

博时智选量化多因子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：浙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。

基金托管人浙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

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53

7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时智选量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	博时智选量化多因子股票	
基金主代码	013465	
交易代码	013465	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 2 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	278,434,653.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
下属分级基金的交易代码	013465	013466
报告期末下属分级基金的份额总额	49,368,940.54 份	229,065,713.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金。投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，大类资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。其次，股票投资策略以“量化投资”为主要投资策略，通过多因子模型进行股票选择并构建股票投资组合。其他资产投资策略包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、流通受限证券投资策略、参与融资业务的投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*90%+中债综合财富（总值）指数收益率*5%+活期存款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	朱巍
	联系电话	0755-83169999	0571-87659806
	电子邮箱	service@bosera.com	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		95105568	95527

传真	0755-83195140	0571-88268688
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	杭州市萧山区鸿宁路 1788 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	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码	518040	310006
法定代表人	江向阳	陆建强

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	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）	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
本期已实现收益	-670,111.67	-4,192,407.00
本期利润	-414,078.93	-2,683,239.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0082	-0.0108
本期加权平均净值利润率	-0.98%	-1.30%
本期基金份额净值增长率	-0.83%	-1.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
期末可供分配利润	-7,971,276.52	-39,523,658.09
期末可供分配基金份额利润	-0.1615	-0.1725
期末基金资产净值	41,397,664.02	189,542,054.98
期末基金份额净值	0.8385	0.8275
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
基金份额累计净值增长率	-16.15%	-17.25%

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

博时智选量化多因子股票 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	-3.76%	1.14%	-7.69%	1.29%	3.93%	-0.15%
过去三个月	-1.64%	1.26%	-8.93%	1.34%	7.29%	-0.08%
过去六个月	-0.83%	1.49%	-14.95%	1.77%	14.12%	-0.28%
过去一年	-12.16%	1.15%	-23.15%	1.39%	10.99%	-0.24%
自基金合同生效起至今	-16.15%	1.21%	-30.61%	1.29%	14.46%	-0.08%

博时智选量化多因子股票 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	-3.80%	1.14%	-7.69%	1.29%	3.89%	-0.15%
过去三个月	-1.75%	1.26%	-8.93%	1.34%	7.18%	-0.08%
过去六个月	-1.06%	1.50%	-14.95%	1.77%	13.89%	-0.27%
过去一年	-12.59%	1.15%	-23.15%	1.39%	10.56%	-0.24%
自基金合同生效起至今	-17.25%	1.21%	-30.61%	1.29%	13.36%	-0.08%

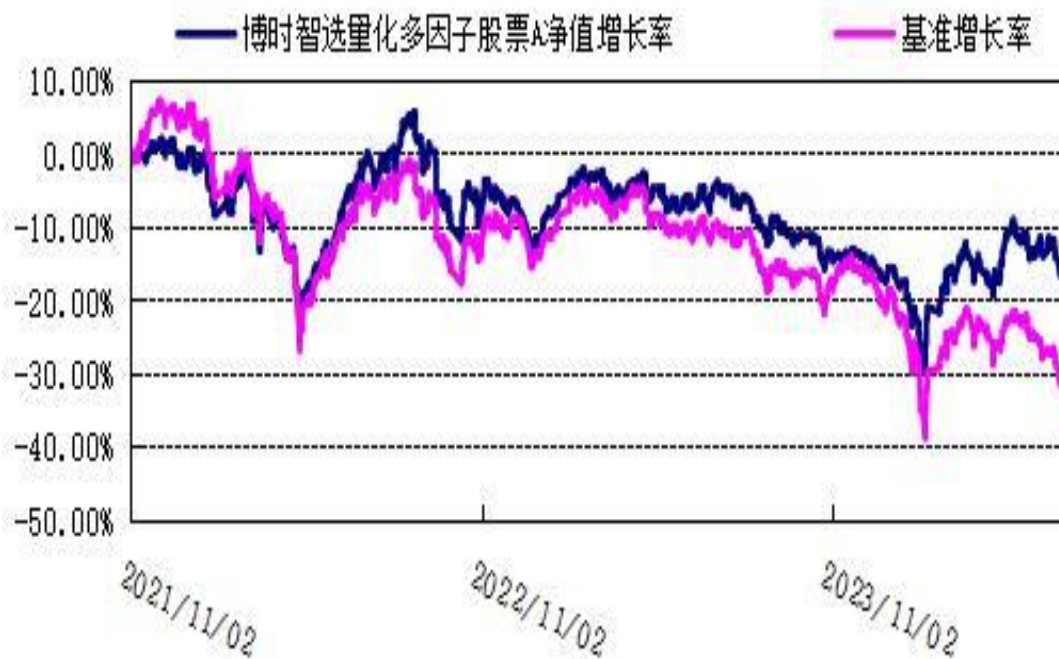
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

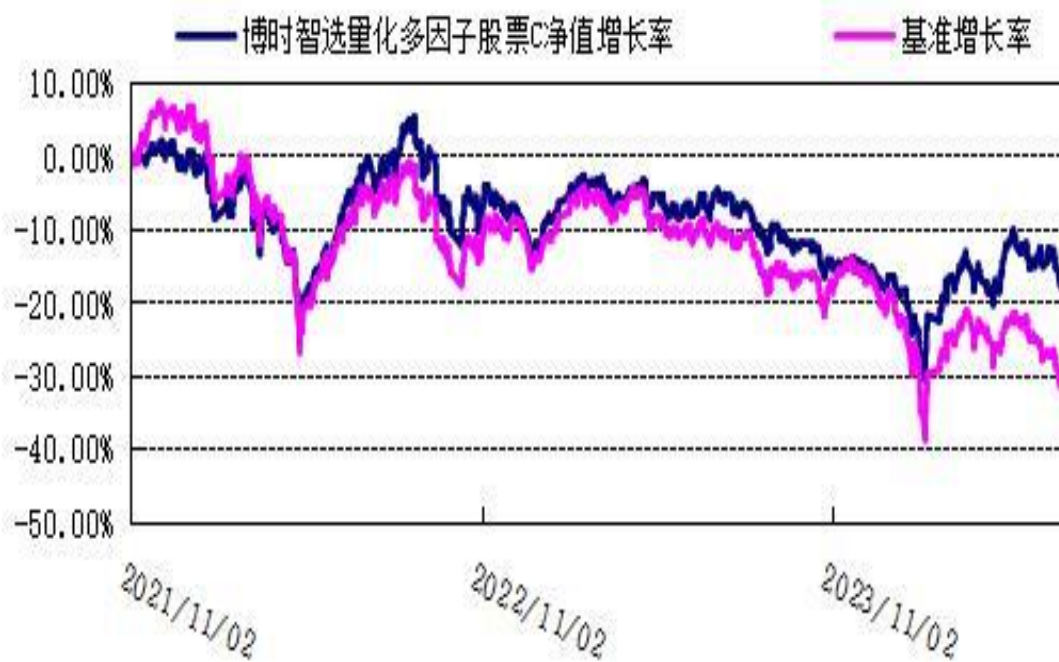
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 11 月 2 日至 2024 年 6 月 30 日)

