

博道伍佰智航股票型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月28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2020年01月01日起至2020年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§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	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	55
§11 备查文件目录	57
11.1 备查文件目录	57
11.2 存放地点	57
11.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道伍佰智航股票型证券投资基金	
基金简称	博道伍佰智航	
基金主代码	007831	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09月26日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	459,026,107.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
下属分级基金的交易代码	007831	007832
报告期末下属分级基金的份额总额	241,812,816.20份	217,213,290.88份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，以股票投资为主。本基金业绩比较基准中股票资产部分以中证500指数为基准指数，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×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、债券型基金与货币市场基金。

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	博道基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	叶文瑛	李申
	联系电话	021-80226288	021-60637102
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-085-2888	021-60637111
传真		021-80226289	021-60635778
注册地址		上海市虹口区东大名路687号1幢262室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		莫泰山	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

§ 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(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
本期已实现收益	26,781,208.75	28,106,702.75

本期利润	46,443,693.84	44,136,505.41
加权平均基金份额本期利润	0.1792	0.1486
本期加权平均净值利润率	16.65%	13.87%
本期基金份额净值增长率	17.12%	16.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	31,598,887.37	27,821,958.92
期末可供分配基金份额利润	0.1307	0.1281
期末基金资产净值	294,126,399.44	263,604,491.47
期末基金份额净值	1.2163	1.2136
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	21.63%	21.36%

注：

- 1、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，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；
- 2、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。

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

博道伍佰智航A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	11.71%	0.96%	8.04%	0.84%	3.67%	0.12%
过去三个月	19.25%	1.06%	15.47%	1.08%	3.78%	-0.02%
过去六个月	17.12%	1.65%	10.84%	1.70%	6.28%	-0.05%

自基金合同生效起至今	21.63%	1.39%	14.60%	1.47%	7.03%	-0.08%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

注：本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%，每日进行再平衡过程。

博道伍佰智航C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	11.69%	0.96%	8.04%	0.84%	3.65%	0.12%
过去三个月	19.17%	1.06%	15.47%	1.08%	3.70%	-0.02%
过去六个月	16.95%	1.65%	10.84%	1.70%	6.11%	-0.05%
自基金合同生效起至今	21.36%	1.39%	14.60%	1.47%	6.76%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%，每日进行再平衡过程。

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

博道伍佰智航A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 9 月 26 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道伍佰智航C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 9 月 26 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§ 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

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本金为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了13只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月定期开放混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
杨梦	博道启航混合、博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道久航混合的基金经理	2019-09-26	-	9 年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司任首席量化分析师。具有基金从业资格。自2018年8月10日起担任博道启航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年1月3日起担任博道中证500指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月26日起担任博道沪深300指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月30日起担任博道远航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年6月5日起担任博道叁佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年9月26日起担任博道伍

					佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月24日起担任博道久航混合型证券投资基金基金经理至今。
--	--	--	--	--	--

注：

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、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

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生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

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生2次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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

2020年上半年，各大指数均上涨，具体而言，沪深300上涨1.64%，中证500上涨11.33%，创业板上涨35.60%。从行业来看，医药生物、休闲服务、电子、食品饮料等涨

幅居前，采掘、银行和非银等跌幅较大。因子表现来看，表征业绩景气度的基本面类因子表现较好，表征均值回复类的因子在上半年一直横盘震荡，期间经历了较大的回撤。

2020年开年，受到疫情冲击，2月经济按下“暂停键”，一季度国内GDP增速出现负增长。3月开始伴随复工复产的逐步推进，各项经济指标逐月修复。制造业PMI连续4个月在荣枯线以上，非制造业PMI连续4个月回升；4月工业增加值转正，5月服务业生产指数，限额以上零售和商品零售转正，投资增速继续回升，工业利润由负转正。政策方面，在疫情深度冲击经济的背景下，各国政府纷纷发力，2月中国综合运用降准降息，3月美联储动用各种工具稳定流动性，并出台了大规模的财政扩张政策，市场的恐慌情绪得到缓解，伴随经济的逐渐修复，市场明显反弹。

报告期间，本基金维持配置中证500多因子选股增强模型，在本报告期间获得了超越业绩比较基准的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“3.2.1本报告期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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内各项经济活动大概率向近年均值水平逐步回归，全年经济增速有望达到2-3%。政策方面，我们预计货币政策的合理宽松将维持，“积极的财政政策会更加积极有为”。

