

博时量化平衡混合型证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国工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。

基金托管人中国工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.....	14
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>37</b>
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.....	37
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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
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	博时量化平衡混合型证券投资基金	
基金简称	博时量化平衡混合	
基金主代码	004495	
交易代码	004495	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 5 月 4 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	202,045,625.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化平衡混合 A	博时量化平衡混合 C
下属分级基金的交易代码	004495	019195
报告期末下属分级基金的份额总额	202,037,374.48 份	8,251.21 份

### 2.2 基金产品说明

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

	收益的基金产品。
--	----------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙麒清	郭明
	联系电话	0755-83169999	010-66105799
	电子邮箱	service@bosera.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105568	95588
传真		0755-83195140	010-66105798
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518040	100140
法定代表人		江向阳	廖林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<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）	
	博时量化平衡混合 A	博时量化平衡混合 C
本期已实现收益	4,775,885.45	119.02
本期利润	2,031,098.70	-72.42
加权平均基金份额本期利润	0.0101	-0.0161

本期加权平均净值利润率	0.77%	-1.22%
本期基金份额净值增长率	0.84%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	博时量化平衡混合 A	博时量化平衡混合 C
期末可供分配利润	58,754,659.68	2,343.53
期末可供分配基金份额利润	0.2908	0.2840
期末基金资产净值	260,792,034.16	10,594.74
期末基金份额净值	1.2908	1.2840
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	博时量化平衡混合 A	博时量化平衡混合 C
基金份额累计净值增长率	38.75%	-5.66%

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

#### 博时量化平衡混合 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	-2.90%	0.50%	0.02%	0.10%	-2.92%	0.40%
过去三个月	-3.01%	0.63%	0.98%	0.14%	-3.99%	0.49%
过去六个月	0.84%	0.61%	3.26%	0.17%	-2.42%	0.44%
过去一年	-5.35%	0.58%	2.71%	0.17%	-8.06%	0.41%
过去三年	-6.57%	0.74%	4.08%	0.21%	-10.65%	0.53%
自基金合同生效起至今	38.75%	0.80%	33.29%	0.23%	5.46%	0.57%

#### 博时量化平衡混合 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	-2.93%	0.50%	0.02%	0.10%	-2.95%	0.40%
过去三个月	-3.73%	0.64%	0.98%	0.14%	-4.71%	0.50%
过去六个月	0.20%	0.62%	3.26%	0.17%	-3.06%	0.45%
自基金合同生效起至今	-5.66%	0.59%	2.42%	0.17%	-8.08%	0.42%

注：自 2023 年 8 月 24 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 8 月 25 日，相关数据按实际存续期计算。

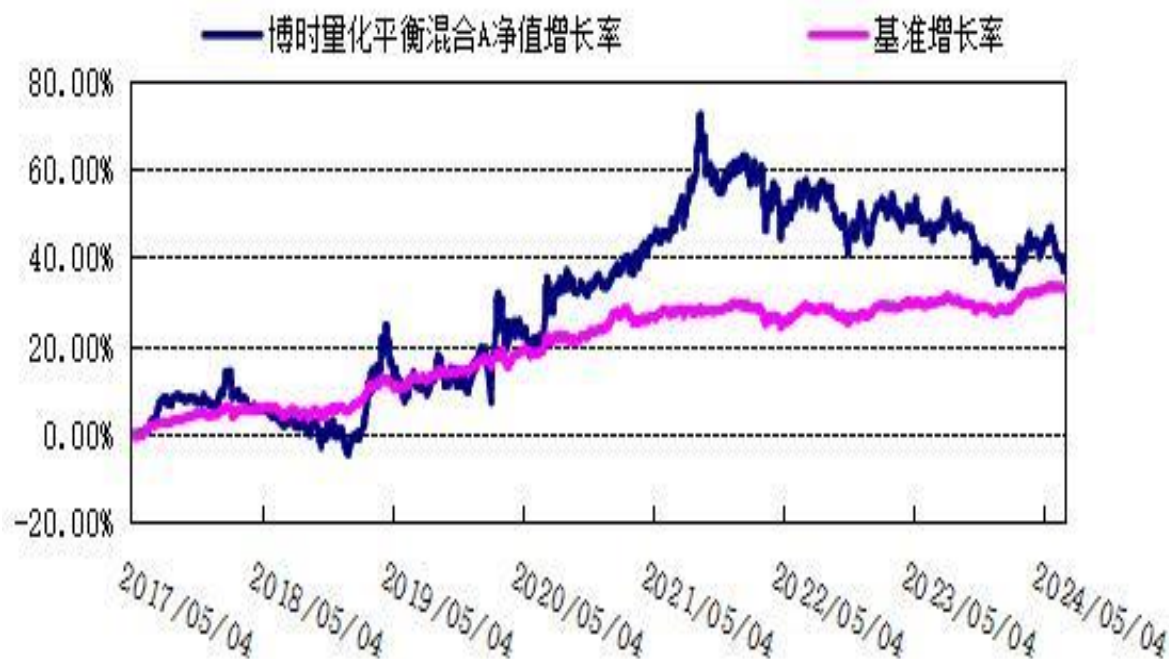
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化平衡混合型证券投资基金

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

(2017 年 5 月 4 日至 2024 年 6 月 30 日)

博时量化平衡混合 A



博时量化平衡混合 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	2017-05-04	-	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

2024 年上半年，我国经济基本面延续修复态势，但整体增速放缓，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。在开年经济数据超预期、一季度迎来“开门红”后，二季度由于国内消费复苏乏力和国外需求不济的双重影响，经济数据开始环比走弱且不及预期。一是信贷数据回落，二是制造业 PMI 跌落至收缩区间，三是 CPI 超预期回落。总体而言，上半年经济数据显示基本面修复尚未稳固，我国经济仍然存在房地产依赖、民营企业信心不足、西方大国选举等内外部挑战。此外，在全球经济复苏力度不足的大背景下，中国经济发展还将面临内外需求不足、转型升级压力较大的问题。

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。年初，股票市场一度单边下探创四年新低，随后，一系列密集救市政策出台，上证指数深 V 形反弹，收复年内跌幅。进入五月份后，指数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。行业板块方面，银行、电力及公用事业、交通运输和煤炭等周期类行业涨幅靠前，综合、消费者服务、传媒、商贸零售等行业跌幅较大。

