

博时量化价值股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58

7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 盈利投资者数量占比	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	61
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化价值股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化价值股票	
基金主代码	005960	
交易代码	005960	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 26 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	78,319,476.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
下属分级基金的交易代码	005960	005961
报告期末下属分级基金的份额总额	24,366,155.62 份	53,953,321.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用量化方法，主要从市场相对估值、历史相对估值和重要股东增持价格三个方向衡量上市公司的估值高低，设计相应的量化策略选出具有估值优势的股票进行投资，力求获取超额收益。
投资策略	本基金投资策略主要由 A 股投资策略、港股投资策略和其他投资策略三部分组成。A 股投资策略：本基金运用量化方法进行价值型投资，本基金管理人以自主研发的量化多策略体系为基础，对其中的价值型策略进行集中配置，在控制其他风格暴露的情况下突出组合的价值风格，获取长期超越市场的回报。港股投资策略：本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。其他投资策略主要包括：存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券的投资策略、权证投

	资策略、股指期货投资策略和国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富(总值)指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于中高风险/收益的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曼	任航
	联系电话	0755-83169999	010-66060069
	电子邮箱	service@bosera.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105568	95599
传真		0755-83195140	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518040	100031
法定代表人		张东	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bosera.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
本期已实现收益	3,259,549.49	4,136,805.03
本期利润	5,614,078.98	8,226,556.77
加权平均基金份额本期利润	0.2476	0.2548
本期加权平均净值利润率	13.97%	14.89%
本期基金份额净值增长率	17.16%	16.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期末可供分配利润	21,775,692.99	43,722,932.67
期末可供分配基金份额利润	0.8937	0.8104
期末基金资产净值	46,141,848.61	97,676,253.69
期末基金份额净值	1.8937	1.8104
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金份额累计净值增长率	129.68%	115.38%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博时量化价值股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	13.08%	1.32%	6.30%	1.05%	6.78%	0.27%
过去六个月	17.16%	1.29%	2.07%	0.98%	15.09%	0.31%
过去一年	48.07%	1.17%	16.20%	0.89%	31.87%	0.28%
过去三年	65.88%	1.16%	25.96%	0.98%	39.92%	0.18%
过去五年	52.47%	1.09%	-3.95%	1.02%	56.42%	0.07%
过去七年	124.84%	1.11%	24.18%	1.04%	100.66%	0.07%
自基金合同生效起至今	129.68%	1.15%	32.13%	1.07%	97.55%	0.08%

博时量化价值股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.85%	1.32%	6.30%	1.05%	6.55%	0.27%
过去六个月	16.71%	1.29%	2.07%	0.98%	14.64%	0.31%
过去一年	46.88%	1.17%	16.20%	0.89%	30.68%	0.28%
过去三年	61.95%	1.16%	25.96%	0.98%	35.99%	0.18%
过去五年	46.50%	1.09%	-3.95%	1.02%	50.45%	0.07%
过去七年	112.58%	1.11%	24.18%	1.04%	88.40%	0.07%
自基金合同生效起至今	115.38%	1.15%	32.13%	1.07%	83.25%	0.08%

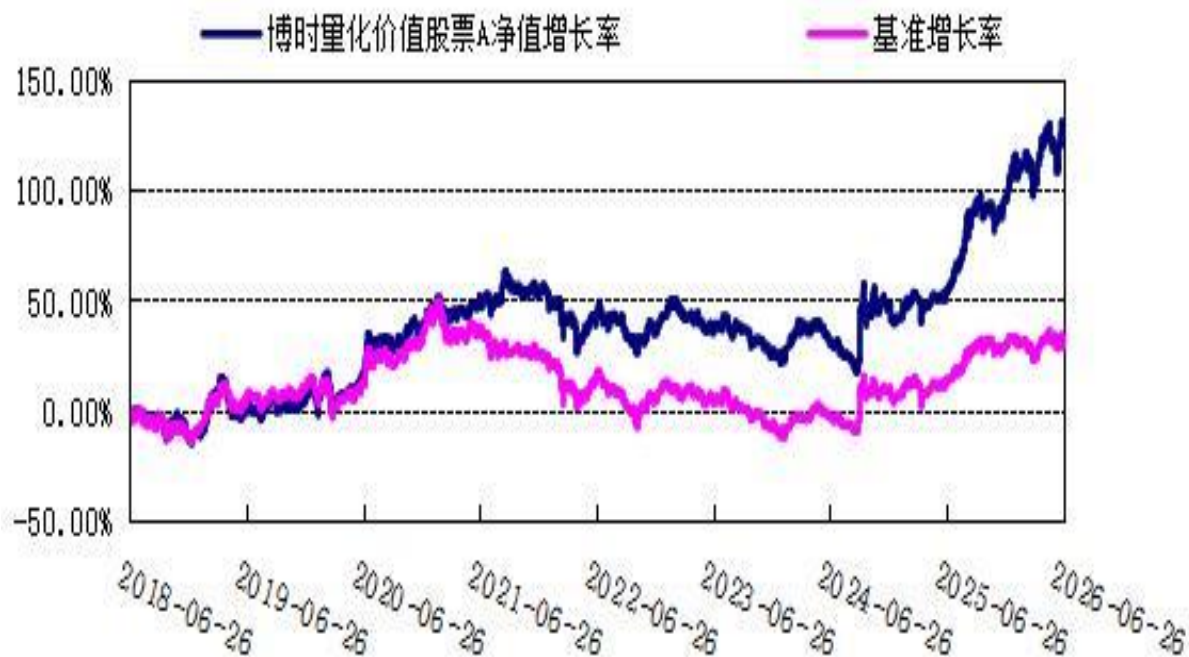
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博时量化价值股票型证券投资基金

