

博时量化价值股票型证券投资基金
2023 年中期报告
2023 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69

7.12 投资组合报告附注.....	70
§8 基金份额持有人信息.....	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
§9 开放式基金份额变动.....	71
§10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
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.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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.....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§12 备查文件目录.....	76
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

§ 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	107,445,223.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 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	87,945,853.86 份	19,499,369.22 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 负责人	姓名	孙麒清	秦一楠
	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

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
本期已实现收益	1,609,887.44	-1,900,680.48
本期利润	704,804.95	-3,538,927.97
加权平均基金份额本期利润	0.0083	-0.0734
本期加权平均净值利润率	0.68%	-6.11%
本期基金份额净值增长率	1.36%	0.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	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	16,641,999.36	3,141,067.70
期末可供分配基金份额利润	0.1892	0.1611
期末基金资产净值	104,587,853.22	22,640,436.92
期末基金份额净值	1.1892	1.1611

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	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	38.46%	32.99%

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

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
过去一个月	1.12%	0.75%	1.92%	0.84%	-0.80%	-0.09%
过去三个月	-2.39%	0.75%	-4.02%	0.77%	1.63%	-0.02%
过去六个月	1.36%	0.75%	-0.51%	0.79%	1.87%	-0.04%
过去一年	-5.23%	0.86%	-11.03%	0.96%	5.80%	-0.10%
过去三年	15.50%	1.02%	-7.41%	1.08%	22.91%	-0.06%
自基金合同生效起至今	38.46%	1.14%	4.90%	1.12%	33.56%	0.02%

博时量化价值股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.05%	0.75%	1.92%	0.84%	-0.87%	-0.09%
过去三个月	-2.59%	0.75%	-4.02%	0.77%	1.43%	-0.02%
过去六个月	0.97%	0.75%	-0.51%	0.79%	1.48%	-0.04%
过去一年	-5.96%	0.86%	-11.03%	0.96%	5.07%	-0.10%
过去三年	12.75%	1.02%	-7.41%	1.08%	20.16%	-0.06%
自基金合同生效起至今	32.99%	1.14%	4.90%	1.12%	28.09%	0.02%

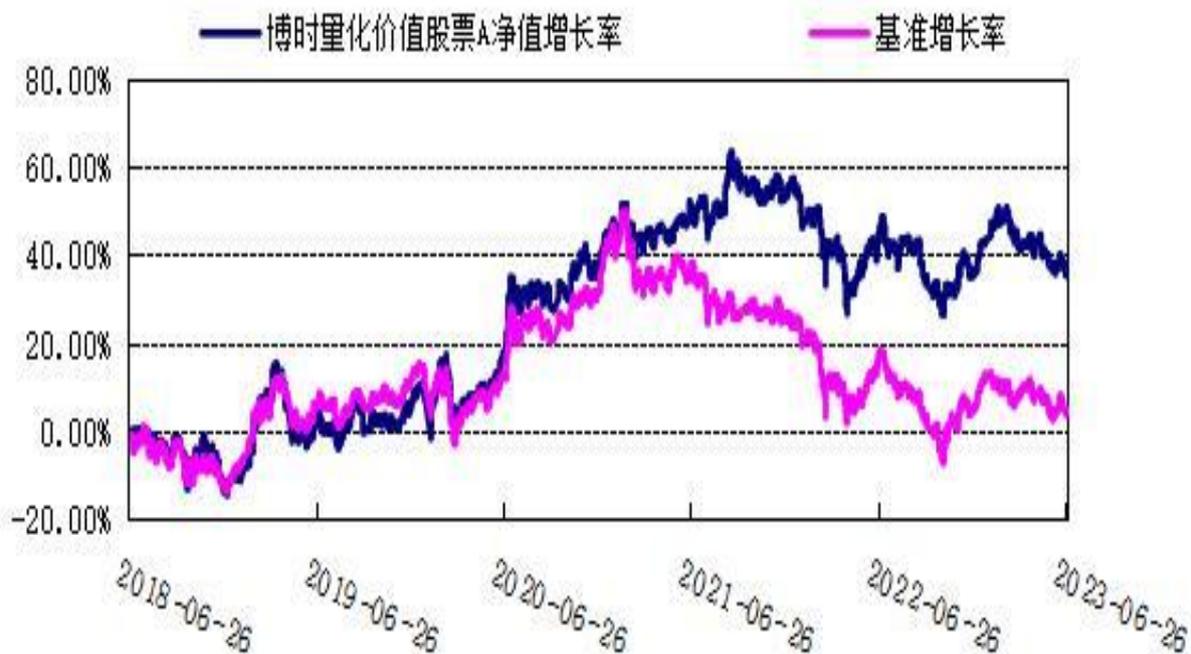
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化价值股票型证券投资基金

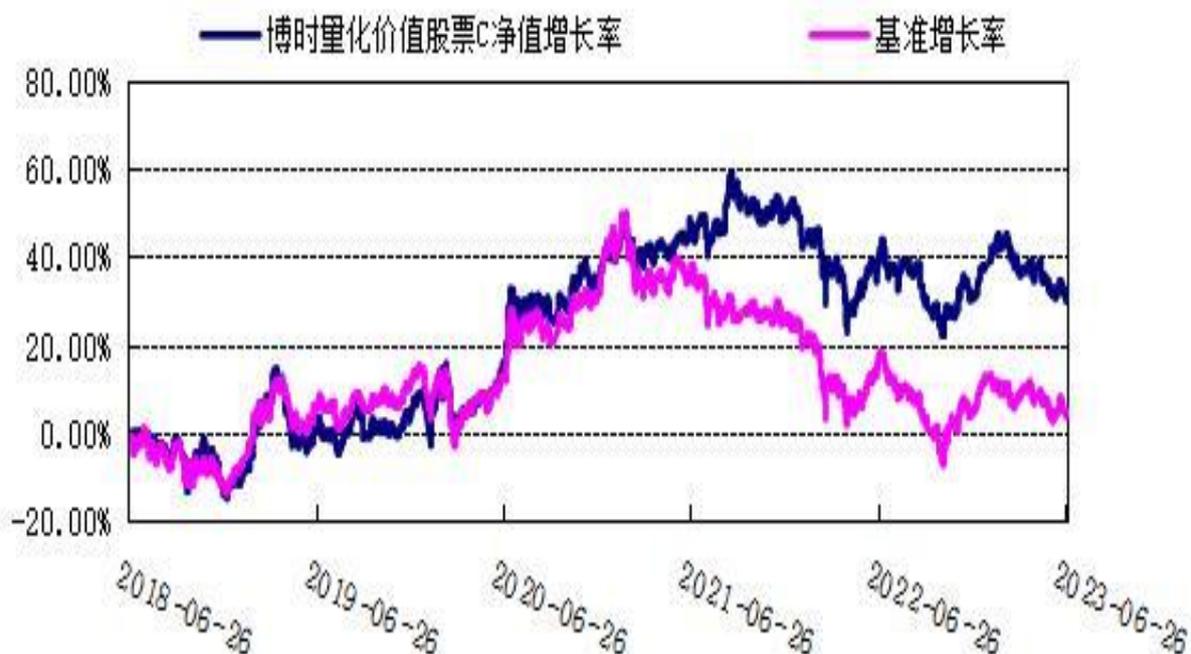
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年6月26日至2023年6月30日)

博时量化价值股票 A



博时量化价值股票 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 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 14767 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 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 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	2018-06-26	2023-03-08	12.9	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)、博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日-2023 年 3 月 8 日)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日-2023 年 3 月 8 日)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2022 年 2 月 28 日-2023 年 3 月 8 日)的基金经理。
黄瑞庆	指数与量化投资部投资总监/基金经理	2018-06-26	-	20.9	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、博时价值增长贰号证券投资基金(2015年2月9日-2016年10月24日)、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、指数与量化投资部总经理。现任指数与量化投资部投资总监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	-	12.9	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。
王萌	基金经理助理	2023-01-20	-	6.9	王萌先生，博士。2016年毕业后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 89 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

2023 年上半年，海外各国为应对通胀问题维持紧缩货币政策，进而给经济带来下行压力。美欧服务业与制造业分化还将延续，服务业高景气对就业形成一定支撑。美国加息措施以及去年的高基数效应，推动 CPI 读数快速下行，通胀延续回落态势。国内经济仍在修复，但供给回升快于需求，需求驱动不足。同时也应注意到，随着经济复苏进入常态化和稳增长政策出台，内需已经出现企稳迹象。

2023 年上半年，A 股市场整体处于低位盘整状态。小盘和价值风格表现强劲，国证 2000 指数、中证 1000 指数以及红利指数在上半年均录得正收益。相比较而言，大盘成长风格持续走弱，在大盘内部，成长和价值之间的分化尤为显著。板块之间的结构分化加剧，受估值驱动因素影响的“中特估”相关板块走势强劲。得益于人工智能科技的突破进展以及相关应用场景的落地，科技板块表现亮眼，受到市场关注。消费和新能源板块持续走弱。根据中信一级行业指数显示，2023 年上半年涨幅靠前的行业是通信、传媒、计算机、家电和机械等，涨幅靠后的行业有消费者服务、房地产、农林牧渔、建材和基础化工等。港股市场在年初冲高后回落，恒生指数在上半年录得负收益。电讯和能源板块涨幅领先，医疗保健、地产建筑和必须性消费板块跌幅较大。

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。本基金维持价值风格暴露,对小盘价值风格予以适度倾斜,实现了对沪深 300 基准的超越。当前,市场整体估值维持震荡,而低估值板块与其他板块的估值差开始修复,未来还有较大的结构性估值修复空间。我们认为未来两年内,大盘价值具有良好的基本面和极低的估值。2023 年我们将持续对价值型策略进行配置,在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格,力争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 2023 年 06 月 30 日,本基金 A 类基金份额净值为 1.1892 元,份额累计净值为 1.3799 元,本基金 C 类基金份额净值为 1.1611 元,份额累计净值为 1.3266 元,报告期内,本基金 A 类基金份额净值增长率为 1.36%,本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.97%,同期业绩基准增长率为-0.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济仍具有较强韧性,就业岗位增幅强劲,失业率保持在较低的水平,实际薪资增速回升,对居民消费能力起到强劲支撑作用,但通货膨胀率仍然较高。6 月美联储 FOMC 会议点阵图和利率预期显示今年还将加息 50bp,年内不降息,而 7 月加息 25bp 已经落地。随着美联储持续加息,经济增长可能会放缓,而这也是降低通胀的必要条件。以目前美国的经济韧性,美联储不得不接受通胀中枢提升,高通胀,高利率,高赤字会成为未来一定时期内美国经济的主要格局。展望国内情况,受疫情政策放开影响,消费环境发生了改变,接触性消费快速增长,叠加政策推动,消费潜力进一步释放。在稳经济、促恢复、扩内需等政策支撑下,市场预期好转,内需稳定恢复,加之降息等政策出台,支撑信贷规模扩张。随着宏观稳经济政策协同发力,整体经济继续稳步恢复,但有效需求不足的问题仍存,经济内生修复动能仍需加强,恢复和扩大需求是未来经济持续回升向好的关键所在。

在国际市场加息周期持续、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 2023 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 2023 年 6 月 30 日,恒生指数的市盈率(TTM)为 8.99,处在 2003 年以来的 10%分位。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

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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合规守信、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中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	9,687,474.92	11,292,908.20
结算备付金		5,215,951.65	1,295,066.28
存出保证金		658,390.34	53,752.33
交易性金融资产	6.4.3.2	112,582,089.26	105,401,229.87
其中：股票投资		112,582,089.26	105,401,229.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-

