

博时量化多策略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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54

7.12 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化多策略股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化多策略股票	
基金主代码	005635	
交易代码	005635	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	590,899,637.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
下属分级基金的交易代码	005635	005636
报告期末下属分级基金的份额总额	521,371,386.20 份	69,528,251.71 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。
投资策略	<p>1、量化选股策略</p> <p>(1) A 股投资策略：本基金的选股策略以量化多策略体系为基础，涵盖因子打分、事件驱动、量价特征等多种投资逻辑。其中因子打分策略主要包括价值、成长、质量、市场情绪和分析师预期等因子，事件策略包括高管增持、股权激励、定向增发等，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特征</p> <p>(2) 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港股市场的投资机会。</p> <p>2、其他投资策略： 存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券的投资策略、金融衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	中证全指指数收益率×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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		江向阳	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.bosera.com">http://www.bosera.com</a>
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）	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	5,272,664.19	1,780,903.46
本期利润	-21,280,943.30	-783,520.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0405	-0.0102
本期加权平均净值利润率	-3.41%	-0.88%
本期基金份额净值增长率	-2.94%	-3.33%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
期末可供分配利润	76,988,050.79	7,855,163.59
期末可供分配基金份额利润	0.1477	0.1130
期末基金资产净值	598,359,436.99	77,383,415.30
期末基金份额净值	1.1477	1.1130
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金份额累计净值增长率	33.93%	27.35%

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

#### 博时量化多策略股票 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	-4.79%	0.58%	-4.35%	0.60%	-0.44%	-0.02%
过去三个月	-6.15%	0.82%	-2.77%	0.85%	-3.38%	-0.03%
过去六个月	-2.94%	0.95%	-4.79%	1.09%	1.85%	-0.14%
过去一年	-12.19%	0.84%	-12.60%	0.94%	0.41%	-0.10%
过去三年	-17.64%	0.92%	-27.20%	1.00%	9.56%	-0.08%
自基金合同生效起至今	33.93%	1.10%	-11.14%	1.08%	45.07%	0.02%

#### 博时量化多策略股票 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	-4.86%	0.58%	-4.35%	0.60%	-0.51%	-0.02%
过去三个月	-6.34%	0.82%	-2.77%	0.85%	-3.57%	-0.03%
过去六个月	-3.33%	0.95%	-4.79%	1.09%	1.46%	-0.14%
过去一年	-12.90%	0.84%	-12.60%	0.94%	-0.30%	-0.10%
过去三年	-19.61%	0.92%	-27.20%	1.00%	7.59%	-0.08%
自基金合同生效起至今	27.35%	1.10%	-11.14%	1.08%	38.49%	0.02%

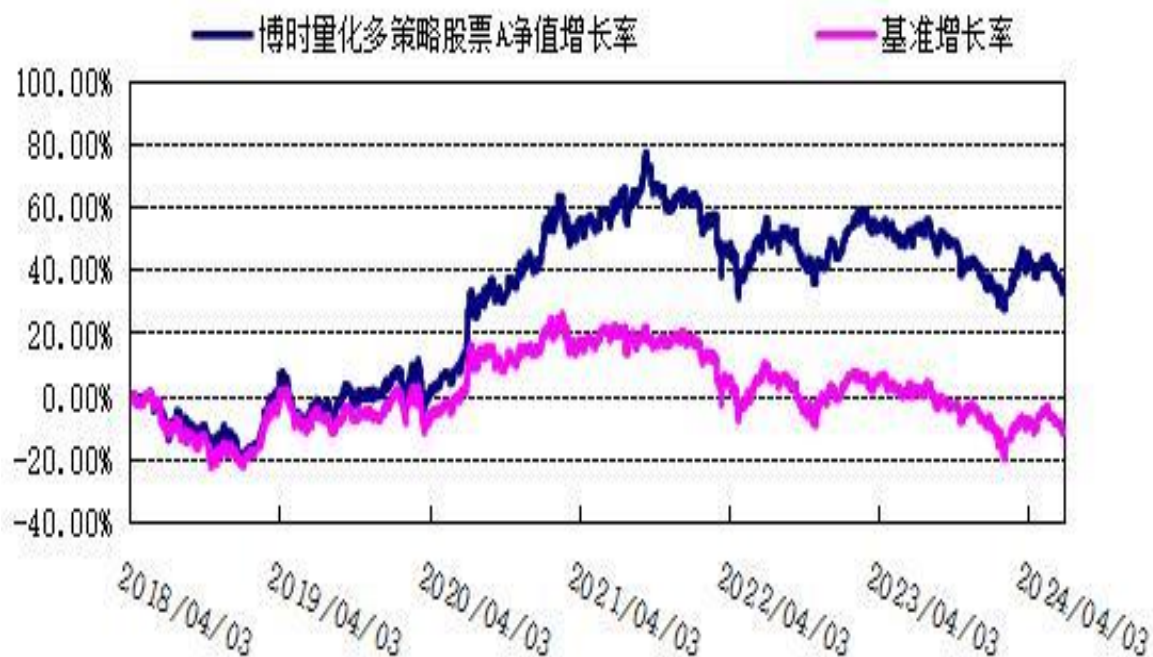
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化多策略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

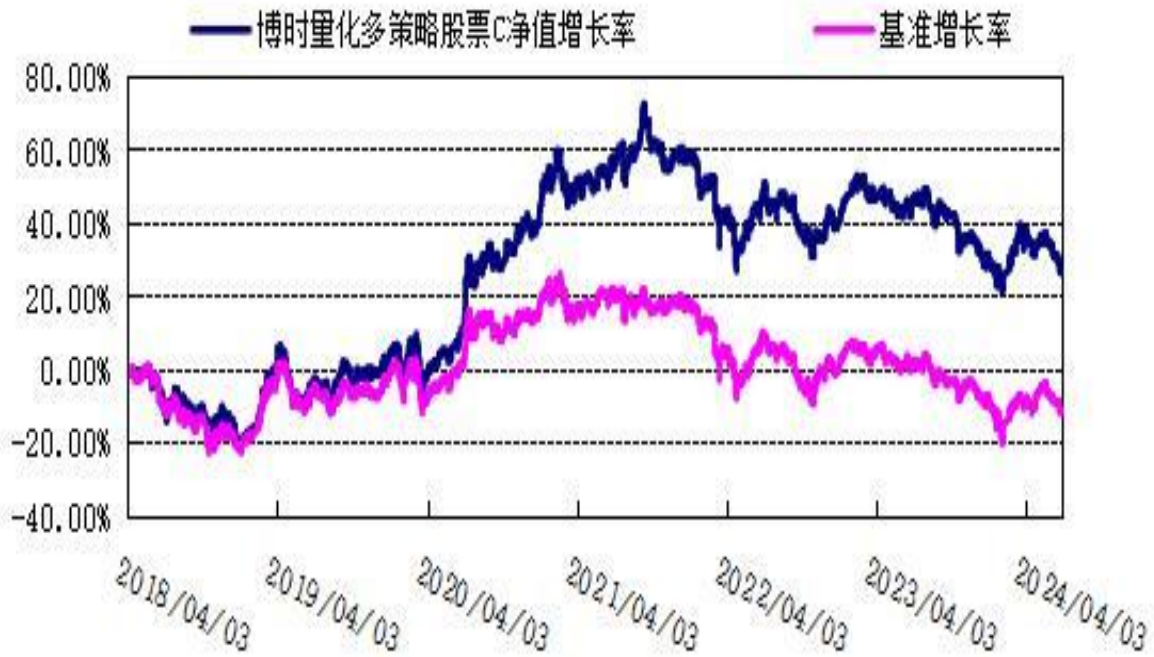
(2018 年 4 月 3 日至 2024 年 6 月 30 日)