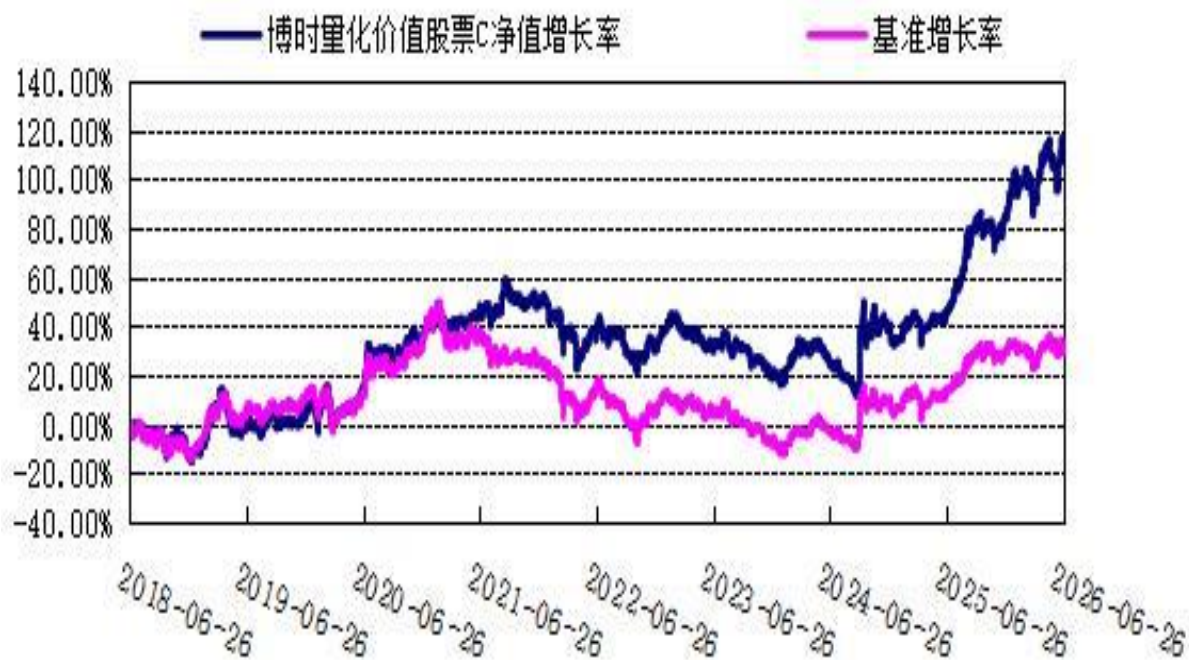
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 6 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日)

博时量化价值股票 A



博时量化价值股票 C



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是公司的使命。公司的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2026 年 6 月 30 日，博时基金管理有限公司共管理 404 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 17,353 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金管理有限公司公募资产管理总规模逾 6,993 亿元人民币，累计分红逾 2,312 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨振建	基金经理	2025-11-03	-	12.8	杨振建先生，博士。2013 年至 2015 年在中证指数有限公司工作（期间借调中国证监会任产品审核员）。2015 年加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理助理、博时中证银联智惠大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日-2021 年 7 月 16 日)、博时中证 A500 指数型证券投资基金(2024 年 10 月 30 日-2024 年 11 月 28 日)、博时中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(2025 年 5 月 14 日-2026 年 5 月 21 日)的基金经理。现任博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2018 年 12 月 3 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019 年 11 月

				13 日—至今)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2020 年 12 月 23 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 3 月 3 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 7 月 27 日—至今)、博时中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(2023 年 11 月 2 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 4 月 16 日—至今)、博时中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 7 月 19 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金(2024 年 11 月 21 日—至今)、博时中证国新央企现代能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2024 年 11 月 27 日—至今)、博时中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 11 月 29 日—至今)、博时中证 800 指数增强型证券投资基金(2025 年 9 月 2 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2025 年 11 月 3 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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 18 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，2026 年上半年 A 股市场呈现“震荡上行、结构分化”的态势，主要指数稳步收涨，市场活力显著增强，行情主线清晰，科技成长板块领涨，人工智能、算力半导体等新质生产力领域表现强劲，市场“含科量”显著提升，上证指数上半年收于 4094 点。海外在地缘局势逐步缓和之后，全球多数权益资产在年初波动后逐步回稳。本基金采用量化多因子、基本面量化等策略对组合进行管理，策略配置均衡，在对于主动权益市场风格的紧密跟踪基础上，力图长期相对稳健地跑赢组合业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.8937 元，份额累计净值为 2.1496 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.8104 元，份额累计净值为 2.0341 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 17.16%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 16.71%，同期业绩基准增长率为 2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年在更加积极有为的宏观政策支持下，中国经济运行总体平稳，出口保持了韧性。宏观政策明确实施“更加积极的财政政策”和“适度宽松的货币政策”，为经济回升向好提供了有力支撑。财政政策保持适度支出强度、持续发行超长期特别国债并支持“两重”“两新”建设，货币政策保持流动性合理充裕，推动社会综合融资成本稳中有降。在此背景下，市场流动性整体充裕，科技成长板块表现相对突出，资源品、红利等板块整体表现相对偏弱。展望下半年，从盈利预期角度看，A 股市场预计将在盈利驱动与政策支持下，市场驱动力将从估值扩张转向企业盈利改善预期。宏观基本面预计

在“十五五”开局之年的产业政策与流动性宽松环境中逐步企稳。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。为确保基金估值工作符合以上规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、法律合规部负责人、风险管理部负责人、投资部门负责人、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具备良好专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价，保证基金估值的公平、合理。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当对估值原则及技术存有异议时，本基金托管人有责任要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议

的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.6.1	8,578,523.08	3,201,159.47
结算备付金		1,167,084.71	493,621.99
存出保证金		466,026.82	106,541.37
交易性金融资产	6.4.6.2	134,120,151.10	46,625,431.34
其中：股票投资		128,156,246.28	46,625,431.34
基金投资		-	-
债券投资		5,963,904.82	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	182,017.45
应收股利		-	-
应收申购款		396,850.18	190,118.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.5	-	-
资产总计		144,728,635.89	50,798,890.07
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		12,785.69	131,754.34
应付赎回款		459,782.85	369,418.08
应付管理人报酬		95,369.20	36,886.92
应付托管费		21,193.17	8,197.06
应付销售服务费		55,800.65	11,521.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,165.45	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.6.6	264,436.58	335,177.99
负债合计		910,533.59	892,956.02
净资产：			
实收基金	6.4.6.7	78,319,476.64	31,352,626.74
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.6.8	65,498,625.66	18,553,307.31
净资产合计		143,818,102.30	49,905,934.05
负债和净资产总计		144,728,635.89	50,798,890.07

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 78,319,476.64 份。其中 A 类基金份额净值 1.8937 元，基金份额总额 24,366,155.62 份；C 类基金份额净值 1.8104 元，基金份额总额 53,953,321.02 份。

6.2 利润表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,618,658.71	4,623,954.63
1.利息收入		14,842.50	17,873.06
其中：存款利息收入	6.4.6.9	14,842.50	17,873.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,060,502.19	3,337,828.83
其中：股票投资收益	6.4.6.10	6,993,992.97	2,419,611.08
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.6.11	6,457.57	2,757.27
资产支持证券投资收益	6.4.6.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	29,875.76	-
股利收益	6.4.6.14	1,030,175.89	915,460.48
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.15	6,444,281.23	1,253,961.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	99,032.79	14,290.82
减：二、营业总支出		778,022.96	605,224.96
1. 管理人报酬		422,989.43	319,040.04
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		93,997.73	70,897.81
3. 销售服务费		216,814.07	150,086.00
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,267.36	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,267.36	-
6. 信用减值损失	6.4.6.17	-	-
7. 税金及附加		124.87	-
8. 其他费用	6.4.6.18	42,829.50	65,201.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,840,635.75	4,018,729.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,840,635.75	4,018,729.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,840,635.75	4,018,729.67