债券市场今年以来延续牛市行情，十年期国债收益率不断创新低，超长债迎来一轮超级牛市。1 至 2 月，超长债表现突出，3 至 6 月，信用债、长期限信用债以及 5 到 10 年利率债表现较好。政府债发行节奏明显偏慢，城投债规模缩量，债券供需不平衡的状况推动收益率继续下行。可转债方面，经过五、六月份的下落，一批相对较低纯债溢价和转股溢价的转债也具备较好的攻防兼备的投资属性。

本基金在 2024 年上半年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了较高水平的股票平均仓位。在年初减仓转债以后，二季度逐步加仓转债，结构方面，调整为以中低风险的银行转债和综合打分的量化模型选择为主。未来本基金将持续通过量化多策略体系充分挖掘和利用股票及债券市场的规律，注重资产本身的收益能力和空间，保持在追求稳健收益的同时，注重回撤风险的

控制，力争获得平稳的绝对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2908 元，份额累计净值为 1.3949 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2840 元，份额累计净值为 1.2840 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.84%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 0.20%，同期业绩基准增长率为 3.26%。

#### 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，我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。债券方面，我们认为本轮债券牛市并未结束，未来应密切关注央行的货币政策动向及政府债务的供给情况，并留意权益市场的变化及超预期因素。

总体而言，随着国内市场的潜力的释放和产业基础的加固，经济内生动能有望得到进一步增强。同时，财政政策仍有较大的发力空间，以促进经济的持续恢复和向好发展及新质生产力的培育，为下半年的经济发展提供坚实的支持。

#### 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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的本基金 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核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

---

## 6.1 资产负债表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

报告截止日：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	30,542,152.40	15,050,755.89
结算备付金		8,829,977.08	3,295,099.87
存出保证金		89,174.99	33,566.04
交易性金融资产	6.4.3.2	222,378,578.35	239,535,156.10
其中：股票投资		100,650,292.89	101,007,960.11
基金投资		-	-
债券投资		121,728,285.46	138,527,195.99
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		-	170,153.95
应收股利		-	-
应收申购款		2,804.98	4,396.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		261,842,687.80	258,089,128.72
<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		0.26	-
应付赎回款		487.46	74,304.47
应付管理人报酬		259,350.86	263,196.32
应付托管费		43,225.14	43,866.06
应付销售服务费		3.00	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,358.58	4,396.48

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	735,633.60	828,544.98
负债合计		1,040,058.90	1,214,308.31
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	202,045,625.69	200,679,710.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	58,757,003.21	56,195,109.60
净资产合计		260,802,628.90	256,874,820.41
<b>负债和净资产总计</b>		<b>261,842,687.80</b>	<b>258,089,128.72</b>

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 202,045,625.69 份。其中 A 类基金份额净值 1.2908 元，基金份额总额 202,037,374.48 份；C 类基金份额净值 1.2840 元，基金份额总额 8,251.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

本报告期：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>		<b>3,972,339.64</b>	<b>9,364,821.60</b>
1. 利息收入		139,437.09	71,388.56
其中：存款利息收入	6.4.3.10	139,437.09	71,388.56
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）		6,573,919.55	11,682,993.04
其中：股票投资收益	6.4.3.11	429,186.22	5,824,581.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	4,365,208.45	3,449,201.58
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	110,115.71	26,870.14
股利收益	6.4.3.15	1,669,409.17	2,382,339.47
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	-2,744,978.19	-2,430,725.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-



5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	3,961.19	41,165.26
<b>减：二、营业总支出</b>		1,941,313.36	2,938,530.23
1. 管理人报酬		1,573,532.70	2,436,318.93
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		262,255.40	406,053.21
3. 销售服务费		10.19	-
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		1,725.77	1,095.57
8. 其他费用	6.4.3.19	103,789.30	95,062.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,031,026.28	6,426,291.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,031,026.28	6,426,291.37
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,031,026.28	6,426,291.37

### 6.3 净资产变动表

会计主体：博时量化平衡混合型证券投资基金

本报告期：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	200,679,710.81	-	56,195,109.60	256,874,820.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	200,679,710.81	-	56,195,109.60	256,874,820.41
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	1,365,914.88	-	2,561,893.61	3,927,808.49
（一）、综合收益总额	-	-	2,031,026.28	2,031,026.28
（二）、本期基金份	1,365,914.88	-	530,867.33	1,896,782.21

额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	3,306,433.59	-	1,116,502.16	4,422,935.75
2. 基金赎回款	-1,940,518.71	-	-585,634.83	-2,526,153.54
（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	202,045,625.69	-	58,757,003.21	260,802,628.90
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	255,686,366.79	-	87,531,425.84	343,217,792.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	255,686,366.79	-	87,531,425.84	343,217,792.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,695,368.40	-	-6,794,414.08	-40,489,782.48
（一）、综合收益总额	-	-	6,426,291.37	6,426,291.37
（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）	-33,695,368.40	-	-13,220,705.45	-46,916,073.85
其中：1. 基金申购款	12,409,854.67	-	5,050,156.76	17,460,011.43
2. 基金赎回款	-46,105,223.07	-	-18,270,862.21	-64,376,085.28
（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	221,990,998.39	-	80,737,011.76	302,728,010.15

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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额

净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。(5)本基金的城市场维护建设税、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	30,542,152.40
等于：本金	30,539,147.92
加：应计利息	3,004.48
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	30,542,152.40

#### 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		103,520,097.96	-	100,650,292.89	-2,869,805.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	120,891,422.09	542,303.91	121,728,285.46	294,559.46
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	120,891,422.09	542,303.91	121,728,285.46	294,559.46
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		224,411,520.05	542,303.91	222,378,578.35	-2,575,245.61

#### 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	0.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	642,294.79
其中：交易所市场	642,294.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,338.50
合计	735,633.60

#### 6.4.3.8 实收基金

##### 博时量化平衡混合 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	200,679,663.00	200,679,663.00
本期申购	3,283,460.84	3,283,460.84
本期赎回（以“-”号填列）	-1,925,749.36	-1,925,749.36
本期末	202,037,374.48	202,037,374.48

##### 博时量化平衡混合 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	47.81	47.81
本期申购	22,972.75	22,972.75
本期赎回（以“-”号填列）	-14,769.35	-14,769.35
本期末	8,251.21	8,251.21