博时量化多策略股票 A



博时量化多策略股票 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	2018-04-03	-	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、

					<p>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。</p>
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	2024-01-31	13.9	<p>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</p>

					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年毕业于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 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。

本基金在 2024 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，策略的这种动态配置虽然在长期来看可以有助于把握主要矛盾，获得稳定的超额收益，但是在今年上半年的剧烈波动市场中会付出一定的损耗。未来本基金将持续运用科学的量化方法，寻找和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，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 1.1477 元，份额累计净值为 1.3468 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1130 元，份额累计净值为 1.2806 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-2.94%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-3.33%，同期业绩基准增长率为-4.79%。

#### 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 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，但是年内降息的市场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。

#### 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：博时量化多策略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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.3.1	11,171,504.91	64,033,805.62
结算备付金		30,732,464.99	27,714,351.93
存出保证金		-	3,145,864.43
交易性金融资产	6.4.3.2	633,759,557.23	625,574,155.46
其中：股票投资		628,668,605.17	604,675,860.12
基金投资		-	-
债券投资		5,090,952.06	20,898,295.34
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		1,049,225.82	4,073.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		676,712,752.95	720,472,250.66
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	45,924,929.40
应付赎回款		8,124.22	11,776.73
应付管理人报酬		698,695.38	654,804.35
应付托管费		116,449.22	109,134.07
应付销售服务费		51,972.49	43,399.62
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	94,659.35	4,664,155.76
负债合计		969,900.66	51,408,199.93
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	590,899,637.91	567,484,186.74

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	84,843,214.38	101,579,863.99
净资产合计		675,742,852.29	669,064,050.73
<b>负债和净资产总计</b>		<b>676,712,752.95</b>	<b>720,472,250.66</b>

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 590,899,637.91 份。其中 A 类基金份额净值 1.1477 元，基金份额总额 521,371,386.20 份；C 类基金份额净值 1.1130 元，基金份额总额 69,528,251.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时量化多策略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
<b>一、营业总收入</b>		-16,652,293.61	13,132,305.82
1. 利息收入		197,737.79	113,652.41
其中：存款利息收入	6.4.3.10	197,737.79	113,652.41
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）		12,173,197.80	14,328,926.50
其中：股票投资收益	6.4.3.11	5,038,962.41	9,648,037.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	47,422.72	118,285.94
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	-1,228,358.26	210,622.72
股利收益	6.4.3.15	8,315,170.93	4,351,980.45
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	-29,118,031.68	-1,613,356.20
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	94,802.48	303,083.11
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>5,412,170.42</b>	<b>3,244,623.62</b>
1. 管理人报酬		4,247,499.35	2,479,995.65
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		707,916.54	413,332.61
3. 销售服务费		355,421.65	250,377.59



4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	1,773.67
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,773.67
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		-	3,250.11
8. 其他费用	6.4.3.19	101,332.88	95,893.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-22,064,464.03	9,887,682.20
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-22,064,464.03	9,887,682.20
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-22,064,464.03	9,887,682.20

### 6.3 净资产变动表

会计主体：博时量化多策略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	567,484,186.74	-	101,579,863.99	669,064,050.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	567,484,186.74	-	101,579,863.99	669,064,050.73
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	23,415,451.17	-	-16,736,649.61	6,678,801.56
（一）、综合收益总额	-	-	-22,064,464.03	-22,064,464.03
（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）	23,415,451.17	-	5,327,814.42	28,743,265.59
其中：1. 基金申购款	146,494,335.39	-	25,164,628.84	171,658,964.23
2. 基金赎回款	-123,078,884.22	-	-19,836,814.42	-142,915,698

				.64
(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	590,899,637.91	-	84,843,214.38	675,742,852.29
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	159,874,747.07	-	72,586,936.48	232,461,683.55
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	159,874,747.07	-	72,586,936.48	232,461,683.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	45,144,575.89	-	33,096,308.88	78,240,884.77
(一)、综合收益总额	-	-	9,887,682.20	9,887,682.20
(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)	45,144,575.89	-	23,208,626.68	68,353,202.57
其中: 1. 基金申购款	171,395,662.29	-	87,044,408.57	258,440,070.86
2. 基金赎回款	-126,251,086.40	-	-63,835,781.89	-190,086,868.29
(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	205,019,322.96	-	105,683,245.36	310,702,568.

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解

禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 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	11,171,504.91
等于：本金	11,170,128.44
加：应计利息	1,376.47
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	11,171,504.91

#### 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	647,878,802.7	-	628,668,605.17	-19,210,197.58

		5			
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,018,750.00	78,452.06	5,090,952.06	-6,250.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,018,750.00	78,452.06	5,090,952.06	-6,250.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		652,897,552.75	78,452.06	633,759,557.23	-19,216,447.58

#### 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	0.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	651.70
预提费用	94,007.60
合计	94,659.35

#### 6.4.3.8 实收基金

##### 博时量化多策略股票 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	504,330,069.27	504,330,069.27
本期申购	113,583,389.18	113,583,389.18
本期赎回（以“-”号填列）	-96,542,072.25	-96,542,072.25
本期末	521,371,386.20	521,371,386.20

##### 博时量化多策略股票 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	63,154,117.47	63,154,117.47
本期申购	32,910,946.21	32,910,946.21
本期赎回（以“-”号填列）	-26,536,811.97	-26,536,811.97
本期末	69,528,251.71	69,528,251.71

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

##### 博时量化多策略股票 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	86,021,154.86	6,003,841.89	92,024,996.75
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	86,021,154.86	6,003,841.89	92,024,996.75
本期利润	5,272,664.19	-26,553,607.49	-21,280,943.30
本期基金份额交易产生的	5,767,902.60	476,094.74	6,243,997.34

变动数			
其中：基金申购款	20,551,110.97	1,230,205.70	21,781,316.67
基金赎回款	-14,783,208.37	-754,110.96	-15,537,319.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,061,721.65	-20,073,670.86	76,988,050.79

**博时量化多策略股票 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	8,814,984.41	739,882.83	9,554,867.24
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	8,814,984.41	739,882.83	9,554,867.24
本期利润	1,780,903.46	-2,564,424.19	-783,520.73
本期基金份额交易产生的变动数	-154,626.45	-761,556.47	-916,182.92
其中：基金申购款	3,905,080.98	-521,768.81	3,383,312.17
基金赎回款	-4,059,707.43	-239,787.66	-4,299,495.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,441,261.42	-2,586,097.83	7,855,163.59

