

博时量化价值股票型证券投资基金
2024 年中期报告
2024 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：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	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遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55

7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 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	194,893,243.18 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	96,909,846.93 份	97,983,396.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。
投资策略	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	任航
	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（2024 年 1 月 1 日至 2024 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	8,233,593.26	2,198,602.45
本期利润	4,790,986.13	-2,369,877.29
加权平均基金份额本期利润	0.0476	-0.0406
本期加权平均净值利润率	4.14%	-3.60%
本期基金份额净值增长率	2.55%	2.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 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	12,199,365.12	8,872,191.27
期末可供分配基金份额利润	0.1259	0.0905
期末基金资产净值	109,109,212.05	106,855,587.52
期末基金份额净值	1.1259	1.0905

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024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	31.09%	24.91%

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	-4.45%	0.56%	-2.61%	0.43%	-1.84%	0.13%
过去三个月	-4.92%	0.76%	0.19%	0.68%	-5.11%	0.08%
过去六个月	2.55%	0.86%	1.98%	0.82%	0.57%	0.04%
过去一年	-5.32%	0.79%	-7.61%	0.81%	2.29%	-0.02%
过去三年	-12.98%	0.92%	-29.55%	0.98%	16.57%	-0.06%
自基金合同生效起至今	31.09%	1.09%	-3.08%	1.08%	34.17%	0.01%

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	-4.51%	0.56%	-2.61%	0.43%	-1.90%	0.13%
过去三个月	-5.12%	0.76%	0.19%	0.68%	-5.31%	0.08%
过去六个月	2.14%	0.86%	1.98%	0.82%	0.16%	0.04%
过去一年	-6.08%	0.79%	-7.61%	0.81%	1.53%	-0.02%
过去三年	-15.04%	0.92%	-29.55%	0.98%	14.51%	-0.06%
自基金合同生效起至今	24.91%	1.09%	-3.08%	1.08%	27.99%	0.01%

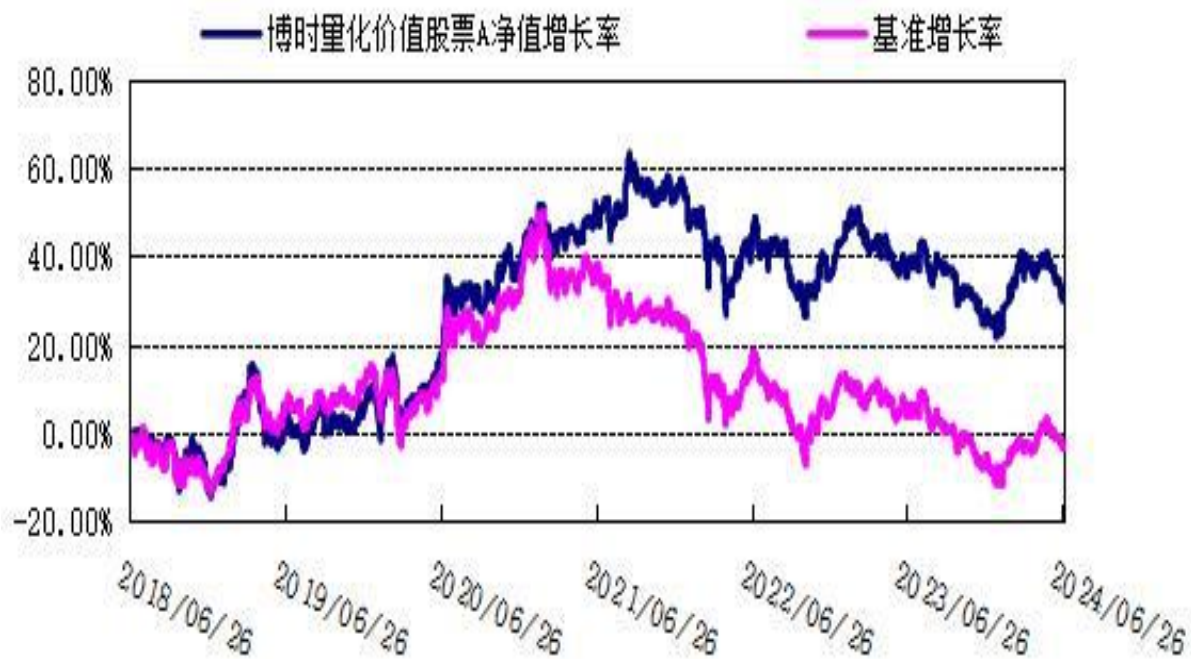
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化价值股票型证券投资基金

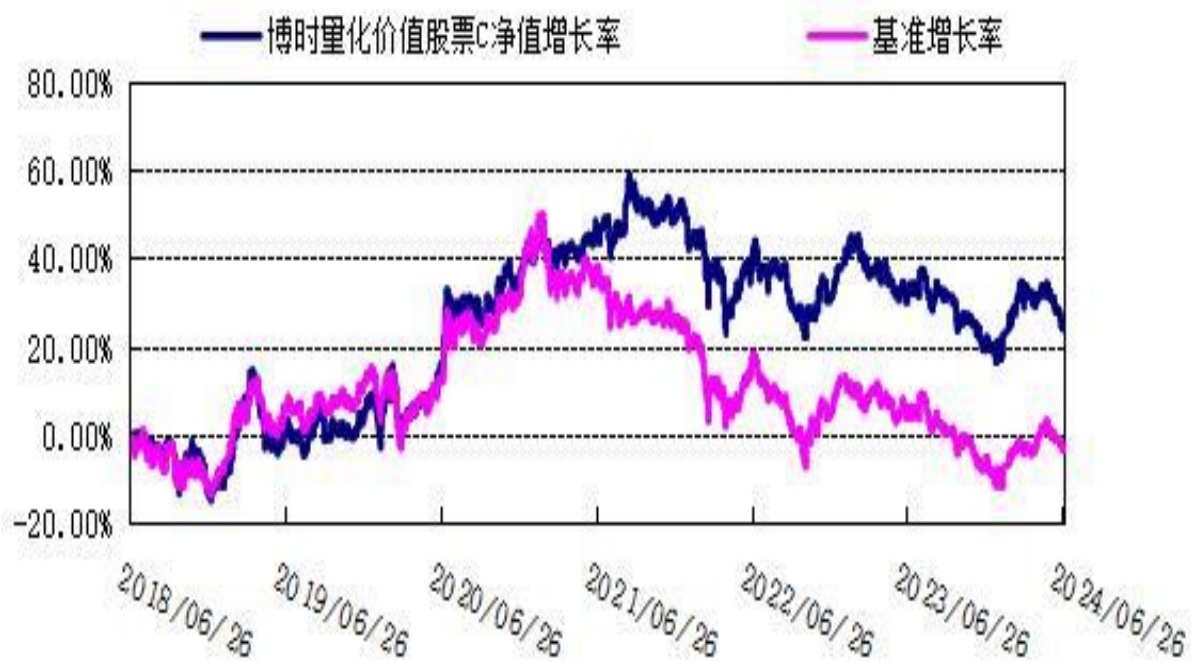
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年6月26日至2024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 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 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 16037 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 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

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		
黄瑞庆	指数与量化投资部投资总监/基金经理	2018-06-26	-	21.9	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	2024-01-31	13.9	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。现任博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 2 月 2 日一至今)、博时创业板指数证券投资基金(2024 年 2 月 2 日一至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 2 月 2 日一至今)、博时中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 2 月 8 日一至今)、博时中证传媒指数型发起式证券投资基金(2024 年 3 月 5 日一至今)、博时国证消费电子主题指数型发起式证券投资基金(2024 年 4 月 23 日一至今)、博时中证全指通信设备指数型发起式证券投资基金(2024 年 5 月 7 日一至今)、博时中证汽车零部件主题指数型发起式证券投资基金(2024 年 5 月 21 日一至今)、博时中证信息技术应用创新产业指数型发起式证券投资基金(2024 年 6 月 4 日一至今)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-01-20	-	7.9	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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 81 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

