

# 博时量化价值股票型证券投资基金

## 2025 年中期报告

### 2025 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

## § 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
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	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63

7.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>64</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	65
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>65</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>66</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
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 .....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
10.4 基金投资策略的改变 .....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
10.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	70
12.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化价值股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化价值股票	
基金主代码	005960	
交易代码	005960	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	64,641,296.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
下属分级基金的交易代码	005960	005961
报告期末下属分级基金的份额总额	17,165,835.38 份	47,475,460.85 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。
投资策略	本基金投资策略主要由 A 股投资策略、港股投资策略和其他投资策略三部分组成。A 股投资策略：本基金运用量化方法进行价值型投资，本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础，对其中的价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。港股投资策略：本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。其他投资策略主要包括：存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富(总值)指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于中高风险/收益的基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	任航
	联系电话	0755-83169999	010-66060069

	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		江向阳	谷澍

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
本期已实现收益	1,196,513.21	1,568,254.54
本期利润	1,839,662.80	2,179,066.87
加权平均基金份额本期利润	0.0703	0.0706
本期加权平均净值利润率	5.52%	5.73%
本期基金份额净值增长率	5.92%	5.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期末可供分配利润	5,703,342.41	13,300,293.03
期末可供分配基金份额利润	0.3322	0.2802
期末基金资产净值	22,869,177.79	60,775,753.88
期末基金份额净值	1.3322	1.2802
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金份额累计净值增长率	55.11%	46.64%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时量化价值股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.87%	0.53%	2.46%	0.58%	0.41%	-0.05%
过去三个月	3.28%	0.96%	1.88%	1.16%	1.40%	-0.20%
过去六个月	5.92%	0.90%	3.78%	1.04%	2.14%	-0.14%
过去一年	18.32%	1.44%	17.33%	1.21%	0.99%	0.23%
过去三年	6.16%	1.07%	-3.56%	1.01%	9.72%	0.06%
自基金合同生效起至今	55.11%	1.14%	13.71%	1.10%	41.40%	0.04%

博时量化价值股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.82%	0.53%	2.46%	0.58%	0.36%	-0.05%
过去三个月	3.08%	0.96%	1.88%	1.16%	1.20%	-0.20%
过去六个月	5.51%	0.90%	3.78%	1.04%	1.73%	-0.14%
过去一年	17.40%	1.44%	17.33%	1.21%	0.07%	0.23%
过去三年	3.68%	1.07%	-3.56%	1.01%	7.24%	0.06%
自基金合同生效起至今	46.64%	1.14%	13.71%	1.10%	32.93%	0.04%

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

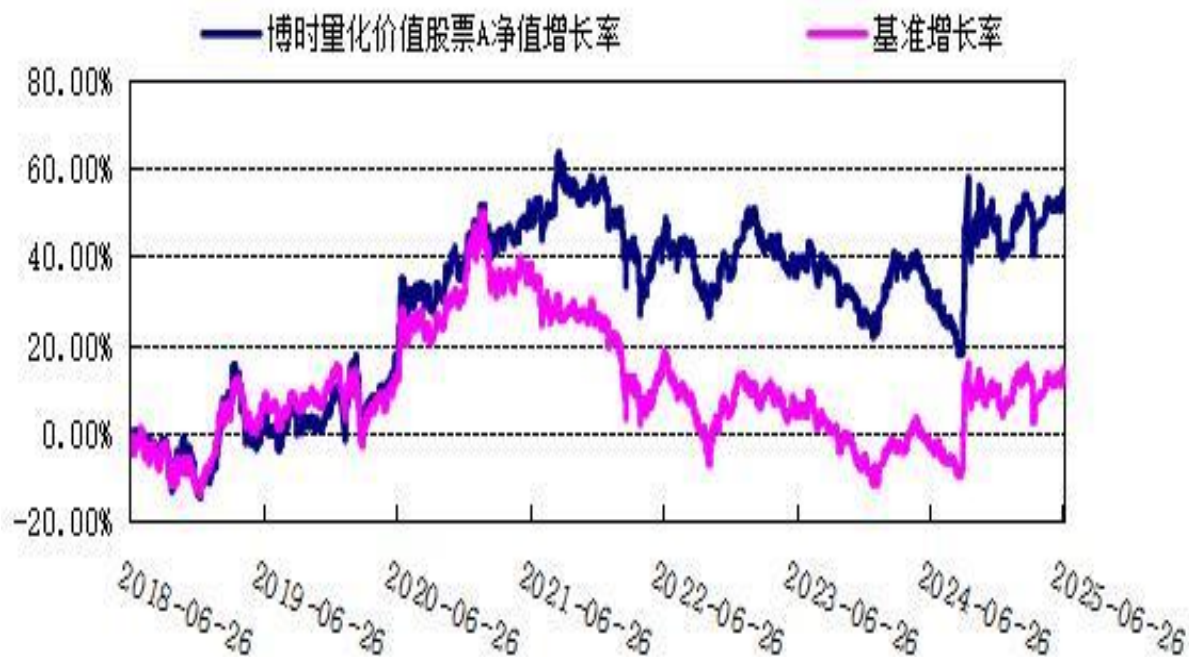
博时量化价值股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

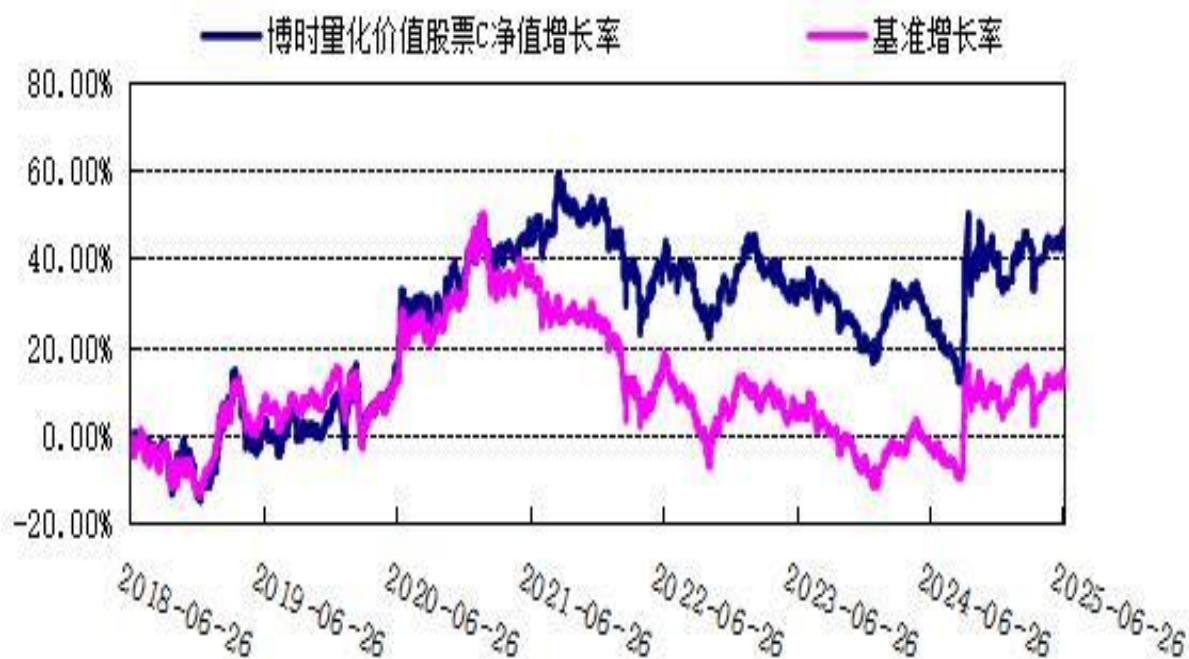
（2018 年 6 月 26 日至 2025 年 6 月 30 日）

博时量化价值股票 A





博时量化价值股票 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 2025 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 394 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 16,069 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 6,729 亿元人民币，累计分红逾 2,186 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄瑞庆	指数与量化投资部投资总监 / 基金经理	2018-06-26	-	22.9	黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长贰号证券投资基金（2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日）、博时价值增长证券投资基金（2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日）、博时特许价值混合型证券投资基金（2015 年 2 月 9 日-2018 年 6 月 21 日）的基金经理、指数与量化投资部总经理。现任指数与量化投资部投资总监兼博时量化平衡混合型证券投资基金（2017 年 5 月 4 日—至

					今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日一至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日一至今)、博时稳健恒利债券型证券投资基金(2024 年 10 月 29 日一至今)的基金经理,兼任投资经理。
王萌	基金经理助理	2023-01-20	2025-04-15	8.9	王萌先生,博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 4 月 16 日一至今)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 6 月 30 日一至今)的基金经理,博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、博时中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、博时中证软件服务指数型发起式证券投资基金、博时中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金、博时中证新能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、博时上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、博时中证传媒指数型发起式证券投资基金、博时创业板指数证券投资基金、博时国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、博时中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金、博时上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。

注:上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
----	------	---------	---------	------

黄瑞庆	公募基金	4	637,846,816.53	2015-02-09
	私募资产管理计划	1	104,759,121.72	2025-01-08
	其他组合	—	—	—
	合计	5	742,605,938.25	

## 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 23 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

2025 年上半年，中国经济一季度和二季度的 GDP 增速为 5.4% 和 5.2%，比年初多数投资者的预期略好。平滑数据之后看进出口贸易趋势，在人民币与美元一起对全球其他主要货币贬值的背景下，按照美元计价的中国出口额稳定增长，进口额保持稳定，顺差继续保持增长态势。进出口价格指数均持续回升，同期国内 CPI 低位运行，而 PPI 则继续下行，整体看制造业仍然面临一定的压力。这种压力在固定资产投资方面体现更加明显，第一、二、三产业以及房地产投资增速均延续下滑趋势。为了积极应对，货币供应量 M1 增速快速转正并到了 4.6%，10 年期国债利率维持低位，1 年期国债利率在 1 季度冲高后持续回落，长短期利差在二季度降到 0.2% 左右。

股票市场投资者预期经过 2024 年四季度政府一系列稳定市场的政策和措施出台之后也逐渐趋

于稳定。虽然经历了 2025 年 4 月初的美国关税政策的冲击，但是市场很快就止住了下跌，并在整个二季度持续上涨。上半年规模以上工业企业营业收入利润率持续上行到 5.15%，但是营业收入和利润各自同比增速都有所下滑。中证 1000 指数表现好于沪深 300 指数，大盘价值指数表现好于大盘成长指数。行业方面，涨幅居前的有有色金属、银行、军工、传媒和通信，而跌幅居前的有煤炭、食品饮料、房地产、石油石化和建筑。行业涨跌幅特征与国际形势和国内投资增速下降的环境相关。