本基金管理人将继续坚持量化多因子的选股思路，秉持勤勉尽责的态度，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由营运分管领导、督察长、基金事务部负责人、投委会主席、研究部负责人、投资运营部负责人、监察稽核部负责人及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会

成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 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，中国建设银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在博道伍佰智航股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金报告期内无利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：博道伍佰智航股票型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2020年06月30日	2019年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	27,684,453.31	82,095,556.00
结算备付金		1,307,616.63	5,004,511.11
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	542,298,477.11	585,293,967.47
其中: 股票投资		517,579,063.51	585,293,967.47
基金投资		-	-
债券投资		24,719,413.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	165,801.63	21,825.80
应收股利		-	-
应收申购款		3,634,138.97	799,155.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		575,090,487.65	673,215,015.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		16,437,617.75	35,562,411.86
应付管理人报酬		590,510.41	823,745.16

应付托管费		99,932.55	139,403.04
应付销售服务费		65,406.70	120,511.83
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	166,129.33	109,245.17
负债合计		17,359,596.74	36,755,317.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	459,026,107.08	613,130,616.11
未分配利润	6.4.7.10	98,704,783.83	23,329,082.53
所有者权益合计		557,730,890.91	636,459,698.64
负债和所有者权益总计		575,090,487.65	673,215,015.70

注：本报告期末基金份额净值请见“3.1 主要财务指标”；基金份额请见“2.1基金基本情况”。

6.2 利润表

会计主体：博道伍佰智航股票型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日 至2020年06月30日
一、收入		105,512,899.56
1. 利息收入		389,789.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	134,212.92
债券利息收入		255,576.69
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		0.08
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		68,180,306.98

其中：股票投资收益	6.4.7.12	63,538,820.59
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13.1	-103,184.50
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	683,184.47
股利收益	6.4.7.15	4,061,486.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	35,692,287.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,250,515.14
减：二、费用		14,932,700.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,888,031.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	657,974.54
3. 销售服务费		480,070.08
4. 交易费用	6.4.7.18	9,816,711.16
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		2,459.46
7. 其他费用	6.4.7.19	87,453.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		90,580,199.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		90,580,199.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博道伍佰智航股票型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	613,130,616.11	23,329,082.53	636,459,698.64
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	90,580,199.25	90,580,199.25
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-154,104,509.03	-15,204,497.95	-169,309,006.98
其中：1. 基金申购款	567,268,759.04	36,204,228.35	603,472,987.39
2. 基金赎回 款	-721,373,268.07	-51,408,726.30	-772,781,994.37
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	459,026,107.08	98,704,783.83	557,730,890.91

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：

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博道伍佰智航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[2019]1387号《关于准予博道伍佰智航股票型证券投资基金注册的批复》核准，由博道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《博道伍佰智航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，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758,118,385.63元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验

字（2019）第0519号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》于2019年9月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为758,452,093.92份基金份额，其中认购资金利息折合333,708.29份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》和《博道伍佰智航股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再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/申购基金时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A类基金份额和C类基金份额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《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货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）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。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。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中证500指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年01月01日至2020年06月30日止期间的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2020年06月30日的财务状况以及2020年01月01日至2020年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	2,256,966.64
定期存款	—
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	25,427,486.67
合计	27,684,453.31

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		469,083,833.92	517,579,063.51	48,495,229.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	24,788,607.20	24,719,413.60	-69,193.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	24,788,607.20	24,719,413.60	-69,193.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		493,872,441.12	542,298,477.11	48,426,035.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	406.03
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	3,428.07
应收结算备付金利息	290.12
应收债券利息	161,677.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	165,801.63

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,206.81
预提费用-审计费	19,890.78
预提费用-信息披露费	99,672.34
其他应付	33,359.40
合计	166,129.33

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 博道伍佰智航A

金额单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	245,266,255.24	245,266,255.24
本期申购	214,589,955.70	214,589,955.70
本期赎回（以“-”号填列）	-218,043,394.74	-218,043,394.74
本期末	241,812,816.20	241,812,816.20

6.4.7.9.2 博道伍佰智航C

金额单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	367,864,360.87	367,864,360.87
本期申购	352,678,803.34	352,678,803.34
本期赎回（以“-”号填列）	-503,329,873.33	-503,329,873.33
本期末	217,213,290.88	217,213,290.88

