

博时研究慧选混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：二〇二四年三月二十九日

§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。本年度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 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	15
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

8.6 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	61
8.7 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	61
8.8 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	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.3 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	63
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时研究慧选混合型证券投资基金	
基金简称	博时研究慧选混合	
基金主代码	012153	
交易代码	012153	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 8 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	117,649,317.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
下属分级基金的交易代码	012153	012154
报告期末下属分级基金的份额总额	103,037,611.23 份	14,611,706.40 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产配置和深度挖掘具备良好成长潜力及合理估值的个股，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过跟踪考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势、外汇占款等）及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，判断经济周期当前所处的位置及未来发展方向，并通过监测重要行业的产能利用与经济景气轮动研究，调整股票资产和固定收益资产的配置比例。本基金的投资策略还包括股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、流通受限证券投资策略、参与融资业务的投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债综合财富(总值)指数收益率×30%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年		2021 年 6 月 8 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
本期已实现收益	-3,997,354.64	-660,595.99	-10,625,315.80	-1,617,181.27	69,931,529.69	5,523,140.83
本期利润	-5,429,676.49	-847,546.43	-35,316,646.61	-5,921,199.63	98,344,138.20	7,047,431.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0495	-0.0544	-0.2699	-0.2957	0.2431	0.2196
本期加权平均净值利润率	-5.01%	-5.58%	-25.82%	-28.40%	22.65%	20.23%
本期基金份额净值增长率	-5.46%	-6.03%	-19.55%	-20.03%	23.35%	22.93%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
期末可供分配利润	-6,371,754.02	-1,112,914.17	-884,614.22	-280,702.45	26,162,861.77	4,027,168.77
期末可供分配基金份额利润	-0.0618	-0.0762	-0.0076	-0.0169	0.1694	0.1655
期末基金资产净值	96,665,857.21	13,498,792.23	114,958,276.63	16,316,433.87	190,461,490.44	29,916,854.02
期末基金份额净值	0.9382	0.9238	0.9924	0.9831	1.2335	1.2293
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
基金份额累计净值增长率	-6.18%	-7.62%	-0.76%	-1.69%	23.35%	22.93%

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

1. 博时研究慧选混合 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
过去三个月	-5.21%	0.89%	-4.47%	0.56%	-0.74%	0.33%
过去六个月	-6.70%	0.98%	-7.02%	0.60%	0.32%	0.38%
过去一年	-5.46%	0.91%	-6.73%	0.59%	1.27%	0.32%
自基金合同生效起至今	-6.18%	1.07%	-22.93%	0.75%	16.75%	0.32%

2. 博时研究慧选混合 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
过去三个月	-5.37%	0.89%	-4.47%	0.56%	-0.90%	0.33%
过去六个月	-6.99%	0.98%	-7.02%	0.60%	0.03%	0.38%
过去一年	-6.03%	0.91%	-6.73%	0.59%	0.70%	0.32%

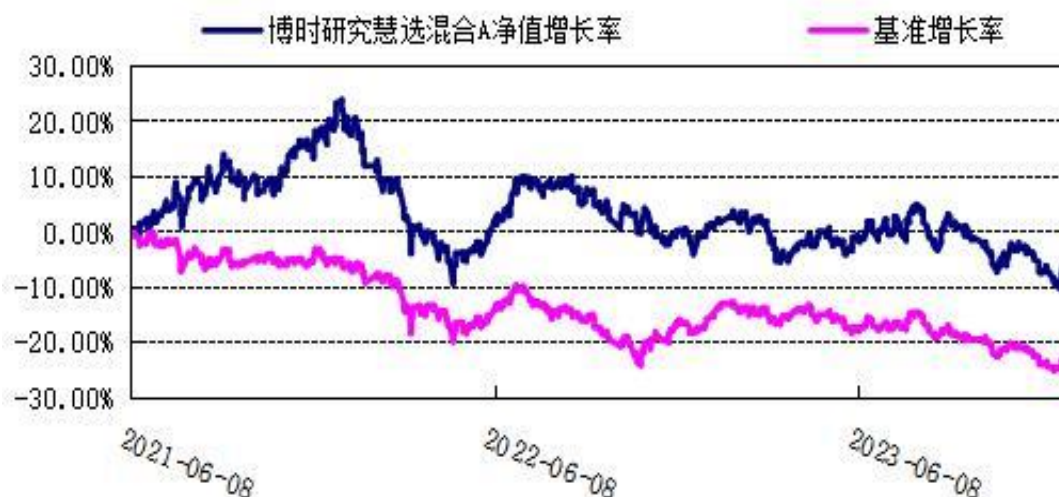
自基金合同生效起至今	-7.62%	1.07%	-22.93%	0.75%	15.31%	0.32%
------------	--------	-------	---------	-------	--------	-------

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

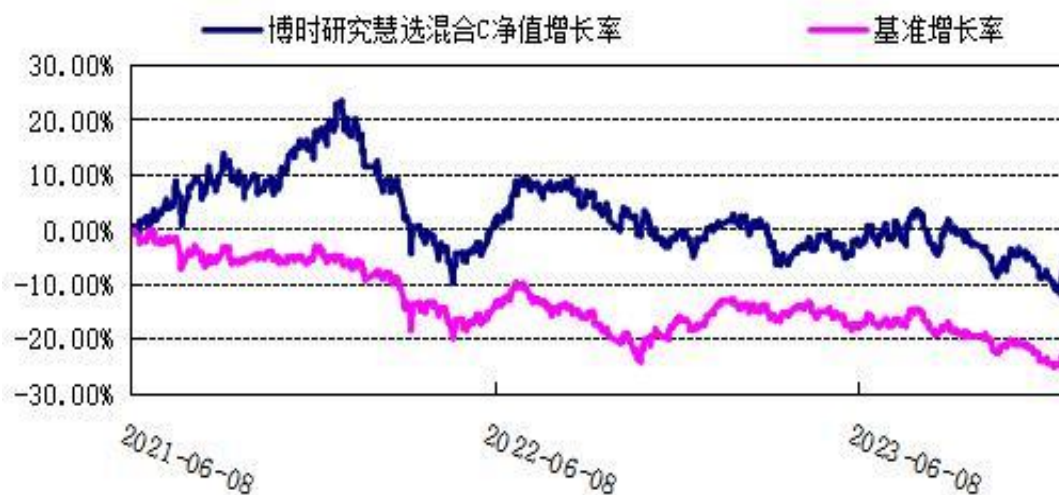
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年6月8日至2023年12月31日)

