

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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
§5 托管人报告	13
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	51
7.1 期末基金资产组合情况	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
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	73
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	73
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	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73

7.12 投资组合报告附注	73
§8 基金份额持有人信息	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
8.2 盈利投资者数量占比	75
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
8.4 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	76
§9 开放式基金份额变动	76
§10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	78
10.8 其他重大事件	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时智选量化多因子股票型证券投资基金	
基金简称	博时智选量化多因子股票	
基金主代码	013465	
交易代码	013465	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 2 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,622,957,938.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
下属分级基金的交易代码	013465	013466
报告期末下属分级基金的份额总额	610,065,663.12 份	1,012,892,275.58 份

2.2 基金产品说明

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

	款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	胡燕
	联系电话	0755-83169999	0571-87659392
	电子邮箱	service@bosera.com	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		95105568	95527
传真		0755-83195140	0571-88268688
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		518040	310006
法定代表人		张东	陈海强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	博时智选量化多因子股 票 A	博时智选量化多因子 股票 C
本期已实现收益	107,479,519.85	188,397,257.59
本期利润	121,020,840.03	205,872,774.21
加权平均基金份额本期利润	0.1758	0.1486
本期加权平均净值利润率	14.25%	12.08%
本期基金份额净值增长率	18.56%	18.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时智选量化多因子股 票 A	博时智选量化多因子 股票 C
期末可供分配利润	47,302,144.95	77,788,195.82
期末可供分配基金份额利润	0.0775	0.0768
期末基金资产净值	790,587,516.21	1,308,986,347.51
期末基金份额净值	1.2959	1.2923
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时智选量化多因子股 票 A	博时智选量化多因子 股票 C
基金份额累计净值增长率	85.35%	81.08%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时智选量化多因子股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	28.09%	1.93%	14.10%	1.45%	13.99%	0.48%
过去六个月	18.56%	1.86%	14.56%	1.46%	4.00%	0.40%
过去一年	50.57%	1.60%	34.56%	1.24%	16.01%	0.36%
过去三年	94.17%	1.57%	31.69%	1.49%	62.48%	0.08%
自基金合同生效起至今	85.35%	1.46%	18.90%	1.40%	66.45%	0.06%

博时智选量化多因子股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	27.93%	1.93%	14.10%	1.45%	13.83%	0.48%
过去六个月	18.27%	1.86%	14.56%	1.46%	3.71%	0.40%
过去一年	49.82%	1.60%	34.56%	1.24%	15.26%	0.36%
过去三年	91.28%	1.57%	31.69%	1.49%	59.59%	0.08%
自基金合同生效起至今	81.08%	1.46%	18.90%	1.40%	62.18%	0.06%

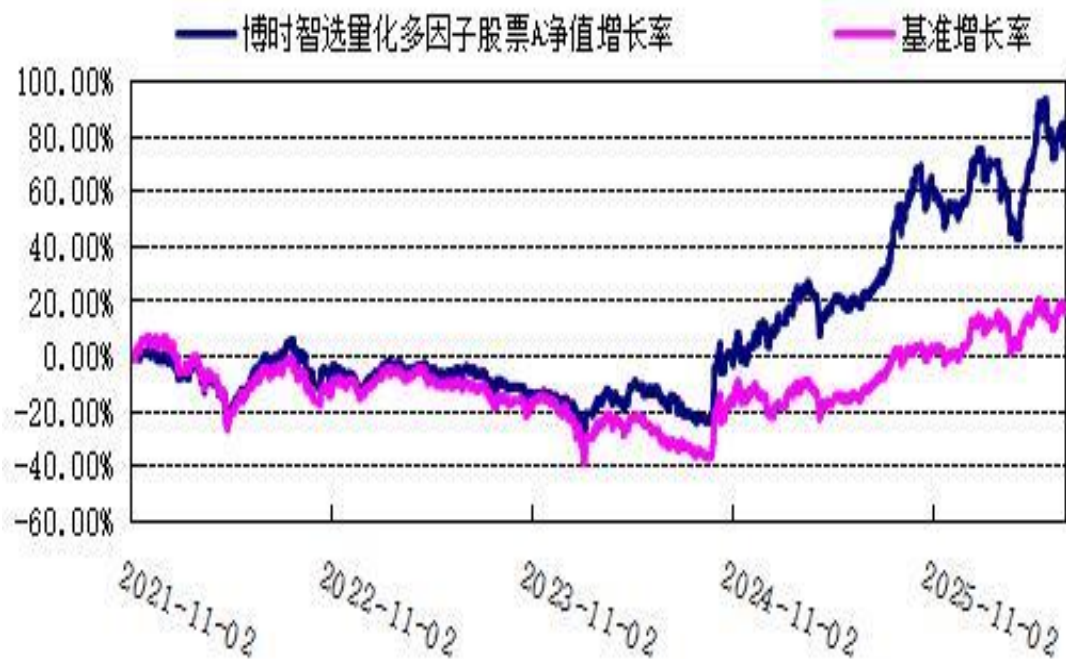
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

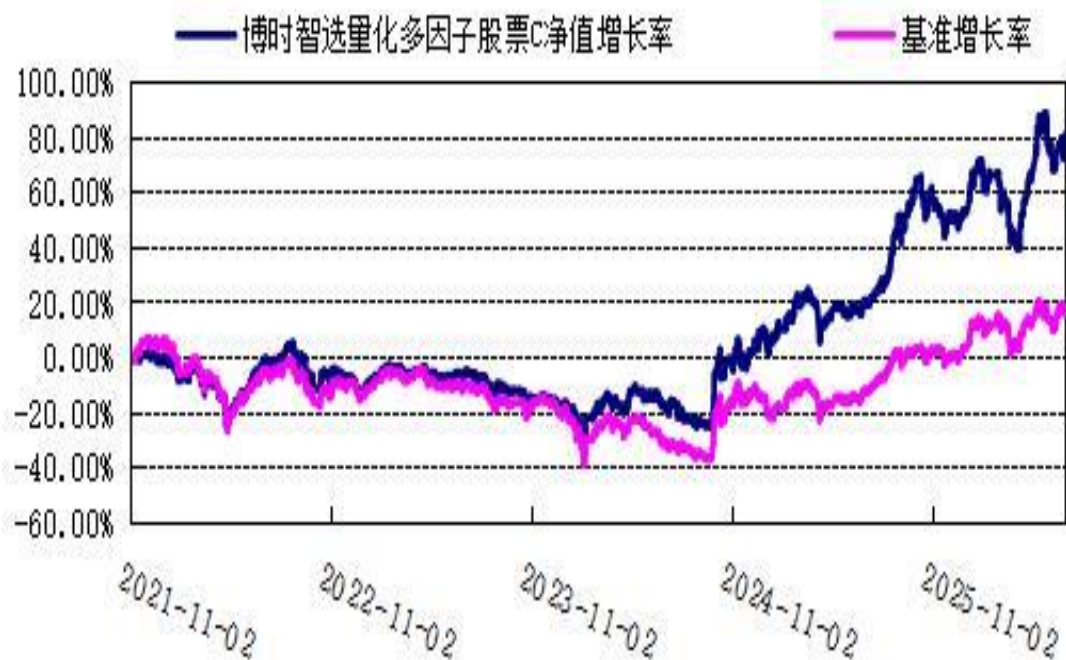
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 11 月 2 日至 2026 年 6 月 30 日)

博时智选量化多因子股票 A



博时智选量化多因子股票 C



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 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 17,353 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘钊	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2021-11-02	-	19.8	刘钊先生，博士。2006 年起先后在深圳证券交易所、五矿证券、摩根士丹利华鑫基金、深圳知方石投资有限公司工作。2020 年加入博时基金管理有限公司。曾任博时沪深 300 指数增强发起式证券投资基金(2020 年 12 月 30 日-2024 年 7 月 10 日)基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时中证 500 指数增强型证券投资基金(2020 年 12 月 23 日—至今)、博时智选量化多因子股票型证券投资基金(2021 年 11 月 2 日—至今)、博时中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 2 月 13 日—至今)、博时 ESG 量化选股混合型证券投资基金(2023 年 3 月 31 日—至今)、博时稳合一年持有期混合型证券投资基金(2024 年 4 月 17 日—至今)的基金经理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵

从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 18 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

2026 年上半年，海内外权益市场整体呈现先抑后扬、极致结构化分化特征。

海外，中东地缘冲突是上半年核心外部扰动。伊朗地缘冲突爆发推升国际油价大幅上行，打破市场美联储降息预期，甚至引发加息定价，全球风险偏好显著回落。目前市场对 2026 年下半年的预期是一到两次加息，幅度在 0.25% 到 0.5% 之间。

国内宏观经济整体处于政策托底、市场筑底修复阶段，上半年国内持续实施积极财政叠加适度宽松货币的双宽松政策，通过全年 4% 左右赤字率、超长期特别国债与专项债发力夯实基建底盘，叠加汽车、家电、智能数码等领域以旧换新消费补贴提振内需，有效对冲外部输入性通胀、地缘冲击及产业分化带来的下行压力；货币政策持续保持流动性合理充裕，加强财政货币协同、压降实体融资成本、助力产业转型升级，政策托底成效持续落地，6 月制造业 PMI、非制造业商务活动指数、

综合 PMI 产出指数分别录得 50.3%、50.2%、50.6%，三大指标全线站稳荣枯线上方，供需同步回暖，经济景气水平稳步修复。

产业方面，大 AI 产业链较为突出。一季度开源 AI 智能体框架“龙虾”（OpenClaw）快速普及，低门槛、开源开放的特性打破行业发展壁垒，带动算力、存储等 AI 硬件需求大幅扩容，AI 全产业链景气度全面激活，为科技板块提供持续结构性机会。二季度 AI 产业景气度进一步向高端赛道集中，结构性分化加剧。但随着 HBM 高端存储需求爆发，头部晶圆厂优先保障算力订单、压降成熟制程产能，挤压手机、PC 等消费电子芯片供给。上游零部件涨价推升终端成本，叠加居民消费意愿偏弱，消费电子及下游传统行业需求持续走弱，形成 AI 算力上游高景气、终端消费偏弱的割裂格局。