应收清算款		66,485.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		202,996.63	7,286.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		128,413,388.47	118,050,243.17
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	3,836,553.06
应付赎回款		4,823.41	15,374.92
应付管理人报酬		111,445.78	90,945.48
应付托管费		30,957.14	25,262.64
应付销售服务费		30,671.32	14,658.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	1,007,200.68	995,168.47
负债合计		1,185,098.33	4,977,962.91
净资产:			
实收基金	6.4.3.8	107,445,223.08	96,723,213.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	19,783,067.06	16,349,066.54
净资产合计		127,228,290.14	113,072,280.26
负债和净资产总计		128,413,388.47	118,050,243.17

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 107,445,223.08 份。其中 A 类基金份额净值 1.1892 元，基金份额总额 87,945,853.86 份；C 类基金份额净值 1.1611 元，基金份额总额 19,499,369.22 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		-1,609,814.18	-339,874.57

1. 利息收入		83,591.66	16,066.95
其中：存款利息收入	6.4.3.10	83,591.66	16,066.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		813,210.64	-1,464,282.13
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-613,258.45	-1,825,063.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	30,612.71	27,979.49
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-592,856.96	-
股利收益	6.4.3.15	1,988,713.34	332,801.38
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）	6.4.3.16	-2,543,329.98	879,267.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	36,713.50	229,073.59
减：二、营业总支出		1,224,308.84	305,106.53
1. 管理人报酬		710,735.31	125,401.05
2. 托管费		197,426.40	34,833.68
3. 销售服务费		221,119.32	87,927.97
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	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		22.37	0.04
8. 其他费用	6.4.3.19	95,005.44	56,943.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,834,123.02	-644,981.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,834,123.02	-644,981.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,834,123.02	-644,981.10

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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）	96,723,213.72	-	16,349,066.54	113,072,280.26
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）	96,723,213.72	-	16,349,066.54	113,072,280.26
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	10,722,009.36	-	3,434,000.52	14,156,009.88
（一）、综合收益总额	-	-	-2,834,123.02	-2,834,123.02
（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）	10,722,009.36	-	6,268,123.54	16,990,132.90
其中：1. 基金申购款	77,477,541.89	-	17,743,062.54	95,220,604.43
2. 基金赎回款	-66,755,532.53	-	-11,474,939.00	-78,230,471.53
（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）	-	-	-	-
（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）	107,445,223.08	-	19,783,067.06	127,228,290.14
项目	上年度可比期间 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 （基金净值）	7,020,614.20	-	3,786,037.39	10,806,651.59
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)	7,020,614.20	-	3,786,037.39	10,806,651.59
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	14,142,587.80	-	5,177,766.30	19,320,354.10
(一)、综合收益总额	-	-	-644,981.10	-644,981.10
(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)	14,142,587.80	-	5,822,747.40	19,965,335.20
其中: 1. 基金申购款	48,127,134.08	-	19,375,074.17	67,502,208.25
2. 基金赎回款	-33,984,546.28	-	-13,552,326.77	-47,536,873.05
(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)	-	-	-	-
(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)	21,163,202.00	-	8,963,803.69	30,127,005.69

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：徐卫，会计机构负责人：倡方方

6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

6.4.2.1 印花税

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

2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.2.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.2.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用

基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.2.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.2.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	9,687,474.92
等于：本金	9,685,522.33
加：应计利息	1,952.59
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	9,687,474.92

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	113,497,497.66	-	112,582,089.26	-915,408.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	113,497,497.66	-	112,582,089.26	-915,408.40

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	4,506,840.00	-	-	-
---股指期货	4,506,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,506,840.00	-	-	-

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

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IH2307	IH2307	6.00	4,461,120.00	-45,720.00
合计	-	-	-	-45,720.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-45,720.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.08
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	883,355.44
其中：交易所市场	883,355.44

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	123,843.16
合计	1,007,200.68

6.4.3.8 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	79,420,487.76	79,420,487.76
本期申购	10,318,749.66	10,318,749.66
本期赎回（以“-”号填列）	-1,793,383.56	-1,793,383.56
本期末	87,945,853.86	87,945,853.86

博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	17,302,725.96	17,302,725.96
本期申购	67,158,792.23	67,158,792.23
本期赎回（以“-”号填列）	-64,962,148.97	-64,962,148.97
本期末	19,499,369.22	19,499,369.22

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

6.4.3.9 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	50,939,367.83	-37,184,579.84	13,754,787.99
本期利润	1,609,887.44	-905,082.49	704,804.95
本期基金份额交易产生的变动数	6,145,322.76	-3,962,916.34	2,182,406.42
其中：基金申购款	7,414,272.40	-4,808,457.76	2,605,814.64
基金赎回款	-1,268,949.64	845,541.42	-423,408.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,694,578.03	-42,052,578.67	16,641,999.36

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	10,511,996.22	-7,917,717.67	2,594,278.55

本期利润	-1,900,680.48	-1,638,247.49	-3,538,927.97
本期基金份额交易产生的变动数	3,642,116.37	443,600.75	4,085,717.12
其中：基金申购款	44,748,686.63	-29,611,438.73	15,137,247.90
基金赎回款	-41,106,570.26	30,055,039.48	-11,051,530.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,253,432.11	-9,112,364.41	3,141,067.70

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	49,473.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	33,306.39
其他	811.40
合计	83,591.66

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,288,312,630.17
减：卖出股票成本总额	1,285,031,622.17
减：交易费用	3,894,266.45
买卖股票差价收入	-613,258.45

6.4.3.12 债券投资收益

6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	26.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	30,585.82
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	30,612.71

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	145,619.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	115,000.00
减：应计利息总额	28.02
减：交易费用	5.75
买卖债券差价收入	30,585.82

6.4.3.13 资产支持证券投资收益

6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.13.2 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。

6.4.3.14 衍生工具收益

6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-592,856.96

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,988,713.34
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	1,988,713.34

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,497,609.98
——股票投资	-2,497,609.98
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-45,720.00
——权证投资	-
——股指期货	-45,720.00
4. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-2,543,329.98

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	35,786.48
基金转换费收入	927.02
合计	36,713.50

6.4.3.18 信用减值损失

无。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
银行汇划费	6,662.28
合计	95,005.44

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

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。

6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
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
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	445,557,423.92	17.27%	196,842,889.83	34.78%

6.4.6.1.2 权证交易

无。

6.4.6.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	34,110.36	23.42%	54,463.80	34.22%

6.4.6.1.4 债券回购交易

无。

6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	414,948.82	17.27%	254,636.75	28.83%
关联方名称	上年度可比期间 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	183,311.18	35.35%	134,313.78	56.59%

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

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	710,735.31
其中：支付销售机构的客户维护费	104,091.57	17,544.41

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.90\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的托管费	197,426.40

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	-	199,685.84	199,685.84
中国农业银行	-	4,319.17	4,319.17
招商证券	-	285.95	285.95
合计	-	204,290.96	204,290.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	-	63,206.63
中国农业银行	-	4,070.29	4,070.29
合计	-	67,276.92	67,276.92

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

博时量化价值股票 C

份额单位：份

关联方名称	博时量化价值股票 C 本期末 2023 年 6 月 30 日		博时量化价值股票 C 上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金

		额的比例		总份额的比例
博时资本管理有限公司	13,754,212.23	12.80%	13,754,212.23	14.22%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。
 2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国农业银行-活期存款	9,687,474.92	49,473.87	1,860,922.56	11,938.20

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	1,688.00	44,478.80
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	2,298.00	58,024.50
上年度可比期间 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
招商证券股份有限公司	002948	青岛银行	网下发行	900.00	2,880.00
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	345.00	4,978.35
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	267.00	10,394.31

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个交易日	新股未上市	26.68	26.68	2,298.00	61,310.64	61,310.64	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个交易日	新股未上市	39.78	39.78	1,110.00	44,155.80	44,155.80	-
301486	致尚科技	2023-06-30	5 个交易日	新股未上市	57.66	57.66	670.00	38,632.20	38,632.20	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个交易日	新股未上市	19.99	19.99	1,851.00	37,001.49	37,001.49	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7 个交易日	新股未上市	36.90	36.90	760.00	28,044.00	28,044.00	-
601916	浙商银行	2023-06-27	7 个交易日	配股未上市	2.02	2.64	10,620.00	21,452.40	28,036.80	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	1,062.00	21,091.32	19,179.72	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	首次公开发行限售	29.60	71.42	167.00	4,943.20	11,927.14	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	675.00	7,492.50	11,520.00	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	首次公开	5.69	5.41	1,939.00	11,032.91	10,489.99	-

				发行 限售							
30132 5	曼恩 斯特	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限售	76.80	107.9 5	96.00	7,372 .80	10,36 3.20	-	
68836 1	中科 飞测	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	23.60	64.67	143.0 0	3,374 .80	9,247 .81	-	
68862 9	华丰 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	9.26	18.59	491.0 0	4,546 .66	9,127 .69	-	
68847 8	晶升 股份	2023- 04-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	32.52	42.37	193.0 0	6,276 .36	8,177 .41	-	
68844 3	智翔 金泰	2023- 06-13	6 个月	首次 公开 发行 限售	37.88	29.49	260.0 0	9,848 .80	7,667 .40	-	
68856 2	航天 软件	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	12.68	22.31	343.0 0	4,349 .24	7,652 .33	-	
68857 6	西山 科技	2023- 05-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	135.8 0	120.4 1	63.00	8,555 .40	7,585 .83	-	
30129 1	明阳 电气	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	38.13	31.03	233.0 0	8,884 .29	7,229 .99	-	
30139 5	仁信 新材	2023- 06-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.68	26.68	256.0 0	6,830 .08	6,830 .08	-	
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次 公开 发行 限售	43.67	53.05	127.0 0	5,546 .09	6,737 .35	-	
68848 4	南芯 科技	2023- 03-28	6 个月	首次 公开	39.99	36.71	179.0 0	7,158 .21	6,571 .09	-	

				发行 限售							
68814 6	中船 特气	2023- 04-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	36.15	38.13	167.0 0	6,037 .05	6,367 .71	-	
68858 2	芯动 联科	2023- 06-21	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.74	40.68	154.0 0	4,117 .96	6,264 .72	-	
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次 公开发 行 限售	21.86	23.85	255.0 0	5,574 .30	6,081 .75	-	
30129 5	美硕 科技	2023- 06-19	6 个月	首次 公开发 行 限售	37.40	36.07	168.0 0	6,283 .20	6,059 .76	-	
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	10.68	12.34	491.0 0	5,243 .88	6,058 .94	-	
30138 2	蜂助 手	2023- 05-09	6 个月	首次 公开发 行 限售	23.80	32.84	183.0 0	4,355 .40	6,009 .72	-	
30121 0	金杨 股份	2023- 06-21	6 个月	首次 公开发 行 限售	57.88	49.17	122.0 0	7,061 .36	5,998 .74	-	
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次 公开发 行 限售	75.00	90.76	61.00	4,575 .00	5,536 .36	-	
68853 5	华海 诚科	2023- 03-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	35.00	51.23	108.0 0	3,780 .00	5,532 .84	-	
30140 8	华人 健康	2023- 02-22	6 个月	首次 公开发 行 限售	16.24	16.95	324.0 0	5,261 .76	5,491 .80	-	
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次 公开	21.17	23.50	232.0 0	4,911 .44	5,452 .00	-	