1、博时研究慧选混合 A



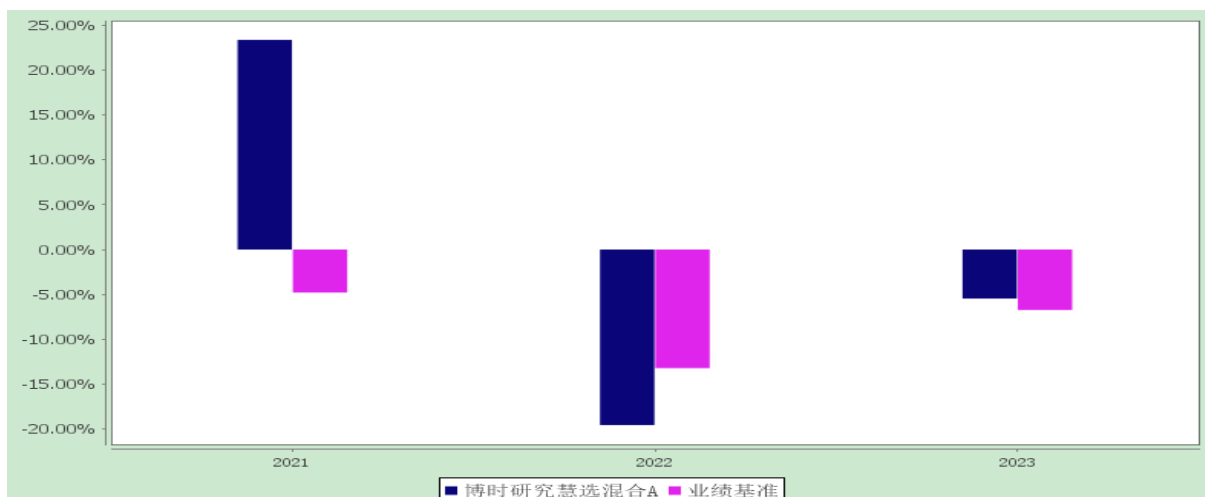
2、博时研究慧选混合 C



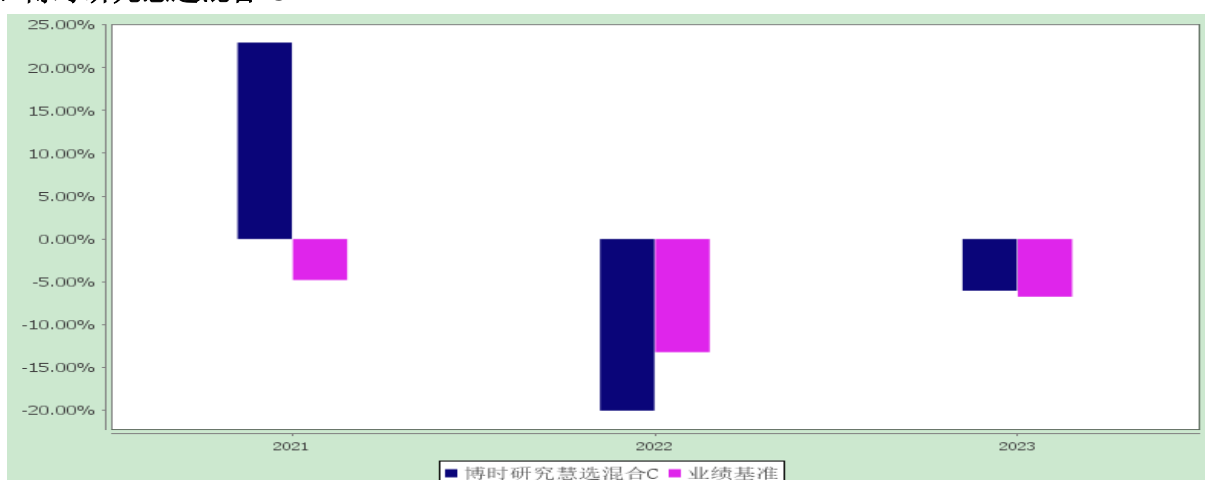
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时研究慧选混合 A



2、博时研究慧选混合 C



注：本基金的基金合同于 2021 年 6 月 8 日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 367 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 14668 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 5478 亿元人民币，累计分红逾 1936 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。

其他大事件

深圳证券交易所发布 2023 年度基金市场优秀机构和个人评选结果，博时基金荣获“优秀 ETF 研究支持奖”。

中债金融估值中心有限公司发布 2023 年度中债指数用户综合评价结果，博时基金管理有限公司荣获“行业发展领军机构”。

12 月 28 日，中国证券报第二十届中国基金业金牛奖榜单出炉，博时基金凭借领先的综合实力，荣膺“海外投资金牛基金公司”“金牛奖 20 周年特别贡献公司”两个奖项。

10 月 25 日，中央国债登记结算有限责任公司重磅揭晓中债指数“20 周年 20 人”行业领军人物。博时基金董事长江向阳荣获中债指数“20 周年 20 人”行业领军人物。

9 月，中国保险资产管理业协会公布 2022 年度中国保险资产管理业“最受险资欢迎投资业务合作机构”基金公司推介结果，博时基金荣获“中国保险资产管理行业 20 年突出贡献合作机构”“最受险资欢迎公募基金公司——固收类公募产品业务”“最受险资欢迎公募基金公司——单一资产管理计划业务”三项推介。

8 月 17 日，由上海证券报主办的第二十届“金基金”奖出炉，博时基金凭借优秀的资产管理能力荣获“金基金 债券投资回报基金管理公司奖”，体现出行业和专业评价机构对公司的高度认可。此外，博时基金凭借《固收的夏日海边茶会》精彩投教案例斩获上海证券报举办的首届投教类奖项“上证 中国基金投教最佳案例奖”。

6 月 7 日，第十八届中国基金业明星基金奖出炉，博时基金荣获三项大奖。博时基金管理有限公司荣获“三年量化投资明星基金公司”，博时新收益灵活配置混合荣获“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”，博时安盈债券荣获“五年持续回报普通债券型明星基金奖”。

5 月 26 日，由北京济安金信科技有限公司主办的第四届济安“群星汇”评选结果揭晓，博时基金凭借卓越的综合资产管理能力荣获基金公司综合奖济安群星汇“五星奖”、“众星奖”，基金公司单项奖“一级债基金管理奖”。博时旗下产品博时合惠货币市场基金获得了“货币型基金”产品奖，博时稳健回报债券（LOF）获得了“一级债基金”产品奖。

4 月 6 日，中国人民银行公布了“2021 年度金融科技发展奖”的获奖名单，博时基金的“云原生信创注册登记（TA）系统”和“基于超自动化的新一代基金运营管理平台”双双荣获二等奖。

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		
于玥	基金经理	2022-02-09	2023-02-24	10.4	于玥女士，硕士。2013 年起先后在光大金控资产管理有限公司、中金公司、中金基金工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时研究慧选混合型证券投资基金(2022 年 2 月 9 日-2023 年 2 月 24 日)基金经理。现任博时第三产业成长混合型证券投资基金(2022 年 2 月 9 日—至今)的基金经理。
冀楠	基金经理	2021-11-08	2023-02-24	11.3	冀楠女士，硕士。2012 年起先后在华创证券、泰达宏利基金工作。2021 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时研究慧选混合型证券投资基金(2021 年 11 月 8 日-2023 年 2 月 24 日)基金经理。现任博时精选混合型证券投资基金(2021 年 5 月 18 日—至今)、博时核心资产精选混合型证券投资基金(2021 年 9 月 17 日—至今)、博时厚泽回报灵活配置混合型证券投资基金(2021 年 11 月 8 日—至今)、博时卓越品牌混合型证券投资基金（LOF）(2022 年 7 月 22 日—至今)、博时优质精选混合型证券投资基金(2022 年 8 月 22 日—至今)、博时厚泽匠选一年持有期混合型证券投资基金(2023 年 4 月 28 日—至今)的基金经理。
吴鹏	基金经理	2023-02-24	-	7.7	吴鹏先生，硕士。2011 年至 2012 年参加大学生西部计划支教。2016 年从上海交通大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员兼基金经理助理、博时研究优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）(2020 年 10 月 28 日-2023 年 9 月 1 日)基金经理。现任博时研究慧选混合型证券