在上述背景下，A 股行业表现较为分化。整个上半年，全市场仅 9 个中信一级行业上涨。其中，电子、通信行业断崖式领先，分别上涨 85.49%、74.54%，建材、基础化工、机械亦录得两位数涨幅，分别为 43.7%、18.56%、16.17%，其它上涨行业涨幅仅为个位数。21 个行业下跌。消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔、商贸零售跌幅居前，涨跌幅分别为-31.88%、-29.58%、-25.09%、-24.76%、-22.18%。行业首尾收益差超 120%。宽基方面，依托 AI 产业爆发行情，科创 50 上涨 64.25%，科创 100 上涨 62.07%。沪深 300、中证 500、中证 1000 分别上涨 7.55%、20.97%、15.99%。港股表现偏弱，恒生指数、恒生科技指数分别下跌 10.73%、18.92%。

整个上半年，本基金持续暴露成长因子与新质生产力行业因子，紧扣产业升级与经济转型主线，超配科创、高端制造等高景气赛道。个股层面，我们延续了基于量化模型的主动优化策略，提升了个股风险敞口，集中配置了具备核心技术壁垒与龙头优势的优质标的，强化持仓核心竞争力。

但在二季度尾端，基于收缩风险的考量，我们对持仓进行了部分的调整，适度平衡了成长行业暴露，增配了消费等跟科技关联性弱的行业，收缩偏高的风险敞口，兼顾了收益弹性与组合稳健性。

整个上半年，我们坚持了量化与主观研判结合的投研体系，贴合产业趋势动态微调持仓，长期投资思路清晰连贯。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2959 元，份额累计净值为 1.7418 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2923 元，份额累计净值为 1.7119 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 18.56%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 18.27%，同期业绩基准增长率为 14.56%。

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 2026 年下半年，中东地缘扰动仍可能阶段性存在，但短期脉冲影响将逐步消退，油价有望向合理区间回归，全球风险偏好持续修复。国内稳增长政策持续落地，经济复苏态势稳步巩固，经

济转型与新质生产力发展的长期逻辑不变，A 股结构性行情延续，科技与高端制造赛道仍具备突出配置价值。

流动性层面，海外加息预期已充分定价，下半年全球流动性收紧压力边际缓解，利好权益估值修复。国内财政与货币政策持续协同，消费、基建政策红利持续释放，内需复苏动能稳步增强，为市场提供基本面支撑。产业层面，AI 智能体、高端算力、先进制造等新质生产力赛道景气度延续上行，仍是市场核心主线；传统行业随经济复苏逐步修复，市场结构性分化有望逐步收敛。

策略层面，本基金下半年将延续核心配置框架，不对核心因子做大幅调整，持续深耕高景气核心赛道。同时精细化管控组合风险，根据市场与产业变化动态微调风险敞口、优化持仓结构。后续将持续超配 AI 全产业链、高端制造等优质赛道，依托量化数据与主观深度研判挖掘优质成长标的，优化收益结构，力争跑赢业绩基准与同业水平，为持有人创造长期稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人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、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、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备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、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，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金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，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，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、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于 2026 年 1 月 10 日发布公告，以 2026 年 1 月 5 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0330 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0260 元人民币；

本基金管理人于 2026 年 2 月 6 日发布公告，以 2026 年 2 月 2 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.3230 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.3170 元人民币；

本基金管理人于 2026 年 3 月 5 日发布公告，以 2026 年 3 月 2 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.2140 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.2100 元人民币；

本基金管理人于 2026 年 6 月 5 日发布公告，以 2026 年 6 月 1 日可分配利润为基准，本基金 A 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5000 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.4820 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	37,107,921.77	52,010,896.80
结算备付金		205,396,162.30	76,379,653.01
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	1,870,045,894.47	2,554,051,626.58
其中：股票投资		1,788,566,690.34	2,487,689,125.97
基金投资		-	-
债券投资		81,479,204.13	66,362,500.61
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		3,638,099.27	5,554,210.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		2,116,188,077.81	2,687,996,387.20
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		13,562,150.38	24,931,963.26
应付管理人报酬		2,006,219.77	2,579,968.83
应付托管费		334,369.98	429,994.80
应付销售服务费		520,240.05	781,166.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,948.27	1,165.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	189,285.64	74,979.84
负债合计		16,614,214.09	28,799,239.27
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	1,622,957,938.70	2,234,713,641.26
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	476,615,925.02	424,483,506.67
净资产合计		2,099,573,863.72	2,659,197,147.93
负债和净资产总计		2,116,188,077.81	2,687,996,387.20

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,622,957,938.70 份。其中 A 类基金份额净值 1.2959 元，基金份额总额 610,065,663.12 份；C 类基金份额净值 1.2923 元，基金份额总额 1,012,892,275.58 份。

6.2 利润表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		349,065,232.36	78,068,562.18
1.利息收入		92,269.60	65,460.02
其中：存款利息收入	6.4.6.9	85,683.74	65,460.02
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		6,585.86	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		316,163,832.33	39,353,457.75
其中：股票投资收益	6.4.6.10	303,046,059.67	28,889,344.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	415,041.91	34,464.34
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	-268,763.20	-58,532.96
股利收益	6.4.6.14	12,971,493.95	10,488,181.57
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）	6.4.6.15	31,016,836.80	37,979,236.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	1,792,293.63	670,407.47
减：二、营业总支出		22,171,618.12	8,006,179.59
1. 管理人报酬		15,276,600.50	5,236,731.85
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		2,546,100.11	872,788.64
3. 销售服务费		4,253,732.64	1,817,302.36
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	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		965.32	13.58
8. 其他费用	6.4.6.18	94,219.55	79,343.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		326,893,614.24	70,062,382.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		326,893,614.24	70,062,382.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		326,893,614.24	70,062,382.59

6.3 净资产变动表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产	2,234,713,641.26	-	424,483,506.67	2,659,197,147.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,234,713,641.26	-	424,483,506.67	2,659,197,147.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-611,755,702.56	-	52,132,418.35	-559,623,284.21
（一）、综合收益总额	-	-	326,893,614.24	326,893,614.24
（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）	-611,755,702.56	-	-57,176,585.00	-668,932,287.56
其中：1.基金申购款	1,322,724,812.13	-	349,119,758.73	1,671,844,570.86
2.基金赎回款	-1,934,480,514.69	-	-406,296,343.73	-2,340,776,858.42
（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）	-	-	-217,584,610.89	-217,584,610.89
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,622,957,938.70	-	476,615,925.02	2,099,573,863.72

产				
---	--	--	--	--

项目	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025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	300,125,298.34	-	22,052,478.98	322,177,777.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	300,125,298.34	-	22,052,478.98	322,177,777.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,034,609,422.74	-	152,834,383.16	1,187,443,805.90
（一）、综合收益总额	-	-	70,062,382.59	70,062,382.59
（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）	1,034,609,422.74	-	139,383,086.71	1,173,992,509.45
其中：1.基金申购款	1,386,092,283.09	-	177,928,797.45	1,564,021,080.54
2.基金赎回款	-351,482,860.35	-	-38,545,710.74	-390,028,571.09
（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）	-	-	-56,611,086.14	-56,611,086.14

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,334,734,721.08	-	174,886,862.14	1,509,621,583.22

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：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时智选量化多因子股票型证券投资基金（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]1517 号《关于准予博时智选量化多因子股票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《博时智选量化多因子股票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基金，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 473,405,857.94 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60669135_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》于 2021 年 11 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 473,529,308.34 份基金份额，其中认购资金利息折合 123,450.40 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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用、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，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票（含主板、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）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、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

券的纯债部分）、可交换债、次级债等）、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金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。本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）的比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货、股票期权、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，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：中证 1000 指数收益率*90%+中债综合财富（总值）指数收益率*5%+活期存款收益率*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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。

6.4.5 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

（2）增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，

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

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	37,107,921.77
等于：本金	37,107,387.25
加：应计利息	534.52
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	37,107,921.77

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,732,693,615.63	-	1,788,566,690.34	55,873,074.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	80,717,796.00	710,271.58	81,479,204.13	51,136.55
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	80,717,796.00	710,271.58	81,479,204.13	51,136.55
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,813,411,411.63	710,271.58	1,870,045,894.47	55,924,211.26

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,119.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	21,946.45
预提费用	164,219.55
合计	189,285.64

6.4.6.7 实收基金

博时智选量化多因子股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额

上年度末	669,654,358.25	669,654,358.25
本期申购	416,941,758.09	416,941,758.09
本期赎回（以“-”号填列）	-476,530,453.22	-476,530,453.22
本期末	610,065,663.12	610,065,663.12

博时智选量化多因子股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,565,059,283.01	1,565,059,283.01
本期申购	905,783,054.04	905,783,054.04
本期赎回（以“-”号填列）	-1,457,950,061.47	-1,457,950,061.47
本期末	1,012,892,275.58	1,012,892,275.58

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)。

6.4.6.8 未分配利润
博时智选量化多因子股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,760,745.26	127,022,917.85	128,783,663.11
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	1,760,745.26	127,022,917.85	128,783,663.11
本期利润	107,479,519.85	13,541,320.18	121,020,840.03
本期基金份额交易产生的变动数	11,882,055.12	-7,344,529.89	4,537,525.23
其中：基金申购款	8,412,257.85	107,436,413.75	115,848,671.60
基金赎回款	3,469,797.27	-114,780,943.64	-111,311,146.37

本期已分配利润	-73,820,175.28	-	-73,820,175.28
本期末	47,302,144.95	133,219,708.14	180,521,853.09

博时智选量化多因子股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,219,891.12	292,479,952.44	295,699,843.56
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	3,219,891.12	292,479,952.44	295,699,843.56
本期利润	188,397,257.59	17,475,516.62	205,872,774.21
本期基金份额交易产生的变动数	29,935,482.72	-91,649,592.95	-61,714,110.23
其中：基金申购款	13,294,230.74	219,976,856.39	233,271,087.13
基金赎回款	16,641,251.98	-311,626,449.34	-294,985,197.36
本期已分配利润	-143,764,435.61	-	-143,764,435.61
本期末	77,788,195.82	218,305,876.11	296,094,071.93

