83	249.0 0	13,04 0.13	11,90 9.67	-	
30122 0	亚香 股份	2022- 06-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	35.98	39.15	285.0 0	10,25 4.30	11,15 7.75	-	
30123 7	和顺 科技	2022- 03-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	56.69	41.86	261.0 0	14,79 6.09	10,92 5.46	-	
30113 7	哈焊 华通	2022- 03-14	6 个月	首次 公开 发行 限售	15.37	15.99	644.0 0	9,898 .28	10,29 7.56	-	
30128 8	清研 环境	2022- 04-14	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.09	19.98	452.0 0	8,628 .68	9,030 .96	-	
30112 5	腾亚 精工	2022- 05-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	22.49	27.42	327.0 0	7,354 .23	8,966 .34	-	
30116 3	宏德 股份	2022- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.27	32.33	277.0 0	7,276 .79	8,955 .41	-	
30113 0	西点 药业	2022- 02-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	22.55	37.70	237.0 0	5,344 .35	8,934 .90	-	
30113 5	瑞德 智能	2022- 04-01	6 个月	首次 公开 发行	31.98	26.26	338.0 0	10,80 9.24	8,875 .88	-	

				限售						
301158	德石股份	2022-01-07	6 个月	首次公开发行限售	15.64	20.38	379.00	5,927.56	7,724.02	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	首次公开发行限售	20.08	20.34	373.00	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	首次公开发行限售	31.20	22.81	296.00	9,235.20	6,751.76	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	首次公开发行限售	41.52	41.52	158.00	6,560.16	6,560.16	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 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》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，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 1%，且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本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；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%。本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。

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》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《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》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板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》，本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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，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。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.9.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.10 金融工具风险及管理

6.4.10.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

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及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

6.4.10.2 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同责任，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。

6.4.10.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,550,504.79	-
合计	4,550,504.79	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.10.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.10.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.10.2.4 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	206,874,997.84	241,991,993.36
AAA 以下	228,707,397.92	374,603,112.73
未评级	5,121,449.32	-
合计	440,703,845.08	616,595,106.09

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

6.4.10.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.10.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.10.3 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	73,792,111.33	-	-	-	73,792,111.33
结算备付金	5,878,364.76	-	-	-	5,878,364.76
存出保证金	202,975.22	-	-	-	202,975.22
交易性金融资产	9,671,954.11	435,511,737.72	70,658.04	314,962,738.56	760,217,088.43
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	50,487.54	50,487.54
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	89,545,405.42	435,511,737.72	70,658.04	315,013,226.10	840,141,027.28
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	21,336,881.69	21,336,881.69
应付证券清算款	-	-	-	5,086,875.26	5,086,875.26
应付管理人报酬	-	-	-	1,072,368.32	1,072,368.32
应付托管费	-	-	-	178,728.06	178,728.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,221.09	2,221.09

应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,484,506.28	1,484,506.28
负债总计	-	-	-	29,161,580.70	29,161,580.70
利率敏感度缺口	89,545,405.42	435,511,737.72	70,658.04	285,851,645.40	810,979,446.58
上年度末 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	84,670,868.17	-	-	-	84,670,868.17
结算备付金	8,277,369.95	-	-	-	8,277,369.95
存出保证金	182,868.13	-	-	-	182,868.13
交易性金融资产	107,191,600.00	429,028,493.69	80,375,012.40	457,159,483.75	1,073,754,589.84
应收证券清算款	-	-	-	195,968.08	195,968.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	185,851.70	185,851.70
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,903,450.65	1,903,450.65
资产总计	200,322,706.25	429,028,493.69	80,375,012.40	459,444,754.18	1,169,170,966.52
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	167,537.65	167,537.65
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,479,828.17	1,479,828.17
应付托管费	-	-	-	246,638.03	246,638.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,794.47	7,794.47
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,365,914.09	2,365,914.09
负债总计	-	-	-	4,267,712.41	4,267,712.41
利率敏感度缺口	200,322,706.25	429,028,493.69	80,375,012.40	455,177,041.77	1,164,903,254.11

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

6.4.10.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 1	-
市场利率下降 25 个基点	增加约 1	-	

注：1、上年度末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

2、上述金额为四舍五入后的结果。

6.4.10.4.2 外汇风险

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

6.4.10.4.3 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。

6.4.10.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	314,962,738.56	38.84	457,159,483.75	39.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	435,582,395.76	53.71	616,595,106.09	52.93
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	750,545,134.32	92.55	1,073,754,589.84	92.18

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注“衍生金融资产/负债”）。在当日无负债结算制度下，

期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.10.4.3.2 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 2,628	增加约 2,108
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,628	减少约 2,108

6.4.11 公允价值

6.4.11.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.11.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.11.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	741,553,980.20
第二层次	10,863,222.72
第三层次	7,799,885.51
合计	760,217,088.43

6.4.11.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.11.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末:同)。

6.4.11.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.12 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。其中“应收利息”与“其他资产”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额；“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”项目的上年度末余额合并列示在资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额；“交易费用”项目与“其他费用”项目的上年度可比期间金额合并列示在利润表“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

§ 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	314,962,738.56	37.49
	其中：股票	314,962,738.56	37.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	445,254,349.87	53.00
	其中：债券	445,254,349.87	53.00
	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	79,670,476.09	9.48
8	其他各项资产	253,462.76	0.03
9	合计	840,141,027.28	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	----------	---------------

A	农、林、牧、渔业	487,326.00	0.06
B	采矿业	10,842,503.44	1.34
C	制造业	209,213,502.31	25.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,535,749.80	0.19
E	建筑业	7,511,017.00	0.93
F	批发和零售业	16,632,491.66	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	10,054,068.00	1.24
H	住宿和餐饮业	31,529.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,724,314.84	1.69
J	金融业	30,199,289.90	3.72
K	房地产业	9,403,044.10	1.16
L	租赁和商务服务业	817,982.85	0.10
M	科学研究和技术服务业	1,107,930.86	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	714,364.80	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	898,580.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	1,736,003.00	0.21
S	综合	53,041.00	0.01
	合计	314,962,738.56	38.84

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	600782	新钢股份	2,991,337	15,076,338.48	1.86
2	000001	平安银行	706,666	10,585,856.68	1.31
3	002304	洋河股份	48,700	8,919,405.00	1.10
4	601919	中远海控	509,850	7,086,915.00	0.87
5	601668	中国建筑	1,276,100	6,788,852.00	0.84
6	600519	贵州茅台	3,300	6,748,500.00	0.83
7	600048	保利发展	340,600	5,946,876.00	0.73
8	600153	建发股份	417,100	5,451,497.00	0.67
9	300390	天华超净	61,300	5,357,620.00	0.66
10	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.65
11	600755	厦门国贸	676,585	5,074,387.50	0.63
12	000568	泸州老窖	19,000	4,684,260.00	0.58
13	002460	赣锋锂业	30,500	4,535,350.00	0.56
14	000950	重药控股	862,300	4,311,500.00	0.53
15	002466	天齐锂业	34,498	4,305,350.40	0.53
16	601166	兴业银行	209,861	4,176,233.90	0.51
17	002709	天赐材料	63,600	3,947,016.00	0.49
18	600873	梅花生物	320,600	3,616,368.00	0.45