本基金在 2025 上半年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了较高的股票仓位。在策略的配置方面，整体上维持了偏重的价值股配置权重，同时继续坚持顺势而为。今年上半年增加了 AI 模型的配置权重，使得组合整体的风险暴露上更加兼顾了动量和反转，有利于获得稳定的超额收益。未来本基金将持续运用科学的量化方法，寻找和把握基本面和市场面的长期规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，在价值风格表现相对较好的时候加大配置权重，并针对当前市场特征，构建量化策略配置模型的组合，力求为投资者获取超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.3322 元，份额累计净值为 1.5229 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2802 元，份额累计净值为 1.4457 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 5.92%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 5.51%，同期业绩基准增长率为 3.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球方面，2025 上半年美国发动的关税政策冲击在三季度将逐步地尘埃落定，后续影响还很复杂，全球各国经济将在新形势下重新再平衡。中国经济具有一定的韧性，从区域上具有纵深，在全球贸易总量和贸易国结构上具有缓冲余地，中国经济沿着国际、国内双循环的规划继续发展的态势不太会受到影响而发生大的改变。

股票市场最近几年小盘风格和价值风格一直表现较好，未来成长风格的表现有可能会阶段性改善。这种改善是否转为中长期的风格优势，还要继续观察企业利润的增长情况。在目前的估值水平分位，预计未来股票市场不会有大的系统性风险。

在行业结构方面，预计将继续在估值和盈利两个主要矛盾的影响下不断轮动。例如钢铁行业上半年利润增长较好，市场也非常关注“反内卷”的主题投资，光伏设备等相关行业也都可能会受到市场更多关注。有一些行业前几年相对估值偏低，近两年得到显著修复，且利润增长仍有压力的，例如银行等行业可能在未来会遇到风格转换带来的阶段性压力。

#### 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

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

---

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—博时基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，

认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为, 博时基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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; 在报告期内, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规, 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

本托管人认为, 博时基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.6.1	6,317,571.42	6,745,231.91
结算备付金		548,760.38	912,102.49
存出保证金		70,548.10	108,990.98
交易性金融资产	6.4.6.2	77,909,359.72	81,063,067.02
其中：股票投资		77,403,006.84	81,063,067.02
基金投资		-	-
债券投资		506,352.88	-
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		1,474,913.68	42,056.19
应收股利		-	-
应收申购款		15,443.80	898.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		86,336,597.10	88,872,347.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,287,962.64	-
应付赎回款		6,863.19	98,597.83
应付管理人报酬		50,138.33	64,296.03
应付托管费		11,141.84	14,288.01
应付销售服务费		29,614.34	32,357.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.6	305,945.09	510,018.90
负债合计		2,691,665.43	719,558.72
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.6.7	64,641,296.23	71,471,164.07
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	19,003,635.44	16,681,624.33
净资产合计		83,644,931.67	88,152,788.40
<b>负债和净资产总计</b>		<b>86,336,597.10</b>	<b>88,872,347.12</b>

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 64,641,296.23 份。其中 A 类基金份额净值 1.3322 元，基金份额总额 17,165,835.38 份；C 类基金份额净值 1.2802 元，基金份额总额 47,475,460.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024
----	-----	----------------------------	---------------------------------



		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,623,954.63	3,767,438.69
1. 利息收入		17,873.06	90,682.87
其中：存款利息收入	6.4.6.9	17,873.06	90,682.87
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,337,828.83	11,684,489.15
其中：股票投资收益	6.4.6.10	2,419,611.08	9,542,223.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.11	2,757.27	-
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	-	-229,059.77
股利收益	6.4.6.14	915,460.48	2,371,325.69
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	1,253,961.92	-8,011,086.87
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	14,290.82	3,353.54
<b>减：二、营业总支出</b>		605,224.96	1,346,329.85
1. 管理人报酬		319,040.04	812,094.69
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		70,897.81	180,465.46
3. 销售服务费		150,086.00	259,365.14
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		-	451.22
8. 其他费用	6.4.6.18	65,201.11	93,953.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,018,729.67	2,421,108.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,018,729.67	2,421,108.84
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,018,729.67	2,421,108.84

### 6.3 净资产变动表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	71,471,164.07	-	16,681,624.33	88,152,788.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,471,164.07	-	16,681,624.33	88,152,788.40
三、本期增减变动 额（减少以“-”号 填列）	-6,829,867.84	-	2,322,011.11	-4,507,856.73
（一）、综合收益总 额	-	-	4,018,729.67	4,018,729.67
（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）	-6,829,867.84	-	-1,696,718.56	-8,526,586.40
其中：1. 基金申购 款	32,391,427.82	-	8,466,728.07	40,858,155.89
2. 基金赎回款	-39,221,295.66	-	-10,163,446.63	-49,384,742.29
（三）、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的净资产变 动（净资产减少以 “-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资 产	64,641,296.23	-	19,003,635.44	83,644,931.67
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 （若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资	123,710,012.43	-	11,270,687.13	134,980,699.56

产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	123,710,012.43	-	11,270,687.13	134,980,699.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	71,183,230.75	-	9,800,869.26	80,984,100.01
（一）、综合收益总额	-	-	2,421,108.84	2,421,108.84
（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）	71,183,230.75	-	7,379,760.42	78,562,991.17
其中：1. 基金申购款	106,841,152.15	-	12,916,933.88	119,758,086.03
2. 基金赎回款	-35,657,921.40	-	-5,537,173.46	-41,195,094.86
（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	194,893,243.18	-	21,071,556.39	215,964,799.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博时量化价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2018]344 号《关于准予博时量化价值股票型证券投资基金注册的批复》的注册，由博时基金管理有限公司于 2018 年 6 月 1 日至 2018 年 6 月 22 日向社会公开募集。基金合同于 2018 年 6 月 26 日生效，首次设立募集规模为 341,191,900.59 份基金份额。本基金为契

约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《博时量化价值股票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，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；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、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。

本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、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”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金，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的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的 80%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债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 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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+恒生综合指数收益率 $\times$ 20%+中债综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 10%。

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 2025 年 8 月 27 日批准报出。

#### 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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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>》以及中国证监会和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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别

核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，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。

### （5） 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号

文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	6,317,571.42
等于：本金	6,316,971.86
加：应计利息	599.56
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	6,317,571.42

##### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		75,857,738.75	-	77,403,006.84	1,545,268.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	501,147.00	6,352.88	506,352.88	-1,147.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	501,147.00	6,352.88	506,352.88	-1,147.00
资产支持证券		-	-	-	-



基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	76,358,885.75	6,352.88	77,909,359.72	1,544,121.09

#### 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 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	224,376.80
其中：交易所市场	224,376.80
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,568.27
合计	305,945.09

#### 6.4.6.7 实收基金

##### 博时量化价值股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	32,195,197.75	32,195,197.75
本期申购	3,067,931.10	3,067,931.10
本期赎回（以“-”号填列）	-18,097,293.47	-18,097,293.47
本期末	17,165,835.38	17,165,835.38

**博时量化价值股票 C**

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	39,275,966.32	39,275,966.32
本期申购	29,323,496.72	29,323,496.72
本期赎回（以“-”号填列）	-21,124,002.19	-21,124,002.19
本期末	47,475,460.85	47,475,460.85

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**
**博时量化价值股票 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	23,068,435.59	-14,768,507.78	8,299,927.81
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	23,068,435.59	-14,768,507.78	8,299,927.81
本期利润	1,196,513.21	643,149.59	1,839,662.80
本期基金份额交易产生的变动数	-10,958,245.21	6,521,997.01	-4,436,248.20
其中：基金申购款	2,310,637.45	-1,448,401.81	862,235.64
基金赎回款	-13,268,882.66	7,970,398.82	-5,298,483.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,306,703.59	-7,603,361.18	5,703,342.41

**博时量化价值股票 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	25,985,681.45	-17,603,984.93	8,381,696.52
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	25,985,681.45	-17,603,984.93	8,381,696.52
本期利润	1,568,254.54	610,812.33	2,179,066.87
本期基金份额交易产生的变动数	6,305,931.79	-3,566,402.15	2,739,529.64
其中：基金申购款	20,640,879.61	-13,036,387.18	7,604,492.43
基金赎回款	-14,334,947.82	9,469,985.03	-4,864,962.79
本期已分配利润	-	-	-

本期末	33,859,867.78	-20,559,574.75	13,300,293.03
-----	---------------	----------------	---------------

#### 6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,798.01
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	1,590.07
其他	1,484.98
合计	17,873.06

#### 6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	614,163,558.06
减：卖出股票成本总额	610,787,715.63
减：交易费用	956,231.35
买卖股票差价收入	2,419,611.08

#### 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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,757.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	2,757.27

##### 6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

#### 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

无发生额。

#### 6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	915,460.48
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	915,460.48

#### 6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,253,961.92
——股票投资	1,255,108.92
——债券投资	-1,147.00
——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	1,253,961.92

#### 6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,213.40
基金转换费收入	1,077.42
合计	14,290.82

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
其他	8.69
银行汇划费	4,124.15
中债登账户维护费	9,000.00
合计	65,201.11

#### 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

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），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。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	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

##### 6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	-	-	771,482,206.04	29.77%

##### 6.4.9.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.9.1.3 债券交易

无。

##### 6.4.9.1.4 债券回购交易

无。

##### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	729,806.60	29.77%	473,923.38	36.92%

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。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	319,040.04	812,094.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	62,058.48	154,877.82
应支付基金管理人的净管理费	256,981.56	657,216.87

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 0.90% 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 × 0.90% / 当年天数。

##### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,897.81	180,465.46

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 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		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
中国农业银行	—	7,303.76	7,303.76
博时基金	—	119,045.29	119,045.29
合计	—	126,349.05	126,349.05
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
博时基金	—	132,433.41	132,433.41
中国农业银行	—	3,383.42	3,383.42
招商证券	—	179.44	179.44



合计	-	135,996.27	135,996.27
----	---	------------	------------

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 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

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期初持有的基金份额	4,714,693.17	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	4,714,693.17	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.29%	-	-	-

##### 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

#### 博时量化价值股票 C

份额单位：份

关联方名称	博时量化价值股票 C 本期末 2025 年 6 月 30 日		博时量化价值股票 C 上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例
博时资本	13,754,212.23	21.28%	13,754,212.23	19.24%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。  
2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国农业银行-活期存款	6,317,571.42	14,798.01	11,354,795.35	50,440.18

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 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
招商证券股份 有限公司	688692	达梦数据	网下发行	663.00	57,654.48

#### 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

无。

#### 6.4.11 期末（2025 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

无。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000633	合金投资	2025-06-24	重大事项停牌	6.15	2025-07-01	6.77	21,400.00	126,054.00	131,610.00	-
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	12,200.00	411,861.21	464,210.00	-