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,443.16
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	55,076.30
其他	17,164.28
合计	85,683.74

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	6,989,107,243.42
减：卖出股票成本总额	6,676,016,572.41
减：交易费用	10,044,611.34
买卖股票差价收入	303,046,059.67

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	417,231.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,189.66
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	415,041.91

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,002,760.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,802,160.00

减：应计利息总额	202,760.00
减：交易费用	29.66
买卖债券差价收入	-2,189.66

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 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。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-268,763.20

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	12,971,493.95
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	12,971,493.95

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
------	---------------------------------------

1.交易性金融资产	31,016,836.80
——股票投资	30,995,192.25
——债券投资	21,644.55
——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	31,016,836.80

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,668,113.28
基金转换费收入	124,180.35
合计	1,792,293.63

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

合计	94,219.55
----	-----------

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2026 年 07 月 08 日宣告 2026 年度第 5 次分红，向截至 2026 年 07 月 10 日止在本基金注册登记人博时基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.6220 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.6200 元。

6.4.8 关联方、关联关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,276,600.50	5,236,731.85

其中：应支付销售机构的客户维护费	3,563,642.17	1,044,791.94
应支付基金管理人的净管理费	11,712,958.33	4,191,939.91

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,546,100.11	872,788.64

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.9.2.3 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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时智选量化多因 子股票 A	博时智选量化多因子股 票 C	合计
浙商银行	-	103,591.38	103,591.38
招商证券	-	9,785.08	9,785.08
博时基金	-	1,650,269.42	1,650,269.42
博时财富	-	264.01	264.01
合计	-	1,763,909.89	1,763,909.89
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C	合计
浙商银行	-	24,750.97	24,750.97
招商证券	-	1,103.63	1,103.63
博时基金	-	661,260.25	661,260.25
合计	-	687,114.85	687,114.85

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.9.5.2 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。

6.4.9.6 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		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收	期末余额	当期利息收

		入		入
浙商银行-活期存款	37,107,921.77	13,443.16	38,092,708.48	10,169.41

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。

6.4.9.7 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	001365	天海电子	网下发行	2,394.00	65,092.86
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

博时智选量化多因子股票 A

单位：人民币元

序号	权益登记 日	除息日 (场外)	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合 计	备 注
1	2026-01-13	2026-01-13	0.0330	1,479,570.82	735,051.74	2,214,622.56	-
2	2026-02-10	2026-02-10	0.3230	13,549,795.13	11,141,398.79	24,691,193.92	-
3	2026-03-09	2026-03-09	0.2140	9,157,517.48	7,528,968.58	16,686,486.06	-

4	2026-06-09	2026-06-09	0.5000	19,795,569.96	10,432,302.78	30,227,872.74	-
合计			1.0700	43,982,453.39	29,837,721.89	73,820,175.28	-

博时智选量化多因子股票 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日 (场外)	每 10 份 基金份 额分红 数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	利润分配合计	备注
1	2026-01-13	2026-01-13	0.0260	1,877,966.13	2,336,406.58	4,214,372.71	-
2	2026-02-10	2026-02-10	0.3170	33,270,089.89	22,678,989.30	55,949,079.19	-
3	2026-03-09	2026-03-09	0.2100	20,956,798.11	14,839,848.72	35,796,646.83	-
4	2026-06-09	2026-06-09	0.4820	30,226,840.31	17,577,496.57	47,804,336.88	-
合计			1.0350	86,331,694.44	57,432,741.17	143,764,435.61	-

6.4.11 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券
6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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
300750	宁德时代	2026-04-24	6 个月	非公开发 行限售	410.34	373.17	234,000.00	96,019,560.00	87,321,780.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	首次公开	104.66	768.89	3,994.00	418,012.04	3,070,946.66	-

				发行 限售						
001248	华润 新能源	2026-06-24	6 个月	首次公 开发 行 限 售	10.11	10.11	58,873.00	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普 微	2026-04-08	6 个月	首次公 开发 行 限 售	46.08	463.33	1,220.00	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合 晶微	2026-04-13	6 个月	首次公 开发 行 限 售	19.68	141.49	2,391.00	47,054.88	338,302.59	-
688781	视涯 科技	2026-03-18	9 个月	首次公 开发 行 限 售	22.68	42.16	6,335.00	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯 仪器	2026-04-16	6 个月	首次公 开发 行 限 售	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-

001248	华润新能源	2026-06-24	6个交易日	新股未上市	10.11	10.11	25,231.00	255,085.41	255,085.41	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	首次公开发行限售	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	首次公开发行限售	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	首次公开发行限售	69.66	160.06	714.00	49,737.24	114,282.84	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	首次公开发行限售	44.56	468.67	207.00	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	首次公开发行限售	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-

				售						
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	首次公开发行限售	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	首次公开发行限售	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	首次公开发行限售	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	首次公开发行限售	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	首次公开发行限售	17.70	84.32	330.00	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电	2026-05-11	6个月	首次公	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-

	子			开 发 行 限 售						
68881 1	有 研 复 材	2026-04-0 1	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
30169 6	三 瑞 智 能	2026-03-3 1	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
00123 7	惠 康 科 技	2026-05-1 5	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	53.26	58.74	285.00	15,179.10	16,740.90	-
30166 9	高 特 电 子	2026-06-0 2	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-
30168 7	新 广 益	2025-12-2 4	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-

				售						
001393	维通利	2026-05-08	6个月	首次公开发行限售	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	首次公开发行限售	13.30	51.56	290.00	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	首次公开发行限售	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	首次公开发行限售	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	首次公开发行限售	58.00	112.16	117.00	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新	2026-03-24	6个月	首次公	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-

	材			开 发 行 限 售						
68881 6	易 思 维	2026-02-0 4	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
60340 7	长 裕 集 团	2026-04-2 9	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	13.86	73.46	137.00	1,898.82	10,064.02	-
30151 3	尚 水 智 能	2026-04-1 0	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
60343 5	嘉 德 利	2026-05-1 5	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限 售	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
60335 2	至 信 股 份	2026-01-0 8	6 个 月	首 次 公 开 发 行 限	21.88	25.52	112.00	2,450.56	2,858.24	-

				售						
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	首次公开发行限售	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	首次公开发行限售	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	首次公开发行限售	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	首次公开发行限售	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-

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。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金,理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过多因子量化模型方法,精选股票进行投资,在充分控制风险的前提下,力争获取超越比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人建立了董事会领导,以风险管理委员会为核心的,由总经理、督察长、法律合规部、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;法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察,并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助,使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标;风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程,组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作,确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.12.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	81,464,260.75	66,362,500.61
合计	81,464,260.75	66,362,500.61

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。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 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 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	14,943.38	-
未评级	-	-
合计	14,943.38	-

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。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 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。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	37,107,921.77	-	-	-	37,107,921.77
结算备付金	205,396,162.30	-	-	-	205,396,162.30
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	81,464,260.75	-	14,943.38	1,788,566,690.34	1,870,045,894.47
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,638,099.27	3,638,099.27
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	323,968,344.82	-	14,943.38	1,792,204,789.61	2,116,188,077.81
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	13,562,150.38	13,562,150.38
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,006,219.77	2,006,219.77
应付托管费	-	-	-	334,369.98	334,369.98
应付销售服务费	-	-	-	520,240.05	520,240.05
应交税费	-	-	-	1,948.27	1,948.27
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,285.64	189,285.64
负债总计	-	-	-	16,614,214.09	16,614,214.09
利率敏感度缺口	323,968,344.82	-	14,943.38	1,775,590,575.52	2,099,573,863.72
上年度末 2025 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	52,010,896.80	-	-	-	52,010,896.80
结算备付金	76,379,653.01	-	-	-	76,379,653.01

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	66,362,500.61	-	-2,487,689,125.97	2,554,051,626.58
应收清算款	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收申购款	-	-	5,554,210.81	5,554,210.81
应收股利	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	194,753,050.42	-	-2,493,243,336.78	2,687,996,387.20
负债				
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	24,931,963.26	24,931,963.26
应付清算款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	2,579,968.83	2,579,968.83
应付托管费	-	-	429,994.80	429,994.80
应付销售服务费	-	-	781,166.79	781,166.79
应交税费	-	-	1,165.75	1,165.75
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	74,979.84	74,979.84
负债总计	-	-	28,799,239.27	28,799,239.27
利率敏感度缺口	194,753,050.42	-	-2,464,444,097.51	2,659,197,147.93

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

6.4.12.4.1.2 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 7	减少约 10
	市场利率下降 25 个基点	增加约 7	增加约 10

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 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。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,788,566,690.34	85.19	2,487,689,125.97	93.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	14,943.38	0.00	-	-
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	1,788,581,633.72	85.19	2,487,689,125.97	93.55

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，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

6.4.12.4.3.2 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 8,148	增加约 15,896
	业绩比较基准下降 5%	减少约 8,148	减少约 15,896

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 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 2026年6月30日
第一层次	1,694,912,639.01
第二层次	82,314,552.19
第三层次	92,818,703.27
合计	1,870,045,894.47

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.14 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	1,788,566,690.34	84.52
	其中：股票	1,788,566,690.34	84.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,479,204.13	3.85
	其中：债券	81,479,204.13	3.85
	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	242,504,084.07	11.46
8	其他各项资产	3,638,099.27	0.17
9	合计	2,116,188,077.81	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	727,928.40	0.03
B	采矿业	27,249,978.22	1.30
C	制造业	1,150,164,275.97	54.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,754,057.44	1.46
E	建筑业	568,416.00	0.03
F	批发和零售业	7,898,969.20	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	4,387,165.72	0.21
H	住宿和餐饮业	39,578.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	411,130,269.97	19.58
J	金融业	143,059,160.42	6.81
K	房地产业	472,091.00	0.02
L	租赁和商务服务业	5,912,291.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	1,911,476.60	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	3,713,677.40	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	122,794.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	453,487.00	0.02
S	综合	1,074.00	0.00
	合计	1,788,566,690.34	85.19