					投资基金(2023年2月24日—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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 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。

4.3.3 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 195 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年全年，A 股市场延续弱势表现，沪深 300 指数下跌-11.38%，上证指数下跌-3.70%，创业板指数下跌-19.41%；香港市场表现相对较弱，恒生指数下跌-8.83%，恒生中国企业指数下跌-13.97%。市场表现较弱主要系整体风险偏好下降，背后有对国内经济预期的分歧、有对国际地缘政

治变化的担忧等因素。在整体市场疲弱背景下，指数表现也分化显著。表现较好的板块包括：与 AI 关联度较高的通信、传媒、计算机、电子等板块，与资源相关的石油石化和煤炭板块。而表现较差的板块主要包括：与地产走弱相关的房地产、建筑材料板块，与消费预期担忧有关的美容护理、商贸零售、社会服务、食品饮料板块，与供给端担忧有关的电力设备板块。全年简单回顾下来，管理人在二季度/三季度券商保险、三季度煤炭等抓住了机会并实现一定收益，不足的地方包括不限于：一季度末低估经济下行幅度在顺周期方面损失、二季度 AI 行情把握不足、四季度持仓风偏较高回撤较大。基金净值收益从结果上来看即机会抓取贡献的净值与错误损失的净值之和，未来我们继续努力，力争不断提升投资人的投资体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9382 元，份额累计净值为 0.9382 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9238 元，份额累计净值为 0.9238 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-5.46%，本基金 C 类基金份额净值增长率为-6.03%，同期业绩基准增长率为-6.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2024 年的宏观环境，我们作如下展望：从经济维度，中长期我们仍旧看好国内经济的韧性，短期国内经济则如市场普遍担忧的，存在一些短期挑战：房地产市场持久的低迷、地方债务背景下的财政新范式、地缘政治贸易争端、制造业转移，以及经济担忧背景下的企业家及居民信心问题。当然，我们认为这些都是经济结构转型过程中的过往问题暴露产生的阵痛，我们也将不断跟踪与经历这些背景下的国内经济周期波动及政策应对。比较正面的是，我们看到 2023 年 7 月以来，国内对经济呵护政策不断，货币上的降准降息、住房领域以北上广深一线城市为代表开启了多轮的放松动作、财政领域则包括再融资债券/万亿国债等。诚然一些矛盾仍需要时间去消化，但我们整体认为市场在经历了持续几年的大幅下跌后，已然更加可为。正如大家在四季报中看到，管理人四季度的持仓在 2024 年开年初便经历了不小挑战，管理人也在复杂市场中积极做应对。未来管理人加大宏观及中微观的波动的敏锐度，把握相关领域的投资机会，目前组合相对布局的方向主要包括有色、电子、财险以及部分细分领域的优质企业等方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进

建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合约义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告。

报告期内，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全投资管理相关的管理机制，完善了《信用评级管理办法》、《个人养老金业务管理制度》、《风险事件管理制度》、《股票池管理办法》、《交易管理制度》、《交易监督管理制度》、《基金资产估值委员会制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台进行迭代更新，搭建了“博时合规管理及审计系统”，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则为：由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销

售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 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 托管人对本年度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本基金 2023 年年度报告中财务指标、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 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 26853 号

博时研究慧选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了博时研究慧选混合型证券投资基金(以下简称“博时研究慧选混合”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了博时研究慧选混合 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博时研究慧选混合,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时研究慧选混合的基金管理人博时基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估博时研究慧选混合的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算博时研究慧选混合、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时研究慧选混合的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博时研究慧选混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时研究慧选混合不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

叶尔甸 陈轶杰

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时研究慧选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	6,147,888.51	8,306,299.54
结算备付金		1,647,641.50	2,716,974.72
存出保证金		69,470.19	21,874.78
交易性金融资产	7.4.7.2	101,838,330.31	91,283,536.85
其中：股票投资		101,634,444.50	91,283,536.85
基金投资		-	-
债券投资		203,885.81	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	28,635,001.96
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	7.4.7.5	-	-
应收清算款		2,104,453.79	2,010,996.08
应收股利		-	-
应收申购款		10,375.02	7,114.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		111,818,159.32	132,981,798.30
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		710,711.60	1,259,082.02
应付赎回款		203,391.30	19,038.79
应付管理人报酬		111,481.16	167,226.98

应付托管费		18,580.19	27,871.17
应付销售服务费		6,798.48	8,340.87
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	7.4.7.7	602,547.15	225,527.97
负债合计		1,653,509.88	1,707,087.80
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	117,649,317.63	132,440,027.17
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	-7,484,668.19	-1,165,316.67
净资产合计		110,164,649.44	131,274,710.50
负债和净资产总计		111,818,159.32	132,981,798.30

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 117,649,317.63 份。其中 A 类基金份额净值 0.9382 元，基金份额总额 103,037,611.23 份；C 类基金份额净值 0.9238 元，基金份额总额 14,611,706.40 份。

7.2 利润表

会计主体：博时研究慧选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-4,039,751.87	-38,137,726.35
1.利息收入		145,898.86	552,420.89
其中：存款利息收入	7.4.7.10	69,296.46	88,075.22
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		76,602.40	464,345.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,572,492.47	-9,770,105.10
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-3,592,024.72	-11,403,356.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	6,282.56	207,017.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-250,219.17	-
股利收益	7.4.7.15	1,263,468.86	1,426,233.81
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）	7.4.7.16	-1,619,272.29	-28,995,349.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,114.03	75,307.03
减：二、营业总支出		2,237,471.05	3,100,119.89
1. 管理人报酬		1,685,170.39	2,376,246.76
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		280,861.67	396,041.08
3. 销售服务费		91,377.25	126,016.08
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		157.51	0.33
8. 其他费用	7.4.7.19	179,904.23	201,815.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,277,222.92	-41,237,846.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,277,222.92	-41,237,846.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,277,222.92	-41,237,846.24

7.3 净资产变动表

会计主体：博时研究慧选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	132,440,027.17	-1,165,316.67	131,274,710.50
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	132,440,027.17	-1,165,316.67	131,274,710.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,790,709.54	-6,319,351.52	-21,110,061.06
（一）、综合收益	-	-6,277,222.92	-6,277,222.92

总额			
(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)	-14,790,709.54	-42,128.60	-14,832,838.14
其中: 1.基金申购款	5,841,055.90	-129,102.76	5,711,953.14
2.基金赎回款	-20,631,765.44	86,974.16	-20,544,791.28
(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	117,649,317.63	-7,484,668.19	110,164,649.44
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	178,746,028.37	41,632,316.09	220,378,344.46
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	178,746,028.37	41,632,316.09	220,378,344.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,306,001.20	-42,797,632.76	-89,103,633.96
(一)、综合收益总额	-	-41,237,846.24	-41,237,846.24
(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)	-46,306,001.20	-1,559,786.52	-47,865,787.72
其中: 1.基金申购款	34,667,749.60	4,219,595.99	38,887,345.59
2.基金赎回款	-80,973,750.80	-5,779,382.51	-86,753,133.31

（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	132,440,027.17	-1,165,316.67	131,274,710.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：陈子成

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时研究慧选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]747 号《关于准予博时研究慧选混合型证券投资基金注册的批复》核准，由博时基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 798,675,951.74 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0545 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 798,851,801.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 175,849.73 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易