中国经济在 2024 上半年相对放缓，主要表现在供需数据走弱，居民负债表修复缓慢，总体经济上行斜率偏低。二季度制造业 PMI 回落至枯荣线以下，服务业生产指数同比持续下滑，社零消费、固定资产投资累计同比一季度均有走弱的迹象。另一方面，海外补库存带动出口回暖，去年增发的国债支撑基建投资平稳向上。地产方面，尽管政策利好频出，但地产行业仍面临严峻挑战。总体上，上半年中国经济增速放缓，金融数据偏弱，经济数据也显示基本面修复尚未稳固，房地产依然是困扰经济增长的重要因素，期待更大规模的政策举措落地。

宏观经济的疲弱对于股票市场的盈利预期和风险偏好造成一定的影响。2024 年初 A 股延续了去年的震荡调整的状态。进入 2 月份后，一系列稳增长政策和资本市场措施提振了市场信心，股票市场从年初的急剧下跌中持续修复。五月份后遇到长期下降趋势线的阻力后转为下跌，总体今年上半年的行情呈现为超跌反弹的格局。风格方面，偏小盘风格的宽基指数跌幅相对较大，而偏价值和红利的指数在弱势中表现出稳定的防御属性，还取得了正收益。行业方面，银行、煤炭、石油石化、

家电和电力及公用事业等行业涨幅靠前，综合、消费者服务、计算机、商贸零售和传媒跌幅较大。

港股市场同样呈现超跌反弹的格局，未来港股的低估值特征可能会持续获得更多关注和投资。从板块上看，能源、原材料、电讯行业涨幅靠前，而医疗保健、地产建筑和必须性消费行业跌幅较大。

本基金在 2024 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，维持了较高的股票仓位。在策略的配置方面，整体上坚持顺势而为，由于适当加大了价值的配置，抵消了一部分今年上半年市场剧烈波动的交易损耗。本基金运用科学的量化方法，把握基本面和市场面的长期规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，在价值型股票中动态地寻找投资机会，并针对当前市场特征，构建量化策略配置模型的组合，力求为投资者获取长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1259 元，份额累计净值为 1.3166 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.0905 元，份额累计净值为 1.2560 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 2.55%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 2.14%，同期业绩基准增长率为 1.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球方面，2024 年上半年美国经济数据虽有分歧，但总体延续韧性表现。具体来看，美国制造业回落，零售数据低于预期，房地产表现萎靡；另一方面，服务业市场有所改善，就业数据超市场预期，通胀延续放缓。财政方面，美国有望延续宽财政紧货币基调。虽然美国大选以及通胀数据对具体降息时间点存在扰动，但是年内降息的市場一致预期还是相对确定的。

国内方面，中国经济可能延续缓慢增长态势，仍需紧密关注政策层面落地情况。三季度是政策发力落地效果的验证窗口期，尤其是关注前期房地产相关政策的落地效果。预计经济整体延续之前缓慢修复特征。国内流动性预计维持合理充裕，政策上以稳经济为主，难有强刺激，地产和消费预计主要依靠内生恢复。

在国际市场加息周期接近尾声、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 2024 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。此外，恒生指数的估值水平处于 2003 年以来的较低位置。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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	11,354,795.35	19,938,043.40
结算备付金		3,763,326.73	4,822,593.04
存出保证金		101,819.56	1,067,307.49
交易性金融资产	6.4.3.2	203,016,211.32	117,866,176.40
其中：股票投资		203,016,211.32	117,866,176.40
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,560.26	1,108.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		218,247,713.22	143,695,228.67
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		0.52	7,047,843.33
应付赎回款		605,845.24	194,447.47
应付管理人报酬		162,540.72	107,883.48
应付托管费		36,120.14	23,974.10
应付销售服务费		70,737.93	30,249.29
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	1,407,669.10	1,310,131.44
负债合计		2,282,913.65	8,714,529.11
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	194,893,243.18	123,710,012.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	21,071,556.39	11,270,687.13
净资产合计		215,964,799.57	134,980,699.56
负债和净资产总计		218,247,713.22	143,695,228.67

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 194,893,243.18 份。其中 A 类基金份额净值 1.1259 元，基金份额总额 96,909,846.93 份；C 类基金份额净值 1.0905 元，基金份额总额 97,983,396.25 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		3,767,438.69	-1,609,814.18

1. 利息收入		90,682.87	83,591.66
其中：存款利息收入	6.4.3.10	90,682.87	83,591.66
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,684,489.15	813,210.64
其中：股票投资收益	6.4.3.11	9,542,223.23	-613,258.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	30,612.71
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	-229,059.77	-592,856.96
股利收益	6.4.3.15	2,371,325.69	1,988,713.34
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	-8,011,086.87	-2,543,329.98
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	3,353.54	36,713.50
减：二、营业总支出		1,346,329.85	1,224,308.84
1. 管理人报酬		812,094.69	710,735.31
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		180,465.46	197,426.40
3. 销售服务费		259,365.14	221,119.32
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		451.22	22.37
8. 其他费用	6.4.3.19	93,953.34	95,005.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,421,108.84	-2,834,123.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,421,108.84	-2,834,123.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,421,108.84	-2,834,123.02

6.3 净资产变动表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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	123,710,012.43	-	11,270,687.13	134,980,699.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	123,710,012.43	-	11,270,687.13	134,980,699.56
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	71,183,230.75	-	9,800,869.26	80,984,100.01
（一）、综合收益总额	-	-	2,421,108.84	2,421,108.84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	71,183,230.75	-	7,379,760.42	78,562,991.17
其中：1. 基金申购款	106,841,152.15	-	12,916,933.88	119,758,086.03
2. 基金赎回款	-35,657,921.40	-	-5,537,173.46	-41,195,094.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	194,893,243.18	-	21,071,556.39	215,964,799.57
项目	上年度可比期间 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	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	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	107,445,223.08	-	19,783,067.06	127,228,290.14

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：王德英，会计机构负责人：陈子成

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

(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‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）

交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（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。

（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。

（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。

（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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	11,354,795.35
等于：本金	11,352,480.28
加：应计利息	2,315.07
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	11,354,795.35

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	209,378,377.54	-	203,016,211.32	-6,362,166.22
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	209,378,377.54	-	203,016,211.32	-6,362,166.22

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

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,283,605.98
其中：交易所市场	1,283,605.98
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	124,063.12
合计	1,407,669.10

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	96,014,269.24	96,014,269.24
本期申购	33,340,435.31	33,340,435.31
本期赎回（以“-”号填列）	-32,444,857.62	-32,444,857.62
本期末	96,909,846.93	96,909,846.93

博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	27,695,743.19	27,695,743.19
本期申购	73,500,716.84	73,500,716.84
本期赎回（以“-”号填列）	-3,213,063.78	-3,213,063.78
本期末	97,983,396.25	97,983,396.25

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	52,455,728.26	-43,058,224.86	9,397,503.40
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	52,455,728.26	-43,058,224.86	9,397,503.40
本期利润	8,233,593.26	-3,442,607.13	4,790,986.13
本期基金份额交易产生的变动数	-576,698.85	-1,412,425.56	-1,989,124.41
其中：基金申购款	18,356,065.07	-15,199,330.43	3,156,734.64
基金赎回款	-18,932,763.92	13,786,904.87	-5,145,859.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,112,622.67	-47,913,257.55	12,199,365.12