19	600809	山西汾酒	10,900	3,540,320.00	0.44
20	300316	晶盛机电	52,200	3,528,198.00	0.44
21	300769	德方纳米	8,360	3,416,564.80	0.42
22	601009	南京银行	321,400	3,348,988.00	0.41
23	000932	华菱钢铁	654,300	3,330,387.00	0.41
24	603392	万泰生物	20,996	3,260,678.80	0.40
25	002756	永兴材料	19,700	2,998,537.00	0.37
26	002192	融捷股份	19,100	2,935,670.00	0.36
27	000933	神火股份	219,600	2,872,368.00	0.35
28	300661	圣邦股份	15,600	2,839,512.00	0.35
29	002594	比亚迪	8,300	2,767,967.00	0.34
30	000792	盐湖股份	81,100	2,429,756.00	0.30
31	600893	航发动力	52,000	2,366,520.00	0.29
32	600030	中信证券	107,260	2,323,251.60	0.29
33	603599	广信股份	81,560	2,295,914.00	0.28
34	000733	振华科技	16,600	2,257,102.00	0.28
35	688575	亚辉龙	105,980	2,217,101.60	0.27
36	600438	通威股份	36,700	2,196,862.00	0.27
37	688123	聚辰股份	18,370	1,956,772.40	0.24
38	002240	盛新锂能	32,000	1,931,520.00	0.24
39	003019	宸展光电	74,885	1,890,097.40	0.23
40	300171	东富龙	54,600	1,851,486.00	0.23
41	000625	长安汽车	100,880	1,747,241.60	0.22
42	601318	中国平安	37,231	1,738,315.39	0.21
43	300639	凯普生物	80,800	1,727,504.00	0.21
44	600389	江山股份	28,300	1,718,659.00	0.21
45	600760	中航沈飞	28,398	1,716,659.10	0.21
46	601088	中国神华	51,400	1,711,620.00	0.21
47	601900	南方传媒	206,800	1,677,148.00	0.21
48	603898	好莱客	161,000	1,661,520.00	0.20
49	300041	回天新材	91,000	1,580,670.00	0.19
50	000596	古井贡酒	6,300	1,572,858.00	0.19
51	300833	浩洋股份	17,900	1,560,164.00	0.19
52	002738	中矿资源	16,200	1,500,282.00	0.18
53	600639	浦东金桥	108,290	1,471,661.10	0.18
54	300268	佳沃食品	49,400	1,469,650.00	0.18
55	300768	迪普科技	90,900	1,468,035.00	0.18
56	688516	奥特维	5,472	1,460,750.40	0.18
57	300820	英杰电气	22,300	1,439,465.00	0.18
58	603868	飞科电器	19,000	1,439,250.00	0.18
59	002884	凌霄泵业	69,600	1,426,104.00	0.18
60	600064	南京高科	128,100	1,409,100.00	0.17
61	601838	成都银行	84,500	1,401,010.00	0.17
62	300803	指南针	23,800	1,398,964.00	0.17

63	002947	恒铭达	75,200	1,383,680.00	0.17
64	002841	视源股份	18,300	1,378,356.00	0.17
65	688019	安集科技	6,463	1,376,101.96	0.17
66	000553	安道麦 A	113,500	1,374,485.00	0.17
67	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.16
68	002176	江特电机	51,800	1,297,072.00	0.16
69	601899	紫金矿业	135,700	1,266,081.00	0.16
70	600089	特变电工	45,900	1,257,201.00	0.16
71	603989	艾华集团	43,400	1,223,880.00	0.15
72	603217	元利科技	41,428	1,218,397.48	0.15
73	603799	华友钴业	12,410	1,186,644.20	0.15
74	600546	山煤国际	60,100	1,169,546.00	0.14
75	688981	中芯国际	25,700	1,160,869.00	0.14
76	688008	澜起科技	19,000	1,151,020.00	0.14
77	000858	五粮液	5,700	1,151,001.00	0.14
78	688037	芯源微	7,600	1,101,772.00	0.14
79	600256	广汇能源	103,600	1,091,944.00	0.13
80	601677	明泰铝业	45,840	1,090,992.00	0.13
81	601012	隆基绿能	16,100	1,072,743.00	0.13
82	002352	顺丰控股	19,100	1,065,971.00	0.13
83	300601	康泰生物	23,100	1,043,658.00	0.13
84	300696	爱乐达	23,460	1,031,067.00	0.13
85	300750	宁德时代	1,900	1,014,600.00	0.13
86	000989	九芝堂	110,700	1,007,370.00	0.12
87	603986	兆易创新	7,000	995,470.00	0.12
88	600887	伊利股份	25,400	989,330.00	0.12
89	600176	中国巨石	56,529	984,169.89	0.12
90	688819	天能股份	28,124	972,527.92	0.12
91	688099	晶晨股份	9,100	919,100.00	0.11
92	601288	农业银行	303,500	916,570.00	0.11
93	002533	金杯电工	127,900	906,811.00	0.11
94	600036	招商银行	21,400	903,080.00	0.11
95	688298	东方生物	7,830	893,794.50	0.11
96	002920	德赛西威	5,900	873,200.00	0.11
97	603613	国联股份	9,520	843,472.00	0.10
98	600499	科达制造	40,400	833,856.00	0.10
99	000651	格力电器	23,500	792,420.00	0.10
100	002821	凯莱英	2,700	780,300.00	0.10
101	002545	东方铁塔	68,500	779,530.00	0.10
102	002555	三七互娱	36,000	764,280.00	0.09
103	002371	北方华创	2,700	748,224.00	0.09
104	002497	雅化集团	22,800	744,420.00	0.09
105	600018	上港集团	123,200	718,256.00	0.09
106	002459	晶澳科技	8,820	695,898.00	0.09