**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	54,680.32
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	142,495.29
其他	562.18
合计	197,737.79

**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	5,740,040,321.66
减：卖出股票成本总额	5,722,406,864.41
减：交易费用	12,594,494.84
买卖股票差价收入	5,038,962.41

### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	50,462.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,039.50
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	47,422.72

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,912,050.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,502,027.00
减：应计利息总额	412,050.00
减：交易费用	1,012.50
买卖债券差价收入	-3,039.50

### 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	-1,228,358.26



**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	8,315,170.93
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	8,315,170.93

**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	-28,536,591.23
——股票投资	-28,530,318.23
——债券投资	-6,273.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-581,440.45
——权证投资	-
——股指期货	-581,440.45
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	-29,118,031.68

**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	94,551.30
基金转换费收入	251.18
合计	94,802.48

**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	29,835.26

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	189.75
银行汇划费	2,635.53
中债登账户维护费	9,000.00
合计	101,332.88

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
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	7,356,014,312.29	63.89%	2,364,935,770.88	40.55%

###### 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	5,018,750.00	100.00%	5,542,690.15	36.00%

### 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	5,885,766.59	65.49%	-	-
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	1,729,477.22	40.55%	1,007,909.87	55.66%

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	4,247,499.35	2,479,995.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	278,388.56	109,133.14
应支付基金管理人的净管理费	3,969,110.79	2,370,862.51

注：于本期及上年度可比期间，截至2023年7月9日止，支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

自2023年7月10日起，支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	707,916.54	413,332.61

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		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	39,908.15	39,908.15
招商证券	-	3,671.14	3,671.14
招商银行	-	1,238.15	1,238.15
合计	-	44,817.44	44,817.44
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		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	117,730.95	117,730.95
招商证券	-	98,733.56	98,733.56
招商银行	-	993.30	993.30
合计	-	217,457.81	217,457.81

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自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**

无。

**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
招商银行-活期存款	11,171,504.91	54,680.32	16,895,791.16	50,354.59

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
-	-	-	-	-	-
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	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	4,806.00	121,351.50

#### 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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	首次公开发行限售	70.48	188.01	1,244.00	87,680.99	233,884.44	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	首次公开发行限售	15.69	18.79	1,045.00	16,396.05	19,635.55	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	首次公开发行限售	22.66	15.89	866.00	19,623.56	13,760.74	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	首次公开发行限售	16.20	15.96	842.00	13,640.40	13,438.32	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	首次公开发行限售	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	首次公开发行限售	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	首次公开发行	72.46	68.06	66.00	4,782.36	4,491.96	-

603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	限售首次公开发行限售	29.02	25.36	130.00	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	限售首次公开发行限售	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	限售首次公开发行限售	16.98	13.48	213.00	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	限售首次公开发行限售	38.18	38.90	72.00	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	限售首次公开发行限售	11.82	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-

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，属于风险水平较高的基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,090,952.06	20,898,295.34
合计	5,090,952.06	20,898,295.34

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

#### 6.4.9.2.2 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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	11,171,504.91	-	-	-	11,171,504.91
结算备付金	30,732,464.99	-	-	-	30,732,464.99
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	5,090,952.06	-	-	628,668,605.17	633,759,557.23
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,049,225.82	1,049,225.82
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>46,994,921.96</b>	-	-	<b>629,717,830.99</b>	<b>676,712,752.95</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,124.22	8,124.22
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	698,695.38	698,695.38
应付托管费	-	-	-	116,449.22	116,449.22
应付销售服务费	-	-	-	51,972.49	51,972.49
应交税费	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	94,659.35	94,659.35
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>969,900.66</b>	<b>969,900.66</b>
利率敏感度缺口	46,994,921.96	-	-	628,747,930.33	675,742,852.29
<b>上年度末</b> <b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	64,033,805.62	-	-	-	64,033,805.62
结算备付金	27,714,351.93	-	-	-	27,714,351.93
存出保证金	213,592.43	-	-	2,932,272.00	3,145,864.43
交易性金融资产	20,898,295.34	-	-	604,675,860.12	625,574,155.46
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,073.22	4,073.22
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>112,860,045.32</b>	-	-	<b>607,612,205.34</b>	<b>720,472,250.66</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,776.73	11,776.73
应付清算款	-	-	-	45,924,929.40	45,924,929.40
应付管理人报酬	-	-	-	654,804.35	654,804.35
应付托管费	-	-	-	109,134.07	109,134.07
应付销售服务费	-	-	-	43,399.62	43,399.62
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,664,155.76	4,664,155.76
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>51,408,199.93</b>	<b>51,408,199.93</b>
利率敏感度缺口	112,860,045.32	-	-	556,204,005.41	669,064,050.73

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 0	减少约 0
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0	增加约 0

注：以上金额为四舍五入的结果。

#### 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	628,668,605.17	93.03	604,675,860.12	90.38
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>628,668,605.17</b>	<b>93.03</b>	<b>604,675,860.12</b>	<b>90.38</b>

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 2,023	增加约 2,353
	业绩比较基准下降 5%	减少约 2,023	减少约 2,353

#### 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	628,353,636.38
第二层次	5,090,952.06
第三层次	314,968.79
合计	633,759,557.23

###### 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	628,668,605.17	92.90
	其中：股票	628,668,605.17	92.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,090,952.06	0.75
	其中：债券	5,090,952.06	0.75
	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	41,903,969.90	6.19
8	其他各项资产	1,049,225.82	0.16
9	合计	676,712,752.95	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	9,255,490.40	1.37
B	采矿业	34,049,481.44	5.04
C	制造业	356,064,299.26	52.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,927,707.96	6.35
E	建筑业	23,434,569.00	3.47
F	批发和零售业	2,795,784.44	0.41

G	交通运输、仓储和邮政业	12,706,434.00	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,090,925.00	2.09
J	金融业	124,452,880.23	18.42
K	房地产业	1,581,789.00	0.23
L	租赁和商务服务业	2,160,860.12	0.32
M	科学研究和技术服务业	4,205,531.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	66,892.32	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	38,439.00	0.01
Q	卫生和社会工作	61,920.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	775,602.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	628,668,605.17	93.03

### 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	34,200	50,184,738.00	7.43
2	000333	美的集团	273,565	17,644,942.50	2.61
3	600900	长江电力	591,918	17,118,268.56	2.53
4	601166	兴业银行	876,100	15,436,882.00	2.28
5	601318	中国平安	350,100	14,480,136.00	2.14
6	300750	宁德时代	57,200	10,297,716.00	1.52
7	002594	比亚迪	37,000	9,259,250.00	1.37
8	601398	工商银行	1,585,900	9,039,630.00	1.34
9	601899	紫金矿业	499,800	8,781,486.00	1.30
10	002475	立讯精密	211,400	8,310,134.00	1.23
11	601328	交通银行	1,091,123	8,150,688.81	1.21
12	300308	中际旭创	58,960	8,129,404.80	1.20
13	000568	泸州老窖	56,400	8,092,836.00	1.20
14	603501	韦尔股份	81,200	8,068,844.00	1.19
15	600276	恒瑞医药	192,420	7,400,473.20	1.10
16	000651	格力电器	181,100	7,102,742.00	1.05
17	600690	海尔智家	236,500	6,711,870.00	0.99
18	600926	杭州银行	514,200	6,710,310.00	0.99
19	601857	中国石油	638,467	6,588,979.44	0.98
20	601088	中国神华	144,300	6,402,591.00	0.95
21	601390	中国中铁	975,200	6,358,304.00	0.94