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	14,015,923.26	-12,142,739.53	1,873,183.73
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	14,015,923.26	-12,142,739.53	1,873,183.73
本期利润	2,198,602.45	-4,568,479.74	-2,369,877.29
本期基金份额交易产生的变动数	39,977,749.37	-30,608,864.54	9,368,884.83
其中：基金申购款	41,809,090.12	-32,048,890.88	9,760,199.24
基金赎回款	-1,831,340.75	1,440,026.34	-391,314.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,192,275.08	-47,320,083.81	8,872,191.27

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	50,440.18
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	39,650.05
其他	592.64
合计	90,682.87

6.4.3.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,255,869,341.75
减：卖出股票成本总额	1,243,081,821.68
减：交易费用	3,245,296.84
买卖股票差价收入	9,542,223.23

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

无发生额。

6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-229,059.77

6.4.3.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	2,371,325.69
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,371,325.69

6.4.3.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-7,783,286.87
——股票投资	-7,783,286.87
——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	-227,800.00
——权证投资	-
——股指期货	-227,800.00
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	-8,011,086.87

6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	2,623.75
基金转换费收入	729.79
合计	3,353.54

6.4.3.18 信用减值损失

无发生额。

6.4.3.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	53.47
银行汇划费	5,336.75

中债登账户维护费	9,000.00
合计	93,953.34

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	771,482,206.04	29.77%	445,557,423.92	17.27%

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 2024年1月1日至2024年6月30	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30
-------	---------------------------	--------------------------------

	日		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%

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 2024年1月1日至2024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	729,806.60	29.77%	473,923.38	36.92%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	812,094.69	710,735.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	154,877.82	104,091.57
应支付基金管理人的净管理费	657,216.87	606,643.74

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.90% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.90% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年
----	-----------------------	----------------------------

	6 月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	180,465.46	197,426.40

注：于本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，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：

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

自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	132,433.41	132,433.41
中国农业银行	-	3,383.42	3,383.42
招商证券	-	179.44	179.44
合计	-	135,996.27	135,996.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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 2024 年 6 月 30 日		博时量化价值股票 C 上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例
博时资本	13,754,212.23	7.06%	13,754,212.23	11.12%

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	11,354,795.35	50,440.18	9,687,474.92	49,473.87

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

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	688692	达梦数据	网下发行	663.00	57,654.48
上年度可比期间 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

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（2024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
603350	安乃达	2024-06-26	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	945.00	19,429.20	19,429.20	-
603285	键邦股份	2024-06-28	5个交易日	新股未上市	18.65	18.65	926.00	17,269.90	17,269.90	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	首次公开发行限售	86.96	174.93	67.00	5,826.32	11,720.31	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	首次公开发行限售	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	首次公开发行限售	11.88	18.98	424.00	5,037.12	8,047.52	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	首次公开发行	44.95	65.93	122.00	5,483.90	8,043.46	-

688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	限售首次公开发行限售	19.86	42.51	170.00	3,376.20	7,226.70	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	限售首次公开发行限售	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	限售首次公开发行限售	8.90	16.97	349.00	3,106.10	5,922.53	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	限售首次公开发行限售	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	限售首次公开发行限售	22.43	31.55	168.00	3,768.24	5,300.40	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	限售首次公开发行限售	21.73	25.26	187.00	4,063.51	4,723.62	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	限售首次公开发行限售	15.69	18.79	244.00	3,828.36	4,584.76	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	限售首次公开发行限售	22.66	15.89	209.00	4,735.94	3,321.01	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	限售首次公开发行限售	16.20	15.96	170.00	2,754.00	2,713.20	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	限售首次公开发行限售	26.00	37.49	67.00	1,742.00	2,511.83	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	限售首次公开发行	20.56	20.56	106.00	2,179.36	2,179.36	-

60338 1	永臻 股份	2024- 06-19	6 个月	限售 首次 公开发 行 限售	23.35	25.13	84.00	1,961 .40	2,110 .92	-
60328 5	键邦 股份	2024- 06-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	18.65	18.65	103.0 0	1,920 .95	1,920 .95	-
60334 4	星德 胜	2024- 03-13	6 个月	首次 公开发 行 限售	19.18	22.66	81.00	1,553 .58	1,835 .46	-
60308 2	北自 科技	2024- 01-23	6 个月	首次 公开发 行 限售	21.28	29.49	55.00	1,170 .40	1,621 .95	-
60337 5	盛景 微	2024- 01-17	6 个月	首次 公开发 行 限售	38.18	38.90	33.00	1,259 .94	1,283 .70	-
60332 5	博隆 技术	2024- 01-03	6 个月	首次 公开发 行 限售	72.46	68.06	18.00	1,304 .28	1,225 .08	-
60331 2	西典 新能	2024- 01-04	6 个月	首次 公开发 行 限售	29.02	25.36	41.00	1,189 .82	1,039 .76	-

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

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

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，将风险控制在此可承受的范围内。

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

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

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

6.4.9.4 市场风险

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

6.4.9.4.1 利率风险

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

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

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,354,795.35	-	-	-	11,354,795.35
结算备付金	3,763,326.73	-	-	-	3,763,326.73
存出保证金	101,819.56	-	-	-	101,819.56
交易性金融资产	-	-	-	203,016,211.32	203,016,211.32
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	11,560.26	11,560.26
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,219,941.64	-	-	203,027,771.58	218,247,713.22
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	605,845.24	605,845.24
应付清算款	-	-	-	0.52	0.52
应付管理人报酬	-	-	-	162,540.72	162,540.72
应付托管费	-	-	-	36,120.14	36,120.14
应付销售服务费	-	-	-	70,737.93	70,737.93
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,407,669.10	1,407,669.10
负债总计	-	-	-	-2,282,913.65	2,282,913.65
利率敏感度缺口	15,219,941.64	-	-	-200,744,857.13	215,964,796.52

				93	9.57
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,938,043.40	-	-	-	19,938,043.40
结算备付金	4,822,593.04	-	-	-	4,822,593.04
存出保证金	53,579.17	-	-	1,013,728.32	1,067,307.49
交易性金融资产	-	-	-	117,866,176.40	117,866,176.40
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,108.34	1,108.34
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,814,215.61	-	-	118,881,013.06	143,695,228.67
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	194,447.47	194,447.47
应付清算款	-	-	-	7,047,843.33	7,047,843.33
应付管理人报酬	-	-	-	107,883.48	107,883.48
应付托管费	-	-	-	23,974.10	23,974.10
应付销售服务费	-	-	-	30,249.29	30,249.29
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,310,131.44	1,310,131.44
负债总计	-	-	-	8,714,529.11	8,714,529.11
利率敏感度缺口	24,814,215.61	-	-	110,166,483.95	134,980,699.56

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	203,016,211.32	94.00	117,866,176.40	87.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	203,016,211.32	94.00	117,866,176.40	87.32

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。

6.4.9.4.3.2 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约915	增加约598
	业绩比较基准下降5%	减少约915	减少约598

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 2024年6月30日
第一层次	202,880,362.74
第二层次	40,799.41
第三层次	95,049.17
合计	203,016,211.32

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	203,016,211.32	93.02
	其中：股票	203,016,211.32	93.02
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	15,118,122.08	6.93
8	其他各项资产	113,379.82	0.05
9	合计	218,247,713.22	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	2,859,094.00	1.32
B	采矿业	11,016,513.50	5.10
C	制造业	114,122,707.50	52.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,030,701.24	6.50
E	建筑业	7,678,363.00	3.56
F	批发和零售业	894,384.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	4,173,591.00	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,700,605.41	2.18
J	金融业	40,806,756.24	18.90
K	房地产业	555,897.00	0.26
L	租赁和商务服务业	736,661.23	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,139,700.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	19,927.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,784.00	0.01
Q	卫生和社会工作	19,608.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	249,918.00	0.12