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

##### 博时量化平衡混合 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	63,871,943.78	-7,676,847.64	56,195,096.14
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	63,871,943.78	-7,676,847.64	56,195,096.14
本期利润	4,775,885.45	-2,744,786.75	2,031,098.70

本期基金份额交易产生的变动数	498,393.64	30,071.20	528,464.84
其中：基金申购款	1,130,936.15	-21,884.80	1,109,051.35
基金赎回款	-632,542.51	51,956.00	-580,586.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,146,222.87	-10,391,563.19	58,754,659.68

**博时量化平衡混合 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	15.33	-1.87	13.46
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	15.33	-1.87	13.46
本期利润	119.02	-191.44	-72.42
本期基金份额交易产生的变动数	2,642.34	-239.85	2,402.49
其中：基金申购款	8,025.93	-575.12	7,450.81
基金赎回款	-5,383.59	335.27	-5,048.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,776.69	-433.16	2,343.53

**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	85,998.27
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	52,916.77
其他	522.05
合计	139,437.09

**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	866,588,968.32
减：卖出股票成本总额	864,083,621.29
减：交易费用	2,076,160.81
买卖股票差价收入	429,186.22

### 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	599,882.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,765,326.03
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	4,365,208.45

#### 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	462,124,633.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	456,457,437.54
减：应计利息总额	1,869,552.96
减：交易费用	32,317.22
买卖债券差价收入	3,765,326.03

### 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	110,115.71



**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	1,669,409.17
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,669,409.17

**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	-2,744,978.19
——股票投资	-4,272,395.15
——债券投资	1,527,416.96
——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	-2,744,978.19

**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	3,908.86
基金转换费收入	52.33
合计	3,961.19

**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	24,366.16
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
其他	12.80
银行汇划费	1,138.00
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,600.00
合计	103,789.30

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
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 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	1,573,532.70	2,436,318.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	69,812.99	110,455.60
应支付基金管理人的净管理费	1,503,719.71	2,325,863.33

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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	262,255.40	406,053.21

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		
	博时量化平衡混合 A	博时量化平衡混合 C	合计
博时基金	-	6.15	6.15
合计	-	6.15	6.15
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		
	博时量化平衡混合 A	博时量化平衡混合 C	合计
合计	-	-	-

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 0.35% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
中国工商银行-活期存款	30,542,152.40	85,998.27	20,801,687.72	39,248.86

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	872.00	75,829.12
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
-	-	-	-	-	-

#### 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
603285	键邦股份	2024-06-28	5 个交易日	新股未上市	18.65	18.65	1,109.00	20,682.85	20,682.85	-
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	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	首次公开发行限售	86.96	174.93	88.00	7,652.48	15,393.84	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	首次公开发行限售	15.69	18.79	429.00	6,731.01	8,060.91	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	首次公开发行限售	22.66	15.89	370.00	8,384.20	5,879.30	-
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	-
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	-
60334	龙旗	2024-	6 个月	首次	26.00	37.49	120.0	3,120	4,498	-

1	科技	02-23		公开发 行限售			0	.00	.80	
60334 4	星德 胜	2024- 03-13	6 个月	首次公 开发行 限售	19.18	22.66	144.0 0	2,761 .92	3,263 .04	-
60338 1	永臻 股份	2024- 06-19	6 个月	首次公 开发行 限售	23.35	25.13	100.0 0	2,335 .00	2,513 .00	-
60328 5	键邦 股份	2024- 06-28	6 个月	首次公 开发行 限售	18.65	18.65	124.0 0	2,312 .60	2,312 .60	-
60335 0	安乃 达	2024- 06-26	6 个月	首次公 开发行 限售	20.56	20.56	106.0 0	2,179 .36	2,179 .36	-

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

### 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债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，对不同的债券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且债券证券公司最近 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	-	1,936,915.18
合计	-	1,936,915.18

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年末 2023 年 12 月 31 日
AAA	60,841,078.30	46,583,468.76
AAA 以下	60,887,207.16	90,006,812.05
未评级	-	-
合计	121,728,285.46	136,590,280.81

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。

#### 6.4.9.2.5 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
<b>资产</b>					
货币资金	30,542,152.40	-	-	-	30,542,152.40
结算备付金	8,829,977.08	-	-	-	8,829,977.08
存出保证金	89,174.99	-	-	-	89,174.99
交易性金融资产	32,123,092.29	78,921,224.16	10,683,969.01	100,650,292.89	222,378,578.35
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,804.98	2,804.98
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>71,584,396.76</b>	<b>78,921,224.16</b>	<b>10,683,969.01</b>	<b>100,653,097.87</b>	<b>261,842,687.80</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	487.46	487.46
应付清算款	-	-	-	0.26	0.26
应付管理人报酬	-	-	-	259,350.86	259,350.86

应付托管费	-	-	-	43,225.14	43,225.14
应付销售服务费	-	-	-	3.00	3.00
应交税费	-	-	-	1,358.58	1,358.58
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	735,633.60	735,633.60
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,040,058.90</b>	<b>1,040,058.90</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>71,584,396.76</b>	<b>78,921,224.16</b>	<b>10,683,969.01</b>	<b>99,613,038.97</b>	<b>260,802,628.90</b>
<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	15,050,755.89	-	-	-	15,050,755.89
结算备付金	3,295,099.87	-	-	-	3,295,099.87
存出保证金	33,566.04	-	-	-	33,566.04
交易性金融资产	26,966,417.81	84,307,456.02	27,253,322.16	101,007,960.11	239,535,156.10
应收清算款	-	-	-	170,153.95	170,153.95
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,396.87	4,396.87
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>45,345,839.61</b>	<b>84,307,456.02</b>	<b>27,253,322.16</b>	<b>101,182,510.93</b>	<b>258,089,128.72</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	74,304.47	74,304.47
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	263,196.32	263,196.32
应付托管费	-	-	-	43,866.06	43,866.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,396.48	4,396.48
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	828,544.98	828,544.98
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,214,308.31</b>	<b>1,214,308.31</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>45,345,839.61</b>	<b>84,307,456.02</b>	<b>27,253,322.16</b>	<b>99,968,202.62</b>	<b>256,874,820.41</b>

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
	市场利率下降 25 个基点	-	增加约 0

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

2. 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	100,650,292.89	38.59	101,007,960.11	39.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	121,728,285.46	46.67	136,590,280.81	53.17
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>222,378,578</b>	<b>85.27</b>	<b>237,598,240</b>	<b>92.50</b>