				发行 限售							
68835 2	顾中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限售	12.10	12.07	445.0 0	5,384 .50	5,371 .15	-	
68833 4	西高 院	2023- 06-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.16	16.21	331.0 0	4,686 .96	5,365 .51	-	
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.18	14.59	366.0 0	4,091 .88	5,339 .94	-	
30142 8	世纪 恒通	2023- 05-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.35	30.60	169.0 0	4,453 .15	5,171 .40	-	
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限售	20.92	19.16	264.0 0	5,522 .88	5,058 .24	-	
30148 8	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个月	首次 公开 发行 限售	39.78	39.78	124.0 0	4,932 .72	4,932 .72	-	
30114 1	中科 磁业	2023- 03-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	41.20	42.69	113.0 0	4,655 .60	4,823 .97	-	
30133 2	德尔 玛	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.81	13.73	351.0 0	5,198 .31	4,819 .23	-	
68843 3	华曙 高科	2023- 04-07	6 个月	首次 公开 发行 限售	26.66	31.50	152.0 0	4,052 .32	4,788 .00	-	
68858 1	安杰 思	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	125.8 0	118.0 3	39.00	4,906 .20	4,603 .17	-	
30130 5	朗坤 环境	2023- 05-15	6 个月	首次 公开	25.25	19.69	230.0 0	5,807 .50	4,528 .70	-	

				发行 限售						
30148 6	致尚 科技	2023- 06-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	57.66	57.66	75.00	4,324 .50	4,324 .50	-
30117 0	锡南 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限售	34.00	34.93	119.0 0	4,046 .00	4,156 .67	-
30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	19.99	206.0 0	4,117 .94	4,117 .94	-
68863 1	莱斯 信息	2023- 06-19	6 个月	首次 公开 发行 限售	25.28	29.87	135.0 0	3,412 .80	4,032 .45	-
68847 9	友车 科技	2023- 05-04	6 个月	首次 公开 发行 限售	33.99	29.49	130.0 0	4,418 .70	3,833 .70	-
30124 6	宏源 药业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	50.00	30.71	124.0 0	6,200 .00	3,808 .04	-
30132 2	绿通 科技	2023- 02-27	6 个月	首次 公开 发行 限售	86.76	53.24	68.00	5,899 .95	3,620 .32	-
30138 6	未来 电器	2023- 03-21	6 个月	首次 公开 发行 限售	29.99	23.79	152.0 0	4,558 .48	3,616 .08	-
30120 3	国泰 环保	2023- 03-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	46.13	34.40	105.0 0	4,843 .65	3,612 .00	-
60106 1	中信 金属	2023- 03-30	6 个月	首次 公开 发行 限售	6.58	7.58	466.0 0	3,066 .28	3,532 .28	-
30126 1	恒工 精密	2023- 06-29	6 个月	首次 公开	36.90	36.90	85.00	3,136 .50	3,136 .50	-

				发行 限售							
60313 5	中重 科技	2023- 03-29	6 个月	首次 公开 发行 限售	17.80	17.89	166.0 0	2,954 .80	2,969 .74	-	
00138 0	华纬 科技	2023- 05-09	6 个月	首次 公开 发行 限售	28.84	30.78	93.00	2,682 .12	2,862 .54	-	
30143 9	泓淋 电力	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	19.99	16.90	143.0 0	2,858 .57	2,416 .70	-	
60313 7	恒尚 节能	2023- 04-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	15.90	17.09	126.0 0	2,003 .40	2,153 .34	-	
60113 3	柏诚 股份	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	11.66	12.26	164.0 0	1,912 .24	2,010 .64	-	
60317 2	万丰 股份	2023- 04-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.58	16.13	122.0 0	1,778 .76	1,967 .86	-	
00128 2	三联 锻造	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限售	27.93	33.03	57.00	1,592 .01	1,882 .71	-	
60106 5	江盐 集团	2023- 03-31	6 个月	首次 公开 发行 限售	10.36	11.84	159.0 0	1,647 .24	1,882 .56	-	
30134 5	涛涛 车业	2023- 03-10	6 个月	首次 公开 发行 限售	73.45	46.64	40.00	2,938 .00	1,865 .60	-	
00132 4	长青 科技	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限售	18.88	19.60	83.00	1,567 .04	1,626 .80	-	
60312 5	常青 科技	2023- 03-30	6 个月	首次 公开	25.98	24.53	53.00	1,376 .94	1,300 .09	-	

				发行 限售						
--	--	--	--	----------	--	--	--	--	--	--

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

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

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

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.9.2 信用风险

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

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

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

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

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

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合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。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	9,687,474.92	-	-	-	9,687,474.92
结算备付金	5,215,951.65	-	-	-	5,215,951.65
存出保证金	118,594.82	-	-	539,795.52	658,390.34
交易性金融资产	-	-	-	112,582,089.26	112,582,089.26
应收清算款	-	-	-	66,485.67	66,485.67
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	202,996.63	202,996.63
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,022,021.39	-	-	113,391,367.08	128,413,388.47
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,823.41	4,823.41
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	111,445.78	111,445.78

应付托管费	-	-	-	30,957.14	30,957.14
应付销售服务费	-	-	-	30,671.32	30,671.32
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,007,200.68	1,007,200.68
负债总计	-	-	-	1,185,098.33	1,185,098.33
利率敏感度缺口	15,022,021.39	-	-	-112,206,268.75	127,228,290.14
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	11,292,908.20	-	-	-	11,292,908.20
结算备付金	1,295,066.28	-	-	-	1,295,066.28
存出保证金	53,752.33	-	-	-	53,752.33
交易性金融资产	-	-	-	105,401,229.87	105,401,229.87
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,286.49	7,286.49
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,641,726.81	-	-	105,408,516.36	118,050,243.17
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	15,374.92	15,374.92
应付清算款	-	-	-	3,836,553.06	3,836,553.06
应付管理人报酬	-	-	-	90,945.48	90,945.48
应付托管费	-	-	-	25,262.64	25,262.64
应付销售服务费	-	-	-	14,658.34	14,658.34
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	995,168.47	995,168.47
负债总计	-	-	-	4,977,962.91	4,977,962.91
利率敏感度缺口	12,641,726.81	-	-	100,430,553.45	113,072,280.26

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

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资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（上期：同）。

6.4.9.4.2 外汇风险

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

6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	112,582,089.26	88.49	105,401,229.87	93.22
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
合计	112,582,089.26	88.49	105,401,229.87	93.22

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 508	增加约 556
	业绩比较基准下降 5%	减少约 508	减少约 556

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 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 2023年6月30日
第一层次	112,020,233.87
第二层次	260,522.67
第三层次	301,332.72
合计	112,582,089.26

6.4.10.2.2 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。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 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。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	112,582,089.26	87.67
	其中：股票	112,582,089.26	87.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,903,426.57	11.61
8	其他各项资产	927,872.64	0.72
9	合计	128,413,388.47	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	38,555.00	0.03
B	采矿业	1,914,276.00	1.50
C	制造业	64,674,814.49	50.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,522,087.00	3.55
E	建筑业	1,399,580.58	1.10
F	批发和零售业	2,624,364.94	2.06
G	交通运输、仓储和邮政业	4,614,254.40	3.63
H	住宿和餐饮业	78,505.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,455,936.00	5.07
J	金融业	17,757,527.00	13.96
K	房地产业	494,679.00	0.39
L	租赁和商务服务业	2,297,281.00	1.81
M	科学研究和技术服务业	2,159,159.51	1.70
N	水利、环境和公共设施管理业	1,714,009.70	1.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,689,681.64	1.33
R	文化、体育和娱乐业	147,378.00	0.12

S	综合	-	-
	合计	112,582,089.26	88.49

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	600519	贵州茅台	2,300	3,889,300.00	3.06
2	300750	宁德时代	12,160	2,782,086.40	2.19
3	601318	中国平安	58,600	2,719,040.00	2.14
4	600060	海信视像	91,300	2,259,675.00	1.78
5	000333	美的集团	37,816	2,228,118.72	1.75
6	002011	盾安环境	156,700	2,167,161.00	1.70
7	600011	华能国际	229,600	2,126,096.00	1.67
8	603345	安井食品	13,200	1,937,760.00	1.52
9	600036	招商银行	57,400	1,880,424.00	1.48
10	000858	五粮液	11,200	1,831,984.00	1.44
11	300532	今天国际	88,900	1,827,784.00	1.44
12	601166	兴业银行	115,000	1,799,750.00	1.41
13	688569	铁科轨道	42,314	1,780,149.98	1.40
14	603676	卫信康	124,600	1,721,972.00	1.35
15	300314	戴维医疗	79,300	1,676,402.00	1.32
16	002478	常宝股份	224,300	1,671,035.00	1.31
17	301103	何氏眼科	39,600	1,661,616.00	1.31
18	601333	广深铁路	417,900	1,654,884.00	1.30
19	600858	银座股份	272,300	1,644,692.00	1.29
20	603757	大元泵业	55,100	1,644,184.00	1.29
21	688305	科德数控	16,375	1,641,757.50	1.29
22	603199	九华旅游	46,700	1,613,485.00	1.27
23	301257	普蕊斯	28,500	1,601,700.00	1.26
24	600197	伊力特	57,400	1,559,558.00	1.23
25	000997	新大陆	82,200	1,553,580.00	1.22
26	300058	蓝色光标	147,200	1,423,424.00	1.12
27	002594	比亚迪	5,200	1,343,004.00	1.06
28	300624	万兴科技	11,200	1,312,080.00	1.03
29	000651	格力电器	33,900	1,237,689.00	0.97
30	600926	杭州银行	100,000	1,175,000.00	0.92
31	600900	长江电力	52,050	1,148,223.00	0.90
32	300274	阳光电源	8,400	979,692.00	0.77
33	601336	新华保险	22,800	838,356.00	0.66
34	600015	华夏银行	147,000	795,270.00	0.63
35	601398	工商银行	163,800	789,516.00	0.62
36	000568	泸州老窖	3,600	754,452.00	0.59

37	601328	交通银行	127,100	737,180.00	0.58
38	600276	恒瑞医药	15,200	728,080.00	0.57
39	601012	隆基绿能	25,300	725,351.00	0.57
40	600030	中信证券	35,600	704,168.00	0.55
41	601899	紫金矿业	61,500	699,255.00	0.55
42	300059	东方财富	49,141	697,802.20	0.55
43	600016	民生银行	184,100	690,375.00	0.54
44	601668	中国建筑	116,700	669,858.00	0.53
45	600887	伊利股份	23,200	657,024.00	0.52
46	000063	中兴通讯	14,000	637,560.00	0.50
47	601816	京沪高铁	115,500	607,530.00	0.48
48	600309	万华化学	6,900	606,096.00	0.48
49	002475	立讯精密	18,500	600,325.00	0.47
50	300760	迈瑞医疗	2,000	599,600.00	0.47
51	000725	京东方 A	137,400	561,966.00	0.44
52	603338	浙江鼎力	9,900	554,499.00	0.44
53	688630	芯碁微装	6,500	546,130.00	0.43
54	600000	浦发银行	75,100	543,724.00	0.43
55	600886	国投电力	42,900	542,685.00	0.43
56	603298	杭叉集团	22,800	536,940.00	0.42
57	688556	高测股份	10,100	536,714.00	0.42
58	600050	中国联通	111,100	533,280.00	0.42
59	300316	晶盛机电	7,500	531,750.00	0.42
60	603027	千禾味业	25,100	530,112.00	0.42
61	002459	晶澳科技	12,400	517,080.00	0.41
62	603197	保隆科技	9,500	515,375.00	0.41
63	300014	亿纬锂能	8,500	514,250.00	0.40
64	600085	同仁堂	8,900	512,284.00	0.40
65	600612	老凤祥	7,300	510,124.00	0.40
66	688599	天合光能	11,900	507,059.00	0.40
67	600115	中国东航	106,200	505,512.00	0.40
68	605117	德业股份	3,380	505,479.00	0.40
69	600061	国投资本	70,600	502,672.00	0.40
70	601877	正泰电器	18,100	500,465.00	0.39
71	002415	海康威视	15,100	499,961.00	0.39
72	002568	百润股份	13,700	497,995.00	0.39
73	601728	中国电信	88,200	496,566.00	0.39
74	002352	顺丰控股	11,000	495,990.00	0.39
75	000596	古井贡酒	2,000	494,760.00	0.39
76	300811	铂科新材	8,280	492,163.20	0.39
77	300124	汇川技术	7,600	487,996.00	0.38
78	603259	药明康德	7,800	486,018.00	0.38
79	002959	小熊电器	5,800	484,300.00	0.38