博时智选量化多因子股票 A



博时智选量化多因子股票 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		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2021-11-02	-	17.8	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日一至今)、博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日一至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日一至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日一至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日一至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日一至今)的基金经理。

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

2024 年上半年，A 股市场首先迎来了一波流动性冲击，随后在宏观调控和基本面修复的背景下强势反弹，但好景不长，进入到二季度后，市场冲高回落。整个上半年，本基金业绩基准中权益部分——中证 1000 指数最终下跌 16.84%。

回顾上半年，A 股市场博弈程度增强，选股难度加大。中信一级行业中 8 个行业上涨，22 个行业下跌，行业涨跌幅中位数约为-11%。如何在纷繁复杂的市场变化情况下，既跑赢业绩基准、又领先于基金同行，成为本基金首要考虑的问题。在此目标约束下，本基金的投资选择小心谨慎。春节前，我们适当降低了整体风险预算，特别是限制了小市值风险的暴露；春节后，又适当调高了风险预算，有限的把握了一波市场风格转换的机会；二季度中后期，我们再度降低风险敞口，在一定程度上减少了净值的回撤。年初的时候，我们分析了市场后认为，2024 年量化基金最大的风险可能是“量化无法跑赢主动基金”的风险，因此，我们在平衡配置各量化策略的基础上，突出了主观能动性，根据量化因子的选股逻辑，结合政策指引和演绎推理，强化了个别股票的配置权重，取得了一

定的效果。

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 0.8385 元，份额累计净值为 0.8385 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.8275 元，份额累计净值为 0.8275 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-0.83%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-1.06%，同期业绩基准增长率为-14.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，A 股市场仍不失机会。宏观层面，虽然 GDP、PMI 等经济数据不尽如人意，但随着美联储降息预期的增强，央行货币政策调整的空间已经具备。二十大三中全会公告也为新的经济增长点提供了坚实的政策保障和制度支持，为长期的资产配置指明了方向。微观层面，结构性增长的行业和个股仍广泛存在。在已经披露了上半年业绩预告的公司中，有 600 余家公司预喜，主要集中在电子、通信、汽车、化工、有色等行业，其中元器件、存储、AI 下游、消费电子等细分行业格外亮眼，部分食品饮料、航空空运板块也有转暖趋势。当然，部分行业如房地产、光伏等业绩仍然不佳，表明市场将继续呈现出分化的走势。除此之外，我们也看到外部环境还存在诸多的不确定性，俄乌冲突和巴以危机没有平息，全球产业链脱钩的风险也并没有减少，证券市场的结构化行情还将持续。

在上述背景下，本基金的投资操作继续保持谨慎。我们认为，市场上稀缺的不是“低估值”，而是“稳定的增长”。那些主营业务收入和利润维持稳定而坚实增长的企业，必将受到资金的青睐。同时，量化基金的方法论会继续面临主动选股方法论的挑战。我们也会延续之前的策略，在平衡配置量化策略的基础上，强化主观能动性，调整个别股票的配置权重。总之，本基金将在控制风险的前提下，采用量化与主观相结合的科学分析方法，争取持续跑赢业绩基准，并领先于基金同行。

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

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

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

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时智选量化多因子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	4,723,046.45	10,583,896.53
结算备付金		10,277,166.80	6,226,140.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.3.2	205,466,436.61	248,981,034.67
其中：股票投资		199,691,595.43	243,311,981.30
基金投资		-	-
债券投资		5,774,841.18	5,669,053.37
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	11,325,000.00	-
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		57,477.80	274,060.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		231,849,127.66	266,065,132.39
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		-	-
应付赎回款		413,709.37	820,533.58
应付管理人报酬		240,114.07	272,083.89
应付托管费		40,019.01	45,347.30

应付销售服务费		82,507.85	94,711.46
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	133,058.36	160,000.97
负债合计		909,408.66	1,392,677.20
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	278,434,653.61	315,870,940.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	-47,494,934.61	-51,198,485.38
净资产合计		230,939,719.00	264,672,455.19
负债和净资产总计		231,849,127.66	266,065,132.39

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 278,434,653.61 份。其中 A 类基金份额净值 0.8385 元，基金份额总额 49,368,940.54 份；C 类基金份额净值 0.8275 元，基金份额总额 229,065,713.07 份。

6.2 利润表

会计主体：博时智选量化多因子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	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
一、营业总收入		-778,279.50	24,918,988.24
1. 利息收入		18,373.69	60,140.90
其中：存款利息收入	6.4.3.10	18,373.69	57,576.52
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		-	2,564.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,711,529.57	13,133,687.77
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-4,829,570.33	9,664,730.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	58,135.97	-
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	-	-8,039.78
股利收益	6.4.3.15	2,059,904.79	3,476,997.18
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	1,765,200.22	11,427,054.12
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	149,676.16	298,105.45
减：二、营业总支出		2,319,038.95	3,683,104.84
1. 管理人报酬		1,480,580.78	2,454,537.93
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		246,763.52	490,907.55
3. 销售服务费		512,131.53	658,105.57
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		-	10.63
8. 其他费用	6.4.3.19	79,563.12	79,543.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,097,318.45	21,235,883.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,097,318.45	21,235,883.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,097,318.45	21,235,883.40

6.3 净资产变动表

会计主体：博时智选量化多因子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	315,870,940.57	-	-51,198,485.38	264,672,455.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	315,870,940.57	-	-51,198,485.38	264,672,455.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-37,436,286.96	-	3,703,550.77	-33,732,736.19

(一)、综合收益总额	-	-	-3,097,318.45	-3,097,318.45
(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)	-37,436,286.96	-	6,800,869.22	-30,635,417.74
其中: 1. 基金申购款	57,592,744.85	-	-10,204,905.75	47,387,839.10
2. 基金赎回款	-95,029,031.81	-	17,005,774.97	-78,023,256.84
(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	278,434,653.61	-	-47,494,934.61	230,939,719.00
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	332,278,363.14	-	-39,434,698.11	292,843,665.03
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	332,278,363.14	-	-39,434,698.11	292,843,665.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	20,424,406.97	-	21,128,179.31	41,552,586.28
(一)、综合收益总额	-	-	21,235,883.40	21,235,883.40
(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)	20,424,406.97	-	-107,704.09	20,316,702.88
其中: 1. 基金申购款	244,822,110.78	-	-14,393,118.84	230,428,991.94

2. 基金赎回款	-224,397,703.81	-	14,285,414.75	-210,112,289.06
(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	352,702,770.11	-	-18,306,518.80	334,396,251.31

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。

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	4,723,046.45
等于：本金	4,722,724.64
加：应计利息	321.81
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	4,723,046.45

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	202,264,453.95	-	199,691,595.43	-2,572,858.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	5,694,726.00	67,611.18	5,774,841.18	12,504.00
交易所				

	场				
	银行 间市 场	-	-	-	-
	合计	5,694,726.00	67,611.18	5,774,841.18	12,504.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		207,959,179.95	67,611.18	205,466,436.61	-2,560,354.52

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,325,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	11,325,000.00	-

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	0.24
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	13,495.00
预提费用	119,563.12
合计	133,058.36