	.35		.92	
--	-----	--	-----	--

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 734	增加约 687
	业绩比较基准下降 5%	减少约 734	减少约 687

#### 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	222,282,958.75
第二层次	44,604.01
第三层次	51,015.59
合计	222,378,578.35

###### 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	100,650,292.89	38.44
	其中：股票	100,650,292.89	38.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,728,285.46	46.49
	其中：债券	121,728,285.46	46.49
	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	-	-
	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	39,372,129.48	15.04
8	其他各项资产	91,979.97	0.04
9	合计	261,842,687.80	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	1,480,482.00	0.57
B	采矿业	5,448,851.00	2.09
C	制造业	57,173,597.93	21.92

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,866,635.00	2.63
E	建筑业	3,753,407.00	1.44
F	批发和零售业	443,054.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	2,025,980.42	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,259,554.54	0.87
J	金融业	19,886,180.00	7.62
K	房地产业	254,529.00	0.10
L	租赁和商务服务业	341,621.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	568,458.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	8,607.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,892.00	0.00
Q	卫生和社会工作	9,288.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	124,156.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	100,650,292.89	38.59

### 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	5,500	8,070,645.00	3.09
2	000333	美的集团	43,800	2,825,100.00	1.08
3	600900	长江电力	94,800	2,741,616.00	1.05
4	600036	招商银行	68,700	2,348,853.00	0.90
5	601318	中国平安	56,100	2,320,296.00	0.89
6	601166	兴业银行	127,400	2,244,788.00	0.86
7	300750	宁德时代	9,100	1,638,273.00	0.63
8	002594	比亚迪	5,700	1,426,425.00	0.55
9	601899	紫金矿业	80,000	1,405,600.00	0.54
10	002475	立讯精密	33,800	1,328,678.00	0.51
11	300308	中际旭创	9,440	1,301,587.20	0.50
12	603501	韦尔股份	13,000	1,291,810.00	0.50
13	000568	泸州老窖	9,000	1,291,410.00	0.50
14	600276	恒瑞医药	30,800	1,184,568.00	0.45
15	601328	交通银行	156,300	1,167,561.00	0.45
16	000651	格力电器	29,000	1,137,380.00	0.44
17	600690	海尔智家	37,800	1,072,764.00	0.41
18	601857	中国石油	102,200	1,054,704.00	0.40

19	601088	中国神华	23,100	1,024,947.00	0.39
20	601390	中国中铁	152,900	996,908.00	0.38
21	600989	宝丰能源	55,400	960,082.00	0.37
22	600015	华夏银行	141,900	908,160.00	0.35
23	601668	中国建筑	168,100	892,611.00	0.34
24	000725	京东方 A	217,800	890,802.00	0.34
25	600926	杭州银行	67,100	875,655.00	0.34
26	601985	中国核电	80,800	861,328.00	0.33
27	601288	农业银行	196,300	855,868.00	0.33
28	600809	山西汾酒	4,000	843,520.00	0.32
29	600019	宝钢股份	125,400	833,910.00	0.32
30	002371	北方华创	2,600	831,714.00	0.32
31	600887	伊利股份	31,100	803,624.00	0.31
32	000001	平安银行	78,600	797,790.00	0.31
33	600016	民生银行	210,000	795,900.00	0.31
34	002714	牧原股份	18,000	784,800.00	0.30
35	000858	五粮液	6,100	781,044.00	0.30
36	601601	中国太保	28,000	780,080.00	0.30
37	300433	蓝思科技	42,000	766,500.00	0.29
38	601229	上海银行	102,500	744,150.00	0.29
39	600886	国投电力	40,700	742,368.00	0.28
40	300498	温氏股份	35,100	695,682.00	0.27
41	600919	江苏银行	89,800	667,214.00	0.26
42	600674	川投能源	35,500	665,625.00	0.26
43	601577	长沙银行	80,900	661,762.00	0.25
44	601997	贵阳银行	124,200	654,534.00	0.25
45	600039	四川路桥	81,400	642,246.00	0.25
46	300760	迈瑞医疗	2,200	640,002.00	0.25
47	600025	华能水电	59,200	638,176.00	0.24
48	002180	纳思达	23,900	631,438.00	0.24
49	600030	中信证券	34,600	630,758.00	0.24
50	002938	鹏鼎控股	15,800	628,208.00	0.24
51	600803	新奥股份	30,200	628,160.00	0.24
52	002252	上海莱士	80,200	627,164.00	0.24
53	603986	兆易创新	6,500	621,530.00	0.24
54	603195	公牛集团	8,035	619,659.20	0.24
55	603323	苏农银行	127,600	613,756.00	0.24
56	300142	沃森生物	53,900	613,382.00	0.24
57	600584	长电科技	19,300	612,003.00	0.23
58	600406	国电南瑞	24,240	605,030.40	0.23
59	300408	三环集团	20,700	604,233.00	0.23
60	605499	东鹏饮料	2,800	604,100.00	0.23
61	002352	顺丰控股	16,918	603,803.42	0.23