6.3 净资产变动表

会计主体：博时量化价值股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	31,352,626.74	-	18,553,307.31	49,905,934.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	31,352,626.74	-	18,553,307.31	49,905,934.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	46,966,849.90	-	46,945,318.35	93,912,168.25
（一）、综合收益总额	-	-	13,840,635.75	13,840,635.75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	46,966,849.90	-	33,104,682.60	80,071,532.50
其中：1.基金申购款	79,248,398.65	-	56,928,198.32	136,176,596.97
2.基金赎回款	-32,281,548.75	-	-23,823,515.72	-56,105,064.47
（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	78,319,476.64	-	65,498,625.66	143,818,102.30

项目	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	71,471,164.07	-	16,681,624.33	88,152,788.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,471,164.07	-	16,681,624.33	88,152,788.40
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-6,829,867.84	-	2,322,011.11	-4,507,856.73
（一）、综合收益总额	-	-	4,018,729.67	4,018,729.67
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-6,829,867.84	-	-1,696,718.56	-8,526,586.40
其中：1.基金申购款	32,391,427.82	-	8,466,728.07	40,858,155.89
2.基金赎回款	-39,221,295.66	-	-10,163,446.63	-49,384,742.29

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	64,641,296.23	-	19,003,635.44	83,644,931.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张东，主管会计工作负责人：吴慧峰，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博时量化价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]344 号《关于准予博时量化价值股票型证券投资基金注册的批复》的注册，由博时基金管理有限公司于 2018 年 6 月 1 日至 2018 年 6 月 22 日向社会公开募集。基金合同于 2018 年 6 月 26 日生效，首次设立募集规模为 341,191,900.59 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为博时基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产

支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的 80%—95%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+恒生综合指数收益率*20%+中债综合财富(总值)指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

（1）印花税

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

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，

自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2） 增值税

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

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

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

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

（3） 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

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

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

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

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	8,578,523.08
等于：本金	8,577,710.96
加：应计利息	812.12
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,578,523.08

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		121,043,560.26	-	128,156,246.28	7,112,686.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,906,579.00	57,774.82	5,963,904.82	-449.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,906,579.00	57,774.82	5,963,904.82	-449.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	126,950,139.26	57,774.82	134,120,151.10	7,112,237.02
----	----------------	-----------	----------------	--------------

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

6.4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	3,479,040.00	-	-	-
---股指期货	3,479,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,479,040.00	-	-	-

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。

6.4.6.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	2.00	3,504,560.00	25,520.00
合计	-	-	-	25,520.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	25,520.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.6.5 其他资产

无余额。

6.4.6.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	73.85
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	205,852.05
其中：交易所市场	205,852.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	58,510.68
合计	264,436.58

6.4.6.7 实收基金

博时量化价值股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	19,540,966.86	19,540,966.86
本期申购	19,249,013.08	19,249,013.08
本期赎回（以“-”号填列）	-14,423,824.32	-14,423,824.32
本期末	24,366,155.62	24,366,155.62

博时量化价值股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	11,811,659.88	11,811,659.88
本期申购	59,999,385.57	59,999,385.57
本期赎回（以“-”号填列）	-17,857,724.43	-17,857,724.43
本期末	53,953,321.02	53,953,321.02

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

6.4.6.8 未分配利润

博时量化价值股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,238,986.35	-9,196,767.01	12,042,219.34
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	21,238,986.35	-9,196,767.01	12,042,219.34
本期利润	3,259,549.49	2,354,529.49	5,614,078.98
本期基金份额交易产生的变动数	5,780,647.64	-1,661,252.97	4,119,394.67
其中：基金申购款	22,650,346.87	-7,431,288.37	15,219,058.50
基金赎回款	-16,869,699.23	5,770,035.40	-11,099,663.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,279,183.48	-8,503,490.49	21,775,692.99

博时量化价值股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	11,942,565.64	-5,431,477.67	6,511,087.97
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	11,942,565.64	-5,431,477.67	6,511,087.97
本期利润	4,136,805.03	4,089,751.74	8,226,556.77
本期基金份额交易产生的变动数	46,164,517.89	-17,179,229.96	28,985,287.93
其中：基金申购款	65,839,881.79	-24,130,741.97	41,709,139.82
基金赎回款	-19,675,363.90	6,951,512.01	-12,723,851.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,243,888.56	-18,520,955.89	43,722,932.67

6.4.6.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,208.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,506.80
其他	127.00
合计	14,842.50

6.4.6.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	287,626,815.59
减：卖出股票成本总额	280,146,977.38

减：交易费用	485,845.24
买卖股票差价收入	6,993,992.97

6.4.6.11 债券投资收益

6.4.6.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,059.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-602.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	6,457.57

6.4.6.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,233,770.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,200,602.00
减：应计利息总额	33,770.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-602.00

6.4.6.12 资产支持证券投资收益

6.4.6.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.6.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.6.13 衍生工具收益

6.4.6.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.6.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	29,875.76

6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,030,175.89
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,030,175.89

6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	6,418,761.23
——股票投资	6,419,210.23
——债券投资	-449.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2.衍生工具	25,520.00
——权证投资	-
——股指期货	25,520.00
4.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	6,444,281.23

6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	92,923.93
基金转换费收入	6,108.86
合计	99,032.79

6.4.6.17 信用减值损失

无发生额。

6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	4,215.49
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
其他	7.64
银行汇划费	4,811.18
中债登账户维护费	9,000.00
合计	42,829.50

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	422,989.43	319,040.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	170,867.66	62,058.48
应支付基金管理人的净管理费	252,121.77	256,981.56

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.90% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.90% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	93,997.73	70,897.81

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
中国农业银行	-	29,391.48	29,391.48
招商证券	-	139.73	139.73
博时基金	-	14,280.70	14,280.70
博时财富	-	15,316.25	15,316.25
合计	-	59,128.16	59,128.16
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	合计
中国农业银行	-	7,303.76	7,303.76
博时基金	-	119,045.29	119,045.29
合计	-	126,349.05	126,349.05

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.80% 的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.9.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
期初持有的基金份额	4,714,693.17	-	4,714,693.17	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	4,714,693.17	-	-	-

期末持有的基金份额	-	-	4,714,693.17	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	7.29%	-

注：1.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）。

2.基金管理人博时基金投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

6.4.9.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	8,578,523.08	13,208.70	6,317,571.42	14,798.01

