

博时智选量化多因子股票型证券投资基金

2025 年年度报告
2025 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年三月三十一日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	89
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	89
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	89
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	89
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	89
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	89
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	90
8.12 投资组合报告附注	90
§9 基金份额持有人信息	91
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	91
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	91
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	91
§10 开放式基金份额变动	91
§11 重大事件揭示	92
11.1 基金份额持有人大会决议	92
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	92
11.4 基金投资策略的改变	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	92
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	94
11.8 其他重大事件	94
§12 影响投资者决策的其他重要信息	98
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	98
§13 备查文件目录	98
13.1 备查文件目录	99
13.2 存放地点	99
13.3 查阅方式	99

§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	2,234,713,641.26 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	669,654,358.25 份	1,565,059,283.01 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	林彬
	联系电话	0755-83169999	0571-88269636
	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

1. 博时智选量化多因子股票 A:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 A
本期已实现收益	95,766,778.15	7,136,816.48	-3,441,049.43
本期利润	84,948,006.44	11,901,585.39	-1,756,023.77
加权平均基金份额本期利润	0.3286	0.2364	-0.0279
本期加权平均净值利润率	26.86%	26.91%	-3.02%
本期基金份额净值增长率	43.78%	28.60%	-4.50%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 A
期末可供分配利润	1,760,745.26	-323,585.51	-7,966,871.51
期末可供分配基金份额利润	0.0026	-0.0057	-0.1545
期末基金资产净值	798,438,021.36	61,498,625.72	43,612,089.47
期末基金份额净值	1.1923	1.0873	0.8455
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末

	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 A	博时智选量化多因子股票 A
基金份额累计净值增长率	56.33%	8.73%	-15.45%

2. 博时智选量化多因子股票 C:

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 C
本期已实现收益	372,590,462.44	28,362,444.16	-20,835,153.35
本期利润	383,274,193.23	52,965,645.37	-15,531,157.63
加权平均基金份额本期利润	0.3780	0.2202	-0.0543
本期加权平均净值利润率	31.18%	25.53%	-5.97%
本期基金份额净值增长率	43.06%	27.97%	-4.97%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 C
期末可供分配利润	3,219,891.12	-5,197,244.19	-43,231,613.87
期末可供分配基金份额利润	0.0021	-0.0213	-0.1636
期末基金资产净值	1,860,759,126.57	260,679,151.60	221,060,365.72
期末基金份额净值	1.1889	1.0703	0.8364
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 C	博时智选量化多因子股票 C
基金份额累计净值增长率	53.11%	7.03%	-16.36%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 博时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	-6.81%	1.31%	0.31%	1.02%	-7.12%	0.29%
过去六个月	27.00%	1.33%	17.46%	1.00%	9.54%	0.33%
过去一年	43.78%	1.43%	24.77%	1.25%	19.01%	0.18%
过去三年	76.59%	1.42%	20.43%	1.40%	56.16%	0.02%
自基金合同生效起至今	56.33%	1.41%	3.79%	1.39%	52.54%	0.02%

2. 博时智选量化多因子股票 C:

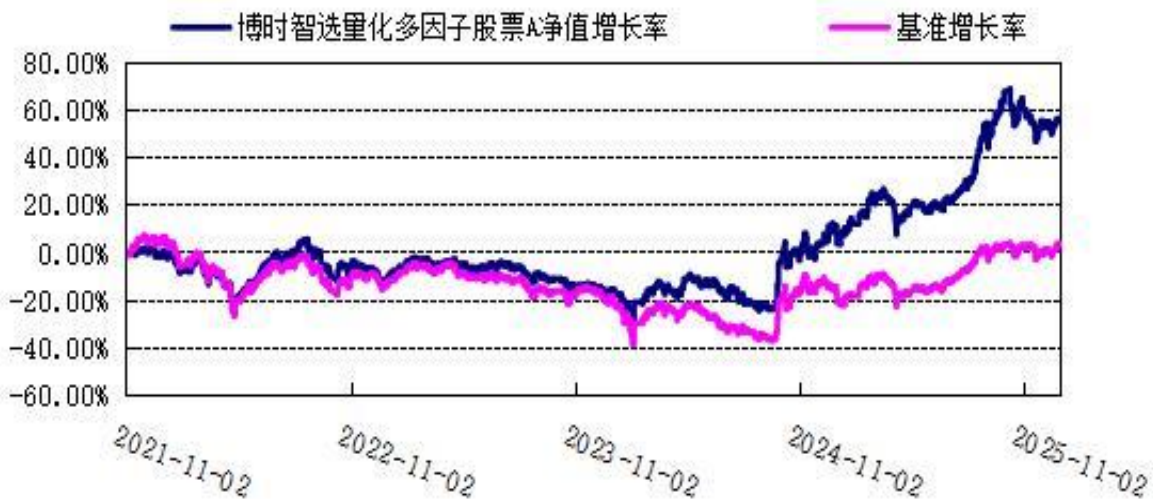
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.94%	1.31%	0.31%	1.02%	-7.25%	0.29%
过去六个月	26.68%	1.33%	17.46%	1.00%	9.22%	0.33%
过去一年	43.06%	1.43%	24.77%	1.25%	18.29%	0.18%
过去三年	73.97%	1.42%	20.43%	1.40%	53.54%	0.02%
自基金合同生效起至今	53.11%	1.41%	3.79%	1.39%	49.32%	0.02%

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

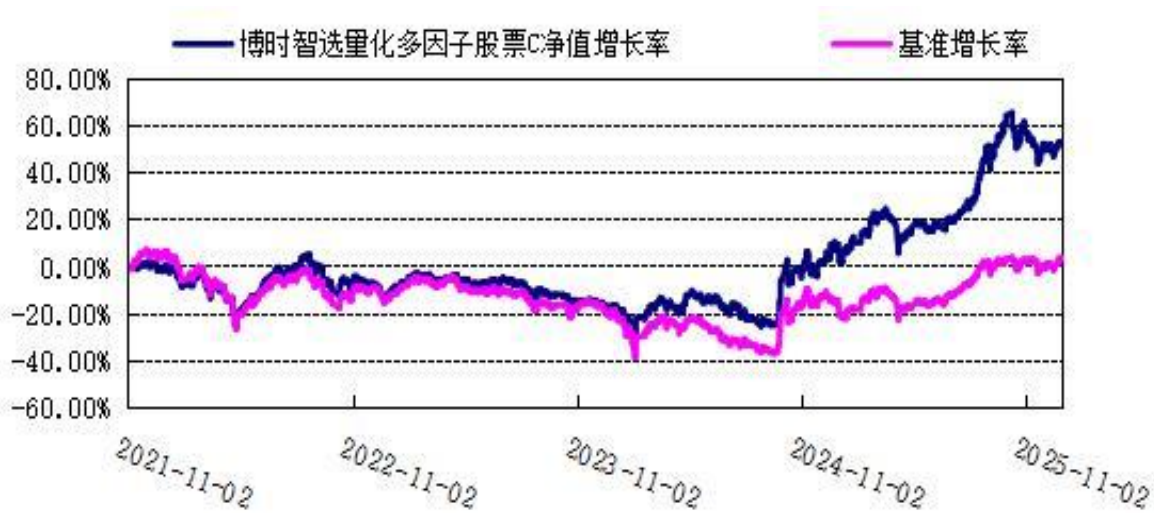
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 11 月 2 日至 2025 年 12 月 31 日)

1、博时智选量化多因子股票 A



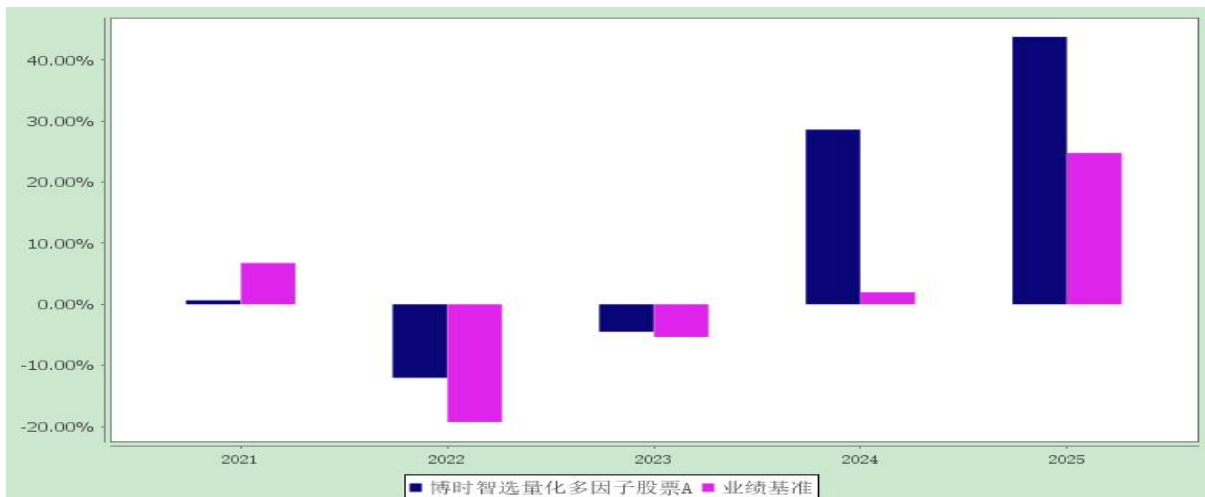
2、博时智选量化多因子股票 C



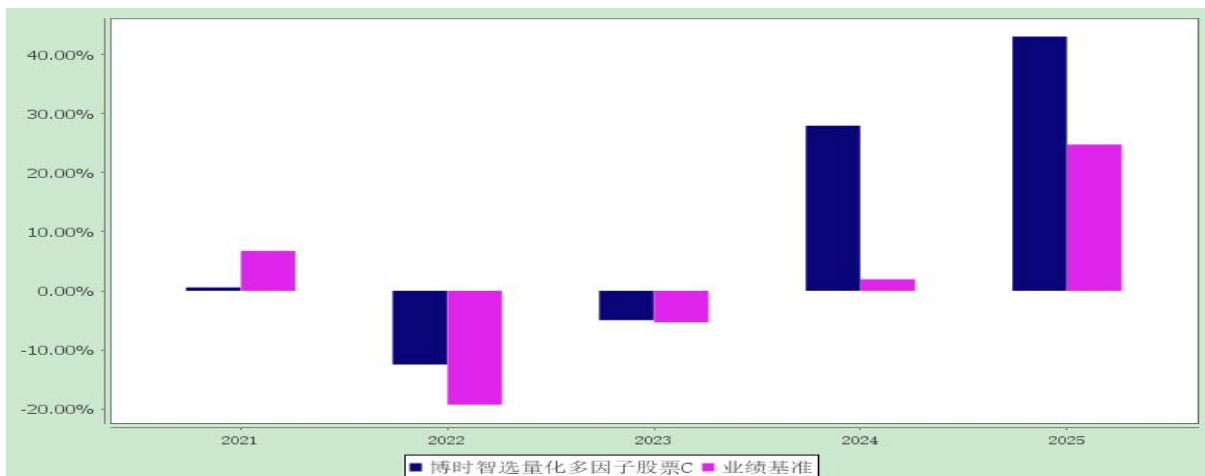
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时智选量化多因子股票 A



2、博时智选量化多因子股票 C



注：本基金的基金合同于 2021 年 11 月 2 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、博时智选量化多因子股票 A:

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	3.3890	75,428,553.08	35,384,280.55	110,812,833.63	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	3.3890	75,428,553.08	35,384,280.55	110,812,833.63	-

2、博时智选量化多因子股票 C:

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	3.1610	205,006,322.01	178,819,551.04	383,825,873.05	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	3.1610	205,006,322.01	178,819,551.04	383,825,873.05	-

§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 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 403 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 16746 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 6938 亿元人民币，累计分红逾 2258 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

9 月，深圳市证券业协会召开深圳资本市场投教讲师工作交流会，举行投教讲师聘任仪式，博时基金 16 位员工获颁“深圳资本市场投资者教育讲师”聘书。

12 月，深圳市证券业协会授予博时基金“突出贡献单位”荣誉证书，授予博时基金投教基地“优秀投资者教育基地”荣誉证书，表彰公司在 2025 年度投资者教育工作中积极有为，表现优异。2025 年度，博时基金共四位员工获得“优秀投教讲师”荣誉证书。

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	-	19.3	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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 37 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，在货币政策精准发力、经济高质量发展稳步推进、外围降息预期逐步兑现等因素的协同作用下，A 股市场延续结构性行情，呈现“成长领跑、分化加剧”的特点，成为产业升级与流动性宽松共振下的结构性收获之年。

首先是货币政策，2025 年央行坚持“总量增长、结构优化”的导向，精准实施流动性调节，全年下调一次存款准备金率、两次 LPR，持续释放长期流动性，助力金融体系加大对实体经济的支持力度。同时，央行货币政策表述延续“适度宽松”基调，进一步强化“宽货币”向“宽信用”的传导效能，明确聚焦实体经济重点领域和薄弱环节，推动社会综合融资成本稳步下行，2025 年 12 月新发放企业贷款和新发放个人住房贷款加权平均利率均降至约 3.1%。伴随着政策发力，银行净息差逐步企稳，10 年期国债利率稳中有降，流动性充裕的格局持续巩固。

其次是财政政策及其他宏观调控，2025 年实施了更积极有为的财政政策，与货币政策协同发力。财政赤字率按 4% 左右安排，新增政府债务 11.86 万亿元，发行超长期等各类特别国债，加大税费减免力度，同时强化民生与促消费投入，推进地方化债、激发民间投资活力，稳定房地产市场，为经

济基本面回升筑牢政策支持，推动财政与产业、区域政策融合，提升调控精准度。

在货币、财政等宏观调控政策协同赋能下，2025 年经济基本面稳步回升。根据国家统计局的数据，2025 年全年 GDP 首次跃上 140 万亿元新台阶，同比增长 5.0%，分季度呈现“前高后稳”态势。物价回升、核心 CPI 温和上行，规模以上工业企业利润转正，出口同时发力。据海关总署及中国汽车工业协会数据，2025 年新能源汽车出口同比增长 100%，表现亮眼。居民收入与经济增长同步，消费潜力持续释放。

外围方面，美联储于 2025 年 9 月、10 月、12 月先后三次降息，全年合计降息 75 个基点，并于 12 月 1 日起结束缩表。随着外围利率实际下行、美元走弱，新兴市场资本外流的压力有所缓解，为国内货币政策调整打开空间。但临近 2025 年底，受美国 12 月非农数据、通胀数据边际变化及美联储内部意见分歧等因素影响，市场对 2026 年美联储降息的时点和幅度预期降温，回归理性。

在上述背景下，A 股市场延续牛市格局，但结构性特征明显，主要宽基指数涨幅并不统一，呈现“小盘领跑、大盘跟涨”的特征，与 2024 年大盘指数涨幅居前的格局形成鲜明对比。全年沪深 300 指数上涨 17.66%，中证 500 指数上涨 30.39%，本基金业绩基准跟踪的中证 1000 指数涨幅达 27.49%，中证 2000 指数表现较优，全年上涨 36.42%，小盘股的成长性优势得到充分释放。