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	688279	峰昭科技	818,905	183,795,038.20	8.75
2	300750	宁德时代	458,111	175,399,644.11	8.35
3	688018	乐鑫科技	1,112,075	142,256,634.00	6.78
4	605499	东鹏饮料	1,145,970	141,447,077.10	6.74
5	300693	盛弘股份	2,359,000	115,001,250.00	5.48
6	301606	绿联科技	1,780,253	108,631,038.06	5.17
7	601688	华泰证券	3,854,500	79,479,790.00	3.79
8	688008	澜起科技	164,068	50,844,673.20	2.42
9	600887	伊利股份	1,563,500	37,461,460.00	1.78
10	688256	寒武纪	22,143	35,330,263.65	1.68
11	300576	容大感光	643,800	32,975,436.00	1.57
12	600398	海澜之家	5,959,000	31,165,570.00	1.48
13	003816	中国广核	6,818,000	26,658,380.00	1.27
14	300054	鼎龙股份	233,700	24,765,189.00	1.18
15	601066	中信建投	759,500	22,078,665.00	1.05
16	600938	中国海油	776,100	21,071,115.00	1.00
17	002736	国信证券	1,961,600	19,596,384.00	0.93
18	300857	协创数据	36,928	12,551,827.20	0.60
19	603986	兆易创新	14,858	12,109,270.00	0.58
20	300618	寒锐钴业	321,100	11,463,270.00	0.55
21	688158	优刻得	294,062	10,809,719.12	0.51
22	600036	招商银行	292,300	10,376,650.00	0.49
23	002156	通富微电	132,800	10,075,536.00	0.48
24	688123	聚辰股份	40,200	8,546,520.00	0.41
25	002008	大族激光	56,828	8,530,451.08	0.41
26	688002	睿创微纳	53,700	8,306,853.00	0.40
27	001389	广合科技	34,100	8,090,225.00	0.39
28	301308	江波龙	11,400	8,023,320.00	0.38
29	002414	高德红外	592,400	7,855,224.00	0.37
30	600150	中国船舶	218,000	7,366,220.00	0.35
31	603699	纽威股份	146,300	7,358,890.00	0.35
32	601231	环旭电子	207,178	6,712,567.20	0.32
33	688059	华锐精密	32,500	6,490,575.00	0.31
34	688498	源杰科技	3,400	6,412,400.00	0.31
35	002281	光迅科技	24,200	6,217,948.00	0.30
36	688702	盛科通信	15,800	6,161,842.00	0.29
37	688629	华丰科技	32,600	6,112,826.00	0.29
38	688388	嘉元科技	138,300	6,085,200.00	0.29
39	301031	中熔电气	50,742	6,061,131.90	0.29
40	002284	亚太股份	632,700	6,004,323.00	0.29

41	688378	奥来德	96,700	5,995,400.00	0.29
42	603901	永创智能	550,587	5,984,880.69	0.29
43	002384	东山精密	22,800	5,981,580.00	0.28
44	300373	扬杰科技	38,000	5,974,740.00	0.28
45	605060	联德股份	104,700	5,940,678.00	0.28
46	300681	英搏尔	207,300	5,932,926.00	0.28
47	688396	华润微	60,200	5,872,510.00	0.28
48	603239	浙江仙通	396,400	5,870,684.00	0.28
49	601208	东材科技	82,900	5,868,491.00	0.28
50	688521	芯原股份	15,700	5,826,898.00	0.28
51	688392	骄成超声	25,400	5,770,372.00	0.27
52	300113	顺网科技	315,100	5,737,971.00	0.27
53	000792	盐湖股份	189,900	5,733,081.00	0.27
54	600570	恒生电子	269,400	5,708,586.00	0.27
55	002709	天赐材料	110,700	5,693,301.00	0.27
56	600320	振华重工	1,378,200	5,691,966.00	0.27
57	000408	藏格矿业	82,000	5,684,240.00	0.27
58	002487	大金重工	97,600	5,657,872.00	0.27
59	600869	远东股份	168,900	5,653,083.00	0.27
60	605016	百龙创园	217,600	5,624,960.00	0.27
61	300033	同花顺	23,180	5,586,380.00	0.27
62	002648	卫星化学	236,600	5,557,734.00	0.26
63	301377	鼎泰高科	10,000	5,509,000.00	0.26
64	301349	信德新材	74,560	5,487,616.00	0.26
65	002250	联化科技	399,184	5,456,845.28	0.26
66	600989	宝丰能源	268,035	5,449,151.55	0.26
67	002545	东方铁塔	333,200	5,404,504.00	0.26
68	000949	新乡化纤	846,300	5,365,542.00	0.26
69	002859	洁美科技	48,700	5,333,137.00	0.25
70	300124	汇川技术	68,600	4,550,238.00	0.22
71	000333	美的集团	60,200	4,546,906.00	0.22
72	300223	北京君正	15,200	3,783,280.00	0.18
73	002517	恺英网络	227,188	3,691,805.00	0.18
74	688208	道通科技	135,147	3,404,352.93	0.16
75	300919	中伟新材	75,700	3,311,875.00	0.16
76	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.15
77	600487	亨通光电	25,547	2,793,308.98	0.13
78	300475	香农芯创	8,800	2,640,000.00	0.13
79	300604	长川科技	7,600	2,594,792.00	0.12
80	688525	佰维存储	5,000	2,473,650.00	0.12
81	600309	万华化学	35,600	2,435,396.00	0.12
82	601318	中国平安	44,833	2,140,327.42	0.10
83	301358	湖南裕能	28,200	2,139,534.00	0.10

84	000933	神火股份	98,700	2,092,440.00	0.10
85	002532	天山铝业	194,900	2,091,277.00	0.10
86	301536	星辰科技	16,200	2,085,102.00	0.10
87	002558	巨人网络	72,100	1,987,076.00	0.09
88	002266	浙富控股	391,190	1,979,421.40	0.09
89	002271	东方雨虹	163,300	1,938,371.00	0.09
90	601233	桐昆股份	88,400	1,913,860.00	0.09
91	000783	长江证券	194,000	1,891,500.00	0.09
92	002120	韵达股份	294,800	1,874,928.00	0.09
93	603345	安井食品	23,000	1,844,370.00	0.09
94	000426	兴业银锡	55,400	1,825,984.00	0.09
95	600499	科达制造	131,500	1,814,700.00	0.09
96	300972	万辰集团	10,300	1,786,123.00	0.09
97	000951	中国重汽	91,200	1,779,312.00	0.08
98	000685	中山公用	158,300	1,766,628.00	0.08
99	688266	泽璟制药	15,100	1,761,566.00	0.08
100	600546	山煤国际	158,800	1,735,684.00	0.08
101	600885	宏发股份	50,200	1,731,398.00	0.08
102	000415	渤海租赁	417,000	1,697,190.00	0.08
103	688257	新锐股份	16,400	1,671,160.00	0.08
104	603233	大参林	108,200	1,626,246.00	0.08
105	601168	西部矿业	59,800	1,622,972.00	0.08
106	601360	三六零	182,200	1,583,318.00	0.08
107	002154	报喜鸟	443,100	1,577,436.00	0.08
108	601500	通用股份	425,200	1,551,980.00	0.07
109	002027	分众传媒	318,725	1,542,629.00	0.07
110	688400	凌云光	23,000	1,522,600.00	0.07
111	300037	新宙邦	16,200	1,504,170.00	0.07
112	688227	品高股份	14,400	1,478,736.00	0.07
113	002886	沃特股份	52,600	1,477,534.00	0.07
114	603638	艾迪精密	62,600	1,467,970.00	0.07
115	002115	三维通信	142,000	1,462,600.00	0.07
116	603061	金海通	2,900	1,456,438.00	0.07
117	688206	概伦电子	32,800	1,455,336.00	0.07
118	688628	优利德	14,600	1,444,524.00	0.07
119	600522	中天科技	23,700	1,438,116.00	0.07
120	603187	海容冷链	123,600	1,420,164.00	0.07
121	301217	铜冠铜箔	8,600	1,419,602.00	0.07
122	688308	欧科亿	7,800	1,418,118.00	0.07
123	688090	瑞松科技	13,200	1,405,140.00	0.07
124	600685	中船防务	55,200	1,404,288.00	0.07
125	001339	智微智能	13,670	1,398,167.60	0.07
126	600268	国电南自	119,900	1,393,238.00	0.07

127	300856	科思股份	128,200	1,366,612.00	0.07
128	600230	沧州大化	104,800	1,364,496.00	0.06
129	001218	丽臣实业	61,400	1,354,484.00	0.06
130	002747	埃斯顿	35,200	1,314,016.00	0.06
131	000987	越秀资本	165,500	1,294,210.00	0.06
132	688328	深科达	13,500	1,291,950.00	0.06
133	600233	圆通速递	79,400	1,250,550.00	0.06
134	002779	中坚科技	15,400	1,209,824.00	0.06
135	600566	济川药业	54,000	1,198,260.00	0.06
136	002353	杰瑞股份	7,800	1,189,500.00	0.06
137	300012	华测检测	85,700	1,187,802.00	0.06
138	002111	威海广泰	126,700	1,140,300.00	0.05
139	002064	华峰化学	120,100	1,139,749.00	0.05
140	000657	中钨高新	11,500	1,100,780.00	0.05
141	688327	云从科技	87,000	1,084,020.00	0.05
142	002351	漫步者	99,200	901,728.00	0.04
143	603317	天味食品	68,400	889,884.00	0.04
144	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.04
145	601689	拓普集团	12,262	691,822.04	0.03
146	603156	养元饮品	13,300	652,631.00	0.03
147	300395	菲利华	4,800	641,904.00	0.03
148	603588	高能环境	32,500	624,000.00	0.03
149	600177	雅戈尔	79,500	598,635.00	0.03
150	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
151	605117	德业股份	5,100	541,518.00	0.03
152	002838	道恩股份	17,000	520,540.00	0.02
153	002738	中矿资源	8,700	513,213.00	0.02
154	001309	德明利	500	471,450.00	0.02
155	002079	苏州固锝	29,400	441,882.00	0.02
156	002956	西麦食品	21,280	441,772.80	0.02
157	300098	高新兴	95,400	437,886.00	0.02
158	300613	富瀚微	5,100	408,408.00	0.02
159	002645	华宏科技	14,800	407,148.00	0.02
160	300168	万达信息	87,900	403,461.00	0.02
161	300768	迪普科技	28,600	393,822.00	0.02
162	300184	力源信息	22,300	391,365.00	0.02
163	002210	飞马国际	181,400	384,568.00	0.02
164	000589	贵州轮胎	93,101	377,990.06	0.02
165	688582	芯动联科	5,800	377,000.00	0.02
166	300388	节能国祯	60,900	375,753.00	0.02
167	300970	华绿生物	20,430	373,460.40	0.02
168	600961	株冶集团	11,500	372,485.00	0.02
169	002557	洽洽食品	20,700	371,772.00	0.02