6.4.3.8 实收基金

博时智选量化多因子股票 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	51,578,960.98	51,578,960.98
本期申购	1,909,572.45	1,909,572.45
本期赎回（以“-”号填列）	-4,119,592.89	-4,119,592.89
本期末	49,368,940.54	49,368,940.54

博时智选量化多因子股票 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	264,291,979.59	264,291,979.59
本期申购	55,683,172.40	55,683,172.40
本期赎回（以“-”号填列）	-90,909,438.92	-90,909,438.92
本期末	229,065,713.07	229,065,713.07

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

博时智选量化多因子股票 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	-7,405,601.50	-561,270.01	-7,966,871.51
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	-7,405,601.50	-561,270.01	-7,966,871.51
本期利润	-670,111.67	256,032.74	-414,078.93
本期基金份额交易产生的变	348,448.67	61,225.25	409,673.92

动数			
其中：基金申购款	-313,248.61	26,571.80	-286,676.81
基金赎回款	661,697.28	34,653.45	696,350.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,727,264.50	-244,012.02	-7,971,276.52

博时智选量化多因子股票 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	-40,360,935.91	-2,870,677.96	-43,231,613.87
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	-40,360,935.91	-2,870,677.96	-43,231,613.87
本期利润	-4,192,407.00	1,509,167.48	-2,683,239.52
本期基金份额交易产生的变动数	6,169,490.22	221,705.08	6,391,195.30
其中：基金申购款	-9,604,555.49	-313,673.45	-9,918,228.94
基金赎回款	15,774,045.71	535,378.53	16,309,424.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,383,852.69	-1,139,805.40	-39,523,658.09

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	6,335.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,037.82
其他	-
合计	18,373.69

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	752,394,295.43
减：卖出股票成本总额	755,701,537.76
减：交易费用	1,522,328.00
买卖股票差价收入	-4,829,570.33

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	56,964.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,171.04
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	58,135.97

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	6,938,280.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,798,822.00
减：应计利息总额	138,280.00
减：交易费用	6.96
买卖债券差价收入	1,171.04

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

无发生额。

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	2,059,904.79
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	2,059,904.79

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	1,765,200.22
——股票投资	1,761,023.22
——债券投资	4,177.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,765,200.22

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	149,307.37
基金转换费收入	368.79
合计	149,676.16

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	-
合计	79,563.12

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
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	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

无。

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	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管理费	1,480,580.78	2,454,537.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	301,164.81	500,442.77
应支付基金管理人的净管理费	1,179,415.97	1,954,095.16

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 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	246,763.52	490,907.55

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 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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		
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	合计
浙商银行	-	22,898.92	22,898.92
博时基金	-	16,907.03	16,907.03
合计	-	39,805.95	39,805.95
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		
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	合计
博时基金	-	39,692.63	39,692.63
浙商银行	-	28,538.68	28,538.68
合计	-	68,231.31	68,231.31

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 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.50% / 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

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
浙商银行-活期存款	4,723,046.45	6,335.87	13,067,522.37	22,026.27

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	802.00	69,741.92
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	4,179.00	105,519.75

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	70.59	188.01	462.00	32,610.73	86,860.62	-
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	1,023.00	19,078.95	19,078.95	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	首次公开发行限售	86.96	174.93	81.00	7,043.76	14,169.33	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	首次公开发行限售	40.09	91.24	149.00	5,972.74	13,594.76	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	首次公开发行限售	16.16	32.27	401.00	6,480.16	12,940.27	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	首次公开发行限售	19.86	42.51	244.00	4,845.84	10,372.44	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	首次公开发行限售	11.88	18.98	516.00	6,130.08	9,793.68	-
301566	达	2023-12-22	6 个	首次	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-

	利凯普		月	公开发 行限售						
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	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	首次公开发 行限售	44.95	65.93	138.00	6,203.10	9,098.34	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	首次公开发 行限售	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	首次公开发 行限售	15.69	18.79	411.00	6,448.59	7,722.69	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	首次公开发 行限售	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	首次公开发 行限售	21.73	25.26	282.00	6,127.86	7,123.32	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	首次公开发 行限售	17.43	34.56	200.00	3,486.00	6,912.00	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	首次公开发 行限售	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	首次公开发 行限售	22.66	15.89	355.00	8,044.30	5,640.95	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	首次公开发 行限售	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
301588	美	2024-03-06	6个	首次	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-

	新科技		月	公开发 行限售						
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	首次公开发 行限售	16.20	15.96	334.00	5,410.80	5,330.64	-
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	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	首次公开发 行限售	26.00	37.49	109.00	2,834.00	4,086.41	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	首次公开发 行限售	17.39	20.60	170.00	2,956.30	3,502.00	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	首次公开发 行限售	19.18	22.66	146.00	2,800.28	3,308.36	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	首次公开发 行限售	21.28	29.49	107.00	2,276.96	3,155.43	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	首次公开发 行限售	11.82	15.25	173.00	2,045.54	2,638.25	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	首次公开发 行限售	38.18	38.90	65.00	2,481.70	2,528.50	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	首次公开发 行限售	72.46	68.06	36.00	2,608.56	2,450.16	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	首次公开发 行限售	23.35	25.13	95.00	2,218.25	2,387.35	-
001379	腾	2024-01-11	6个月	首次	16.98	13.48	175.00	2,971.50	2,359.00	-

	达科技		月	公开发 行限售						
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	首次公开发 行限售	29.02	25.36	89.00	2,582.78	2,257.04	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	首次公开发 行限售	20.56	20.56	106.00	2,179.36	2,179.36	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	首次公开发 行限售	18.65	18.65	114.00	2,126.10	2,126.10	-

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

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币

市场基金。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。

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	5,774,841.18	5,669,053.37
合计	5,774,841.18	5,669,053.37

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	4,723,046.45	-	-	-	4,723,046.45
结算备付金	10,277,166.80	-	-	-	10,277,166.80
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	5,774,841.18	-	-	199,691,595.43	205,466,436.61
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	11,325,000.00	-	-	-	11,325,000.00
应收申购款	-	-	-	57,477.80	57,477.80
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,100,054.43	-	-	-199,749,073.23	231,849,127.66
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	413,709.37	413,709.37
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	240,114.07	240,114.07
应付托管费	-	-	-	40,019.01	40,019.01
应付销售服务费	-	-	-	82,507.85	82,507.85
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	133,058.36	133,058.36
负债总计	-	-	-	909,408.66	909,408.66
利率敏感度缺口	32,100,054.43	-	-	-198,839,664.57	230,939,719.00
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	10,583,896.53	-	-	-	10,583,896.53
结算备付金	6,226,140.27	-	-	-	6,226,140.27
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	5,669,053.37	-	-	243,311,981.30	248,981,034.67
应收清算款	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-
应收申购款	-	-	274,060.92	274,060.92
应收股利	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	22,479,090.17	-	-243,586,042.22	266,065,132.39
负债				
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	820,533.58	820,533.58
应付清算款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	272,083.89	272,083.89
应付托管费	-	-	45,347.30	45,347.30
应付销售服务费	-	-	94,711.46	94,711.46
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	160,000.97	160,000.97
负债总计	-	-	1,392,677.20	1,392,677.20
利率敏感度缺口	22,479,090.17	-	-242,193,365.02	264,672,455.19