站在因子投资的角度，2025 年 A 股市场同样呈现三个特点，一是极致结构性分化，二是风格趋于固化且成长主导，三是量化博弈呈现“头部集中、策略创新”的新态势。

首先，A 股市场结构性行情进一步升级。行业因子层面，31 个申万一级行业首尾差异接近 100 个百分点，其中有色金属以 92.64% 的涨幅登顶，通信、国防军工、计算机等行业涨幅均超 45%，而食品饮料、煤炭等行业则呈现负增长。个股层面，硬科技、资源类相关个股持续表现突出，有色金属、通信等赛道龙头个股全年涨幅显著，部分标的涨幅翻倍，而消费、地产链等传统赛道个股则持续承压，个股涨跌差异进一步扩大。

其次，2025 年 A 股市场波动率系统性下移，单日股指回调超 1% 的交易日数为历轮牛市中最少，市场整体运行平稳，风格呈现“成长主导、长期固化”的特征，相较于 2024 年风格及风险偏好快速切换的格局，全年风格切换频次明显减少。全年市场核心主线始终围绕硬科技、高端制造、资源类赛道展开，AI 算力、半导体国产替代、人形机器人、商业航天等细分领域持续获得资金抱团，风险偏好整体维持在较高水平，未出现 2024 年那样的集中流动性风险释放或短期暴涨行情，风格择时难度有所降低，但赛道择时与个股选择难度显著提升，对量化策略的行业适配性提出更高要求。

最后，量化投资行业迎来高光时刻，同时行业发展呈现“公募发力、策略革新”的新特点。《证券日报》等权威数据源显示，2025 年公募量化指数增强基金表现亮眼，全年募集资金突破千亿元，超过此前三年总和。随着 AI 技术深度融合成为行业主流，公募量化机构加速策略迭代，在传统量价、

基本面因子挖掘基础上，重点布局另类数据应用与多策略协同，同时强化风险管控适配市场低波动特征。此外，公募量化产品凭借规范运作、门槛适中的优势持续“圈粉”，成为普通投资者分享结构性行情的重要渠道，推动量化投资向大众化、规范化方向稳步发展。

最近几年，我们也一直在思考公募主动量化基金投资方法论的改进，包括但不限于放大行业的暴露、量化结合主观分析放大个股暴露、使用人工智能技术挖掘增量信息、强化投资模型和投资经验的相互印证等。从全年来看，我们主动暴露新质生产力相关行业、暴露得到主观研究印证的个股、基于投资经验切换风格因子、借助 AI 模型提供投资决策依据等操作，均取得了一定的效果。

特别需要指出的是行业暴露的放大。传统的量化投资实践中，有一条很重要的原则，就是行业中性。一般情况下，量化因子都进行了行业中性的处理。但在国民经济结构转型的宏观背景下，行业分化持续加大，并趋向于长期化。基于这一逻辑，我们放松了传统量化投资对行业暴露的限制，有计划的加大新质生产力相关行业的风险暴露，并最终取得了更高的超额收益。

本基金采用量化和主观相结合的方法配置股票资产。我们认为，量化分析工具和主观分析方法并无明显的界限，所有的工具方法都只为找到有投资价值的公司，并为基金持有人带来合理的投资回报。量化投资的本质是科学投资，投资策略没有禁区，所有符合科学思想的工具和逻辑均可为我所用。本基金也会坚持这一大的原则，及时学习包括 AI 在内的方法论的演进，跟踪分析市场的新变化，检讨应对思路，认真调整策略组合。我们相信，随着时间的推移，基于量化模型的科学投资方法论会在本基金投资管理业务上恒进致远。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.1923 元，份额累计净值为 1.5312 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.1889 元，份额累计净值为 1.5050 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 43.78%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 43.06%，同期业绩基准增长率为 24.77%。

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，我们认为 A 股市场仍将延续结构性行情，市场风格虽较 2025 年适度偏向均衡，但成长或仍是核心主线，整体呈现“稳中有进、分化收敛”的格局，投资机会与挑战并存。国内宏观环境持续向好，经济正从温和复苏稳步转向提质增效，“十五五”开局之年的政策红利将逐步释放，货币与财政政策协同发力，重点推动物价合理回升、化解供强需弱矛盾。国际层面，美联储降息节奏回归理性，降息预期较 2025 年底有所缓和，但地区冲突、逆全球化趋势以及全球经济复苏动能分化等因素，仍将为全年宏观走势增添不确定性。无论外部环境如何波动，中国经济结构转型与产业升级的步伐不会停滞，新质生产力培育将成为驱动经济增长的核心力量。2025 年 AI、人形机器人等

领域积累的技术突破与产业基础，将在 2026 年持续释放发展动能，新能源、新材料等新兴增长点也蓄势待发。其中，人工智能技术的深度应用将持续渗透全产业链，不断带动全社会生产效率提升，为国民经济高质量增长提供强劲支撑。在政策环境稳定、经济提质增效预期增强的背景下，2026 年 A 股市场投资机会大于风险，市场流动性有望保持充裕。其中居民储蓄资金稳步入市，机构长期资金的配置力度进一步加大，叠加宏观政策持续注入基础流动性、海外资金对 A 股配置需求提升，多重力量有望共同支撑市场流动性宽松的格局。具体到风格特征，我们认为，2026 年或将继续以成长为主导，虽然相较 2025 年的程度有所下降，但仍是首要布局方向。其中，AI 及相关产业链作为新质生产力的核心载体，需置于重点关注。行业配置可围绕这一核心主线展开：一是深耕以 AI 及产业链为核心的科技高端制造赛道，挖掘细分领域投资机遇；二是关注受益于扩内需政策的消费板块；三是布局传统产业优化升级受益领域，同时需警惕估值陷阱，适度回避虽然低估值但低成长甚至负增长标的。综上所述，我们将以积极的心态看待 2026 年 A 股市场的投资机会。我们同时认为，公募基金作为一种门槛低、老百姓触达较为便利的金融产品，是普惠金融的坚定践行者，是持有人利益的根本捍卫者。而中国金融市场复杂多变，风格切换较为迅速；投资人，特别是散户投资者，在金融知识储备、信息获取时效性以及自身风险偏好认知等方面，客观上存在一定提升空间。在上述情况下，基金经理作为证券市场的一线参与者，占据了市场信息和专业认知的相对优势，有责任和义务帮助持有人及时跟进产业趋势，有效调整投资组合风格暴露，稳健优化个股、行业、风险因子的配置，力争帮助持有人获取长期、稳健、合理的投资回报。2026 年，我们将继续坚持以跑赢基金业同行和业绩基准为投资目标，以量化模型为立足之本，强调模型的投资逻辑及行为金融学含义；以主观修正为破局助力，强调投资经验在策略和风格比例配置中不可或缺的地位；坚持以维护持有人利益为价值导向，及时跟进宏观环境与市场风格的最新变化，做好风险和收益的相对平衡；坚持以中长期主义为决策依据，避免短期过度投机。希望本基金最终能实现为基金持有人赚取长期稳健合理投资回报的目标。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，持续健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时提示有关业务人员并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、

信息技术等开展内部审计项目，作出独立客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《博时基金风险管理与内部控制管理制度》《博时基金合规管理制度》《博时基金问责管理制度》《博时基金关联交易管理制度》《博时基金洗钱风险管理制度》《博时基金销售管理制度》《博时基金私募资产管理业务基本制度》《博时基金信息技术管理制度》《博时基金管理有限公司交易管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，探索完善“合规管理平台”中应用模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并积极做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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验。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金默认收益分配基准日为每个自然月的第一个工作日，当每月默认收益分配基准日的每份基金份额可供分配利润为正时，且在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以按月进行收益分配。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金管理人可根据基金运作的实际情况对上述规则进行调整，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本基金管理人于 2025 年 2 月 22 日发布公告，以 2025 年 2 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 0.2310 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.0660 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 3 月 7 日发布公告，以 2025 年 3 月 3 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 0.4800 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.4690 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 4 月 10 日发布公告，以 2025 年 4 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 0.2410 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.2360 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 8 月 6 日发布公告，以 2025 年 8 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 0.1760 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.1560 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 9 月 6 日发布公告，以 2025 年 9 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 0.5730 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5670 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 10 月 15 日发布公告，以 2025 年 10 月 9 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 0.5890 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5810 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 11 月 7 日发布公告，以 2025 年 11 月 3 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 0.5820 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5760 元人民币；

本基金管理人于 2025 年 12 月 4 日发布公告，以 2025 年 12 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 0.5170 元人民币，本基金 C 类基金份额每 10 份基金份额发放红利 0.5100 元人民币。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对博时基金管理有限公司编制和披露的博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2026）审字第 70019484_A47 号

博时智选量化多因子股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时智选量化多因子股票型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的博时智选量化多因子股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时智选量化多因子股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

博时智选量化多因子股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估博时智选量化多因子股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督博时智选量化多因子股票型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对博时智选量化多因子股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博时智选量化多因子股票型证券投资基金不能持续经营。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

楼坚 朱燕

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2026 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时智选量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	52,010,896.80	11,699,651.82
结算备付金		76,379,653.01	6,528,035.23
存出保证金		-	536,022.00
交易性金融资产	7.4.7.2	2,554,051,626.58	304,443,272.15
其中：股票投资		2,487,689,125.97	297,052,082.20
基金投资		-	-
债券投资		66,362,500.61	7,391,189.95
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,554,210.81	7,932,776.14
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,687,996,387.20	331,139,757.34
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		24,931,963.26	8,464,106.66
应付管理人报酬		2,579,968.83	304,273.66
应付托管费		429,994.80	50,712.27
应付销售服务费		781,166.79	102,323.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,165.75	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	74,979.84	40,563.56
负债合计		28,799,239.27	8,961,980.02
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	2,234,713,641.26	300,125,298.34
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	424,483,506.67	22,052,478.98
净资产合计		2,659,197,147.93	322,177,777.32
负债和净资产总计		2,687,996,387.20	331,139,757.34

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,234,713,641.26 份。其中 A 类基金份额净值 1.1923 元，基金份额总额 669,654,358.25 份；C 类基金份额净值 1.1889 元，基金份额总额 1,565,059,283.01 份。

7.2 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		495,964,809.90	69,583,502.48
1.利息收入		160,822.58	36,671.91
其中：存款利息收入	7.4.7.9	160,822.58	35,872.96
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		-	798.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		493,392,396.03	39,840,271.57
其中：股票投资收益	7.4.7.10	473,681,806.72	36,817,122.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	754,557.52	156,745.15
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-57,945.65	-87,979.67
股利收益	7.4.7.14	19,013,977.44	2,954,383.85
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-135,040.92	29,367,970.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,546,632.21	338,588.88
减：二、营业总支出		27,742,610.23	4,716,271.72
1. 管理人报酬		18,387,950.93	3,017,016.81
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		3,064,658.45	502,836.22
3. 销售服务费		6,099,787.47	1,036,418.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		213.38	0.11
8. 其他费用	7.4.7.18	190,000.00	160,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		468,222,199.67	64,867,230.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		468,222,199.67	64,867,230.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		468,222,199.67	64,867,230.76

7.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	1,934,588,342.92	402,431,027.69	2,337,019,370.61
（一）、综合收益总额	-	468,222,199.67	468,222,199.67
（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）	1,934,588,342.92	428,847,534.70	2,363,435,877.62
其中：1.基金申购款	3,493,178,313.18	782,654,735.59	4,275,833,048.77
2.基金赎回款	-1,558,589,970.26	-353,807,200.89	-1,912,397,171.15
（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）	-	-494,638,706.68	-494,638,706.68
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	2,234,713,641.26	424,483,506.67	2,659,197,147.93
项目	上年度可比期间		
	2024年1月1日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	315,870,940.57	-51,198,485.38	264,672,455.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	315,870,940.57	-51,198,485.38	264,672,455.19

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,745,642.23	73,250,964.36	57,505,322.13
（一）、综合收益总额	-	64,867,230.76	64,867,230.76
（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）	-15,745,642.23	8,383,733.60	-7,361,908.63
其中：1.基金申购款	218,677,269.36	-7,880,114.24	210,797,155.12
2.基金赎回款	-234,422,911.59	16,263,847.84	-218,159,063.75
（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	300,125,298.34	22,052,478.98	322,177,777.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时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%。

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 2026 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除

适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于流通受限股票、出现

重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况的上市股票、在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种、基金投资，本基金根据具体情况分别按照《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》、《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》、《关于固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》提供的估值方法进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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；

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	52,010,896.80	11,699,651.82
等于：本金	52,010,188.44	11,699,426.87
加：应计利息	708.36	224.95
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	52,010,896.80	11,699,651.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,462,811,243.51	-	2,487,689,125.97	24,877,882.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	65,988,628.00	344,380.61	66,362,500.61	29,492.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	65,988,628.00	344,380.61	66,362,500.61	29,492.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,528,799,871.51	344,380.61	2,554,051,626.58	24,907,374.46
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		272,033,127.82	-	297,052,082.20	25,018,954.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,311,579.00	74,749.95	7,391,189.95	4,861.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,311,579.00	74,749.95	7,391,189.95	4,861.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		279,344,706.82	74,749.95	304,443,272.15	25,023,815.38

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		合同/名义 金额	公允价值		备注
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-
权益衍生工具		-	-	-	-
其他衍生工具		-	-	-	-
合计		-	-	-	-
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		合同/名义	公允价值		备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,554,880.00	-	-	-
---股指期货	3,554,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,554,880.00	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,979.84	563.56
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	-	-
预提费用	70,000.00	40,000.00
合计	74,979.84	40,563.56

7.4.7.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	56,559,750.21	56,559,750.21
本期申购	836,517,012.89	836,517,012.89
本期赎回（以“-”号填列）	-223,422,404.85	-223,422,404.85

本期末	669,654,358.25	669,654,358.25
-----	----------------	----------------

博时智选量化多因子股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	243,565,548.13	243,565,548.13
本期申购	2,656,661,300.29	2,656,661,300.29
本期赎回（以“-”号填列）	-1,335,167,565.41	-1,335,167,565.41
本期末	1,565,059,283.01	1,565,059,283.01

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

7.4.7.8 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	-323,585.51	5,262,461.02	4,938,875.51
本期期初	-323,585.51	5,262,461.02	4,938,875.51
本期利润	95,766,778.15	-10,818,771.71	84,948,006.44
本期基金份额交易产生的变动数	17,130,386.25	132,579,228.54	149,709,614.79
其中：基金申购款	25,051,626.15	178,716,501.15	203,768,127.30
基金赎回款	-7,921,239.90	-46,137,272.61	-54,058,512.51
本期已分配利润	-110,812,833.63	-	-110,812,833.63
本期末	1,760,745.26	127,022,917.85	128,783,663.11

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	-5,197,244.19	22,310,847.66	17,113,603.47
本期期初	-5,197,244.19	22,310,847.66	17,113,603.47
本期利润	372,590,462.44	10,683,730.79	383,274,193.23
本期基金份额交易产生的变动数	19,652,545.92	259,485,373.99	279,137,919.91
其中：基金申购款	59,109,415.49	519,777,192.80	578,886,608.29
基金赎回款	-39,456,869.57	-260,291,818.81	-299,748,688.38
本期已分配利润	-383,825,873.05	-	-383,825,873.05
本期末	3,219,891.12	292,479,952.44	295,699,843.56

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	20,549.50	11,240.53
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	87,084.87	24,632.43
其他	53,188.21	-
合计	160,822.58	35,872.96

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	8,902,173,081.36	1,630,085,944.97
减：卖出股票成本总额	8,414,093,509.36	1,590,399,504.94
减：交易费用	14,397,765.28	2,869,317.79
买卖股票差价收入	473,681,806.72	36,817,122.24