22	601288	农业银行	1,426,200	6,218,232.00	0.92
23	601668	中国建筑	1,159,500	6,156,945.00	0.91
24	600015	华夏银行	951,200	6,087,680.00	0.90
25	600989	宝丰能源	347,000	6,013,510.00	0.89
26	601985	中国核电	505,400	5,387,564.00	0.80
27	600809	山西汾酒	25,300	5,335,264.00	0.79
28	600019	宝钢股份	784,500	5,216,925.00	0.77
29	002371	北方华创	16,100	5,150,229.00	0.76
30	600887	伊利股份	194,200	5,018,128.00	0.74
31	000001	平安银行	490,998	4,983,629.70	0.74
32	600016	民生银行	1,309,900	4,964,521.00	0.73
33	002714	牧原股份	112,400	4,900,640.00	0.73
34	000858	五粮液	38,200	4,891,128.00	0.72
35	601601	中国太保	174,800	4,869,928.00	0.72
36	300433	蓝思科技	262,800	4,796,100.00	0.71
37	600919	江苏银行	637,342	4,735,451.06	0.70
38	601229	上海银行	641,261	4,655,554.86	0.69
39	600886	国投电力	254,300	4,638,432.00	0.69
40	600039	四川路桥	575,600	4,541,484.00	0.67
41	300498	温氏股份	219,720	4,354,850.40	0.64
42	601577	长沙银行	522,700	4,275,686.00	0.63
43	601997	贵阳银行	802,700	4,230,229.00	0.63
44	600674	川投能源	222,300	4,168,125.00	0.62
45	300760	迈瑞医疗	14,000	4,072,740.00	0.60
46	600025	华能水电	370,430	3,993,235.40	0.59
47	002180	纳思达	149,400	3,947,148.00	0.58
48	600030	中信证券	216,400	3,944,972.00	0.58
49	000725	京东方 A	963,200	3,939,488.00	0.58
50	600803	新奥股份	189,200	3,935,360.00	0.58
51	002938	鹏鼎控股	98,800	3,928,288.00	0.58
52	002252	上海莱士	501,800	3,924,076.00	0.58
53	603323	苏农银行	812,100	3,906,201.00	0.58
54	603986	兆易创新	40,700	3,891,734.00	0.58
55	603195	公牛集团	50,395	3,886,462.40	0.58
56	300142	沃森生物	337,600	3,841,888.00	0.57
57	600584	长电科技	120,800	3,830,568.00	0.57
58	605499	东鹏饮料	17,700	3,818,775.00	0.57
59	002352	顺丰控股	106,600	3,804,554.00	0.56
60	600406	国电南瑞	152,300	3,801,408.00	0.56
61	300408	三环集团	129,500	3,780,105.00	0.56
62	600732	爱旭股份	406,400	3,677,920.00	0.54
63	601816	京沪高铁	586,400	3,148,968.00	0.47
64	600309	万华化学	38,300	3,096,938.00	0.46

65	300492	华图山鼎	31,950	3,009,690.00	0.45
66	601633	长城汽车	111,500	2,820,950.00	0.42
67	600028	中国石化	441,600	2,790,912.00	0.41
68	002415	海康威视	88,300	2,729,353.00	0.40
69	601127	赛力斯	29,600	2,697,152.00	0.40
70	601688	华泰证券	217,100	2,689,869.00	0.40
71	300857	协创数据	46,600	2,656,200.00	0.39
72	300059	东方财富	251,080	2,651,404.80	0.39
73	300529	健帆生物	94,500	2,571,345.00	0.38
74	002928	华夏航空	403,800	2,560,092.00	0.38
75	002984	森麒麟	105,600	2,543,904.00	0.38
76	002726	龙大美食	386,000	2,532,160.00	0.37
77	001301	尚太科技	58,400	2,524,048.00	0.37
78	601138	工业富联	91,600	2,509,840.00	0.37
79	600050	中国联通	532,500	2,502,750.00	0.37
80	601225	陕西煤业	96,400	2,484,228.00	0.37
81	603496	恒为科技	100,700	2,462,115.00	0.36
82	300446	航天智造	204,700	2,435,930.00	0.36
83	300708	聚灿光电	266,700	2,400,300.00	0.36
84	300005	探路者	473,900	2,374,239.00	0.35
85	688408	中信博	25,700	2,366,456.00	0.35
86	601989	中国重工	473,100	2,332,383.00	0.35
87	600941	中国移动	21,500	2,311,250.00	0.34
88	688138	清溢光电	107,229	2,305,423.50	0.34
89	688036	传音控股	29,820	2,282,422.80	0.34
90	300840	酷特智能	245,900	2,274,575.00	0.34
91	601186	中国铁建	254,500	2,181,065.00	0.32
92	689009	九号公司	59,082	2,174,808.42	0.32
93	300969	恒帅股份	31,400	2,170,682.00	0.32
94	688498	源杰科技	16,500	2,161,335.00	0.32
95	688233	神工股份	111,901	2,156,332.27	0.32
96	601728	中国电信	338,000	2,078,700.00	0.31
97	300124	汇川技术	40,009	2,052,461.70	0.30
98	000063	中兴通讯	72,000	2,013,840.00	0.30
99	002493	荣盛石化	208,400	2,013,144.00	0.30
100	600010	包钢股份	1,357,100	1,899,940.00	0.28
101	688111	金山办公	8,300	1,888,250.00	0.28
102	000338	潍柴动力	110,800	1,799,392.00	0.27
103	000596	古井贡酒	8,100	1,709,667.00	0.25
104	601012	隆基绿能	117,200	1,643,144.00	0.24
105	601717	郑煤机	108,400	1,604,320.00	0.24
106	603198	迎驾贡酒	27,700	1,592,750.00	0.24
107	300274	阳光电源	24,800	1,538,344.00	0.23