互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债、次级债等)、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。基金的投资组合比例为:本基金的股票(含存托凭证)资产投资比例为基金资产的 60%-95%, 港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金以后, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率 \times 60%+中证港股通综合指数收益率 \times 10%+中债综合财富(总值)指数收益率 \times 30%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为

衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具

的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)

等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点

的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	6,147,888.51	8,306,299.54
等于：本金	6,147,221.96	8,304,536.24
加：应计利息	666.55	1,763.30
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	6,147,888.51	8,306,299.54

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	102,312,243.17	-	101,634,444.50	-677,798.67	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	199,944.00	3,865.81	203,885.81	76.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	199,944.00	3,865.81	203,885.81	76.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	102,512,187.17	3,865.81	101,838,330.31	-677,722.67	
项目	上年度末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	90,341,987.23	-	91,283,536.85	941,549.62	

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	90,341,987.23	-	91,283,536.85	941,549.62

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	28,635,001.96	-
银行间市场	-	-
合计	28,635,001.96	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他权益工具投资

7.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.37	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	440,045.78	41,027.97
其中：交易所市场	440,045.78	41,027.97
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	162,500.00	184,500.00
合计	602,547.15	225,527.97

7.4.7.8 实收基金
博时研究慧选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	115,842,890.85	115,842,890.85
本期申购	3,251,161.39	3,251,161.39
本期赎回（以“-”号填列）	-16,056,441.01	-16,056,441.01
本期末	103,037,611.23	103,037,611.23

博时研究慧选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	16,597,136.32	16,597,136.32
本期申购	2,589,894.51	2,589,894.51
本期赎回（以“-”号填列）	-4,575,324.43	-4,575,324.43
本期末	14,611,706.40	14,611,706.40

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)。

7.4.7.9 未分配利润
博时研究慧选混合 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	10,558,726.42	-11,443,340.64	-884,614.22
本期期初	10,558,726.42	-11,443,340.64	-884,614.22
本期利润	-3,997,354.64	-1,432,321.85	-5,429,676.49

本期基金份额交易产生的变动数	-1,275,464.33	1,218,001.02	-57,463.31
其中：基金申购款	279,126.75	-331,727.76	-52,601.01
基金赎回款	-1,554,591.08	1,549,728.78	-4,862.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,285,907.45	-11,657,661.47	-6,371,754.02

博时研究慧选混合 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	1,351,136.96	-1,631,839.41	-280,702.45
本期期初	1,351,136.96	-1,631,839.41	-280,702.45
本期利润	-660,595.99	-186,950.44	-847,546.43
本期基金份额交易产生的变动数	-159,759.50	175,094.21	15,334.71
其中：基金申购款	216,380.91	-292,882.66	-76,501.75
基金赎回款	-376,140.41	467,976.87	91,836.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	530,781.47	-1,643,695.64	-1,112,914.17

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	36,188.24	47,249.39
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	31,976.06	39,720.35
其他	1,132.16	1,105.48
合计	69,296.46	88,075.22

7.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,150,578,110.58	360,477,775.31
减：卖出股票成本总额	1,150,960,555.99	370,904,451.14
减：交易费用	3,209,579.31	976,680.61
买卖股票差价收入	-3,592,024.72	-11,403,356.44

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	889.02	84.41
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	5,393.54	206,933.12
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	6,282.56	207,017.53

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到 期兑付)成交总额	120,164.82	430,237.46
减: 卖出债券(债转股及债 券到期兑付)成本总额	114,600.00	223,200.00
减: 应计利息总额	166.53	87.08
减: 交易费用	4.75	17.26
买卖债券差价收入	5,393.54	206,933.12

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-250,219.17	-

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,263,468.86	1,426,233.81
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	1,263,468.86	1,426,233.81

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-1,619,272.29	-28,995,349.17
——股票投资	-1,619,348.29	-28,995,349.17
——债券投资	76.00	-
——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	-1,619,272.29	-28,995,349.17

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	4,592.80	74,660.10
基金转换费收入	1,521.23	646.93

合计	6,114.03	75,307.03
----	----------	-----------

7.4.7.18 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	38,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	917.50	-
银行汇划费	2,986.73	3,815.64
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	179,904.23	201,815.64

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议，股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。于 2023 年 8 月 29 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，本次股东变更完成后，基金管理人股权结构为：招商证券股份有限公司 49%，中国长城资产管理股份有限公司 25%，上海汇华实业有限公司 12%，

天津港(集团)有限公司 6%，上海盛业股权投资基金有限公司 6%和浙江省国贸集团资产经营有限公司 2%。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	49,991,936.41	2.16%	11,837,891.05	1.83%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	590,500,000.00	9.65%

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	40,516.73	2.28%	30,414.40	6.91%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

		总量的比例		金总额的比例
招商证券	8,656.70	1.56%	5,477.92	13.35%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,685,170.39	2,376,246.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	789,652.54	1,103,532.16
应支付基金管理人的净管理费	895,517.85	1,272,714.60

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	280,861.67	396,041.08

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	合计

中国工商银行	-	41,735.96	41,735.96
博时基金	-	194.07	194.07
招商证券	-	45.43	45.43
合计	-	41,975.46	41,975.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C	合计
中国工商银行	-	53,998.69	53,998.69
博时基金	-	787.73	787.73
招商证券	-	124.87	124.87
合计	-	54,911.29	54,911.29

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 0.60% 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 × 0.60% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	6,147,888.51	36,188.24	8,306,299.54	47,249.39

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	301123	奕东电子	网下发行	1,674.00	62,323.02
招商证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	40,187.00	579,898.41
招商证券股份有限公司	001323	慕思股份	网下发行	573.00	22,306.89

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券
7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	首次公开发行限售	46.77	87.72	76.00	3,554.52	6,666.72	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	首次公开发行限售	78.99	60.49	92.00	7,267.08	5,565.08	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	首次公开发行限售	26.74	38.67	123.00	3,289.02	4,756.41	-
688638	誉辰智能	2023-07-04	6 个月	首次公开发行限售	83.90	59.68	56.00	4,698.40	3,342.08	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。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在严格控制风险的前提下,通过大类资产配置和深度挖掘具备良好成长潜力及合理估值的个股,力争获得超越业绩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内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	203,885.81	-
合计	203,885.81	-

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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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约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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让

的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	6,147,888.51	-	-	-	6,147,888.51
结算备付金	1,647,641.50	-	-	-	1,647,641.50
存出保证金	69,470.19	-	-	-	69,470.19
交易性金融资产	203,885.81	-	-	101,634,444.50	101,838,330.31
应收清算款	-	-	-	2,104,453.79	2,104,453.79