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	321,045.22	101,700.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	433,512.30	55,044.53
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	754,557.52	156,745.15

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	23,854,459.48	10,201,272.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,098,158.00	9,961,683.00
减：应计利息总额	322,636.73	184,512.37

减：交易费用	152.45	33.02
买卖债券差价收入	433,512.30	55,044.53

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 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。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股指期货投资收益	-57,945.65	-87,979.67

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	19,013,977.44	2,954,383.85
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	19,013,977.44	2,954,383.85

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-116,440.92	29,349,370.12
——股票投资	-141,071.92	29,352,836.12
——债券投资	24,631.00	-3,466.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2.衍生工具	-18,600.00	18,600.00
——权证投资	-	-
——股指期货	-18,600.00	18,600.00
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	-135,040.92	29,367,970.12

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	2,233,539.47	318,824.97
基金转换费收入	313,092.74	19,763.91
合计	2,546,632.21	338,588.88

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	70,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
合计	190,000.00	160,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2026 年 01 月 10 日宣告 2026 年度第 1 次分红，向截至 2026 年 01 月 13 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 0.0330 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.0260 元。于 2026 年 02 月 06 日宣告 2026 年度第 2 次分红，向截至 2026 年 02 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 0.3230 元，C 类份额按每 10 份基金份额

额发放红利 0.3170 元。于 2026 年 03 月 05 日宣告 2026 年度第 3 次分红，向截至 2026 年 03 月 09 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 0.2140 元，C 类份额按每 10 份基金份额发放红利 0.2100 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
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
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
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
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，基金管理人原股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的 2%股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。上述股东变更事项已于 2024 年 12 月 24 日完成工商变更登记。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,387,950.93	3,017,016.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,556,245.86	630,855.77
应支付基金管理人的净管理费	14,831,705.07	2,386,161.04

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,064,658.45	502,836.22

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	-	94,102.04	94,102.04
招商证券	-	8,812.96	8,812.96
博时基金	-	2,759,356.74	2,759,356.74
博时财富	-	268.57	268.57
合计	-	2,862,540.31	2,862,540.31
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 12 月 31 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	-	45,514.20	45,514.20
招商证券	-	3.64	3.64
博时基金	-	18,865.71	18,865.71
合计	-	64,383.55	64,383.55

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明
7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况
7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行-活期存款	52,010,896.80	20,549.50	11,699,651.82	11,240.53

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年1月1日至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下发行	937.00	15,385.54
招商证券股份有限公司	301632	广东建科	网下发行	6,557.00	43,013.92
招商证券股份有限公司	001386	马可波罗	网下发行	5,419.00	74,511.25
招商证券股份有限公司	301638	南网数字	网下发行	23,213.00	132,081.97
招商证券股份有限公司	301449	天溯计量	网下发行	1,118.00	41,142.40
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券股份有限公司	688692	达梦数据	网下发行	802.00	69,741.92
招商证券股份有限公司	301631	壹连科技	网下发行	1,050.00	76,639.50

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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		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
		场内	场外					
1	2025-02-25	-	2025-02-25	0.2310	1,850,260.68	389,609.77	2,239,870.45	-
2	2025-03-11	-	2025-03-11	0.4800	3,939,745.36	1,194,979.50	5,134,724.86	-
3	2025-04-14	-	2025-04-14	0.2410	2,908,901.20	930,190.16	3,839,091.36	-
4	2025-08-08	-	2025-08-08	0.1760	2,913,189.51	1,170,569.10	4,083,758.61	-
5	2025-09-09	-	2025-09-09	0.5730	11,992,349.96	4,645,148.84	16,637,498.80	-
6	2025-10-17	-	2025-10-17	0.5890	15,988,649.38	7,999,083.72	23,987,733.10	-
7	2025-11-11	-	2025-11-11	0.5820	18,147,972.36	8,590,734.12	26,738,706.48	-
8	2025-12-08	-	2025-12-08	0.5170	17,687,484.63	10,463,965.34	28,151,449.97	-
合计				3.3890	75,428,553.08	35,384,280.55	110,812,833.63	-

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		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
		场内	场外					
1	2025-02-25	-	2025-02-25	0.0660	1,956,758.74	917,348.11	2,874,106.85	-
2	2025-03-11	-	2025-03-11	0.4690	16,559,824.41	8,249,751.93	24,809,576.34	-
3	2025-04-14	-	2025-04-14	0.2360	9,414,349.34	8,299,366.94	17,713,716.28	-
4	2025-08-08	-	2025-08-08	0.1560	7,629,750.96	8,258,106.11	15,887,857.07	-
5	2025-09-09	-	2025-09-09	0.5670	35,069,375.72	36,373,767.88	71,443,143.60	-
6	2025-10-17	-	2025-10-17	0.5810	48,372,584.34	39,362,365.57	87,734,949.91	-
7	2025-11-11	-	2025-11-11	0.5760	46,138,840.97	39,064,610.52	85,203,451.49	-
8	2025-12-08	-	2025-12-08	0.5100	39,864,837.53	38,294,233.98	78,159,071.51	-
合				3.1610	205,006,322.01	178,819,551.04	383,825,873.05	-

计									
---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券
7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	首次公开发行限售	104.66	399.40	3,994.00	418,012.04	1,595,203.60	-
600930	华电新能	2025-07-09	6 个月	首次公开发行限售	3.18	6.24	209,972.00	667,710.96	1,310,225.28	-
301656	联合动力	2025-09-17	6 个月	首次公开发行限售	12.48	25.46	7,395.00	92,289.60	188,276.70	-
001280	中国铀业	2025-11-25	6 个月	首次公开发行限售	17.89	45.36	2,277.00	40,735.53	103,284.72	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6 个月	首次公开发行限售	8.45	24.28	3,505.00	29,617.25	85,101.40	-
688809	强一股份	2025-12-23	6 个月	首次公开发行限售	85.09	203.31	259.00	22,038.31	52,657.29	-
301638	南网数字	2025-11-11	6 个月	首次公开发行限售	5.69	14.21	2,322.00	13,212.18	32,995.62	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6 个月	首次公开发行限售	13.75	18.53	1,626.00	22,357.50	30,129.78	-
688727	恒坤	2025-11-11	6 个月	首次公开	14.99	34.87	563.00	8,439.37	19,631.81	-

	新材			发行 限售							
001233	海安集团	2025-11-18	6个月	首次 公开发 行 限售	48.00	51.88	370.00	17,760.00	19,195.60	-	
688796	百奥赛图	2025-12-02	6个月	首次 公开发 行 限售	26.68	42.25	423.00	11,285.64	17,871.75	-	
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	首次 公开发 行 限售	51.66	135.56	131.00	6,767.46	17,758.36	-	
301632	广东建科	2025-08-05	6个月	首次 公开发 行 限售	6.56	23.68	656.00	4,303.36	15,534.08	-	
301563	云汉芯城	2025-09-23	6个月	首次 公开发 行 限售	27.00	133.69	110.00	2,970.00	14,705.90	-	
301491	汉桑科技	2025-07-29	6个月	首次 公开发 行 限售	28.91	55.11	245.00	7,082.95	13,501.95	-	
301584	建发致新	2025-09-18	6个月	首次 公开发 行 限售	7.05	26.82	447.00	3,151.35	11,988.54	-	
001369	双欣环保	2025-12-23	6个月	首次 公开发 行 限售	6.85	12.89	897.00	6,144.45	11,562.33	-	
301609	山大电力	2025-07-16	6个月	首次 公开发 行 限售	14.66	40.99	277.00	4,060.82	11,354.23	-	
301687	新广益	2025-12-24	6个月	首次 公开发 行 限售	21.93	54.39	195.00	4,276.35	10,606.05	-	
001221	悍高	2025-07-23	6个月	首次公 开	15.43	56.94	160.00	2,468.80	9,110.40	-	

	集团			发行限售						
301667	纳百川	2025-12-10	6个月	首次公开发售	22.63	57.07	151.00	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	首次公开发售	18.58	32.37	265.00	4,923.70	8,578.05	-
603418	友升股份	2025-09-16	6个月	首次公开发售	46.36	59.06	139.00	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月	首次公开发售	17.08	48.56	169.00	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025-10-30	6个月	首次公开发售	46.68	55.66	146.00	6,815.28	8,126.36	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月	首次公开发售	42.28	56.08	137.00	5,792.36	7,682.96	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月	首次公开发售	21.00	44.80	165.00	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月	首次公开发售	36.80	65.23	112.00	4,121.60	7,305.76	-
601026	道生天合	2025-10-09	6个月	首次公开发售	5.98	14.28	451.00	2,696.98	6,440.28	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6个月	首次公开发售	27.69	49.55	126.00	3,488.94	6,243.30	-
603406	天富	2025-07-30	6个月	首次公开	23.60	40.16	153.00	3,610.80	6,144.48	-

	龙			发行限售						
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月	首次公开发行限售	10.10	16.30	260.00	2,626.00	4,238.00	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	首次公开发行限售	16.42	42.94	94.00	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025-08-27	6个月	首次公开发行限售	18.60	46.35	82.00	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	首次公开发行限售	12.55	26.21	111.00	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月	首次公开发行限售	24.49	32.82	88.00	2,155.12	2,888.16	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6个月	首次公开发行限售	22.29	35.39	69.00	1,538.01	2,441.91	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
603508	思维列	2025-12-29	重大事	27.82	2026-01-07	27.83	1,100.00	36,502.71	30,602.00	-

	控		项停牌							
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项停牌	78.81	2026-01-15	86.69	121,725.00	9,848,925.11	9,593,147.25	-

注：本基金截至 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	66,362,500.61	6,478,175.46
合计	66,362,500.61	6,478,175.46

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	913,014.49
合计	-	913,014.49

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2024 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	11,699,651.82	-	-	-	11,699,651.82
结算备付金	6,528,035.23	-	-	-	6,528,035.23
存出保证金	-	-	-	536,022.00	536,022.00
交易性金融资产	7,391,189.95	-	-	297,052,082.20	304,443,272.15
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,932,776.14	7,932,776.14
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,618,877.00	-	-	305,520,880.34	331,139,757.34
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,464,106.66	8,464,106.66
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	304,273.66	304,273.66
应付托管费	-	-	-	50,712.27	50,712.27
应付销售服务费	-	-	-	102,323.87	102,323.87
应交税费	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	40,563.56	40,563.56
负债总计	-	-	8,961,980.02	8,961,980.02
利率敏感度缺口	25,618,877.00	-	296,558,900.32	322,177,777.32

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 10	减少约 1
市场利率下降 25 个基点	增加约 10	增加约 1	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	2,487,689,125.97	93.55	297,052,082.20	92.20
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	2,487,689,125.97	93.55	297,052,082.20	92.20

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 15,896	增加约 1,326
业绩比较基准下降 5%	减少约 15,896	减少约 1,326	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	2,474,391,420.15	296,539,698.20
第二层次	75,986,249.86	7,418,926.45
第三层次	3,673,956.57	484,647.50
合计	2,554,051,626.58	304,443,272.15

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的

影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	484,647.50	484,647.50
当期购买	-	1,662,817.11	1,662,817.11
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,203,207.74	1,203,207.74
当期利得或损失总额	-	2,729,699.70	2,729,699.70
其中：计入损益的利得或损失	-	2,729,699.70	2,729,699.70
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	3,673,956.57	3,673,956.57
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,230,829.44	2,230,829.44
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	769,321.22	769,321.22
当期购买	-	344,144.96	344,144.96
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	928,975.98	928,975.98
当期利得或损失总额	-	300,157.30	300,157.30
其中：计入损益的利得或损失	-	300,157.30	300,157.30
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	484,647.50	484,647.50
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	290,916.64	290,916.64

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	3,673,956.57	平均价格亚式期权模型	预期波动率	16.28%-307.91%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	484,647.50	平均价格亚式期权模型	预期波动率	26.65%-574.44%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,487,689,125.97	92.55
	其中：股票	2,487,689,125.97	92.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,362,500.61	2.47
	其中：债券	66,362,500.61	2.47
	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	128,390,549.81	4.78
8	其他各项资产	5,554,210.81	0.21
9	合计	2,687,996,387.20	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,065,612.00	0.04
B	采矿业	23,908,401.72	0.90
C	制造业	1,603,923,698.54	60.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,803,924.28	0.59
E	建筑业	10,881,181.60	0.41
F	批发和零售业	13,151,751.89	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	2,523,692.86	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	645,965,309.73	24.29
J	金融业	29,374,389.20	1.10
K	房地产业	6,194,552.00	0.23
L	租赁和商务服务业	115,777,484.25	4.35
M	科学研究和技术服务业	13,567,591.50	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	747,261.40	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	288,144.00	0.01
Q	卫生和社会工作	429,052.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	3,791,704.00	0.14
S	综合	295,375.00	0.01
	合计	2,487,689,125.97	93.55

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688018	乐鑫科技	1,228,793	208,894,810.00	7.86
2	688249	晶合集成	5,801,218	192,542,425.42	7.24
3	688220	翱捷科技	2,284,190	188,696,935.90	7.10
4	688279	峰昭科技	786,152	159,974,070.48	6.02
5	002558	巨人网络	2,504,300	108,411,147.00	4.08
6	301606	绿联科技	1,800,953	105,787,979.22	3.98

7	002027	分众传媒	13,982,325	103,049,735.25	3.88
8	002847	盐津铺子	1,202,418	82,137,173.58	3.09
9	301656	联合动力	2,777,321	73,425,120.14	2.76
10	002517	恺英网络	2,291,500	50,115,105.00	1.88
11	688008	澜起科技	386,621	45,543,953.80	1.71
12	300750	宁德时代	100,080	36,755,380.80	1.38
13	688766	普冉股份	286,334	36,424,548.14	1.37
14	688403	汇成股份	1,276,941	20,916,293.58	0.79
15	002436	兴森科技	638,400	13,514,928.00	0.51
16	688002	睿创微纳	133,700	13,476,960.00	0.51
17	603444	吉比特	31,100	13,181,735.00	0.50
18	002008	大族激光	316,128	13,021,312.32	0.49
19	000887	中鼎股份	557,800	12,946,538.00	0.49
20	301308	江波龙	52,800	12,927,552.00	0.49
21	600938	中国海油	427,900	12,914,022.00	0.49
22	688183	生益电子	132,300	12,659,787.00	0.48
23	301200	大族数控	105,700	12,553,989.00	0.47
24	300442	润泽科技	228,700	12,075,360.00	0.45
25	300058	蓝色光标	1,044,000	12,026,880.00	0.45
26	601865	福莱特	745,600	11,683,552.00	0.44
27	600183	生益科技	162,100	11,575,561.00	0.44
28	300073	当升科技	199,400	11,525,320.00	0.43
29	688017	绿的谐波	59,300	11,391,530.00	0.43
30	601717	中创智领	461,200	11,322,460.00	0.43
31	688213	思特威	117,800	11,201,602.00	0.42
32	603049	中策橡胶	197,858	11,070,155.10	0.42
33	300017	网宿科技	1,058,269	10,847,257.25	0.41
34	301607	富特科技	266,800	10,701,348.00	0.40
35	301031	中熔电气	95,164	10,676,449.16	0.40
36	002074	国轩高科	272,700	10,665,297.00	0.40
37	605305	中际联合	255,100	10,627,466.00	0.40
38	300567	精测电子	115,400	10,524,480.00	0.40
39	603185	弘元绿能	342,000	10,431,000.00	0.39
40	301529	福赛科技	92,100	10,416,510.00	0.39
41	300926	博俊科技	313,600	10,279,808.00	0.39
42	600469	风神股份	1,479,700	10,269,118.00	0.39
43	300850	新强联	248,070	10,262,655.90	0.39
44	002048	宁波华翔	324,100	10,196,186.00	0.38
45	300681	英搏尔	406,700	10,191,902.00	0.38
46	002765	蓝黛科技	761,100	10,175,907.00	0.38
47	002156	通富微电	269,800	10,171,460.00	0.38
48	002236	大华股份	535,500	10,142,370.00	0.38
49	688088	虹软科技	204,500	10,122,750.00	0.38