S	综合	-	-
	合计	203,016,211.32	94.00

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	10,700	15,701,073.00	7.27
2	000333	美的集团	88,816	5,728,632.00	2.65
3	600900	长江电力	192,550	5,568,546.00	2.58
4	601318	中国平安	114,100	4,719,176.00	2.19
5	600036	招商银行	133,700	4,571,203.00	2.12
6	601166	兴业银行	249,700	4,399,714.00	2.04
7	300750	宁德时代	17,000	3,060,510.00	1.42
8	002594	比亚迪	10,900	2,727,725.00	1.26
9	601899	紫金矿业	152,300	2,675,911.00	1.24
10	300308	中际旭创	19,040	2,625,235.20	1.22
11	603501	韦尔股份	26,200	2,603,494.00	1.21
12	002475	立讯精密	65,500	2,574,805.00	1.19
13	000568	泸州老窖	17,700	2,539,773.00	1.18
14	601398	工商银行	435,100	2,480,070.00	1.15
15	000651	格力电器	59,000	2,313,980.00	1.07
16	600276	恒瑞医药	59,700	2,296,062.00	1.06
17	601328	交通银行	305,800	2,284,326.00	1.06
18	601857	中国石油	207,300	2,139,336.00	0.99
19	600690	海尔智家	74,100	2,102,958.00	0.97
20	601088	中国神华	46,900	2,080,953.00	0.96
21	601390	中国中铁	314,900	2,053,148.00	0.95
22	600989	宝丰能源	111,800	1,937,494.00	0.90
23	600015	华夏银行	283,400	1,813,760.00	0.84
24	601668	中国建筑	340,800	1,809,648.00	0.84
25	601985	中国核电	168,400	1,795,144.00	0.83
26	600809	山西汾酒	8,200	1,729,216.00	0.80
27	600019	宝钢股份	258,800	1,721,020.00	0.80
28	000725	京东方 A	420,200	1,718,618.00	0.80
29	000001	平安银行	165,200	1,676,780.00	0.78
30	600926	杭州银行	128,200	1,673,010.00	0.77
31	600016	民生银行	440,700	1,670,253.00	0.77
32	002371	北方华创	5,200	1,663,428.00	0.77
33	600887	伊利股份	63,200	1,633,088.00	0.76

34	601601	中国太保	56,800	1,582,448.00	0.73
35	601229	上海银行	213,200	1,547,832.00	0.72
36	300433	蓝思科技	84,700	1,545,775.00	0.72
37	600886	国投电力	83,600	1,524,864.00	0.71
38	002714	牧原股份	34,800	1,517,280.00	0.70
39	000858	五粮液	11,300	1,446,852.00	0.67
40	600674	川投能源	71,600	1,342,500.00	0.62
41	300498	温氏股份	67,700	1,341,814.00	0.62
42	601577	长沙银行	161,000	1,316,980.00	0.61
43	601997	贵阳银行	247,400	1,303,798.00	0.60
44	600039	四川路桥	164,200	1,295,538.00	0.60
45	600919	江苏银行	173,500	1,289,105.00	0.60
46	600025	华能水电	119,308	1,286,140.24	0.60
47	002180	纳思达	48,200	1,273,444.00	0.59
48	600803	新奥股份	61,000	1,268,800.00	0.59
49	002252	上海莱士	161,800	1,265,276.00	0.59
50	002938	鹏鼎控股	31,800	1,264,368.00	0.59
51	603195	公牛集团	16,245	1,252,814.40	0.58
52	603986	兆易创新	13,100	1,252,622.00	0.58
53	300142	沃森生物	108,800	1,238,144.00	0.57
54	600584	长电科技	38,900	1,233,519.00	0.57
55	605499	东鹏饮料	5,700	1,229,775.00	0.57
56	603323	苏农银行	255,400	1,228,474.00	0.57
57	002352	顺丰控股	34,400	1,227,736.00	0.57
58	600406	国电南瑞	49,100	1,225,536.00	0.57
59	300760	迈瑞医疗	4,200	1,221,822.00	0.57
60	300408	三环集团	41,700	1,217,223.00	0.56
61	600732	爱旭股份	131,000	1,185,550.00	0.55
62	600030	中信证券	64,300	1,172,189.00	0.54
63	600028	中国石化	152,800	965,696.00	0.45
64	601816	京沪高铁	174,300	935,991.00	0.43
65	600309	万华化学	11,300	913,718.00	0.42
66	601688	华泰证券	73,700	913,143.00	0.42
67	601633	长城汽车	35,700	903,210.00	0.42
68	601138	工业富联	32,000	876,800.00	0.41
69	601225	陕西煤业	33,600	865,872.00	0.40
70	601127	赛力斯	9,500	865,640.00	0.40
71	300857	协创数据	15,000	855,000.00	0.40
72	600050	中国联通	181,100	851,170.00	0.39
73	300529	健帆生物	30,500	829,905.00	0.38
74	002928	华夏航空	130,200	825,468.00	0.38
75	002984	森麒麟	34,000	819,060.00	0.38
76	002726	龙大美食	124,500	816,720.00	0.38

77	001301	尚太科技	18,800	812,536.00	0.38
78	002415	海康威视	26,200	809,842.00	0.37
79	600941	中国移动	7,400	795,500.00	0.37
80	603496	恒为科技	32,500	794,625.00	0.37
81	300446	航天智造	66,000	785,400.00	0.36
82	300059	东方财富	73,529	776,466.24	0.36
83	300708	聚灿光电	86,100	774,900.00	0.36
84	300005	探路者	152,900	766,029.00	0.35
85	688408	中信博	8,300	764,264.00	0.35
86	688036	传音控股	9,900	757,746.00	0.35
87	300492	华图山鼎	8,000	753,600.00	0.35
88	601989	中国重工	152,600	752,318.00	0.35
89	688138	清溢光电	34,600	743,900.00	0.34
90	300840	酷特智能	79,300	733,525.00	0.34
91	601728	中国电信	118,600	729,390.00	0.34
92	689009	九号公司	19,100	703,071.00	0.33
93	300969	恒帅股份	10,100	698,213.00	0.32
94	688233	神工股份	36,100	695,647.00	0.32
95	688498	源杰科技	5,300	694,247.00	0.32
96	601186	中国铁建	79,800	683,886.00	0.32
97	002493	荣盛石化	67,200	649,152.00	0.30
98	000063	中兴通讯	23,200	648,904.00	0.30
99	600010	包钢股份	435,900	610,260.00	0.28
100	000338	潍柴动力	37,300	605,752.00	0.28
101	300124	汇川技术	11,700	600,210.00	0.28
102	688111	金山办公	2,600	591,500.00	0.27
103	000596	古井贡酒	2,600	548,782.00	0.25
104	601717	郑煤机	34,900	516,520.00	0.24
105	603198	迎驾贡酒	8,900	511,750.00	0.24
106	601988	中国银行	110,200	509,124.00	0.24
107	300274	阳光电源	8,000	496,240.00	0.23
108	600737	中粮糖业	51,000	489,090.00	0.23
109	601919	中远海控	31,400	486,386.00	0.23
110	601012	隆基绿能	34,300	480,886.00	0.22
111	600566	济川药业	15,100	478,821.00	0.22
112	601800	中国交建	52,900	472,926.00	0.22
113	601169	北京银行	80,600	470,704.00	0.22
114	600938	中国海油	12,900	425,700.00	0.20
115	601600	中国铝业	55,200	421,176.00	0.20
116	600795	国电电力	68,400	409,716.00	0.19
117	601117	中国化学	49,700	409,528.00	0.19
118	601888	中国中免	6,300	393,687.00	0.18
119	603160	汇顶科技	5,600	385,000.00	0.18