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 博道伍佰智航A

单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,099,905.03	4,351,963.92	9,451,868.95
本期利润	26,781,208.75	19,662,485.09	46,443,693.84
本期基金份额交易产生的变动数	-282,226.41	-3,299,753.14	-3,581,979.55
其中：基金申购款	13,416,008.14	-528,979.04	12,887,029.10
基金赎回款	-13,698,234.55	-2,770,774.10	-16,469,008.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,598,887.37	20,714,695.87	52,313,583.24

6.4.7.10.2 博道伍佰智航C

单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,354,952.04	6,522,261.54	13,877,213.58
本期利润	28,106,702.75	16,029,802.66	44,136,505.41
本期基金份额交易产生的变动数	-7,639,695.87	-3,982,822.53	-11,622,518.40
其中：基金申购款	21,141,056.44	2,176,142.81	23,317,199.25
基金赎回款	-28,780,752.31	-6,158,965.34	-34,939,717.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,821,958.92	18,569,241.67	46,391,200.59

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	9,856.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	119,409.15
结算备付金利息收入	4,947.07
其他	-
合计	134,212.92

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	4,119,722,220.09
减：卖出股票成本总额	4,056,183,399.50
买卖股票差价收入	63,538,820.59

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	31,711,710.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	31,237,509.90
减：应收利息总额	577,385.21
买卖债券差价收入	-103,184.50

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无权证投资收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年01月01日至2020年06月30日
期货投资	683,184.47

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,061,486.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,061,486.42

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	35,692,287.75
——股票投资	35,761,481.35
——债券投资	-69,193.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	35,692,287.75

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	1,248,798.12
转换费收入	1,717.02
合计	1,250,515.14

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	9,809,856.97
银行间市场交易费用	—
期货市场交易费用	6,854.19
合计	9,816,711.16

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
汇划手续费	7,890.66
合计	87,453.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,888,031.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,252,809.72

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
----	-------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	657,974.54
----------------	------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.22%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×0.22%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C	合计
博道基金 管理有限 公司	0.00	7,521.50	7,521.50
建设银行 股份有限 公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	7,521.50	7,521.50

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的基金资产净值×0.30%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道伍佰智航A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金合同生效日（2019	1,999,697.30

年09月26日)持有的基金份额	
报告期初持有的基金份额	1,999,697.30
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	1,999,697.30
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.44%

博道伍佰智航C

份额单位: 份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金合同生效日(2019年09月26日)持有的基金份额	1,000,048.61
报告期初持有的基金份额	1,000,048.61
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	1,000,048.61
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.22%

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、基金管理人博道基金认购本基金的交易通过直销柜台办理，A类适用费率为0.02%，C类适用费率为零。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,256,966.64	9,856.70

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：股)	总额	总额	
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	新股锁定	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688396	华润微	2020-02-14	2020-08-27	新股锁定	12.80	41.45	42,491	543,884.80	1,761,251.95	-
688208	道通科技	2020-02-06	2020-08-13	新股锁定	24.36	54.23	14,165	345,059.40	768,167.95	-
688598	金博股份	2020-05-08	2020-11-18	新股锁定	47.20	77.94	7,645	360,844.00	595,851.30	-
688558	国盛智科	2020-06-19	2020-12-30	新股锁定	17.37	35.26	8,488	147,436.56	299,286.88	-
688157	松井股份	2020-05-29	2020-12-09	新股锁定	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-	2021-01-	新股锁定	15.50	15.50	5,468	84,754.0	84,754.0	-

		23	04					0	0	
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：

- 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月；
- 2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

6.4.13.2 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中国建设银行，其他存款存放于浙商证券股份有限公司，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均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，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。

于2020年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2019年12月31日：本基金无债券投资）。

6.4.13.3 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可随时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。

于2020年6月30日，本基金所承担的全部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（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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2020年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.77%。

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2020年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为548,777,381.28元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	27,684,453.31	-	-	-	-	-	27,684,453.31
结算备付金	1,307,616.63	-	-	-	-	-	1,307,616.63
交易性金融资产	-	-	24,719,413.60	-	-	517,579,063.51	542,298,477.11
应收利息	-	-	-	-	-	165,801.63	165,801.63
应收申购款	-	-	-	-	-	3,634,138.97	3,634,138.97
资产总计	28,992,069.94	0.00	24,719,413.60	0.00	0.00	521,379,004.11	575,090,487.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,437,617.75	16,437,617.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	590,510.41	590,510.41
应付托管费	-	-	-	-	-	99,932.55	99,932.55