62	600732	爱旭股份	64,900	587,345.00	0.23
63	601816	京沪高铁	93,900	504,243.00	0.19
64	600309	万华化学	6,100	493,246.00	0.19
65	601633	长城汽车	17,700	447,810.00	0.17
66	600028	中国石化	70,700	446,824.00	0.17
67	002415	海康威视	14,100	435,831.00	0.17
68	601688	华泰证券	34,700	429,933.00	0.16
69	601127	赛力斯	4,700	428,264.00	0.16
70	300059	东方财富	40,200	424,512.00	0.16
71	300857	协创数据	7,400	421,800.00	0.16
72	300529	健帆生物	15,100	410,871.00	0.16
73	002928	华夏航空	64,600	409,564.00	0.16
74	002984	森麒麟	16,900	407,121.00	0.16
75	002726	龙大美食	61,700	404,752.00	0.16
76	601138	工业富联	14,700	402,780.00	0.15
77	001301	尚太科技	9,300	401,946.00	0.15
78	600050	中国联通	85,200	400,440.00	0.15
79	601225	陕西煤业	15,400	396,858.00	0.15
80	603496	恒为科技	16,100	393,645.00	0.15
81	300446	航天智造	32,800	390,320.00	0.15
82	688408	中信博	4,209	387,564.72	0.15
83	300708	聚灿光电	42,700	384,300.00	0.15
84	300005	探路者	75,800	379,758.00	0.15
85	300492	华图山鼎	4,000	376,800.00	0.14
86	601989	中国重工	75,600	372,708.00	0.14
87	688138	清溢光电	17,200	369,800.00	0.14
88	688036	传音控股	4,800	367,392.00	0.14
89	600941	中国移动	3,400	365,500.00	0.14
90	300840	酷特智能	39,400	364,450.00	0.14
91	689009	九号公司	9,500	349,695.00	0.13
92	300969	恒帅股份	5,000	345,650.00	0.13
93	688233	神工股份	17,900	344,933.00	0.13
94	688498	源杰科技	2,600	340,574.00	0.13
95	601728	中国电信	54,100	332,715.00	0.13
96	300124	汇川技术	6,400	328,320.00	0.13
97	601186	中国铁建	37,900	324,803.00	0.12
98	002493	荣盛石化	33,300	321,678.00	0.12
99	000063	中兴通讯	11,500	321,655.00	0.12
100	600010	包钢股份	216,000	302,400.00	0.12
101	688111	金山办公	1,300	295,750.00	0.11
102	000596	古井贡酒	1,300	274,391.00	0.11
103	000338	潍柴动力	16,700	271,208.00	0.10
104	601012	隆基绿能	18,800	263,576.00	0.10

105	601717	郑煤机	17,300	256,040.00	0.10
106	603198	迎驾贡酒	4,400	253,000.00	0.10
107	300274	阳光电源	3,920	243,157.60	0.09
108	600737	中粮糖业	25,300	242,627.00	0.09
109	600566	济川药业	7,500	237,825.00	0.09
110	601800	中国交建	25,400	227,076.00	0.09
111	601988	中国银行	47,500	219,450.00	0.08
112	600938	中国海油	6,400	211,200.00	0.08
113	601919	中远海控	13,600	210,664.00	0.08
114	601600	中国铝业	27,400	209,062.00	0.08
115	601117	中国化学	24,600	202,704.00	0.08
116	601169	北京银行	34,700	202,648.00	0.08
117	601888	中国中免	3,100	193,719.00	0.07
118	603160	汇顶科技	2,800	192,500.00	0.07
119	600667	太极实业	32,700	186,717.00	0.07
120	600795	国电电力	31,100	186,289.00	0.07
121	603259	药明康德	4,700	184,193.00	0.07
122	600183	生益科技	8,700	183,222.00	0.07
123	000400	许继电气	5,300	182,373.00	0.07
124	603606	东方电缆	3,600	175,716.00	0.07
125	688578	艾力斯	2,700	172,098.00	0.07
126	600707	彩虹股份	25,100	170,931.00	0.07
127	300502	新易盛	1,600	168,880.00	0.06
128	002142	宁波银行	7,500	165,450.00	0.06
129	600066	宇通客车	6,300	162,540.00	0.06
130	688041	海光信息	2,300	161,736.00	0.06
131	002595	豪迈科技	4,200	160,314.00	0.06
132	601818	光大银行	50,100	158,817.00	0.06
133	603369	今世缘	3,400	157,080.00	0.06
134	600362	江西铜业	6,600	156,288.00	0.06
135	002106	莱宝高科	14,100	153,690.00	0.06
136	600000	浦发银行	18,600	153,078.00	0.06
137	300979	华利集团	2,500	152,125.00	0.06
138	603993	洛阳钼业	17,700	150,450.00	0.06
139	000708	中信特钢	11,000	149,270.00	0.06
140	002028	思源电气	2,200	147,180.00	0.06
141	601163	三角轮胎	9,600	146,112.00	0.06
142	601336	新华保险	4,800	144,144.00	0.06
143	000625	长安汽车	10,600	142,358.00	0.05
144	002311	海大集团	3,000	141,150.00	0.05
145	300009	安科生物	16,100	137,494.00	0.05
146	601939	建设银行	18,400	136,160.00	0.05
147	601319	中国人保	26,100	134,415.00	0.05

148	002558	巨人网络	14,200	134,048.00	0.05
149	002920	德赛西威	1,500	130,635.00	0.05
150	002236	大华股份	8,400	129,864.00	0.05
151	300724	捷佳伟创	2,400	129,624.00	0.05
152	000975	银泰黄金	7,800	127,062.00	0.05
153	002752	昇兴股份	24,900	125,994.00	0.05
154	000963	华东医药	4,500	125,145.00	0.05
155	601766	中国中车	16,500	123,915.00	0.05
156	000550	江铃汽车	5,700	123,747.00	0.05
157	600188	兖矿能源	5,400	122,742.00	0.05
158	600346	恒力石化	8,700	121,365.00	0.05
159	002027	分众传媒	19,900	120,594.00	0.05
160	601669	中国电建	21,400	119,626.00	0.05
161	600150	中国船舶	2,800	113,988.00	0.04
162	002035	华帝股份	18,200	113,386.00	0.04
163	002648	卫星化学	6,300	113,274.00	0.04
164	300144	宋城演艺	14,100	113,223.00	0.04
165	600048	保利发展	12,900	113,004.00	0.04
166	300122	智飞生物	4,000	112,120.00	0.04
167	000661	长春高新	1,200	110,124.00	0.04
168	001979	招商蛇口	11,900	104,601.00	0.04
169	300896	爱美客	600	103,260.00	0.04
170	300389	艾比森	8,400	103,152.00	0.04
171	603806	福斯特	6,980	102,606.00	0.04
172	601865	福莱特	5,100	102,510.00	0.04
173	600210	紫江企业	19,000	101,080.00	0.04
174	601658	邮储银行	19,500	98,865.00	0.04
175	600585	海螺水泥	4,100	96,719.00	0.04
176	600219	南山铝业	24,500	93,345.00	0.04
177	300999	金龙鱼	3,400	92,990.00	0.04
178	601009	南京银行	8,900	92,471.00	0.04
179	601898	中煤能源	7,400	92,352.00	0.04
180	002625	光启技术	5,300	91,955.00	0.04
181	003816	中国广核	19,700	91,211.00	0.03
182	603518	锦泓集团	9,900	87,120.00	0.03
183	000034	神州数码	3,800	86,982.00	0.03
184	002466	天齐锂业	2,900	86,739.00	0.03
185	600023	浙能电力	12,000	85,320.00	0.03
186	601998	中信银行	12,700	85,090.00	0.03
187	600104	上汽集团	6,100	84,546.00	0.03
188	601618	中国中冶	27,100	84,010.00	0.03
189	601006	大秦铁路	11,600	83,056.00	0.03
190	000983	山西焦煤	8,000	82,480.00	0.03