50	300953	震裕科技	60,162	10,108,419.24	0.38
51	300596	利安隆	238,800	10,079,748.00	0.38
52	688095	福昕软件	112,900	10,078,583.00	0.38
53	300415	伊之密	385,800	10,053,948.00	0.38
54	002354	天娱数科	1,568,600	9,991,982.00	0.38
55	000792	盐湖股份	353,848	9,964,359.68	0.37
56	300113	顺网科技	492,100	9,960,104.00	0.37
57	300454	深信服	86,480	9,959,036.80	0.37
58	002028	思源电气	64,400	9,955,596.00	0.37
59	600933	爱柯迪	494,100	9,931,410.00	0.37
60	300438	鹏辉能源	186,600	9,930,852.00	0.37
61	002916	深南电路	42,700	9,918,783.00	0.37
62	603296	华勤技术	109,082	9,898,100.68	0.37
63	300790	宇瞳光学	330,700	9,891,237.00	0.37
64	603699	纽威股份	190,300	9,889,891.00	0.37
65	605060	联德股份	266,700	9,857,232.00	0.37
66	300833	浩洋股份	241,400	9,820,152.00	0.37
67	000800	一汽解放	1,448,180	9,818,660.40	0.37
68	600315	上海家化	435,815	9,814,553.80	0.37
69	600150	中国船舶	295,059	9,813,662.34	0.37
70	002734	利民股份	615,039	9,803,721.66	0.37
71	002997	瑞鹄模具	261,900	9,795,060.00	0.37
72	002545	东方铁塔	530,100	9,780,345.00	0.37
73	002768	国恩股份	185,500	9,772,140.00	0.37
74	600875	东方电气	402,300	9,767,844.00	0.37
75	688082	盛美上海	55,400	9,753,170.00	0.37
76	688357	建龙微纳	294,900	9,746,445.00	0.37
77	688322	奥比中光	108,300	9,711,261.00	0.37
78	688536	思瑞浦	60,600	9,688,728.00	0.36
79	688308	欧科亿	306,200	9,688,168.00	0.36
80	601318	中国平安	141,533	9,680,857.20	0.36
81	002922	伊戈尔	315,600	9,663,672.00	0.36
82	002600	领益智造	620,200	9,637,908.00	0.36
83	002690	美亚光电	468,400	9,634,988.00	0.36
84	002284	亚太股份	645,000	9,629,850.00	0.36
85	002049	紫光国微	121,725	9,593,147.25	0.36
86	603163	圣晖集成	139,836	9,592,749.60	0.36
87	688372	伟测科技	87,900	9,589,011.00	0.36
88	002276	万马股份	566,900	9,586,279.00	0.36
89	688027	国盾量子	19,000	9,572,010.00	0.36
90	002402	和而泰	244,200	9,553,104.00	0.36
91	300274	阳光电源	55,700	9,526,928.00	0.36
92	300124	汇川技术	68,600	5,167,638.00	0.19

93	688123	聚辰股份	40,200	5,048,316.00	0.19
94	000333	美的集团	60,200	4,704,630.00	0.18
95	600549	厦门钨业	109,200	4,483,752.00	0.17
96	000783	长江证券	542,800	4,423,820.00	0.17
97	002414	高德红外	297,900	4,370,193.00	0.16
98	600988	赤峰黄金	126,500	3,951,860.00	0.15
99	600909	华安证券	550,200	3,730,356.00	0.14
100	600848	上海临港	298,100	3,487,770.00	0.13
101	601108	财通证券	392,200	3,419,984.00	0.13
102	603379	三美股份	55,800	3,388,176.00	0.13
103	600378	昊华科技	105,268	3,364,365.28	0.13
104	600517	国网英大	549,700	3,303,697.00	0.12
105	603233	大参林	180,100	3,173,362.00	0.12
106	600098	广州发展	480,900	3,145,086.00	0.12
107	300857	协创数据	18,420	3,107,085.60	0.12
108	603486	科沃斯	36,900	2,977,092.00	0.11
109	688295	中复神鹰	88,000	2,887,280.00	0.11
110	600801	华新建材	116,800	2,866,272.00	0.11
111	600309	万华化学	34,900	2,676,132.00	0.10
112	002281	光迅科技	35,500	2,483,225.00	0.09
113	688521	芯原股份	17,294	2,368,759.18	0.09
114	600873	梅花生物	233,800	2,368,394.00	0.09
115	000589	贵州轮胎	456,801	2,366,229.18	0.09
116	002841	视源股份	59,600	2,361,948.00	0.09
117	000733	振华科技	44,900	2,353,209.00	0.09
118	300373	扬杰科技	34,600	2,352,800.00	0.09
119	603659	璞泰来	81,600	2,230,944.00	0.08
120	600704	物产中大	398,285	2,218,447.45	0.08
121	600361	创新新材	519,800	2,203,952.00	0.08
122	002293	罗莱生活	206,700	2,122,809.00	0.08
123	600166	福田汽车	723,700	2,113,204.00	0.08
124	600867	通化东宝	255,800	2,089,886.00	0.08
125	300573	兴齐眼药	29,580	2,079,178.20	0.08
126	300146	汤臣倍健	172,100	2,066,921.00	0.08
127	002410	广联达	162,560	2,045,004.80	0.08
128	001218	丽臣实业	88,300	2,011,474.00	0.08
129	600096	云天化	58,300	1,947,803.00	0.07
130	000598	兴蓉环境	270,200	1,937,334.00	0.07
131	600126	杭钢股份	233,700	1,906,992.00	0.07
132	600739	辽宁成大	169,300	1,892,774.00	0.07
133	601019	山东出版	215,400	1,861,056.00	0.07
134	300972	万辰集团	9,200	1,849,844.00	0.07
135	688778	厦钨新能	23,800	1,841,406.00	0.07

136	603259	药明康德	20,200	1,830,928.00	0.07
137	300219	鸿利智汇	251,200	1,811,152.00	0.07
138	600998	九州通	349,500	1,789,440.00	0.07
139	002624	完美世界	106,700	1,748,813.00	0.07
140	002612	朗姿股份	84,900	1,735,356.00	0.07
141	600210	紫江企业	235,000	1,727,250.00	0.06
142	601958	金铂股份	109,800	1,710,684.00	0.06
143	600332	白云山	65,800	1,693,692.00	0.06
144	601168	西部矿业	58,500	1,616,940.00	0.06
145	688802	沐曦股份	3,994	1,595,203.60	0.06
146	603341	龙旗科技	37,700	1,593,202.00	0.06
147	002039	黔源电力	86,500	1,571,705.00	0.06
148	688235	百济神州	5,800	1,557,880.00	0.06
149	600685	中船防务	53,500	1,522,075.00	0.06
150	000543	皖能电力	191,400	1,521,630.00	0.06
151	002202	金风科技	71,419	1,456,947.60	0.05
152	300604	长川科技	14,300	1,448,733.00	0.05
153	603979	金诚信	18,900	1,439,235.00	0.05
154	600329	达仁堂	31,100	1,418,782.00	0.05
155	002595	豪迈科技	16,700	1,411,317.00	0.05
156	688702	盛科通信	9,900	1,402,731.00	0.05
157	000060	中金岭南	232,900	1,362,465.00	0.05
158	600578	京能电力	266,800	1,360,680.00	0.05
159	300861	美畅股份	90,800	1,355,644.00	0.05
160	600930	华电新能	209,972	1,310,225.28	0.05
161	601138	工业富联	20,400	1,265,820.00	0.05
162	000987	越秀资本	155,400	1,264,956.00	0.05
163	601333	广深铁路	415,600	1,263,424.00	0.05
164	603856	东宏股份	98,600	1,229,542.00	0.05
165	000750	国海证券	288,200	1,221,968.00	0.05
166	688677	海泰新光	28,300	1,221,428.00	0.05
167	601388	怡球资源	404,400	1,217,244.00	0.05
168	301345	涛涛车业	4,800	1,206,336.00	0.05
169	002351	漫步者	99,200	1,196,352.00	0.04
170	688819	天能股份	36,000	1,195,920.00	0.04
171	600064	南京高科	126,600	1,098,888.00	0.04
172	600507	方大特钢	183,500	1,080,815.00	0.04
173	000050	深天马 A	117,300	1,059,219.00	0.04
174	002452	长高电新	126,700	1,042,741.00	0.04
175	600011	华能国际	138,200	1,030,972.00	0.04
176	003035	南网能源	214,900	984,242.00	0.04
177	601689	拓普集团	12,262	946,381.16	0.04
178	300735	光弘科技	37,800	939,708.00	0.04

179	002645	华宏科技	61,600	901,824.00	0.03
180	601801	皖新传媒	136,500	898,170.00	0.03
181	002454	松芝股份	101,000	879,710.00	0.03
182	600032	浙江新能	114,400	847,704.00	0.03
183	002772	众兴菌业	54,200	790,778.00	0.03
184	002246	北化股份	43,800	789,276.00	0.03
185	603890	春秋电子	48,600	783,918.00	0.03
186	600808	马钢股份	175,800	741,876.00	0.03
187	002222	福晶科技	12,200	687,348.00	0.03
188	000600	建投能源	77,900	664,487.00	0.02
189	300098	高新兴	106,500	649,650.00	0.02
190	300395	菲利华	6,400	641,920.00	0.02
191	002943	宇晶股份	15,800	625,680.00	0.02
192	603698	航天工程	16,100	623,875.00	0.02
193	301051	信濠光电	31,700	621,320.00	0.02
194	688160	步科股份	4,000	610,000.00	0.02
195	688690	纳微科技	23,000	593,630.00	0.02
196	300031	宝通科技	26,000	590,980.00	0.02
197	300008	天海防务	74,900	590,961.00	0.02
198	688312	燕麦科技	17,800	590,604.00	0.02
199	601020	华钰矿业	21,900	588,234.00	0.02
200	300620	光库科技	4,000	588,200.00	0.02
201	601231	环旭电子	19,600	588,000.00	0.02
202	603085	天成自控	49,600	587,760.00	0.02
203	603009	北特科技	12,200	587,552.00	0.02
204	301349	信德新材	12,500	586,375.00	0.02
205	000949	新乡化纤	106,600	586,300.00	0.02
206	600601	方正科技	49,300	577,796.00	0.02
207	688257	新锐股份	16,800	575,904.00	0.02
208	300206	理邦仪器	44,800	572,992.00	0.02
209	300357	我武生物	20,200	572,670.00	0.02
210	688636	智明达	13,100	561,204.00	0.02
211	301489	思泉新材	2,800	557,200.00	0.02
212	002518	科士达	11,300	548,276.00	0.02
213	600572	康恩贝	115,100	513,346.00	0.02
214	600487	亨通光电	20,647	510,600.31	0.02
215	601377	兴业证券	68,700	509,754.00	0.02
216	603929	亚翔集成	5,300	506,150.00	0.02
217	002340	格林美	60,300	504,108.00	0.02
218	000933	神火股份	18,300	502,701.00	0.02
219	002080	中材科技	13,503	490,699.02	0.02
220	002273	水晶光电	19,100	479,792.00	0.02
221	601555	东吴证券	52,900	479,274.00	0.02

222	300072	海新能科	103,300	475,180.00	0.02
223	002367	康力电梯	58,000	467,480.00	0.02
224	002016	世荣兆业	78,600	454,308.00	0.02
225	002314	南山控股	158,600	452,010.00	0.02
226	001258	立新能源	63,400	450,774.00	0.02
227	601900	南方传媒	33,400	447,894.00	0.02
228	300466	赛摩智能	44,400	446,220.00	0.02
229	300802	矩子科技	23,300	445,962.00	0.02
230	600959	江苏有线	129,190	444,413.60	0.02
231	002138	顺络电子	12,400	440,572.00	0.02
232	601921	浙版传媒	50,200	392,564.00	0.01
233	000951	中国重汽	23,200	392,080.00	0.01
234	603867	新化股份	15,400	391,160.00	0.01
235	002299	圣农发展	23,200	383,728.00	0.01
236	688582	芯动联科	5,800	383,438.00	0.01
237	600038	中直股份	10,300	372,139.00	0.01
238	002850	科达利	2,300	363,078.00	0.01
239	600649	城投控股	79,200	352,440.00	0.01
240	002608	江苏国信	47,500	351,025.00	0.01
241	300496	中科创达	5,200	351,000.00	0.01
242	002152	广电运通	25,200	348,012.00	0.01
243	000021	深科技	13,700	346,336.00	0.01
244	688772	珠海冠宇	15,700	338,021.00	0.01
245	603331	百达精工	23,000	327,750.00	0.01
246	600583	海油工程	59,200	325,008.00	0.01
247	688498	源杰科技	500	320,995.00	0.01
248	300162	雷曼光电	38,800	315,444.00	0.01
249	603236	移远通信	3,300	314,853.00	0.01
250	603787	新日股份	22,300	313,538.00	0.01
251	300138	晨光生物	24,800	307,768.00	0.01
252	300003	乐普医疗	19,300	305,133.00	0.01
253	300012	华测检测	22,400	303,520.00	0.01
254	000650	仁和药业	53,200	300,580.00	0.01
255	600027	华电国际	60,500	300,080.00	0.01
256	600546	山煤国际	29,600	298,664.00	0.01
257	601368	绿城水务	60,100	298,096.00	0.01
258	600100	同方股份	33,400	297,928.00	0.01
259	603700	宁水集团	21,900	297,621.00	0.01
260	300381	溢多利	45,300	295,356.00	0.01
261	600082	海泰发展	72,700	295,162.00	0.01
262	603578	三星新材	24,400	294,752.00	0.01
263	300412	迦南科技	55,000	294,250.00	0.01
264	002587	奥拓电子	43,500	294,060.00	0.01