80	601021	春秋航空	8,400	482,748.00	0.38
81	600438	通威股份	13,900	476,909.00	0.37
82	600919	江苏银行	61,200	449,820.00	0.35
83	300896	爱美客	1,000	444,950.00	0.35
84	600089	特变电工	19,500	434,655.00	0.34
85	301101	明月镜片	10,300	422,609.00	0.33
86	002603	以岭药业	16,400	421,316.00	0.33
87	601818	光大银行	134,400	412,608.00	0.32
88	002027	分众传媒	58,900	401,109.00	0.32
89	600419	天润乳业	24,700	400,634.00	0.31
90	601229	上海银行	69,500	399,625.00	0.31
91	601888	中国中免	3,600	397,908.00	0.31
92	601997	贵阳银行	69,900	360,684.00	0.28
93	000002	万科 A	25,100	351,902.00	0.28
94	605088	冠盛股份	20,200	346,430.00	0.27
95	601825	沪农商行	63,300	344,985.00	0.27
96	300771	智莱科技	31,600	344,124.00	0.27
97	601077	渝农商行	93,900	337,101.00	0.26
98	600028	中国石化	48,700	309,732.00	0.24
99	603657	春光科技	17,200	301,860.00	0.24
100	601857	中国石油	40,400	301,788.00	0.24
101	603600	永艺股份	31,500	299,565.00	0.24
102	601601	中国太保	11,500	298,770.00	0.23
103	600741	华域汽车	15,500	286,130.00	0.22
104	301003	江苏博云	12,000	277,320.00	0.22
105	300543	朗科智能	27,200	269,008.00	0.21
106	301042	安联锐视	7,900	268,205.00	0.21
107	603788	宁波高发	21,700	267,344.00	0.21
108	002136	安纳达	23,400	266,292.00	0.21
109	603706	东方环宇	17,400	261,870.00	0.21
110	000548	湖南投资	54,100	261,844.00	0.21
111	603810	丰山集团	19,000	261,630.00	0.21
112	002105	信隆健康	43,700	260,015.00	0.20
113	603102	百合股份	6,000	259,140.00	0.20
114	600356	恒丰纸业	33,000	258,390.00	0.20
115	300743	天地数码	16,400	257,808.00	0.20
116	002722	物产金轮	18,300	253,821.00	0.20
117	603585	苏利股份	16,800	249,984.00	0.20
118	002938	鹏鼎控股	10,200	247,758.00	0.19
119	003019	宸展光电	11,666	239,153.00	0.19
120	601231	环旭电子	15,600	233,376.00	0.18
121	603368	柳药集团	8,600	212,506.00	0.17
122	603767	中马传动	13,200	204,072.00	0.16

123	601390	中国中铁	26,100	197,838.00	0.16
124	601169	北京银行	40,200	186,126.00	0.15
125	002056	横店东磁	9,800	178,458.00	0.14
126	603926	铁流股份	16,400	167,772.00	0.13
127	002533	金杯电工	20,200	164,832.00	0.13
128	000895	双汇发展	6,500	159,185.00	0.13
129	603185	弘元绿能	2,100	156,555.00	0.12
130	000776	广发证券	10,600	155,926.00	0.12
131	688525	佰维存储	1,938	154,826.82	0.12
132	601319	中国人保	26,400	154,176.00	0.12
133	688303	大全能源	3,600	145,620.00	0.11
134	601919	中远海控	15,420	144,948.00	0.11
135	601186	中国铁建	14,700	144,795.00	0.11
136	000906	浙商中拓	16,000	142,720.00	0.11
137	601699	潞安环能	8,500	138,720.00	0.11
138	300363	博腾股份	4,600	136,114.00	0.11
139	300951	博硕科技	2,400	131,112.00	0.10
140	603071	物产环能	7,900	131,061.00	0.10
141	601618	中国中冶	31,800	126,246.00	0.10
142	000933	神火股份	9,700	126,100.00	0.10
143	600873	梅花生物	13,800	123,234.00	0.10
144	601916	浙商银行	46,020	121,492.80	0.10
145	600273	嘉化能源	12,600	118,692.00	0.09
146	603369	今世缘	2,200	116,160.00	0.09
147	603886	元祖股份	6,300	115,542.00	0.09
148	601138	工业富联	4,500	113,400.00	0.09
149	600941	中国移动	1,200	111,960.00	0.09
150	002555	三七互娱	3,100	108,128.00	0.08
151	688289	圣湘生物	6,400	107,776.00	0.08
152	600180	瑞茂通	17,400	104,052.00	0.08
153	600019	宝钢股份	18,100	101,722.00	0.08
154	002737	葵花药业	4,100	99,794.00	0.08
155	600026	中远海能	7,800	98,592.00	0.08
156	003816	中国广核	31,400	97,654.00	0.08
157	688111	金山办公	200	94,444.00	0.07
158	603360	百傲化学	9,300	94,302.00	0.07
159	601168	西部矿业	8,600	90,386.00	0.07
160	601985	中国核电	12,800	90,240.00	0.07
161	002736	国信证券	10,200	89,046.00	0.07
162	601717	郑煤机	7,100	88,395.00	0.07
163	002756	永兴材料	1,400	87,654.00	0.07
164	601766	中国中车	13,100	85,150.00	0.07
165	600048	保利发展	6,500	84,695.00	0.07

166	601988	中国银行	21,400	83,674.00	0.07
167	300433	蓝思科技	7,100	83,496.00	0.07
168	002955	鸿合科技	3,500	82,425.00	0.06
169	600998	九州通	7,897	81,970.86	0.06
170	601088	中国神华	2,600	79,950.00	0.06
171	000408	藏格矿业	3,500	78,995.00	0.06
172	603967	中创物流	8,300	75,862.00	0.06
173	002609	捷顺科技	6,500	75,790.00	0.06
174	301291	明阳电气	2,322	75,331.39	0.06
175	600073	上海梅林	10,100	73,730.00	0.06
176	000822	山东海化	10,800	73,548.00	0.06
177	603233	大参林	2,600	72,826.00	0.06
178	600803	新奥股份	3,800	72,124.00	0.06
179	002022	科华生物	6,800	72,080.00	0.06
180	600837	海通证券	7,800	71,916.00	0.06
181	300121	阳谷华泰	7,300	69,715.00	0.05
182	601225	陕西煤业	3,800	69,122.00	0.05
183	301395	仁信新材	2,554	68,140.72	0.05
184	600642	申能股份	9,700	67,803.00	0.05
185	002543	万和电气	8,400	66,444.00	0.05
186	000048	京基智农	3,400	66,368.00	0.05
187	600258	首旅酒店	3,500	66,325.00	0.05
188	600057	厦门象屿	7,600	66,120.00	0.05
189	601688	华泰证券	4,800	66,096.00	0.05
190	603787	新日股份	3,900	65,559.00	0.05
191	000617	中油资本	8,800	63,624.00	0.05
192	000739	普洛药业	3,500	62,090.00	0.05
193	301210	金杨股份	1,213	61,999.77	0.05
194	601006	大秦铁路	8,300	61,669.00	0.05
195	603529	爱玛科技	1,900	61,218.00	0.05
196	300389	艾比森	3,000	61,110.00	0.05
197	300787	海能实业	3,050	60,085.00	0.05
198	600875	东方电气	3,200	59,680.00	0.05
199	601939	建设银行	9,300	58,218.00	0.05
200	600362	江西铜业	3,000	56,940.00	0.04
201	601800	中国交建	5,200	56,732.00	0.04
202	600219	南山铝业	18,600	56,172.00	0.04
203	600809	山西汾酒	300	55,521.00	0.04
204	600383	金地集团	7,700	55,517.00	0.04
205	600373	中文传媒	4,100	54,612.00	0.04
206	601211	国泰君安	3,900	54,561.00	0.04
207	603589	口子窖	1,100	54,285.00	0.04
208	603556	海兴电力	2,100	53,004.00	0.04

209	601658	邮储银行	10,800	52,812.00	0.04
210	002334	英威腾	4,100	52,234.00	0.04
211	600582	天地科技	8,900	51,887.00	0.04
212	300413	芒果超媒	1,500	51,315.00	0.04
213	000708	中信特钢	3,200	50,688.00	0.04
214	300515	三德科技	3,100	49,972.00	0.04
215	301488	豪恩汽电	1,234	49,088.52	0.04
216	002466	天齐锂业	700	48,937.00	0.04
217	600104	上汽集团	3,410	48,319.70	0.04
218	600256	广汇能源	7,000	48,020.00	0.04
219	601567	三星医疗	3,800	47,994.00	0.04
220	000938	紫光股份	1,500	47,775.00	0.04
221	002230	科大讯飞	700	47,572.00	0.04
222	301039	中集车辆	3,500	46,305.00	0.04
223	603688	石英股份	400	45,536.00	0.04
224	600585	海螺水泥	1,900	45,106.00	0.04
225	002727	一心堂	1,700	44,880.00	0.04
226	600662	外服控股	7,700	44,044.00	0.03
227	002106	莱宝高科	5,100	43,350.00	0.03
228	600905	三峡能源	8,000	42,960.00	0.03
229	301486	致尚科技	745	42,956.70	0.03
230	601890	亚星锚链	3,700	42,846.00	0.03
231	000034	神州数码	1,600	42,544.00	0.03
232	000877	天山股份	5,200	42,328.00	0.03
233	002432	九安医疗	1,200	42,252.00	0.03
234	002493	荣盛石化	3,600	41,904.00	0.03
235	301292	海科新源	2,057	41,119.43	0.03
236	688981	中芯国际	800	40,416.00	0.03
237	300827	上能电气	1,100	39,655.00	0.03
238	000977	浪潮信息	800	38,800.00	0.03
239	601009	南京银行	4,700	37,600.00	0.03
240	300231	银信科技	4,200	37,422.00	0.03
241	600702	舍得酒业	300	37,185.00	0.03
242	600132	重庆啤酒	400	36,864.00	0.03
243	000301	东方盛虹	3,100	36,642.00	0.03
244	600096	云天化	2,100	35,847.00	0.03
245	600511	国药股份	900	34,965.00	0.03
246	601669	中国电建	5,900	33,866.00	0.03
247	603566	普莱柯	1,400	32,550.00	0.03
248	603551	奥普家居	2,500	32,325.00	0.03
249	603986	兆易创新	300	31,875.00	0.03
250	002371	北方华创	100	31,765.00	0.02
251	301261	恒工精密	845	31,180.50	0.02