107	600919	江苏银行	96,100	684,232.00	0.08
108	688200	华峰测控	1,900	677,160.00	0.08
109	600233	圆通速递	33,100	674,909.00	0.08
110	300196	长海股份	35,300	666,817.00	0.08
111	600276	恒瑞医药	17,300	641,657.00	0.08
112	000725	京东方A	161,900	637,886.00	0.08
113	600702	舍得酒业	3,100	632,369.00	0.08
114	603327	福蓉科技	43,310	595,512.50	0.07
115	600863	内蒙华电	159,800	583,270.00	0.07
116	601567	三星医疗	43,700	580,336.00	0.07
117	603882	金域医学	6,800	561,340.00	0.07
118	002645	华宏科技	25,500	556,410.00	0.07
119	300130	新国都	43,900	538,214.00	0.07
120	600096	云天化	16,700	525,716.00	0.06
121	300037	新宙邦	9,300	488,808.00	0.06
122	300073	当升科技	5,400	487,836.00	0.06
123	000408	藏格矿业	13,900	457,866.00	0.06
124	300363	博腾股份	5,800	452,342.00	0.06
125	600031	三一重工	23,500	447,910.00	0.06
126	000333	美的集团	7,168	432,875.52	0.05
127	688005	容百科技	3,300	427,152.00	0.05
128	601225	陕西煤业	20,000	423,600.00	0.05
129	300568	星源材质	14,400	418,176.00	0.05
130	603288	海天味业	4,500	406,620.00	0.05
131	600141	兴发集团	9,236	406,291.64	0.05
132	600060	海信视像	31,500	393,750.00	0.05
133	002759	天际股份	14,400	391,392.00	0.05
134	300122	智飞生物	3,500	388,535.00	0.05
135	002405	四维图新	25,600	385,792.00	0.05
136	601857	中国石油	69,200	366,760.00	0.05
137	688388	嘉元科技	4,300	364,941.00	0.05
138	002049	紫光国微	1,900	360,468.00	0.04
139	600585	海螺水泥	10,200	359,856.00	0.04
140	000935	四川双马	14,700	356,034.00	0.04
141	600596	新安股份	16,260	352,029.00	0.04
142	601601	中国太保	14,500	341,185.00	0.04
143	688606	奥泰生物	2,800	340,536.00	0.04
144	002432	九安医疗	5,600	336,336.00	0.04
145	600900	长江电力	14,500	335,240.00	0.04
146	688238	和元生物	12,836	325,007.52	0.04
147	603668	天马科技	15,800	323,742.00	0.04
148	300423	昇辉科技	29,800	322,436.00	0.04
149	002615	哈尔斯	51,700	321,574.00	0.04
150	600019	宝钢股份	53,188	320,191.76	0.04

151	002286	保龄宝	27,900	319,455.00	0.04
152	601818	光大银行	105,700	318,157.00	0.04
153	688556	高测股份	3,940	317,958.00	0.04
154	002815	崇达技术	24,600	315,126.00	0.04
155	002407	多氟多	6,400	313,024.00	0.04
156	688589	力合微	6,900	309,258.00	0.04
157	600028	中国石化	74,300	303,144.00	0.04
158	002517	恺英网络	54,200	302,436.00	0.04
159	000617	中油资本	62,100	298,701.00	0.04
160	300487	蓝晓科技	4,850	295,850.00	0.04
161	688111	金山办公	1,500	295,680.00	0.04
162	300059	东方财富	11,552	293,420.80	0.04
163	600273	嘉化能源	26,600	288,876.00	0.04
164	002410	广联达	5,300	288,532.00	0.04
165	000970	中科三环	15,200	285,456.00	0.04
166	603259	药明康德	2,745	285,452.55	0.04
167	688400	凌云光	12,839	281,559.27	0.03
168	300170	汉得信息	31,200	281,112.00	0.03
169	603369	今世缘	5,500	280,500.00	0.03
170	600104	上汽集团	15,300	272,493.00	0.03
171	300450	先导智能	4,300	271,674.00	0.03
172	000063	中兴通讯	10,400	265,512.00	0.03
173	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.03
174	601888	中国中免	1,100	256,223.00	0.03
175	300721	怡达股份	7,100	256,097.00	0.03
176	300218	安利股份	17,900	255,433.00	0.03
177	000630	铜陵有色	78,000	254,280.00	0.03
178	603659	璞泰来	3,000	253,200.00	0.03
179	603026	石大胜华	1,700	247,095.00	0.03
180	601689	拓普集团	3,600	246,348.00	0.03
181	600481	双良节能	14,500	244,325.00	0.03
182	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.03
183	600426	华鲁恒升	8,320	242,944.00	0.03
184	600050	中国联通	69,900	241,854.00	0.03
185	000039	中集集团	17,400	240,990.00	0.03
186	300896	爱美客	400	240,004.00	0.03
187	688559	海目星	3,300	239,910.00	0.03
188	603983	丸美股份	8,800	235,840.00	0.03
189	688012	中微公司	2,000	233,500.00	0.03
190	002539	云图控股	14,500	231,855.00	0.03
191	002484	江海股份	9,900	231,066.00	0.03
192	002027	分众传媒	34,300	230,839.00	0.03
193	601390	中国中铁	37,300	229,022.00	0.03
194	688590	新致软件	15,900	227,847.00	0.03

195	603529	爱玛科技	4,341	227,381.58	0.03
196	000338	潍柴动力	17,700	220,719.00	0.03
197	000100	TCL 科技	45,500	217,945.00	0.03
198	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
199	603308	应流股份	13,300	216,524.00	0.03
200	002475	立讯精密	6,400	216,256.00	0.03
201	000830	鲁西化工	12,200	210,938.00	0.03
202	300613	富瀚微	2,470	209,456.00	0.03
203	601766	中国中车	40,100	208,520.00	0.03
204	300482	万孚生物	5,100	207,621.00	0.03
205	300015	爱尔眼科	4,600	205,942.00	0.03
206	300432	富临精工	9,100	200,200.00	0.02
207	601958	金钼股份	22,600	199,784.00	0.02
208	000002	万 科 A	9,700	198,850.00	0.02
209	601328	交通银行	39,900	198,702.00	0.02
210	600160	巨化股份	14,800	194,620.00	0.02
211	601965	中国汽研	11,200	181,552.00	0.02
212	300707	威唐工业	10,600	179,246.00	0.02
213	603619	中曼石油	8,500	174,845.00	0.02
214	600309	万华化学	1,800	174,582.00	0.02
215	300327	中颖电子	3,500	174,335.00	0.02
216	002085	万丰奥威	32,200	172,914.00	0.02
217	002436	兴森科技	15,200	171,304.00	0.02
218	300124	汇川技术	2,600	171,262.00	0.02
219	600623	华谊集团	20,400	169,320.00	0.02
220	600352	浙江龙盛	16,600	168,988.00	0.02
221	000799	酒鬼酒	900	167,229.00	0.02
222	601898	中煤能源	16,100	167,118.00	0.02
223	688329	艾隆科技	5,100	164,985.00	0.02
224	002597	金禾实业	3,800	164,654.00	0.02
225	600097	开创国际	16,700	164,161.00	0.02
226	000807	云铝股份	16,600	164,008.00	0.02
227	002394	联发股份	22,400	163,744.00	0.02
228	002927	泰永长征	13,900	161,935.00	0.02
229	600901	江苏租赁	31,100	159,543.00	0.02
230	600170	上海建工	51,900	157,257.00	0.02
231	300760	迈瑞医疗	500	156,600.00	0.02
232	002415	海康威视	4,300	155,660.00	0.02
233	600415	小商品城	27,800	154,846.00	0.02
234	000403	派林生物	7,000	153,720.00	0.02
235	601717	郑煤机	10,600	152,746.00	0.02
236	000878	云南铜业	13,400	152,626.00	0.02
237	600559	老白干酒	5,300	152,057.00	0.02
238	300782	卓胜微	1,120	151,200.00	0.02