265	600805	悦达投资	54,100	293,763.00	0.01
266	600935	华塑股份	119,900	293,755.00	0.01
267	000421	南京公用	42,500	293,675.00	0.01
268	601518	吉林高速	104,000	293,280.00	0.01
269	603335	迪生力	52,076	293,187.88	0.01
270	603045	福达合金	14,900	292,785.00	0.01
271	600020	中原高速	68,700	292,662.00	0.01
272	600051	宁波联合	38,800	292,552.00	0.01
273	300425	中建环能	59,100	292,545.00	0.01
274	600780	通宝能源	51,500	292,520.00	0.01
275	002441	众业达	31,100	292,340.00	0.01
276	301103	何氏眼科	14,900	292,338.00	0.01
277	603126	中材节能	43,500	292,320.00	0.01
278	002375	亚厦股份	77,100	292,209.00	0.01
279	300664	鹏鹞环保	54,500	292,120.00	0.01
280	300193	佳士科技	32,600	291,770.00	0.01
281	000778	新兴铸管	69,800	291,764.00	0.01
282	600269	赣粤高速	56,200	291,678.00	0.01
283	600251	冠农股份	31,600	291,668.00	0.01
284	600982	宁波能源	67,200	291,648.00	0.01
285	300639	凯普生物	54,200	291,596.00	0.01
286	603739	蔚蓝生物	20,600	291,490.00	0.01
287	000166	申万宏源	55,300	291,431.00	0.01
288	600782	新钢股份	75,100	291,388.00	0.01
289	002573	清新环境	77,900	291,346.00	0.01
290	300662	科锐国际	11,500	291,295.00	0.01
291	000726	鲁泰 A	40,900	291,208.00	0.01
292	301110	青木科技	4,400	291,192.00	0.01
293	300464	星徽股份	45,900	291,006.00	0.01
294	603309	维力医疗	21,400	290,826.00	0.01
295	003030	祖名股份	14,400	290,736.00	0.01
296	000990	诚志股份	36,700	290,664.00	0.01
297	601117	中国化学	38,600	290,658.00	0.01
298	600989	宝丰能源	14,800	290,524.00	0.01
299	600278	东方创业	38,200	290,320.00	0.01
300	003025	思进智能	20,200	290,274.00	0.01
301	601901	方正证券	37,200	290,160.00	0.01
302	603500	祥和实业	24,200	289,916.00	0.01
303	300407	凯发电气	25,600	289,792.00	0.01
304	002687	乔治白	60,100	289,682.00	0.01
305	300824	北鼎股份	25,600	289,536.00	0.01
306	002556	辉隆股份	47,900	289,316.00	0.01
307	300320	海达股份	31,000	289,230.00	0.01

308	002489	浙江永强	75,500	289,165.00	0.01
309	300358	楚天科技	29,500	288,805.00	0.01
310	601678	滨化股份	68,100	288,744.00	0.01
311	605098	行动教育	6,900	288,144.00	0.01
312	300041	回天新材	26,000	288,080.00	0.01
313	002546	新联电子	41,200	287,988.00	0.01
314	301382	蜂助手	8,100	287,064.00	0.01
315	605001	威奥股份	37,600	286,888.00	0.01
316	300257	开山股份	20,400	286,620.00	0.01
317	000581	威孚高科	13,900	286,618.00	0.01
318	605208	永茂泰	21,100	286,538.00	0.01
319	300382	斯莱克	18,400	286,304.00	0.01
320	300083	创世纪	31,000	285,510.00	0.01
321	600057	厦门象屿	33,400	284,568.00	0.01
322	001337	四川黄金	10,100	281,386.00	0.01
323	301596	瑞迪智驱	3,500	275,170.00	0.01
324	300970	华绿生物	13,400	274,834.00	0.01
325	300852	四会富仕	7,100	271,078.00	0.01
326	300302	同有科技	14,800	268,472.00	0.01
327	000848	承德露露	30,500	259,250.00	0.01
328	300409	道氏技术	11,500	258,635.00	0.01
329	000623	吉林敖东	13,200	257,796.00	0.01
330	300001	特锐德	10,000	256,800.00	0.01
331	002532	天山铝业	15,800	255,644.00	0.01
332	300207	欣旺达	9,600	251,040.00	0.01
333	300619	金银河	5,600	245,840.00	0.01
334	300450	先导智能	4,900	244,902.00	0.01
335	601628	中国人寿	5,300	241,150.00	0.01
336	300458	全志科技	5,700	239,571.00	0.01
337	000402	金融街	84,600	232,650.00	0.01
338	002004	华邦健康	48,400	231,352.00	0.01
339	000923	河钢资源	10,900	230,753.00	0.01
340	600569	安阳钢铁	102,100	229,725.00	0.01
341	601996	丰林集团	101,900	229,275.00	0.01
342	600195	中牧股份	28,900	227,443.00	0.01
343	002993	奥海科技	5,200	227,292.00	0.01
344	002824	和胜股份	11,400	221,160.00	0.01
345	301080	百普赛斯	4,000	216,000.00	0.01
346	002975	博杰股份	2,800	215,600.00	0.01
347	600478	科力远	30,900	212,901.00	0.01
348	600060	海信视像	8,700	211,236.00	0.01
349	601857	中国石油	20,200	210,282.00	0.01
350	603558	健盛集团	18,000	202,140.00	0.01

351	000776	广发证券	8,800	193,776.00	0.01
352	600512	腾达建设	79,900	193,358.00	0.01
353	603328	依顿电子	17,600	192,896.00	0.01
354	601928	凤凰传媒	18,900	189,756.00	0.01
355	002409	雅克科技	2,500	185,250.00	0.01
356	600435	北方导航	12,000	185,040.00	0.01
357	300389	艾比森	11,200	181,776.00	0.01
358	002100	天康生物	23,900	176,143.00	0.01
359	300110	华仁药业	55,900	176,085.00	0.01
360	000157	中联重科	20,200	174,326.00	0.01
361	600143	金发科技	8,900	173,906.00	0.01
362	002312	川发龙蟒	15,600	170,508.00	0.01
363	603077	和邦生物	74,400	168,144.00	0.01
364	300136	信维通信	2,700	167,400.00	0.01
365	688301	奕瑞科技	1,600	161,776.00	0.01
366	002763	汇洁股份	22,400	161,728.00	0.01
367	000338	潍柴动力	9,400	161,680.00	0.01
368	300446	航天智造	6,300	159,642.00	0.01
369	688182	灿勤科技	5,400	159,408.00	0.01
370	300260	新莱应材	2,800	159,292.00	0.01
371	002544	普天科技	4,600	158,654.00	0.01
372	000852	石化机械	21,800	158,486.00	0.01
373	300140	节能环保	23,300	157,741.00	0.01
374	300593	新雷能	5,300	157,728.00	0.01
375	300858	科拓生物	9,400	157,638.00	0.01
376	000555	神州信息	9,500	157,225.00	0.01
377	603078	江化微	8,800	157,080.00	0.01
378	603858	步长制药	10,000	156,400.00	0.01
379	688352	颀中科技	12,400	156,364.00	0.01
380	002950	奥美医疗	14,300	156,156.00	0.01
381	300304	云意电气	13,400	155,976.00	0.01
382	002335	科华数据	2,800	155,484.00	0.01
383	688390	固德威	2,500	155,325.00	0.01
384	688179	阿拉丁	12,400	154,876.00	0.01
385	300870	欧陆通	700	154,700.00	0.01
386	300319	麦捷科技	13,200	154,308.00	0.01
387	688410	山外山	10,300	154,191.00	0.01
388	002478	常宝股份	18,200	154,154.00	0.01
389	603950	长源东谷	5,300	153,435.00	0.01
390	603489	八方股份	5,000	152,900.00	0.01
391	002636	金安国纪	9,100	152,061.00	0.01
392	688531	日联科技	2,300	151,869.00	0.01
393	002668	TCL 智家	14,400	149,472.00	0.01

394	300759	康龙化成	5,200	147,836.00	0.01
395	002475	立讯精密	2,600	147,446.00	0.01
396	300383	光环新网	11,600	145,116.00	0.01
397	002261	拓维信息	4,300	142,330.00	0.01
398	603456	九洲药业	7,800	139,620.00	0.01
399	002821	凯莱英	1,500	139,395.00	0.01
400	600763	通策医疗	3,400	136,714.00	0.01
401	301219	腾远钴业	2,000	136,560.00	0.01
402	300919	中伟股份	2,700	125,091.00	0.00
403	002837	英维克	1,170	125,061.30	0.00
404	000997	新大陆	4,400	124,608.00	0.00
405	000009	中国宝安	12,500	123,125.00	0.00
406	300755	华致酒行	6,900	121,578.00	0.00
407	688599	天合光能	7,200	119,160.00	0.00
408	300420	五洋自控	29,700	118,503.00	0.00
409	000603	盛达资源	3,800	117,648.00	0.00
410	000717	中南股份	45,300	117,327.00	0.00
411	300239	东宝生物	20,000	117,200.00	0.00
412	603876	鼎胜新材	7,800	117,078.00	0.00
413	000544	中原环保	14,000	116,480.00	0.00
414	600120	浙江东方	18,800	115,996.00	0.00
415	600499	科达制造	7,900	109,573.00	0.00
416	600007	中国国贸	5,500	109,010.00	0.00
417	300674	宇信科技	4,400	106,744.00	0.00
418	688578	艾力斯	1,000	104,150.00	0.00
419	600295	鄂尔多斯	8,400	103,824.00	0.00
420	688525	佰维存储	900	103,311.00	0.00
421	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
422	000938	紫光股份	4,100	100,860.00	0.00
423	002091	江苏国泰	11,100	100,233.00	0.00
424	603565	中谷物流	9,800	98,392.00	0.00
425	002706	良信股份	9,000	97,020.00	0.00
426	300363	博腾股份	4,100	95,284.00	0.00
427	000828	东莞控股	8,700	93,612.00	0.00
428	603939	益丰药房	4,200	91,224.00	0.00
429	002271	东方雨虹	6,400	86,976.00	0.00
430	002897	意华股份	1,600	86,512.00	0.00
431	002867	周大生	7,100	86,478.00	0.00
432	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
433	001696	宗申动力	3,900	84,591.00	0.00
434	603920	世运电路	1,700	82,297.00	0.00
435	300474	景嘉微	1,100	79,057.00	0.00
436	600398	海澜之家	12,700	76,835.00	0.00

437	002357	富临运业	7,100	76,112.00	0.00
438	002126	银轮股份	2,000	75,600.00	0.00
439	001389	广合科技	900	73,467.00	0.00
440	603156	养元饮品	2,500	71,875.00	0.00
441	601336	新华保险	1,000	69,700.00	0.00
442	300502	新易盛	160	68,940.80	0.00
443	688608	恒玄科技	300	68,082.00	0.00
444	688439	振华风光	1,000	64,600.00	0.00
445	603197	保隆科技	1,700	62,883.00	0.00
446	002195	岩山科技	8,800	62,392.00	0.00
447	600497	驰宏锌锗	8,300	60,673.00	0.00
448	000426	兴业银锡	1,700	60,520.00	0.00
449	300119	瑞普生物	3,200	60,064.00	0.00
450	688591	泰凌微	1,400	59,584.00	0.00
451	600526	菲达环保	11,100	59,496.00	0.00
452	002484	江海股份	2,000	59,400.00	0.00
453	300684	中石科技	1,200	59,064.00	0.00
454	002111	威海广泰	5,600	58,912.00	0.00
455	600854	春兰股份	11,800	58,882.00	0.00
456	603566	普莱柯	4,700	58,421.00	0.00
457	002010	传化智联	10,000	58,100.00	0.00
458	600479	千金药业	5,700	57,912.00	0.00
459	600415	小商品城	3,600	57,420.00	0.00
460	600967	内蒙一机	3,300	55,440.00	0.00
461	600004	白云机场	5,800	54,868.00	0.00
462	600188	兖矿能源	4,100	53,915.00	0.00
463	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
464	603179	新泉股份	700	51,716.00	0.00
465	600392	盛和资源	2,400	51,672.00	0.00
466	600352	浙江龙盛	4,700	50,102.00	0.00
467	688005	容百科技	1,400	49,560.00	0.00
468	300984	金沃股份	580	49,230.40	0.00
469	688519	南亚新材	600	48,516.00	0.00
470	600114	东睦股份	1,500	45,825.00	0.00
471	600062	华润双鹤	2,500	45,725.00	0.00
472	300035	中科电气	2,134	45,432.86	0.00
473	688380	中微半导	1,400	45,010.00	0.00
474	603986	兆易创新	208	44,564.00	0.00
475	300432	富临精工	2,660	44,422.00	0.00
476	002444	巨星科技	1,300	44,226.00	0.00
477	605020	永和股份	1,600	43,024.00	0.00
478	000898	鞍钢股份	16,300	41,239.00	0.00
479	000657	中钨高新	1,400	38,794.00	0.00

480	002050	三花智控	700	38,717.00	0.00
481	300002	神州泰岳	3,300	38,016.00	0.00
482	688545	兴福电子	990	37,174.50	0.00
483	603816	顾家家居	1,200	36,888.00	0.00
484	300408	三环集团	800	36,600.00	0.00
485	000680	山推股份	3,000	35,910.00	0.00
486	600580	卧龙电驱	700	34,370.00	0.00
487	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
488	601021	春秋航空	541	32,189.50	0.00
489	600312	平高电气	1,800	31,230.00	0.00
490	002442	龙星科技	4,978	30,913.38	0.00
491	603508	思维列控	1,100	30,602.00	0.00
492	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
493	300679	电连技术	600	29,208.00	0.00
494	688297	中无人机	600	28,812.00	0.00
495	603129	春风动力	100	27,868.00	0.00
496	600299	安迪苏	3,100	27,807.00	0.00
497	300655	晶瑞电材	1,700	27,421.00	0.00
498	000034	神州数码	700	27,237.00	0.00
499	603118	共进股份	2,300	26,450.00	0.00
500	300101	振芯科技	900	25,587.00	0.00
501	301166	优宁维	800	23,744.00	0.00
502	600562	国睿科技	800	22,608.00	0.00
503	600664	哈药股份	6,500	22,425.00	0.00
504	603529	爱玛科技	730	21,681.00	0.00
505	600480	凌云股份	1,600	19,664.00	0.00
506	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
507	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
508	002151	北斗星通	400	18,172.00	0.00
509	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
510	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
511	600872	中炬高新	1,000	17,550.00	0.00
512	688180	君实生物	500	17,080.00	0.00
513	002946	新乳业	900	16,677.00	0.00
514	600063	皖维高新	2,800	16,492.00	0.00
515	605319	无锡振华	780	16,411.20	0.00
516	603160	汇顶科技	200	15,800.00	0.00
517	600019	宝钢股份	2,100	15,645.00	0.00
518	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
519	002773	康弘药业	500	14,985.00	0.00
520	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
521	301602	超研股份	658	14,173.32	0.00
522	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00

523	300100	双林股份	334	13,233.08	0.00
524	002185	华天科技	1,200	13,164.00	0.00
525	301486	致尚科技	100	12,405.00	0.00
526	600600	青岛啤酒	200	12,240.00	0.00
527	001286	陕西能源	1,300	12,103.00	0.00
528	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
529	688981	中芯国际	95	11,668.85	0.00
530	300800	力合科技	1,000	11,630.00	0.00
531	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
532	300570	太辰光	100	11,555.00	0.00
533	300866	安克创新	100	11,439.00	0.00
534	600428	中远海特	1,600	11,360.00	0.00
535	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
536	600869	远东股份	1,400	11,270.00	0.00
537	600267	海正药业	1,100	10,879.00	0.00
538	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
539	300151	昌红科技	700	10,556.00	0.00
540	001339	智微智能	200	10,222.00	0.00
541	600941	中国移动	100	10,105.00	0.00
542	002014	永新股份	800	9,536.00	0.00
543	002352	顺丰控股	248	9,503.36	0.00
544	600826	兰生股份	900	9,486.00	0.00
545	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
546	001206	依依股份	300	8,913.00	0.00
547	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
548	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
549	605589	圣泉集团	300	8,490.00	0.00
550	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
551	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
552	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
553	002961	瑞达期货	300	8,121.00	0.00
554	002084	海鸥住工	2,000	7,760.00	0.00
555	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
556	002001	新和成	300	7,557.00	0.00
557	603317	天味食品	600	7,512.00	0.00
558	001914	招商积余	700	7,476.00	0.00
559	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
560	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
561	603728	鸣志电器	100	7,235.00	0.00
562	002296	辉煌科技	600	6,720.00	0.00
563	002311	海大集团	120	6,645.60	0.00
564	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
565	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00