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

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	199,691,595.43	86.47	243,311,981.30	91.93
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	199,691,595.43	86.47	243,311,981.30	91.93

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891	增加约891
	业绩比较基准下降5%	减少约891	减少约891

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	199,374,309.89
第二层次	5,817,654.79
第三层次	274,471.93
合计	205,466,436.61

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	199,691,595.43	86.13
	其中:股票	199,691,595.43	86.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,774,841.18	2.49
	其中:债券	5,774,841.18	2.49
	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	11,325,000.00	4.88
	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	15,000,213.25	6.47
8	其他各项资产	57,477.80	0.02
9	合计	231,849,127.66	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	12,276.00	0.01
B	采矿业	1,442,783.00	0.62
C	制造业	157,334,511.39	68.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,914,346.00	0.83
E	建筑业	907,552.00	0.39
F	批发和零售业	3,150,622.16	1.36
G	交通运输、仓储和邮政业	10,037,724.53	4.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,396,096.27	7.10
J	金融业	232,222.00	0.10
K	房地产业	124,048.00	0.05
L	租赁和商务服务业	5,898,337.00	2.55
M	科学研究和技术服务业	444,700.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,709,729.08	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	86,648.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	199,691,595.43	86.47

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	605499	东鹏饮料	94,700	20,431,525.00	8.85
2	688279	峰昭科技	96,848	10,740,443.20	4.65
3	601021	春秋航空	164,341	9,257,328.53	4.01
4	601689	拓普集团	136,508	7,318,193.88	3.17

5	002027	分众传媒	968,300	5,867,898.00	2.54
6	603997	继峰股份	466,200	4,769,226.00	2.07
7	300428	立中集团	194,300	3,612,037.00	1.56
8	300679	电连技术	75,800	3,049,434.00	1.32
9	300708	聚灿光电	324,800	2,923,200.00	1.27
10	002340	格林美	458,500	2,920,645.00	1.26
11	300857	协创数据	48,800	2,781,600.00	1.20
12	605333	沪光股份	90,400	2,517,640.00	1.09
13	601500	通用股份	445,000	2,376,300.00	1.03
14	601058	赛轮轮胎	161,200	2,256,800.00	0.98
15	603239	浙江仙通	163,600	2,242,956.00	0.97
16	603728	鸣志电器	50,000	2,011,500.00	0.87
17	300115	长盈精密	156,600	1,877,634.00	0.81
18	300870	欧陆通	42,900	1,861,002.00	0.81
19	300441	鲍斯股份	302,400	1,793,232.00	0.78
20	300100	双林股份	163,400	1,759,818.00	0.76
21	002897	意华股份	46,600	1,754,956.00	0.76
22	688510	航亚科技	95,183	1,752,319.03	0.76
23	601127	赛力斯	19,200	1,749,504.00	0.76
24	601717	郑煤机	117,100	1,733,080.00	0.75
25	002322	理工能科	106,700	1,709,334.00	0.74
26	002273	水晶光电	99,100	1,682,718.00	0.73
27	600160	巨化股份	69,600	1,679,448.00	0.73
28	600066	宇通客车	64,700	1,669,260.00	0.72
29	603699	纽威股份	97,400	1,667,488.00	0.72
30	300926	博俊科技	83,289	1,667,445.78	0.72
31	688150	莱特光电	85,900	1,666,460.00	0.72
32	002073	软控股份	224,700	1,660,533.00	0.72
33	605111	新洁能	54,240	1,659,201.60	0.72
34	300433	蓝思科技	90,900	1,658,925.00	0.72
35	603158	腾龙股份	235,400	1,657,216.00	0.72
36	688766	普冉股份	17,040	1,655,776.80	0.72
37	688138	清溢光电	77,000	1,655,500.00	0.72
38	688146	中船特气	55,405	1,653,839.25	0.72
39	688535	华海诚科	24,050	1,647,906.00	0.71
40	603348	文灿股份	59,500	1,647,555.00	0.71
41	000913	钱江摩托	104,400	1,645,344.00	0.71
42	301160	翔楼新材	44,100	1,642,725.00	0.71
43	603507	振江股份	50,043	1,642,411.26	0.71
44	688352	颀中科技	143,500	1,637,335.00	0.71
45	603296	华勤技术	29,600	1,634,808.00	0.71
46	688092	爱科科技	76,288	1,628,748.80	0.71
47	688234	天岳先进	34,700	1,628,124.00	0.70

48	000550	江铃汽车	74,900	1,626,079.00	0.70
49	688480	赛恩斯	58,104	1,618,777.44	0.70
50	688408	中信博	17,533	1,614,438.64	0.70
51	002315	焦点科技	59,700	1,609,512.00	0.70
52	688019	安集科技	12,750	1,603,950.00	0.69
53	688596	正帆科技	48,600	1,603,800.00	0.69
54	603605	珀莱雅	14,400	1,598,256.00	0.69
55	603228	景旺电子	44,200	1,405,560.00	0.61
56	600711	盛屯矿业	358,500	1,315,695.00	0.57
57	000544	中原环保	166,100	1,307,207.00	0.57
58	300783	三只松鼠	59,600	1,303,452.00	0.56
59	001206	依依股份	98,100	1,277,262.00	0.55
60	688123	聚辰股份	20,880	1,270,130.40	0.55
61	300872	天阳科技	95,700	1,268,025.00	0.55
62	002215	诺普信	169,600	1,263,520.00	0.55
63	002752	昇兴股份	237,300	1,200,738.00	0.52
64	300005	探路者	234,300	1,173,843.00	0.51
65	603368	柳药集团	65,100	1,139,250.00	0.49
66	000990	诚志股份	149,200	1,110,048.00	0.48
67	002083	孚日股份	252,100	1,066,383.00	0.46
68	002534	西子洁能	102,300	1,024,023.00	0.44
69	603408	建霖家居	74,800	986,612.00	0.43
70	601633	长城汽车	34,100	862,730.00	0.37
71	301308	江波龙	9,100	862,134.00	0.37
72	600183	生益科技	39,300	827,658.00	0.36
73	001309	德明利	9,510	821,664.00	0.36
74	002140	东华科技	101,000	782,750.00	0.34
75	002532	天山铝业	91,300	740,443.00	0.32
76	300396	迪瑞医疗	34,800	706,788.00	0.31
77	300181	佐力药业	45,400	686,448.00	0.30
78	603786	科博达	10,700	686,405.00	0.30
79	300680	隆盛科技	34,400	656,008.00	0.28
80	002008	大族激光	31,400	653,120.00	0.28
81	688017	绿的谐波	7,947	652,448.70	0.28
82	603535	嘉诚国际	40,100	647,214.00	0.28
83	300351	永贵电器	43,300	640,840.00	0.28
84	002997	瑞鹤模具	19,800	633,006.00	0.27
85	300893	松原股份	21,700	619,969.00	0.27
86	002011	盾安环境	62,600	615,358.00	0.27
87	002284	亚太股份	90,500	611,780.00	0.26
88	603596	伯特利	15,700	610,730.00	0.26
89	002920	德赛西威	6,900	600,921.00	0.26
90	002130	沃尔核材	38,800	547,856.00	0.24