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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 2025 年 6 月 30 日	上年末 2024 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	506,352.88	—
合计	506,352.88	—

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

无。

#### 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 2025 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	6,317,571.42	-	-	-	6,317,571.42
结算备付金	548,760.38	-	-	-	548,760.38
存出保证金	70,548.10	-	-	-	70,548.10
交易性金融资产	506,352.88	-	-	77,403,006.84	77,909,359.72

应收清算款	-	-	-	1,474,913.68	1,474,913.68
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	15,443.80	15,443.80
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>7,443,232.78</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-78,893,364.32</b>	<b>86,336,597.10</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,863.19	6,863.19
应付清算款	-	-	-	2,287,962.64	2,287,962.64
应付管理人报酬	-	-	-	50,138.33	50,138.33
应付托管费	-	-	-	11,141.84	11,141.84
应付销售服务费	-	-	-	29,614.34	29,614.34
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	305,945.09	305,945.09
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,691,665.43</b>	<b>2,691,665.43</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>7,443,232.78</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-76,201,698.89</b>	<b>83,644,931.67</b>
<b>上年度末</b>					
<b>2024 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	6,745,231.91	-	-	-	6,745,231.91
结算备付金	912,102.49	-	-	-	912,102.49
存出保证金	108,990.98	-	-	-	108,990.98
交易性金融资产	-	-	-	81,063,067.02	81,063,067.02
应收清算款	-	-	-	42,056.19	42,056.19
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	898.53	898.53
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>7,766,325.38</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-81,106,021.74</b>	<b>88,872,347.12</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	98,597.83	98,597.83
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	64,296.03	64,296.03
应付托管费	-	-	-	14,288.01	14,288.01
应付销售服务费	-	-	-	32,357.95	32,357.95



应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	510,018.90	510,018.90
负债总计	-	-	719,558.72	719,558.72
利率敏感度缺口	7,766,325.38	-	-80,386,463.02	88,152,788.40

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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(不包括可转债和可交换债)、资产支持证券投资 and 国债期货投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

2. 以上金额为四舍五入的结果。

#### 6.4.12.4.2 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	77,403,006.84	92.54	81,063,067.02	91.96
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	77,403,006.84	92.54	81,063,067.02	91.96

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为0。

#### 6.4.12.4.3.2 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约378	增加约405
	业绩比较基准下降5%	减少约378	减少约405

#### 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 2025年6月30日
第一层次	76,807,186.84
第二层次	1,102,172.88
第三层次	—
合计	77,909,359.72

###### 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	77,403,006.84	89.65
	其中：股票	77,403,006.84	89.65
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	506,352.88	0.59
	其中：债券	506,352.88	0.59
	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	6,866,331.80	7.95
8	其他各项资产	1,560,905.58	1.81
9	合计	86,336,597.10	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	269,932.00	0.32
B	采矿业	2,289,368.00	2.74

C	制造业	42,651,389.24	50.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,279,607.00	2.73
E	建筑业	900,405.00	1.08
F	批发和零售业	2,004,716.00	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	1,536,825.00	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,948,214.00	4.72
J	金融业	18,713,709.70	22.37
K	房地产业	310,338.00	0.37
L	租赁和商务服务业	532,567.50	0.64
M	科学研究和技术服务业	972,652.40	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	242,014.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	65,006.00	0.08
Q	卫生和社会工作	19,968.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	662,806.00	0.79
S	综合	3,489.00	0.00
	合计	77,403,006.84	92.54

### 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	601318	中国平安	46,200	2,563,176.00	3.06
2	600036	招商银行	43,600	2,003,420.00	2.40
3	601166	兴业银行	64,100	1,496,094.00	1.79
4	600519	贵州茅台	1,000	1,409,520.00	1.69
5	000333	美的集团	15,800	1,140,760.00	1.36
6	601398	工商银行	145,200	1,102,068.00	1.32
7	300502	新易盛	8,540	1,084,750.80	1.30
8	300750	宁德时代	3,300	832,326.00	1.00
9	601328	交通银行	102,300	818,400.00	0.98
10	300972	万辰集团	4,200	757,008.00	0.91
11	600919	江苏银行	61,200	730,728.00	0.87
12	601211	国泰海通	38,100	729,996.00	0.87
13	000858	五粮液	5,700	677,730.00	0.81
14	600866	星湖科技	92,400	638,484.00	0.76
15	000651	格力电器	14,100	633,372.00	0.76
16	601728	中国电信	78,900	611,475.00	0.73
17	300274	阳光电源	8,900	603,153.00	0.72

18	300059	东方财富	24,900	575,937.00	0.69
19	600030	中信证券	20,600	568,972.00	0.68
20	300655	晶瑞电材	56,300	563,563.00	0.67
21	300236	上海新阳	14,200	550,960.00	0.66
22	301230	泓博医药	15,900	547,278.00	0.65
23	600887	伊利股份	19,600	546,448.00	0.65
24	000893	亚钾国际	17,900	539,506.00	0.64
25	603466	风语筑	52,800	532,752.00	0.64
26	600771	广誉远	26,400	532,224.00	0.64
27	301031	中熔电气	6,680	532,062.00	0.64
28	300990	同飞股份	10,600	528,940.00	0.63
29	300824	北鼎股份	44,300	528,499.00	0.63
30	600578	京能电力	117,600	528,024.00	0.63
31	301196	唯科科技	7,800	527,826.00	0.63
32	603380	易德龙	19,800	526,680.00	0.63
33	605599	菜百股份	32,200	526,470.00	0.63
34	601003	柳钢股份	149,000	524,480.00	0.63
35	603040	新坐标	13,000	522,210.00	0.62
36	601601	中国太保	13,700	513,887.00	0.61
37	000568	泸州老窖	4,400	498,960.00	0.60
38	688502	茂莱光学	1,700	489,022.00	0.58
39	601899	紫金矿业	24,400	475,800.00	0.57
40	002594	比亚迪	1,400	464,674.00	0.56
41	688313	仕佳光子	12,200	464,210.00	0.55
42	601988	中国银行	80,700	453,534.00	0.54
43	600941	中国移动	4,000	450,200.00	0.54
44	601860	紫金银行	143,700	431,100.00	0.52
45	688041	海光信息	3,021	426,837.09	0.51
46	600050	中国联通	79,700	425,598.00	0.51
47	689009	九号公司	7,000	414,190.00	0.50
48	600900	长江电力	13,000	391,820.00	0.47
49	601088	中国神华	9,100	368,914.00	0.44
50	688012	中微公司	2,000	364,600.00	0.44
51	601857	中国石油	41,300	353,115.00	0.42
52	601939	建设银行	36,900	348,336.00	0.42
53	300394	天孚通信	4,360	348,102.40	0.42
54	600760	中航沈飞	5,900	345,858.00	0.41
55	601818	光大银行	82,600	342,790.00	0.41
56	000001	平安银行	27,800	335,546.00	0.40
57	600809	山西汾酒	1,900	335,141.00	0.40
58	600031	三一重工	18,600	333,870.00	0.40
59	601229	上海银行	31,400	333,154.00	0.40
60	601169	北京银行	47,200	322,376.00	0.39

61	000009	中国宝安	35,500	315,240.00	0.38
62	601688	华泰证券	17,700	315,237.00	0.38
63	605499	东鹏饮料	1,000	314,050.00	0.38
64	000725	京东方 A	78,700	314,013.00	0.38
65	603893	瑞芯微	2,000	303,720.00	0.36
66	300033	同花顺	1,100	300,311.00	0.36
67	002142	宁波银行	10,800	295,488.00	0.35
68	688981	中芯国际	3,351	295,457.67	0.35
69	601919	中远海控	19,400	291,776.00	0.35
70	300308	中际旭创	2,000	291,720.00	0.35
71	002179	中航光电	7,200	290,592.00	0.35
72	688617	惠泰医疗	950	282,150.00	0.34
73	002475	立讯精密	7,700	267,113.00	0.32
74	600893	航发动力	6,800	262,072.00	0.31
75	601658	邮储银行	47,500	259,825.00	0.31
76	601012	隆基绿能	17,100	256,842.00	0.31
77	688256	寒武纪	426	256,239.00	0.31
78	601009	南京银行	22,000	255,640.00	0.31
79	002028	思源电气	3,500	255,185.00	0.31
80	601766	中国中车	35,900	252,736.00	0.30
81	601668	中国建筑	42,400	244,648.00	0.29
82	603259	药明康德	3,400	236,470.00	0.28
83	002371	北方华创	500	221,105.00	0.26
84	600926	杭州银行	13,000	218,660.00	0.26
85	000063	中兴通讯	6,700	217,683.00	0.26
86	600000	浦发银行	15,600	216,528.00	0.26
87	600276	恒瑞医药	4,100	212,790.00	0.25
88	601816	京沪高铁	35,200	202,400.00	0.24
89	000768	中航西飞	7,300	199,582.00	0.24
90	000338	潍柴动力	12,900	198,402.00	0.24
91	600585	海螺水泥	8,800	188,936.00	0.23
92	600028	中国石化	33,200	187,248.00	0.22
93	600352	浙江龙盛	18,000	182,880.00	0.22
94	601225	陕西煤业	9,300	178,932.00	0.21
95	002027	分众传媒	24,100	175,930.00	0.21
96	601336	新华保险	3,000	175,500.00	0.21
97	600089	特变电工	14,600	174,178.00	0.21
98	000977	浪潮信息	3,400	172,992.00	0.21
99	002230	科大讯飞	3,600	172,368.00	0.21
100	300628	亿联网络	4,800	166,848.00	0.20
101	300153	科泰电源	4,800	162,480.00	0.19
102	000776	广发证券	9,600	161,376.00	0.19
103	600015	华夏银行	20,300	160,573.00	0.19