191	600905	三峡能源	18,600	81,096.00	0.03
192	301219	腾远钴业	2,100	80,346.00	0.03
193	601211	国泰君安	5,900	79,945.00	0.03
194	601799	星宇股份	700	78,428.00	0.03
195	601236	红塔证券	12,200	78,324.00	0.03
196	000426	兴业银锡	5,500	74,690.00	0.03
197	600547	山东黄金	2,700	73,926.00	0.03
198	002852	道道全	9,700	69,840.00	0.03
199	601868	中国能建	32,800	69,536.00	0.03
200	000876	新希望	7,500	68,550.00	0.03
201	601699	潞安环能	3,700	67,081.00	0.03
202	600438	通威股份	3,500	66,885.00	0.03
203	600111	北方稀土	3,700	63,640.00	0.02
203	600489	中金黄金	4,300	63,640.00	0.02
204	301015	百洋医药	2,700	63,531.00	0.02
205	002050	三花智控	3,300	62,964.00	0.02
206	300441	鲍斯股份	10,300	61,079.00	0.02
207	600866	星湖科技	11,000	60,720.00	0.02
208	000301	东方盛虹	7,500	59,775.00	0.02
209	601838	成都银行	3,700	56,203.00	0.02
210	688472	阿特斯	5,400	54,972.00	0.02
211	600011	华能国际	5,700	54,834.00	0.02
212	300772	运达股份	5,700	54,720.00	0.02
213	000977	浪潮信息	1,400	50,918.00	0.02
214	601021	春秋航空	900	50,697.00	0.02
215	002966	苏州银行	6,700	50,250.00	0.02
216	601000	唐山港	10,400	48,880.00	0.02
217	600096	云天化	2,500	48,550.00	0.02
218	301187	欧圣电气	2,000	48,500.00	0.02
219	002230	科大讯飞	1,100	47,245.00	0.02
220	601825	沪农商行	6,900	46,368.00	0.02
221	600998	九州通	9,500	46,360.00	0.02
222	002001	新和成	2,400	46,080.00	0.02
223	002460	赣锋锂业	1,600	45,840.00	0.02
224	600031	三一重工	2,700	44,550.00	0.02
225	600901	江苏金租	8,800	44,440.00	0.02
226	603799	华友钴业	2,000	44,260.00	0.02
227	300628	亿联网络	1,200	44,124.00	0.02
228	600398	海澜之家	4,700	43,428.00	0.02
229	600350	山东高速	4,900	43,365.00	0.02
230	002267	陕天然气	5,600	42,336.00	0.02
231	600282	南钢股份	8,500	42,330.00	0.02
232	002327	富安娜	4,100	41,205.00	0.02

233	002911	佛燃能源	4,500	41,130.00	0.02
234	603967	中创物流	4,400	40,920.00	0.02
235	603156	养元饮品	1,900	40,413.00	0.02
236	002340	格林美	6,300	40,131.00	0.02
237	002032	苏泊尔	800	40,080.00	0.02
238	002416	爱施德	4,500	39,825.00	0.02
239	002540	亚太科技	7,500	39,675.00	0.02
240	002563	森马服饰	6,800	39,508.00	0.02
241	601058	赛轮轮胎	2,800	39,200.00	0.02
242	002773	康弘药业	1,800	38,970.00	0.01
243	300782	卓胜微	500	38,870.00	0.01
244	000030	富奥股份	7,900	38,789.00	0.01
245	002270	华明装备	1,700	37,808.00	0.01
246	000069	华侨城 A	18,100	36,924.00	0.01
247	600741	华域汽车	2,200	36,036.00	0.01
248	002841	视源股份	1,200	35,436.00	0.01
249	002601	龙佰集团	1,900	35,283.00	0.01
250	000895	双汇发展	1,400	33,278.00	0.01
251	688561	奇安信	1,400	33,068.00	0.01
252	000792	盐湖股份	1,800	31,410.00	0.01
253	000933	神火股份	1,500	30,345.00	0.01
254	600694	大商股份	1,800	30,258.00	0.01
255	300735	光弘科技	1,300	28,080.00	0.01
256	601808	中海油服	1,600	27,520.00	0.01
257	601126	四方股份	1,400	26,908.00	0.01
258	600916	中国黄金	2,700	25,974.00	0.01
259	000877	天山股份	4,800	25,920.00	0.01
260	600062	华润双鹤	1,300	25,454.00	0.01
261	000630	铜陵有色	6,900	24,909.00	0.01
262	002384	东山精密	1,200	24,840.00	0.01
263	603285	键邦股份	1,233	22,995.45	0.01
264	688065	凯赛生物	500	22,695.00	0.01
265	600018	上港集团	3,900	22,542.00	0.01
266	000100	TCL 科技	5,200	22,464.00	0.01
267	600893	航发动力	600	21,930.00	0.01
268	301301	川宁生物	1,700	21,726.00	0.01
269	603279	景津装备	1,000	21,690.00	0.01
270	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
271	600993	马应龙	800	21,336.00	0.01
272	688516	奥特维	500	20,905.00	0.01
273	600436	片仔癀	100	20,717.00	0.01
274	000758	中色股份	3,900	19,812.00	0.01
275	600660	福耀玻璃	400	19,160.00	0.01