252	601998	中信银行	5,200	31,096.00	0.02
253	603758	秦安股份	2,900	30,856.00	0.02
254	000999	华润三九	500	30,330.00	0.02
255	600346	恒力石化	2,100	30,093.00	0.02
256	688318	财富趋势	300	29,991.00	0.02
257	600079	人福医药	1,100	29,634.00	0.02
258	603501	韦尔股份	300	29,412.00	0.02
259	600436	片仔癀	100	28,636.00	0.02
260	601163	三角轮胎	1,800	28,566.00	0.02
261	002017	东信和平	2,150	28,186.50	0.02
262	002049	紫光国微	300	27,975.00	0.02
263	600009	上海机场	600	27,252.00	0.02
264	600704	物产中大	5,400	26,676.00	0.02
265	600141	兴发集团	1,200	26,664.00	0.02
266	002410	广联达	820	26,641.80	0.02
267	600570	恒生电子	600	26,574.00	0.02
268	601117	中国化学	3,200	26,496.00	0.02
269	600153	建发股份	2,400	26,184.00	0.02
270	300039	上海凯宝	3,700	25,530.00	0.02
271	300815	玉禾田	1,700	25,296.00	0.02
272	600271	航天信息	1,800	24,642.00	0.02
273	001696	宗申动力	3,400	24,072.00	0.02
274	688511	天微电子	700	23,870.00	0.02
275	603301	振德医疗	800	23,696.00	0.02
276	000032	深桑达 A	700	23,030.00	0.02
277	601868	中国能建	9,700	22,698.00	0.02
278	002129	TCL 中环	675	22,410.00	0.02
279	600985	淮北矿业	1,900	21,888.00	0.02
280	000888	峨眉山 A	1,900	21,774.00	0.02
281	300444	双杰电气	2,800	21,560.00	0.02
282	000768	中航西飞	800	21,400.00	0.02
283	601019	山东出版	2,300	21,091.00	0.02
284	002714	牧原股份	500	21,075.00	0.02
285	600188	兖矿能源	700	20,944.00	0.02
286	000625	长安汽车	1,600	20,688.00	0.02
287	600018	上港集团	3,900	20,475.00	0.02
288	603019	中科曙光	400	20,360.00	0.02
289	000860	顺鑫农业	600	20,214.00	0.02
290	600795	国电电力	5,200	19,916.00	0.02
291	600537	亿晶光电	2,600	19,864.00	0.02
292	601881	中国银河	1,700	19,737.00	0.02
293	002033	丽江股份	1,800	19,584.00	0.02
294	688249	晶合集成	1,062	19,179.72	0.02

295	603508	思维列控	1,100	18,755.00	0.01
296	600039	四川路桥	1,860	18,246.60	0.01
297	600674	川投能源	1,200	18,060.00	0.01
298	002241	歌尔股份	1,000	17,750.00	0.01
299	601598	中国外运	3,800	17,708.00	0.01
300	300033	同花顺	100	17,528.00	0.01
301	300511	雪榕生物	2,300	17,480.00	0.01
302	000830	鲁西化工	1,600	16,896.00	0.01
302	688108	赛诺医疗	1,600	16,896.00	0.01
303	600054	黄山旅游	1,300	16,640.00	0.01
304	300668	杰恩设计	700	16,345.00	0.01
305	600029	南方航空	2,700	16,281.00	0.01
306	600755	厦门国贸	2,100	16,254.00	0.01
307	000707	双环科技	1,900	16,150.00	0.01
308	300015	爱尔眼科	870	16,138.50	0.01
309	000885	城发环境	1,200	15,972.00	0.01
310	600488	津药药业	2,800	15,736.00	0.01
311	300452	山河药辅	900	15,696.00	0.01
312	688012	中微公司	100	15,645.00	0.01
313	002932	明德生物	594	15,378.66	0.01
314	000792	盐湖股份	800	15,336.00	0.01
315	600502	安徽建工	2,900	15,312.00	0.01
316	601360	三六零	1,200	15,048.00	0.01
317	688418	震有科技	700	14,756.00	0.01
318	688036	传音控股	100	14,700.00	0.01
319	688190	云路股份	200	14,600.00	0.01
320	600588	用友网络	700	14,350.00	0.01
321	300390	天华新能	400	14,320.00	0.01
322	600596	新安股份	1,300	14,209.00	0.01
323	601038	一拖股份	1,200	14,088.00	0.01
324	601111	中国国航	1,700	14,008.00	0.01
325	002600	领益智造	2,000	13,820.00	0.01
326	603799	华友钴业	300	13,773.00	0.01
327	000661	长春高新	100	13,630.00	0.01
328	603800	道森股份	500	13,600.00	0.01
329	600845	宝信软件	260	13,210.60	0.01
330	600233	圆通速递	900	13,104.00	0.01
331	301150	中一科技	260	13,002.60	0.01
332	688357	建龙微纳	200	12,938.00	0.01
333	603628	清源股份	800	12,664.00	0.01
334	603898	好莱客	1,300	12,636.00	0.01
335	300628	亿联网络	360	12,625.20	0.01
336	688386	泛亚微透	300	12,600.00	0.01

337	300968	格林精密	1,400	12,446.00	0.01
338	300109	新开源	500	12,435.00	0.01
339	002186	全聚德	1,000	12,180.00	0.01
340	600111	北方稀土	500	11,990.00	0.01
341	301293	三博脑科	167	11,927.14	0.01
342	601898	中煤能源	1,400	11,816.00	0.01
343	600469	风神股份	1,800	11,592.00	0.01
344	688472	阿特斯	675	11,502.00	0.01
345	688008	澜起科技	200	11,484.00	0.01
346	000100	TCL 科技	2,900	11,426.00	0.01
347	600183	生益科技	800	11,360.00	0.01
348	002866	传艺科技	400	11,336.00	0.01
349	300454	深信服	100	11,325.00	0.01
350	002649	博彦科技	800	11,304.00	0.01
351	300534	陇神戎发	1,100	11,132.00	0.01
352	688722	同益中	600	11,124.00	0.01
353	600406	国电南瑞	480	11,088.00	0.01
354	300230	永利股份	3,100	10,974.00	0.01
355	000049	德赛电池	300	10,584.00	0.01
356	300909	汇创达	400	10,568.00	0.01
357	688469	中芯集成	1,939	10,489.99	0.01
358	688396	华润微	200	10,482.00	0.01
359	301325	曼恩斯特	96	10,363.20	0.01
360	688561	奇安信	200	10,362.00	0.01
361	002886	沃特股份	500	10,140.00	0.01
361	300976	达瑞电子	200	10,140.00	0.01
362	002149	西部材料	600	10,074.00	0.01
363	688456	有研粉材	300	10,041.00	0.01
364	300639	凯普生物	1,000	10,020.00	0.01
365	600583	海油工程	1,700	9,945.00	0.01
366	688398	赛特新材	290	9,903.50	0.01
367	002319	乐通股份	600	9,864.00	0.01
368	601872	招商轮船	1,700	9,843.00	0.01
369	600745	闻泰科技	200	9,780.00	0.01
370	688186	广大特材	300	9,759.00	0.01
371	603823	百合花	780	9,672.00	0.01
372	300782	卓胜微	100	9,663.00	0.01
373	002812	恩捷股份	100	9,635.00	0.01
373	300496	中科创达	100	9,635.00	0.01
374	002978	安宁股份	300	9,633.00	0.01
375	605287	德才股份	400	9,480.00	0.01
376	601226	华电重工	1,200	9,408.00	0.01
377	600584	长电科技	300	9,351.00	0.01

378	601137	博威合金	600	9,336.00	0.01
379	603979	金诚信	300	9,330.00	0.01
380	600871	石化油服	4,700	9,306.00	0.01
381	000420	吉林化纤	2,500	9,275.00	0.01
382	688196	卓越新能	200	9,250.00	0.01
383	688361	中科飞测	143	9,247.81	0.01
384	300041	回天新材	780	9,204.00	0.01
385	688629	华丰科技	491	9,127.69	0.01
386	002887	绿茵生态	1,000	9,090.00	0.01
387	605183	确成股份	500	9,050.00	0.01
388	300224	正海磁材	700	9,002.00	0.01
389	002053	云南能投	800	8,976.00	0.01
390	000589	贵州轮胎	1,600	8,960.00	0.01
391	688179	阿拉丁	300	8,958.00	0.01
392	601958	金铂股份	800	8,920.00	0.01
393	000055	方大集团	1,800	8,910.00	0.01
394	601686	友发集团	1,300	8,892.00	0.01
395	002442	龙星化工	1,800	8,856.00	0.01
396	000878	云南铜业	800	8,840.00	0.01
396	300122	智飞生物	200	8,840.00	0.01
397	688571	杭华股份	1,400	8,834.00	0.01
398	002683	广东宏大	300	8,832.00	0.01
399	000096	广聚能源	1,100	8,822.00	0.01
400	600531	豫光金铅	1,400	8,820.00	0.01
401	600508	上海能源	600	8,808.00	0.01
402	300408	三环集团	300	8,805.00	0.01
403	600143	金发科技	1,000	8,730.00	0.01
404	603300	华铁应急	1,600	8,720.00	0.01
405	600888	新疆众和	1,100	8,712.00	0.01
406	600423	柳化股份	2,800	8,708.00	0.01
407	600315	上海家化	300	8,703.00	0.01
408	002540	亚太科技	1,500	8,670.00	0.01
409	002062	宏润建设	1,600	8,656.00	0.01
410	605050	福然德	700	8,645.00	0.01
411	002775	文科园林	2,300	8,625.00	0.01
412	603878	武进不锈	1,020	8,619.00	0.01
413	002893	京能热力	800	8,616.00	0.01
414	300320	海达股份	1,100	8,613.00	0.01
415	600512	腾达建设	3,200	8,576.00	0.01
415	300234	开尔新材	1,600	8,576.00	0.01
416	000962	东方钨业	700	8,575.00	0.01
417	002171	楚江新材	1,200	8,544.00	0.01
418	002155	湖南黄金	700	8,540.00	0.01

419	300019	硅宝科技	500	8,525.00	0.01
420	603067	振华股份	700	8,505.00	0.01
421	603183	建研院	1,800	8,496.00	0.01
422	300384	三联虹普	500	8,495.00	0.01
423	002381	双箭股份	1,100	8,492.00	0.01
424	601003	柳钢股份	2,100	8,484.00	0.01
425	300796	贝斯美	700	8,421.00	0.01
426	603041	美思德	700	8,414.00	0.01
427	002203	海亮股份	700	8,407.00	0.01
428	600458	时代新材	700	8,393.00	0.01
429	605166	聚合顺	900	8,388.00	0.01
430	002066	瑞泰科技	700	8,365.00	0.01
431	002915	中欣氟材	500	8,355.00	0.01
432	002783	凯龙股份	1,000	8,340.00	0.01
433	300547	川环科技	500	8,335.00	0.01
434	601808	中海油服	600	8,328.00	0.01
435	603020	爱普股份	900	8,244.00	0.01
436	002709	天赐材料	200	8,238.00	0.01
437	601702	华峰铝业	600	8,208.00	0.01
438	000655	金岭矿业	1,300	8,203.00	0.01
439	603378	亚士创能	900	8,199.00	0.01
440	000719	中原传媒	700	8,190.00	0.01
441	688478	晶升股份	193	8,177.41	0.01
442	002179	中航光电	180	8,163.00	0.01
443	002081	金螳螂	1,800	8,118.00	0.01
444	003012	东鹏控股	1,000	8,090.00	0.01
445	600218	全柴动力	900	8,064.00	0.01
446	603993	洛阳钼业	1,500	7,995.00	0.01
447	300839	博汇股份	600	7,974.00	0.01
448	605077	华康股份	300	7,944.00	0.01
449	300142	沃森生物	300	7,935.00	0.01
450	301092	争光股份	300	7,854.00	0.01
451	301076	新瀚新材	400	7,848.00	0.01
452	688625	呈和科技	200	7,838.00	0.01
453	600971	恒源煤电	1,000	7,790.00	0.01
454	600035	楚天高速	1,900	7,752.00	0.01
455	600269	赣粤高速	2,100	7,707.00	0.01
456	600368	五洲交通	2,110	7,680.40	0.01
457	603861	白云电器	800	7,680.00	0.01
458	688443	智翔金泰	260	7,667.40	0.01
459	688562	航天软件	343	7,652.33	0.01
460	600549	厦门钨业	400	7,612.00	0.01
461	688576	西山科技	63	7,585.83	0.01