170	600598	北大荒	32,700	354,468.00	0.02
171	600801	华新建材	22,500	351,000.00	0.02
172	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.02
173	002588	史丹利	38,900	307,310.00	0.01
174	600026	中远海能	16,600	297,804.00	0.01
175	603508	思维列控	13,300	284,088.00	0.01
176	603045	福达合金	3,900	278,421.00	0.01
177	600872	中炬高新	15,900	276,024.00	0.01
178	688578	艾力斯	2,500	273,000.00	0.01
179	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
180	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
181	300596	利安隆	4,900	257,152.00	0.01
182	002587	奥拓电子	31,700	247,577.00	0.01
183	688107	安路科技	5,400	246,240.00	0.01
184	300895	铜牛信息	4,700	244,588.00	0.01
185	300323	华灿光电	11,900	242,760.00	0.01
186	603100	川仪股份	13,400	241,870.00	0.01
187	300428	立中集团	13,300	241,794.00	0.01
188	688095	福昕软件	4,000	237,720.00	0.01
189	000880	潍柴重机	10,300	237,003.00	0.01
190	300444	双杰电气	19,300	235,653.00	0.01
191	300067	安诺其	42,900	232,518.00	0.01
192	300830	金现代	29,200	231,848.00	0.01
193	688717	艾罗能源	2,800	231,196.00	0.01
194	688531	日联科技	1,300	231,192.00	0.01
195	603013	亚普股份	14,600	230,534.00	0.01
196	002029	七匹狼	30,100	229,964.00	0.01
197	688275	万润新能	1,800	229,590.00	0.01
198	688787	海天瑞声	1,700	228,565.00	0.01
199	688339	亿华通	12,200	228,140.00	0.01
200	300226	上海钢联	14,900	228,119.00	0.01
201	002606	大连电瓷	17,000	227,970.00	0.01
202	300504	天邑股份	14,100	227,433.00	0.01
203	600158	中体产业	33,700	227,138.00	0.01
204	002832	比音勒芬	11,000	227,040.00	0.01
205	601789	宁波建工	56,600	226,966.00	0.01
206	603283	赛腾股份	2,800	226,744.00	0.01
207	600619	海立股份	14,300	226,655.00	0.01
208	603489	八方股份	8,100	226,476.00	0.01
209	603579	荣泰健康	13,300	225,701.00	0.01
210	603719	良品铺子	26,000	224,900.00	0.01
211	301109	军信股份	18,000	224,280.00	0.01
212	002923	润都股份	23,500	222,310.00	0.01

213	688222	成都先导	6,900	221,559.00	0.01
214	300404	博济医药	25,200	220,752.00	0.01
215	600711	盛屯矿业	19,500	213,915.00	0.01
216	300458	全志科技	5,000	197,300.00	0.01
217	603077	和邦生物	82,500	191,400.00	0.01
218	601828	美凯龙	92,300	188,292.00	0.01
219	002493	荣盛石化	17,500	188,125.00	0.01
220	002436	兴森科技	3,600	183,420.00	0.01
221	002134	天津普林	6,000	182,520.00	0.01
222	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
223	600595	中孚实业	31,900	179,278.00	0.01
224	600601	方正科技	12,500	173,000.00	0.01
225	002841	视源股份	5,000	172,650.00	0.01
226	000612	焦作万方	16,300	172,617.00	0.01
227	600361	创新新材	47,800	172,080.00	0.01
228	000975	山金国际	10,100	171,700.00	0.01
229	000938	紫光股份	5,900	170,274.00	0.01
230	600288	大恒科技	12,600	167,580.00	0.01
231	600489	中金黄金	9,200	166,060.00	0.01
232	600433	冠豪高新	51,700	165,957.00	0.01
233	002653	海思科	2,500	165,850.00	0.01
234	000629	钒钛股份	49,400	164,996.00	0.01
235	301219	腾远钴业	3,010	164,948.00	0.01
236	600037	歌华有线	26,100	163,647.00	0.01
237	603390	通达电气	15,600	162,864.00	0.01
238	300187	永清环保	32,200	162,610.00	0.01
239	301662	宏工科技	1,600	162,112.00	0.01
240	000810	创维数字	12,200	161,650.00	0.01
241	603025	大豪科技	11,800	160,952.00	0.01
242	000709	河钢股份	82,900	160,826.00	0.01
243	300662	科锐国际	9,400	159,612.00	0.01
244	300073	当升科技	3,300	158,532.00	0.01
245	601899	紫金矿业	6,300	158,382.00	0.01
246	300213	佳讯飞鸿	26,100	158,166.00	0.01
247	600425	青松建化	48,300	157,941.00	0.01
248	300074	华平股份	46,400	157,760.00	0.01
249	300933	中辰股份	25,900	157,472.00	0.01
250	600688	上海石化	53,700	157,341.00	0.01
251	000807	云铝股份	7,100	157,194.00	0.01
252	300230	永利股份	37,400	157,080.00	0.01
253	002593	日上集团	39,200	156,408.00	0.01
254	002148	北纬科技	26,900	156,289.00	0.01
255	300890	翔丰华	4,700	155,899.00	0.01

256	002425	凯撒文化	59,500	155,295.00	0.01
257	603066	音飞储存	15,900	155,184.00	0.01
258	600168	武汉控股	38,400	155,136.00	0.01
259	600300	维维股份	55,000	155,100.00	0.01
260	600390	五矿资本	34,000	155,040.00	0.01
261	603018	华设集团	30,140	154,919.60	0.01
262	300425	中建环能	41,400	154,836.00	0.01
263	600704	物产中大	32,785	154,745.20	0.01
264	000848	承德露露	20,900	154,660.00	0.01
265	002573	清新环境	52,600	154,644.00	0.01
266	000565	渝三峡 A	27,200	154,496.00	0.01
267	600210	紫江企业	24,900	154,380.00	0.01
268	600008	首创环保	56,700	154,224.00	0.01
269	600482	中国动力	4,700	154,160.00	0.01
270	600606	绿地控股	127,300	154,033.00	0.01
271	002562	兄弟科技	35,400	153,990.00	0.01
272	603689	皖天然气	22,200	153,846.00	0.01
273	600874	创业环保	28,700	153,832.00	0.01
274	600148	长春一东	10,600	153,806.00	0.01
275	601200	上海环境	23,300	153,780.00	0.01
276	000421	南京公用	31,000	153,760.00	0.01
277	000059	华锦股份	41,000	153,750.00	0.01
278	600419	天润乳业	20,300	153,671.00	0.01
279	001914	招商积余	18,800	153,408.00	0.01
280	002391	长青股份	31,500	153,405.00	0.01
281	301019	宁波色母	8,600	153,338.00	0.01
282	002722	物产金轮	13,000	153,270.00	0.01
283	601368	绿城水务	37,400	152,966.00	0.01
284	000419	通程控股	33,900	152,889.00	0.01
285	002563	森马服饰	30,300	152,712.00	0.01
286	600356	恒丰纸业	20,600	152,646.00	0.01
287	000900	现代投资	44,100	152,586.00	0.01
288	000605	渤海股份	28,500	152,475.00	0.01
289	300915	海融科技	7,700	152,460.00	0.01
290	600262	北方股份	7,700	152,383.00	0.01
291	001332	锡装股份	3,880	152,367.60	0.01
292	002274	华昌化工	32,900	152,327.00	0.01
293	603518	锦泓集团	21,300	152,295.00	0.01
294	600731	湖南海利	29,700	152,064.00	0.01
295	000553	安道麦 A	28,400	151,940.00	0.01
296	002780	三夫户外	12,500	151,750.00	0.01
297	300583	赛托生物	13,500	151,605.00	0.01
298	601111	中国国航	25,000	151,250.00	0.01