91	000519	中兵红箭	36,800	539,856.00	0.23
92	002979	雷赛智能	29,400	535,080.00	0.23
93	300304	云意电气	80,400	523,404.00	0.23
94	300446	航天智造	43,900	522,410.00	0.23
95	603698	航天工程	43,400	519,498.00	0.22
96	003019	宸展光电	20,365	515,845.45	0.22
97	000949	新乡化纤	151,200	514,080.00	0.22
98	301150	中一科技	28,240	507,472.80	0.22
99	688690	纳微科技	29,179	506,839.23	0.22
100	603201	常润股份	20,500	496,100.00	0.21
101	002557	洽洽食品	16,900	476,411.00	0.21
102	301015	百洋医药	18,600	437,658.00	0.19
103	300492	华图山鼎	4,500	423,900.00	0.18
104	301033	迈普医学	10,800	422,388.00	0.18
105	600642	申能股份	43,100	380,573.00	0.16
106	300673	佩蒂股份	27,400	359,488.00	0.16
107	601865	福莱特	17,400	349,740.00	0.15
108	002984	森麒麟	13,400	322,806.00	0.14
109	300002	神州泰岳	37,100	301,252.00	0.13
110	300049	福瑞股份	5,400	271,836.00	0.12
111	300453	三鑫医疗	42,400	270,936.00	0.12
112	603160	汇顶科技	3,700	254,375.00	0.11
113	600285	羚锐制药	10,100	244,521.00	0.11
114	300502	新易盛	2,200	232,210.00	0.10
115	603039	泛微网络	6,500	206,440.00	0.09
116	605277	新亚电子	14,100	182,172.00	0.08
117	603733	仙鹤股份	9,900	174,042.00	0.08
118	002463	沪电股份	4,657	169,980.50	0.07
119	003000	劲仔食品	10,700	128,935.00	0.06
120	600872	中炬高新	5,200	117,988.00	0.05
121	300113	顺网科技	10,100	103,424.00	0.04
122	002139	拓邦股份	9,600	101,952.00	0.04
123	002035	华帝股份	15,800	98,434.00	0.04
124	300755	华致酒行	6,900	94,254.00	0.04
125	301589	诺瓦星云	462	86,860.62	0.04
126	300969	恒帅股份	1,200	82,956.00	0.04
127	300207	欣旺达	4,100	62,197.00	0.03
128	002558	巨人网络	6,300	59,472.00	0.03
129	002782	可立克	5,300	58,724.00	0.03
130	002020	京新药业	5,300	55,491.00	0.02
131	000887	中鼎股份	4,400	53,856.00	0.02
132	603197	保隆科技	1,700	53,550.00	0.02
133	300303	聚飞光电	9,100	44,226.00	0.02

134	002249	大洋电机	9,200	43,516.00	0.02
135	600623	华谊集团	7,300	42,194.00	0.02
136	300463	迈克生物	3,700	42,106.00	0.02
137	600874	创业环保	7,500	41,925.00	0.02
138	600299	安迪苏	4,200	40,740.00	0.02
139	300307	慈星股份	6,800	40,460.00	0.02
140	000926	福星股份	12,500	39,625.00	0.02
141	000758	中色股份	7,800	39,624.00	0.02
142	600776	东方通信	4,000	39,320.00	0.02
143	600315	上海家化	2,200	39,116.00	0.02
144	300403	汉宇集团	5,700	38,931.00	0.02
145	603809	豪能股份	4,800	38,784.00	0.02
146	603051	鹿山新材	1,700	37,111.00	0.02
147	301260	格力博	2,700	36,774.00	0.02
148	300976	达瑞电子	800	36,680.00	0.02
149	300296	利亚德	8,100	36,450.00	0.02
150	300383	光环新网	4,300	36,335.00	0.02
151	300529	健帆生物	1,300	35,373.00	0.02
152	001338	永顺泰	3,600	35,280.00	0.02
153	002563	森马服饰	5,800	33,698.00	0.01
154	688029	南微医学	539	33,180.84	0.01
155	600707	彩虹股份	4,800	32,688.00	0.01
156	300638	广和通	1,900	32,490.00	0.01
157	300070	碧水源	7,600	31,844.00	0.01
158	300054	鼎龙股份	1,400	31,752.00	0.01
159	002266	浙富控股	11,300	31,527.00	0.01
160	600699	均胜电子	2,100	31,122.00	0.01
161	603220	中贝通信	1,100	29,876.00	0.01
162	002296	辉煌科技	2,500	25,775.00	0.01
163	688516	奥特维	600	25,086.00	0.01
164	600839	四川长虹	5,500	24,695.00	0.01
165	600038	中直股份	600	24,666.00	0.01
166	000883	湖北能源	4,100	24,641.00	0.01
167	300241	瑞丰光电	6,000	24,600.00	0.01
168	601609	金田股份	4,300	24,338.00	0.01
169	601616	广电电气	8,300	24,153.00	0.01
170	601700	风范股份	5,500	24,145.00	0.01
171	002876	三利谱	1,000	24,120.00	0.01
172	003023	彩虹集团	1,500	23,925.00	0.01
173	601198	东兴证券	3,000	23,880.00	0.01
174	600521	华海药业	1,400	23,870.00	0.01
175	001213	中铁特货	6,000	23,700.00	0.01
176	002036	联创电子	3,500	23,625.00	0.01

176	002392	北京利尔	7,500	23,625.00	0.01
177	600320	振华重工	6,900	23,598.00	0.01
178	600177	雅戈尔	3,300	23,496.00	0.01
179	600688	上海石化	9,000	23,490.00	0.01
180	002228	合兴包装	10,000	23,400.00	0.01
181	301007	德迈仕	2,000	23,360.00	0.01
182	300120	经纬辉开	4,500	23,355.00	0.01
183	688281	华秦科技	280	23,329.60	0.01
184	000060	中金岭南	5,500	23,320.00	0.01
185	000797	中国武夷	10,000	23,300.00	0.01
186	000050	深天马 A	3,200	23,296.00	0.01
187	601311	骆驼股份	2,900	23,258.00	0.01
188	600512	腾达建设	12,300	23,247.00	0.01
189	002753	永东股份	4,000	23,240.00	0.01
190	600308	华泰股份	7,400	23,236.00	0.01
191	603321	梅轮电梯	3,400	23,222.00	0.01
192	600586	金晶科技	4,000	23,200.00	0.01
193	300111	向日葵	12,400	23,188.00	0.01
194	000897	津滨发展	11,300	23,165.00	0.01
195	600909	华安证券	5,500	23,155.00	0.01
196	301011	华立科技	1,500	23,115.00	0.01
197	002387	维信诺	3,800	23,104.00	0.01
198	002161	远望谷	5,000	23,100.00	0.01
199	300247	融捷健康	9,500	23,085.00	0.01
200	600399	抚顺特钢	4,100	23,083.00	0.01
201	002686	亿利达	5,500	23,045.00	0.01
202	600152	维科技术	4,800	23,040.00	0.01
203	300253	卫宁健康	3,900	23,010.00	0.01
203	603617	君禾股份	3,900	23,010.00	0.01
204	002303	美盈森	9,500	22,895.00	0.01
205	600219	南山铝业	6,000	22,860.00	0.01
206	000639	西王食品	9,600	22,848.00	0.01
206	603817	海峡环保	4,800	22,848.00	0.01
207	002666	德联集团	6,300	22,806.00	0.01
208	002420	毅昌科技	5,000	22,800.00	0.01
208	002662	京威股份	7,500	22,800.00	0.01
208	600300	维维股份	9,500	22,800.00	0.01
209	603328	依顿电子	2,900	22,794.00	0.01
210	002121	科陆电子	6,000	22,740.00	0.01
211	300251	光线传媒	2,700	22,707.00	0.01
212	600865	百大集团	3,500	22,645.00	0.01
213	300204	舒泰神	4,000	22,640.00	0.01
214	000930	中粮科技	4,500	22,635.00	0.01