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

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券股份有限公司	920186	中科仪	北交所网下新股中签	600.00	9,726.00
上年度可比期间					
2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

6.4.9.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10 利润分配情况

无。

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

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-10	18 个交易日	新债未上市	100.00	100.01	10.00	1,000.00	1,000.05	-
118072	鼎通转债	2026-06-24	17 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	10.00	1,000.00	1,000.03	-

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	200.00	119,595.00	166,400.00	-

注：本基金截至 2026 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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

6.4.12.2 信用风险

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

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

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

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,961,904.74	-
合计	5,961,904.74	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,000.08	-
未评级	-	-
合计	2,000.08	-

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

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.12.3 流动性风险

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

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的

合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久

期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,578,523.08	-	-	-	8,578,523.08
结算备付金	1,167,084.71	-	-	-	1,167,084.71
存出保证金	41,975.06	-	-	424,051.76	466,026.82
交易性金融资产	5,961,904.74	-	2,000.08	128,156,246.28	134,120,151.10
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	396,850.18	396,850.18
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,749,487.59	-	2,000.08	128,977,148.22	144,728,635.89
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	459,782.85	459,782.85
应付清算款	-	-	-	12,785.69	12,785.69
应付管理人报酬	-	-	-	95,369.20	95,369.20
应付托管费	-	-	-	21,193.17	21,193.17
应付销售服务费	-	-	-	55,800.65	55,800.65
应交税费	-	-	-	1,165.45	1,165.45
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	264,436.58	264,436.58
负债总计	-	-	-	910,533.59	910,533.59
利率敏感度缺口	15,749,487.59	-	2,000.08	128,066,614.63	143,818,102.30
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,201,159.47	-	-	-	3,201,159.47
结算备付金	493,621.99	-	-	-	493,621.99
存出保证金	106,541.37	-	-	-	106,541.37
交易性金融资产	-	-	-	46,625,431.34	46,625,431.34
应收清算款	-	-	-	182,017.45	182,017.45
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	190,118.45	190,118.45

应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,801,322.83	-	-	46,997,567.24	50,798,890.07
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	369,418.08	369,418.08
应付清算款	-	-	-	131,754.34	131,754.34
应付管理人报酬	-	-	-	36,886.92	36,886.92
应付托管费	-	-	-	8,197.06	8,197.06
应付销售服务费	-	-	-	11,521.63	11,521.63
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	335,177.99	335,177.99
负债总计	-	-	-	892,956.02	892,956.02
利率敏感度缺口	3,801,322.83	-	-	46,104,611.22	49,905,934.05

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

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 0	-
	市场利率下降 25 个基点	增加约 0	-

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

2.以上金额为四舍五入的结果。

6.4.12.4.2 外汇风险

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

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	128,156,246.28	89.11	46,625,431.34	93.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,000.08	0.00	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	128,158,246.36	89.11	46,625,431.34	93.43

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 777	增加约 261
	业绩比较基准下降 5%	减少约 777	减少约 261

6.4.13 公允价值

6.4.13.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年6月30日
第一层次	127,989,846.28
第二层次	6,130,304.82
第三层次	-
合计	134,120,151.10

6.4.13.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.13.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.13.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	128,156,246.28	88.55
	其中：股票	128,156,246.28	88.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,963,904.82	4.12
	其中：债券	5,963,904.82	4.12
	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	9,745,607.79	6.73
8	其他各项资产	862,877.00	0.60
9	合计	144,728,635.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,034,658.00	0.72

B	采矿业	3,229,708.00	2.25
C	制造业	95,624,866.80	66.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,263.70	0.01
E	建筑业	1,831,261.00	1.27
F	批发和零售业	4,274,472.00	2.97
G	交通运输、仓储和邮政业	1,295,228.04	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,875,669.34	4.78
J	金融业	4,885,791.40	3.40
K	房地产业	1,725,244.00	1.20
L	租赁和商务服务业	510,699.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	3,965,929.00	2.76
N	水利、环境和公共设施管理业	2,058,392.00	1.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	834,064.00	0.58
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	128,156,246.28	89.11

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	5,200	6,604,000.00	4.59
2	300750	宁德时代	8,000	3,144,080.00	2.19
3	605117	德业股份	24,540	2,605,657.20	1.81
4	603259	药明康德	20,600	2,564,906.00	1.78
5	603345	安井食品	27,400	2,197,206.00	1.53

6	603986	兆易创新	2,600	2,119,000.00	1.47
7	603317	天味食品	144,900	1,885,149.00	1.31
8	300972	万辰集团	9,300	1,612,713.00	1.12
9	002001	新和成	56,700	1,611,414.00	1.12
10	688256	寒武纪	1,000	1,595,550.00	1.11
11	301345	涛涛车业	6,400	1,478,400.00	1.03
12	002487	大金重工	25,000	1,449,250.00	1.01
13	002414	高德红外	108,100	1,433,406.00	1.00
14	601899	紫金矿业	54,400	1,367,616.00	0.95
15	002648	卫星化学	54,500	1,280,205.00	0.89
16	600487	亨通光电	11,700	1,279,278.00	0.89
17	688002	睿创微纳	8,214	1,270,623.66	0.88
18	601995	中金公司	34,300	1,239,945.00	0.86
19	000951	中国重汽	62,700	1,223,277.00	0.85
20	000933	神火股份	56,400	1,195,680.00	0.83
21	688111	金山办公	5,600	1,193,080.00	0.83
22	002558	巨人网络	39,500	1,088,620.00	0.76
23	000792	盐湖股份	35,800	1,080,802.00	0.75
24	600150	中国船舶	31,900	1,077,901.00	0.75
25	603444	吉比特	3,000	1,075,260.00	0.75
26	000807	云铝股份	46,900	1,038,366.00	0.72
27	301358	湖南裕能	13,600	1,031,832.00	0.72
28	300590	移为通信	71,000	1,018,850.00	0.71
29	301087	可孚医疗	21,300	1,014,945.00	0.71
30	688498	源杰科技	535	1,009,010.00	0.70
31	002916	深南电路	2,200	1,007,380.00	0.70
32	300681	英搏尔	35,100	1,004,562.00	0.70
33	688525	佰维存储	2,000	989,460.00	0.69
34	002653	海思科	14,900	988,466.00	0.69
35	600989	宝丰能源	48,600	988,038.00	0.69
36	600015	华夏银行	153,600	981,504.00	0.68
37	603588	高能环境	49,900	958,080.00	0.67
38	002111	威海广泰	104,800	943,200.00	0.66
39	601869	长飞光纤	1,700	928,030.00	0.65
40	600323	瀚蓝环境	32,700	897,942.00	0.62
41	601872	招商轮船	50,800	892,556.00	0.62
42	000938	紫光股份	30,900	891,774.00	0.62
43	300502	新易盛	1,440	874,080.00	0.61
44	688503	聚和材料	6,500	862,550.00	0.60
45	688059	华锐精密	4,300	858,753.00	0.60
46	688388	嘉元科技	19,365	852,060.00	0.59
47	600007	中国国贸	44,700	848,406.00	0.59
48	605098	行动教育	15,400	834,064.00	0.58