239	600808	马钢股份	39,854	151,046.66	0.02
240	601006	大秦铁路	22,900	150,911.00	0.02
241	601186	中国铁建	19,000	150,100.00	0.02
242	002714	牧原股份	2,700	149,229.00	0.02
243	600779	水井坊	1,600	148,064.00	0.02
244	002092	中泰化学	19,000	147,440.00	0.02
245	600486	扬农化工	1,100	146,608.00	0.02
246	688521	芯原股份	2,900	143,260.00	0.02
247	002268	卫士通	3,300	141,603.00	0.02
248	600584	长电科技	5,200	140,400.00	0.02
249	601138	工业富联	14,200	139,728.00	0.02
250	000729	燕京啤酒	14,400	139,104.00	0.02
251	002895	川恒股份	4,100	138,621.00	0.02
252	601600	中国铝业	29,000	137,750.00	0.02
253	603708	家家悦	9,600	136,704.00	0.02
254	600123	兰花科创	8,300	136,535.00	0.02
255	601615	明阳智能	4,000	135,200.00	0.02
256	300935	盈建科	4,320	135,129.60	0.02
257	002013	中航机电	10,900	134,615.00	0.02
258	601933	永辉超市	31,100	133,108.00	0.02
259	000895	双汇发展	4,500	131,850.00	0.02
260	603156	养元饮品	5,800	131,776.00	0.02
261	600027	华电国际	33,500	131,655.00	0.02
262	603099	长白山	13,800	131,652.00	0.02
263	002142	宁波银行	3,613	129,381.53	0.02
264	000959	首钢股份	26,400	125,664.00	0.02
265	002869	金溢科技	8,300	125,164.00	0.02
266	002865	钧达股份	1,300	123,968.00	0.02
267	300480	光力科技	6,898	123,750.12	0.02
268	603938	三孚股份	2,500	123,575.00	0.02
269	601678	滨化股份	20,600	123,394.00	0.02
270	603773	沃格光电	7,630	122,080.00	0.02
271	002150	通润装备	18,300	122,061.00	0.02
272	300583	赛托生物	5,400	122,040.00	0.02
273	300650	太龙股份	9,200	121,624.00	0.01
274	603933	睿能科技	11,100	121,212.00	0.01
275	603926	铁流股份	11,790	121,083.30	0.01
276	600985	淮北矿业	8,300	120,848.00	0.01
277	601988	中国银行	36,800	119,968.00	0.01
278	600741	华域汽车	5,200	119,600.00	0.01
279	300074	华平股份	31,800	119,568.00	0.01
280	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
281	000789	万年青	11,000	119,240.00	0.01
282	300515	三德科技	11,600	118,320.00	0.01

283	601816	京沪高铁	23,500	117,970.00	0.01
284	603260	合盛硅业	1,000	117,960.00	0.01
285	000898	鞍钢股份	36,600	117,852.00	0.01
286	603903	中持股份	12,000	117,840.00	0.01
287	300970	华绿生物	6,200	117,304.00	0.01
288	300529	健帆生物	2,300	117,047.00	0.01
289	300150	世纪瑞尔	28,800	116,064.00	0.01
290	688399	硕世生物	1,009	115,046.18	0.01
291	600282	南钢股份	36,300	114,345.00	0.01
292	300628	亿联网络	1,500	114,225.00	0.01
293	601939	建设银行	18,800	113,928.00	0.01
294	600997	开滦股份	14,900	113,538.00	0.01
295	605111	新洁能	900	113,229.00	0.01
296	601699	潞安环能	7,700	112,574.00	0.01
297	603080	新疆火炬	8,600	112,488.00	0.01
298	000825	太钢不锈	20,500	111,725.00	0.01
299	000157	中联重科	18,100	111,496.00	0.01
300	002110	三钢闽光	18,000	109,620.00	0.01
301	300033	同花顺	1,100	105,765.00	0.01
302	000717	韶钢松山	30,100	105,350.00	0.01
303	002805	丰元股份	1,700	105,230.00	0.01
304	603928	兴业股份	8,000	105,040.00	0.01
305	603006	黎明股份	11,500	104,765.00	0.01
306	300595	欧普康视	1,800	102,942.00	0.01
307	688202	美迪西	300	101,883.00	0.01
308	000762	西藏矿业	1,800	100,674.00	0.01
309	300562	乐心医疗	10,400	100,568.00	0.01
310	002601	龙佰集团	4,900	98,245.00	0.01
311	300244	迪安诊断	3,100	96,410.00	0.01
312	300332	天壕环境	8,600	96,320.00	0.01
313	000425	徐工机械	17,300	93,247.00	0.01
314	300861	美畅股份	1,000	92,690.00	0.01
315	600188	兖矿能源	2,300	90,804.00	0.01
316	688335	复洁环保	3,100	89,001.00	0.01
317	002649	博彦科技	8,700	88,827.00	0.01
318	600582	天地科技	18,200	86,996.00	0.01
319	301238	瑞泰新材	2,670	85,626.90	0.01
320	605399	晨光新材	2,000	85,100.00	0.01
321	002365	永安药业	6,900	85,008.00	0.01
322	601577	长沙银行	10,700	84,851.00	0.01
323	300358	楚天科技	4,600	81,834.00	0.01
324	601997	贵阳银行	14,000	81,340.00	0.01
325	603115	海星股份	3,300	81,081.00	0.01
326	300652	雷迪克	3,300	80,751.00	0.01

327	603279	景津装备	2,580	80,005.80	0.01
328	601077	渝农商行	21,200	78,440.00	0.01
329	002698	博实股份	6,600	78,078.00	0.01
330	600111	北方稀土	2,200	77,352.00	0.01
331	000893	亚钾国际	2,200	75,702.00	0.01
332	600714	金瑞矿业	6,000	75,300.00	0.01
333	002812	恩捷股份	300	75,135.00	0.01
334	000707	双环科技	4,400	74,756.00	0.01
335	300077	国民技术	4,000	74,320.00	0.01
336	300354	东华测试	2,300	73,945.00	0.01
337	300818	耐普矿机	1,800	73,008.00	0.01
338	002648	卫星化学	2,816	72,793.60	0.01
339	002322	理工能科	8,100	72,495.00	0.01
340	603328	依顿电子	11,400	72,390.00	0.01
341	600867	通化东宝	7,000	72,380.00	0.01
342	000631	顺发恒业	18,800	70,688.00	0.01
343	600295	鄂尔多斯	3,900	70,395.00	0.01
344	000822	山东海化	6,900	70,104.00	0.01
345	600128	弘业股份	8,300	70,052.00	0.01
346	600179	安通控股	18,100	69,142.00	0.01
347	300224	正海磁材	4,500	68,850.00	0.01
348	002538	司尔特	6,100	68,076.00	0.01
349	002252	上海莱士	11,400	67,602.00	0.01
350	300275	梅安森	5,000	66,350.00	0.01
351	601231	环旭电子	4,600	66,056.00	0.01
352	002326	永太科技	2,000	65,860.00	0.01
353	688617	惠泰医疗	300	65,724.00	0.01
354	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
355	300373	扬杰科技	900	64,125.00	0.01
356	002850	科达利	400	63,600.00	0.01
357	002843	泰嘉股份	4,500	63,000.00	0.01
358	688063	派能科技	200	62,440.00	0.01
359	300505	川金诺	2,000	61,920.00	0.01
360	300349	金卡智能	6,300	61,362.00	0.01
361	600547	山东黄金	3,300	61,248.00	0.01
362	600987	航民股份	11,300	60,229.00	0.01
363	603379	三美股份	2,700	60,075.00	0.01
364	600845	宝信软件	1,100	60,060.00	0.01
365	300308	中际旭创	1,900	58,995.00	0.01
366	000719	中原传媒	7,900	58,855.00	0.01
367	300068	南都电源	3,800	58,292.00	0.01
368	603227	雪峰科技	6,400	57,920.00	0.01
369	300777	中简科技	1,200	57,840.00	0.01
370	002182	云海金属	2,300	57,684.00	0.01