566	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
567	002483	润邦股份	800	5,712.00	0.00
568	603357	设计总院	700	5,705.00	0.00
569	300652	雷迪克	100	5,486.00	0.00
570	002658	雪迪龙	600	5,418.00	0.00
571	300230	永利股份	1,100	5,258.00	0.00
572	688387	信科移动	400	5,160.00	0.00
573	603868	飞科电器	100	4,328.00	0.00
574	601107	四川成渝	700	4,256.00	0.00
575	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
576	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
577	002250	联化科技	300	4,014.00	0.00
578	002432	九安医疗	100	4,004.00	0.00
579	601918	新集能源	600	3,966.00	0.00
580	300699	光威复材	100	3,946.00	0.00
581	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
582	002266	浙富控股	890	3,702.40	0.00
583	300752	隆利科技	200	3,650.00	0.00
584	000538	云南白药	60	3,405.60	0.00
585	600131	国网信通	200	3,228.00	0.00
586	003816	中国广核	800	3,008.00	0.00
587	600582	天地科技	500	2,915.00	0.00
588	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
589	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
590	002635	安洁科技	200	2,772.00	0.00
591	601066	中信建投	100	2,677.00	0.00
592	000591	太阳能	600	2,664.00	0.00
593	002507	涪陵榨菜	200	2,582.00	0.00
594	000768	中航西飞	100	2,538.00	0.00
595	002283	天润工业	400	2,496.00	0.00
596	300703	创源股份	100	2,444.00	0.00
597	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
598	002061	浙江交科	600	2,388.00	0.00
599	002163	海南发展	100	2,384.00	0.00
600	002747	埃斯顿	100	2,370.00	0.00
601	000429	粤高速 A	200	2,356.00	0.00
602	300070	碧水源	600	2,352.00	0.00
603	600271	航天信息	200	2,338.00	0.00
604	002739	万达电影	200	2,264.00	0.00
605	601568	北元集团	600	2,232.00	0.00
606	603993	洛阳钼业	100	2,000.00	0.00
607	600609	金杯汽车	400	1,852.00	0.00
608	601952	苏垦农发	200	1,824.00	0.00

609	300351	永贵电器	100	1,803.00	0.00
610	002500	山西证券	300	1,797.00	0.00
611	601319	中国人保	200	1,790.00	0.00
612	600410	华胜天成	100	1,788.00	0.00
613	002395	双象股份	100	1,673.00	0.00
614	000532	华金资本	100	1,612.00	0.00
615	300541	先进数通	100	1,506.00	0.00
616	002969	嘉美包装	100	1,266.00	0.00
617	601728	中国电信	200	1,260.00	0.00
618	002083	孚日股份	100	1,190.00	0.00
619	000593	德龙汇能	100	1,120.00	0.00
620	002457	青龙管业	100	1,093.00	0.00
621	002852	道道全	100	1,055.00	0.00
622	600268	国电南自	100	1,048.00	0.00
623	603916	苏博特	100	946.00	0.00
624	002062	宏润建设	100	925.00	0.00
625	002437	誉衡药业	300	921.00	0.00
626	601311	骆驼股份	100	917.00	0.00
627	301039	中集车辆	100	915.00	0.00
628	600025	华能水电	100	908.00	0.00
629	300453	三鑫医疗	100	872.00	0.00
630	002469	三维化学	100	835.00	0.00
631	600986	浙文互联	100	782.00	0.00
632	002121	科陆电子	100	770.00	0.00
633	002615	哈尔斯	100	767.00	0.00
634	600223	福瑞达	100	736.00	0.00
635	600110	诺德股份	100	709.00	0.00
636	603718	海利生物	100	610.00	0.00
637	601599	浙文影业	100	398.00	0.00
638	002060	广东建工	100	360.00	0.00
639	002421	达实智能	100	285.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688018	乐鑫科技	241,932,250.39	75.09
2	002027	分众传媒	202,920,815.18	62.98
3	688249	晶合集成	198,869,890.23	61.73
4	300750	宁德时代	198,329,007.80	61.56
5	688220	翱捷科技	192,892,788.31	59.87
6	688008	澜起科技	175,418,326.69	54.45

7	688279	峰岹科技	166,188,806.56	51.58
8	601318	中国平安	132,102,503.00	41.00
9	301606	绿联科技	124,038,867.00	38.50
10	300124	汇川技术	118,293,663.50	36.72
11	600036	招商银行	102,253,087.00	31.74
12	002311	海大集团	97,811,146.70	30.36
13	002558	巨人网络	89,138,182.00	27.67
14	002847	盐津铺子	87,061,515.22	27.02
15	002352	顺丰控股	78,796,470.60	24.46
16	688256	寒武纪	78,549,524.38	24.38
17	603986	兆易创新	75,756,523.67	23.51
18	301656	联合动力	75,711,050.35	23.50
19	688775	影石创新	71,690,692.16	22.25
20	688766	普冉股份	56,840,349.38	17.64
21	002517	恺英网络	54,060,617.00	16.78
22	300850	新强联	53,527,702.35	16.61
23	603893	瑞芯微	52,570,509.99	16.32
24	688183	生益电子	47,184,565.02	14.65
25	002284	亚太股份	46,398,957.61	14.40
26	002595	豪迈科技	45,463,680.00	14.11
27	002734	利民股份	44,875,622.42	13.93
28	300113	顺网科技	44,650,334.69	13.86
29	603508	思维列控	42,801,971.40	13.29
30	002920	德赛西威	42,394,013.00	13.16
31	300502	新易盛	42,106,365.11	13.07
32	688629	华丰科技	40,778,165.48	12.66
33	603166	福达股份	39,651,765.00	12.31
34	003022	联泓新科	39,004,296.00	12.11
35	688213	思特威	38,961,629.30	12.09
36	300373	扬杰科技	38,818,944.04	12.05
37	603612	索通发展	38,654,921.00	12.00
38	688095	福昕软件	38,135,350.16	11.84
39	600030	中信证券	38,093,947.15	11.82
40	002202	金风科技	38,046,185.64	11.81
41	605020	永和股份	37,947,580.26	11.78
42	600183	生益科技	37,773,694.00	11.72
43	603236	移远通信	37,546,178.50	11.65
44	601108	财通证券	37,447,839.60	11.62
45	603379	三美股份	37,377,190.95	11.60
46	601021	春秋航空	37,098,171.22	11.51
47	603444	吉比特	36,762,961.00	11.41
48	603737	三棵树	36,680,058.20	11.39
49	600866	星湖科技	36,317,242.00	11.27

50	002028	思源电气	36,245,498.97	11.25
51	300681	英搏尔	35,395,357.29	10.99
52	605305	中际联合	35,341,565.52	10.97
53	600633	浙数文化	34,968,306.00	10.85
54	688591	泰凌微	34,714,818.10	10.78
55	300454	深信服	34,676,584.80	10.76
56	603129	春风动力	34,049,459.00	10.57
57	000408	藏格矿业	33,797,102.00	10.49
58	300777	中简科技	33,323,691.11	10.34
59	603699	纽威股份	32,962,660.53	10.23
60	300100	双林股份	32,901,998.90	10.21
61	300926	博俊科技	32,671,807.20	10.14
62	301308	江波龙	32,351,608.92	10.04
63	301196	唯科科技	32,024,906.00	9.94
64	300953	震裕科技	31,874,766.80	9.89
65	603766	隆鑫通用	31,409,047.00	9.75
66	603296	华勤技术	31,404,562.14	9.75
67	605319	无锡振华	30,319,500.00	9.41
68	688372	伟测科技	29,843,397.61	9.26
69	603380	易德龙	29,582,805.00	9.18
70	002624	完美世界	29,447,474.00	9.14
71	688297	中无人机	29,288,454.08	9.09
72	000680	山推股份	28,859,275.00	8.96
73	603173	福斯达	28,483,787.12	8.84
74	600150	中国船舶	28,444,430.66	8.83
75	300228	富瑞特装	28,179,703.00	8.75
76	601717	中创智领	28,173,285.00	8.74
77	002683	广东宏大	28,134,472.00	8.73
78	688258	卓易信息	28,033,692.80	8.70
79	301031	中熔电气	27,751,886.36	8.61
80	002442	龙星科技	26,705,652.32	8.29
81	688208	道通科技	26,489,050.13	8.22
82	603809	豪能股份	26,407,451.80	8.20
83	300073	当升科技	26,358,080.27	8.18
84	688313	仕佳光子	26,054,108.29	8.09
85	688017	绿的谐波	25,916,877.06	8.04
86	002487	大金重工	25,779,621.06	8.00
87	002983	芯瑞达	25,662,222.67	7.97
88	002545	东方铁塔	25,649,183.00	7.96
89	600499	科达制造	25,593,186.00	7.94
90	002049	紫光国微	24,941,303.45	7.74
91	603486	科沃斯	24,811,094.00	7.70
92	300274	阳光电源	24,702,585.00	7.67

93	600114	东睦股份	24,684,820.00	7.66
94	600096	云天化	24,630,491.00	7.64
95	600938	中国海油	24,461,368.00	7.59
96	301165	锐捷网络	24,354,374.00	7.56
97	300984	金沃股份	24,251,094.80	7.53
98	002266	浙富控股	24,238,511.90	7.52
99	600826	兰生股份	24,137,443.00	7.49
100	002353	杰瑞股份	23,698,366.00	7.36
101	688392	骄成超声	22,909,115.34	7.11
102	688778	厦钨新能	22,745,053.17	7.06
103	688608	恒玄科技	22,614,108.90	7.02
104	605589	圣泉集团	22,297,611.00	6.92
105	002600	领益智造	22,012,960.00	6.83
106	000553	安道麦 A	21,917,154.01	6.80
107	301345	涛涛车业	21,626,428.82	6.71
108	688403	汇成股份	21,353,621.96	6.63
109	002768	国恩股份	21,341,230.00	6.62
110	688498	源杰科技	21,251,584.60	6.60
111	688002	睿创微纳	20,593,509.28	6.39
112	688295	中复神鹰	20,542,815.03	6.38
113	301200	大族数控	20,527,704.00	6.37
114	603187	海容冷链	20,453,097.00	6.35
115	300674	宇信科技	20,451,642.00	6.35
116	002436	兴森科技	20,338,030.16	6.31
117	605168	三人行	20,248,616.65	6.28
118	688088	虹软科技	20,075,745.36	6.23
119	300627	华测导航	19,894,193.20	6.17
120	002246	北化股份	19,820,869.75	6.15
121	002236	大华股份	19,641,854.00	6.10
122	301029	怡合达	19,608,834.00	6.09
123	002997	瑞鹄模具	19,607,638.00	6.09
124	603009	北特科技	19,607,245.00	6.09
125	002916	深南电路	19,569,153.50	6.07
126	688267	中触媒	19,474,820.54	6.04
127	002245	蔚蓝锂芯	19,449,526.00	6.04
128	600435	北方导航	19,408,733.00	6.02
129	605016	百龙创园	19,407,646.30	6.02
130	688772	珠海冠宇	19,385,048.51	6.02
131	600885	宏发股份	19,349,208.00	6.01
132	603163	圣晖集成	19,181,524.88	5.95
133	002597	金禾实业	19,157,028.03	5.95
134	300803	指南针	19,136,101.45	5.94
135	688065	凯赛生物	18,776,702.98	5.83

136	300438	鹏辉能源	18,715,719.00	5.81
137	300476	胜宏科技	18,690,533.00	5.80
138	300035	中科电气	18,643,716.32	5.79
139	603185	弘元绿能	18,575,934.80	5.77
140	601138	工业富联	18,552,353.00	5.76
141	002281	光迅科技	18,513,515.67	5.75
142	002402	和而泰	18,440,438.00	5.72
143	600389	江山股份	18,285,278.70	5.68
144	300017	网宿科技	18,232,712.28	5.66
145	301338	凯格精机	18,191,018.00	5.65
146	002008	大族激光	18,169,095.36	5.64
147	001301	尚太科技	18,050,350.00	5.60
148	300450	先导智能	18,009,894.80	5.59
149	002414	高德红外	17,998,568.00	5.59
150	000719	中原传媒	17,927,473.00	5.56
151	605060	联德股份	17,841,826.00	5.54
152	300002	神州泰岳	17,833,053.00	5.54
153	603678	火炬电子	17,537,175.00	5.44
154	300442	润泽科技	17,533,298.98	5.44
155	300652	雷迪克	17,465,585.00	5.42
156	002354	天娱数科	17,370,047.98	5.39
157	300763	锦浪科技	17,325,577.10	5.38
158	301377	鼎泰高科	17,270,840.00	5.36
159	688045	必易微	17,181,012.35	5.33
160	001339	智微智能	17,162,215.00	5.33
161	002050	三花智控	16,958,101.43	5.26
162	600482	中国动力	16,957,362.00	5.26
163	688668	鼎通科技	16,928,060.39	5.25
164	300596	利安隆	16,882,885.11	5.24
165	688536	思瑞浦	16,779,136.94	5.21
166	688630	芯碁微装	16,740,203.42	5.20
167	600031	三一重工	16,735,659.00	5.19
168	601311	骆驼股份	16,732,315.00	5.19
169	688286	敏芯股份	16,662,637.32	5.17
170	300408	三环集团	16,388,429.00	5.09
171	688326	经纬恒润	16,342,444.12	5.07
172	600660	福耀玻璃	16,333,219.60	5.07
173	300861	美畅股份	16,200,258.60	5.03
174	601865	福莱特	16,163,472.00	5.02
175	300443	金雷股份	16,136,084.17	5.01
176	300458	全志科技	16,074,073.83	4.99
177	688027	国盾量子	16,042,695.83	4.98
178	300415	伊之密	16,015,997.00	4.97

179	300496	中科创达	16,010,822.00	4.97
180	688048	长光华芯	15,999,312.20	4.97
181	688049	炬芯科技	15,969,259.35	4.96
182	300679	电连技术	15,961,354.00	4.95
183	300432	富临精工	15,960,492.00	4.95
184	603179	新泉股份	15,888,335.00	4.93
185	688308	欧科亿	15,810,197.92	4.91
186	000422	湖北宜化	15,799,001.00	4.90
187	301035	润丰股份	15,661,207.00	4.86
188	688147	微导纳米	15,619,707.13	4.85
189	603529	爱玛科技	15,482,074.70	4.81
190	000792	盐湖股份	15,446,527.32	4.79
191	600299	安迪苏	15,401,909.00	4.78
192	600909	华安证券	15,389,300.63	4.78
193	000887	中鼎股份	15,276,891.00	4.74
194	688357	建龙微纳	15,220,586.71	4.72
195	600989	宝丰能源	15,182,080.00	4.71
196	688322	奥比中光	15,156,721.00	4.70
197	002276	万马股份	15,125,651.00	4.69
198	300567	精测电子	15,109,450.00	4.69
199	300389	艾比森	15,080,381.00	4.68
200	002643	万润股份	15,031,307.25	4.67
201	002048	宁波华翔	14,967,079.00	4.65
202	000987	越秀资本	14,944,970.00	4.64
203	002074	国轩高科	14,943,180.00	4.64
204	600104	上汽集团	14,885,294.00	4.62
205	600933	爱柯迪	14,880,266.00	4.62
206	600517	国网英大	14,877,039.00	4.62
207	688270	臻镭科技	14,856,982.24	4.61
208	300346	南大光电	14,838,023.80	4.61
209	301607	富特科技	14,826,440.80	4.60
210	300033	同花顺	14,789,363.00	4.59
211	002444	巨星科技	14,777,536.00	4.59
212	688686	奥普特	14,765,236.00	4.58
213	002850	科达利	14,691,127.03	4.56
214	301529	福赛科技	14,600,320.00	4.53
215	300833	浩洋股份	14,529,211.00	4.51
216	000783	长江证券	14,425,057.00	4.48
217	000709	河钢股份	14,278,085.00	4.43
218	002156	通富微电	14,235,701.00	4.42
219	600315	上海家化	14,169,169.55	4.40
220	688123	聚辰股份	14,133,747.01	4.39
221	002396	星网锐捷	14,105,508.00	4.38