49	001218	丽臣实业	37,600	829,456.00	0.58
50	300037	新宙邦	8,700	807,795.00	0.56
51	300857	协创数据	2,340	795,366.00	0.55
52	300438	鹏辉能源	9,600	795,360.00	0.55
53	000408	藏格矿业	11,300	783,316.00	0.54
54	002956	西麦食品	37,100	770,196.00	0.54
55	600176	中国巨石	10,500	765,240.00	0.53
56	002384	东山精密	2,900	760,815.00	0.53
57	001389	广合科技	3,200	759,200.00	0.53
58	301606	绿联科技	12,400	756,648.00	0.53
59	688008	澜起科技	2,400	743,760.00	0.52
60	600522	中天科技	12,000	728,160.00	0.51
61	301200	大族数控	2,000	721,300.00	0.50
62	603061	金海通	1,390	698,085.80	0.49
63	688127	蓝特光学	7,040	687,104.00	0.48
64	600502	安徽建工	154,100	670,335.00	0.47
65	001309	德明利	700	660,030.00	0.46
66	002008	大族激光	4,300	645,473.00	0.45
67	600183	生益科技	3,700	641,580.00	0.45
68	300475	香农芯创	2,100	630,000.00	0.44
69	002709	天赐材料	12,200	627,446.00	0.44
70	688045	必易微	7,713	623,056.14	0.43
71	002043	兔宝宝	55,800	618,264.00	0.43
72	688630	芯碁微装	1,100	604,329.00	0.42
73	688578	艾力斯	5,533	604,203.60	0.42
74	688239	航宇科技	10,000	598,300.00	0.42
75	600768	宁波富邦	39,800	596,204.00	0.41
76	601138	工业富联	8,200	591,630.00	0.41
77	002463	沪电股份	3,700	565,360.00	0.39
78	000657	中钨高新	5,900	564,748.00	0.39
79	301308	江波龙	800	563,040.00	0.39
80	601886	江河集团	65,800	528,374.00	0.37
81	688155	先惠技术	6,500	525,785.00	0.37
82	002532	天山铝业	48,800	523,624.00	0.36
83	603233	大参林	34,600	520,038.00	0.36
84	603127	昭衍新药	13,600	519,792.00	0.36
85	688257	新锐股份	5,080	517,652.00	0.36
86	688266	泽璟制药	4,400	513,304.00	0.36
87	300604	长川科技	1,500	512,130.00	0.36
88	002271	东方雨虹	43,000	510,410.00	0.35
89	601061	中信金属	46,400	499,728.00	0.35
90	301377	鼎泰高科	900	495,810.00	0.34
91	003010	若羽臣	20,000	486,000.00	0.34

92	002028	思源电气	2,800	484,400.00	0.34
93	603638	艾迪精密	20,500	480,725.00	0.33
94	688717	艾罗能源	5,800	478,906.00	0.33
95	605599	菜百股份	34,900	478,130.00	0.33
96	002961	瑞达期货	24,200	473,836.00	0.33
97	601339	百隆东方	68,400	463,068.00	0.32
98	002557	洽洽食品	25,600	459,776.00	0.32
99	688308	欧科亿	2,500	454,525.00	0.32
100	000708	中信特钢	35,700	450,534.00	0.31
101	688372	伟测科技	2,400	446,400.00	0.31
102	603993	洛阳钼业	24,800	435,240.00	0.30
103	688331	荣昌生物	3,305	430,509.30	0.30
104	000036	华联控股	95,500	417,335.00	0.29
105	002460	赣锋锂业	6,200	405,480.00	0.28
106	301607	富特科技	7,700	402,325.00	0.28
107	600489	中金黄金	22,100	398,905.00	0.28
108	000988	华工科技	2,100	387,681.00	0.27
109	600755	厦门国贸	71,200	385,904.00	0.27
110	300953	震裕科技	2,880	385,056.00	0.27
111	688766	普冉股份	500	383,300.00	0.27
112	600066	宇通客车	14,000	375,340.00	0.26
113	000333	美的集团	4,900	370,097.00	0.26
114	000776	广发证券	15,700	367,380.00	0.26
115	002517	恺英网络	22,200	360,750.00	0.25
116	688779	五矿新能	44,275	359,070.25	0.25
117	600026	中远海能	20,000	358,800.00	0.25
118	600801	华新建材	22,900	357,240.00	0.25
119	600685	中船防务	13,800	351,072.00	0.24
120	688221	前沿生物	15,400	344,960.00	0.24
121	600030	中信证券	12,000	344,760.00	0.24
122	688559	海目星	4,100	344,072.00	0.24
123	002202	金风科技	14,100	336,990.00	0.23
124	300970	华绿生物	18,250	333,610.00	0.23
125	688275	万润新能	2,600	331,630.00	0.23
126	688025	杰普特	700	329,000.00	0.23
127	688309	恒誉环保	5,300	322,664.00	0.22
128	300042	朗科科技	4,200	319,914.00	0.22
129	600750	华润江中	14,300	315,601.00	0.22
130	600499	科达制造	22,400	309,120.00	0.21
131	603268	松发股份	2,200	306,416.00	0.21
132	002299	圣农发展	20,000	303,200.00	0.21
133	603929	亚翔集成	1,100	299,222.00	0.21
134	688378	奥来德	4,800	297,600.00	0.21