276	601916	浙商银行	6,700	18,492.00	0.01
277	300910	瑞丰新材	400	17,488.00	0.01
278	603288	海天味业	500	17,235.00	0.01
279	601500	通用股份	3,200	17,088.00	0.01
280	600089	特变电工	1,200	16,644.00	0.01
281	002304	洋河股份	200	16,148.00	0.01
282	688692	达梦数据	88	15,393.84	0.01
283	002241	歌尔股份	700	13,657.00	0.01
284	600153	建发股份	1,500	13,395.00	0.01
285	603919	金徽酒	700	12,719.00	0.00
286	300457	赢合科技	700	12,481.00	0.00
287	605305	中际联合	480	12,379.20	0.00
288	688772	珠海冠宇	800	11,920.00	0.00
289	300820	英杰电气	300	11,802.00	0.00
290	300458	全志科技	500	11,755.00	0.00
291	688008	澜起科技	200	11,432.00	0.00
292	002179	中航光电	300	11,415.00	0.00
293	002897	意华股份	300	11,298.00	0.00
294	000938	紫光股份	500	11,175.00	0.00
295	600582	天地科技	1,600	11,024.00	0.00
296	300251	光线传媒	1,300	10,933.00	0.00
297	002315	焦点科技	400	10,784.00	0.00
298	000997	新大陆	700	9,737.00	0.00
299	688234	天岳先进	200	9,384.00	0.00
300	301030	仕净科技	380	9,355.60	0.00
301	600755	厦门国贸	1,300	9,321.00	0.00
302	300015	爱尔眼科	900	9,288.00	0.00
303	002697	红旗连锁	2,000	9,260.00	0.00
304	603688	石英股份	300	8,883.00	0.00
305	002112	三变科技	1,000	8,880.00	0.00
306	000035	中国天楹	1,900	8,607.00	0.00
307	002469	三维化学	1,500	8,550.00	0.00
308	600745	闻泰科技	300	8,475.00	0.00
309	600372	中航机载	700	8,379.00	0.00
310	600029	南方航空	1,400	8,246.00	0.00
311	688709	成都华微	429	8,060.91	0.00
312	300926	博俊科技	400	8,008.00	0.00
313	003019	宸展光电	315	7,978.95	0.00
314	601607	上海医药	400	7,644.00	0.00
315	603929	亚翔集成	300	7,170.00	0.00
316	001337	四川黄金	300	6,963.00	0.00
317	000821	京山轻机	600	6,798.00	0.00
318	300783	三只松鼠	300	6,561.00	0.00

319	688223	晶科能源	900	6,390.00	0.00
320	603899	晨光股份	200	6,256.00	0.00
321	600186	莲花控股	1,800	6,174.00	0.00
322	600132	重庆啤酒	100	6,070.00	0.00
323	002991	甘源食品	100	6,065.00	0.00
324	603277	银都股份	200	6,008.00	0.00
325	300192	科德教育	600	5,892.00	0.00
326	300880	迦南智能	300	5,889.00	0.00
327	688584	上海合晶	370	5,879.30	0.00
328	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
329	002459	晶澳科技	500	5,600.00	0.00
330	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
331	300102	乾照光电	800	5,136.00	0.00
332	000999	华润三九	120	5,109.60	0.00
333	002919	名臣健康	440	5,108.40	0.00
334	688599	天合光能	300	5,076.00	0.00
335	300450	先导智能	300	4,989.00	0.00
336	000408	藏格矿业	200	4,814.00	0.00
337	002707	众信旅游	800	4,592.00	0.00
338	603341	龙旗科技	120	4,498.80	0.00
339	600721	百花医药	700	4,060.00	0.00
340	300836	佰奥智能	100	3,979.00	0.00
341	300872	天阳科技	300	3,975.00	0.00
342	600979	广安爱众	1,100	3,696.00	0.00
343	003025	思进智能	300	3,693.00	0.00
344	002068	黑猫股份	500	3,550.00	0.00
345	001289	龙源电力	200	3,450.00	0.00
346	688222	成都先导	300	3,405.00	0.00
347	002835	同为股份	200	3,378.00	0.00
348	603344	星德胜	144	3,263.04	0.00
349	300758	七彩化学	300	3,225.00	0.00
350	603055	台华新材	300	3,039.00	0.00
351	300316	晶盛机电	100	2,873.00	0.00
352	002845	同兴达	200	2,644.00	0.00
353	600727	鲁北化工	400	2,520.00	0.00
354	603381	永臻股份	100	2,513.00	0.00
355	300707	威唐工业	200	2,476.00	0.00
356	300100	双林股份	200	2,154.00	0.00
357	000700	模塑科技	400	2,100.00	0.00
358	603108	润达医疗	100	1,514.00	0.00
359	603332	苏州龙杰	100	737.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	18,542,185.00	7.22
2	601318	中国平安	16,021,906.00	6.24
3	000333	美的集团	15,479,883.00	6.03
4	600519	贵州茅台	15,036,223.00	5.85
5	601166	兴业银行	14,810,749.50	5.77
6	600153	建发股份	12,882,171.00	5.01
7	300750	宁德时代	10,376,493.80	4.04
8	600900	长江电力	10,361,657.00	4.03
9	000651	格力电器	9,742,881.00	3.79
10	600919	江苏银行	8,708,551.00	3.39
11	601288	农业银行	8,240,322.00	3.21
12	601668	中国建筑	6,908,923.00	2.69
13	000932	华菱钢铁	6,777,167.00	2.64
14	002466	天齐锂业	6,729,328.46	2.62
15	601328	交通银行	6,604,291.00	2.57
16	000001	平安银行	6,335,180.00	2.47
17	002324	普利特	6,213,359.80	2.42
18	000568	泸州老窖	6,125,133.00	2.38
19	300274	阳光电源	6,093,472.00	2.37
20	601229	上海银行	6,048,407.34	2.35
21	002415	海康威视	5,868,756.00	2.28
22	600016	民生银行	5,384,437.00	2.10
23	002544	普天科技	5,369,931.00	2.09

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	20,159,925.50	7.85
2	600036	招商银行	17,915,977.67	6.97
3	600153	建发股份	14,635,996.30	5.70
4	601318	中国平安	14,569,768.00	5.67
5	601166	兴业银行	14,204,444.87	5.53
6	000651	格力电器	13,091,292.83	5.10



7	300750	宁德时代	10,095,843.20	3.93
8	600900	长江电力	8,517,555.00	3.32
9	002466	天齐锂业	8,246,159.00	3.21
10	600919	江苏银行	8,138,789.00	3.17
11	002324	普利特	7,826,917.00	3.05
12	601288	农业银行	7,351,044.00	2.86
13	000932	华菱钢铁	7,176,856.00	2.79
14	300274	阳光电源	6,935,157.00	2.70
15	601668	中国建筑	6,700,572.00	2.61
16	601088	中国神华	6,674,862.00	2.60
17	600519	贵州茅台	6,208,043.00	2.42
18	601012	隆基绿能	6,021,740.00	2.34
19	002544	普天科技	5,780,057.90	2.25
20	601229	上海银行	5,618,920.00	2.19
21	601328	交通银行	5,552,999.00	2.16
22	002415	海康威视	5,547,229.00	2.16
23	000001	平安银行	5,543,891.00	2.16
24	601009	南京银行	5,457,107.00	2.12
25	601818	光大银行	5,433,866.00	2.12
26	601919	中远海控	5,333,429.70	2.08
27	601077	渝农商行	5,224,196.00	2.03
28	600089	特变电工	5,217,462.80	2.03
29	600048	保利发展	5,166,765.00	2.01
30	600015	华夏银行	5,143,335.29	2.00