应付销售服务费	-	-	-	-	-	65,406.70	65,406.70
其他负债	-	-	-	-	-	166,129.33	166,129.33
负债总计	-	-	-	-	-	17,359,596.74	17,359,596.74
利率敏感度缺口	28,992,069.94	0.00	24,719,413.60	0.00	0.00	504,019,407.37	557,730,890.91
上年度末2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	82,095,556.00	-	-	-	-	-	82,095,556.00
结算备付金	5,004,511.11	-	-	-	-	-	5,004,511.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	585,293,967.47	585,293,967.47
应收利息	-	-	-	-	-	21,825.80	21,825.80
应收申购款	-	-	-	-	-	799,155.32	799,155.32
资产总计	87,100,067.11	0.00	0.00	0.00	0.00	586,114,948.59	673,215,015.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	35,562,411.86	35,562,411.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	823,745.16	823,745.16
应付托管费	-	-	-	-	-	139,403.04	139,403.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	120,511.83	120,511.83
其他负债	-	-	-	-	-	109,245.17	109,245.17
负债总计	-	-	-	-	-	36,755,317.06	36,755,317.06
利率敏感度缺口	87,100,067.11	0.00	0.00	0.00	0.00	549,359,631.53	636,459,698.64

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.43%(2019年12月31日：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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。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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	517,579,063.51	92.80	585,293,967.47	91.96
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	517,579,063.51	92.80	585,293,967.47	91.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数收益率以外的其他市场价格变量保持不变		
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：人民币元）	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	1. 中证500指数收益率上升5%	23,301,380.46	28,204,823.20
	2. 中证500指数收益率下降5%	-23,301,380.46	-28,204,823.20

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	517,579,063.51	90.00
	其中：股票	517,579,063.51	90.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,719,413.60	4.30
	其中：债券	24,719,413.60	4.30
	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	28,992,069.94	5.04
8	其他各项资产	3,799,940.60	0.66
9	合计	575,090,487.65	100.00

注：银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	4,983,436.00	0.89
B	采矿业	14,986,335.50	2.69
C	制造业	309,952,583.93	55.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,815,689.20	2.48
E	建筑业	8,695,562.05	1.56
F	批发和零售业	42,522,777.08	7.62

G	交通运输、仓储和邮政业	17,485,978.12	3.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,166,949.63	10.25
J	金融业	22,966,355.00	4.12
K	房地产业	11,954,480.00	2.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,580,128.00	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	2,628,155.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,865,396.00	0.33
S	综合	2,975,238.00	0.53
	合计	517,579,063.51	92.80

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通过港股通投资的股票。

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603258	电魂网络	148,097	8,228,269.32	1.48
2	300607	拓斯达	186,480	7,587,871.20	1.36
3	300529	健帆生物	96,547	6,710,016.50	1.20
4	601872	招商轮船	1,118,200	6,519,106.00	1.17
5	002493	荣盛石化	523,600	6,440,280.00	1.15
6	603218	日月股份	340,316	6,227,782.80	1.12

7	603444	吉比特	11,300	6,203,813.00	1.11
8	300686	智动力	251,200	6,043,872.00	1.08
9	603113	金能科技	497,100	5,910,519.00	1.06
10	000090	天健集团	834,100	5,763,631.00	1.03
11	600639	浦东金桥	359,600	5,746,408.00	1.03
12	002216	三全食品	240,400	5,745,560.00	1.03
13	300558	贝达药业	40,800	5,711,184.00	1.02
14	603233	大参林	69,860	5,674,029.20	1.02
15	000923	河钢资源	444,877	5,605,450.20	1.01
16	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	1.00
17	002214	大立科技	196,200	5,528,916.00	0.99
18	300677	英科医疗	43,200	5,520,960.00	0.99
19	300059	东方财富	262,460	5,301,692.00	0.95
20	300418	昆仑万维	204,700	5,109,312.00	0.92
21	600109	国金证券	444,000	5,066,040.00	0.91
22	300390	天华超净	360,400	5,020,372.00	0.90
23	002897	意华股份	145,000	4,966,250.00	0.89
24	002697	红旗连锁	452,139	4,937,357.88	0.89
25	300701	森霸传感	141,500	4,928,445.00	0.88
26	002443	金洲管道	691,680	4,710,340.80	0.84
27	600459	贵研铂业	156,500	4,665,265.00	0.84
28	600845	宝信软件	77,848	4,599,259.84	0.82
29	300497	富祥药业	233,200	4,563,724.00	0.82
30	002398	垒知集团	417,200	4,409,804.00	0.79
31	002531	天顺风能	724,511	4,332,575.78	0.78
32	002803	吉宏股份	170,700	4,257,258.00	0.76
33	603988	中电电机	321,500	4,176,285.00	0.75
34	000531	穗恒运 A	553,400	4,150,500.00	0.74
35	603079	圣达生物	139,860	4,144,051.80	0.74
36	300206	理邦仪器	225,450	4,112,208.00	0.74
37	300179	四方达	722,770	4,098,105.90	0.73