462	000823	超声电子	800	7,584.00	0.01
463	000421	南京公用	1,400	7,560.00	0.01
464	601666	平煤股份	1,000	7,540.00	0.01
464	002091	江苏国泰	1,000	7,540.00	0.01
465	002916	深南电路	100	7,537.00	0.01
466	600894	广日股份	1,000	7,530.00	0.01
467	600033	福建高速	2,400	7,512.00	0.01
468	002479	富春环保	1,600	7,456.00	0.01
469	600742	一汽富维	900	7,371.00	0.01
470	600284	浦东建设	1,200	7,344.00	0.01
471	000731	四川美丰	900	7,335.00	0.01
472	600938	中国海油	400	7,248.00	0.01
473	600025	华能水电	1,000	7,130.00	0.01
474	000498	山东路桥	1,100	7,062.00	0.01
475	603260	合盛硅业	100	7,002.00	0.01
476	000529	广弘控股	1,100	6,996.00	0.01
477	603659	璞泰来	180	6,879.60	0.01
478	002180	纳思达	200	6,850.00	0.01
479	002462	嘉事堂	500	6,840.00	0.01
480	688543	国科军工	127	6,737.35	0.01
481	002120	韵达股份	700	6,692.00	0.01
482	688484	南芯科技	179	6,571.09	0.01
483	300347	泰格医药	100	6,454.00	0.01
484	601100	恒立液压	100	6,433.00	0.01
485	002025	航天电器	100	6,380.00	0.01
485	603198	迎驾贡酒	100	6,380.00	0.01
486	688146	中船特气	167	6,367.71	0.01
487	300937	药易购	200	6,358.00	0.00
488	601788	光大证券	400	6,356.00	0.00
489	688126	沪硅产业	300	6,270.00	0.00
490	688582	芯动联科	154	6,264.72	0.00
491	688523	航天环宇	255	6,081.75	0.00
492	301295	美硕科技	168	6,059.76	0.00
493	688620	安凯微	491	6,058.94	0.00
494	600460	士兰微	200	6,054.00	0.00
495	301382	蜂助手	183	6,009.72	0.00
496	002236	大华股份	300	5,925.00	0.00
497	600566	济川药业	200	5,808.00	0.00
498	688223	晶科能源	400	5,624.00	0.00
499	688458	美芯晟	61	5,536.36	0.00
500	688535	华海诚科	108	5,532.84	0.00
501	301408	华人健康	324	5,491.80	0.00
502	688552	航天南湖	232	5,452.00	0.00

503	688352	颀中科技	445	5,371.15	0.00
504	688334	西高院	331	5,365.51	0.00
505	688593	新相微	366	5,339.94	0.00
506	603806	福斯特	140	5,206.60	0.00
507	301428	世纪恒通	169	5,171.40	0.00
508	688512	慧智微	264	5,058.24	0.00
509	300207	欣旺达	300	4,896.00	0.00
510	601066	中信建投	200	4,840.00	0.00
511	301141	中科磁业	113	4,823.97	0.00
512	301332	德尔玛	351	4,819.23	0.00
513	000726	鲁泰 A	700	4,788.00	0.00
513	688433	华曙高科	152	4,788.00	0.00
514	688581	安杰思	39	4,603.17	0.00
515	301305	朗坤环境	230	4,528.70	0.00
516	601086	国芳集团	1,000	4,450.00	0.00
516	603283	赛腾股份	100	4,450.00	0.00
517	605111	新洁能	100	4,352.00	0.00
518	002929	润建股份	100	4,341.00	0.00
519	688006	杭可科技	140	4,265.80	0.00
520	600879	航天电子	500	4,245.00	0.00
521	688007	光峰科技	200	4,170.00	0.00
522	301170	锡南科技	119	4,156.67	0.00
523	688631	莱斯信息	135	4,032.45	0.00
524	688093	世华科技	200	4,012.00	0.00
525	603171	税友股份	100	3,998.00	0.00
526	000910	大亚圣象	500	3,905.00	0.00
527	688479	友车科技	130	3,833.70	0.00
528	300759	康龙化成	100	3,828.00	0.00
529	688033	天宜上佳	200	3,824.00	0.00
530	301246	宏源药业	124	3,808.04	0.00
531	600363	联创光电	100	3,710.00	0.00
532	002990	盛视科技	100	3,680.00	0.00
533	002851	麦格米特	100	3,647.00	0.00
534	301322	绿通科技	68	3,620.32	0.00
535	300450	先导智能	100	3,617.00	0.00
536	301386	未来电器	152	3,616.08	0.00
537	301203	国泰环保	105	3,612.00	0.00
538	002335	科华数据	100	3,595.00	0.00
539	601995	中金公司	100	3,552.00	0.00
540	601061	中信金属	466	3,532.28	0.00
541	002063	远光软件	400	3,472.00	0.00
542	603032	德新科技	100	3,454.00	0.00
543	300319	麦捷科技	400	3,424.00	0.00

544	603220	中贝通信	200	3,410.00	0.00
545	300627	华测导航	100	3,247.00	0.00
546	603279	景津装备	100	3,136.00	0.00
547	688299	长阳科技	200	3,134.00	0.00
548	002782	可立克	200	3,058.00	0.00
549	600320	振华重工	800	2,984.00	0.00
550	603135	中重科技	166	2,969.74	0.00
551	600580	卧龙电驱	200	2,922.00	0.00
552	002660	茂硕电源	300	2,889.00	0.00
553	001380	华纬科技	93	2,862.54	0.00
554	002976	瑞玛精密	100	2,797.00	0.00
555	600481	双良节能	200	2,796.00	0.00
556	688586	江航装备	200	2,782.00	0.00
557	603466	风语筑	200	2,780.00	0.00
558	002635	安洁科技	200	2,760.00	0.00
559	601600	中国铝业	500	2,745.00	0.00
560	300978	东箭科技	200	2,726.00	0.00
561	002048	宁波华翔	200	2,680.00	0.00
562	603392	万泰生物	40	2,670.80	0.00
563	603040	新坐标	100	2,659.00	0.00
564	002141	贤丰控股	800	2,632.00	0.00
565	002139	拓邦股份	200	2,610.00	0.00
566	002724	海洋王	300	2,604.00	0.00
567	002690	美亚光电	100	2,575.00	0.00
568	600215	派斯林	300	2,565.00	0.00
569	603895	天永智能	100	2,553.00	0.00
570	002046	国机精工	200	2,552.00	0.00
571	300032	金龙机电	400	2,528.00	0.00
572	300155	安居宝	500	2,520.00	0.00
572	300352	北信源	500	2,520.00	0.00
573	603088	宁波精达	300	2,514.00	0.00
574	002158	汉钟精机	100	2,496.00	0.00
575	000338	潍柴动力	200	2,492.00	0.00
576	002467	二六三	500	2,485.00	0.00
577	600312	平高电气	200	2,478.00	0.00
578	300661	圣邦股份	30	2,463.90	0.00
579	002937	兴瑞科技	100	2,460.00	0.00
580	601222	林洋能源	300	2,457.00	0.00
581	000786	北新建材	100	2,451.00	0.00
582	000738	航发控制	100	2,440.00	0.00
583	300251	光线传媒	300	2,427.00	0.00
584	301439	泓淋电力	143	2,416.70	0.00
585	600288	大恒科技	200	2,414.00	0.00

586	603488	展鹏科技	300	2,409.00	0.00
587	002512	达华智能	600	2,406.00	0.00
588	600576	祥源文旅	300	2,391.00	0.00
589	002273	水晶光电	200	2,388.00	0.00
590	300523	辰安科技	100	2,386.00	0.00
591	600480	凌云股份	300	2,358.00	0.00
592	600637	东方明珠	300	2,346.00	0.00
593	002152	广电运通	200	2,344.00	0.00
593	600482	中国动力	100	2,344.00	0.00
594	605378	野马电池	100	2,331.00	0.00
595	002583	海能达	400	2,324.00	0.00
596	000020	深华发 A	200	2,314.00	0.00
597	000400	许继电气	100	2,305.00	0.00
598	002131	利欧股份	1,000	2,300.00	0.00
599	603158	腾龙股份	300	2,298.00	0.00
600	002438	江苏神通	200	2,296.00	0.00
600	002611	东方精工	400	2,296.00	0.00
601	002249	大洋电机	400	2,280.00	0.00
601	600517	国网英大	400	2,280.00	0.00
602	603881	数据港	100	2,259.00	0.00
603	001289	龙源电力	100	2,250.00	0.00
603	002526	山东矿机	900	2,250.00	0.00
603	002706	良信股份	200	2,250.00	0.00
604	300185	通裕重工	800	2,232.00	0.00
605	301028	东亚机械	200	2,230.00	0.00
606	000570	苏常柴 A	400	2,228.00	0.00
607	300718	长盛轴承	100	2,225.00	0.00
608	002389	航天彩虹	100	2,221.00	0.00
609	300304	云意电气	400	2,216.00	0.00
610	300219	鸿利智汇	300	2,205.00	0.00
611	002987	京北方	100	2,192.00	0.00
612	002270	华明装备	200	2,190.00	0.00
613	002885	京泉华	100	2,184.00	0.00
614	300004	南风股份	400	2,160.00	0.00
614	600815	厦工股份	800	2,160.00	0.00
615	000852	石化机械	300	2,157.00	0.00
616	300416	苏试试验	100	2,156.00	0.00
617	603137	恒尚节能	126	2,153.34	0.00
618	300300	海峡创新	500	2,145.00	0.00
619	600353	旭光电子	260	2,132.00	0.00
620	002484	江海股份	100	2,129.00	0.00
621	002421	达实智能	600	2,112.00	0.00
622	603989	艾华集团	100	2,106.00	0.00

622	300162	雷曼光电	300	2,106.00	0.00
623	002448	中原内配	300	2,100.00	0.00
624	002947	恒铭达	100	2,084.00	0.00
625	002322	理工能科	200	2,080.00	0.00
626	002080	中材科技	100	2,052.00	0.00
627	600379	宝光股份	200	2,040.00	0.00
628	600498	烽火通信	100	2,037.00	0.00
629	603096	新经典	100	2,036.00	0.00
630	300941	创识科技	100	2,034.00	0.00
631	000157	中联重科	300	2,025.00	0.00
632	600131	国网信通	100	2,019.00	0.00
633	601133	柏诚股份	164	2,010.64	0.00
634	300136	信维通信	100	2,008.00	0.00
635	603187	海容冷链	100	1,999.00	0.00
636	600761	安徽合力	100	1,993.00	0.00
637	002073	软控股份	300	1,986.00	0.00
638	600528	中铁工业	200	1,976.00	0.00
638	000982	中银绒业	1,300	1,976.00	0.00
639	300667	必创科技	100	1,969.00	0.00
640	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
641	002212	天融信	200	1,940.00	0.00
642	605167	利柏特	200	1,936.00	0.00
643	002283	天润工业	300	1,926.00	0.00
644	002446	盛路通信	200	1,890.00	0.00
645	001282	三联锻造	57	1,882.71	0.00
646	601065	江盐集团	159	1,882.56	0.00
647	301345	涛涛车业	40	1,865.60	0.00
648	603012	创力集团	300	1,851.00	0.00
649	600571	信雅达	200	1,828.00	0.00
650	300127	银河磁体	100	1,813.00	0.00
651	002284	亚太股份	200	1,794.00	0.00
652	002434	万里扬	200	1,790.00	0.00
653	603768	常青股份	100	1,777.00	0.00
654	002952	亚世光电	100	1,773.00	0.00
655	002698	博实股份	100	1,749.00	0.00
656	688009	中国通号	300	1,740.00	0.00
657	002402	和而泰	100	1,698.00	0.00
658	002454	松芝股份	200	1,694.00	0.00
659	603319	湘油泵	100	1,693.00	0.00
660	000951	中国重汽	100	1,685.00	0.00
661	603103	横店影视	100	1,684.00	0.00
662	600031	三一重工	100	1,663.00	0.00
663	002169	智光电气	200	1,658.00	0.00