108	600737	中粮糖业	158,000	1,515,220.00	0.22
109	600566	济川药业	46,900	1,487,199.00	0.22
110	601988	中国银行	296,000	1,367,520.00	0.20
111	600938	中国海油	40,000	1,320,000.00	0.20
112	601919	中远海控	85,000	1,316,650.00	0.19
113	601600	中国铝业	171,200	1,306,256.00	0.19
114	601169	北京银行	217,500	1,270,200.00	0.19
115	601117	中国化学	154,100	1,269,784.00	0.19
116	002142	宁波银行	56,200	1,239,772.00	0.18
117	601888	中国中免	19,700	1,231,053.00	0.18
118	603160	汇顶科技	17,200	1,182,500.00	0.17
119	600667	太极实业	206,700	1,180,257.00	0.17
120	600795	国电电力	194,400	1,164,456.00	0.17
121	603259	药明康德	29,400	1,152,186.00	0.17
122	600183	生益科技	54,700	1,151,982.00	0.17
123	000400	许继电气	33,200	1,142,412.00	0.17
124	603606	东方电缆	22,300	1,088,463.00	0.16
125	688578	艾力斯	16,987	1,082,751.38	0.16
126	600707	彩虹股份	157,300	1,071,213.00	0.16
127	300502	新易盛	9,900	1,044,945.00	0.15
128	600066	宇通客车	39,500	1,019,100.00	0.15
129	688041	海光信息	14,300	1,005,576.00	0.15
130	603369	今世缘	21,600	997,920.00	0.15
131	601818	光大银行	314,300	996,331.00	0.15
132	002595	豪迈科技	26,000	992,420.00	0.15
133	600362	江西铜业	41,600	985,088.00	0.15
134	300979	华利集团	16,000	973,600.00	0.14
135	002106	莱宝高科	87,900	958,110.00	0.14
136	600000	浦发银行	115,700	952,211.00	0.14
137	603993	洛阳钼业	110,800	941,800.00	0.14
138	002028	思源电气	13,900	929,910.00	0.14
139	000708	中信特钢	68,500	929,545.00	0.14
140	601163	三角轮胎	60,400	919,288.00	0.14
141	601336	新华保险	30,100	903,903.00	0.13
142	000625	长安汽车	66,400	891,752.00	0.13
143	002311	海大集团	18,700	879,835.00	0.13
144	300009	安科生物	101,000	862,540.00	0.13
145	601939	建设银行	114,900	850,260.00	0.13
146	002558	巨人网络	88,900	839,216.00	0.12
147	601319	中国人保	162,900	838,935.00	0.12
148	300724	捷佳伟创	15,200	820,952.00	0.12
149	002920	德赛西威	9,400	818,646.00	0.12
150	002236	大华股份	52,400	810,104.00	0.12

151	000975	银泰黄金	49,000	798,210.00	0.12
152	000963	华东医药	28,500	792,585.00	0.12
153	002752	昇兴股份	155,500	786,830.00	0.12
154	000550	江铃汽车	35,600	772,876.00	0.11
155	601766	中国中车	102,800	772,028.00	0.11
156	600188	兖矿能源	33,500	761,455.00	0.11
157	600346	恒力石化	54,100	754,695.00	0.11
158	002027	分众传媒	123,900	750,834.00	0.11
159	601669	中国电建	134,000	749,060.00	0.11
160	600150	中国船舶	17,600	716,496.00	0.11
161	002648	卫星化学	39,500	710,210.00	0.11
162	002035	华帝股份	113,700	708,351.00	0.10
163	300144	宋城演艺	88,000	706,640.00	0.10
164	300122	智飞生物	25,200	706,356.00	0.10
165	600048	保利发展	79,700	698,172.00	0.10
166	000661	长春高新	7,500	688,275.00	0.10
167	001979	招商蛇口	74,300	653,097.00	0.10
168	300896	爱美客	3,740	643,654.00	0.10
169	300389	艾比森	52,400	643,472.00	0.10
170	601865	福莱特	31,900	641,190.00	0.09
171	603806	福斯特	43,560	640,332.00	0.09
172	600210	紫江企业	118,700	631,484.00	0.09
173	601658	邮储银行	121,700	617,019.00	0.09
174	600585	海螺水泥	25,700	606,263.00	0.09
175	600219	南山铝业	153,100	583,311.00	0.09
176	300999	金龙鱼	21,300	582,555.00	0.09
177	002625	光启技术	33,200	576,020.00	0.09
178	601898	中煤能源	46,000	574,080.00	0.08
179	601009	南京银行	55,200	573,528.00	0.08
180	003816	中国广核	123,100	569,953.00	0.08
181	601998	中信银行	84,300	564,810.00	0.08
182	000034	神州数码	23,800	544,782.00	0.08
183	603518	锦泓集团	61,700	542,960.00	0.08
184	002466	天齐锂业	18,100	541,371.00	0.08
185	601799	星宇股份	4,800	537,792.00	0.08
186	600023	浙能电力	75,000	533,250.00	0.08
187	601618	中国中冶	169,300	524,830.00	0.08
188	601006	大秦铁路	72,200	516,952.00	0.08
189	000983	山西焦煤	49,800	513,438.00	0.08
190	301219	腾远钴业	13,400	512,684.00	0.08
191	600905	三峡能源	116,500	507,940.00	0.08
192	601211	国泰君安	37,100	502,705.00	0.07
193	601236	红塔证券	76,200	489,204.00	0.07

194	000426	兴业银锡	34,400	467,152.00	0.07
195	600547	山东黄金	16,600	454,508.00	0.07
196	002852	道道全	60,900	438,480.00	0.06
197	601868	中国能建	205,000	434,600.00	0.06
198	000876	新希望	46,700	426,838.00	0.06
199	601699	潞安环能	23,200	420,616.00	0.06
200	600438	通威股份	21,600	412,776.00	0.06
201	600111	北方稀土	23,400	402,480.00	0.06
202	301015	百洋医药	17,000	400,010.00	0.06
203	600489	中金黄金	26,800	396,640.00	0.06
204	002050	三花智控	20,600	393,048.00	0.06
205	300441	鲍斯股份	64,200	380,706.00	0.06
206	600866	星湖科技	68,700	379,224.00	0.06
207	000301	东方盛虹	46,800	372,996.00	0.06
208	600011	华能国际	36,000	346,320.00	0.05
209	688472	阿特斯	33,900	345,102.00	0.05
210	300772	运达股份	35,900	344,640.00	0.05
211	601021	春秋航空	5,900	332,347.00	0.05
212	000977	浪潮信息	9,100	330,967.00	0.05
213	601838	成都银行	20,700	314,433.00	0.05
214	600096	云天化	15,900	308,778.00	0.05
215	601000	唐山港	65,100	305,970.00	0.05
216	301187	欧圣电气	12,500	303,125.00	0.04
217	002001	新和成	15,400	295,680.00	0.04
218	002460	赣锋锂业	10,300	295,095.00	0.04
219	002230	科大讯飞	6,800	292,060.00	0.04
220	600998	九州通	59,538	290,545.44	0.04
221	600031	三一重工	17,000	280,500.00	0.04
222	600901	江苏金租	55,300	279,265.00	0.04
223	603799	华友钴业	12,500	276,625.00	0.04
224	600398	海澜之家	29,500	272,580.00	0.04
225	600350	山东高速	30,600	270,810.00	0.04
226	300628	亿联网络	7,300	268,421.00	0.04
227	300782	卓胜微	3,400	264,316.00	0.04
228	600282	南钢股份	53,000	263,940.00	0.04
229	002267	陕天然气	34,900	263,844.00	0.04
230	002966	苏州银行	34,900	261,750.00	0.04
231	603967	中创物流	27,900	259,470.00	0.04
232	002327	富安娜	25,700	258,285.00	0.04
233	002911	佛燃能源	28,200	257,748.00	0.04
234	002032	苏泊尔	5,100	255,510.00	0.04
235	000030	富奥股份	51,600	253,356.00	0.04
236	603156	养元饮品	11,800	250,986.00	0.04