135	688097	博众精工	4,700	296,335.00	0.21
136	002240	盛新锂能	6,600	295,878.00	0.21
137	000778	新兴铸管	78,900	292,719.00	0.20
138	300073	当升科技	6,000	288,240.00	0.20
139	600251	冠农股份	33,200	286,848.00	0.20
140	600927	永安期货	23,000	286,350.00	0.20
141	300432	富临精工	14,200	285,278.00	0.20
142	603659	璞泰来	9,800	283,514.00	0.20
143	603991	领先股份	2,000	282,300.00	0.20
144	688321	微芯生物	10,700	281,731.00	0.20
145	002772	众兴菌业	24,800	281,728.00	0.20
146	603515	欧普照明	17,200	281,048.00	0.20
147	001339	智微智能	2,610	266,950.80	0.19
148	688531	日联科技	1,500	266,760.00	0.19
149	603256	宏和科技	1,000	265,330.00	0.18
150	688231	隆达股份	7,185	263,905.05	0.18
151	603507	振江股份	8,000	263,120.00	0.18
152	300769	德方纳米	3,800	252,700.00	0.18
153	600295	鄂尔多斯	23,500	251,920.00	0.18
154	600598	北大荒	23,200	251,488.00	0.17
155	605289	罗曼股份	1,720	249,400.00	0.17
156	002142	宁波银行	8,300	246,427.00	0.17
157	002850	科达利	1,300	246,090.00	0.17
158	601997	贵阳银行	46,300	237,519.00	0.17
159	001914	招商积余	28,400	231,744.00	0.16
160	603045	福达合金	3,200	228,448.00	0.16
161	688208	道通科技	9,000	226,710.00	0.16
162	688543	国科军工	5,700	224,865.00	0.16
163	300666	江丰电子	600	221,160.00	0.15
164	600938	中国海油	8,100	219,915.00	0.15
165	600686	金龙汽车	19,100	215,639.00	0.15
166	688416	恒烁股份	1,540	215,600.00	0.15
167	000426	兴业银锡	6,500	214,240.00	0.15
168	603093	南华期货	11,800	214,170.00	0.15
169	600546	山煤国际	19,400	212,042.00	0.15
170	002602	世纪华通	14,818	208,933.80	0.15
171	002128	电投能源	8,900	205,768.00	0.14
172	002378	章源钨业	6,100	204,228.00	0.14
173	002033	丽江股份	24,500	202,370.00	0.14
174	300201	海伦哲	9,400	198,058.00	0.14
175	300394	天孚通信	640	193,715.20	0.13
176	300054	鼎龙股份	1,800	190,746.00	0.13
177	603124	江南新材	1,000	186,980.00	0.13

178	688778	厦钨新能	3,200	174,080.00	0.12
179	601398	工商银行	23,900	168,973.00	0.12
180	002458	益生股份	21,600	167,832.00	0.12
181	002865	钧达股份	2,800	167,104.00	0.12
182	600188	兖矿能源	9,400	167,038.00	0.12
183	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.12
184	301338	凯格精机	1,000	162,890.00	0.11
185	002416	爱施德	17,600	157,696.00	0.11
186	600641	先导基电	3,800	151,468.00	0.11
187	688668	鼎通科技	400	149,320.00	0.10
188	688046	药康生物	6,100	147,620.00	0.10
189	300975	商络电子	2,800	144,900.00	0.10
190	688700	东威科技	1,600	143,040.00	0.10
191	688410	山外山	9,225	132,471.00	0.09
192	688629	华丰科技	700	131,257.00	0.09
193	601233	桐昆股份	6,000	129,900.00	0.09
194	601877	正泰电器	5,100	127,857.00	0.09
195	605123	派克新材	1,300	126,113.00	0.09
196	002027	分众传媒	25,700	124,388.00	0.09
197	000973	佛塑科技	8,600	123,410.00	0.09
198	688110	东芯股份	600	122,220.00	0.08
199	002859	洁美科技	1,100	120,461.00	0.08
200	600919	江苏银行	10,900	117,502.00	0.08
201	301536	星辰科技	900	115,839.00	0.08
202	688202	美迪西	1,400	112,994.00	0.08
203	688521	芯原股份	300	111,342.00	0.08
204	301031	中熔电气	900	107,505.00	0.07
205	301189	奥尼电子	1,800	106,074.00	0.07
206	300476	胜宏科技	300	103,929.00	0.07
207	300223	北京君正	400	99,560.00	0.07
208	300677	英科医疗	2,400	94,008.00	0.07
209	600710	苏美达	9,600	91,776.00	0.06
210	002645	华宏科技	3,320	91,333.20	0.06
211	002701	奥瑞金	21,000	89,460.00	0.06
212	688796	百奥赛图	800	87,520.00	0.06
213	605099	共创草坪	2,700	86,940.00	0.06
214	688222	成都先导	2,700	86,697.00	0.06
215	600388	龙净环保	5,800	84,390.00	0.06
216	600463	空港股份	11,000	83,930.00	0.06
217	301086	鸿富瀚	400	83,712.00	0.06
218	300408	三环集团	500	83,450.00	0.06
219	688530	欧莱新材	800	77,520.00	0.05
220	600064	南京高科	10,700	76,291.00	0.05

221	688519	南亚新材	200	76,008.00	0.05
222	002948	青岛银行	14,200	72,136.00	0.05
223	688627	精智达	100	71,500.00	0.05
224	600309	万华化学	1,000	68,410.00	0.05
225	601009	南京银行	6,900	68,241.00	0.05
226	002297	博云新材	2,300	66,677.00	0.05
227	600037	歌华有线	10,400	65,208.00	0.05
228	002545	东方铁塔	4,000	64,880.00	0.05
229	002466	天齐锂业	1,000	61,320.00	0.04
230	688633	星球石墨	2,033	60,441.09	0.04
231	002245	蔚蓝锂芯	3,200	59,872.00	0.04
232	002833	弘亚数控	3,100	59,799.00	0.04
233	301571	国科天成	900	58,662.00	0.04
234	300490	华自科技	4,200	55,566.00	0.04
235	301201	诚达药业	1,500	54,540.00	0.04
236	002091	江苏国泰	7,400	53,502.00	0.04
237	688610	埃科光电	200	52,680.00	0.04
238	688215	瑞晟智能	1,300	52,208.00	0.04
239	002281	光迅科技	200	51,388.00	0.04
240	600998	九州通	10,900	51,121.00	0.04
241	603998	方盛制药	5,400	48,762.00	0.03
242	300033	同花顺	200	48,200.00	0.03
243	603558	健盛集团	4,300	47,687.00	0.03
244	300390	天华新能	500	46,755.00	0.03
245	300302	同有科技	900	46,053.00	0.03
246	603906	龙蟠科技	1,700	45,101.00	0.03
247	000957	中通客车	4,800	44,928.00	0.03
248	301216	万凯新材	1,900	43,681.00	0.03
249	688205	德科立	200	41,638.00	0.03
250	300397	天和防务	2,500	37,850.00	0.03
251	600428	中远海特	4,800	37,488.00	0.03
252	600426	华鲁恒升	1,500	35,880.00	0.02
253	600105	永鼎股份	500	33,740.00	0.02
254	688087	英科再生	1,000	33,420.00	0.02
255	688390	固德威	304	32,987.04	0.02
256	002821	凯莱英	200	32,400.00	0.02
257	688237	超卓航科	600	32,052.00	0.02
258	002353	杰瑞股份	200	30,500.00	0.02
259	300283	温州宏丰	1,400	28,770.00	0.02
260	000062	深圳华强	900	28,638.00	0.02
261	000697	炼石航空	2,700	28,026.00	0.02
262	000703	恒逸石化	2,000	27,140.00	0.02
263	300395	菲利华	200	26,746.00	0.02