104	600309	万华化学	2,900	157,354.00	0.19
105	300760	迈瑞医疗	700	157,325.00	0.19
106	300124	汇川技术	2,400	154,968.00	0.19
107	603019	中科曙光	2,200	154,880.00	0.19
108	601825	沪农商行	15,900	154,230.00	0.18
109	601600	中国铝业	21,900	154,176.00	0.18
110	600938	中国海油	5,900	154,049.00	0.18
111	600372	中航机载	12,600	151,956.00	0.18
112	601006	大秦铁路	22,600	149,160.00	0.18
113	688578	艾力斯	1,600	148,864.00	0.18
114	600438	通威股份	8,700	145,725.00	0.17
115	002465	海格通信	10,400	144,976.00	0.17
116	002415	海康威视	5,100	141,423.00	0.17
117	601998	中信银行	16,500	140,250.00	0.17
118	002315	焦点科技	3,000	137,070.00	0.16
119	002545	东方铁塔	15,332	136,301.48	0.16
120	600879	航天电子	13,000	136,110.00	0.16
121	002714	牧原股份	3,200	134,432.00	0.16
122	600096	云天化	6,100	134,017.00	0.16
123	688700	东威科技	3,364	132,709.80	0.16
124	302132	中航成飞	1,500	131,910.00	0.16
125	000633	合金投资	21,400	131,610.00	0.16
126	600019	宝钢股份	19,800	130,482.00	0.16
127	601138	工业富联	6,100	130,418.00	0.16
128	603129	春风动力	600	129,900.00	0.16
129	000792	盐湖股份	7,600	129,808.00	0.16
130	600873	梅花生物	12,100	129,349.00	0.15
131	300498	温氏股份	7,500	128,100.00	0.15
132	601319	中国人保	14,700	128,037.00	0.15
133	002938	鹏鼎控股	3,900	124,917.00	0.15
134	688122	西部超导	2,400	124,512.00	0.15
135	300474	景嘉微	1,700	124,100.00	0.15
136	002311	海大集团	2,100	123,039.00	0.15
137	300433	蓝思科技	5,500	122,650.00	0.15
138	600061	国投资本	16,300	122,576.00	0.15
139	601390	中国中铁	21,200	118,932.00	0.14
140	605376	博迁新材	3,000	114,990.00	0.14
141	000708	中信特钢	9,700	114,072.00	0.14
142	600862	中航高科	4,300	112,144.00	0.13
143	688111	金山办公	400	112,020.00	0.13
144	600741	华域汽车	6,300	111,195.00	0.13
145	600016	民生银行	23,300	110,675.00	0.13
146	000902	新洋丰	8,000	110,640.00	0.13



147	600150	中国船舶	3,400	110,636.00	0.13
148	600033	福建高速	31,000	109,740.00	0.13
149	603766	隆鑫通用	8,600	109,736.00	0.13
150	300414	中光防雷	7,000	108,360.00	0.13
151	000938	紫光股份	4,500	107,955.00	0.13
152	300395	菲利华	2,100	107,310.00	0.13
153	300450	先导智能	4,300	106,855.00	0.13
154	601168	西部矿业	6,400	106,432.00	0.13
155	601628	中国人寿	2,500	102,975.00	0.12
156	601231	环旭电子	7,000	102,410.00	0.12
157	603501	豪威集团	800	102,120.00	0.12
158	603833	欧派家居	1,800	101,610.00	0.12
159	603089	正裕工业	7,700	100,639.00	0.12
160	000733	振华科技	2,000	100,100.00	0.12
161	600299	安迪苏	10,300	99,395.00	0.12
162	603605	珀莱雅	1,200	99,348.00	0.12
163	688036	传音控股	1,239	98,748.30	0.12
164	002416	爱施德	8,200	98,564.00	0.12
165	600795	国电电力	20,100	97,284.00	0.12
166	600886	国投电力	6,500	95,810.00	0.11
167	002946	新乳业	5,100	95,727.00	0.11
168	300699	光威复材	3,000	95,010.00	0.11
169	601808	中海油服	6,900	94,944.00	0.11
170	603816	顾家家居	3,700	94,424.00	0.11
171	601127	赛力斯	700	94,024.00	0.11
172	000988	华工科技	2,000	94,020.00	0.11
173	601083	锦江航运	8,400	93,324.00	0.11
174	601698	中国卫通	4,400	90,068.00	0.11
175	600527	江南高纤	43,500	90,045.00	0.11
176	002299	圣农发展	6,300	90,027.00	0.11
177	600320	振华重工	20,600	90,022.00	0.11
178	300982	苏文电能	5,000	89,950.00	0.11
179	002363	隆基机械	11,800	89,798.00	0.11
180	601002	晋亿实业	18,200	89,726.00	0.11
181	601188	龙江交通	25,500	89,505.00	0.11
182	600262	北方股份	3,900	88,920.00	0.11
183	600118	中国卫星	3,100	88,567.00	0.11
184	002414	高德红外	8,600	88,150.00	0.11
185	002690	美亚光电	5,200	87,724.00	0.10
186	600817	宇通重工	7,400	87,616.00	0.10
187	603566	普莱柯	6,400	87,104.00	0.10
188	600335	国机汽车	13,500	87,075.00	0.10
189	000100	TCL 科技	20,100	87,033.00	0.10

190	600316	洪都航空	2,300	86,710.00	0.10
191	688652	京仪装备	1,500	85,980.00	0.10
192	000408	藏格矿业	2,000	85,340.00	0.10
193	002852	道道全	8,900	85,084.00	0.10
194	000738	航发控制	4,100	85,075.00	0.10
195	000301	东方盛虹	10,200	84,966.00	0.10
196	002304	洋河股份	1,300	83,915.00	0.10
197	603939	益丰药房	3,400	83,198.00	0.10
198	600765	中航重机	4,900	82,712.00	0.10
199	600038	中直股份	2,100	81,501.00	0.10
200	002806	华锋股份	6,100	81,435.00	0.10
201	600435	北方导航	5,200	81,068.00	0.10
202	603933	睿能科技	4,700	80,934.00	0.10
203	002976	瑞玛精密	3,100	80,600.00	0.10
204	601528	瑞丰银行	13,900	80,481.00	0.10
205	301107	瑜欣电子	2,700	80,325.00	0.10
206	601186	中国铁建	10,000	80,100.00	0.10
207	600011	华能国际	11,200	79,968.00	0.10
208	605028	世茂能源	4,100	79,663.00	0.10
209	688020	方邦股份	2,100	79,527.00	0.10
210	300964	本川智能	1,900	79,287.00	0.09
211	601963	重庆银行	7,300	79,278.00	0.09
212	603578	三星新材	5,500	79,200.00	0.09
213	300251	光线传媒	3,900	79,053.00	0.09
214	002267	陕天然气	10,400	78,728.00	0.09
215	002357	富临运业	8,500	78,625.00	0.09
216	300565	科信技术	6,200	78,616.00	0.09
217	300812	易天股份	3,400	78,574.00	0.09
218	600346	恒力石化	5,500	78,430.00	0.09
219	603161	科华控股	6,100	78,324.00	0.09
220	688618	三旺通信	3,200	78,080.00	0.09
221	605258	协和电子	2,500	77,875.00	0.09
222	605298	必得科技	5,300	76,956.00	0.09
223	603048	浙江黎明	3,900	76,674.00	0.09
224	002476	宝莫股份	15,700	76,459.00	0.09
225	300701	森霸传感	7,300	76,358.00	0.09
226	688689	银河微电	3,300	76,131.00	0.09
227	300686	智动力	7,600	75,924.00	0.09
228	301235	华康洁净	3,200	75,648.00	0.09
229	000715	中兴商业	13,200	75,636.00	0.09
230	300889	爱克股份	5,600	75,376.00	0.09
231	688610	埃科光电	1,900	75,354.00	0.09
232	300335	迪森股份	13,800	75,348.00	0.09

233	300074	华平股份	15,400	75,152.00	0.09
234	688682	霍莱沃	2,400	75,120.00	0.09
235	002972	科安达	6,100	74,969.00	0.09
236	300615	欣天科技	5,600	74,872.00	0.09
237	603682	锦和商管	13,200	74,844.00	0.09
238	300483	首华燃气	6,500	74,620.00	0.09
239	002871	伟隆股份	6,700	74,571.00	0.09
240	603726	朗迪集团	4,600	74,474.00	0.09
241	002888	惠威科技	4,100	74,374.00	0.09
242	002796	世嘉科技	6,300	74,340.00	0.09
243	603700	宁水集团	6,200	74,276.00	0.09
244	603163	圣晖集成	2,600	74,126.00	0.09
245	688314	康拓医疗	2,400	74,112.00	0.09
246	603311	金海高科	6,700	74,102.00	0.09
247	001266	宏英智能	2,800	74,060.00	0.09
248	300597	吉大通信	7,600	74,024.00	0.09
249	002863	今飞凯达	14,600	74,022.00	0.09
250	301059	金三江	6,500	73,970.00	0.09
251	688307	中润光学	2,600	73,944.00	0.09
252	688008	澜起科技	900	73,800.00	0.09
253	603079	圣达生物	4,300	73,745.00	0.09
254	600099	林海股份	6,800	73,712.00	0.09
255	688030	山石网科	4,600	73,554.00	0.09
256	002451	摩恩电气	10,600	73,458.00	0.09
257	605186	健麾信息	3,500	73,290.00	0.09
258	301045	天禄科技	3,200	73,280.00	0.09
259	603755	日辰股份	2,800	73,136.00	0.09
260	603617	君禾股份	10,200	73,134.00	0.09
261	603909	建发合诚	7,500	73,050.00	0.09
262	688338	赛科希德	2,900	73,022.00	0.09
263	001218	丽臣实业	4,000	73,000.00	0.09
264	603798	康普顿	6,700	72,896.00	0.09
265	002209	达意隆	5,800	72,790.00	0.09
266	603458	勘设股份	9,200	72,772.00	0.09
267	603968	醋化股份	6,400	72,768.00	0.09
268	002802	洪汇新材	5,200	72,748.00	0.09
269	688288	鸿泉物联	2,500	72,525.00	0.09
270	603320	迪贝电气	4,000	72,520.00	0.09
271	000809	和展能源	23,800	72,352.00	0.09
272	600159	大龙地产	26,300	72,325.00	0.09
273	001219	青岛食品	5,300	72,186.00	0.09
274	600615	丰华股份	6,460	72,093.60	0.09
275	301097	天益医疗	1,800	71,982.00	0.09