120	600667	太极实业	65,900	376,289.00	0.17
121	002142	宁波银行	16,900	372,814.00	0.17
122	603259	药明康德	9,500	372,305.00	0.17
123	600183	生益科技	17,600	370,656.00	0.17
124	000400	许继电气	10,700	368,187.00	0.17
125	600000	浦发银行	44,300	364,589.00	0.17
126	601818	光大银行	114,400	362,648.00	0.17
127	603606	东方电缆	7,200	351,432.00	0.16
128	688578	艾力斯	5,500	350,570.00	0.16
129	600707	彩虹股份	50,700	345,267.00	0.16
130	300502	新易盛	3,200	337,760.00	0.16
131	600066	宇通客车	12,700	327,660.00	0.15
132	688041	海光信息	4,600	323,472.00	0.15
133	603369	今世缘	7,000	323,400.00	0.15
134	002595	豪迈科技	8,400	320,628.00	0.15
135	600362	江西铜业	13,400	317,312.00	0.15
136	601939	建设银行	42,500	314,500.00	0.15
137	300979	华利集团	5,100	310,335.00	0.14
138	002106	莱宝高科	28,400	309,560.00	0.14
139	000708	中信特钢	22,700	308,039.00	0.14
140	601336	新华保险	10,200	306,306.00	0.14
141	603993	洛阳钼业	35,700	303,450.00	0.14
142	601766	中国中车	40,400	303,404.00	0.14
143	002028	思源电气	4,500	301,050.00	0.14
144	601163	三角轮胎	19,500	296,790.00	0.14
145	300389	艾比森	23,600	289,808.00	0.13
146	000625	长安汽车	21,400	287,402.00	0.13
147	002027	分众传媒	47,056	285,159.36	0.13
148	002311	海大集团	6,000	282,300.00	0.13
149	601319	中国人保	54,700	281,705.00	0.13
150	300009	安科生物	32,600	278,404.00	0.13
151	600048	保利发展	31,000	271,560.00	0.13
152	002558	巨人网络	28,700	270,928.00	0.13
153	600188	兖矿能源	11,650	264,804.50	0.12
154	300724	捷佳伟创	4,900	264,649.00	0.12
155	600346	恒力石化	18,800	262,260.00	0.12
156	002236	大华股份	16,900	261,274.00	0.12
157	002920	德赛西威	3,000	261,270.00	0.12
158	000975	银泰黄金	15,800	257,382.00	0.12
159	000963	华东医药	9,200	255,852.00	0.12
160	002752	昇兴股份	50,200	254,012.00	0.12
161	601006	大秦铁路	34,900	249,884.00	0.12
162	000550	江铃汽车	11,500	249,665.00	0.12

163	601669	中国电建	43,200	241,488.00	0.11
164	601658	邮储银行	46,800	237,276.00	0.11
165	600585	海螺水泥	9,900	233,541.00	0.11
166	600150	中国船舶	5,700	232,047.00	0.11
167	002648	卫星化学	12,700	228,346.00	0.11
168	300144	宋城演艺	28,400	228,052.00	0.11
169	002035	华帝股份	36,600	228,018.00	0.11
170	300122	智飞生物	8,100	227,043.00	0.11
171	601009	南京银行	21,200	220,268.00	0.10
172	000661	长春高新	2,400	220,248.00	0.10
173	001979	招商蛇口	23,900	210,081.00	0.10
174	601865	福莱特	10,300	207,030.00	0.10
175	300896	爱美客	1,200	206,520.00	0.10
176	603806	福斯特	14,040	206,388.00	0.10
177	003816	中国广核	44,500	206,035.00	0.10
178	600104	上汽集团	14,800	205,128.00	0.09
179	600210	紫江企业	38,300	203,756.00	0.09
180	601211	国泰君安	15,000	203,250.00	0.09
181	601898	中煤能源	16,000	199,680.00	0.09
182	002466	天齐锂业	6,600	197,406.00	0.09
183	300999	金龙鱼	6,900	188,715.00	0.09
184	600219	南山铝业	49,300	187,833.00	0.09
185	601998	中信银行	27,800	186,260.00	0.09
186	002625	光启技术	10,700	185,645.00	0.09
187	601618	中国中冶	59,300	183,830.00	0.09
188	603518	锦泓集团	19,900	175,120.00	0.08
189	000034	神州数码	7,600	173,964.00	0.08
190	600023	浙能电力	24,200	172,062.00	0.08
191	600438	通威股份	8,800	168,168.00	0.08
192	601799	星宇股份	1,500	168,060.00	0.08
193	000983	山西焦煤	16,100	165,991.00	0.08
194	301219	腾远钴业	4,300	164,518.00	0.08
195	600905	三峡能源	37,500	163,500.00	0.08
196	601236	红塔证券	24,500	157,290.00	0.07
197	000426	兴业银锡	11,100	150,738.00	0.07
198	600547	山东黄金	5,300	145,114.00	0.07
199	002852	道道全	19,600	141,120.00	0.07
200	601868	中国能建	66,100	140,132.00	0.06
201	000876	新希望	15,100	138,014.00	0.06
202	601699	潞安环能	7,500	135,975.00	0.06
203	301015	百洋医药	5,500	129,415.00	0.06
204	600111	北方稀土	7,500	129,000.00	0.06
205	600489	中金黄金	8,600	127,280.00	0.06

206	002050	三花智控	6,600	125,928.00	0.06
207	300441	鲍斯股份	20,700	122,751.00	0.06
208	600866	星湖科技	22,100	121,992.00	0.06
209	000301	东方盛虹	15,100	120,347.00	0.06
210	688472	阿特斯	11,000	111,980.00	0.05
211	600011	华能国际	11,600	111,592.00	0.05
212	300772	运达股份	11,600	111,360.00	0.05
213	601838	成都银行	7,100	107,849.00	0.05
214	601021	春秋航空	1,900	107,027.00	0.05
215	000977	浪潮信息	2,900	105,473.00	0.05
216	600096	云天化	5,100	99,042.00	0.05
217	601000	唐山港	21,000	98,700.00	0.05
218	301187	欧圣电气	4,000	97,000.00	0.04
219	002460	赣锋锂业	3,300	94,545.00	0.04
220	002230	科大讯飞	2,200	94,490.00	0.04
221	002001	新和成	4,900	94,080.00	0.04
222	600998	九州通	19,225	93,818.00	0.04
223	600031	三一重工	5,500	90,750.00	0.04
224	600741	华域汽车	5,500	90,090.00	0.04
225	600901	江苏金租	17,800	89,890.00	0.04
226	603799	华友钴业	4,000	88,520.00	0.04
227	600398	海澜之家	9,500	87,780.00	0.04
228	002966	苏州银行	11,600	87,000.00	0.04
229	600350	山东高速	9,800	86,730.00	0.04
230	000895	双汇发展	3,600	85,572.00	0.04
231	300782	卓胜微	1,100	85,514.00	0.04
232	600282	南钢股份	17,100	85,158.00	0.04
233	002267	陕天然气	11,200	84,672.00	0.04
234	300628	亿联网络	2,300	84,571.00	0.04
235	603967	中创物流	9,000	83,700.00	0.04
236	002327	富安娜	8,300	83,415.00	0.04
237	002911	佛燃能源	9,100	83,174.00	0.04
238	002340	格林美	12,700	80,899.00	0.04
239	603156	养元饮品	3,800	80,826.00	0.04
240	002416	爱施德	9,100	80,535.00	0.04
241	002540	亚太科技	15,200	80,408.00	0.04
242	002032	苏泊尔	1,600	80,160.00	0.04
243	002773	康弘药业	3,700	80,105.00	0.04
244	601825	沪农商行	11,800	79,296.00	0.04
245	002563	森马服饰	13,600	79,016.00	0.04
246	000030	富奥股份	16,000	78,560.00	0.04
247	601058	赛轮轮胎	5,600	78,400.00	0.04
248	002270	华明装备	3,500	77,840.00	0.04