664	001324	长青科技	83	1,626.80	0.00
665	000811	冰轮环境	100	1,576.00	0.00
666	300872	天阳科技	100	1,554.00	0.00
667	601126	四方股份	100	1,519.00	0.00
668	600372	中航电子	100	1,518.00	0.00
669	603950	长源东谷	100	1,496.00	0.00
670	603331	百达精工	100	1,478.00	0.00
671	300435	中泰股份	100	1,444.00	0.00
672	000066	中国长城	100	1,383.00	0.00
673	603118	共进股份	100	1,329.00	0.00
674	603125	常青科技	53	1,300.09	0.00
675	600970	中材国际	100	1,275.00	0.00
676	601179	中国西电	200	1,082.00	0.00
677	000657	中钨高新	100	969.00	0.00
678	688425	铁建重工	200	962.00	0.00
679	600968	海油发展	300	921.00	0.00
680	000050	深天马 A	100	918.00	0.00
681	600229	城市传媒	100	852.00	0.00
682	601611	中国核建	100	845.00	0.00
683	000778	新兴铸管	200	816.00	0.00
684	600339	中油工程	200	814.00	0.00
685	600500	中化国际	100	556.00	0.00
686	600497	驰宏锌锗	100	502.00	0.00
687	000825	太钢不锈	100	387.00	0.00
688	600782	新钢股份	100	371.00	0.00
689	601106	中国一重	100	336.00	0.00
690	601399	国机重装	100	318.00	0.00
691	000898	鞍钢股份	100	278.00	0.00
692	600808	马钢股份	100	257.00	0.00
693	601005	重庆钢铁	100	140.00	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	600036	招商银行	22,790,181.67	20.16
2	601318	中国平安	20,434,179.00	18.07
3	300750	宁德时代	18,153,417.60	16.05
4	600519	贵州茅台	16,198,364.00	14.33
5	601166	兴业银行	14,192,689.00	12.55
6	000858	五粮液	11,639,893.00	10.29

7	000333	美的集团	9,388,990.64	8.30
8	300059	东方财富	9,171,324.56	8.11
9	600900	长江电力	9,110,138.00	8.06
10	601668	中国建筑	8,558,170.00	7.57
11	301042	安联锐视	7,795,300.00	6.89
12	601398	工商银行	7,749,379.00	6.85
13	600048	保利发展	7,590,299.00	6.71
14	600050	中国联通	7,348,636.00	6.50
15	601012	隆基绿能	7,318,046.00	6.47
16	002415	海康威视	6,489,091.00	5.74
17	601328	交通银行	6,436,644.00	5.69
18	600016	民生银行	6,281,924.00	5.56
19	603788	宁波高发	6,262,647.00	5.54
20	601728	中国电信	6,216,179.00	5.50
21	603706	东方环宇	5,724,268.00	5.06
22	300274	阳光电源	5,634,078.00	4.98
23	000568	泸州老窖	5,544,362.00	4.90
24	601899	紫金矿业	5,263,360.00	4.65
25	601818	光大银行	5,212,869.00	4.61
26	000725	京东方 A	5,176,055.00	4.58
27	000002	万科 A	5,174,108.00	4.58
28	605108	同庆楼	5,143,746.90	4.55
29	601390	中国中铁	5,138,579.00	4.54
30	000651	格力电器	5,090,950.00	4.50
31	600000	浦发银行	5,077,177.00	4.49
32	605287	德才股份	5,067,961.00	4.48
33	000001	平安银行	5,049,366.00	4.47
34	600057	厦门象屿	4,906,636.00	4.34
35	601888	中国中免	4,899,939.00	4.33
36	600309	万华化学	4,807,238.99	4.25
37	300760	迈瑞医疗	4,804,404.00	4.25
38	603035	常熟汽饰	4,757,081.00	4.21
39	600919	江苏银行	4,718,536.18	4.17
40	688511	天微电子	4,702,297.16	4.16
41	002594	比亚迪	4,689,610.00	4.15
42	300532	今天国际	4,619,076.60	4.09
43	601229	上海银行	4,588,173.00	4.06
44	603937	丽岛新材	4,536,983.00	4.01
45	600028	中国石化	4,528,911.00	4.01
46	600809	山西汾酒	4,516,347.00	3.99
47	603259	药明康德	4,394,012.00	3.89
48	688556	高测股份	4,340,711.54	3.84
49	603529	爱玛科技	4,297,184.00	3.80

50	601997	贵阳银行	4,278,353.27	3.78
51	300218	安利股份	4,203,593.00	3.72
52	300375	鹏翎股份	4,171,778.18	3.69
53	601857	中国石油	4,162,124.00	3.68
54	603926	铁流股份	4,157,883.66	3.68
55	600153	建发股份	4,105,287.00	3.63
56	003015	日久光电	4,036,746.88	3.57
57	601766	中国中车	4,002,942.00	3.54
58	601699	潞安环能	3,991,606.00	3.53
59	601186	中国铁建	3,982,032.00	3.52
60	300583	赛托生物	3,956,473.52	3.50
61	601601	中国太保	3,928,416.00	3.47
62	600073	上海梅林	3,868,700.00	3.42
63	002475	立讯精密	3,862,348.00	3.42
64	601117	中国化学	3,857,362.00	3.41
65	002714	牧原股份	3,845,975.00	3.40
66	605009	豪悦护理	3,834,287.48	3.39
67	600015	华夏银行	3,801,734.10	3.36
68	300124	汇川技术	3,744,140.00	3.31
69	601088	中国神华	3,733,680.64	3.30
70	600782	新钢股份	3,733,080.00	3.30
71	600419	天润乳业	3,723,215.00	3.29
72	300884	狄耐克	3,665,347.60	3.24
73	601825	沪农商行	3,615,785.00	3.20
74	002230	科大讯飞	3,611,008.00	3.19
75	301033	迈普医学	3,580,074.39	3.17
76	605077	华康股份	3,574,230.00	3.16
77	002600	领益智造	3,559,259.00	3.15
78	603928	兴业股份	3,518,794.00	3.11
79	603767	中马传动	3,475,768.00	3.07
80	601988	中国银行	3,459,995.00	3.06
81	300519	新光药业	3,445,930.00	3.05
82	600019	宝钢股份	3,437,558.00	3.04
83	603027	千禾味业	3,426,755.68	3.03
84	600585	海螺水泥	3,404,479.00	3.01
85	002142	宁波银行	3,401,757.00	3.01
86	000932	华菱钢铁	3,371,509.00	2.98
87	603676	卫信康	3,341,078.00	2.95
88	600546	山煤国际	3,310,666.78	2.93
89	600548	深高速	3,305,368.14	2.92
90	601939	建设银行	3,305,082.00	2.92
91	300076	GQY 视讯	3,301,340.00	2.92
92	600030	中信证券	3,301,266.80	2.92

93	002027	分众传媒	3,283,924.00	2.90
94	601985	中国核电	3,274,414.00	2.90
95	002105	信隆健康	3,274,365.00	2.90
96	600438	通威股份	3,272,550.00	2.89
97	301017	漱玉平民	3,262,751.00	2.89
98	600011	华能国际	3,258,785.00	2.88
99	601919	中远海控	3,221,504.00	2.85
100	601816	京沪高铁	3,191,292.00	2.82
101	300543	朗科智能	3,183,364.00	2.82
102	600837	海通证券	3,179,266.00	2.81
103	603006	黎明股份	3,173,316.00	2.81
104	601998	中信银行	3,168,318.00	2.80
105	002871	伟隆股份	3,165,234.79	2.80
106	688080	映翰通	3,158,694.84	2.79
107	300141	和顺电气	3,158,415.00	2.79
108	300042	朗科科技	3,134,853.00	2.77
109	300316	晶盛机电	3,131,434.00	2.77
110	600406	国电南瑞	3,112,466.84	2.75
111	600039	四川路桥	3,086,290.00	2.73
112	300935	盈建科	3,085,965.60	2.73
113	601169	北京银行	2,978,439.00	2.63
114	688069	德林海	2,953,656.36	2.61
115	000028	国药一致	2,923,909.00	2.59
116	603345	安井食品	2,920,859.00	2.58
117	600887	伊利股份	2,914,097.00	2.58
118	002011	盾安环境	2,884,646.00	2.55
119	000937	冀中能源	2,849,380.00	2.52
120	000830	鲁西化工	2,810,576.00	2.49
121	002649	博彦科技	2,800,270.00	2.48
122	600596	新安股份	2,775,411.00	2.45
123	600060	海信视像	2,765,064.00	2.45
124	300017	网宿科技	2,752,841.00	2.43
125	688569	铁科轨道	2,744,538.89	2.43
126	605117	德业股份	2,734,118.40	2.42
127	002352	顺丰控股	2,718,249.00	2.40
128	601077	渝农商行	2,711,883.00	2.40
129	600276	恒瑞医药	2,710,791.20	2.40
130	688217	睿昂基因	2,707,423.25	2.39
131	002959	小熊电器	2,677,921.00	2.37
132	600559	老白干酒	2,668,459.00	2.36
133	002952	亚世光电	2,661,612.00	2.35
134	300014	亿纬锂能	2,661,100.00	2.35
135	601688	华泰证券	2,658,562.78	2.35

136	300789	唐源电气	2,654,361.00	2.35
137	600985	淮北矿业	2,653,101.00	2.35
138	002938	鹏鼎控股	2,645,367.39	2.34
139	603019	中科曙光	2,621,241.00	2.32
140	601138	工业富联	2,609,455.00	2.31
141	300889	爱克股份	2,563,035.00	2.27
142	688399	硕世生物	2,555,840.02	2.26
143	601577	长沙银行	2,545,762.70	2.25
144	600273	嘉化能源	2,537,178.00	2.24
145	601800	中国交建	2,531,884.00	2.24
146	002748	世龙实业	2,528,057.00	2.24
147	000422	湖北宜化	2,524,653.57	2.23
148	600389	江山股份	2,517,487.00	2.23
149	601225	陕西煤业	2,512,188.00	2.22
150	603080	新疆火炬	2,502,486.00	2.21
151	300515	三德科技	2,462,471.00	2.18
152	601678	滨化股份	2,450,463.00	2.17
153	002271	东方雨虹	2,449,561.00	2.17
154	688011	新光光电	2,448,603.52	2.17
155	603219	富佳股份	2,417,127.00	2.14
156	601211	国泰君安	2,414,487.00	2.14
157	601669	中国电建	2,414,267.00	2.14
158	300639	凯普生物	2,397,528.00	2.12
159	000906	浙高中拓	2,386,415.00	2.11
160	600761	安徽合力	2,362,530.00	2.09
161	601658	邮储银行	2,362,014.00	2.09
162	300150	世纪瑞尔	2,361,217.00	2.09
163	300058	蓝色光标	2,338,604.00	2.07
164	300314	戴维医疗	2,338,069.00	2.07
165	002478	常宝股份	2,320,047.00	2.05
166	301103	何氏眼科	2,315,365.51	2.05
167	603757	大元泵业	2,312,109.00	2.04
168	688981	中芯国际	2,297,136.22	2.03
169	000063	中兴通讯	2,281,856.00	2.02
170	603199	九华旅游	2,267,854.00	2.01
171	301257	普蕊斯	2,267,748.00	2.01