276	002025	航天电器	1,400	71,974.00	0.09
276	603836	海程邦达	5,300	71,974.00	0.09
277	603201	常润股份	3,900	71,955.00	0.09
278	600333	长春燃气	14,800	71,928.00	0.09
279	605155	西大门	6,000	71,820.00	0.09
280	000985	大庆华科	3,900	71,799.00	0.09
281	002879	长缆科技	4,700	71,628.00	0.09
282	603810	丰山集团	4,400	71,588.00	0.09
283	600785	新华百货	6,100	71,553.00	0.09
284	300556	丝路视觉	3,600	71,532.00	0.09
285	001331	胜通能源	7,300	71,394.00	0.09
286	688229	博睿数据	1,400	71,330.00	0.09
287	300519	新光药业	4,800	71,232.00	0.09
288	603329	上海雅仕	6,330	71,212.50	0.09
289	000407	胜利股份	20,900	71,060.00	0.08
290	603214	爱婴室	3,700	71,003.00	0.08
291	601916	浙商银行	20,900	70,851.00	0.08
292	001299	美能能源	6,300	70,812.00	0.08
293	000757	浩物股份	15,600	70,668.00	0.08
294	002330	得利斯	15,400	70,532.00	0.08
295	600570	恒生电子	2,100	70,434.00	0.08
296	601877	正泰电器	3,100	70,277.00	0.08
297	002787	华源控股	8,600	70,262.00	0.08
298	605169	洪通燃气	6,600	70,158.00	0.08
299	000007	全新好	9,200	70,012.00	0.08
300	001228	永泰运	2,800	69,692.00	0.08
301	002942	新农股份	4,000	69,520.00	0.08
302	600064	南京高科	9,000	69,390.00	0.08
303	688667	菱电电控	1,300	69,173.00	0.08
304	688597	煜邦电力	8,760	68,590.80	0.08
305	600660	福耀玻璃	1,200	68,412.00	0.08
306	000425	徐工机械	8,800	68,376.00	0.08
307	300316	晶盛机电	2,500	67,875.00	0.08
308	603080	新疆火炬	3,900	67,665.00	0.08
309	000803	山高环能	10,900	67,144.00	0.08
310	002129	TCL 中环	8,700	66,816.00	0.08
311	600303	曙光股份	17,600	66,704.00	0.08
312	002887	绿茵生态	7,900	66,044.00	0.08
313	601989	中国重工	13,800	64,032.00	0.08
314	001979	招商蛇口	7,200	63,144.00	0.08
315	600487	亨通光电	4,100	62,730.00	0.07
316	300339	润和软件	1,200	60,996.00	0.07
317	301118	恒光股份	2,600	60,762.00	0.07

318	600273	嘉化能源	7,100	60,066.00	0.07
319	300724	捷佳伟创	1,100	59,730.00	0.07
320	603859	能科科技	1,800	58,176.00	0.07
321	600958	东方证券	5,900	57,112.00	0.07
322	600685	中船防务	2,100	57,099.00	0.07
323	600219	南山铝业	14,900	57,067.00	0.07
324	601901	方正证券	7,200	56,952.00	0.07
325	000895	双汇发展	2,300	56,143.00	0.07
326	688223	晶科能源	10,700	55,533.00	0.07
327	600132	重庆啤酒	1,000	55,100.00	0.07
328	002966	苏州银行	6,200	54,436.00	0.07
329	601360	三六零	5,300	54,060.00	0.06
330	000157	中联重科	7,400	53,502.00	0.06
331	688297	中无人机	1,000	53,400.00	0.06
332	601717	郑煤机	3,200	53,184.00	0.06
333	000685	中山公用	6,000	52,680.00	0.06
334	000526	学大教育	1,100	52,525.00	0.06
335	002648	卫星化学	3,000	51,990.00	0.06
336	002459	晶澳科技	5,200	51,896.00	0.06
337	000166	申万宏源	10,300	51,706.00	0.06
338	600160	巨化股份	1,800	51,624.00	0.06
339	600764	中国海防	1,500	51,000.00	0.06
340	688599	天合光能	3,500	50,855.00	0.06
341	600989	宝丰能源	3,100	50,034.00	0.06
342	300442	润泽科技	1,000	49,530.00	0.06
343	002281	光迅科技	1,000	49,320.00	0.06
344	600023	浙能电力	9,300	49,290.00	0.06
345	601377	兴业证券	7,800	48,282.00	0.06
346	002195	岩山科技	8,500	47,855.00	0.06
347	002948	青岛银行	9,600	47,808.00	0.06
348	600188	兖矿能源	3,900	47,463.00	0.06
349	600066	宇通客车	1,900	47,234.00	0.06
350	601058	赛轮轮胎	3,600	47,232.00	0.06
351	300533	冰川网络	1,400	46,774.00	0.06
352	600104	上汽集团	2,900	46,545.00	0.06
353	002261	拓维信息	1,500	46,425.00	0.06
354	601800	中国交建	5,200	46,228.00	0.06
355	601995	中金公司	1,300	45,968.00	0.05
356	600426	华鲁恒升	2,100	45,507.00	0.05
357	600582	天地科技	7,500	44,925.00	0.05
358	688777	中控技术	1,000	44,910.00	0.05
359	600901	江苏金租	7,400	44,844.00	0.05
360	300136	信维通信	2,000	44,800.00	0.05

361	000625	长安汽车	3,500	44,660.00	0.05
362	605305	中际联合	1,600	44,448.00	0.05
363	301236	软通动力	800	43,712.00	0.05
364	601100	恒立液压	600	43,200.00	0.05
365	603993	洛阳钼业	5,100	42,942.00	0.05
366	000066	中国长城	2,900	42,920.00	0.05
367	002335	科华数据	1,000	42,680.00	0.05
368	002463	沪电股份	1,000	42,580.00	0.05
369	601997	贵阳银行	6,800	42,432.00	0.05
370	000623	吉林敖东	2,500	42,375.00	0.05
371	600536	中国软件	900	42,093.00	0.05
372	601618	中国中冶	14,100	42,018.00	0.05
373	300751	迈为股份	600	41,736.00	0.05
374	600588	用友网络	3,100	41,447.00	0.05
375	000630	铜陵有色	12,400	41,416.00	0.05
376	601881	中国银河	2,400	41,160.00	0.05
377	600732	爱旭股份	3,100	40,610.00	0.05
378	601128	常熟银行	5,510	40,608.70	0.05
379	300803	指南针	500	40,330.00	0.05
380	603806	福斯特	3,100	40,176.00	0.05
381	600057	厦门象屿	5,700	40,071.00	0.05
382	603167	渤海轮渡	3,500	39,900.00	0.05
383	300957	贝泰妮	900	39,798.00	0.05
384	300017	网宿科技	3,700	39,664.00	0.05
385	688563	航材股份	700	39,641.00	0.05
386	601788	光大证券	2,200	39,556.00	0.05
387	601162	天风证券	8,000	39,440.00	0.05
388	688472	阿特斯	4,200	38,430.00	0.05
389	603986	兆易创新	300	37,959.00	0.05
390	000875	吉电股份	7,400	37,444.00	0.04
391	002601	龙佰集团	2,300	37,283.00	0.04
392	603063	禾望电气	1,100	37,246.00	0.04
393	601898	中煤能源	3,400	37,196.00	0.04
394	301269	华大九天	300	37,164.00	0.04
395	000672	上峰水泥	4,700	37,130.00	0.04
396	600750	江中药业	1,700	37,111.00	0.04
397	601865	福莱特	2,400	36,504.00	0.04
398	688281	华秦科技	600	36,306.00	0.04
399	600039	四川路桥	3,600	35,640.00	0.04
400	000997	新大陆	1,100	35,618.00	0.04
401	002493	荣盛石化	4,300	35,604.00	0.04
402	600018	上港集团	6,200	35,402.00	0.04
403	000928	中钢国际	5,600	35,168.00	0.04

404	002807	江阴银行	7,400	35,150.00	0.04
405	601872	招商轮船	5,600	35,056.00	0.04
406	300896	爱美客	200	34,962.00	0.04
407	002404	嘉欣丝绸	5,400	34,938.00	0.04
408	002839	张家港行	7,700	34,650.00	0.04
409	600894	广日股份	3,300	34,617.00	0.04
410	300763	锦浪科技	600	34,434.00	0.04
411	002709	天赐材料	1,900	34,428.00	0.04
412	300496	中科创达	600	34,332.00	0.04
413	000591	太阳能	7,800	34,242.00	0.04
414	601369	陕鼓动力	3,900	34,203.00	0.04
415	688082	盛美上海	300	34,182.00	0.04
416	002056	横店东磁	2,400	33,960.00	0.04
417	002617	露笑科技	4,500	33,885.00	0.04
418	000034	神州数码	900	33,876.00	0.04
419	601878	浙商证券	3,100	33,821.00	0.04
420	600461	洪城环境	3,500	33,740.00	0.04
421	601066	中信建投	1,400	33,670.00	0.04
422	002410	广联达	2,500	33,525.00	0.04
423	603897	长城科技	1,400	33,460.00	0.04
424	600572	康恩贝	7,600	33,288.00	0.04
425	002797	第一创业	4,700	33,276.00	0.04
426	002065	东华软件	3,400	32,640.00	0.04
427	002506	协鑫集成	12,200	32,574.00	0.04
428	601000	唐山港	8,000	32,480.00	0.04
429	603565	中谷物流	3,400	32,470.00	0.04
430	603967	中创物流	2,900	32,277.00	0.04
431	601838	成都银行	1,600	32,160.00	0.04
432	600398	海澜之家	4,600	32,016.00	0.04
433	600547	山东黄金	1,000	31,930.00	0.04
434	002001	新和成	1,500	31,905.00	0.04
435	002233	塔牌集团	4,300	31,820.00	0.04
436	002582	好想你	3,200	31,744.00	0.04
437	002032	苏泊尔	600	31,434.00	0.04
438	688169	石头科技	200	31,310.00	0.04
439	600845	宝信软件	1,300	30,706.00	0.04
440	601099	太平洋	7,700	30,261.00	0.04
441	300383	光环新网	2,100	30,030.00	0.04
442	601077	渝农商行	4,200	29,988.00	0.04
443	600143	金发科技	2,900	29,899.00	0.04
444	600315	上海家化	1,400	29,498.00	0.04
445	600498	烽火通信	1,400	29,442.00	0.04
446	300054	鼎龙股份	1,000	28,680.00	0.03



447	000563	陕国投 A	8,000	28,560.00	0.03
448	600637	东方明珠	3,800	28,386.00	0.03
449	601689	拓普集团	600	28,350.00	0.03
450	688396	华润微	600	28,296.00	0.03
451	603688	石英股份	800	28,176.00	0.03
452	000429	粤高速 A	2,100	27,993.00	0.03
453	600269	赣粤高速	5,500	27,830.00	0.03
454	003022	联泓新科	1,700	26,911.00	0.03
455	300476	胜宏科技	200	26,876.00	0.03
456	601137	博威合金	1,500	26,685.00	0.03
457	000783	长江证券	3,800	26,334.00	0.03
458	688188	柏楚电子	200	26,332.00	0.03
459	300073	当升科技	600	26,322.00	0.03
460	601098	中南传媒	2,000	26,240.00	0.03
461	688271	联影医疗	200	25,548.00	0.03
462	600020	中原高速	5,300	25,334.00	0.03
463	601216	君正集团	4,500	24,840.00	0.03
464	002516	旷达科技	4,800	24,720.00	0.03
465	601778	晶科科技	8,300	24,651.00	0.03
466	300037	新宙邦	700	24,640.00	0.03
467	300232	洲明科技	3,400	24,616.00	0.03
468	601198	东兴证券	2,200	24,530.00	0.03
469	002673	西部证券	3,100	24,428.00	0.03
470	601311	骆驼股份	2,700	24,381.00	0.03
471	002152	广电运通	1,800	24,192.00	0.03
472	002061	浙江交科	6,100	24,156.00	0.03
473	300118	东方日升	2,500	23,950.00	0.03
474	603260	合盛硅业	500	23,700.00	0.03
475	002595	豪迈科技	400	23,688.00	0.03
476	603368	柳药集团	1,400	23,674.00	0.03
477	601633	长城汽车	1,100	23,628.00	0.03
478	688065	凯赛生物	499	23,502.90	0.03
479	601298	青岛港	2,700	23,463.00	0.03
480	002472	双环传动	700	23,443.00	0.03
481	002241	歌尔股份	1,000	23,320.00	0.03
481	600035	楚天高速	5,500	23,320.00	0.03
482	002947	恒铭达	700	23,233.00	0.03
483	300919	中伟股份	700	23,016.00	0.03
484	600821	金开新能	4,200	22,806.00	0.03
485	002850	科达利	200	22,634.00	0.03
486	600141	兴发集团	1,100	22,583.00	0.03
487	600460	士兰微	900	22,338.00	0.03
488	300024	机器人	1,300	22,334.00	0.03