299	000544	中原环保	21,600	150,552.00	0.01
300	600717	天津港	38,700	150,543.00	0.01
301	002752	昇兴股份	27,200	150,144.00	0.01
302	000402	金融街	62,300	150,143.00	0.01
303	601968	宝钢包装	38,300	150,136.00	0.01
304	603711	香飘飘	13,500	149,985.00	0.01
305	000989	九芝堂	19,300	149,961.00	0.01
306	605151	西上海	8,500	149,685.00	0.01
307	002818	富森美	14,400	149,616.00	0.01
308	603600	永艺股份	16,800	149,016.00	0.01
309	600827	百联股份	20,100	148,941.00	0.01
310	603383	顶点软件	5,600	148,736.00	0.01
311	605577	龙版传媒	16,800	148,008.00	0.01
312	605266	健之佳	10,000	146,400.00	0.01
313	600426	华鲁恒升	6,100	145,912.00	0.01
314	603799	华友钴业	3,000	144,780.00	0.01
315	600346	恒力石化	8,100	143,451.00	0.01
316	300502	新易盛	224	135,968.00	0.01
317	300408	三环集团	800	133,520.00	0.01
318	688545	兴福电子	990	131,729.40	0.01
319	000922	佳电股份	9,100	127,036.00	0.01
320	002381	双箭股份	24,100	124,838.00	0.01
321	300359	全通教育	34,300	122,794.00	0.01
322	600526	菲达环保	29,700	122,067.00	0.01
323	002837	英维克	1,521	121,010.76	0.01
324	600035	楚天高速	35,800	120,646.00	0.01
325	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
326	601677	明泰铝业	7,200	119,520.00	0.01
327	300439	美康生物	14,800	118,844.00	0.01
328	600655	豫园股份	28,600	117,546.00	0.01
329	600221	海航控股	86,900	117,315.00	0.01
330	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
331	000869	张裕 A	7,200	112,176.00	0.01
332	002273	水晶光电	3,100	109,988.00	0.01
333	600251	冠农股份	12,700	109,728.00	0.01
334	301200	大族数控	300	108,195.00	0.01
335	002049	紫光国微	1,200	106,500.00	0.01
336	688469	芯联集成	10,000	106,100.00	0.01
337	688347	华虹宏力	300	100,890.00	0.00
338	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
339	002340	格林美	14,400	95,184.00	0.00
340	002061	浙江交科	28,500	94,050.00	0.00
341	600386	北巴传媒	29,500	92,040.00	0.00

342	002432	九安医疗	1,300	91,884.00	0.00
343	600512	腾达建设	49,100	91,817.00	0.00
344	002916	深南电路	200	91,580.00	0.00
345	600479	千金药业	9,800	91,140.00	0.00
346	603629	利通电子	500	89,405.00	0.00
347	002737	葵花药业	7,900	88,559.00	0.00
348	600109	国金证券	9,900	86,922.00	0.00
349	002410	广联达	10,600	86,496.00	0.00
350	600558	大西洋	17,500	86,450.00	0.00
351	002299	圣农发展	5,700	86,412.00	0.00
352	003010	若羽臣	3,500	85,050.00	0.00
353	000897	津滨发展	49,700	82,502.00	0.00
354	000423	东阿阿胶	1,800	81,648.00	0.00
355	300773	拉卡拉	5,300	81,090.00	0.00
356	600105	永鼎股份	1,200	80,976.00	0.00
357	000683	博源化工	13,900	80,064.00	0.00
358	300755	华致酒行	6,900	78,591.00	0.00
359	002624	完美世界	6,300	78,246.00	0.00
360	601108	财通证券	9,000	77,850.00	0.00
361	603511	爱慕股份	6,600	75,900.00	0.00
362	688213	思特威	700	74,949.00	0.00
363	000750	国海证券	19,800	72,864.00	0.00
364	600496	精工钢构	23,100	71,610.00	0.00
365	002444	巨星科技	2,300	71,530.00	0.00
366	600183	生益科技	400	69,360.00	0.00
367	600114	东睦股份	1,800	67,968.00	0.00
368	688019	安集科技	200	67,892.00	0.00
369	000060	中金岭南	8,800	66,616.00	0.00
370	300438	鹏辉能源	800	66,280.00	0.00
371	300957	贝泰妮	2,100	66,171.00	0.00
372	688120	华海清科	200	64,436.00	0.00
373	002152	广电运通	6,600	61,908.00	0.00
374	002746	仙坛股份	12,000	61,200.00	0.00
375	002463	沪电股份	400	61,120.00	0.00
376	000034	神州数码	2,200	61,050.00	0.00
377	603111	康尼机电	10,600	59,996.00	0.00
378	000960	锡业股份	1,400	59,766.00	0.00
379	000404	长虹华意	7,600	59,736.00	0.00
380	603195	公牛集团	1,500	58,725.00	0.00
381	600616	金枫酒业	15,500	58,125.00	0.00
382	002078	太阳纸业	4,600	57,454.00	0.00
383	002961	瑞达期货	2,900	56,782.00	0.00
384	600312	平高电气	3,200	56,512.00	0.00

385	603816	顾家家居	2,500	55,900.00	0.00
386	688372	伟测科技	300	55,800.00	0.00
387	002185	华天科技	2,500	55,775.00	0.00
388	600497	驰宏锌锗	4,600	55,706.00	0.00
389	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.00
390	002126	银轮股份	1,100	54,780.00	0.00
391	300110	华仁药业	22,000	54,560.00	0.00
392	600642	申能股份	6,200	54,126.00	0.00
393	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
394	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
395	300432	富临精工	2,660	53,439.40	0.00
396	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.00
397	000021	深科技	800	51,416.00	0.00
398	001286	陕西能源	4,900	49,686.00	0.00
399	601225	陕西煤业	2,400	48,840.00	0.00
400	603179	新泉股份	980	48,657.00	0.00
401	603308	应流股份	800	48,320.00	0.00
402	300136	信维通信	400	47,700.00	0.00
403	603197	保隆科技	1,700	47,498.00	0.00
404	300769	德方纳米	700	46,550.00	0.00
405	002222	福晶科技	500	46,140.00	0.00
406	300001	特锐德	1,200	45,396.00	0.00
407	300623	捷捷微电	1,000	44,990.00	0.00
408	603920	世运电路	900	43,236.00	0.00
409	600995	南网储能	3,500	43,050.00	0.00
410	600583	海油工程	8,500	42,755.00	0.00
411	601155	新城控股	4,100	42,066.00	0.00
412	300285	国瓷材料	400	41,272.00	0.00
413	002170	芭田股份	3,800	41,268.00	0.00
414	688099	晶晨股份	400	41,160.00	0.00
415	600998	九州通	8,600	40,334.00	0.00
416	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
417	688183	生益电子	300	39,720.00	0.00
418	600754	锦江酒店	2,200	39,578.00	0.00
419	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
420	600765	中航重机	3,000	38,760.00	0.00
421	301626	苏州天脉	100	38,396.00	0.00
422	002396	星网锐捷	2,000	38,340.00	0.00
423	000155	川能动力	3,200	38,336.00	0.00
424	600332	白云山	1,900	38,076.00	0.00
425	603379	三美股份	500	37,945.00	0.00
426	002603	以岭药业	2,500	37,500.00	0.00
427	603606	东方电缆	900	37,359.00	0.00

428	603259	药明康德	300	37,353.00	0.00
429	300140	节能环保	7,500	37,275.00	0.00
430	000603	盛达资源	1,600	36,960.00	0.00
431	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.00
432	600380	健康元	3,900	36,738.00	0.00
433	300146	汤臣倍健	4,000	36,160.00	0.00
434	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
435	003031	中瓷电子	200	36,060.00	0.00
436	300679	电连技术	600	35,994.00	0.00
437	600196	复星医药	1,600	35,952.00	0.00
438	688385	复旦微电	500	35,645.00	0.00
439	601600	中国铝业	4,300	35,346.00	0.00
440	603939	益丰药房	1,900	34,162.00	0.00
441	600549	厦门钨业	400	34,080.00	0.00
442	002926	华西证券	4,100	33,497.00	0.00
443	000893	亚钾国际	800	32,712.00	0.00
444	300573	兴齐眼药	800	32,608.00	0.00
445	601608	中信重工	6,700	31,959.00	0.00
446	603035	常熟汽饰	3,000	31,860.00	0.00
447	601163	三角轮胎	2,500	31,725.00	0.00
448	688615	合合信息	280	31,668.00	0.00
449	600352	浙江龙盛	2,600	31,486.00	0.00
450	300984	金沃股份	580	31,163.40	0.00
451	300381	溢多利	5,500	30,910.00	0.00
452	300035	中科电气	2,134	30,772.28	0.00
453	002050	三花智控	700	30,681.00	0.00
454	000581	威孚高科	1,800	30,636.00	0.00
455	603290	斯达半导	200	30,588.00	0.00
456	600166	福田汽车	10,500	30,555.00	0.00
457	002344	海宁皮城	8,700	30,450.00	0.00
458	300738	奥飞数据	1,500	30,330.00	0.00
459	600435	北方导航	2,700	30,240.00	0.00
460	000680	山推股份	3,000	30,150.00	0.00
461	002249	大洋电机	4,000	30,000.00	0.00
462	000338	潍柴动力	1,100	29,975.00	0.00
463	002500	山西证券	5,800	29,928.00	0.00
464	600028	中国石化	6,700	29,882.00	0.00
465	603071	物产环能	2,700	29,862.00	0.00
466	002734	利民股份	1,739	29,858.63	0.00
467	600329	达仁堂	800	29,776.00	0.00
468	600115	中国东航	7,700	29,337.00	0.00
469	300045	华力创通	1,700	29,308.00	0.00
470	300699	光威复材	1,000	28,650.00	0.00

471	603877	太平鸟	2,400	28,392.00	0.00
472	600048	保利发展	6,100	28,243.00	0.00
473	600508	上海能源	3,820	28,153.40	0.00
474	002262	恩华药业	1,500	28,125.00	0.00
475	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
476	600577	精达股份	2,800	27,384.00	0.00
477	600098	广州发展	4,600	27,186.00	0.00
478	300030	阳普医疗	4,500	26,145.00	0.00
479	002600	领益智造	1,500	26,010.00	0.00
480	000513	丽珠集团	900	26,001.00	0.00
481	000681	视觉中国	1,300	25,922.00	0.00
482	601156	东航物流	1,600	25,792.00	0.00
483	300002	神州泰岳	3,300	25,773.00	0.00
484	600602	云赛智联	1,600	25,728.00	0.00
485	601019	山东出版	4,000	25,600.00	0.00
486	603129	春风动力	100	25,580.00	0.00
487	603338	浙江鼎力	600	25,500.00	0.00
488	603083	剑桥科技	100	25,487.00	0.00
489	300770	新媒股份	800	25,192.00	0.00
490	688297	中无人机	600	24,930.00	0.00
491	002195	岩山科技	3,800	24,852.00	0.00
492	000555	神州信息	2,400	24,720.00	0.00
493	300570	太辰光	100	24,671.00	0.00
494	601021	春秋航空	541	24,658.78	0.00
495	601801	皖新传媒	5,000	24,650.00	0.00
496	600229	城市传媒	5,300	24,592.00	0.00
497	002442	龙星科技	4,978	24,541.54	0.00
498	301369	联动科技	100	24,500.00	0.00
499	600299	安迪苏	3,100	24,335.00	0.00
500	600517	国网英大	5,100	23,868.00	0.00
501	600988	赤峰黄金	900	23,688.00	0.00
502	300759	康龙化成	800	23,144.00	0.00
502	603659	璞泰来	800	23,144.00	0.00
503	002423	中粮资本	2,800	23,044.00	0.00
504	002400	省广集团	3,600	22,716.00	0.00
505	601877	正泰电器	900	22,563.00	0.00
506	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
507	600089	特变电工	1,000	22,500.00	0.00
508	002409	雅克科技	100	22,450.00	0.00
509	002240	盛新锂能	500	22,415.00	0.00
510	600369	西南证券	5,500	22,110.00	0.00
511	603556	海兴电力	1,000	22,000.00	0.00
512	000676	智度股份	4,300	21,973.00	0.00