222	688005	容百科技	14,101,727.48	4.38
223	300790	宇瞳光学	14,055,837.00	4.36
224	300573	兴齐眼药	14,050,924.20	4.36
225	688006	杭可科技	13,978,509.81	4.34
226	688798	艾为电子	13,932,999.43	4.32
227	002938	鹏鼎控股	13,866,358.00	4.30
228	300058	蓝色光标	13,845,336.01	4.30
229	002765	蓝黛科技	13,842,264.00	4.30
230	605167	利柏特	13,829,290.00	4.29
231	601019	山东出版	13,795,680.00	4.28
232	000893	亚钾国际	13,753,088.00	4.27
233	600998	九州通	13,726,176.00	4.26
234	600487	亨通光电	13,710,551.09	4.26
235	001380	华纬科技	13,702,874.84	4.25
236	000988	华工科技	13,663,277.40	4.24
237	603859	能科科技	13,539,194.00	4.20
238	000060	中金岭南	13,521,815.00	4.20
239	002690	美亚光电	13,508,603.00	4.19
240	002922	伊戈尔	13,486,829.00	4.19
241	600959	江苏有线	13,477,266.00	4.18
242	002837	英维克	13,418,822.00	4.17
243	000725	京东方 A	13,153,703.00	4.08
244	002539	云图控股	13,138,690.00	4.08
245	002518	科士达	13,115,393.00	4.07
246	603565	中谷物流	13,061,614.00	4.05
247	600875	东方电气	13,029,856.00	4.04
248	300604	长川科技	12,833,923.39	3.98
249	600469	风神股份	12,681,277.00	3.94
250	688127	蓝特光学	12,598,859.13	3.91
251	000800	一汽解放	12,564,980.40	3.90
252	688550	瑞联新材	12,348,408.84	3.83
253	002011	盾安环境	12,194,125.53	3.78
254	603233	大参林	12,183,046.60	3.78
255	600873	梅花生物	12,127,798.00	3.76
256	688082	盛美上海	12,069,352.87	3.75
257	000811	冰轮环境	12,054,014.00	3.74
258	600312	平高电气	12,053,721.00	3.74
259	300001	特锐德	11,998,365.00	3.72
260	603867	新化股份	11,958,181.00	3.71
261	603049	中策橡胶	11,926,218.46	3.70
262	301095	广立微	11,916,877.54	3.70
263	001696	宗申动力	11,840,938.00	3.68
264	688800	瑞可达	11,785,373.35	3.66

265	300768	迪普科技	11,769,401.00	3.65
266	603979	金诚信	11,700,298.00	3.63
267	600817	宇通重工	11,693,581.00	3.63
268	600699	均胜电子	11,681,503.00	3.63
269	002384	东山精密	11,676,207.00	3.62
270	603086	先达股份	11,637,193.00	3.61
271	300708	聚灿光电	11,558,506.00	3.59
272	601179	中国西电	11,375,095.00	3.53
273	600704	物产中大	11,227,305.25	3.48
274	301162	国能日新	11,203,644.00	3.48
275	000543	皖能电力	11,186,765.00	3.47
276	000825	太钢不锈	11,083,498.00	3.44
277	300570	太辰光	10,744,661.00	3.34
278	603259	药明康德	10,477,037.00	3.25
279	002594	比亚迪	10,454,383.00	3.24
280	300003	乐普医疗	10,360,702.00	3.22
281	688187	时代电气	10,287,307.75	3.19
282	600063	皖维高新	10,062,912.00	3.12
283	600578	京能电力	10,061,252.00	3.12
284	603659	璞泰来	10,005,018.95	3.11
285	601900	南方传媒	9,911,006.00	3.08
286	002500	山西证券	9,841,706.00	3.05
287	600166	福田汽车	9,764,987.00	3.03
288	000050	深天马 A	9,746,666.43	3.03
289	300972	万辰集团	9,695,332.72	3.01
290	002299	圣农发展	9,695,332.00	3.01
291	600098	广州发展	9,662,567.00	3.00
292	601728	中国电信	9,594,701.00	2.98
293	603077	和邦生物	9,492,741.00	2.95
294	603466	风语筑	9,395,018.00	2.92
295	600741	华域汽车	9,361,634.00	2.91
296	601211	国泰海通	9,223,108.00	2.86
297	688469	芯联集成	9,218,959.29	2.86
298	000623	吉林敖东	9,151,867.00	2.84
299	601333	广深铁路	9,106,248.00	2.83
300	300140	节能环保	9,064,276.00	2.81
301	688582	芯动联科	9,055,268.81	2.81
302	000726	鲁泰 A	8,987,739.36	2.79
303	002546	新联电子	8,958,239.00	2.78
304	603816	顾家家居	8,872,174.97	2.75
305	600582	天地科技	8,866,224.00	2.75
306	600867	通化东宝	8,840,500.64	2.74
307	002203	海亮股份	8,840,471.00	2.74

308	603786	科博达	8,814,820.00	2.74
309	002701	奥瑞金	8,808,994.00	2.73
310	300666	江丰电子	8,748,879.00	2.72
311	601568	北元集团	8,728,835.00	2.71
312	688100	威胜信息	8,714,944.20	2.71
313	600064	南京高科	8,612,197.00	2.67
314	002368	太极股份	8,601,251.00	2.67
315	300990	同飞股份	8,531,132.00	2.65
316	000768	中航西飞	8,408,220.00	2.61
317	603868	飞科电器	8,389,343.00	2.60
318	000932	华菱钢铁	8,380,364.00	2.60
319	000951	中国重汽	8,372,153.00	2.60
320	002080	中材科技	8,278,939.83	2.57
321	600549	厦门钨业	8,207,157.58	2.55
322	003031	中瓷电子	8,167,774.80	2.54
323	002958	青农商行	8,110,300.00	2.52
324	002296	辉煌科技	8,092,697.00	2.51
325	600460	士兰微	7,895,236.00	2.45
326	000039	中集集团	7,891,637.50	2.45
327	688188	柏楚电子	7,876,481.93	2.44
328	601456	国联民生	7,870,248.00	2.44
329	600109	国金证券	7,800,243.00	2.42
330	300146	汤臣倍健	7,788,954.00	2.42
331	002138	顺络电子	7,760,566.00	2.41
332	300360	炬华科技	7,526,349.00	2.34
333	603858	步长制药	7,523,527.00	2.34
334	600271	航天信息	7,489,299.00	2.32
335	002206	海利得	7,473,440.00	2.32
336	002865	钧达股份	7,472,567.10	2.32
337	000959	首钢股份	7,456,247.00	2.31
338	000750	国海证券	7,443,764.00	2.31
339	600361	创新新材	7,440,464.00	2.31
340	688301	奕瑞科技	7,322,793.62	2.27
341	002906	华阳集团	7,182,814.00	2.23
342	003816	中国广核	7,169,691.00	2.23
343	002532	天山铝业	7,163,362.00	2.22
344	600038	中直股份	7,158,573.00	2.22
345	600458	时代新材	7,068,596.00	2.19
346	600739	辽宁成大	7,056,711.00	2.19
347	000009	中国宝安	6,997,200.00	2.17
348	688676	金盘科技	6,923,671.64	2.15
349	002250	联化科技	6,912,765.00	2.15
350	000598	兴蓉环境	6,865,967.00	2.13

351	605259	绿田机械	6,858,076.64	2.13
352	603680	今创集团	6,767,020.00	2.10
353	600066	宇通客车	6,727,259.00	2.09
354	000636	风华高科	6,682,213.00	2.07
355	002648	卫星化学	6,676,953.00	2.07
356	688578	艾力斯	6,615,036.56	2.05
357	603799	华友钴业	6,601,607.52	2.05
358	603916	苏博特	6,529,101.00	2.03
359	600329	达仁堂	6,524,197.00	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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688008	澜起科技	245,241,660.38	76.12
2	300750	宁德时代	221,952,993.60	68.89
3	601318	中国平安	122,845,623.26	38.13
4	688775	影石创新	120,442,229.54	37.38
5	688256	寒武纪	114,731,934.93	35.61
6	300124	汇川技术	107,117,403.00	33.25
7	600036	招商银行	106,844,440.00	33.16
8	002027	分众传媒	94,576,700.00	29.36
9	002311	海大集团	90,614,327.00	28.13
10	603986	兆易创新	75,625,916.00	23.47
11	002352	顺丰控股	70,482,579.24	21.88
12	603893	瑞芯微	55,464,939.16	17.22
13	688279	峰岬科技	55,399,172.08	17.20
14	300502	新易盛	53,849,219.15	16.71
15	300850	新强联	48,054,354.53	14.92
16	002595	豪迈科技	46,175,466.00	14.33
17	688183	生益电子	45,861,568.48	14.23
18	688629	华丰科技	44,601,839.35	13.84
19	002920	德赛西威	43,999,292.15	13.66
20	603508	思维列控	43,083,686.92	13.37
21	003022	联泓新科	42,195,355.05	13.10
22	002284	亚太股份	41,650,781.00	12.93
23	300373	扬杰科技	41,158,677.00	12.78
24	603236	移远通信	41,120,060.72	12.76
25	688766	普冉股份	39,984,318.25	12.41
26	603166	福达股份	39,716,504.00	12.33
27	002202	金风科技	39,714,619.66	12.33
28	603612	索通发展	39,632,604.00	12.30
29	300113	顺网科技	39,616,941.95	12.30

30	600030	中信证券	39,594,856.44	12.29
31	688018	乐鑫科技	39,553,212.37	12.28
32	603379	三美股份	39,441,348.11	12.24
33	603737	三棵树	38,478,458.72	11.94
34	301196	唯科科技	38,339,270.00	11.90
35	688313	仕佳光子	38,025,517.39	11.80
36	000408	藏格矿业	37,954,714.00	11.78
37	605020	永和股份	37,344,065.12	11.59
38	300100	双林股份	36,914,966.40	11.46
39	603380	易德龙	36,521,791.15	11.34
40	601021	春秋航空	36,287,162.00	11.26
41	601108	财通证券	36,242,189.90	11.25
42	600866	星湖科技	35,747,826.01	11.10
43	600633	浙数文化	35,087,858.80	10.89
44	688297	中无人机	35,047,665.77	10.88
45	002734	利民股份	34,596,855.61	10.74
46	603766	隆鑫通用	34,386,179.00	10.67
47	688591	泰凌微	34,118,008.13	10.59
48	600183	生益科技	33,220,343.57	10.31
49	688095	福昕软件	32,928,730.42	10.22
50	002028	思源电气	32,631,431.01	10.13
51	300777	中简科技	31,854,189.56	9.89
52	688258	卓易信息	31,791,344.48	9.87
53	603129	春风动力	31,248,991.00	9.70
54	605319	无锡振华	30,871,621.89	9.58
55	002050	三花智控	30,820,772.00	9.57
56	002487	大金重工	30,081,387.00	9.34
57	000680	山推股份	29,936,892.85	9.29
58	300228	富瑞特装	29,717,755.00	9.22
59	002683	广东宏大	29,413,393.00	9.13
60	002624	完美世界	28,948,776.00	8.99
61	603173	福斯达	28,274,706.83	8.78
62	002442	龙星科技	28,055,915.70	8.71
63	600114	东睦股份	28,014,346.89	8.70
64	600826	兰生股份	27,812,920.40	8.63
65	300984	金沃股份	27,635,554.80	8.58
66	600499	科达制造	27,586,244.00	8.56
67	300953	震裕科技	27,382,403.78	8.50
68	301308	江波龙	27,356,747.35	8.49
69	603809	豪能股份	27,279,128.43	8.47
70	002983	芯瑞达	27,189,255.19	8.44
71	002266	浙富控股	27,046,753.80	8.39
72	605305	中际联合	26,768,118.63	8.31

73	688213	思特威	26,228,047.15	8.14
74	688208	道通科技	25,437,187.60	7.90
75	688392	骄成超声	25,287,806.13	7.85
76	603486	科沃斯	25,097,799.78	7.79
77	002353	杰瑞股份	25,026,374.00	7.77
78	300926	博俊科技	24,936,851.60	7.74
79	603699	纽威股份	24,626,328.00	7.64
80	301345	涛涛车业	24,393,536.00	7.57
81	688372	伟测科技	24,051,934.61	7.47
82	600096	云天化	24,009,174.90	7.45
83	301165	锐捷网络	23,825,073.78	7.40
84	603444	吉比特	23,735,990.00	7.37
85	688778	厦钨新能	23,590,524.57	7.32
86	002245	蔚蓝锂芯	23,398,647.00	7.26
87	300454	深信服	23,320,957.00	7.24
88	000553	安道麦 A	23,035,042.37	7.15
89	300476	胜宏科技	22,628,399.00	7.02
90	603296	华勤技术	22,616,693.80	7.02
91	605589	圣泉集团	22,514,481.59	6.99
92	301377	鼎泰高科	22,136,469.00	6.87
93	300803	指南针	21,825,374.20	6.77
94	601138	工业富联	21,223,176.00	6.59
95	688498	源杰科技	21,192,168.30	6.58
96	300674	宇信科技	21,122,844.40	6.56
97	688668	鼎通科技	20,842,342.89	6.47
98	300681	英搏尔	20,838,935.04	6.47
99	688123	聚辰股份	20,465,370.49	6.35
100	001339	智微智能	20,134,519.93	6.25
101	688049	炬芯科技	19,855,906.63	6.16
102	301029	怡合达	19,844,256.76	6.16
103	603009	北特科技	19,825,005.94	6.15
104	300627	华测导航	19,812,136.20	6.15
105	001301	尚太科技	19,753,824.00	6.13
106	301338	凯格精机	19,689,647.37	6.11
107	600885	宏发股份	19,673,704.00	6.11
108	300450	先导智能	19,584,597.00	6.08
109	603187	海容冷链	19,551,797.20	6.07
110	688608	恒玄科技	19,393,597.51	6.02
111	300274	阳光电源	19,319,374.20	6.00
112	600435	北方导航	19,286,569.00	5.99
113	601717	中创智领	19,145,381.00	5.94
114	605016	百龙创园	19,056,658.30	5.91
115	300763	锦浪科技	19,051,405.24	5.91