489	603360	百傲化学	980	22,020.60	0.03
490	002008	大族激光	900	21,933.00	0.03
491	600546	山煤国际	2,500	21,825.00	0.03
492	600905	三峡能源	5,100	21,726.00	0.03
493	688390	固德威	500	21,725.00	0.03
494	601222	林洋能源	3,800	21,660.00	0.03
495	600377	宁沪高速	1,400	21,476.00	0.03
496	300776	帝尔激光	400	21,284.00	0.03
497	600713	南京医药	4,200	21,252.00	0.03
498	002050	三花智控	800	21,104.00	0.03
499	002353	杰瑞股份	600	21,000.00	0.03
500	300303	聚飞光电	3,300	20,922.00	0.03
501	000927	中国铁物	8,100	20,817.00	0.02
502	001203	大中矿业	2,200	20,790.00	0.02
502	002212	天融信	2,700	20,790.00	0.02
503	000750	国海证券	5,000	20,600.00	0.02
504	600169	太原重工	8,500	20,570.00	0.02
505	688213	思特威	200	20,444.00	0.02
506	000617	中油资本	2,800	20,440.00	0.02
507	002444	巨星科技	800	20,408.00	0.02
508	300101	振芯科技	900	20,367.00	0.02
509	002683	广东宏大	600	20,364.00	0.02
510	601696	中银证券	1,900	20,311.00	0.02
511	002221	东华能源	2,100	20,286.00	0.02
512	600027	华电国际	3,700	20,239.00	0.02
513	600584	长电科技	600	20,214.00	0.02
514	601990	南京证券	2,500	20,200.00	0.02
515	002489	浙江永强	5,500	20,130.00	0.02
516	300487	蓝晓科技	400	20,120.00	0.02
517	600029	南方航空	3,400	20,060.00	0.02
518	300408	三环集团	600	20,040.00	0.02
519	003816	中国广核	5,500	20,020.00	0.02
520	600436	片仔癀	100	20,001.00	0.02
521	300015	爱尔眼科	1,600	19,968.00	0.02
522	600918	中泰证券	3,100	19,933.00	0.02
523	300012	华测检测	1,700	19,873.00	0.02
524	002049	紫光国微	300	19,758.00	0.02
525	300151	昌红科技	1,600	19,696.00	0.02
526	600151	航天机电	2,700	19,683.00	0.02
527	600717	天津港	4,300	19,608.00	0.02
528	600369	西南证券	4,500	19,575.00	0.02
529	002865	钧达股份	500	19,500.00	0.02
530	002174	游族网络	1,600	19,408.00	0.02

531	000517	荣安地产	10,700	19,367.00	0.02
532	300319	麦捷科技	1,800	19,332.00	0.02
533	688521	芯原股份	200	19,300.00	0.02
534	600674	川投能源	1,200	19,248.00	0.02
535	002390	信邦制药	5,500	19,140.00	0.02
536	300285	国瓷材料	1,100	19,085.00	0.02
537	600100	同方股份	2,600	18,824.00	0.02
538	601059	信达证券	1,100	18,810.00	0.02
539	301358	湖南裕能	600	18,714.00	0.02
540	688408	中信博	400	18,672.00	0.02
541	600909	华安证券	3,200	18,656.00	0.02
542	002079	苏州固锔	1,900	18,525.00	0.02
543	300393	中来股份	3,200	18,432.00	0.02
544	300827	上能电气	600	18,330.00	0.02
545	300014	亿纬锂能	400	18,324.00	0.02
546	000032	深桑达 A	900	18,207.00	0.02
547	601326	秦港股份	5,600	18,088.00	0.02
548	688375	国博电子	300	18,003.00	0.02
549	688520	神州细胞	300	17,955.00	0.02
550	300779	惠城环保	100	17,849.00	0.02
551	002064	华峰化学	2,700	17,847.00	0.02
552	002439	启明星辰	1,100	17,589.00	0.02
553	301308	江波龙	200	17,498.00	0.02
554	300212	易华录	800	17,408.00	0.02
555	603927	中科软	900	17,406.00	0.02
556	600155	华创云信	2,500	17,400.00	0.02
556	600486	扬农化工	300	17,400.00	0.02
557	000900	现代投资	4,100	17,343.00	0.02
558	600223	福瑞达	2,100	17,262.00	0.02
559	002984	森麒麟	900	16,875.00	0.02
560	000012	南玻 A	3,600	16,632.00	0.02
561	688516	奥特维	500	16,620.00	0.02
562	000598	兴蓉环境	2,300	16,583.00	0.02
563	002006	精工科技	1,000	16,430.00	0.02
564	603185	弘元绿能	1,100	16,335.00	0.02
565	600482	中国动力	700	16,149.00	0.02
566	002926	华西证券	1,800	16,092.00	0.02
567	600131	国网信通	900	15,930.00	0.02
568	000030	富奥股份	2,700	15,903.00	0.02
569	688387	信科移动	2,800	15,820.00	0.02
570	002518	科士达	700	15,813.00	0.02
571	600271	航天信息	1,700	15,708.00	0.02
572	603193	润本股份	500	15,705.00	0.02

573	001965	招商公路	1,300	15,600.00	0.02
574	002003	伟星股份	1,400	15,274.00	0.02
575	002091	江苏国泰	2,100	15,267.00	0.02
576	300390	天华新能	800	15,256.00	0.02
577	688598	金博股份	600	15,252.00	0.02
578	002758	浙农股份	1,700	15,181.00	0.02
579	000975	山金国际	800	15,152.00	0.02
580	002939	长城证券	1,800	15,084.00	0.02
581	300740	水羊股份	900	15,075.00	0.02
581	600183	生益科技	500	15,075.00	0.02
582	603077	和邦生物	8,600	15,050.00	0.02
583	600481	双良节能	3,100	14,942.00	0.02
584	000039	中集集团	1,900	14,934.00	0.02
585	000901	航天科技	1,200	14,916.00	0.02
586	300088	长信科技	2,500	14,900.00	0.02
587	601966	玲珑轮胎	1,000	14,670.00	0.02
588	600323	瀚蓝环境	600	14,610.00	0.02
589	600390	五矿资本	2,500	14,575.00	0.02
590	300661	圣邦股份	200	14,554.00	0.02
591	600586	金晶科技	3,000	14,490.00	0.02
592	603379	三美股份	300	14,436.00	0.02
593	600338	西藏珠峰	1,300	14,417.00	0.02
594	002626	金达威	700	14,322.00	0.02
595	300782	卓胜微	200	14,274.00	0.02
596	003035	南网能源	3,100	14,229.00	0.02
597	002073	软控股份	1,600	14,224.00	0.02
598	603338	浙江鼎力	300	14,220.00	0.02
599	688099	晶晨股份	200	14,202.00	0.02
600	002745	木林森	1,800	14,184.00	0.02
601	002500	山西证券	2,400	14,016.00	0.02
602	603737	三棵树	380	14,003.00	0.02
603	688002	睿创微纳	200	13,944.00	0.02
604	688009	中国通号	2,700	13,878.00	0.02
605	300664	鹏鹞环保	2,500	13,700.00	0.02
606	002430	杭氧股份	700	13,594.00	0.02
607	688561	奇安信	400	13,592.00	0.02
608	600816	建元信托	4,600	13,570.00	0.02
609	601236	红塔证券	1,600	13,552.00	0.02
610	688525	佰维存储	200	13,480.00	0.02
611	000596	古井贡酒	100	13,315.00	0.02
612	300842	帝科股份	300	13,149.00	0.02
613	600368	五洲交通	3,100	13,144.00	0.02
614	688126	沪硅产业	700	13,104.00	0.02

615	600095	湘财股份	1,300	13,039.00	0.02
616	600017	日照港	4,200	13,020.00	0.02
617	601126	四方股份	800	13,016.00	0.02
618	688556	高测股份	1,800	12,924.00	0.02
619	002156	通富微电	500	12,810.00	0.02
620	688187	时代电气	300	12,795.00	0.02
621	600009	上海机场	400	12,708.00	0.02
622	002236	大华股份	800	12,704.00	0.02
623	603983	丸美生物	300	12,639.00	0.02
624	600597	光明乳业	1,500	12,615.00	0.02
625	002922	伊戈尔	800	12,584.00	0.02
626	300821	东岳硅材	1,600	12,576.00	0.02
627	601619	嘉泽新能	3,500	12,530.00	0.01
628	601799	星宇股份	100	12,500.00	0.01
629	600111	北方稀土	500	12,450.00	0.01
630	601456	国联民生	1,200	12,420.00	0.01
631	600690	海尔智家	500	12,390.00	0.01
632	600531	豫光金铅	1,600	12,384.00	0.01
633	300567	精测电子	200	12,122.00	0.01
634	600032	浙江新能	1,600	12,096.00	0.01
635	300207	欣旺达	600	12,036.00	0.01
636	601665	齐鲁银行	1,900	12,008.00	0.01
637	002273	水晶光电	600	11,982.00	0.01
638	601136	首创证券	600	11,928.00	0.01
639	600499	科达制造	1,200	11,760.00	0.01
640	000987	越秀资本	1,700	11,662.00	0.01
641	603486	科沃斯	200	11,646.00	0.01
642	002897	意华股份	300	11,637.00	0.01
643	603990	麦迪科技	700	11,375.00	0.01
644	600406	国电南瑞	500	11,205.00	0.01
645	688778	厦钨新能	200	11,184.00	0.01
646	002185	华天科技	1,100	11,110.00	0.01
647	603799	华友钴业	300	11,106.00	0.01
648	600739	辽宁成大	1,000	11,000.00	0.01
649	600563	法拉电子	100	10,909.00	0.01
650	002916	深南电路	100	10,781.00	0.01
651	688717	艾罗能源	200	10,766.00	0.01
652	600410	华胜天成	1,100	10,549.00	0.01
653	603596	伯特利	200	10,538.00	0.01
654	002670	国盛金控	700	10,535.00	0.01
655	603298	杭叉集团	500	10,475.00	0.01
656	002153	石基信息	1,200	10,392.00	0.01
657	600439	瑞贝卡	2,900	10,353.00	0.01