371	601216	君正集团	11,800	57,584.00	0.01
372	000629	攀钢钒钛	15,100	57,380.00	0.01
373	600507	方大特钢	8,200	57,318.00	0.01
374	600362	江西铜业	3,200	57,056.00	0.01
375	605198	德利股份	3,100	56,544.00	0.01
376	600328	中盐化工	2,400	56,520.00	0.01
377	000968	蓝焰控股	5,400	56,430.00	0.01
378	600340	华夏幸福	17,500	56,000.00	0.01
379	300552	万集科技	1,800	55,332.00	0.01
380	603032	德新交运	700	55,300.00	0.01
381	300226	上海钢联	2,440	55,266.00	0.01
382	601882	海天精工	2,600	53,586.00	0.01
383	603516	淳中科技	4,300	53,234.00	0.01
384	600673	东阳光	5,900	53,041.00	0.01
385	300160	秀强股份	6,400	52,032.00	0.01
386	002809	红墙股份	5,200	52,000.00	0.01
387	002258	利尔化学	2,200	51,964.00	0.01
388	600051	宁波联合	7,600	51,908.00	0.01
389	688669	聚石化学	2,024	51,875.12	0.01
390	002624	完美世界	3,600	51,732.00	0.01
391	603456	九洲药业	1,000	51,700.00	0.01
392	300773	拉卡拉	2,700	51,462.00	0.01
393	002747	埃斯顿	2,100	51,450.00	0.01
394	605100	华丰股份	3,560	51,442.00	0.01
395	002381	双箭股份	8,000	51,360.00	0.01
396	002743	富煌钢构	8,500	51,255.00	0.01
397	000517	荣安地产	16,100	51,198.00	0.01
398	002896	中大力德	2,800	51,184.00	0.01
399	300195	长荣股份	9,100	51,051.00	0.01
400	301006	迈拓股份	2,700	50,760.00	0.01
401	002521	齐峰新材	9,400	50,478.00	0.01
402	002241	歌尔股份	1,500	50,400.00	0.01
403	603920	世运电路	2,900	50,170.00	0.01
404	300533	冰川网络	1,900	49,970.00	0.01
405	002741	光华科技	2,500	49,825.00	0.01
406	300920	润阳科技	2,300	49,128.00	0.01
407	688033	天宜上佳	2,300	48,852.00	0.01
408	600888	新疆众和	5,300	48,760.00	0.01
409	601985	中国核电	7,100	48,706.00	0.01
410	603906	龙蟠科技	1,300	48,022.00	0.01
411	603666	亿嘉和	700	48,020.00	0.01
412	300748	金力永磁	1,300	47,840.00	0.01
413	301217	铜冠铜箔	3,221	47,767.43	0.01
414	002472	双环传动	1,500	47,760.00	0.01

415	002414	高德红外	3,700	47,619.00	0.01
416	603306	华懋科技	1,400	47,460.00	0.01
417	300357	我武生物	900	46,827.00	0.01
418	002687	乔治白	10,330	46,175.10	0.01
419	688122	西部超导	500	46,100.00	0.01
420	600367	红星发展	2,100	46,074.00	0.01
421	688083	中望软件	220	46,072.40	0.01
422	300573	兴齐眼药	300	45,996.00	0.01
423	301236	软通动力	1,454	45,626.52	0.01
424	300457	赢合科技	1,600	45,456.00	0.01
425	601688	华泰证券	3,200	45,440.00	0.01
426	603203	快克股份	1,770	45,312.00	0.01
427	300832	新产业	1,000	45,110.00	0.01
428	003025	思进智能	2,175	45,000.75	0.01
429	300586	美联新材	2,600	44,694.00	0.01
430	688518	联赢激光	1,300	44,187.00	0.01
431	603993	洛阳钼业	7,700	44,121.00	0.01
432	300681	英搏尔	760	43,905.20	0.01
433	603187	海容冷链	1,200	43,860.00	0.01
434	002204	大连重工	10,000	43,700.00	0.01
435	603358	华达科技	2,200	43,560.00	0.01
436	601628	中国人寿	1,400	43,512.00	0.01
437	300775	三角防务	900	43,335.00	0.01
438	002376	新北洋	5,600	43,288.00	0.01
439	002526	山东矿机	18,300	43,188.00	0.01
440	001979	招商蛇口	3,200	42,976.00	0.01
441	688003	天准科技	1,300	42,900.00	0.01
442	603859	能科科技	1,400	42,504.00	0.01
443	603305	旭升股份	1,400	42,308.00	0.01
444	601369	陕鼓动力	4,400	42,240.00	0.01
445	603277	银都股份	2,000	42,220.00	0.01
446	605123	派克新材	300	42,216.00	0.01
447	002064	华峰化学	5,000	42,200.00	0.01
448	300695	兆丰股份	800	42,048.00	0.01
449	600967	内蒙一机	4,600	41,952.00	0.01
450	002023	海特高新	4,100	41,943.00	0.01
451	300375	鹏翎股份	9,400	41,924.00	0.01
452	300341	麦克奥迪	4,600	41,814.00	0.01
453	002823	凯中精密	4,100	41,738.00	0.01
454	002488	金固股份	6,200	41,726.00	0.01
455	300416	苏试试验	1,690	41,540.20	0.01
456	301200	大族数控	800	41,536.00	0.01
457	300593	新雷能	1,000	41,510.00	0.01
458	002690	美亚光电	1,910	41,408.80	0.01