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	600036	招商银行	26,958,793.83	23.84
2	601318	中国平安	24,986,328.50	22.10
3	600519	贵州茅台	18,733,502.96	16.57
4	300750	宁德时代	18,296,825.39	16.18
5	601166	兴业银行	15,764,989.86	13.94
6	000858	五粮液	12,005,340.00	10.62
7	600900	长江电力	10,917,319.00	9.66
8	300059	东方财富	10,820,820.86	9.57
9	000333	美的集团	9,808,250.40	8.67
10	601398	工商银行	9,657,782.00	8.54
11	600048	保利发展	8,252,294.72	7.30
12	601328	交通银行	8,135,112.00	7.19
13	601668	中国建筑	8,046,486.80	7.12
14	600016	民生银行	7,959,522.00	7.04
15	301042	安联锐视	7,708,101.38	6.82
16	601012	隆基绿能	7,694,392.52	6.80
17	000001	平安银行	6,985,113.00	6.18
18	002415	海康威视	6,839,283.46	6.05
19	600000	浦发银行	6,749,801.37	5.97
20	000568	泸州老窖	6,637,186.00	5.87
21	000651	格力电器	6,478,090.00	5.73
22	601888	中国中免	6,458,028.00	5.71
23	600050	中国联通	6,297,794.00	5.57
24	600309	万华化学	6,217,548.00	5.50
25	300760	迈瑞医疗	6,164,440.00	5.45
26	603259	药明康德	6,120,470.00	5.41
27	603788	宁波高发	6,033,389.00	5.34
28	601899	紫金矿业	5,690,354.00	5.03
29	002714	牧原股份	5,639,403.00	4.99
30	000002	万科 A	5,575,275.00	4.93
31	603706	东方环宇	5,476,673.00	4.84
32	002475	立讯精密	5,355,468.18	4.74
33	605108	同庆楼	5,330,507.20	4.71
34	603035	常熟汽饰	5,283,965.96	4.67
35	601728	中国电信	5,270,379.00	4.66
36	300124	汇川技术	5,134,231.00	4.54
37	601390	中国中铁	5,109,920.00	4.52
38	605287	德才股份	5,022,972.00	4.44
39	000725	京东方 A	4,974,515.00	4.40
40	601818	光大银行	4,867,418.00	4.30
41	600057	厦门象屿	4,807,337.00	4.25
42	688511	天微电子	4,752,765.37	4.20

43	600030	中信证券	4,751,877.20	4.20
44	601699	潞安环能	4,702,427.00	4.16
45	600919	江苏银行	4,495,894.00	3.98
46	600887	伊利股份	4,495,709.00	3.98
47	300274	阳光电源	4,492,786.00	3.97
48	603937	丽岛新材	4,472,293.00	3.96
49	002594	比亚迪	4,464,097.04	3.95
50	600028	中国石化	4,393,344.00	3.89
51	301033	迈普医学	4,393,155.21	3.89
52	601857	中国石油	4,385,500.00	3.88
53	601229	上海银行	4,351,709.43	3.85
54	600276	恒瑞医药	4,266,833.20	3.77
55	603529	爱玛科技	4,250,320.20	3.76
56	300218	安利股份	4,250,300.00	3.76
57	600809	山西汾酒	4,202,038.00	3.72
58	300375	鹏翎股份	4,201,577.10	3.72
59	300583	赛托生物	4,085,442.00	3.61
60	003015	日久光电	4,052,500.00	3.58
61	601186	中国铁建	4,026,608.00	3.56
62	603926	铁流股份	4,026,365.01	3.56
63	600153	建发股份	4,011,731.00	3.55
64	605077	华康股份	3,992,653.20	3.53
65	002230	科大讯飞	3,966,008.00	3.51
66	601766	中国中车	3,958,892.00	3.50
67	688556	高测股份	3,921,147.74	3.47
68	601997	贵阳银行	3,887,228.00	3.44
69	601088	中国神华	3,874,915.00	3.43
70	600782	新钢股份	3,809,100.00	3.37
71	605009	豪悦护理	3,756,474.20	3.32
72	300884	狄耐克	3,721,324.00	3.29
73	300532	今天国际	3,709,807.00	3.28
74	601117	中国化学	3,697,369.00	3.27
75	601601	中国太保	3,696,562.00	3.27
76	600073	上海梅林	3,669,329.00	3.25
77	300042	朗科科技	3,667,143.11	3.24
78	603928	兴业股份	3,631,170.00	3.21
79	002600	领益智造	3,567,797.00	3.16
80	601988	中国银行	3,548,614.00	3.14
81	300519	新光药业	3,525,441.00	3.12
82	600585	海螺水泥	3,524,423.00	3.12
83	603767	中马传动	3,502,003.00	3.10
84	000932	华菱钢铁	3,483,047.00	3.08
85	603006	黎明股份	3,474,335.00	3.07

86	601939	建设银行	3,443,596.00	3.05
87	002142	宁波银行	3,381,783.00	2.99
88	601816	京沪高铁	3,360,536.00	2.97
89	600019	宝钢股份	3,357,331.99	2.97
90	600548	深高速	3,323,532.00	2.94
91	601919	中远海控	3,314,229.60	2.93
92	688080	映翰通	3,293,531.09	2.91
93	600419	天润乳业	3,272,781.10	2.89
94	601985	中国核电	3,270,124.00	2.89
95	601998	中信银行	3,262,267.00	2.89
96	600837	海通证券	3,255,637.00	2.88
97	601825	沪农商行	3,252,959.00	2.88
98	600546	山煤国际	3,203,629.00	2.83
99	688217	睿昂基因	3,198,286.36	2.83
100	300076	GQY 视讯	3,163,737.00	2.80
101	600015	华夏银行	3,162,692.00	2.80
102	600039	四川路桥	3,145,609.00	2.78
103	600406	国电南瑞	3,126,337.40	2.76
104	301017	漱玉平民	3,113,922.00	2.75
105	300141	和顺电气	3,091,432.42	2.73
106	300935	盈建科	3,052,900.96	2.70
107	002027	分众传媒	3,040,923.00	2.69
108	688069	德林海	3,025,284.65	2.68
109	002871	伟隆股份	3,015,001.00	2.67
110	002938	鹏鼎控股	3,007,070.25	2.66
111	601169	北京银行	3,001,502.00	2.65
112	300543	朗科智能	2,995,967.00	2.65
113	003040	楚天龙	2,991,102.96	2.65
114	000028	国药一致	2,958,739.70	2.62
115	002105	信隆健康	2,935,227.00	2.60
116	002959	小熊电器	2,902,821.00	2.57
117	601138	工业富联	2,871,478.00	2.54
118	603027	千禾味业	2,832,996.80	2.51
119	300017	网宿科技	2,829,058.64	2.50
120	000937	冀中能源	2,803,949.70	2.48
121	002352	顺丰控股	2,779,191.43	2.46
122	000830	鲁西化工	2,775,795.00	2.45
123	300761	立华股份	2,774,735.00	2.45
124	002085	万丰奥威	2,753,541.52	2.44
125	601688	华泰证券	2,752,216.00	2.43
126	300910	瑞丰新材	2,747,662.00	2.43
127	600438	通威股份	2,741,724.00	2.42
128	002952	亚世光电	2,721,858.00	2.41

129	603019	中科曙光	2,720,902.00	2.41
130	300502	新易盛	2,693,854.00	2.38
131	002748	世龙实业	2,675,409.00	2.37
132	002982	湘佳股份	2,672,454.00	2.36
133	600596	新安股份	2,663,605.40	2.36
134	300889	爱克股份	2,661,226.00	2.35
135	002649	博彦科技	2,656,579.00	2.35
136	300316	晶盛机电	2,643,633.00	2.34
137	601225	陕西煤业	2,631,074.00	2.33
138	300789	唐源电气	2,619,036.20	2.32
139	601577	长沙银行	2,576,889.74	2.28
140	600559	老白干酒	2,576,439.00	2.28
141	600985	淮北矿业	2,573,956.00	2.28
142	688011	新光光电	2,573,873.29	2.28
143	603219	富佳股份	2,547,114.00	2.25
144	301004	嘉益股份	2,541,848.00	2.25
145	300298	三诺生物	2,526,376.00	2.23
146	601211	国泰君安	2,515,160.00	2.22
147	300575	中旗股份	2,509,846.00	2.22
148	000913	钱江摩托	2,507,512.00	2.22
149	601800	中国交建	2,502,392.00	2.21
150	300515	三德科技	2,469,948.00	2.18
151	603080	新疆火炬	2,465,302.01	2.18
152	002271	东方雨虹	2,447,422.00	2.16
153	688399	硕世生物	2,435,305.71	2.15
154	300150	世纪瑞尔	2,425,685.00	2.15
155	600389	江山股份	2,422,132.70	2.14
156	601678	滨化股份	2,420,729.00	2.14
157	601077	渝农商行	2,415,715.00	2.14
158	000422	湖北宣化	2,405,473.00	2.13
159	601658	邮储银行	2,384,970.00	2.11
160	600273	嘉化能源	2,376,122.00	2.10
161	002942	新农股份	2,358,311.70	2.09
162	601628	中国人寿	2,341,029.00	2.07
163	601669	中国电建	2,335,668.00	2.07
164	300639	凯普生物	2,300,116.36	2.03
165	600104	上汽集团	2,298,858.00	2.03
166	600761	安徽合力	2,294,373.00	2.03
167	000983	山西焦煤	2,288,783.00	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,294,710,091.54
卖出股票的收入（成交）总额	1,288,312,630.17

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国银行保险监督管理委员会和中国人民银行的处罚。中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制前一年受到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	658,390.34
2	应收清算款	66,485.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	202,996.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	927,872.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时量化价值股票 A	802	109,658.17	74,692,427.73	84.93%	13,253,426.13	15.07%
博时量化价值股票 C	532	36,652.95	13,950,596.32	71.54%	5,548,772.90	28.46%
合计	1,247	86,162.97	88,643,024.05	82.50%	18,802,199.03	17.50%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化价值股票 A	-	-
	博时量化价值股票 C	50.00	0.00%
	合计	50.00	0.00%

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

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 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	79,420,487.76	17,302,725.96
本报告期基金总申购份额	10,318,749.66	67,158,792.23
减：本报告期基金总赎回份额	1,793,383.56	64,962,148.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	87,945,853.86	19,499,369.22

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 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》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 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》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	539,964,195.32	20.93%	502,857.96	20.93%	-
国泰君安	1	295,814,079.02	11.47%	275,490.49	11.47%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	174,218,028.76	6.75%	162,249.11	6.75%	-
申万宏源	2	1,005,121,242.99	38.96%	936,080.84	38.96%	-
招商证券	2	445,557,423.92	17.27%	414,948.82	17.27%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	118,955,372.62	4.61%	110,782.89	4.61%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	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，我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

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
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	61,941.59	42.54%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	49,567.64	34.04%	-	-	-	-

招商证券	34,110.36	23.42%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
2	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	2023-05-27
3	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-17
4	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-12
5	博时量化价值股票型证券投资基金 2023 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	2023-04-22
6	博时量化价值股票型证券投资基金 2022 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	2023-03-30
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	2023-03-09
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	2023-03-09
9	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08
10	博时基金管理有限公司关于博时量化价值股票型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-08

11	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	2023-02-18
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业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	2023-02-13
13	博时量化价值股票型证券投资基金 2022 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	2023-01-20
14	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-20230104	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§ 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	2023-01-01~2023-06-30	44,060,963.41	-	-	44,060,963.41	41.01%
	2	2023-01-01~2023-03-21;2023-03-23~2023-03-26;2023-04-10~2023-06-30	30,631,464.32	-	-	30,631,464.32	28.51%
	3	2023-02-06~2023-03-12;2023-04-28~2023-05-04	-	28,466,289.66	28,466,289.66	-	-
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。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化价值股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化价值股票型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时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

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
二〇二三年八月三十一日