249	000069	华侨城 A	36,400	74,256.00	0.03
250	002841	视源股份	2,400	70,872.00	0.03
251	002601	龙佰集团	3,800	70,566.00	0.03
252	688561	奇安信	2,800	66,136.00	0.03
253	000792	盐湖股份	3,700	64,565.00	0.03
254	000933	神火股份	3,000	60,690.00	0.03
255	600694	大商股份	3,600	60,516.00	0.03
256	601808	中海油服	3,300	56,760.00	0.03
257	300735	光弘科技	2,600	56,160.00	0.03
258	600018	上港集团	9,700	56,066.00	0.03
259	601126	四方股份	2,800	53,816.00	0.02
260	600916	中国黄金	5,500	52,910.00	0.02
261	000877	天山股份	9,700	52,380.00	0.02
262	600062	华润双鹤	2,600	50,908.00	0.02
263	688065	凯赛生物	1,100	49,929.00	0.02
264	000630	铜陵有色	13,800	49,818.00	0.02
265	002384	东山精密	2,300	47,610.00	0.02
266	600893	航发动力	1,300	47,515.00	0.02
267	603279	景津装备	2,100	45,549.00	0.02
268	000100	TCL 科技	10,500	45,360.00	0.02
269	301301	川宁生物	3,400	43,452.00	0.02
270	600993	马应龙	1,600	42,672.00	0.02
271	688516	奥特维	1,000	41,810.00	0.02
272	600436	片仔癀	200	41,434.00	0.02
273	000758	中色股份	7,800	39,624.00	0.02
274	300910	瑞丰新材	900	39,348.00	0.02
275	600660	福耀玻璃	800	38,320.00	0.02
276	601916	浙商银行	13,500	37,260.00	0.02
277	688506	百利天恒	200	36,280.00	0.02
278	601500	通用股份	6,500	34,710.00	0.02
279	600089	特变电工	2,330	32,317.10	0.01
280	603288	海天味业	900	31,023.00	0.01
281	688008	澜起科技	500	28,580.00	0.01
282	600153	建发股份	3,100	27,683.00	0.01
283	002241	歌尔股份	1,400	27,314.00	0.01
284	300458	全志科技	1,100	25,861.00	0.01
285	300457	赢合科技	1,400	24,962.00	0.01
286	002304	洋河股份	300	24,222.00	0.01
287	605305	中际联合	920	23,726.80	0.01
288	603919	金徽酒	1,300	23,621.00	0.01
289	002179	中航光电	600	22,830.00	0.01
290	000938	紫光股份	1,000	22,350.00	0.01
290	688772	珠海冠宇	1,500	22,350.00	0.01

291	600582	天地科技	3,200	22,048.00	0.01
292	300251	光线传媒	2,600	21,866.00	0.01
293	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
294	002315	焦点科技	800	21,568.00	0.01
295	000997	新大陆	1,500	20,865.00	0.01
296	301030	仕净科技	820	20,188.40	0.01
297	300820	英杰电气	500	19,670.00	0.01
298	300015	爱尔眼科	1,900	19,608.00	0.01
299	603285	键邦股份	1,029	19,190.85	0.01
300	002897	意华股份	500	18,830.00	0.01
301	688234	天岳先进	400	18,768.00	0.01
302	600755	厦门国贸	2,600	18,642.00	0.01
303	002697	红旗连锁	4,000	18,520.00	0.01
304	002112	三变科技	2,000	17,760.00	0.01
305	002469	三维化学	3,100	17,670.00	0.01
306	000035	中国天楹	3,800	17,214.00	0.01
307	688798	艾为电子	300	16,986.00	0.01
308	001337	四川黄金	700	16,247.00	0.01
309	300926	博俊科技	800	16,016.00	0.01
310	600029	南方航空	2,700	15,903.00	0.01
311	003019	宸展光电	620	15,704.60	0.01
312	600372	中航机载	1,300	15,561.00	0.01
313	603277	银都股份	500	15,020.00	0.01
314	603688	石英股份	500	14,805.00	0.01
315	600745	闻泰科技	500	14,125.00	0.01
316	000821	京山轻机	1,200	13,596.00	0.01
317	601607	上海医药	700	13,377.00	0.01
318	688223	晶科能源	1,800	12,780.00	0.01
319	600186	莲花控股	3,700	12,691.00	0.01
320	603899	晨光股份	400	12,512.00	0.01
321	600132	重庆啤酒	200	12,140.00	0.01
322	603929	亚翔集成	500	11,950.00	0.01
323	300751	迈为股份	100	11,948.00	0.01
324	300836	佰奥智能	300	11,937.00	0.01
325	688599	天合光能	700	11,844.00	0.01
326	300192	科德教育	1,200	11,784.00	0.01
327	688692	达梦数据	67	11,720.31	0.01
328	000999	华润三九	270	11,496.60	0.01
329	002459	晶澳科技	1,000	11,200.00	0.01
330	300783	三只松鼠	500	10,935.00	0.01
331	300102	乾照光电	1,600	10,272.00	0.00
332	002919	名臣健康	860	9,984.60	0.00
333	300450	先导智能	600	9,978.00	0.00

334	300880	迦南智能	500	9,815.00	0.00
335	002707	众信旅游	1,700	9,758.00	0.00
336	000408	藏格矿业	400	9,628.00	0.00
337	300872	天阳科技	700	9,275.00	0.00
338	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
339	300316	晶盛机电	300	8,619.00	0.00
340	002835	同为股份	500	8,445.00	0.00
341	600721	百花医药	1,400	8,120.00	0.00
342	301565	中仑新材	424	8,047.52	0.00
343	301580	爱迪特	122	8,043.46	0.00
344	003025	思进智能	600	7,386.00	0.00
345	688691	灿芯股份	170	7,226.70	0.00
346	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
347	002068	黑猫股份	1,000	7,100.00	0.00
348	603055	台华新材	700	7,091.00	0.00
349	600979	广安爱众	2,100	7,056.00	0.00
350	001289	龙源电力	400	6,900.00	0.00
351	301526	国际复材	2,017	6,716.61	0.00
352	002845	同兴达	500	6,610.00	0.00
353	300707	威唐工业	500	6,190.00	0.00
354	002991	甘源食品	100	6,065.00	0.00
355	301566	达利凯普	349	5,922.53	0.00
356	688222	成都先导	500	5,675.00	0.00
357	600727	鲁北化工	900	5,670.00	0.00
358	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
359	300758	七彩化学	500	5,375.00	0.00
360	688695	中创股份	168	5,300.40	0.00
361	000700	模塑科技	900	4,725.00	0.00
362	301587	中瑞股份	187	4,723.62	0.00
363	688709	成都华微	244	4,584.76	0.00
364	603108	润达医疗	300	4,542.00	0.00
365	300100	双林股份	400	4,308.00	0.00
366	301578	辰奕智能	91	3,600.87	0.00
367	688584	上海合晶	209	3,321.01	0.00
368	601033	永兴股份	170	2,713.20	0.00
369	603341	龙旗科技	67	2,511.83	0.00
370	603381	永臻股份	84	2,110.92	0.00
371	600875	东方电气	100	1,845.00	0.00
372	603344	星德胜	81	1,835.46	0.00
373	603373	安邦护卫	63	1,731.87	0.00
374	603082	北自科技	55	1,621.95	0.00
375	603332	苏州龙杰	200	1,474.00	0.00
376	603375	盛景微	33	1,283.70	0.00