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,375.02	10,375.02
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,068,886.01	-	-	103,749,273.31	111,818,159.32
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	203,391.30	203,391.30
应付清算款	-	-	-	710,711.60	710,711.60
应付管理人报酬	-	-	-	111,481.16	111,481.16
应付托管费	-	-	-	18,580.19	18,580.19
应付销售服务费	-	-	-	6,798.48	6,798.48
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	602,547.15	602,547.15
负债总计	-	-	-	1,653,509.88	1,653,509.88
利率敏感度缺口	8,068,886.01	-	-	102,095,763.43	110,164,649.44
上年度末					
2022 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	8,306,299.54	-	-	-	8,306,299.54
结算备付金	2,716,974.72	-	-	-	2,716,974.72
存出保证金	21,874.78	-	-	-	21,874.78
交易性金融资产	-	-	-	91,283,536.85	91,283,536.85
应收清算款	-	-	-	2,010,996.08	2,010,996.08
买入返售金融资产	28,635,001.96	-	-	-	28,635,001.96
应收申购款	-	-	-	7,114.37	7,114.37
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,680,151.00	-	-	93,301,647.30	132,981,798.30
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	19,038.79	19,038.79
应付清算款	-	-	-	1,259,082.02	1,259,082.02
应付管理人报酬	-	-	-	167,226.98	167,226.98
应付托管费	-	-	-	27,871.17	27,871.17
应付销售服务费	-	-	-	8,340.87	8,340.87
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	225,527.97	225,527.97
负债总计	-	-	-	1,707,087.80	1,707,087.80
利率敏感度缺口	39,680,151.00	-	-	91,594,559.50	131,274,710.50

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。

7.4.13.4.1.2 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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.上年度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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	8,984,569.56	8,984,569.56
资产合计	-	8,984,569.56	8,984,569.56
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	8,984,569.56	8,984,569.56
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
资产合计	-	-	-
以外币计价的			

负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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）	
分析		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.所有港币均相对人民币升值 5%	增加约 45	-
	2.所有港币均相对人民币贬值 5%	减少约 45	-

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	101,634,444.50	92.26	91,283,536.85	69.54
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	101,634,444.50	92.26	91,283,536.85	69.54

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。

7.4.13.4.3.2 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		
	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）	
分析		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 517	增加约 455
	业绩比较基准下降 5%	减少约 517	减少约 455

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	101,614,114.21	91,283,536.85
第二层次	203,885.81	-
第三层次	20,330.29	-
合计	101,838,330.31	91,283,536.85

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	89,616.23	89,616.23
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	85,627.74	85,627.74
当期利得或损失总额	-	16,341.80	16,341.80
其中：计入损益的利得或损失	-	16,341.80	16,341.80
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	20,330.29	20,330.29
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,521.27	1,521.27
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价	采用的估值技	不可观察输入值
----	--------	--------	---------

	值	术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	20,330.29	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.55%-31.13%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 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（上年度末：同）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	101,634,444.50	90.89
	其中：股票	101,634,444.50	90.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	203,885.81	0.18
	其中：债券	203,885.81	0.18
	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	7,795,530.01	6.97
8	其他各项资产	2,184,299.00	1.95
9	合计	111,818,159.32	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 8,984,569.56 元，净值占比 8.16%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,950,332.00	4.49
C	制造业	70,488,122.72	63.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,469,106.00	2.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,755,191.22	2.50
J	金融业	10,264,220.00	9.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,266,024.00	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	16,967.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	439,912.00	0.40
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,649,874.94	84.10

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
电信业务	718,378.72	0.65
公用事业	5,201.70	0.00
金融	6,519,796.16	5.92
医疗保健	1,741,192.98	1.58
合计	8,984,569.56	8.16

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.3 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	600426	华鲁恒升	280,883	7,749,561.97	7.03
2	002475	立讯精密	217,600	7,496,320.00	6.80
3	601899	紫金矿业	362,200	4,513,012.00	4.10
4	600961	株冶集团	440,200	3,680,072.00	3.34

5	605305	中际联合	106,100	3,428,091.00	3.11
6	300136	信维通信	143,600	3,388,960.00	3.08
7	300750	宁德时代	20,600	3,363,156.00	3.05
8	300782	卓胜微	23,400	3,299,400.00	2.99
9	2328	中国财险	388,000	3,262,971.98	2.96
10	3908	中金公司	313,600	3,256,824.18	2.96
11	301101	明月镜片	70,300	2,942,758.00	2.67
12	688017	绿的谐波	17,521	2,689,473.50	2.44
13	003000	劲仔食品	201,600	2,463,552.00	2.24
14	688332	中科蓝讯	26,630	2,008,434.60	1.82
15	002142	宁波银行	93,900	1,888,329.00	1.71
16	000708	中信特钢	128,100	1,798,524.00	1.63
17	601702	华峰铝业	99,200	1,780,640.00	1.62
18	600519	贵州茅台	1,000	1,726,000.00	1.57
19	300803	指南针	27,500	1,657,150.00	1.50
20	002273	水晶光电	104,000	1,408,160.00	1.28
21	000858	五粮液	10,000	1,403,100.00	1.27
22	601555	东吴证券	186,500	1,363,315.00	1.24
23	603259	药明康德	17,400	1,266,024.00	1.15
24	601126	四方股份	89,400	1,265,904.00	1.15
25	002415	海康威视	36,400	1,263,808.00	1.15
26	688484	南芯科技	31,560	1,257,666.00	1.14
27	600183	生益科技	67,800	1,241,418.00	1.13
28	601901	方正证券	150,100	1,209,806.00	1.10
29	300408	三环集团	40,800	1,201,560.00	1.09
30	000661	长春高新	8,200	1,195,560.00	1.09
31	688331	荣昌生物	18,360	1,139,421.60	1.03
32	601881	中国银河	91,100	1,097,755.00	1.00
33	600452	涪陵电力	79,140	1,044,648.00	0.95
34	1548	金斯瑞生物 科技	58,000	1,043,856.69	0.95
35	300748	金力永磁	50,800	1,027,176.00	0.93
36	600109	国金证券	101,900	925,252.00	0.84
37	002092	中泰化学	144,500	881,450.00	0.80
38	601688	华泰证券	61,300	855,135.00	0.78
39	002311	海大集团	18,922	849,787.02	0.77
40	688225	亚信安全	45,453	833,608.02	0.76
41	603156	养元饮品	37,600	799,376.00	0.73
42	600011	华能国际	99,500	766,150.00	0.70
43	600809	山西汾酒	3,300	761,409.00	0.69
44	603383	顶点软件	15,100	744,430.00	0.68
45	0700	腾讯控股	2,700	718,378.72	0.65
46	1801	信达生物	18,000	697,336.29	0.63

47	603501	韦尔股份	6,200	661,602.00	0.60
48	600023	浙能电力	142,800	658,308.00	0.60
49	688111	金山办公	2,036	643,783.20	0.58
50	000021	深科技	38,700	627,327.00	0.57
51	002600	领益智造	89,900	607,724.00	0.55
52	688772	珠海冠宇	26,175	576,111.75	0.52
53	600958	东方证券	64,300	559,410.00	0.51
54	300480	光力科技	25,969	554,438.15	0.50
55	600507	方大特钢	118,200	544,902.00	0.49
56	002230	科大讯飞	11,500	533,370.00	0.48
57	000568	泸州老窖	2,900	520,318.00	0.47
58	601456	国联证券	45,800	496,472.00	0.45
59	605155	西大门	31,820	492,573.60	0.45
60	600745	闻泰科技	11,600	490,796.00	0.45
61	600529	山东药玻	18,800	481,280.00	0.44
62	000526	学大教育	8,800	439,912.00	0.40
63	603993	洛阳钼业	84,100	437,320.00	0.40
64	000100	TCL 科技	101,300	435,590.00	0.40
65	603203	快克智能	14,000	404,740.00	0.37
66	600416	湘电股份	14,700	233,436.00	0.21
67	002797	第一创业	35,800	207,998.00	0.19
68	688235	百济神州	1,406	195,490.24	0.18
69	002422	科伦药业	4,500	130,725.00	0.12
70	000888	峨眉山 A	1,900	16,967.00	0.02
71	688627	精智达	76	6,666.72	0.01
72	688563	航材股份	92	5,565.08	0.01
73	2380	中国电力	2,000	5,201.70	0.00
74	688582	芯动联科	123	4,756.41	0.00
75	601059	信达证券	200	3,598.00	0.00
76	688638	誉辰智能	56	3,342.08	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600426	华鲁恒升	19,894,654.00	15.15
2	3908	中金公司	17,502,554.10	13.33
3	0700	腾讯控股	15,041,802.30	11.46
4	002271	东方雨虹	14,383,705.00	10.96
5	601688	华泰证券	13,559,841.90	10.33
6	1024	快手-W	13,386,745.04	10.20
7	002142	宁波银行	12,847,731.00	9.79