264	603966	法兰泰克	3,000	24,450.00	0.02
265	002345	潮宏基	2,200	20,174.00	0.01
266	601187	厦门银行	2,700	18,441.00	0.01
267	601360	三六零	1,900	16,511.00	0.01
268	688456	有研粉材	100	13,960.00	0.01
269	300434	金石亚药	1,000	11,230.00	0.01
270	600382	广东明珠	1,200	8,076.00	0.01
271	603195	公牛集团	200	7,830.00	0.01
272	001287	中电港	200	6,230.00	0.00
273	000685	中山公用	500	5,580.00	0.00
274	688678	福立旺	133	3,214.61	0.00
275	000682	东方电子	200	2,526.00	0.00
276	002810	山东赫达	100	2,470.00	0.00
277	301219	腾远钴业	40	2,192.00	0.00
278	603162	海通发展	232	2,081.04	0.00
279	601677	明泰铝业	100	1,660.00	0.00
280	600233	圆通速递	100	1,575.00	0.00
281	301110	青木科技	40	1,514.40	0.00
282	600366	宁波韵升	100	1,468.00	0.00
283	002468	申通快递	100	1,456.00	0.00
284	002606	大连电瓷	100	1,341.00	0.00
285	603223	恒通股份	100	1,305.00	0.00
286	002120	韵达股份	200	1,272.00	0.00
287	002439	启明星辰	100	1,265.00	0.00
288	000531	穗恒运 A	200	1,198.00	0.00
289	000722	湖南发展	100	1,136.00	0.00
290	002493	荣盛石化	100	1,075.00	0.00
291	000612	焦作万方	100	1,059.00	0.00
292	603390	通达电气	100	1,044.00	0.00
293	000729	燕京啤酒	100	1,013.00	0.00
294	002064	华峰化学	100	949.00	0.00
295	601857	中国石油	100	868.00	0.00
296	000791	甘肃能源	100	760.00	0.00
297	002461	珠江啤酒	100	757.00	0.00
298	002154	报喜鸟	200	712.00	0.00
299	600595	中孚实业	100	562.00	0.00
300	002752	昇兴股份	100	552.00	0.00
301	601128	常熟银行	70	407.40	0.00
302	000415	渤海租赁	100	407.00	0.00
303	002911	佛燃能源	30	284.70	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	6,382,097.00	12.79
2	300750	宁德时代	4,031,030.00	8.08
3	603345	安井食品	3,856,538.00	7.73
4	603259	药明康德	3,762,543.00	7.54
5	300972	万辰集团	3,271,939.00	6.56
6	000792	盐湖股份	3,136,768.00	6.29
7	603317	天味食品	3,058,826.00	6.13
8	605117	德业股份	3,016,963.00	6.05
9	601899	紫金矿业	2,679,475.00	5.37
10	601872	招商轮船	2,447,787.00	4.90
11	301358	湖南裕能	2,411,153.00	4.83
12	688208	道通科技	2,226,892.38	4.46
13	603986	兆易创新	2,222,464.00	4.45
14	002487	大金重工	2,196,704.00	4.40
15	600989	宝丰能源	2,172,456.00	4.35
16	301345	涛涛车业	2,139,113.00	4.29
17	002001	新和成	2,126,823.00	4.26
18	688127	蓝特光学	2,109,365.76	4.23
19	002028	思源电气	2,065,999.00	4.14
20	603588	高能环境	1,992,563.00	3.99
21	000807	云铝股份	1,920,069.00	3.85
22	300681	英搏尔	1,912,201.00	3.83
23	003010	若羽臣	1,890,038.00	3.79
24	002648	卫星化学	1,878,856.00	3.76
25	000933	神火股份	1,878,123.00	3.76
26	688111	金山办公	1,875,792.51	3.76
27	000408	藏格矿业	1,848,508.00	3.70
28	603444	吉比特	1,825,720.00	3.66
29	002414	高德红外	1,733,183.50	3.47
30	600176	中国巨石	1,702,825.00	3.41
31	002558	巨人网络	1,694,005.00	3.39
32	002345	潮宏基	1,675,702.00	3.36
33	300502	新易盛	1,672,719.00	3.35
34	603093	南华期货	1,662,372.00	3.33
35	000938	紫光股份	1,655,522.00	3.32

36	002709	天赐材料	1,644,844.00	3.30
37	688578	艾力斯	1,639,228.53	3.28
38	600150	中国船舶	1,635,846.00	3.28
39	000951	中国重汽	1,596,253.00	3.20
40	002956	西麦食品	1,543,716.00	3.09
41	603929	亚翔集成	1,532,550.00	3.07
42	002916	深南电路	1,488,406.00	2.98
43	688002	睿创微纳	1,474,540.58	2.95
44	000776	广发证券	1,461,352.00	2.93
45	601138	工业富联	1,461,303.00	2.93
46	601869	长飞光纤	1,420,767.00	2.85
47	603233	大参林	1,396,897.00	2.80
48	601995	中金公司	1,380,664.00	2.77
49	688525	佰维存储	1,376,558.24	2.76
50	603993	洛阳钼业	1,349,164.00	2.70
51	601339	百隆东方	1,342,646.00	2.69
52	605098	行动教育	1,338,254.00	2.68
53	688256	寒武纪	1,326,332.42	2.66
54	300590	移为通信	1,303,205.00	2.61
55	301606	绿联科技	1,292,638.00	2.59
56	301607	富特科技	1,290,889.00	2.59
57	600323	瀚蓝环境	1,274,268.00	2.55
58	605599	莱百股份	1,269,540.00	2.54
59	300037	新宙邦	1,263,115.00	2.53
60	002271	东方雨虹	1,260,509.00	2.53
61	002948	青岛银行	1,259,578.00	2.52
62	601677	明泰铝业	1,241,273.00	2.49
63	300073	当升科技	1,227,143.00	2.46
64	002111	威海广泰	1,216,952.00	2.44
65	001389	广合科技	1,208,801.00	2.42
66	601857	中国石油	1,177,400.00	2.36
67	001218	丽臣实业	1,155,355.00	2.32
68	688388	嘉元科技	1,150,646.52	2.31
69	688059	华锐精密	1,150,234.72	2.30
70	301031	中熔电气	1,134,722.00	2.27
71	002284	亚太股份	1,129,376.00	2.26
72	002033	丽江股份	1,128,958.00	2.26
73	002545	东方铁塔	1,119,163.00	2.24
74	002653	海思科	1,114,864.00	2.23
75	600487	亨通光电	1,108,672.00	2.22
76	600015	华夏银行	1,108,228.00	2.22
77	600183	生益科技	1,101,181.00	2.21
78	600502	安徽建工	1,077,037.00	2.16