377	603004	鼎龙科技	73	1,237.35	0.00
378	603325	博隆技术	18	1,225.08	0.00
379	603312	西典新能	41	1,039.76	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	600519	贵州茅台	25,196,771.96	18.67
2	601318	中国平安	19,331,902.00	14.32
3	000333	美的集团	18,400,992.00	13.63
4	600036	招商银行	18,332,805.00	13.58
5	600900	长江电力	14,636,954.99	10.84
6	601166	兴业银行	13,916,824.00	10.31
7	300750	宁德时代	13,033,918.00	9.66
8	000001	平安银行	12,664,185.00	9.38
9	000651	格力电器	11,408,395.00	8.45
10	601088	中国神华	10,983,326.00	8.14
11	000568	泸州老窖	9,360,027.00	6.93
12	601398	工商银行	9,178,697.00	6.80
13	601328	交通银行	9,044,986.00	6.70
14	601857	中国石油	8,778,029.50	6.50
15	300760	迈瑞医疗	8,560,352.00	6.34
16	601668	中国建筑	8,316,687.00	6.16
17	601899	紫金矿业	8,156,976.00	6.04
18	601229	上海银行	7,353,278.00	5.45
19	002415	海康威视	7,100,276.38	5.26
20	601169	北京银行	6,823,743.00	5.06
21	002594	比亚迪	6,806,310.00	5.04
22	600015	华夏银行	6,786,871.00	5.03
23	000858	五粮液	6,750,488.00	5.00
24	600016	民生银行	6,746,859.00	5.00
25	601997	贵阳银行	6,329,988.00	4.69
26	002475	立讯精密	6,171,617.00	4.57
27	603501	韦尔股份	6,168,134.65	4.57
28	600919	江苏银行	6,149,965.00	4.56
29	600809	山西汾酒	6,103,079.00	4.52
30	300308	中际旭创	6,015,105.00	4.46
31	601577	长沙银行	6,003,755.00	4.45
32	601390	中国中铁	5,751,761.00	4.26
33	000625	长安汽车	5,685,213.26	4.21

34	600028	中国石化	5,661,340.00	4.19
35	601225	陕西煤业	5,620,989.00	4.16
36	601816	京沪高铁	5,609,981.00	4.16
37	603323	苏农银行	5,363,521.60	3.97
38	600926	杭州银行	5,231,222.40	3.88
39	002371	北方华创	5,218,816.00	3.87
40	600737	中粮糖业	5,157,509.97	3.82
41	601601	中国太保	5,077,512.00	3.76
42	600438	通威股份	5,042,425.00	3.74
43	002600	领益智造	4,977,923.00	3.69
44	600741	华域汽车	4,897,102.00	3.63
45	601231	环旭电子	4,891,155.00	3.62
46	600019	宝钢股份	4,827,218.00	3.58
47	600050	中国联通	4,764,895.00	3.53
48	601818	光大银行	4,589,284.00	3.40
49	601988	中国银行	4,483,965.00	3.32
50	601077	渝农商行	4,472,312.00	3.31
51	002027	分众传媒	4,347,504.48	3.22
52	601688	华泰证券	4,325,997.00	3.20
53	601888	中国中免	4,214,795.00	3.12
54	600276	恒瑞医药	4,200,341.64	3.11
55	601138	工业富联	4,168,344.00	3.09
56	300274	阳光电源	4,162,090.00	3.08
57	002714	牧原股份	4,119,601.00	3.05
58	300059	东方财富	4,102,365.10	3.04
59	605499	东鹏饮料	4,054,575.00	3.00
60	300394	天孚通信	3,943,262.20	2.92
61	601186	中国铁建	3,900,221.00	2.89
62	002595	豪迈科技	3,895,250.00	2.89
63	000002	万科 A	3,841,760.00	2.85
64	600989	宝丰能源	3,835,118.00	2.84
65	000521	长虹美菱	3,799,781.00	2.82
66	000725	京东方 A	3,776,016.00	2.80
67	688599	天合光能	3,759,957.69	2.79
68	688036	传音控股	3,730,110.76	2.76
69	600887	伊利股份	3,703,854.00	2.74
70	002984	森麒麟	3,696,771.20	2.74
71	688408	中信博	3,687,577.53	2.73
72	300390	天华新能	3,685,288.80	2.73
73	603259	药明康德	3,656,229.60	2.71
74	603198	迎驾贡酒	3,636,966.00	2.69
75	600150	中国船舶	3,631,580.00	2.69
76	600000	浦发银行	3,625,968.60	2.69

77	601633	长城汽车	3,574,760.00	2.65
78	603993	洛阳钼业	3,539,467.00	2.62
79	601211	国泰君安	3,539,338.00	2.62
80	600096	云天化	3,483,308.00	2.58
81	601012	隆基绿能	3,418,673.60	2.53
82	300498	温氏股份	3,390,870.00	2.51
83	600309	万华化学	3,299,122.00	2.44
84	689009	九号公司	3,264,465.72	2.42
85	600030	中信证券	3,260,822.00	2.42
86	601985	中国核电	3,186,007.93	2.36
87	002048	宁波华翔	3,161,433.51	2.34
88	002459	晶澳科技	3,159,140.60	2.34
89	600690	海尔智家	3,135,123.00	2.32
90	300492	华图山鼎	3,069,626.00	2.27
91	300124	汇川技术	3,065,411.00	2.27
92	002648	卫星化学	2,974,752.06	2.20
93	300969	恒帅股份	2,970,722.00	2.20
94	300529	健帆生物	2,964,938.00	2.20
95	601728	中国电信	2,942,262.00	2.18
96	002726	龙大美食	2,939,531.80	2.18
97	300828	锐新科技	2,922,586.00	2.17
98	600436	片仔癀	2,918,850.00	2.16
99	002928	华夏航空	2,914,382.45	2.16
100	601117	中国化学	2,908,672.00	2.15
101	601163	三角轮胎	2,908,260.00	2.15
102	601717	郑煤机	2,893,942.00	2.14
103	000338	潍柴动力	2,892,661.00	2.14
104	688498	源杰科技	2,879,156.37	2.13
105	300005	探路者	2,865,398.00	2.12
106	300708	聚灿光电	2,846,436.00	2.11
107	601958	金铂股份	2,845,326.00	2.11
108	001301	尚太科技	2,832,767.00	2.10
109	000090	天健集团	2,812,369.00	2.08
110	688169	石头科技	2,781,370.57	2.06
111	002756	永兴材料	2,767,411.00	2.05
112	600066	宇通客车	2,751,420.00	2.04
113	603839	安正时尚	2,740,135.40	2.03
114	688233	神工股份	2,728,800.34	2.02
115	601127	赛力斯	2,721,662.00	2.02
116	300433	蓝思科技	2,719,222.00	2.01
117	000550	江铃汽车	2,709,112.00	2.01
118	600089	特变电工	2,707,173.70	2.01
119	600489	中金黄金	2,706,169.00	2.00