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	867,998,349.22
卖出股票的收入（成交）总额	866,588,968.32

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	-	-
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）	121,728,285.46	46.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,728,285.46	46.67

## 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	113021	中信转债	140,110	16,554,457.14	6.35
2	113050	南银转债	116,880	14,658,164.17	5.62
3	127032	苏行转债	94,190	11,839,966.86	4.54
4	110079	杭银转债	94,550	11,418,541.87	4.38
5	127020	中金转债	67,140	8,086,902.63	3.10

## 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，南京银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局淮安监管分局、国家外汇管理局江苏省分局的处罚。杭州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北京市分局、国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行济南分行、国家外汇管理局湖州市分局、国家金融监督管理总局的处罚。江苏常熟农村商业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局扬州监管分局的处罚。苏州银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家金融监督管理总局无锡监管分局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

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

### 7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	89,174.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,804.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,979.97

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113021	中信转债	16,554,457.14	6.35
2	113050	南银转债	14,658,164.17	5.62
3	127032	苏行转债	11,839,966.86	4.54
4	110079	杭银转债	11,418,541.87	4.38
5	127020	中金转债	8,086,902.63	3.10
6	128087	孚日转债	7,454,813.97	2.86

7	113062	常银转债	3,670,601.10	1.41
8	127086	恒邦转债	3,261,141.63	1.25
9	128042	凯中转债	2,849,828.75	1.09
10	123184	天阳转债	2,825,875.18	1.08
11	113516	苏农转债	2,791,285.45	1.07
12	113527	维格转债	2,786,786.18	1.07
13	123213	天源转债	2,774,624.99	1.06
14	127101	豪鹏转债	2,761,527.34	1.06
15	127049	希望转 2	2,699,347.16	1.04
16	113033	利群转债	2,697,013.63	1.03
17	123226	中富转债	2,678,538.55	1.03
18	128141	旺能转债	2,674,258.88	1.03
19	123011	德尔转债	2,658,114.41	1.02
20	113602	景 20 转债	2,637,948.10	1.01
21	113669	景 23 转债	2,594,921.46	0.99
22	123225	翔丰转债	2,469,278.13	0.95
23	113662	豪能转债	2,401,727.52	0.92
24	113532	海环转债	2,296,748.81	0.88
25	128048	张行转债	2,185,871.55	0.84

#### 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
博时量化平衡混合 A	3,148	64,179.60	177,466,130.89	87.84%	24,571,243.59	12.16%
博时量化平衡混合 C	4	2,062.80	-	-	8,251.21	100.00%
合计	3,152	64,100.77	177,466,130.	87.83%	24,579,494.8	12.17

			89		0	%
--	--	--	----	--	---	---

## 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	博时量化平衡混合 A	47,572.78	0.02%
	博时量化平衡混合 C	47.81	0.58%
	合计	47,620.59	0.02%

## 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	博时量化平衡混合 A	-
	博时量化平衡混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化平衡混合 A	0~10
	博时量化平衡混合 C	-
	合计	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化平衡混合 A	博时量化平衡混合 C
基金合同生效日（2017 年 5 月 4 日）基金份额总额	262,251,781.89	-
本报告期期初基金份额总额	200,679,663.00	47.81
本报告期基金总申购份额	3,283,460.84	22,972.75
减：本报告期基金总赎回份额	1,925,749.36	14,769.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	202,037,374.48	8,251.21

## § 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	
中信证券	1	206,359,374.06	11.90%	195,197.65	12.78%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	230,005,064.56	13.26%	171,561.30	11.23%	增加 1 个

中金公司	2	71,906,925.91	4.15%	68,016.09	4.45%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	20,582,586.27	1.19%	19,469.17	1.27%	-
长江证券	1	206,547,769.11	11.91%	195,373.92	12.79%	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	48,135,233.16	2.78%	45,530.81	2.98%	-
平安证券	1	34,454,844.77	1.99%	32,590.77	2.13%	-
天风证券	2	109,098,812.42	6.29%	81,377.39	5.33%	增加 1 个
方正证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	68,615,977.40	3.96%	64,907.86	4.25%	-
国金证券	1	233,750,303.39	13.48%	217,457.60	14.23%	-
长城证券	1	122,975,095.00	7.09%	91,728.44	6.00%	增加 1 个
兴业证券	1	116,558,727.41	6.72%	110,253.16	7.22%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	49,158,191.62	2.83%	36,666.53	2.40%	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	183,435,078.19	10.58%	173,511.94	11.36%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	32,575,336.75	1.88%	24,298.67	1.59%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	145,451,122.01	16.16%	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
开源证券	118,392,686.07	13.16%	-	-	-	-
中金公司	84,210,426.82	9.36%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	133,459,833.14	14.83%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	55,516,863.64	6.17%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	17,266,173.55	1.92%	-	-	-	-
国金证券	92,234,221.30	10.25%	-	-	-	-
长城证券	38,441,519.52	4.27%	-	-	-	-
兴业证券	112,257,781.28	12.47%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-



光大证券	83,874,654 .28	9.32%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	18,822,898 .39	2.09%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

### 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	博时量化平衡混合型证券投资基金(博时量化平衡混合 A) 基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
2	博时量化平衡混合型证券投资基金(博时量化平衡混合 C) 基金产品资料概要更新	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
8	博时量化平衡混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	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	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-13
10	博时量化平衡混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-29

		网站	
11	博时量化平衡混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024-05-10~2024-06-30	-	171,032,744.49	-	171,032,744.49	84.65%
	2	2024-01-01~2024-05-09	171,032,744.49	-	171,032,744.49	-	-

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化平衡混合型证券投资基金设立的文件

- 2、《博时量化平衡混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化平衡混合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、博时量化平衡混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时量化平衡混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日