8	601628	中国人寿	12,055,046.58	9.18
9	601899	紫金矿业	11,704,956.47	8.92
10	601555	东吴证券	10,882,641.50	8.29
11	300750	宁德时代	10,834,197.00	8.25
12	002475	立讯精密	10,504,487.00	8.00
13	300033	同花顺	10,404,617.29	7.93
14	601857	中国石油	9,899,937.00	7.54
15	601881	中国银河	9,652,391.00	7.35
16	300803	指南针	9,640,982.20	7.34
17	1378	中国宏桥	9,404,955.78	7.16
18	601658	邮储银行	9,168,944.00	6.98
19	601601	中国太保	9,146,835.00	6.97
20	601318	中国平安	8,849,374.84	6.74
21	600155	华创云信	8,809,273.53	6.71
22	600703	三安光电	8,688,210.22	6.62
23	300855	图南股份	8,358,437.42	6.37
24	601528	瑞丰银行	8,164,420.10	6.22
25	0857	中国石油股份	8,044,111.29	6.13
26	605305	中际联合	7,845,122.42	5.98
27	300059	东方财富	7,739,231.80	5.90
28	000933	神火股份	7,587,423.16	5.78
29	300693	盛弘股份	7,263,615.68	5.53
30	9868	小鹏汽车—W	7,234,860.95	5.51
31	603063	禾望电气	7,232,979.00	5.51
32	603383	顶点软件	6,994,857.00	5.33
33	301153	中科江南	6,679,516.60	5.09
34	301339	通行宝	6,675,713.51	5.09
35	688319	欧林生物	6,624,692.24	5.05
36	688186	广大特材	6,604,261.71	5.03
37	300408	三环集团	6,570,020.00	5.00
38	0388	香港交易所	6,512,344.88	4.96
39	601136	首创证券	6,360,099.26	4.84
40	301101	明月镜片	6,258,295.98	4.77
41	002236	大华股份	6,166,864.00	4.70
42	000690	宝新能源	6,161,103.00	4.69
43	601128	常熟银行	6,130,540.00	4.67
44	300782	卓胜微	5,992,925.00	4.57
45	688484	南芯科技	5,855,698.00	4.46
46	600900	长江电力	5,739,228.00	4.37
47	3690	美团—W	5,509,835.81	4.20
48	603191	望变电气	5,489,849.00	4.18

49	688318	财富趋势	5,474,057.96	4.17
50	002922	伊戈尔	5,452,503.91	4.15
51	600765	中航重机	5,417,746.40	4.13
52	000617	中油资本	5,199,922.00	3.96
53	001223	欧克科技	5,169,698.00	3.94
54	002311	海大集团	5,150,291.00	3.92
55	600958	东方证券	5,137,285.00	3.91
56	600266	城建发展	5,122,843.98	3.90
57	688121	卓然股份	5,013,812.13	3.82
58	601901	方正证券	5,004,512.00	3.81
59	301168	通灵股份	4,998,608.00	3.81
60	688332	中科蓝讯	4,905,135.49	3.74
61	600256	广汇能源	4,895,329.97	3.73
62	603606	东方电缆	4,877,515.00	3.72
63	601702	华峰铝业	4,856,793.00	3.70
64	300769	德方纳米	4,786,435.00	3.65
65	300498	温氏股份	4,757,445.70	3.62
66	300727	润禾材料	4,739,336.00	3.61
67	300136	信维通信	4,728,737.00	3.60
68	000858	五粮液	4,680,227.00	3.57
69	688017	绿的谐波	4,555,586.87	3.47
70	6865	福莱特玻璃	4,503,462.30	3.43
71	600031	三一重工	4,497,239.09	3.43
72	000807	云铝股份	4,430,588.00	3.38
73	601838	成都银行	4,396,698.00	3.35
74	688687	凯因科技	4,367,813.30	3.33
75	301155	海力风电	4,193,622.00	3.19
76	300308	中际旭创	4,120,198.00	3.14
77	600085	同仁堂	4,103,770.00	3.13
78	601677	明泰铝业	3,996,213.00	3.04
79	603260	合盛硅业	3,986,240.00	3.04
80	600109	国金证券	3,977,572.00	3.03
81	1171	兖矿能源	3,956,496.89	3.01
82	603259	药明康德	3,936,871.00	3.00
83	688596	正帆科技	3,916,486.99	2.98
84	600309	万华化学	3,874,706.00	2.95
85	600027	华电国际	3,874,703.84	2.95
86	601390	中国中铁	3,825,823.00	2.91
87	2015	理想汽车— W	3,808,194.89	2.90
88	600837	海通证券	3,751,199.00	2.86
89	002797	第一创业	3,743,972.00	2.85
90	002230	科大讯飞	3,742,128.00	2.85

91	000568	泸州老窖	3,738,849.00	2.85
92	000563	陕国投 A	3,701,007.00	2.82
93	600452	涪陵电力	3,698,433.00	2.82
94	688072	拓荆科技	3,669,609.43	2.80
95	1368	特步国际	3,665,746.30	2.79
96	1088	中国神华	3,653,130.14	2.78
97	002895	川恒股份	3,651,770.00	2.78
98	2380	中国电力	3,647,151.83	2.78
99	2601	中国太保	3,646,096.43	2.78
100	600546	山煤国际	3,582,759.00	2.73
101	601225	陕西煤业	3,555,365.00	2.71
102	688590	新致软件	3,543,572.94	2.70
103	300129	泰胜风能	3,495,153.00	2.66
104	000935	四川双马	3,444,905.00	2.62
105	1548	金斯瑞生物 科技	3,403,094.70	2.59
106	601377	兴业证券	3,397,905.00	2.59
107	603163	圣晖集成	3,390,523.00	2.58
108	600000	浦发银行	3,367,747.00	2.57
109	600522	中天科技	3,355,323.95	2.56
110	601818	光大银行	3,336,352.00	2.54
111	600961	株冶集团	3,334,456.00	2.54
112	002709	天赐材料	3,246,417.00	2.47
113	601328	交通银行	3,158,640.00	2.41
114	002941	新疆交建	3,147,113.00	2.40
115	002182	宝武镁业	3,141,342.00	2.39
116	2328	中国财险	3,125,495.20	2.38
117	300274	阳光电源	3,074,339.00	2.34
118	603995	甬金股份	2,998,127.00	2.28
119	9966	康宁杰瑞制 药-B	2,996,050.73	2.28
120	600533	栖霞建设	2,982,791.00	2.27
121	002276	万马股份	2,944,547.00	2.24
122	603369	今世缘	2,911,736.00	2.22
123	000625	长安汽车	2,878,732.00	2.19
124	601689	拓普集团	2,877,747.00	2.19
125	601456	国联证券	2,869,393.00	2.19
126	603737	三棵树	2,865,236.00	2.18
127	688111	金山办公	2,805,555.85	2.14
128	600584	长电科技	2,792,914.00	2.13
129	688239	航宇科技	2,766,020.23	2.11
130	002532	天山铝业	2,728,402.00	2.08
131	000983	山西焦煤	2,702,698.00	2.06