658	601985	中国核电	1,100	10,252.00	0.01
659	600906	财达证券	1,500	10,230.00	0.01
660	002920	德赛西威	100	10,213.00	0.01
661	688249	晶合集成	500	10,135.00	0.01
662	002958	青农商行	2,800	10,108.00	0.01
663	603507	振江股份	400	10,032.00	0.01
664	688469	芯联集成	2,100	10,017.00	0.01
665	600988	赤峰黄金	400	9,952.00	0.01
666	002480	新筑股份	1,600	9,856.00	0.01
667	688385	复旦微电	200	9,854.00	0.01
668	603650	彤程新材	300	9,645.00	0.01
669	002085	万丰奥威	600	9,534.00	0.01
670	605117	德业股份	180	9,478.80	0.01
671	002544	普天科技	400	9,380.00	0.01
672	000021	深科技	500	9,370.00	0.01
673	002436	兴森科技	700	9,268.00	0.01
674	601568	北元集团	2,200	9,130.00	0.01
675	601399	国机重装	3,000	9,000.00	0.01
676	300604	长川科技	200	8,982.00	0.01
677	603630	拉芳家化	400	8,968.00	0.01
678	600528	中铁工业	1,200	8,856.00	0.01
679	603636	南威软件	700	8,848.00	0.01
680	688680	海优新材	200	8,840.00	0.01
681	600489	中金黄金	600	8,778.00	0.01
682	300348	长亮科技	500	8,695.00	0.01
683	600537	亿晶光电	2,900	8,526.00	0.01
684	002138	顺络电子	300	8,436.00	0.01
685	600875	东方电气	500	8,370.00	0.01
686	603228	景旺电子	200	8,368.00	0.01
687	300080	易成新能	2,000	8,360.00	0.01
688	002063	远光软件	1,400	8,330.00	0.01
689	600735	新华锦	1,000	8,320.00	0.01
690	601608	中信重工	1,900	8,303.00	0.01
691	000862	银星能源	1,500	8,205.00	0.01
692	603290	斯达半导	100	8,127.00	0.01
693	601106	中国一重	2,900	8,120.00	0.01
694	002218	拓日新能	2,500	8,100.00	0.01
695	603296	华勤技术	100	8,068.00	0.01
696	002847	盐津铺子	100	8,040.00	0.01
697	601515	东峰集团	2,100	8,022.00	0.01
698	000807	云铝股份	500	7,990.00	0.01
699	300317	珈伟新能	1,900	7,866.00	0.01
700	603288	海天味业	200	7,782.00	0.01

701	600179	安通控股	2,800	7,728.00	0.01
702	300185	通裕重工	2,700	7,722.00	0.01
703	301371	敷尔佳	300	7,611.00	0.01
704	000719	中原传媒	600	7,446.00	0.01
705	300967	晓鸣股份	400	7,400.00	0.01
706	603105	芯能科技	900	7,398.00	0.01
707	600048	保利发展	900	7,290.00	0.01
708	002249	大洋电机	1,100	7,238.00	0.01
709	605098	行动教育	200	7,156.00	0.01
710	300463	迈克生物	600	7,140.00	0.01
710	600207	安彩高科	1,500	7,140.00	0.01
711	603160	汇顶科技	100	7,103.00	0.01
712	600699	均胜电子	400	6,976.00	0.01
713	600135	乐凯胶片	900	6,948.00	0.01
714	688425	铁建重工	1,700	6,936.00	0.01
715	300223	北京君正	100	6,920.00	0.01
716	603328	依顿电子	700	6,867.00	0.01
717	301029	怡合达	300	6,858.00	0.01
718	300762	上海瀚讯	300	6,789.00	0.01
719	600361	创新新材	1,700	6,783.00	0.01
720	603195	公牛集团	140	6,755.00	0.01
721	601238	广汽集团	900	6,741.00	0.01
722	300548	博创科技	100	6,677.00	0.01
723	301004	嘉益股份	100	6,623.00	0.01
724	300772	运达股份	500	6,440.00	0.01
725	002738	中矿资源	200	6,432.00	0.01
726	002466	天齐锂业	200	6,408.00	0.01
727	301165	锐捷网络	100	6,146.00	0.01
728	601888	中国中免	100	6,097.00	0.01
729	688560	明冠新材	400	6,068.00	0.01
730	002913	奥士康	200	5,882.00	0.01
731	001258	立新能源	800	5,880.00	0.01
732	603826	坤彩科技	300	5,871.00	0.01
733	300051	璩升科技	800	5,768.00	0.01
734	603938	三孚股份	400	5,752.00	0.01
735	688772	珠海冠宇	400	5,716.00	0.01
736	603051	鹿山新材	200	5,696.00	0.01
737	000538	云南白药	100	5,579.00	0.01
738	000156	华数传媒	700	5,558.00	0.01
739	301009	可靠股份	400	5,500.00	0.01
740	002409	雅克科技	100	5,469.00	0.01
741	300492	华图山鼎	80	5,430.40	0.01
742	688538	和辉光电	2,300	5,382.00	0.01



743	301171	易点天下	200	5,346.00	0.01
744	603713	密尔克卫	100	5,332.00	0.01
745	600661	昂立教育	500	5,325.00	0.01
746	003031	中瓷电子	100	5,321.00	0.01
747	603508	思维列控	200	5,296.00	0.01
748	688739	成大生物	200	5,280.00	0.01
749	000887	中鼎股份	300	5,277.00	0.01
750	300373	扬杰科技	100	5,190.00	0.01
751	605090	九丰能源	200	5,162.00	0.01
752	603396	金辰股份	200	5,100.00	0.01
753	002532	天山铝业	600	4,986.00	0.01
754	603628	清源股份	400	4,884.00	0.01
755	600166	福田汽车	1,800	4,878.00	0.01
756	002623	亚玛顿	300	4,845.00	0.01
757	000426	兴业银锡	300	4,740.00	0.01
758	300360	炬华科技	300	4,725.00	0.01
759	002597	金禾实业	200	4,710.00	0.01
760	603179	新泉股份	100	4,697.00	0.01
761	601900	南方传媒	300	4,692.00	0.01
762	600362	江西铜业	200	4,686.00	0.01
763	605358	立昂微	200	4,660.00	0.01
764	300702	天宇股份	200	4,652.00	0.01
765	603979	金诚信	100	4,644.00	0.01
766	603456	九洲药业	300	4,563.00	0.01
767	600285	羚锐制药	200	4,534.00	0.01
768	301090	华润材料	600	4,518.00	0.01
769	002895	川恒股份	200	4,512.00	0.01
770	300836	佰奥智能	100	4,447.00	0.01
771	600927	永安期货	300	4,443.00	0.01
772	002588	史丹利	500	4,405.00	0.01
773	601811	新华文轩	300	4,371.00	0.01
774	601101	昊华能源	600	4,344.00	0.01
775	000050	深天马 A	500	4,260.00	0.01
775	600420	国药现代	400	4,260.00	0.01
776	600987	航民股份	600	4,242.00	0.01
777	600075	新疆天业	1,000	4,230.00	0.01
778	601107	四川成渝	700	4,214.00	0.01
779	002314	南山控股	1,600	4,208.00	0.01
780	601609	金田股份	600	4,206.00	0.01
781	300009	安科生物	500	4,185.00	0.01
782	600549	厦门钨业	200	4,184.00	0.01
783	600874	创业环保	700	4,179.00	0.00
784	600475	华光环能	400	4,168.00	0.00

785	688295	中复神鹰	200	4,160.00	0.00
786	600780	通宝能源	700	4,151.00	0.00
787	000089	深圳机场	600	4,140.00	0.00
787	601096	宏盛华源	1,000	4,140.00	0.00
788	001311	多利科技	200	4,134.00	0.00
789	000636	风华高科	300	4,122.00	0.00
790	000498	山东路桥	700	4,116.00	0.00
790	002081	金螳螂	1,200	4,116.00	0.00
791	600888	新疆众和	600	4,092.00	0.00
792	000544	中原环保	500	4,065.00	0.00
793	603341	龙旗科技	100	4,063.00	0.00
794	002226	江南化工	700	4,060.00	0.00
795	600664	哈药股份	1,100	4,048.00	0.00
796	600682	南京新百	600	4,032.00	0.00
797	300415	伊之密	200	4,030.00	0.00
798	300770	新媒股份	100	3,999.00	0.00
799	000885	城发环境	300	3,996.00	0.00
800	002149	西部材料	200	3,970.00	0.00
801	600125	铁龙物流	700	3,962.00	0.00
802	605507	国邦医药	200	3,954.00	0.00
803	300113	顺网科技	200	3,952.00	0.00
804	600392	盛和资源	300	3,951.00	0.00
805	002351	漫步者	300	3,936.00	0.00
806	600746	江苏索普	500	3,905.00	0.00
807	300955	嘉亨家化	200	3,900.00	0.00
808	600707	彩虹股份	600	3,876.00	0.00
809	600058	五矿发展	500	3,865.00	0.00
810	300182	捷成股份	700	3,857.00	0.00
811	000559	万向钱潮	500	3,825.00	0.00
812	000878	云南铜业	300	3,816.00	0.00
813	000686	东北证券	500	3,815.00	0.00
814	000990	诚志股份	500	3,780.00	0.00
815	600502	安徽建工	800	3,760.00	0.00
816	601677	明泰铝业	300	3,726.00	0.00
817	600757	长江传媒	400	3,712.00	0.00
818	001914	招商积余	300	3,711.00	0.00
819	600497	驰宏锌锗	700	3,703.00	0.00
820	300140	节能环保	600	3,702.00	0.00
821	600267	海正药业	400	3,700.00	0.00
822	600073	光明肉业	500	3,690.00	0.00
823	300470	中密控股	100	3,677.00	0.00
824	000848	承德露露	400	3,652.00	0.00
825	000831	中国稀土	100	3,612.00	0.00