79	300428	立中集团	1,057,633.00	2.12
80	301087	可孚医疗	1,053,635.00	2.11
81	601628	中国人寿	1,047,794.00	2.10
82	300033	同花顺	1,033,378.00	2.07
83	600066	宇通客车	1,031,918.00	2.07
84	002043	兔宝宝	1,031,312.00	2.07
85	002440	闰土股份	1,029,652.00	2.06
86	600750	华润江中	1,016,214.00	2.04
87	688182	灿勤科技	1,006,863.45	2.02

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产 净值比例（%）
1	000792	盐湖股份	2,600,644.00	5.21
2	603259	药明康德	2,287,840.00	4.58
3	300972	万辰集团	2,121,686.00	4.25
4	688127	蓝特光学	2,070,373.23	4.15
5	300308	中际旭创	2,034,007.31	4.08
6	601872	招商轮船	1,958,551.00	3.92
7	600176	中国巨石	1,925,192.00	3.86
8	688208	道通科技	1,834,941.86	3.68
9	002028	思源电气	1,776,026.00	3.56
10	600549	厦门钨业	1,707,954.00	3.42
11	603986	兆易创新	1,680,534.38	3.37
12	301031	中熔电气	1,680,192.20	3.37
13	603929	亚翔集成	1,579,213.00	3.16
14	600989	宝丰能源	1,557,013.00	3.12
15	601628	中国人寿	1,553,319.00	3.11
16	002345	潮宏基	1,540,961.00	3.09
17	300033	同花顺	1,537,674.40	3.08
18	300502	新易盛	1,479,061.80	2.96
19	301358	湖南裕能	1,470,298.00	2.95
20	603444	吉比特	1,454,179.00	2.91
21	601138	工业富联	1,418,465.00	2.84
22	601336	新华保险	1,367,913.00	2.74
23	603093	南华期货	1,361,098.00	2.73
24	603588	高能环境	1,349,759.00	2.70
25	300681	英搏尔	1,348,845.00	2.70
26	603993	洛阳钼业	1,343,143.00	2.69

27	301607	富特科技	1,327,492.40	2.66
28	600988	赤峰黄金	1,325,617.00	2.66
29	688072	拓荆科技	1,323,329.10	2.65
30	002948	青岛银行	1,315,638.00	2.64
31	300604	长川科技	1,315,588.00	2.64
32	002284	亚太股份	1,270,268.00	2.55
33	601677	明泰铝业	1,267,602.00	2.54
34	002709	天赐材料	1,266,220.00	2.54
35	601899	紫金矿业	1,235,543.00	2.48
36	603345	安井食品	1,225,861.00	2.46
37	601211	国泰海通	1,215,115.00	2.43
38	688525	佰维存储	1,211,293.72	2.43
39	600415	小商品城	1,191,250.00	2.39
40	688578	艾力斯	1,182,904.91	2.37
41	601857	中国石油	1,179,447.00	2.36
42	002916	深南电路	1,178,874.00	2.36
43	002545	东方铁塔	1,170,839.00	2.35
44	600183	生益科技	1,166,576.20	2.34
45	002170	芭田股份	1,164,799.00	2.33
46	003010	若羽臣	1,157,757.00	2.32
47	002039	黔源电力	1,154,847.00	2.31
48	600132	重庆啤酒	1,139,342.00	2.28
49	601168	西部矿业	1,122,237.00	2.25
50	301345	涛涛车业	1,111,605.00	2.23
51	000776	广发证券	1,095,868.00	2.20
52	002440	闰土股份	1,083,995.00	2.17
53	000791	甘肃能源	1,025,843.00	2.06
54	002736	国信证券	1,024,253.00	2.05
55	301219	腾远钴业	1,012,469.00	2.03
56	002033	丽江股份	1,001,184.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	355,258,582.09
卖出股票的收入（成交）总额	287,626,815.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,961,904.74	4.15
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）	2,000.08	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,963,904.82	4.15

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019792	25 国债 19	59,000	5,961,904.74	4.15
2	113704	春风转债	10	1,000.05	0.00
3	118072	鼎通转债	10	1,000.03	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	466,026.82
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	396,850.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	862,877.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时量化价值股票 A	5,008	4,865.45	1,498.25	0.01%	24,364,657.37	99.99%
博时量化价值股票 C	1,530	35,263.61	29,912,203.10	55.44%	24,041,117.92	44.56%
合计	6,434	12,172.75	29,913,701.35	38.19%	48,405,775.29	61.81%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	91.27%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

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

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

交易过户入)+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易，剔除场内相关数据（如有）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化价值股票 A	149,182.58	0.61%
	博时量化价值股票 C	50.00	0.00%
	合计	149,232.58	0.19%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	-
	博时量化价值股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化价值股票 A	10~50
	博时量化价值股票 C	-
	合计	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化价值股票 A	博时量化价值股票 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 26 日）基金份额总额	177,981,219.30	163,210,681.29
本报告期期初基金份额总额	19,540,966.86	11,811,659.88
本报告期基金总申购份额	19,249,013.08	59,999,385.57
减：本报告期基金总赎回份额	14,423,824.32	17,857,724.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	24,366,155.62	53,953,321.02
--------------	---------------	---------------

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2026 年 02 月 14 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生代任公司首席信息官，王德英先生离任公司副总经理、公司首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员没有受到监管部门的调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人的相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
国金证券	1	57,907,333.54	9.01%	27,095.82	9.01%	-
浙商证券	1	69,466,620.39	10.81%	32,506.24	10.81%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	85,125.74	0.01%	32.94	0.01%	增加 1 个
国信证券	2	229,196,949.45	35.65%	107,244.08	35.65%	-
申万宏源	2	209,339,068.25	32.56%	97,948.81	32.56%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国泰海通	2	76,867,094.25	11.96%	35,969.88	11.96%	-

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序

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

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	300,450.00	3.71%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	5,904,579.00	72.85%	4,700,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰海通	1,900,152.00	23.44%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时量化价值股票型证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
2	博时基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
3	博时量化价值股票型证券投资基金（博时量化价值股票 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
4	博时量化价值股票型证券投资基金（博时量化价值股票 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-06-26
5	博时基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-05-29

6	2025 年度博时基金以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-30
7	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-24
8	博时量化价值股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-04-22
9	博时基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	博时量化价值股票型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-03-31
11	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	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-26
12	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-02-14
13	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20260124	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-24
14	博时量化价值股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026-01-22

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日