459	688558	国盛智科	1,200	41,268.00	0.01
460	300263	隆华科技	4,600	41,216.00	0.01
461	000969	安泰科技	4,600	41,032.00	0.01
462	600885	宏发股份	980	41,013.00	0.01
463	688056	莱伯泰科	1,113	40,847.10	0.01
464	688569	铁科轨道	2,225	40,828.75	0.01
465	603337	杰克股份	1,900	40,812.00	0.01
466	300473	德尔股份	2,200	40,766.00	0.01
467	300447	全信股份	2,000	40,740.00	0.01
468	300813	泰林生物	1,000	40,690.00	0.01
469	603717	天域生态	4,700	40,608.00	0.01
470	300837	浙矿股份	1,000	40,550.00	0.01
471	002441	众业达	4,300	40,506.00	0.00
472	600590	泰豪科技	6,200	40,486.00	0.00
473	300145	中金环境	14,700	40,425.00	0.00
474	000559	万向钱潮	6,800	40,392.00	0.00
475	300257	开山股份	2,700	40,392.00	0.00
476	603008	喜临门	1,100	40,370.00	0.00
477	603690	至纯科技	1,000	40,300.00	0.00
478	603081	大丰实业	3,600	40,140.00	0.00
479	300445	康斯特	3,500	40,110.00	0.00
480	002662	京威股份	11,000	39,930.00	0.00
481	601658	邮储银行	7,400	39,886.00	0.00
482	600163	中闽能源	4,700	39,715.00	0.00
483	603050	科林电气	2,900	39,701.00	0.00
484	300617	安靠智电	900	39,699.00	0.00
485	300623	捷捷微电	1,600	39,680.00	0.00
486	601211	国泰君安	2,600	39,520.00	0.00
487	605377	华旺科技	2,200	39,402.00	0.00
488	601828	美凯龙	6,500	39,390.00	0.00
489	600475	华光环能	4,870	39,300.90	0.00
490	002139	拓邦股份	3,200	39,264.00	0.00
491	600452	涪陵电力	3,380	39,241.80	0.00
492	603901	永创智能	2,900	39,179.00	0.00
493	300035	中科电气	1,400	39,130.00	0.00
494	600480	凌云股份	4,400	39,116.00	0.00
495	600183	生益科技	2,300	39,077.00	0.00
496	600320	振华重工	11,600	38,976.00	0.00
497	688016	心脉医疗	200	38,962.00	0.00
498	300512	中亚股份	4,750	38,950.00	0.00
499	688025	杰普特	785	38,920.30	0.00
500	603489	八方股份	200	38,898.00	0.00
501	300947	德必集团	1,200	38,880.00	0.00
502	002009	天奇股份	2,100	38,850.00	0.00

503	300470	中密控股	1,100	38,819.00	0.00
504	603444	吉比特	100	38,800.00	0.00
505	600970	中材国际	4,000	38,760.00	0.00
506	600884	杉杉股份	1,300	38,636.00	0.00
507	603788	宁波高发	3,100	38,626.00	0.00
508	600562	国睿科技	2,600	38,610.00	0.00
509	605336	帅丰电器	1,300	38,415.00	0.00
510	002831	裕同科技	1,300	38,415.00	0.00
511	002388	新亚制程	6,700	38,391.00	0.00
512	603319	湘油泵	2,020	38,299.20	0.00
513	002752	昇兴股份	7,700	38,269.00	0.00
514	688378	奥来德	980	38,229.80	0.00
515	002891	中宠股份	1,500	38,130.00	0.00
516	600011	华能国际	5,400	38,016.00	0.00
517	300083	创世纪	3,300	37,950.00	0.00
518	600875	东方电气	2,300	37,835.00	0.00
519	600662	外服控股	5,600	37,800.00	0.00
520	600536	中国软件	930	37,748.70	0.00
521	603179	新泉股份	1,300	37,700.00	0.00
522	300733	西菱动力	1,700	37,638.00	0.00
523	300382	斯莱克	2,400	37,608.00	0.00
524	603348	文灿股份	700	37,520.00	0.00
525	002002	鸿达兴业	10,100	37,471.00	0.00
526	688097	博众精工	1,100	37,455.00	0.00
527	688191	智洋创新	2,200	37,400.00	0.00
528	002340	格林美	4,100	37,310.00	0.00
529	601968	宝钢包装	4,800	37,296.00	0.00
530	000915	华特达因	900	37,215.00	0.00
531	300036	超图软件	1,900	37,126.00	0.00
532	002230	科大讯飞	900	37,098.00	0.00
533	601089	N 福元	1,749	36,816.45	0.00
534	002727	一心堂	1,600	36,688.00	0.00
535	688626	翔宇医疗	1,100	36,586.00	0.00
536	002925	盈趣科技	1,700	36,584.00	0.00
537	688198	佰仁医疗	300	36,576.00	0.00
538	605005	合兴股份	2,100	36,414.00	0.00
539	002449	国星光电	4,500	36,405.00	0.00
540	600592	龙溪股份	4,600	36,340.00	0.00
541	300127	银河磁体	1,900	36,271.00	0.00
542	603408	建霖家居	3,100	36,270.00	0.00
543	688311	盟升电子	600	36,264.00	0.00
544	002906	华阳集团	800	36,248.00	0.00
545	600392	盛和资源	1,600	36,160.00	0.00
546	688683	莱尔科技	1,500	36,060.00	0.00

547	603665	康隆达	700	35,938.00	0.00
548	600619	海立股份	5,300	35,934.00	0.00
549	300240	飞力达	4,300	35,905.00	0.00
550	688266	泽璟制药	1,000	35,890.00	0.00
551	300676	华大基因	500	35,850.00	0.00
552	600664	哈药股份	11,900	35,819.00	0.00
553	600380	健康元	2,900	35,815.00	0.00
554	600080	金花股份	4,700	35,814.00	0.00
555	000726	鲁泰A	5,000	35,750.00	0.00
556	600201	生物股份	3,900	35,724.00	0.00
557	688015	交控科技	1,482	35,716.20	0.00
558	600436	片仔癀	100	35,673.00	0.00
559	300867	圣元环保	1,700	35,564.00	0.00
560	603588	高能环境	3,080	35,512.40	0.00
561	603338	浙江鼎力	700	35,490.00	0.00
562	600216	浙江医药	2,600	35,490.00	0.00
563	300433	蓝思科技	3,200	35,424.00	0.00
564	000623	吉林敖东	2,400	35,424.00	0.00
565	002129	TCL 中环	600	35,334.00	0.00
566	000546	金圆股份	2,200	35,332.00	0.00
567	600225	天津松江	11,800	35,282.00	0.00
568	600629	华建集团	4,800	35,280.00	0.00
569	300739	明阳电路	2,200	35,244.00	0.00
570	688010	福光股份	1,400	35,196.00	0.00
571	603363	傲农生物	1,900	35,169.00	0.00
572	603128	华贸物流	3,500	35,105.00	0.00
573	000069	华侨城A	5,400	35,046.00	0.00
574	600763	通策医疗	200	34,888.00	0.00
575	603399	吉翔股份	1,400	34,874.00	0.00
576	603177	德创环保	2,300	34,845.00	0.00
577	601866	中远海发	11,600	34,800.00	0.00
578	600905	三峡能源	5,500	34,595.00	0.00
579	300776	帝尔激光	200	34,560.00	0.00
580	600268	国电南自	3,900	34,515.00	0.00
581	600679	上海凤凰	3,300	34,485.00	0.00
582	688330	宏力达	400	34,396.00	0.00
583	603759	海天股份	3,400	34,374.00	0.00
584	300258	精锻科技	3,100	34,224.00	0.00
585	603129	春风动力	300	34,116.00	0.00
586	603919	金徽酒	1,000	33,990.00	0.00
587	301206	三元生物	743	33,947.67	0.00
588	300040	九洲集团	4,700	33,934.00	0.00
589	688317	之江生物	900	33,651.00	0.00
590	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00