826	600133	东湖高新	400	3,592.00	0.00
827	002399	海普瑞	300	3,573.00	0.00
828	002155	湖南黄金	200	3,570.00	0.00
829	603173	福斯达	100	3,555.00	0.00
830	601965	中国汽研	200	3,550.00	0.00
831	600508	上海能源	300	3,510.00	0.00
832	600673	东阳光	300	3,489.00	0.00
833	603529	爱玛科技	100	3,440.00	0.00
834	002034	旺能环境	200	3,358.00	0.00
835	300199	翰宇药业	200	3,310.00	0.00
836	301039	中集车辆	400	3,252.00	0.00
837	300049	福瑞股份	100	3,243.00	0.00
838	000828	东莞控股	300	3,207.00	0.00
839	002756	永兴材料	100	3,175.00	0.00
840	603699	纽威股份	100	3,117.00	0.00
841	002203	海亮股份	300	3,096.00	0.00
842	000960	锡业股份	200	3,060.00	0.00
843	002434	万里扬	400	2,932.00	0.00
844	000060	中金岭南	600	2,748.00	0.00
845	000800	一汽解放	400	2,744.00	0.00
846	002706	良信股份	300	2,673.00	0.00
847	300748	金力永磁	100	2,384.00	0.00
848	002685	华东重机	300	2,259.00	0.00
849	601958	金钼股份	200	2,188.00	0.00
850	000503	国新健康	200	2,114.00	0.00
851	002202	金风科技	200	2,050.00	0.00
852	600861	北京人力	100	1,930.00	0.00
853	601212	白银有色	600	1,878.00	0.00
854	301069	凯盛新材	100	1,611.00	0.00
855	000758	中色股份	300	1,509.00	0.00
856	600782	新钢股份	400	1,416.00	0.00
857	000650	仁和药业	200	1,084.00	0.00
858	000560	我爱我家	300	891.00	0.00
859	601801	皖新传媒	100	683.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	10,707,078.00	12.15
2	000333	美的集团	9,448,011.00	10.72

3	601318	中国平安	7,516,678.00	8.53
4	601899	紫金矿业	6,984,961.00	7.92
5	600036	招商银行	6,249,921.00	7.09
6	600019	宝钢股份	5,308,140.94	6.02
7	000651	格力电器	5,134,655.00	5.82
8	000063	中兴通讯	4,591,706.00	5.21
9	601166	兴业银行	4,429,479.00	5.02
10	300033	同花顺	4,382,801.00	4.97
11	601088	中国神华	4,146,698.00	4.70
12	300750	宁德时代	4,066,926.00	4.61
13	300308	中际旭创	3,623,016.00	4.11
14	600010	包钢股份	3,603,909.00	4.09
15	300059	东方财富	3,230,481.00	3.66
16	601857	中国石油	3,228,850.00	3.66
17	601888	中国中免	3,135,612.00	3.56
18	000858	五粮液	3,121,966.00	3.54
19	601398	工商银行	3,112,365.00	3.53
20	601728	中国电信	3,102,357.00	3.52
21	603605	珀莱雅	3,083,366.00	3.50
22	600900	长江电力	3,056,883.00	3.47
23	000009	中国宝安	2,954,989.00	3.35
24	600028	中国石化	2,904,017.00	3.29
25	601328	交通银行	2,875,723.00	3.26
26	600030	中信证券	2,782,454.00	3.16
27	002594	比亚迪	2,780,465.00	3.15
28	600941	中国移动	2,633,966.00	2.99
29	002714	牧原股份	2,616,038.00	2.97
30	601225	陕西煤业	2,574,528.00	2.92
31	600690	海尔智家	2,499,181.00	2.84
32	605499	东鹏饮料	2,376,447.00	2.70
33	600398	海澜之家	2,348,866.00	2.66
34	002272	川润股份	2,342,481.00	2.66
35	002050	三花智控	2,337,886.00	2.65
36	600887	伊利股份	2,325,397.00	2.64
37	600309	万华化学	2,264,002.00	2.57
38	300498	温氏股份	2,253,171.00	2.56
39	300502	新易盛	2,224,382.45	2.52
40	600050	中国联通	2,218,819.00	2.52
41	600177	雅戈尔	2,173,559.00	2.47
42	601988	中国银行	2,158,045.00	2.45
43	601211	国泰海通	2,042,073.16	2.32
44	002195	岩山科技	1,987,942.00	2.26
45	600415	小商品城	1,983,773.00	2.25

46	002078	太阳纸业	1,970,121.00	2.23
47	601360	三六零	1,952,899.00	2.22
48	600919	江苏银行	1,944,286.00	2.21
49	600938	中国海油	1,891,229.00	2.15
50	000932	华菱钢铁	1,824,676.00	2.07
51	603338	浙江鼎力	1,785,241.00	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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	11,361,295.48	12.89
2	600519	贵州茅台	10,355,941.00	11.75
3	601318	中国平安	8,148,759.00	9.24
4	601899	紫金矿业	7,518,873.00	8.53
5	600036	招商银行	7,149,410.00	8.11
6	000651	格力电器	6,160,123.00	6.99
7	600019	宝钢股份	6,032,342.00	6.84
8	601088	中国神华	4,811,416.00	5.46
9	000063	中兴通讯	4,792,516.00	5.44
10	601166	兴业银行	4,782,125.00	5.42
11	300750	宁德时代	4,745,053.00	5.38
12	300308	中际旭创	4,178,097.00	4.74
13	300033	同花顺	4,092,317.00	4.64
14	600010	包钢股份	3,977,903.00	4.51
15	601857	中国石油	3,785,160.00	4.29
16	601398	工商银行	3,643,708.00	4.13
17	601728	中国电信	3,525,091.00	4.00
18	600028	中国石化	3,512,815.00	3.98
19	600900	长江电力	3,495,827.50	3.97
20	601328	交通银行	3,265,553.00	3.70
21	000009	中国宝安	3,093,833.00	3.51
22	300059	东方财富	3,062,281.90	3.47
23	601888	中国中免	3,054,437.00	3.46
24	600941	中国移动	3,015,977.00	3.42
25	603605	珀莱雅	2,983,837.00	3.38
26	601225	陕西煤业	2,882,101.00	3.27
27	600887	伊利股份	2,856,231.00	3.24
28	002594	比亚迪	2,849,216.00	3.23
29	002272	川润股份	2,775,958.00	3.15

30	000858	五粮液	2,692,520.00	3.05
31	600690	海尔智家	2,675,008.00	3.03
32	600050	中国联通	2,576,813.00	2.92
33	600030	中信证券	2,566,628.00	2.91
34	002714	牧原股份	2,492,911.00	2.83
35	600398	海澜之家	2,362,679.00	2.68
36	002050	三花智控	2,358,965.00	2.68
37	601988	中国银行	2,312,939.00	2.62
38	600309	万华化学	2,241,609.00	2.54
39	600938	中国海油	2,230,804.00	2.53
40	600919	江苏银行	2,214,458.00	2.51
41	600177	雅戈尔	2,183,193.00	2.48
42	300498	温氏股份	2,138,490.00	2.43
43	605499	东鹏饮料	2,129,176.80	2.42
44	600415	小商品城	2,084,495.00	2.36
45	002027	分众传媒	2,064,948.00	2.34
46	300502	新易盛	1,998,091.60	2.27
47	002078	太阳纸业	1,968,457.00	2.23
48	000932	华菱钢铁	1,940,472.00	2.20
49	002195	岩山科技	1,915,223.00	2.17
50	600048	保利发展	1,846,981.00	2.10
51	600000	浦发银行	1,836,655.00	2.08
52	603338	浙江鼎力	1,785,047.00	2.02
53	002475	立讯精密	1,780,392.00	2.02
54	688981	中芯国际	1,779,110.32	2.02

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	605,872,546.53
卖出股票的收入（成交）总额	614,163,558.06

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	506,352.88	0.61
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	506,352.88	0.61

## 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	019749	24 国债 15	5,000	506,352.88	0.61

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行南阳市分行、国家外汇管理局泉州市分局、国家外汇管理局福建省分局、国家税务总局



咸宁市税务局、国家金融监督管理总局上海监管局、宁夏回族自治区市场监督管理局的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行辽宁省分行、国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局湖北监管局、大同市云冈区住房和城乡建设局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行常德市分行、国家外汇管理局广西壮族自治区分局、国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绍兴市分局、国家外汇管理局贵州省分局、国家金融监督管理总局四川监管局、国家金融监督管理总局山东监管局、深圳市市场监督管理局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。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	70,548.10
2	应收清算款	1,474,913.68
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	15,443.80
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,560,905.58

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时量化价值股票 A	703	24,417.97	4,718,034.89	27.49%	12,447,800.49	72.51%
博时量化价值股票 C	540	87,917.52	41,509,330.79	87.43%	5,966,130.06	12.57%
合计	1,175	55,013.87	46,227,365.68	71.51%	18,413,930.55	28.49%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化价值股票 A	45,121.97	0.26%
	博时量化价值股票 C	80.74	0.00%
	合计	45,202.71	0.07%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金合同生效日(2018年6月26日)基金份额总额	177,981,219.30	163,210,681.29
本报告期期初基金份额总额	32,195,197.75	39,275,966.32
本报告期基金总申购份额	3,067,931.10	29,323,496.72
减：本报告期基金总赎回份额	18,097,293.47	21,124,002.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	17,165,835.38	47,475,460.85
--------------	---------------	---------------

## § 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

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	67,553,553.96	5.54%	31,606.09	5.54%	-
申万宏源	2	630,747,595.38	51.70%	295,159.62	51.70%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	145,020,094.24	11.89%	67,855.50	11.89%	-
中金公司	1	376,714,861.01	30.88%	176,272.26	30.88%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	增加 1 个
国信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-

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) 本公司建立公正公平的证券公司服务评价体系，在符合上述标准的证券公司中进行基金的证券交易佣金分配。主要程序：双方签署服务协议；证券公司提供交易和研究服务；公司每季度分别按照被动股票型基金和其他类型基金的服务评价规则，对证券公司进行服务评价，并按照评分排名确定佣金的分配资格和比例额度。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	501,147.00	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时量化价值股票型证券投资基金（博时量化价值股票 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	2025-06-26
2	博时量化价值股票型证券投资基金（博时量化价值股票 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	2025-06-26
3	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-20250606	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
4	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-20250603	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
5	博时量化价值股票型证券投资基金 2025 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	2025-04-22
6	博时基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
7	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-20250408	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
8	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（2024 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
9	博时量化价值股票型证券投资基金 2024 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	2025-03-31
10	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-20250325	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-25
11	博时量化价值股票型证券投资基金 2024 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	2025-01-22

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025-06-12~2025-06-30	—	27,755,029.76	—	27,755,029.76	42.94%
	2	2025-01-01~2025-06-30	13,754,212.23	—	—	13,754,212.23	21.28%
	3	2025-01-01~2025-02-10	14,858,780.86	—	14,858,780.86	—	—

#### 产品特有风险

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

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

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化价值股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化价值股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化价值股票型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时量化价值股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时量化价值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  
二〇二五年八月二十九日