116	002049	紫光国微	19,000,068.00	5.90
117	600150	中国船舶	18,930,030.00	5.88
118	300035	中科电气	18,793,189.00	5.83
119	688772	珠海冠宇	18,536,245.88	5.75
120	000719	中原传媒	18,533,091.00	5.75
121	688267	中触媒	18,497,131.69	5.74
122	605168	三人行	18,493,787.75	5.74
123	688017	绿的谐波	18,215,009.08	5.65
124	600389	江山股份	18,193,661.50	5.65
125	002545	东方铁塔	18,069,187.00	5.61
126	688065	凯赛生物	17,955,083.43	5.57
127	002597	金禾实业	17,948,496.99	5.57
128	600482	中国动力	17,872,958.00	5.55
129	688295	中复神鹰	17,741,042.88	5.51
130	300002	神州泰岳	17,302,365.00	5.37
131	688147	微导纳米	17,270,463.31	5.36
132	002396	星网锐捷	17,169,157.00	5.33
133	002281	光迅科技	16,827,429.00	5.22
134	600031	三一重工	16,683,944.00	5.18
135	300073	当升科技	16,613,432.00	5.16
136	002246	北化股份	16,554,770.00	5.14
137	300443	金雷股份	16,527,056.00	5.13
138	601311	骆驼股份	16,486,766.00	5.12
139	300652	雷迪克	16,431,875.10	5.10
140	600660	福耀玻璃	16,390,697.00	5.09
141	688798	艾为电子	16,297,405.93	5.06
142	300432	富临精工	16,294,930.50	5.06
143	301031	中熔电气	16,163,990.64	5.02
144	688045	必易微	15,965,716.53	4.96
145	001380	华纬科技	15,947,546.51	4.95
146	002850	科达利	15,943,630.00	4.95
147	601288	农业银行	15,901,112.00	4.94
148	300389	艾比森	15,795,101.00	4.90
149	301035	润丰股份	15,783,004.00	4.90
150	688048	长光华芯	15,666,033.59	4.86
151	300346	南大光电	15,553,730.00	4.83
152	603678	火炬电子	15,551,312.74	4.83
153	000422	湖北宜化	15,470,925.00	4.80
154	600989	宝丰能源	15,384,410.00	4.78
155	688630	芯碁微装	15,383,551.36	4.77
156	000988	华工科技	15,116,794.66	4.69
157	300408	三环集团	15,109,892.00	4.69
158	300458	全志科技	15,092,296.00	4.68

159	002938	鹏鼎控股	15,036,813.00	4.67
160	000893	亚钾国际	15,022,360.00	4.66
161	688550	瑞联新材	14,996,525.26	4.65
162	688686	奥普特	14,907,369.63	4.63
163	002643	万润股份	14,873,019.12	4.62
164	603163	圣晖集成	14,858,419.25	4.61
165	300861	美畅股份	14,850,700.95	4.61
166	600299	安迪苏	14,803,472.00	4.59
167	603529	爱玛科技	14,794,524.00	4.59
168	688326	经纬恒润	14,745,037.00	4.58
169	600487	亨通光电	14,728,687.00	4.57
170	300496	中科创达	14,538,345.00	4.51
171	000709	河钢股份	14,436,848.00	4.48
172	002414	高德红外	14,362,948.00	4.46
173	300033	同花顺	14,356,011.00	4.46
174	603179	新泉股份	14,338,941.00	4.45
175	688006	杭可科技	14,331,762.37	4.45
176	300001	特锐德	14,108,707.00	4.38
177	688005	容百科技	14,088,521.62	4.37
178	688286	敏芯股份	14,075,950.67	4.37
179	688270	臻镭科技	14,013,915.72	4.35
180	605167	利柏特	13,984,370.00	4.34
181	603859	能科科技	13,931,217.00	4.32
182	300679	电连技术	13,679,598.00	4.25
183	688800	瑞可达	13,653,813.67	4.24
184	600104	上汽集团	13,459,738.00	4.18
185	000987	越秀资本	13,317,733.00	4.13
186	603565	中谷物流	13,223,535.00	4.10
187	002768	国恩股份	13,210,190.00	4.10
188	300573	兴齐眼药	13,170,731.62	4.09
189	002837	英维克	13,083,736.00	4.06
190	600959	江苏有线	13,071,187.00	4.06
191	000725	京东方 A	12,991,420.00	4.03
192	002518	科士达	12,964,182.00	4.02
193	300570	太辰光	12,876,581.00	4.00
194	002444	巨星科技	12,824,664.00	3.98
195	600938	中国海油	12,814,220.00	3.98
196	000060	中金岭南	12,753,247.00	3.96
197	003816	中国广核	12,503,248.00	3.88
198	002384	东山精密	12,470,657.00	3.87
199	002600	领益智造	12,352,004.00	3.83
200	002539	云图控股	12,220,661.00	3.79
201	001696	宗申动力	12,210,888.00	3.79

202	301095	广立微	12,127,204.00	3.76
203	601179	中国西电	12,122,583.00	3.76
204	600312	平高电气	12,095,188.13	3.75
205	603086	先达股份	12,037,404.00	3.74
206	000811	冰轮环境	12,020,137.00	3.73
207	002916	深南电路	12,004,858.00	3.73
208	600517	国网英大	11,956,373.60	3.71
209	600998	九州通	11,849,452.88	3.68
210	600909	华安证券	11,827,736.00	3.67
211	600872	中炬高新	11,777,065.00	3.66
212	603786	科博达	11,773,791.00	3.65
213	688127	蓝特光学	11,730,996.06	3.64
214	601019	山东出版	11,470,975.00	3.56
215	603979	金诚信	11,379,363.00	3.53
216	000825	太钢不锈	11,332,322.00	3.52
217	002011	盾安环境	11,265,133.00	3.50
218	603867	新化股份	11,168,965.00	3.47
219	600817	宇通重工	11,107,769.80	3.45
220	600699	均胜电子	11,072,665.00	3.44
221	605499	东鹏饮料	10,960,036.40	3.40
222	301162	国能日新	10,956,059.56	3.40
223	300604	长川科技	10,868,796.24	3.37
224	300768	迪普科技	10,818,487.00	3.36
225	688002	睿创微纳	10,521,928.40	3.27
226	688469	芯联集成	10,483,980.74	3.25
227	300708	聚灿光电	10,482,525.00	3.25
228	002594	比亚迪	10,443,555.00	3.24
229	301529	福赛科技	10,164,506.00	3.15
230	300666	江丰电子	10,161,386.00	3.15
231	000768	中航西飞	10,055,908.00	3.12
232	600063	皖维高新	10,007,448.00	3.11
233	603077	和邦生物	9,984,039.00	3.10
234	688582	芯动联科	9,957,761.64	3.09
235	002500	山西证券	9,918,039.40	3.08
236	000783	长江证券	9,866,326.00	3.06
237	688220	翱捷科技	9,861,725.58	3.06
238	600741	华域汽车	9,808,440.00	3.04
239	688187	时代电气	9,758,115.33	3.03
240	300990	同飞股份	9,746,412.00	3.03
241	002236	大华股份	9,715,704.00	3.02
242	000543	皖能电力	9,669,098.00	3.00
243	601211	国泰海通	9,630,365.46	2.99
244	300003	乐普医疗	9,576,332.00	2.97

245	300438	鹏辉能源	9,547,410.00	2.96
246	605060	联德股份	9,510,481.00	2.95
247	603466	风语筑	9,462,490.00	2.94
248	002997	瑞鹄模具	9,418,236.00	2.92
249	603816	顾家家居	9,332,928.10	2.90
250	000623	吉林敖东	9,306,893.00	2.89
251	000050	深天马 A	9,253,686.00	2.87
252	600873	梅花生物	9,253,031.00	2.87
253	603233	大参林	9,247,051.00	2.87
254	002299	圣农发展	9,198,088.76	2.85
255	688676	金盘科技	9,166,188.07	2.85
256	300140	节能环保	9,121,863.98	2.83
257	002701	奥瑞金	9,034,447.00	2.80
258	601728	中国电信	9,034,334.00	2.80
259	688088	虹软科技	9,005,047.34	2.80
260	600704	物产中大	8,976,630.00	2.79
261	603259	药明康德	8,959,632.00	2.78
262	600582	天地科技	8,958,868.00	2.78
263	603185	弘元绿能	8,956,025.00	2.78
264	601900	南方传媒	8,893,925.56	2.76
265	688100	威胜信息	8,837,208.78	2.74
266	603659	璞泰来	8,770,886.15	2.72
267	600578	京能电力	8,770,377.00	2.72
268	000726	鲁泰 A	8,669,851.00	2.69
269	002203	海亮股份	8,600,013.00	2.67
270	601568	北元集团	8,588,569.00	2.67
271	000932	华菱钢铁	8,546,596.00	2.65
272	002546	新联电子	8,535,343.00	2.65
273	300972	万辰集团	8,523,106.00	2.65
274	603868	飞科电器	8,356,634.00	2.59
275	301200	大族数控	8,325,741.00	2.58
276	000039	中集集团	8,295,768.00	2.57
277	601658	邮储银行	8,247,321.00	2.56
278	600460	士兰微	8,148,032.00	2.53
279	688027	国盾量子	8,147,482.56	2.53
280	000959	首钢股份	8,095,360.00	2.51
281	002368	太极股份	8,082,592.00	2.51
282	002138	顺络电子	8,078,731.00	2.51
283	002206	海利得	7,919,829.50	2.46
284	002296	辉煌科技	7,917,290.00	2.46
285	605259	绿田机械	7,910,478.96	2.46
286	002080	中材科技	7,905,683.38	2.45
287	600166	福田汽车	7,830,971.00	2.43

288	688188	柏楚电子	7,826,689.42	2.43
289	600109	国金证券	7,800,284.00	2.42
290	002865	钧达股份	7,784,988.39	2.42
291	300433	蓝思科技	7,778,546.00	2.41
292	003031	中瓷电子	7,762,098.00	2.41
293	603858	步长制药	7,688,803.59	2.39
294	601456	国联民生	7,672,887.52	2.38
295	688536	思瑞浦	7,662,731.18	2.38
296	000951	中国重汽	7,605,944.00	2.36
297	600064	南京高科	7,484,552.00	2.32
298	002958	青农商行	7,452,686.00	2.31
299	601333	广深铁路	7,434,714.00	2.31
300	000792	盐湖股份	7,428,494.00	2.31
301	002532	天山铝业	7,362,989.00	2.29
302	600458	时代新材	7,352,468.00	2.28
303	000009	中国宝安	7,338,241.00	2.28
304	300360	炬华科技	7,329,149.00	2.27
305	002906	华阳集团	7,317,514.00	2.27
306	600392	盛和资源	7,303,488.00	2.27
307	600271	航天信息	7,132,276.00	2.21
308	300596	利安隆	7,122,802.50	2.21
309	688099	晶晨股份	6,989,045.13	2.17
310	000636	风华高科	6,955,963.00	2.16
311	002648	卫星化学	6,921,124.00	2.15
312	688172	燕东微	6,915,199.86	2.15
313	002250	联化科技	6,894,396.00	2.14
314	603916	苏博特	6,891,595.00	2.14
315	603799	华友钴业	6,848,253.00	2.13
316	688301	奕瑞科技	6,796,877.89	2.11
317	600066	宇通客车	6,752,571.00	2.10
318	603680	今创集团	6,730,263.90	2.09
319	300684	中石科技	6,718,788.00	2.09
320	600867	通化东宝	6,718,509.00	2.09
321	300567	精测电子	6,615,548.00	2.05
322	600038	中直股份	6,552,941.00	2.03
323	688308	欧科亿	6,542,694.66	2.03
324	300415	伊之密	6,525,965.00	2.03
325	301080	百普赛斯	6,504,480.20	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,604,871,625.05
---------------	-------------------

卖出股票的收入（成交）总额	8,902,173,081.36
---------------	------------------

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	66,362,500.61	2.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	66,362,500.61	2.50

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019792	25 国债 19	243,000	24,378,951.70	0.92
2	019785	25 国债 13	168,000	16,901,306.30	0.64
3	019773	25 国债 08	148,000	14,949,427.29	0.56
4	102317	国债 2519	101,000	10,132,815.32	0.38

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参

与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,554,210.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,554,210.81

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	301656	联合动力	188,276.70	0.01	首次公开发行限售

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
博时智选量 化多因子股 票 A	19,101	35,058.60	283,252,139.35	42.30%	386,402,218.90	57.70%
博时智选量 化多因子股 票 C	62,468	25,053.78	886,989,097.95	56.67%	678,070,185.06	43.33%
合计	80,435	27,782.85	1,170,241,237.30	52.37%	1,064,472,403.96	47.63%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时智选量化多 因子股票 A	4,265,057.76	0.64%
	博时智选量化多 因子股票 C	229,469.67	0.01%
	合计	4,494,527.43	0.20%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人 员、基金投资和研 究部门负责人持有本 开放式基金	博时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	-
	合计	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

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

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	56,559,750.21	243,565,548.13
本报告期基金总申购份额	836,517,012.89	2,656,661,300.29
减: 本报告期基金总赎回份额	223,422,404.85	1,335,167,565.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	669,654,358.25	1,565,059,283.01

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2025 年 10 月 16 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生任公司董事长（法定代表人）、代任公司总经理，离任公司总经理。江向阳先生离任公司董事长。

基金管理人于 2025 年 11 月 12 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》，陈宇先生任公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请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。报告期内本基金应付审计费为 70000 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	博时基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 31 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正、暂停部分业务
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 28 日；2025 年 10 月 28 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局；中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控；合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》；《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收；公司已采取完善制度、优化流程、强化监督等措施，全面完成整改工作，已通过整改验收
其他	-； -

11.6.3 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。

11.6.4 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	19,500,866,974.23	100.00%	8,696,292.92	100.00%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	82,220,416.48	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于暂停使用富友支付提供的快捷支付通道办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-31
2	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	2025-12-18
3	博时基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-12-06
4	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	2025-12-04

		金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
5	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	2025-12-04
6	关于调整博时智选量化多因子股票型证券投资基金的申购、赎回、定投、转换起点及最低持有数量限制的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-11-26
7	博时智选量化多因子股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-11-26
8	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	2025-11-13
9	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-11-12
10	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	2025-11-07
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	2025-11-07
12	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 年第 3 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	2025-10-28
13	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	2025-10-17
14	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	2025-10-16
15	博时智选量化多因子股票型证券投资基金暂停大额申购、	上海证券报、基	2025-10-15

	转换转入、定期定额投资业务的公告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
16	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	2025-10-15
17	博时智选量化多因子股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2025-09-30
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	2025-09-06
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	2025-09-06
20	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	2025-09-04
21	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 年中期报 告	上海证券报、基 金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2025-08-29
22	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	2025-08-07
23	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	2025-08-06
24	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	2025-08-06
25	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 年第 2 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	2025-07-21
26	博时基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期	上海证券报、基	2025-06-26

	内承销证券的公告	金管理人网站、证监会基金电子披露网站	
27	博时智选量化多因子股票型证券投资基金（博时智选量化多因子股票 A）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-26
28	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	2025-06-26
29	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-06
30	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20250603	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-06-03
31	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2025 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	2025-04-22
32	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	2025-04-10
33	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	2025-04-10
34	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
35	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	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-04-08
36	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）	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2025-03-31
37	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 年年度报告	上海证券报、基	2025-03-31

	告	金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	
38	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	上海证券报、基金管理人网站、 证监会基金电 子披露网站	2025-03-25
39	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	2025-03-07
40	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	2025-03-07
41	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	2025-02-22
42	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	2025-02-22
43	博时智选量化多因子股票型证券投资基金 2024 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	2025-01-22

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日