237	002416	爱施德	28,300	250,455.00	0.04
238	002340	格林美	39,300	250,341.00	0.04
239	002540	亚太科技	47,200	249,688.00	0.04
240	002773	康弘药业	11,400	246,810.00	0.04
241	002563	森马服饰	42,300	245,763.00	0.04
242	601825	沪农商行	36,500	245,280.00	0.04
243	601058	赛轮轮胎	17,400	243,600.00	0.04
244	002270	华明装备	10,900	242,416.00	0.04
245	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
246	000069	华侨城 A	113,000	230,520.00	0.03
247	600741	华域汽车	14,000	229,320.00	0.03
248	002841	视源股份	7,600	224,428.00	0.03
249	002601	龙佰集团	12,000	222,840.00	0.03
250	000895	双汇发展	8,900	211,553.00	0.03
251	688561	奇安信	8,700	205,494.00	0.03
252	000792	盐湖股份	11,500	200,675.00	0.03
253	000933	神火股份	9,400	190,162.00	0.03
254	600694	大商股份	11,300	189,953.00	0.03
255	601808	中海油服	10,400	178,880.00	0.03
256	600916	中国黄金	18,400	177,008.00	0.03
257	300735	光弘科技	8,100	174,960.00	0.03
258	601126	四方股份	8,600	165,292.00	0.02
259	000877	天山股份	30,100	162,540.00	0.02
260	600062	华润双鹤	8,300	162,514.00	0.02
261	000630	铜陵有色	43,000	155,230.00	0.02
262	688065	凯赛生物	3,400	154,326.00	0.02
263	002384	东山精密	7,300	151,110.00	0.02
264	600893	航发动力	4,100	149,855.00	0.02
265	603279	景津装备	6,600	143,154.00	0.02
266	301301	川宁生物	11,100	141,858.00	0.02
267	000100	TCL 科技	32,600	140,832.00	0.02
268	600018	上港集团	24,000	138,720.00	0.02
269	688516	奥特维	3,264	136,467.84	0.02
270	600993	马应龙	5,100	136,017.00	0.02
271	688506	百利天恒	700	126,980.00	0.02
272	000758	中色股份	24,300	123,444.00	0.02
273	300910	瑞丰新材	2,800	122,416.00	0.02
274	601916	浙商银行	41,900	115,644.00	0.02
275	600660	福耀玻璃	2,400	114,960.00	0.02
276	601500	通用股份	20,200	107,868.00	0.02
277	600436	片仔癀	500	103,585.00	0.02
278	600089	特变电工	7,360	102,083.20	0.02
279	603288	海天味业	2,900	99,963.00	0.01

280	002304	洋河股份	1,100	88,814.00	0.01
281	600153	建发股份	9,700	86,621.00	0.01
282	688008	澜起科技	1,500	85,740.00	0.01
283	002241	歌尔股份	4,300	83,893.00	0.01
284	300458	全志科技	3,400	79,934.00	0.01
285	300457	赢合科技	4,400	78,452.00	0.01
286	603919	金徽酒	4,200	76,314.00	0.01
287	002315	焦点科技	2,700	72,792.00	0.01
288	605305	中际联合	2,800	72,212.00	0.01
289	000938	紫光股份	3,200	71,520.00	0.01
289	688772	珠海冠宇	4,800	71,520.00	0.01
290	600582	天地科技	10,100	69,589.00	0.01
291	300251	光线传媒	8,200	68,962.00	0.01
292	002179	中航光电	1,800	68,490.00	0.01
293	301030	仕净科技	2,600	64,012.00	0.01
294	300820	英杰电气	1,600	62,944.00	0.01
295	000997	新大陆	4,500	62,595.00	0.01
296	300015	爱尔眼科	6,000	61,920.00	0.01
297	002897	意华股份	1,600	60,256.00	0.01
298	600755	厦门国贸	8,300	59,511.00	0.01
299	002697	红旗连锁	12,500	57,875.00	0.01
300	688234	天岳先进	1,200	56,304.00	0.01
301	002112	三变科技	6,300	55,944.00	0.01
302	002469	三维化学	9,500	54,150.00	0.01
303	000035	中国天楹	11,800	53,454.00	0.01
304	001337	四川黄金	2,200	51,062.00	0.01
305	603688	石英股份	1,700	50,337.00	0.01
306	600372	中航机载	4,200	50,274.00	0.01
307	600029	南方航空	8,500	50,065.00	0.01
308	300926	博俊科技	2,500	50,050.00	0.01
309	003019	宸展光电	1,965	49,773.45	0.01
310	600132	重庆啤酒	800	48,560.00	0.01
311	688798	艾为电子	800	45,296.00	0.01
312	600745	闻泰科技	1,600	45,200.00	0.01
313	603277	银都股份	1,500	45,060.00	0.01
314	601607	上海医药	2,300	43,953.00	0.01
315	000821	京山轻机	3,700	41,921.00	0.01
316	603899	晨光股份	1,300	40,664.00	0.01
317	688223	晶科能源	5,700	40,470.00	0.01
318	002736	国信证券	4,500	39,105.00	0.01
319	600186	莲花控股	11,400	39,102.00	0.01
320	603929	亚翔集成	1,600	38,240.00	0.01
321	300192	科德教育	3,800	37,316.00	0.01

322	300836	佰奥智能	900	35,811.00	0.01
323	000999	华润三九	840	35,767.20	0.01
324	688599	天合光能	2,100	35,532.00	0.01
325	300783	三只松鼠	1,600	34,992.00	0.01
326	002459	晶澳科技	3,100	34,720.00	0.01
327	300880	迦南智能	1,700	33,371.00	0.00
328	300450	先导智能	1,900	31,597.00	0.00
329	300102	乾照光电	4,900	31,458.00	0.00
330	002707	众信旅游	5,300	30,422.00	0.00
331	002919	名臣健康	2,620	30,418.20	0.00
332	301526	国际复材	9,037	30,093.21	0.00
333	300872	天阳科技	2,100	27,825.00	0.00
334	003025	思进智能	2,200	27,082.00	0.00
335	002835	同为股份	1,600	27,024.00	0.00
336	000408	藏格矿业	1,100	26,477.00	0.00
337	300316	晶盛机电	900	25,857.00	0.00
338	600721	百花医药	4,200	24,360.00	0.00
339	002991	甘源食品	400	24,260.00	0.00
340	300751	迈为股份	200	23,896.00	0.00
341	002068	黑猫股份	3,300	23,430.00	0.00
342	600979	广安爱众	6,700	22,512.00	0.00
343	603055	台华新材	2,100	21,273.00	0.00
344	001289	龙源电力	1,200	20,700.00	0.00
345	002845	同兴达	1,500	19,830.00	0.00
346	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
347	688222	成都先导	1,700	19,295.00	0.00
348	300758	七彩化学	1,700	18,275.00	0.00
349	600727	鲁北化工	2,900	18,270.00	0.00
350	300707	威唐工业	1,400	17,332.00	0.00
351	688363	华熙生物	300	16,971.00	0.00
352	300100	双林股份	1,400	15,078.00	0.00
353	000700	模塑科技	2,800	14,700.00	0.00
354	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
355	603108	润达医疗	900	13,626.00	0.00
356	601033	永兴股份	842	13,438.32	0.00
357	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
358	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
359	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
360	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
361	603332	苏州龙杰	700	5,159.00	0.00
362	300002	神州泰岳	600	4,872.00	0.00
363	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
364	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00