215	000155	川能动力	2,100	22,617.00	0.01
216	603088	宁波精达	3,000	22,590.00	0.01
217	601636	旗滨集团	3,500	22,575.00	0.01
218	000563	陕国投 A	8,200	22,550.00	0.01
219	300432	富临精工	3,500	22,540.00	0.01
220	601375	中原证券	6,600	22,506.00	0.01
221	000788	北大医药	4,500	22,455.00	0.01
222	002741	光华科技	2,500	22,450.00	0.01
223	300194	福安药业	6,000	22,440.00	0.01
223	603980	吉华集团	6,000	22,440.00	0.01
224	002661	克明食品	3,000	22,410.00	0.01
225	002863	今飞凯达	5,500	22,385.00	0.01
226	600429	三元股份	6,000	22,380.00	0.01
227	002282	博深股份	3,500	22,365.00	0.01
228	002454	松芝股份	4,000	22,360.00	0.01
229	300055	万邦达	5,500	22,275.00	0.01
230	002061	浙江交科	6,100	22,265.00	0.01
231	300664	鹏鹞环保	5,000	22,250.00	0.01
232	002019	亿帆医药	1,800	22,248.00	0.01
233	300840	酷特智能	2,400	22,200.00	0.01
234	002928	华夏航空	3,500	22,190.00	0.01
235	600959	江苏有线	8,400	22,176.00	0.01
236	600339	中油工程	7,100	22,152.00	0.01
237	002065	东华软件	4,900	22,148.00	0.01
238	000030	富奥股份	4,500	22,095.00	0.01
239	002507	涪陵榨菜	1,800	22,050.00	0.01
240	000967	盈峰环境	5,200	21,996.00	0.01
241	000920	沃顿科技	3,000	21,990.00	0.01
242	603385	惠达卫浴	4,000	21,960.00	0.01
243	301028	东亚机械	2,500	21,925.00	0.01
244	000541	佛山照明	4,500	21,915.00	0.01
245	600928	西安银行	6,700	21,909.00	0.01
246	002961	瑞达期货	2,000	21,900.00	0.01
247	002462	嘉事堂	2,000	21,880.00	0.01
248	000551	创元科技	2,500	21,825.00	0.01
249	605208	永茂泰	3,500	21,805.00	0.01
250	002106	莱宝高科	2,000	21,800.00	0.01
251	002165	红宝丽	6,600	21,780.00	0.01
252	688779	长远锂科	4,700	21,761.00	0.01
253	603399	吉翔股份	3,500	21,665.00	0.01
254	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
255	300724	捷佳伟创	400	21,604.00	0.01
256	000153	丰原药业	4,000	21,520.00	0.01

257	300170	汉得信息	3,500	21,490.00	0.01
258	300677	英科医疗	800	21,448.00	0.01
259	600827	百联股份	2,900	21,402.00	0.01
260	002093	国脉科技	3,500	21,245.00	0.01
261	603285	键邦股份	1,137	21,205.05	0.01
262	002283	天润工业	4,900	21,021.00	0.01
263	300566	激智科技	1,500	20,985.00	0.01
264	605166	聚合顺	2,000	20,980.00	0.01
265	000685	中山公用	2,900	20,909.00	0.01
266	300687	赛意信息	1,500	20,880.00	0.01
267	603909	建发合诚	2,500	20,800.00	0.01
268	600517	国网英大	4,800	20,784.00	0.01
269	601952	苏垦农发	2,300	20,746.00	0.01
270	002860	星帅尔	2,500	20,475.00	0.01
271	002646	天佑德酒	2,000	20,460.00	0.01
272	600208	新潮中宝	12,900	20,382.00	0.01
273	002745	木林森	2,500	20,150.00	0.01
274	601222	林洋能源	3,200	20,064.00	0.01
275	603676	卫信康	2,500	20,025.00	0.01
276	603238	诺邦股份	2,000	19,920.00	0.01
277	603727	博迈科	1,500	19,740.00	0.01
278	002204	大连重工	4,600	19,642.00	0.01
279	600409	三友化工	3,900	19,578.00	0.01
280	600710	苏美达	2,400	19,560.00	0.01
281	603915	国茂股份	1,900	19,551.00	0.01
282	002034	旺能环境	1,500	19,515.00	0.01
283	002048	宁波华翔	1,500	19,410.00	0.01
284	300176	派生科技	4,400	19,404.00	0.01
285	002245	蔚蓝锂芯	2,500	19,375.00	0.01
286	002276	万马股份	2,700	19,359.00	0.01
287	000498	山东路桥	3,700	19,351.00	0.01
288	600618	氯碱化工	2,200	19,316.00	0.01
289	002755	奥赛康	2,000	19,300.00	0.01
290	002274	华昌化工	2,600	19,292.00	0.01
291	600787	中储股份	4,000	19,240.00	0.01
292	002706	良信股份	2,800	19,208.00	0.01
293	300772	运达股份	2,000	19,200.00	0.01
294	002390	信邦制药	5,800	19,198.00	0.01
295	600458	时代新材	1,900	19,190.00	0.01
296	002701	奥瑞金	4,600	19,136.00	0.01
297	603681	永冠新材	1,500	19,125.00	0.01
298	600562	国睿科技	1,400	19,124.00	0.01
299	600966	博汇纸业	4,000	19,120.00	0.01