513	000887	中鼎股份	1,200	21,468.00	0.00
514	002065	东华软件	3,000	21,420.00	0.00
515	600063	皖维高新	2,800	21,280.00	0.00
516	002283	天润工业	2,200	21,230.00	0.00
517	301086	鸿富瀚	100	20,928.00	0.00
518	301486	致尚科技	100	20,832.00	0.00
519	688591	泰凌微	600	20,628.00	0.00
520	002063	远光软件	4,000	20,400.00	0.00
521	688677	海泰新光	200	20,226.00	0.00
522	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
523	002922	伊戈尔	600	19,680.00	0.00
524	600664	哈药股份	6,500	19,435.00	0.00
525	300454	深信服	200	19,240.00	0.00
526	600480	凌云股份	2,300	19,113.00	0.00
527	603298	杭叉集团	800	19,088.00	0.00
528	688486	龙迅股份	300	19,074.00	0.00
529	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
530	000776	广发证券	800	18,720.00	0.00
531	600211	西藏药业	500	18,695.00	0.00
532	688439	振华风光	400	18,480.00	0.00
533	000988	华工科技	100	18,461.00	0.00
534	000768	中航西飞	900	18,432.00	0.00
535	688295	中复神鹰	300	18,162.00	0.00
536	600298	安琪酵母	500	18,100.00	0.00
537	600038	中直股份	700	17,703.00	0.00
538	605319	无锡振华	780	17,698.20	0.00
539	002006	精工科技	1,200	17,652.00	0.00
540	600416	湘电股份	1,800	17,640.00	0.00
541	600131	国网信通	1,200	17,520.00	0.00
542	300151	昌红科技	700	17,465.00	0.00
543	002690	美亚光电	1,200	17,196.00	0.00
544	002335	科华数据	400	16,980.00	0.00
545	603279	景津装备	1,400	16,800.00	0.00
546	688561	奇安信	700	16,786.00	0.00
547	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
548	000528	柳工	2,200	16,610.00	0.00
549	000738	航发控制	900	16,461.00	0.00
550	688045	必易微	200	16,156.00	0.00
551	300415	伊之密	800	15,928.00	0.00
552	600848	上海临港	2,100	15,729.00	0.00
553	301607	富特科技	300	15,675.00	0.00
554	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
555	603927	中科软	1,200	15,252.00	0.00

556	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
557	300397	天和防务	1,000	15,140.00	0.00
558	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
559	002270	华明装备	800	15,080.00	0.00
560	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
561	603858	步长制药	1,000	14,600.00	0.00
562	002297	博云新材	500	14,495.00	0.00
563	603529	爱玛科技	730	14,242.30	0.00
564	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
565	000650	仁和药业	2,700	13,743.00	0.00
566	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
567	002595	豪迈科技	290	13,514.00	0.00
568	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
569	002354	天娱数科	1,400	13,020.00	0.00
570	002946	新乳业	900	12,672.00	0.00
571	002429	兆驰股份	1,200	12,468.00	0.00
572	600143	金发科技	800	12,360.00	0.00
573	300684	中石科技	200	12,200.00	0.00
574	300034	钢研高纳	700	11,998.00	0.00
575	002636	金安国纪	100	11,997.00	0.00
576	002155	湖南黄金	500	11,935.00	0.00
577	600933	爱柯迪	800	11,824.00	0.00
578	600389	江山股份	600	11,712.00	0.00
579	300017	网宿科技	900	11,709.00	0.00
580	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
581	000973	佛塑科技	800	11,480.00	0.00
582	601958	金钼股份	400	11,244.00	0.00
583	600267	海正药业	1,100	11,121.00	0.00
584	600737	中粮糖业	900	11,097.00	0.00
585	000591	太阳能	2,400	11,040.00	0.00
586	600460	士兰微	200	10,932.00	0.00
587	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.00
588	600478	科力远	2,100	10,584.00	0.00
589	300866	安克创新	100	10,450.00	0.00
590	600600	青岛啤酒	200	10,446.00	0.00
591	300975	商络电子	200	10,350.00	0.00
592	600486	扬农化工	200	10,140.00	0.00
593	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
594	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
595	002043	兔宝宝	900	9,972.00	0.00
596	603596	伯特利	400	9,936.00	0.00
597	603225	新凤鸣	500	9,825.00	0.00
598	603118	共进股份	800	9,688.00	0.00

599	000883	湖北能源	2,200	9,504.00	0.00
600	000967	盈峰环境	900	9,477.00	0.00
601	300100	双林股份	334	9,278.52	0.00
602	300800	力合科技	1,000	9,250.00	0.00
603	603040	新坐标	145	9,145.15	0.00
604	301602	超研股份	658	9,040.92	0.00
605	002131	利欧股份	1,900	9,025.00	0.00
606	600867	通化东宝	1,100	8,844.00	0.00
607	603565	中谷物流	900	8,829.00	0.00
608	601872	招商轮船	500	8,785.00	0.00
609	000400	许继电气	400	8,680.00	0.00
610	600941	中国移动	100	8,613.00	0.00
611	300257	开山股份	300	8,604.00	0.00
612	002001	新和成	300	8,526.00	0.00
613	002014	永新股份	800	8,448.00	0.00
614	603950	长源东谷	100	8,443.00	0.00
615	600060	海信视像	300	8,361.00	0.00
616	300283	温州宏丰	400	8,220.00	0.00
617	688387	信科移动	400	7,936.00	0.00
618	601139	深圳燃气	1,400	7,924.00	0.00
619	600826	兰生股份	900	7,911.00	0.00
620	002352	顺丰控股	248	7,752.48	0.00
621	002810	山东赫达	300	7,410.00	0.00
622	600498	烽火通信	100	7,360.00	0.00
623	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.00
624	600388	龙净环保	500	7,275.00	0.00
625	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
626	002084	海鸥住工	2,000	6,960.00	0.00
627	002293	罗莱生活	700	6,923.00	0.00
628	002378	章源钨业	200	6,696.00	0.00
629	002812	恩捷股份	100	6,691.00	0.00
630	603889	新澳股份	1,300	6,643.00	0.00
631	601311	骆驼股份	800	6,232.00	0.00
632	603728	鸣志电器	100	6,092.00	0.00
633	002688	金河生物	1,300	6,006.00	0.00
634	601336	新华保险	100	5,966.00	0.00
635	002833	弘亚数控	300	5,787.00	0.00
636	002338	奥普光电	100	5,720.00	0.00
637	002969	嘉美包装	400	5,632.00	0.00
638	001206	依依股份	300	5,628.00	0.00
639	300115	长盈精密	200	5,588.00	0.00
640	002074	国轩高科	200	5,502.00	0.00
641	002518	科士达	100	5,359.00	0.00

642	002311	海大集团	120	5,353.20	0.00
643	002296	辉煌科技	600	5,328.00	0.00
644	300302	同有科技	100	5,117.00	0.00
645	002658	雪迪龙	600	5,070.00	0.00
646	603806	福斯特	300	5,037.00	0.00
647	002407	多氟多	100	5,023.00	0.00
648	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
649	601020	华钰矿业	200	4,798.00	0.00
650	600141	兴发集团	100	4,697.00	0.00
651	000600	建投能源	500	4,375.00	0.00
652	000009	中国宝安	700	4,361.00	0.00
653	601857	中国石油	500	4,340.00	0.00
654	600699	均胜电子	200	4,322.00	0.00
655	688182	灿勤科技	100	4,307.00	0.00
656	603357	设计总院	700	4,256.00	0.00
657	002635	安洁科技	200	4,090.00	0.00
658	605020	永和股份	100	4,072.00	0.00
659	600185	珠免集团	900	4,050.00	0.00
660	002483	润邦股份	800	3,952.00	0.00
661	002465	海格通信	300	3,831.00	0.00
662	603127	昭衍新药	100	3,822.00	0.00
663	300752	隆利科技	280	3,771.60	0.00
664	600282	南钢股份	800	3,672.00	0.00
665	001337	四川黄金	100	3,666.00	0.00
666	300592	华凯易佰	200	3,540.00	0.00
667	601107	四川成渝	700	3,416.00	0.00
668	300652	雷迪克	100	3,351.00	0.00
669	002867	周大生	300	3,345.00	0.00
670	002294	信立泰	100	3,189.00	0.00
671	603868	飞科电器	100	3,080.00	0.00
672	002440	闰土股份	300	3,075.00	0.00
673	000058	深赛格	500	3,070.00	0.00
674	603737	三棵树	120	2,892.00	0.00
675	600875	东方电气	100	2,877.00	0.00
676	002805	丰元股份	100	2,859.00	0.00
677	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
678	002202	金风科技	119	2,844.10	0.00
679	000538	云南白药	60	2,842.20	0.00
680	600507	方大特钢	700	2,835.00	0.00
681	601717	中创智领	200	2,782.00	0.00
682	601333	广深铁路	1,000	2,750.00	0.00
683	000429	粤高速 A	200	2,730.00	0.00
684	601678	滨化股份	400	2,636.00	0.00