365	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
366	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
367	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
368	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
369	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
370	300150	世纪瑞尔	1,000	2,580.00	0.00
371	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
372	600525	长园集团	500	2,130.00	0.00
373	300837	浙矿股份	100	2,076.00	0.00
374	600221	海航控股	1,800	1,836.00	0.00
375	300562	乐心医疗	200	1,782.00	0.00
376	300638	广和通	100	1,710.00	0.00
377	300145	中金环境	600	1,500.00	0.00
378	301568	思泰克	46	1,463.72	0.00
379	301158	德石股份	100	1,237.00	0.00
380	600661	昂立教育	100	1,123.00	0.00
381	600776	东方通信	100	983.00	0.00
382	300703	创源股份	100	808.00	0.00
383	002796	世嘉科技	100	795.00	0.00
384	300603	立昂技术	100	691.00	0.00
385	002774	快意电梯	100	635.00	0.00
386	300011	鼎汉技术	100	499.00	0.00
387	001358	兴欣新材	22	451.44	0.00
388	300081	恒信东方	100	442.00	0.00
389	601399	国机重装	100	258.00	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	600519	贵州茅台	109,242,506.20	16.33
2	601318	中国平安	83,971,596.00	12.55
3	000333	美的集团	72,177,123.71	10.79
4	300750	宁德时代	63,029,973.68	9.42
5	601288	农业银行	62,410,820.00	9.33
6	600900	长江电力	58,633,646.80	8.76
7	601857	中国石油	57,720,504.70	8.63
8	601166	兴业银行	50,863,715.60	7.60
9	601398	工商银行	47,603,256.00	7.11
10	000001	平安银行	46,362,128.16	6.93
11	300760	迈瑞医疗	45,091,531.24	6.74

12	000651	格力电器	44,137,679.73	6.60
13	000568	泸州老窖	43,218,385.00	6.46
14	601328	交通银行	42,753,250.50	6.39
15	601668	中国建筑	39,380,008.00	5.89
16	601229	上海银行	38,362,031.02	5.73
17	002415	海康威视	35,914,783.63	5.37
18	601088	中国神华	34,633,736.98	5.18
19	002594	比亚迪	34,104,713.00	5.10
20	000858	五粮液	30,580,316.00	4.57
21	601899	紫金矿业	29,441,025.00	4.40
22	601138	工业富联	28,674,842.36	4.29
23	601231	环旭电子	28,181,724.60	4.21
24	601169	北京银行	27,604,374.72	4.13
25	300274	阳光电源	27,582,812.20	4.12
26	600015	华夏银行	27,500,052.89	4.11
27	600016	民生银行	27,236,665.46	4.07
28	600028	中国石化	26,621,178.50	3.98
29	600919	江苏银行	26,056,608.00	3.89
30	601390	中国中铁	25,264,966.66	3.78
31	601997	贵阳银行	24,707,784.20	3.69
32	000625	长安汽车	24,135,546.20	3.61
33	601577	长沙银行	23,669,021.65	3.54
34	300308	中际旭创	23,463,252.26	3.51
35	600809	山西汾酒	23,444,674.00	3.50
36	601601	中国太保	23,216,093.00	3.47
37	600050	中国联通	22,983,987.00	3.44
38	600438	通威股份	22,730,444.00	3.40
39	601816	京沪高铁	22,207,975.00	3.32
40	600089	特变电工	22,194,996.69	3.32
41	603323	苏农银行	22,126,899.90	3.31
42	601818	光大银行	21,669,999.00	3.24
43	603501	韦尔股份	21,599,532.00	3.23
44	002475	立讯精密	21,229,711.00	3.17
45	688036	传音控股	21,155,164.25	3.16
46	600926	杭州银行	20,835,152.48	3.11
47	600998	九州通	20,750,544.37	3.10
48	603259	药明康德	20,715,859.60	3.10
49	601186	中国铁建	20,699,162.00	3.09
50	600737	中粮糖业	20,023,691.00	2.99
51	601012	隆基绿能	19,880,314.07	2.97
52	002600	领益智造	19,408,520.46	2.90
53	002027	分众传媒	19,216,259.02	2.87
54	600741	华域汽车	19,201,874.00	2.87

55	002371	北方华创	18,724,833.00	2.80
56	002714	牧原股份	18,634,295.40	2.79
57	601988	中国银行	18,579,062.00	2.78
58	300394	天孚通信	18,523,109.40	2.77
59	600276	恒瑞医药	18,501,397.40	2.77
60	002648	卫星化学	18,490,453.47	2.76
61	300059	东方财富	18,433,974.91	2.76
62	300390	天华新能	18,105,347.30	2.71
63	601077	渝农商行	17,511,139.00	2.62
64	600887	伊利股份	17,246,208.23	2.58
65	600030	中信证券	17,159,130.37	2.56
66	600019	宝钢股份	16,618,512.00	2.48
67	300124	汇川技术	16,274,627.24	2.43
68	603198	迎驾贡酒	15,966,891.78	2.39
69	601633	长城汽车	15,887,173.93	2.37
70	601688	华泰证券	15,424,001.00	2.31
71	600000	浦发银行	15,393,135.86	2.30
72	600309	万华化学	15,299,970.00	2.29
73	300828	锐新科技	15,163,026.66	2.27
74	601888	中国中免	15,147,175.00	2.26
75	688599	天合光能	15,017,617.24	2.24
76	000725	京东方 A	14,842,007.00	2.22
77	300498	温氏股份	14,830,620.20	2.22
78	300532	今天国际	14,778,989.00	2.21
79	000002	万科 A	14,722,260.00	2.20
80	600150	中国船舶	14,716,575.00	2.20
81	601211	国泰君安	14,440,751.74	2.16
82	601225	陕西煤业	14,269,575.00	2.13
83	002595	豪迈科技	14,016,921.11	2.10
84	002459	晶澳科技	14,001,625.00	2.09
85	000521	长虹美菱	13,951,588.93	2.09
86	601728	中国电信	13,523,969.00	2.02
87	600989	宝丰能源	13,489,279.50	2.02

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	601318	中国平安	78,730,702.76	11.77
2	601857	中国石油	72,647,345.90	10.86