300	600971	恒源煤电	1,600	19,104.00	0.01
301	002545	东方铁塔	2,800	19,068.00	0.01
302	601886	江河集团	3,900	19,032.00	0.01
303	603013	亚普股份	1,400	18,858.00	0.01
304	300674	宇信科技	1,700	18,836.00	0.01
305	688778	厦钨新能	600	18,744.00	0.01
306	600195	中牧股份	2,500	18,725.00	0.01
307	300707	威唐工业	1,500	18,570.00	0.01
308	002461	珠江啤酒	2,500	18,550.00	0.01
309	600261	阳光照明	6,800	18,360.00	0.01
310	002823	凯中精密	1,500	18,300.00	0.01
311	002705	新宝股份	1,300	18,291.00	0.01
312	601163	三角轮胎	1,200	18,264.00	0.01
313	601811	新华文轩	1,300	18,213.00	0.01
314	002053	云南能投	1,500	18,135.00	0.01
315	600850	电科数字	1,000	18,100.00	0.01
316	300173	福能东方	4,800	18,096.00	0.01
317	000725	京东方 A	4,400	17,996.00	0.01
318	603680	今创集团	2,700	17,820.00	0.01
319	603893	瑞芯微	300	17,751.00	0.01
320	300016	北陆药业	4,000	17,640.00	0.01
321	000728	国元证券	2,900	17,574.00	0.01
322	601997	贵阳银行	3,300	17,391.00	0.01
323	603393	新天然气	500	17,370.00	0.01
324	688233	神工股份	900	17,343.00	0.01
325	002773	康弘药业	800	17,320.00	0.01
326	300444	双杰电气	2,700	17,145.00	0.01
327	605189	富春染织	1,600	17,056.00	0.01
328	300694	蠡湖股份	2,000	17,020.00	0.01
329	300900	广联航空	900	16,857.00	0.01
330	000860	顺鑫农业	1,000	16,740.00	0.01
331	002267	陕天然气	2,200	16,632.00	0.01
332	603711	香飘飘	1,200	16,620.00	0.01
333	300397	天和防务	1,800	16,560.00	0.01
334	601019	山东出版	1,400	16,548.00	0.01
335	002455	百川股份	1,800	16,524.00	0.01
336	600262	北方股份	1,000	16,430.00	0.01
337	603693	江苏新能	1,400	16,268.00	0.01
338	603299	苏盐井神	1,700	16,150.00	0.01
339	601566	九牧王	1,900	15,998.00	0.01
340	601000	唐山港	3,400	15,980.00	0.01
341	300381	溢多利	2,600	15,964.00	0.01
342	605365	立达信	1,000	15,870.00	0.01

343	002845	同兴达	1,200	15,864.00	0.01
344	000555	神州信息	1,700	15,844.00	0.01
345	601595	上海电影	800	15,824.00	0.01
345	688425	铁建重工	4,300	15,824.00	0.01
346	603337	杰克股份	600	15,792.00	0.01
347	688533	上声电子	600	15,522.00	0.01
348	300842	帝科股份	400	15,520.00	0.01
349	300660	江苏雷利	600	15,312.00	0.01
350	601298	青岛港	1,600	15,296.00	0.01
351	002975	博杰股份	500	14,940.00	0.01
352	300699	光威复材	600	14,898.00	0.01
353	688484	南芯科技	400	14,840.00	0.01
354	603496	恒为科技	600	14,670.00	0.01
355	600901	江苏金租	2,900	14,645.00	0.01
356	002384	东山精密	700	14,490.00	0.01
357	601231	环旭电子	900	14,445.00	0.01
358	600282	南钢股份	2,900	14,442.00	0.01
359	002970	锐明技术	400	14,412.00	0.01
360	601168	西部矿业	800	14,360.00	0.01
361	000598	兴蓉环境	1,900	14,288.00	0.01
362	301221	光庭信息	400	14,272.00	0.01
363	000932	华菱钢铁	3,200	14,176.00	0.01
364	688692	达梦数据	81	14,169.33	0.01
365	601598	中国外运	2,500	14,075.00	0.01
366	000738	航发控制	700	14,049.00	0.01
367	600873	梅花生物	1,400	14,028.00	0.01
368	688006	杭可科技	800	13,960.00	0.01
369	600998	九州通	2,857	13,942.16	0.01
370	000778	新兴铸管	4,000	13,920.00	0.01
371	600704	物产中大	3,200	13,888.00	0.01
372	000156	华数传媒	2,200	13,816.00	0.01
373	600549	厦门钨业	800	13,800.00	0.01
374	600582	天地科技	2,000	13,780.00	0.01
375	000709	河钢股份	7,100	13,774.00	0.01
376	600801	华新水泥	1,000	13,750.00	0.01
377	601568	北元集团	3,700	13,727.00	0.01
378	600820	隧道股份	2,100	13,713.00	0.01
379	000878	云南铜业	1,100	13,706.00	0.01
379	300136	信维通信	700	13,706.00	0.01
380	601216	君正集团	3,700	13,653.00	0.01
381	002765	蓝黛科技	2,900	13,630.00	0.01
381	300088	长信科技	2,900	13,630.00	0.01
382	002064	华峰化学	1,900	13,623.00	0.01

382	600755	厦门国贸	1,900	13,623.00	0.01
383	000785	居然之家	5,600	13,608.00	0.01
384	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
385	600096	云天化	700	13,594.00	0.01
386	300146	汤臣倍健	1,000	13,550.00	0.01
387	601958	金铂股份	1,300	13,533.00	0.01
388	600499	科达制造	1,600	13,488.00	0.01
389	001872	招商港口	700	13,475.00	0.01
390	002465	海格通信	1,300	13,468.00	0.01
391	600694	大商股份	800	13,448.00	0.01
392	600737	中粮糖业	1,400	13,426.00	0.01
393	600867	通化东宝	1,600	13,392.00	0.01
394	000559	万向钱潮	3,000	13,380.00	0.01
394	002906	华阳集团	500	13,380.00	0.01
395	600637	东方明珠	2,200	13,376.00	0.01
396	300193	佳士科技	1,800	13,356.00	0.01
396	600141	兴发集团	700	13,356.00	0.01
396	600373	中文传媒	900	13,356.00	0.01
397	002195	岩山科技	5,300	13,303.00	0.01
398	002054	德美化工	2,700	13,257.00	0.01
399	600386	北巴传媒	4,700	13,113.00	0.01
400	300915	海融科技	500	13,070.00	0.01
401	600325	华发股份	2,000	13,000.00	0.01
402	601555	东吴证券	2,200	12,980.00	0.01
403	600967	内蒙一机	1,800	12,960.00	0.01
404	301536	星辰科技	401	12,940.27	0.01
405	002080	中材科技	1,000	12,900.00	0.01
406	600626	申达股份	5,300	12,826.00	0.01
407	301309	万得凯	500	12,780.00	0.01
408	002373	千方科技	1,400	12,698.00	0.01
409	600566	济川药业	400	12,684.00	0.01
410	600664	哈药股份	4,800	12,672.00	0.01
411	603927	中科软	700	12,663.00	0.01
412	603989	艾华集团	900	12,654.00	0.01
413	600535	天士力	1,000	12,580.00	0.01
414	603218	日月股份	1,200	12,324.00	0.01
415	600511	国药股份	400	12,316.00	0.01
416	600380	健康元	1,100	12,287.00	0.01
417	002299	圣农发展	900	12,276.00	0.01
418	002572	索菲亚	800	12,264.00	0.01
419	000933	神火股份	600	12,138.00	0.01
420	002683	广东宏大	600	12,078.00	0.01
421	300387	富邦股份	2,000	11,980.00	0.01