685	000686	东北证券	300	2,520.00	0.00
686	301060	兰卫医学	300	2,451.00	0.00
687	300206	理邦仪器	200	2,446.00	0.00
688	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
689	002315	焦点科技	100	2,328.00	0.00
690	300658	延江股份	200	2,286.00	0.00
691	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
692	002612	朗姿股份	200	2,242.00	0.00
693	600582	天地科技	500	2,225.00	0.00
694	300171	东富龙	200	2,212.00	0.00
695	002507	涪陵榨菜	200	2,160.00	0.00
696	000593	德龙汇能	100	2,138.00	0.00
697	688728	格科微	100	2,104.00	0.00
698	301027	华蓝集团	100	2,069.00	0.00
699	601568	北元化工	600	2,040.00	0.00
700	000050	深天马 A	200	1,982.00	0.00
701	300070	碧水源	600	1,914.00	0.00
702	603993	洛阳钼业	100	1,755.00	0.00
703	002701	奥瑞金	400	1,704.00	0.00
704	001330	博纳影业	300	1,686.00	0.00
705	300351	永贵电器	100	1,650.00	0.00
706	688779	五矿新能	200	1,622.00	0.00
707	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
708	002204	大连重工	300	1,584.00	0.00
709	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
710	600410	华胜天成	100	1,583.00	0.00
711	600110	诺德股份	100	1,509.00	0.00
712	601952	苏垦农发	200	1,498.00	0.00
713	000778	新兴铸管	400	1,484.00	0.00
714	600032	浙江新能	200	1,410.00	0.00
715	300162	雷曼光电	100	1,381.00	0.00
716	603456	九洲药业	100	1,366.00	0.00
716	603916	苏博特	100	1,366.00	0.00
717	601339	百隆东方	200	1,354.00	0.00
718	601319	中国人保	200	1,352.00	0.00
719	601921	浙版传媒	200	1,338.00	0.00
720	600271	航天信息	200	1,316.00	0.00
721	000598	兴蓉环境	200	1,284.00	0.00
722	300703	创源股份	100	1,277.00	0.00
723	002419	天虹股份	300	1,269.00	0.00
724	603328	依顿电子	100	1,253.00	0.00
725	600609	金杯汽车	400	1,248.00	0.00
726	300383	光环新网	100	1,244.00	0.00

727	002457	青龙管业	100	1,223.00	0.00
728	002395	双象股份	100	1,196.00	0.00
729	000902	新洋丰	100	1,156.00	0.00
730	603739	蔚蓝生物	100	1,153.00	0.00
731	000532	华金资本	100	1,074.00	0.00
732	000151	中成股份	100	1,070.00	0.00
733	002083	孚日股份	100	1,049.00	0.00
734	002687	乔治白	200	1,048.00	0.00
735	601728	中国电信	200	1,038.00	0.00
736	600483	福能股份	100	1,019.00	0.00
737	300541	先进数通	100	965.00	0.00
738	300694	蠡湖股份	100	960.00	0.00
739	300453	三鑫医疗	100	904.00	0.00
740	600025	华能水电	100	889.00	0.00
741	002163	海南发展	100	834.00	0.00
742	601777	千里科技	100	816.00	0.00
743	600004	白云机场	100	726.00	0.00
744	002062	宏润建设	100	716.00	0.00
745	002852	道道全	100	709.00	0.00
746	301039	中集车辆	100	705.00	0.00
747	300466	赛摩智能	100	704.00	0.00
748	600986	浙文互联	100	698.00	0.00
749	002615	哈尔斯	100	690.00	0.00
750	002054	德美化工	100	665.00	0.00
751	002478	常宝股份	100	618.00	0.00
752	300008	天海防务	100	606.00	0.00
753	002469	三维化学	100	572.00	0.00
754	002121	科陆电子	100	545.00	0.00
755	600223	福瑞达	100	503.00	0.00
756	601686	友发集团	100	483.00	0.00
757	300182	捷成股份	100	475.00	0.00
758	300242	佳云科技	100	470.00	0.00
759	600120	浙江东方	100	430.00	0.00
760	002421	达实智能	100	347.00	0.00
761	002110	三钢闽光	100	288.00	0.00
762	601599	浙文影业	100	279.00	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	300750	宁德时代	322,043,338.40	12.11
2	688008	澜起科技	198,430,052.12	7.46
3	300054	鼎龙股份	176,605,551.66	6.64
4	605499	东鹏饮料	157,815,868.11	5.93
5	300693	盛弘股份	113,738,318.50	4.28
6	688279	峰昭科技	97,174,224.69	3.65
7	301486	致尚科技	89,840,753.90	3.38
8	002558	巨人网络	85,396,714.40	3.21
9	688403	汇成股份	83,738,744.32	3.15
10	300274	阳光电源	77,674,236.40	2.92
11	601688	华泰证券	76,282,681.00	2.87
12	600398	海澜之家	69,648,513.90	2.62
13	688630	芯碁微装	68,414,707.84	2.57
14	002517	恺英网络	64,813,791.28	2.44
15	603296	华勤技术	58,560,353.00	2.20
16	688249	晶合集成	57,722,282.72	2.17
17	603986	兆易创新	57,700,540.06	2.17
18	688256	寒武纪	55,512,610.90	2.09
19	688127	蓝特光学	51,915,960.63	1.95
20	688018	乐鑫科技	50,430,781.24	1.90

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	688008	澜起科技	312,570,594.73	11.75
2	688249	晶合集成	214,200,970.70	8.06
3	300054	鼎龙股份	211,899,534.05	7.97
4	688220	翱捷科技	186,357,069.93	7.01
5	300750	宁德时代	183,796,712.22	6.91
6	002558	巨人网络	180,527,326.00	6.79
7	301486	致尚科技	132,596,211.91	4.99
8	688018	乐鑫科技	125,527,408.67	4.72
9	002847	盐津铺子	104,724,520.61	3.94
10	002517	恺英网络	103,609,127.00	3.90
11	002027	分众传媒	94,838,952.00	3.57
12	688279	峰昭科技	92,632,732.16	3.48
13	688403	汇成股份	83,425,483.54	3.14
14	688766	普冉股份	81,836,455.41	3.08

15	688630	芯碁微装	79,091,208.99	2.97
16	300274	阳光电源	76,507,613.90	2.88
17	603296	华勤技术	75,065,034.67	2.82
18	603986	兆易创新	67,677,619.60	2.55
19	688127	蓝特光学	63,481,507.74	2.39
20	301656	联合动力	61,074,932.54	2.30
21	002436	兴森科技	58,797,634.00	2.21

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	5,945,898,944.53
卖出股票的收入（成交）总额	6,989,107,243.42

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	81,464,260.75	3.88
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）	14,943.38	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,479,204.13	3.88

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	019827	26 国债 01	295,000	29,691,216.58	1.41
2	019792	25 国债 19	243,000	24,554,963.59	1.17
3	019785	25 国债 13	168,000	17,012,108.06	0.81
4	102317	国债 2519	101,000	10,205,972.52	0.49
5	123272	中汽转债	95	14,943.38	0.00

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

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

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约定备选股票库之外的股票。
 本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,638,099.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,638,099.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净值 比例(%)	流通受限情况说 明
1	300750	宁德时代	87,321,780.00	4.16	非公开发行限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时智选量化多因子股票 A	17,273	35,319.03	226,773,003.40	37.17%	383,292,659.72	62.83%
博时智选量化多因子股票 C	56,894	17,803.15	508,750,640.22	50.23%	504,141,635.36	49.77%
合计	73,268	22,150.98	735,523,643.62	45.32%	887,434,295.08	54.68%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	89.59%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易，剔除场内相关数据（如有）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时智选量化多因子股票 A	2,423,973.76	0.40%
	博时智选量化多因子股票 C	229,843.77	0.02%
	合计	2,653,817.53	0.16%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	>100
	博时智选量化多因子股票 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博时智选量化多因子股票 A	>100
	博时智选量化多因子股票 C	0~10
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 C
基金合同生效日（2021 年 11 月 2 日）基金份额总额	30,217,799.02	443,311,509.32
本报告期期初基金份额总额	669,654,358.25	1,565,059,283.01
本报告期基金总申购份额	416,941,758.09	905,783,054.04
减：本报告期基金总赎回份额	476,530,453.22	1,457,950,061.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	610,065,663.12	1,012,892,275.58

§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 2026 年 02 月 14 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》，张东先生代任公司首席信息官，王德英先生离任公司副总经理、公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
华创证券	3	12,835,112,791.75	100.00%	5,723,500.28	100.00%	增加 1 个

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

(1) 本公司根据法规要求制定《博时基金公募基金证券交易佣金分配管理办法》，明确选择证券公司参与证券交易的标准和程序，并建立证券公司的准入管理机制，符合筛选标准的证券公司可纳入公司证券公司白名单库，并持续动态管理。

(2) 本公司选择证券公司参与证券交易的主要标准是财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易。严禁基金销售业务人员参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

(3) 本公司依据上述标准进行评估并确定证券公司，与其签订交易单元租用协议或证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	29,521,828.00	100.00%	180,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时智选量化多因子股票型证券投资基金（博	上海证券报、基金管理人	2026-06-26

	时智选量化多因子股票 A) 基金产品资料概要更新	网站、证监会基金电子披露网站	
2	博时智选量化多因子股票型证券投资基金（博时智选量化多因子股票 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
3	博时智选量化多因子股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-05
4	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29
5	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-13
6	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
7	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金投资非公开发行业股票的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-28
8	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-22
9	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
11	博时智选量化多因子股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-05
12	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
13	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
14	博时智选量化多因子股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-06
15	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-20260124	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24

16	博时智选量化多因子股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-22
17	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-22
18	博时智选量化多因子股票型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-10
19	博时智选量化多因子股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-09

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时智选量化多因子股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时智选量化多因子股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时智选量化多因子股票型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时智选量化多因子股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时智选量化多因子股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日