591	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
592	002885	京泉华	1,100	33,308.00	0.00
593	002378	章源钨业	4,100	33,128.00	0.00
594	300303	聚飞光电	6,900	33,120.00	0.00
595	000739	普洛药业	1,600	33,024.00	0.00
596	600685	中船防务	2,000	32,980.00	0.00
597	300112	万讯自控	3,200	32,288.00	0.00
598	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
599	002952	亚世光电	2,600	31,824.00	0.00
600	000776	广发证券	1,700	31,790.00	0.00
601	603300	华铁应急	3,940	31,401.80	0.00
602	301219	腾远钴业	353	31,000.46	0.00
603	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
604	300735	光弘科技	2,900	30,305.00	0.00
605	300231	银信科技	4,000	30,280.00	0.00
606	605168	三人行	279	30,168.27	0.00
607	000848	承德露露	3,100	30,008.00	0.00
608	688661	和林微纳	500	29,980.00	0.00
609	002605	姚记科技	1,800	29,970.00	0.00
610	601669	中国电建	3,800	29,906.00	0.00
611	300014	亿纬锂能	300	29,250.00	0.00
612	603087	甘李药业	600	28,782.00	0.00
613	000735	罗牛山	4,000	27,280.00	0.00
614	000983	山西焦煤	2,000	26,780.00	0.00
615	301302	C 华如	466	26,291.72	0.00
616	002379	宏创控股	6,900	25,875.00	0.00
617	603387	基蛋生物	1,800	25,668.00	0.00
618	000428	华天酒店	4,700	25,239.00	0.00
619	600489	中金黄金	3,400	25,126.00	0.00
620	603486	科沃斯	200	24,378.00	0.00
621	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
622	300498	温氏股份	1,100	23,419.00	0.00
623	000661	长春高新	100	23,342.00	0.00
624	002128	电投能源	1,600	22,912.00	0.00
625	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
626	600988	赤峰黄金	1,400	22,330.00	0.00
627	603959	百利科技	1,800	21,816.00	0.00
628	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
629	688586	江航装备	800	21,288.00	0.00
630	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
631	002271	东方雨虹	400	20,588.00	0.00
632	002932	明德生物	298	20,430.88	0.00
633	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
634	603605	珀莱雅	120	19,821.60	0.00

635	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
636	300274	阳光电源	200	19,650.00	0.00
637	000975	银泰黄金	2,000	19,480.00	0.00
638	000627	天茂集团	5,600	19,096.00	0.00
639	002677	浙江美大	1,300	19,071.00	0.00
640	000928	中钢国际	3,000	18,810.00	0.00
641	600746	江苏索普	1,600	18,528.00	0.00
642	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
643	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
644	301112	N 信邦	399	17,970.96	0.00
645	601998	中信银行	3,700	17,575.00	0.00
646	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
647	002839	张家港行	3,300	17,457.00	0.00
648	603501	韦尔股份	100	17,303.00	0.00
649	002807	江阴银行	3,800	17,214.00	0.00
650	001872	招商港口	1,100	17,160.00	0.00
651	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.00
652	000666	经纬纺机	1,900	17,062.00	0.00
653	000560	我爱我家	5,900	16,992.00	0.00
654	002133	广宇集团	4,600	16,698.00	0.00
655	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
656	002948	青岛银行	4,600	16,652.00	0.00
657	002310	东方园林	6,900	16,629.00	0.00
658	002966	苏州银行	2,690	16,409.00	0.00
659	000415	渤海租赁	7,500	16,275.00	0.00
660	000926	福星股份	3,400	16,150.00	0.00
661	000402	金融街	2,700	16,065.00	0.00
662	002936	郑州银行	5,900	15,871.00	0.00
663	300607	拓斯达	1,200	15,864.00	0.00
664	603185	上机数控	100	15,599.00	0.00
665	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
666	002978	安宁股份	400	15,452.00	0.00
667	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
668	600886	国投电力	1,400	14,700.00	0.00
669	600132	重庆啤酒	100	14,660.00	0.00
670	300142	沃森生物	300	14,517.00	0.00
671	601066	中信建投	500	14,455.00	0.00
672	001914	招商积余	800	14,376.00	0.00
673	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
674	601800	中国交建	1,500	13,920.00	0.00
675	600597	光明乳业	1,100	13,893.00	0.00
676	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
677	600690	海尔智家	500	13,730.00	0.00
678	601618	中国中冶	3,900	13,650.00	0.00

679	000938	紫光股份	700	13,580.00	0.00
680	600710	苏美达	2,300	13,570.00	0.00
681	600346	恒力石化	600	13,344.00	0.00
682	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
683	600570	恒生电子	300	13,062.00	0.00
684	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
685	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
686	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
687	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
688	688396	华润微	200	11,814.00	0.00
689	300347	泰格医药	100	11,445.00	0.00
690	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
691	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
692	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
693	002493	荣盛石化	700	10,773.00	0.00
694	003816	中国广核	3,800	10,640.00	0.00
695	601881	中国银河	1,100	10,637.00	0.00
696	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
697	000708	中信特钢	500	10,075.00	0.00
698	002550	千红制药	1,700	9,741.00	0.00
699	601319	中国人保	1,900	9,614.00	0.00
700	300759	康龙化成	100	9,522.00	0.00
701	600971	恒源煤电	1,200	9,480.00	0.00
702	002608	江苏国信	1,400	9,100.00	0.00
703	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
704	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
705	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
706	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
707	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
708	000728	国元证券	1,400	8,708.00	0.00
709	600745	闻泰科技	100	8,511.00	0.00
710	600606	绿地控股	2,100	8,316.00	0.00
711	601728	中国电信	2,100	7,833.00	0.00
712	601377	兴业证券	1,100	7,755.00	0.00
713	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
714	600025	华能水电	1,100	7,689.00	0.00
715	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
716	002167	东方锆业	1,000	7,320.00	0.00
717	002562	兄弟科技	1,100	7,128.00	0.00
718	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
719	603806	福斯特	100	6,552.00	0.00
720	601788	光大证券	400	6,304.00	0.00
721	600754	锦江酒店	100	6,290.00	0.00
722	601100	恒立液压	100	6,172.00	0.00