3	300750	宁德时代	69,209,449.22	10.34
4	000333	美的集团	68,584,772.79	10.25
5	601288	农业银行	61,172,374.00	9.14
6	600519	贵州茅台	59,660,291.00	8.92
7	300760	迈瑞医疗	49,103,037.61	7.34
8	000651	格力电器	48,369,960.77	7.23
9	600900	长江电力	45,496,955.00	6.80
10	601166	兴业银行	43,476,991.00	6.50
11	601398	工商银行	40,643,687.00	6.07
12	000001	平安银行	40,378,353.00	6.04
13	000568	泸州老窖	38,882,054.00	5.81
14	601138	工业富联	37,560,005.28	5.61
15	601328	交通银行	36,539,655.10	5.46
16	601229	上海银行	36,424,148.35	5.44
17	300274	阳光电源	34,844,123.80	5.21
18	000858	五粮液	34,624,182.98	5.18
19	601088	中国神华	34,398,037.71	5.14
20	601668	中国建筑	34,322,962.40	5.13
21	601899	紫金矿业	34,050,025.00	5.09
22	002415	海康威视	33,519,319.02	5.01
23	002594	比亚迪	31,458,810.94	4.70
24	600028	中国石化	31,165,979.00	4.66
25	600089	特变电工	30,407,601.33	4.54
26	601231	环旭电子	29,125,449.00	4.35
27	601169	北京银行	28,842,244.36	4.31
28	600438	通威股份	28,340,856.00	4.24
29	688036	传音控股	27,881,268.28	4.17
30	000625	长安汽车	26,572,741.57	3.97
31	300394	天孚通信	25,487,139.17	3.81
32	601818	光大银行	25,212,170.00	3.77
33	002027	分众传媒	25,159,180.00	3.76
34	600015	华夏银行	24,929,111.03	3.73
35	600016	民生银行	24,531,792.60	3.67
36	601012	隆基绿能	23,419,747.40	3.50
37	601601	中国太保	22,796,418.00	3.41
38	600741	华域汽车	22,491,251.00	3.36
39	601997	贵阳银行	22,450,178.00	3.36
40	300059	东方财富	22,135,049.98	3.31
41	600050	中国联通	22,135,045.00	3.31
42	603259	药明康德	21,760,894.40	3.25
43	600919	江苏银行	21,682,773.62	3.24
44	300308	中际旭创	20,228,864.80	3.02
45	601077	渝农商行	20,213,173.00	3.02

46	600809	山西汾酒	19,967,974.62	2.98
47	600737	中粮糖业	19,962,683.00	2.98
48	601816	京沪高铁	19,645,819.00	2.94
49	002475	立讯精密	19,515,077.19	2.92
50	601577	长沙银行	19,489,733.00	2.91
51	002600	领益智造	19,261,905.00	2.88
52	600998	九州通	19,133,541.74	2.86
53	002459	晶澳科技	18,918,935.20	2.83
54	300124	汇川技术	18,880,629.50	2.82
55	300390	天华新能	18,717,248.60	2.80
56	600150	中国船舶	18,709,394.00	2.80
57	601186	中国铁建	18,706,691.00	2.80
58	601390	中国中铁	18,698,918.00	2.79
59	603323	苏农银行	18,408,822.10	2.75
60	002714	牧原股份	18,246,705.00	2.73
61	002648	卫星化学	18,146,578.60	2.71
62	601600	中国铝业	17,878,675.00	2.67
63	601988	中国银行	17,825,120.00	2.66
64	300532	今天国际	17,746,511.80	2.65
65	600153	建发股份	17,455,713.00	2.61
66	000002	万科 A	16,741,994.00	2.50
67	600309	万华化学	16,610,648.50	2.48
68	000725	京东方 A	16,102,568.75	2.41
69	688599	天合光能	15,887,130.95	2.37
70	600096	云天化	15,675,286.00	2.34
71	603993	洛阳钼业	15,659,568.29	2.34
72	600938	中国海油	15,601,977.00	2.33
73	002371	北方华创	15,580,316.00	2.33
74	601225	陕西煤业	15,520,559.48	2.32
75	603501	韦尔股份	15,421,643.05	2.30
76	603198	迎驾贡酒	15,218,894.00	2.27
77	002236	大华股份	15,153,796.00	2.26
78	600000	浦发银行	15,032,277.87	2.25
79	600582	天地科技	15,001,927.00	2.24
80	000521	长虹美菱	14,989,739.76	2.24
81	600926	杭州银行	14,933,619.00	2.23
82	300828	锐新科技	14,882,464.00	2.22
83	600941	中国移动	14,598,770.00	2.18
84	601211	国泰君安	14,198,672.49	2.12
85	601888	中国中免	13,708,932.00	2.05
86	600030	中信证券	13,439,414.55	2.01

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	5,774,929,927.69
卖出股票的收入（成交）总额	5,740,040,321.66

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,090,952.06	0.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,090,952.06	0.75

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019727	23 国债 24	50,000	5,090,952.06	0.75

#### 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。中国工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内蒙古自治区分行、国家外汇管理局菏泽市分局、国家金融监督管理总局上海证监局的处罚。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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,049,225.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,049,225.82

#### 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
博时量化多策略股票 A	2,591	201,224.00	501,428,899.55	96.17%	19,942,486.65	3.83%
博时量化多策略股票 C	918	75,738.84	62,710,086.17	90.19%	6,818,165.54	9.81%
合计	3,447	171,424.32	564,138,985.72	95.47%	26,760,652.19	4.53%

### 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	博时量化多策略股票 A	394,890.88	0.08%
	博时量化多策略股票 C	151.41	0.00%
	合计	395,042.29	0.07%

### 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	博时量化多策略股票 A	-
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	10~50
	博时量化多策略股票 C	-



	合计	10~50
--	----	-------

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	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 3 日）基金份额总额	146,135,440.46	765,094,981.90
本报告期期初基金份额总额	504,330,069.27	63,154,117.47
本报告期基金总申购份额	113,583,389.18	32,910,946.21
减：本报告期基金总赎回份额	96,542,072.25	26,536,811.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	521,371,386.20	69,528,251.71

## § 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，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	305,120,147.81	2.65%	227,588.37	2.53%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	2,383,744,943.83	20.70%	1,778,034.79	19.78%	-
中金公司	2	1,469,188,546.64	12.76%	1,095,879.63	12.19%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	9	7,356,014,312.29	63.89%	5,885,766.59	65.49%	增加3个

注：本基金于 2024 年 2 月由托管结算模式切换为券商结算模式。

#### 一、切换前：

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》（证监基金字[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服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

## 2、基金专用交易席位的选择程序如下

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

## 二、切换后：

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。
- 2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下估值的时效性要求。

### 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	5,018,750.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	博时量化多策略股票型证券投资基金(博时量化多策略股票 A) 基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
2	博时量化多策略股票型证券投资基金(博时量化多策略股票 C) 基金产品资料概要更新	上海证券报、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高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-25
4	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
5	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
6	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
7	博时量化多策略股票型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-22
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-13
9	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-29
10	博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-01
11	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-01
12	博时基金管理有限公司关于博时量化多策略股票型证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-01
13	博时基金管理有限公司关于博时量化多策略股票型证券投资基金证券交易结算模式转换有关事项的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-02-27
14	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

---

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化多策略股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化多策略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、博时量化多策略股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时量化多策略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）

二〇二四年八月三十日