132	300842	帝科股份	2,690,665.00	2.05
133	600975	新五丰	2,686,083.00	2.05
134	688772	珠海冠宇	2,666,195.52	2.03

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。

8.4.2 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	3908	中金公司	14,470,906.24	11.02
2	1024	快手-W	14,396,507.99	10.97
3	002271	东方雨虹	13,798,415.00	10.51
4	0700	腾讯控股	13,531,302.16	10.31
5	601688	华泰证券	13,011,090.00	9.91
6	600519	贵州茅台	11,870,523.00	9.04
7	301101	明月镜片	11,809,417.90	9.00
8	601628	中国人寿	11,804,937.00	8.99
9	601857	中国石油	11,089,515.00	8.45
10	600426	华鲁恒升	10,967,499.33	8.35
11	300033	同花顺	10,635,047.00	8.10
12	002142	宁波银行	10,623,861.00	8.09
13	600155	华创云信	9,578,501.29	7.30
14	601601	中国太保	9,493,912.00	7.23
15	601555	东吴证券	9,292,810.00	7.08
16	1378	中国宏桥	9,174,624.79	6.99
17	601318	中国平安	9,130,487.00	6.96
18	601881	中国银河	9,035,511.77	6.88
19	601658	邮储银行	8,797,665.00	6.70
20	600703	三安光电	8,574,739.00	6.53
21	300855	图南股份	8,346,628.60	6.36
22	0857	中国石油股份	8,274,342.12	6.30
23	601528	瑞丰银行	8,164,304.00	6.22
24	300803	指南针	7,981,387.52	6.08
25	603688	石英股份	7,939,966.00	6.05
26	601225	陕西煤业	7,897,131.00	6.02
27	600765	中航重机	7,869,061.00	5.99
28	300750	宁德时代	7,675,863.20	5.85
29	000933	神火股份	7,613,160.00	5.80
30	9868	小鹏汽车-W	7,549,989.07	5.75
31	300059	东方财富	7,393,691.60	5.63
32	688186	广大特材	7,213,762.68	5.50
33	601899	紫金矿业	7,171,425.00	5.46

34	301153	中科江南	7,159,903.13	5.45
35	300693	盛弘股份	7,010,418.47	5.34
36	301339	通行宝	6,875,526.13	5.24
37	603063	禾望电气	6,761,205.00	5.15
38	601136	首创证券	6,696,284.00	5.10
39	000568	泸州老窖	6,523,436.00	4.97
40	000690	宝新能源	6,499,396.00	4.95
41	0388	香港交易所	6,484,855.34	4.94
42	603383	顶点软件	6,388,625.00	4.87
43	688319	欧林生物	6,371,864.75	4.85
44	603606	东方电缆	6,115,120.00	4.66
45	601128	常熟银行	6,092,807.00	4.64
46	300498	温氏股份	6,032,407.00	4.60
47	600900	长江电力	5,838,054.00	4.45
48	3690	美团-W	5,744,824.51	4.38
49	688318	财富趋势	5,708,406.49	4.35
50	002236	大华股份	5,694,824.00	4.34
51	300408	三环集团	5,500,557.00	4.19
52	002594	比亚迪	5,411,409.00	4.12
53	688072	拓荆科技	5,369,686.69	4.09
54	002922	伊戈尔	5,302,354.00	4.04
55	601689	拓普集团	5,211,932.00	3.97
56	000617	中油资本	5,123,902.00	3.90
57	001223	欧克科技	5,103,396.00	3.89
58	605305	中际联合	5,011,341.47	3.82
59	688484	南芯科技	4,897,946.35	3.73
60	600256	广汇能源	4,834,432.70	3.68
61	000807	云铝股份	4,760,491.00	3.63
62	300727	润禾材料	4,743,042.00	3.61
63	301168	通灵股份	4,709,898.00	3.59
64	688687	凯因科技	4,676,942.65	3.56
65	600266	城建发展	4,666,435.56	3.55
66	1171	兖矿能源	4,652,920.51	3.54
67	603191	望变电气	4,633,026.00	3.53
68	600958	东方证券	4,536,067.00	3.46
69	300856	科思股份	4,488,194.50	3.42
70	300034	钢研高纳	4,462,809.00	3.40
71	2015	理想汽车-W	4,422,543.84	3.37
72	300129	泰胜风能	4,389,012.00	3.34
73	601901	方正证券	4,382,570.00	3.34
74	600027	华电国际	4,380,991.00	3.34
75	688596	正帆科技	4,378,742.87	3.34

76	6865	福莱特玻璃	4,378,553.87	3.34
77	600546	山煤国际	4,314,574.00	3.29
78	300769	德方纳米	4,260,382.00	3.25
79	601838	成都银行	4,216,224.00	3.21
80	688121	卓然股份	4,213,965.14	3.21
81	002050	三花智控	4,180,434.15	3.18
82	600085	同仁堂	4,122,043.00	3.14
83	600031	三一重工	4,090,085.00	3.12
84	301073	君亭酒店	4,086,311.00	3.11
85	300308	中际旭创	4,077,962.91	3.11
86	2601	中国太保	4,050,264.03	3.09
87	601677	明泰铝业	4,021,556.00	3.06
88	000563	陕国投 A	3,994,066.00	3.04
89	600837	海通证券	3,906,153.00	2.98
90	301155	海力风电	3,883,066.61	2.96
91	603260	合盛硅业	3,868,812.00	2.95
92	002475	立讯精密	3,847,726.00	2.93
93	1088	中国神华	3,841,068.90	2.93
94	688017	绿的谐波	3,840,193.99	2.93
95	002371	北方华创	3,837,891.13	2.92
96	603163	圣晖集成	3,833,268.00	2.92
97	002311	海大集团	3,750,842.28	2.86
98	601888	中国中免	3,529,414.00	2.69
99	600309	万华化学	3,528,707.00	2.69
100	002797	第一创业	3,515,987.00	2.68
101	000935	四川双马	3,507,348.00	2.67
102	601390	中国中铁	3,418,425.00	2.60
103	688590	新致软件	3,415,314.88	2.60
104	002230	科大讯飞	3,392,549.00	2.58
105	601377	兴业证券	3,378,150.50	2.57
106	601702	华峰铝业	3,354,048.00	2.55
107	2380	中国电力	3,299,421.43	2.51
108	600000	浦发银行	3,275,602.00	2.50
109	603995	甬金股份	3,240,170.00	2.47
110	1368	特步国际	3,225,089.05	2.46
111	600522	中天科技	3,141,274.00	2.39
112	000858	五粮液	3,133,799.00	2.39
113	601818	光大银行	3,120,889.00	2.38
114	002276	万马股份	3,110,079.00	2.37
115	688332	中科蓝讯	3,109,053.22	2.37
116	603369	今世缘	3,095,329.00	2.36
117	002182	宝武镁业	3,089,407.00	2.35
118	000983	山西焦煤	3,074,641.00	2.34