723	002986	宇新股份	260	6,104.80	0.00
724	600004	白云机场	400	5,964.00	0.00
725	688550	瑞联新材	80	5,487.20	0.00
726	300801	泰和科技	200	5,204.00	0.00
727	601155	新城控股	200	5,086.00	0.00
728	000301	东方盛虹	300	5,073.00	0.00
729	600758	辽宁能源	1,100	4,840.00	0.00
730	601995	中金公司	100	4,449.00	0.00
731	300831	派瑞股份	300	4,236.00	0.00
732	601118	海南橡胶	800	3,824.00	0.00
733	000877	天山股份	300	3,690.00	0.00
734	002658	雪迪龙	500	3,515.00	0.00
735	603329	上海雅仕	200	3,260.00	0.00
736	002041	登海种业	100	2,109.00	0.00
737	603585	苏利股份	100	1,943.00	0.00
738	600737	中粮糖业	100	752.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600782	新钢股份	97,875,291.13	8.40
2	000001	平安银行	36,108,468.78	3.10
3	601919	中远海控	24,289,427.92	2.09
4	601668	中国建筑	23,907,923.00	2.05
5	600519	贵州茅台	21,504,912.00	1.85
6	601318	中国平安	17,984,510.00	1.54
7	601166	兴业银行	17,544,761.00	1.51
8	600048	保利发展	17,306,001.00	1.49
9	300750	宁德时代	17,222,183.91	1.48
10	000333	美的集团	14,870,208.00	1.28
11	601009	南京银行	12,628,454.00	1.08
12	601985	中国核电	11,610,645.60	1.00
13	002466	天齐锂业	11,314,892.00	0.97
14	600153	建发股份	10,713,660.00	0.92
15	600755	厦门国贸	10,440,795.12	0.90
16	002304	洋河股份	10,126,805.00	0.87
17	603392	万泰生物	9,732,081.00	0.84
18	600036	招商银行	9,406,069.00	0.81
19	002920	德赛西威	8,889,524.00	0.76
20	601288	农业银行	8,520,886.00	0.73

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	600782	新钢股份	81,160,044.60	6.97
2	600755	厦门国贸	53,870,539.54	4.62
3	000001	平安银行	30,969,009.45	2.66
4	000333	美的集团	30,916,759.32	2.65
5	601318	中国平安	27,414,349.22	2.35
6	601166	兴业银行	24,077,089.00	2.07
7	600153	建发股份	19,653,873.00	1.69
8	600519	贵州茅台	19,500,738.00	1.67
9	601668	中国建筑	19,113,506.84	1.64
10	601919	中远海控	17,391,312.80	1.49
11	300750	宁德时代	16,479,880.00	1.41
12	600048	保利发展	16,186,388.62	1.39
13	000932	华菱钢铁	15,775,923.00	1.35
14	000651	格力电器	15,419,072.00	1.32
15	600036	招商银行	15,274,949.00	1.31
16	601288	农业银行	12,625,527.00	1.08
17	601985	中国核电	12,059,028.85	1.04
18	601328	交通银行	11,934,070.00	1.02
19	601009	南京银行	10,813,451.00	0.93
20	000002	万科 A	10,630,600.00	0.91

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,911,281,052.30
卖出股票的收入（成交）总额	2,014,069,201.51

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	9,671,954.11	1.19
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）	435,582,395.76	53.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	445,254,349.87	54.90

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110053	苏银转债	635,130	80,013,346.78	9.87
2	110079	杭银转债	634,550	79,497,953.87	9.80
3	127027	靖远转债	455,960	67,389,501.38	8.31
4	110043	无锡转债	540,140	63,689,579.61	7.85
5	113050	南银转债	378,400	46,423,635.97	5.72

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会北京监管局、中国人民银行营业管理部的处罚。杭州银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会深圳监管局、中国人民银行杭州中心支行的处罚。无锡农村商业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会无锡监管分局的处罚。南京银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会江苏监管局的处罚。江苏张家港农村商业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行广州分行、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

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	202,975.22
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,487.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	253,462.76

7.12.4 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	110053	苏银转债	80,013,346.78	9.87
2	110079	杭银转债	79,497,953.87	9.80
3	127027	靖远转债	67,389,501.38	8.31
4	110043	无锡转债	63,689,579.61	7.85
5	113050	南银转债	46,423,635.97	5.72

6	127020	中金转债	40,358,840.45	4.98
7	128048	张行转债	26,309,806.03	3.24
8	128114	正邦转债	10,839,068.49	1.34
9	113609	永安转债	8,464,127.58	1.04
10	128085	鸿达转债	7,076,979.35	0.87
11	123080	海波转债	1,974,817.39	0.24
12	110080	东湖转债	1,710,584.33	0.21
13	113532	海环转债	829,028.05	0.10

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	5,264,494.38	0.65	首次公开发行限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,862	114,463.93	525,338,158.81	94.40%	31,185,454.62	5.60%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	303,340.70	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 5 月 4 日）基金份额总额	262,251,781.89
本报告期期初基金份额总额	747,145,531.52
本报告期基金总申购份额	151,521,802.71
减：本报告期基金总赎回份额	342,143,720.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	556,523,613.43

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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	
华泰证券	3	163,052,669.93	4.29%	151,852.18	4.64%	增加 1 个
东莞证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	182,113,701.96	4.79%	133,174.58	4.07%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
新时代	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	126,557,727.09	3.33%	92,553.01	2.83%	增加 1 个
华西证券	3	724,039,133.99	19.05%	529,485.37	16.16%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	807,138.59	0.02%	751.65	0.02%	-
安信证券	1	203,557,118.03	5.36%	189,571.72	5.79%	增加 1 个
银河证券	1	112,962,415.85	2.97%	105,201.73	3.21%	-
长江证券	1	284,178,355.61	7.48%	264,654.04	8.08%	-
招商证券	2	656,287,258.47	17.27%	611,203.49	18.66%	-
中金公	2	535,620,987.24	14.09%	498,823.51	15.23%	-

司						
方正证券	2	285,960,706.25	7.52%	209,125.20	6.38%	增加 1 个
中信建投	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	103,341.56	-	96.24	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	401,815,251.99	10.57%	374,212.44	11.42%	-
广发证券	1	123,803,178.46	3.26%	115,297.30	3.52%	-
华创证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	32,775,657.30	3.69%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

西部证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	241,428,053.61	27.17%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	67,560,912.40	7.60%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	185,711,905.06	20.90%	-	-	-	-
招商证券	136,302,383.33	15.34%	-	-	-	-
中金公司	141,571,043.30	15.93%	-	-	-	-
方正证券	45,372,982.93	5.11%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东吴证券	34,291,879.45	3.86%	-	-	-	-
广发证券	3,428,188.50	0.39%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-06-18
2	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-20220430	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-30
3	博时量化平衡混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-04-22
4	博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-30

5	博时量化平衡混合型证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-24
6	博时量化平衡混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-23
7	博时基金管理有限公司关于调整直销网上交易定期投资业务影响部分定期投资计划的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-03-14
8	博时量化平衡混合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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-02-17
9	博时基金管理有限公司关于部分基金在青岛农商银行直销银行开展费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-02-11
10	博时基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
11	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-28
12	博时量化平衡混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-24
13	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20220121	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-21
14	关于成立博时财富基金销售有限公司的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-20
15	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-18
16	博时基金管理有限公司关于暂停使用交通银行非快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-06
17	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通交通银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-04
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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01
19	博时基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2022-01-01

	网站	
--	----	--

§ 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

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 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-03-10~ 2022-06-30	91,714,801.4 5	79,317,9 43.04	-	171,032,74 4.49	30.73%

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。

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量化平衡混合型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《博时量化平衡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 博时量化平衡混合型证券投资基金各年度审计报告正本

12.1.6 报告期内博时量化平衡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、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二二年八月三十一日