120	601600	中国铝业	2,701,615.00	2.00
-----	--------	------	--------------	------

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	000333	美的集团	18,398,835.85	13.63
2	601318	中国平安	17,696,675.39	13.11
3	600036	招商银行	15,266,279.00	11.31
4	000651	格力电器	13,335,533.00	9.88
5	601166	兴业银行	11,976,605.00	8.87
6	300750	宁德时代	11,306,795.80	8.38
7	601857	中国石油	11,151,429.00	8.26
8	600900	长江电力	10,667,415.00	7.90
9	000001	平安银行	10,564,496.00	7.83
10	601088	中国神华	10,561,755.84	7.82
11	600519	贵州茅台	8,773,217.00	6.50
12	300760	迈瑞医疗	8,228,834.00	6.10
13	601398	工商银行	7,621,535.00	5.65
14	601328	交通银行	7,611,755.00	5.64
15	601169	北京银行	7,195,573.00	5.33
16	601668	中国建筑	7,158,217.00	5.30
17	000568	泸州老窖	6,791,847.00	5.03
18	600028	中国石化	6,674,540.00	4.94
19	601229	上海银行	6,634,676.41	4.92
20	601899	紫金矿业	6,531,695.00	4.84
21	002415	海康威视	6,500,439.00	4.82
22	600438	通威股份	5,987,609.00	4.44
23	000858	五粮液	5,930,343.00	4.39
24	002027	分众传媒	5,889,131.00	4.36
25	600016	民生银行	5,836,842.00	4.32
26	600015	华夏银行	5,824,474.00	4.32
27	601138	工业富联	5,731,319.00	4.25
28	000625	长安汽车	5,706,227.40	4.23
29	601225	陕西煤业	5,585,213.00	4.14
30	600741	华域汽车	5,553,833.00	4.11
31	601997	贵阳银行	5,427,244.00	4.02
32	601231	环旭电子	5,359,134.20	3.97
33	601818	光大银行	5,297,066.00	3.92
34	300394	天孚通信	5,206,939.83	3.86

35	600919	江苏银行	5,140,982.00	3.81
36	601077	渝农商行	5,013,307.00	3.71
37	002600	领益智造	4,968,782.00	3.68
38	600737	中粮糖业	4,932,389.00	3.65
39	000002	万科 A	4,914,339.00	3.64
40	601816	京沪高铁	4,855,105.00	3.60
41	688036	传音控股	4,754,821.37	3.52
42	601577	长沙银行	4,738,772.00	3.51
43	601601	中国太保	4,704,867.00	3.49
44	002594	比亚迪	4,659,105.00	3.45
45	600050	中国联通	4,579,501.00	3.39
46	300308	中际旭创	4,547,557.00	3.37
47	300274	阳光电源	4,519,104.00	3.35
48	600809	山西汾酒	4,463,056.20	3.31
49	002475	立讯精密	4,435,787.00	3.29
50	601988	中国银行	4,379,354.00	3.24
51	600089	特变电工	4,265,125.20	3.16
52	600150	中国船舶	4,253,605.00	3.15
53	600096	云天化	4,164,893.00	3.09
54	603323	苏农银行	4,108,518.00	3.04
55	300390	天华新能	4,064,895.10	3.01
56	000521	长虹美菱	4,051,148.00	3.00
57	002459	晶澳科技	3,884,890.00	2.88
58	601600	中国铝业	3,846,508.00	2.85
59	601390	中国中铁	3,843,947.00	2.85
60	688169	石头科技	3,825,724.73	2.83
61	600926	杭州银行	3,823,602.40	2.83
62	688599	天合光能	3,807,782.63	2.82
63	603993	洛阳钼业	3,806,995.00	2.82
64	300059	东方财富	3,767,142.78	2.79
65	601888	中国中免	3,737,768.00	2.77
66	603501	韦尔股份	3,719,099.42	2.76
67	601688	华泰证券	3,652,716.00	2.71
68	600941	中国移动	3,631,427.98	2.69
69	002595	豪迈科技	3,624,544.00	2.69
70	002371	北方华创	3,589,624.00	2.66
71	600938	中国海油	3,561,833.00	2.64
72	600000	浦发银行	3,545,525.00	2.63
73	601211	国泰君安	3,488,199.00	2.58
74	601186	中国铁建	3,433,824.00	2.54
75	603259	药明康德	3,427,317.00	2.54
76	601985	中国核电	3,377,320.00	2.50
77	000932	华菱钢铁	3,328,177.00	2.47

78	000090	天健集团	3,318,567.95	2.46
79	600019	宝钢股份	3,248,603.00	2.41
80	601012	隆基绿能	3,234,245.00	2.40
81	605499	东鹏饮料	3,221,346.00	2.39
82	600436	片仔癀	3,202,850.00	2.37
83	603198	迎驾贡酒	3,193,241.70	2.37
84	002048	宁波华翔	3,074,458.99	2.28
85	601117	中国化学	3,066,448.00	2.27
86	002714	牧原股份	3,035,958.20	2.25
87	002648	卫星化学	3,002,292.00	2.22
88	600309	万华化学	2,973,139.00	2.20
89	002236	大华股份	2,957,058.30	2.19
90	601958	金铂股份	2,900,666.00	2.15
91	600153	建发股份	2,897,706.00	2.15
92	300828	锐新科技	2,893,752.00	2.14
93	300124	汇川技术	2,851,822.00	2.11
94	002466	天齐锂业	2,836,879.00	2.10
95	000725	京东方 A	2,805,202.00	2.08
96	002756	永兴材料	2,804,880.00	2.08
97	002984	森麒麟	2,783,581.00	2.06
98	688408	中信博	2,761,251.07	2.05
99	000933	神火股份	2,746,925.00	2.04
100	600057	厦门象屿	2,744,483.00	2.03
101	601633	长城汽车	2,730,625.00	2.02
102	688556	高测股份	2,730,131.41	2.02
103	603839	安正时尚	2,704,831.08	2.00

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	1,336,015,143.47
卖出股票的收入（成交）总额	1,255,869,341.75

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，兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绵阳市分局、国家金融监督管理总局北京监管局、天津市市场监督管理委员会的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行南昌中心支行、国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局河南监管局的处罚。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	101,819.56
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,560.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,379.82

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	766	126,514.16	85,445,576.12	88.17%	11,464,270.81	11.83%
博时量化价值股票 C	702	139,577.49	93,058,520.09	94.97%	4,924,876.16	5.03%
合计	1,386	140,615.62	178,504,096.21	91.59%	16,389,146.97	8.41%

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	48,887.80	0.05%
	博时量化价值股票 C	80.74	0.00%
	合计	48,968.54	0.03%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	-
	博时量化价值股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	0~10
	博时量化价值股票 C	-
	合计	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§ 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	96,014,269.24	27,695,743.19
本报告期基金总申购份额	33,340,435.31	73,500,716.84
减：本报告期基金总赎回份额	32,444,857.62	3,213,063.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	96,909,846.93	97,983,396.25

§ 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 2024 年 4 月 13 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》，

徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 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》，张东先生任公司总经理。

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	
中银国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	149,814,180.15	5.78%	141,710.67	5.78%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	117,378,348.59	4.53%	111,028.24	4.53%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	73,323,666.76	2.83%	69,357.38	2.83%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	2	771,482,206.04	29.77%	729,806.60	29.77%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	458,506,066.75	17.69%	433,701.08	17.69%	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	814,943,253.49	31.45%	770,911.51	31.45%	-
国泰君安	1	205,810,782.13	7.94%	194,681.62	7.94%	-
中信建投	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；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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	2024-06-26
2	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	2024-06-26
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	2024-06-06
4	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	2024-05-25
5	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
6	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
7	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
8	博时量化价值股票型证券投资基金 2024 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	2024-04-22
9	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	2024-04-13
10	博时量化价值股票型证券投资基金 2023 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	2024-03-29
11	博时量化价值股票型证券投资基金 2023 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	2024-01-22

§ 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	2024-01-01~2024-06-30	44,060,963.41	-	-	44,060,963.41	22.61%
	2	2024-01-01~2024-02-26	30,631,464.32	-	30,631,464.32	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，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。</p>							

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

二〇二四年八月三十日