119	002895	川恒股份	3,029,433.00	2.31
120	601328	交通银行	3,017,361.00	2.30
121	600109	国金证券	2,924,121.00	2.23
122	002941	新疆交建	2,921,399.31	2.23
123	300782	卓胜微	2,915,681.00	2.22
124	600975	新五丰	2,907,417.00	2.21
125	002532	天山铝业	2,879,548.00	2.19
126	000625	长安汽车	2,869,884.00	2.19
127	300274	阳光电源	2,865,897.00	2.18
128	688068	热景生物	2,855,715.45	2.18
129	002709	天赐材料	2,836,701.00	2.16
130	9966	康宁杰瑞制 药-B	2,834,697.22	2.16
131	600028	中国石化	2,757,402.00	2.10
132	0390	中国中铁	2,738,725.05	2.09
133	600584	长电科技	2,729,551.59	2.08
134	600533	栖霞建设	2,713,589.00	2.07
135	002345	潮宏基	2,703,921.00	2.06
136	688239	航宇科技	2,690,853.64	2.05
137	1138	中远海能	2,686,532.47	2.05
138	600452	涪陵电力	2,676,027.20	2.04

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,162,930,811.93
卖出股票的收入（成交）总额	1,150,578,110.58

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。

8.5 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	203,885.81	0.19
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	203,885.81	0.19

8.6 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	019694	23 国债 01	2,000	203,885.81	0.19

8.7 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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，中国人民财产保险股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行的处罚。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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	69,470.19
2	应收清算款	2,104,453.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,375.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,184,299.00

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
博时研究慧选 混合 A	2,052	50,213.26	98.14	0.00%	103,037,513.09	100.00%
博时研究慧选 混合 C	1,164	12,553.01	99.30	0.00%	14,611,607.10	100.00%
合计	3,138	37,491.82	197.44	0.00%	117,649,120.19	100.00%

9.2 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	博时研究慧选混合 A	600,139.54	0.58%
	博时研究慧选混合 C	61,152.17	0.42%
	合计	661,291.71	0.56%

9.3 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	博时研究慧选混合 A	-
	博时研究慧选混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时研究慧选混合 A	10~50
	博时研究慧选混合 C	-
	合计	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时研究慧选混合 A	博时研究慧选混合 C
基金合同生效日（2021年6月8日）基金份额总额	761,215,820.05	37,635,981.42
本报告期期初基金份额总额	115,842,890.85	16,597,136.32
本报告期基金总申购份额	3,251,161.39	2,589,894.51
减：本报告期基金总赎回份额	16,056,441.01	4,575,324.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	103,037,611.23	14,611,706.40

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2023年2月18日，基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生不再担任公司副总经理。

2023 年 5 月 27 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,吴慧峰先生任公司副总经理、财务负责人,孙献女士不再担任公司财务负责人。

2023 年 11 月 1 日,基金管理人发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,高阳先生不再担任公司总经理,江向阳先生代任公司总经理。

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。

11.3 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事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。报告期内本基金应付审计费为 38000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
方正证券	3	332,586,768.00	14.38%	171,813.75	9.66%	增加 1 个
华西证券	3	249,022,569.55	10.77%	114,309.04	6.43%	增加 1 个
广发证券	1	211,646,909.34	9.15%	199,152.64	11.20%	-
中信证券	1	150,831,219.56	6.52%	136,833.79	7.70%	-
国元证券	1	141,938,210.97	6.14%	132,187.18	7.43%	增加 1 个
天风证券	2	132,118,135.65	5.71%	97,568.17	5.49%	增加 2 个
东吴证券	1	114,860,517.71	4.97%	108,647.33	6.11%	-

山西证券	1	113,784,893.49	4.92%	87,033.87	4.89%	增加 1 个
开源证券	2	110,698,139.79	4.79%	80,956.08	4.55%	-
海通证券	1	105,931,504.01	4.58%	99,652.19	5.60%	-
国联证券	1	103,840,412.60	4.49%	76,797.12	4.32%	-
中金公司	2	99,943,016.29	4.32%	93,438.76	5.26%	-
东方证券	2	80,246,890.14	3.47%	58,884.54	3.31%	增加 1 个
光大证券	2	76,127,464.74	3.29%	59,063.73	3.32%	增加 1 个
国投证券	1	72,276,772.11	3.13%	67,310.57	3.79%	-
国金证券	1	55,011,910.18	2.38%	51,232.90	2.88%	增加 1 个
长江证券	1	49,859,681.30	2.16%	46,579.82	2.62%	-
招商证券	3	49,991,936.41	2.16%	40,516.73	2.28%	增加 2 个
平安证券	1	40,443,335.73	1.75%	38,252.39	2.15%	增加 1 个
世纪证券	1	11,368,219.60	0.49%	10,587.33	0.60%	-
中信建投	2	7,108,219.00	0.31%	5,302.06	0.30%	-
西部证券	1	2,535,539.32	0.11%	1,854.47	0.10%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	90,717.16	-	66.35	-	增加 1 个

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、个股分析的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

11.7.2 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
方正证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	39,670,000.00	5.85%	-	-
广发证券	199,944.00	62.46%	17,240,000.00	2.54%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

国元证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	120,164.82	37.54%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	36,186,000.00	5.33%	-	-
海通证券	-	-	41,781,000.00	6.16%	-	-
国联证券	-	-	23,157,000.00	3.41%	-	-
中金公司	-	-	239,429,000.00	35.29%	-	-
东方证券	-	-	39,315,000.00	5.80%	-	-
光大证券	-	-	44,012,000.00	6.49%	-	-
国投证券	-	-	40,101,000.00	5.91%	-	-
国金证券	-	-	39,333,000.00	5.80%	-	-
长江证券	-	-	5,577,000.00	0.82%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	17,810,000.00	2.63%	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	94,758,000.00	13.97%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通平安银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-22
2	博时基金管理有限公司关于暂停使用平安银行直联快捷支付服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-22
3	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-11-11
4	博时研究慧选混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-10-25

5	博时研究慧选混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-09-28
6	博时研究慧选混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-31
7	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 A)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-25
8	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 C)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-25
9	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-22
10	博时基金管理有限公司关于与银联商务股份有限公司合作开通华夏银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-03
11	博时基金管理有限公司关于与上海银联电子支付服务有限公司合作开通的华夏银行借记卡网上支付服务迁移的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-08-03
12	博时研究慧选混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-21
13	博时研究慧选混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
14	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 C)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
15	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 A)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08

16	博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
17	博时研究慧选混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
18	博时基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-07-08
19	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
20	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
21	博时研究慧选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
22	博时研究慧选混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
23	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 A)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-25
24	博时研究慧选混合型证券投资基金(博时研究慧选混合 C)基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-25
25	博时研究慧选混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-24
26	博时基金管理有限公司关于博时研究慧选混合型证券投资基金的基金经理变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-24

27	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
28	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
29	博时研究慧选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
30	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时研究慧选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时研究慧选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时研究慧选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、博时研究慧选混合型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时研究慧选混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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
二〇二四年三月二十九日