422	600480	凌云股份	1,200	11,796.00	0.01
423	600062	华润双鹤	600	11,748.00	0.01
424	688122	西部超导	300	11,496.00	0.00
425	301327	华宝新能	200	11,460.00	0.00
426	000513	丽珠集团	300	11,163.00	0.00
427	300145	中金环境	4,300	10,750.00	0.00
428	603015	弘讯科技	1,400	10,584.00	0.00
429	688691	灿芯股份	244	10,372.44	0.00
430	300800	力合科技	1,000	10,360.00	0.00
431	301565	中仑新材	516	9,793.68	0.00
432	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
433	300595	欧普康视	600	9,408.00	0.00
434	300883	龙利得	2,200	9,306.00	0.00
435	300048	合康新能	2,000	9,260.00	0.00
436	600617	国新能源	3,700	9,250.00	0.00
437	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
438	301580	爱迪特	138	9,098.34	0.00
439	603668	天马科技	800	9,080.00	0.00
440	300562	乐心医疗	1,000	8,910.00	0.00
441	001203	大中矿业	900	8,649.00	0.00
442	003010	若羽臣	800	8,464.00	0.00
443	600000	浦发银行	1,000	8,230.00	0.00
444	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
445	688709	成都华微	411	7,722.69	0.00
446	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
447	301587	中瑞股份	282	7,123.32	0.00
448	002743	富煌钢构	1,900	7,011.00	0.00
449	001389	广合科技	200	6,912.00	0.00
450	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
451	688584	上海合晶	355	5,640.95	0.00
452	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
453	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
454	601033	永兴股份	334	5,330.64	0.00
455	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
456	002948	青岛银行	1,400	4,718.00	0.00
457	600143	金发科技	700	4,627.00	0.00
458	600335	国机汽车	800	4,616.00	0.00
459	600736	苏州高新	1,100	4,576.00	0.00
460	000032	深桑达 A	300	4,494.00	0.00
461	002408	齐翔腾达	800	4,480.00	0.00
462	000548	湖南投资	1,100	4,422.00	0.00
463	603341	龙旗科技	109	4,086.41	0.00
464	603726	朗迪集团	300	4,020.00	0.00

465	002084	海鸥住工	1,500	3,675.00	0.00
466	001359	平安电工	170	3,502.00	0.00
467	603344	星德胜	146	3,308.36	0.00
468	600662	外服控股	800	3,208.00	0.00
469	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
470	002635	安洁科技	200	3,088.00	0.00
471	600717	天津港	700	2,989.00	0.00
472	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
473	603375	盛景微	65	2,528.50	0.00
474	603325	博隆技术	36	2,450.16	0.00
475	688739	成大生物	100	2,424.00	0.00
476	603381	永臻股份	95	2,387.35	0.00
477	001379	腾达科技	175	2,359.00	0.00
478	603312	西典新能	89	2,257.04	0.00
479	603920	世运电路	100	1,974.00	0.00
480	600169	太原重工	1,000	1,830.00	0.00
481	688106	金宏气体	100	1,752.00	0.00
482	603611	诺力股份	100	1,704.00	0.00
483	002120	韵达股份	200	1,548.00	0.00
484	600223	福瑞达	100	707.00	0.00
485	600866	星湖科技	100	552.00	0.00
486	002163	海南发展	100	548.00	0.00
487	002516	旷达科技	100	364.00	0.00
488	601619	嘉泽新能	100	303.00	0.00
489	600017	日照港	100	267.00	0.00
490	002437	誉衡药业	100	170.00	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	002050	三花智控	27,593,923.84	10.43
2	601689	拓普集团	19,105,930.64	7.22
3	603728	鸣志电器	14,358,945.80	5.43
4	688279	峰昭科技	10,729,839.22	4.05
5	605333	沪光股份	10,390,097.00	3.93
6	601021	春秋航空	9,494,418.20	3.59
7	605499	东鹏饮料	7,279,447.30	2.75
8	002027	分众传媒	5,857,397.00	2.21
9	300893	松原股份	5,592,819.23	2.11
10	603997	继峰股份	4,960,509.00	1.87

11	002906	华阳集团	4,881,889.00	1.84
12	601921	浙版传媒	4,830,521.00	1.83
13	000550	江铃汽车	4,751,531.00	1.80
14	300857	协创数据	4,704,214.90	1.78
15	688480	赛恩斯	4,656,776.47	1.76
16	600114	东睦股份	4,628,959.19	1.75
17	002152	广电运通	4,562,185.96	1.72
18	601717	郑煤机	4,428,182.00	1.67
19	601500	通用股份	4,291,622.79	1.62
20	603556	海兴电力	4,288,763.00	1.62

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	002050	三花智控	24,788,180.91	9.37
2	605333	沪光股份	17,952,680.00	6.78
3	601689	拓普集团	17,739,035.75	6.70
4	601288	农业银行	11,089,689.00	4.19
5	605499	东鹏饮料	9,911,583.60	3.74
6	603728	鸣志电器	9,553,125.00	3.61
7	601799	星宇股份	7,350,963.00	2.78
8	601988	中国银行	6,191,027.00	2.34
9	601398	工商银行	5,926,779.00	2.24
10	600660	福耀玻璃	5,666,678.72	2.14
11	002906	华阳集团	5,468,236.00	2.07
12	603556	海兴电力	4,950,082.00	1.87
13	300893	松原股份	4,893,865.00	1.85
14	002683	广东宏大	4,878,813.00	1.84
15	601921	浙版传媒	4,782,925.00	1.81
16	600114	东睦股份	4,777,386.08	1.81
17	300866	安克创新	4,732,697.59	1.79
18	300001	特锐德	4,718,384.54	1.78
19	002152	广电运通	4,574,334.00	1.73
20	601939	建设银行	4,429,074.00	1.67

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	710,320,128.67
卖出股票的收入（成交）总额	752,394,295.43

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	5,774,841.18	2.50
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	5,774,841.18	2.50

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	019733	24 国债 02	29,000	2,931,118.99	1.27
2	019709	23 国债 16	28,000	2,843,722.19	1.23

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的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内受到公开谴责、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	57,477.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,477.80

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
博时智选量化多因子股票 A	4,495	10,983.08	23,751,728.00	48.11%	25,617,212.54	51.89%
博时智选量化多因子股票 C	16,725	13,696.01	1,236,874.58	0.54%	227,828,838.49	99.46%
合计	21,073	13,212.86	24,988,602.58	8.97%	253,446,051.03	91.03%

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	博时智选量化多因子股票 A	1,708,932.92	3.46%
	博时智选量化多因子股票 C	107,665.81	0.05%
	合计	1,816,598.73	0.65%

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	博时智选量化多因子股票 A	-
	博时智选量化多因子股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	>100
	博时智选量化多因子股票 C	-
	合计	>100

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	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
基金合同生效日(2021年11月2)	30,217,799.02	443,311,509.32

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	51,578,960.98	264,291,979.59
本报告期基金总申购份额	1,909,572.45	55,683,172.40
减: 本报告期基金总赎回份额	4,119,592.89	90,909,438.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	49,368,940.54	229,065,713.07

§ 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，本基金托管人及其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	
华创证券	2	1,461,432,199.10	100.00%	1,052,327.62	100.00%	-

注：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
华创证券	6,907,195.00	100.00%	11,325,000.00	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	博时智选量化多因子股票型证券投资基金（博时智选量化多因子股票 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
2	博时智选量化多因子股票型证券投资基金（博时智选量化多因子股票 A）基金产品资料概要	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披	2024-06-26

	更新	露网站	
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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-06
4	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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
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	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
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	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
8	博时智选量化多因子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
9	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
10	博时智选量化多因子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
11	博时智选量化多因子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智选量化多因子股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时智选量化多因子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、博时智选量化多因子股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时智选量化多因子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