38	300246	宝莱特	116,700	4,093,836.00	0.73
39	002661	克明面业	176,200	4,084,316.00	0.73
40	300031	宝通科技	160,700	4,023,928.00	0.72
41	600998	九州通	214,400	3,992,128.00	0.72
42	300738	奥飞数据	69,100	3,985,688.00	0.71
43	603985	恒润股份	240,800	3,951,528.00	0.71
44	300617	安靠智电	115,790	3,890,544.00	0.70
45	601012	隆基股份	92,900	3,783,817.00	0.68
46	300729	乐歌股份	71,300	3,762,501.00	0.67
47	002324	普利特	247,716	3,718,217.16	0.67
48	000036	华联控股	842,280	3,706,032.00	0.66
49	603883	老百姓	36,700	3,671,468.00	0.66
50	603363	傲农生物	157,100	3,671,427.00	0.66
51	300624	万兴科技	45,120	3,632,160.00	0.65
52	300433	蓝思科技	129,300	3,625,572.00	0.65
53	600361	华联综超	746,400	3,605,112.00	0.65
54	300119	瑞普生物	159,900	3,573,765.00	0.64
55	002605	姚记科技	92,900	3,530,200.00	0.63
56	600396	金山股份	1,463,400	3,497,526.00	0.63
57	300715	凯伦股份	93,100	3,470,768.00	0.62
58	300387	富邦股份	406,700	3,400,012.00	0.61
59	002893	华通热力	351,274	3,379,255.88	0.61
60	002847	盐津铺子	35,400	3,370,788.00	0.60
61	603189	网达软件	139,200	3,280,944.00	0.59
62	002128	露天煤业	422,100	3,271,275.00	0.59
63	300261	雅本化学	525,800	3,259,960.00	0.58
64	002626	金达威	124,200	3,224,232.00	0.58
65	300214	日科化学	389,000	3,166,460.00	0.57
66	002603	以岭药业	101,300	3,159,547.00	0.57
67	601808	中海油服	239,400	3,145,716.00	0.56
68	002001	新 和 成	105,800	3,078,780.00	0.55

69	603360	百傲化学	154,120	2,994,551.60	0.54
70	600833	第一医药	274,900	2,941,430.00	0.53
71	603416	信捷电气	73,700	2,937,682.00	0.53
72	002921	联诚精密	134,900	2,917,887.00	0.52
73	300092	科新机电	377,985	2,910,484.50	0.52
74	603031	安德利	81,800	2,903,900.00	0.52
75	600731	湖南海利	406,000	2,882,600.00	0.52
76	002567	唐人神	302,200	2,876,944.00	0.52
77	002859	洁美科技	95,300	2,857,094.00	0.51
78	300511	雪榕生物	221,200	2,837,996.00	0.51
79	603611	诺力股份	130,700	2,804,822.00	0.50
80	600745	闻泰科技	22,100	2,783,495.00	0.50
81	603335	迪生力	579,400	2,781,120.00	0.50
82	600726	华电能源	1,484,300	2,775,641.00	0.50
83	000987	越秀金控	231,900	2,703,954.00	0.48
84	601878	浙商证券	272,800	2,703,448.00	0.48
85	002028	思源电气	130,400	2,667,984.00	0.48
86	002734	利民股份	177,390	2,655,528.30	0.48
87	603708	家家悦	53,900	2,655,114.00	0.48
88	300190	维尔利	348,100	2,628,155.00	0.47
89	600809	山西汾酒	18,100	2,624,500.00	0.47
90	002782	可立克	198,500	2,622,185.00	0.47
91	603238	诺邦股份	60,600	2,557,320.00	0.46
92	002869	金溢科技	38,700	2,557,296.00	0.46
93	000963	华东医药	99,400	2,514,820.00	0.45
94	002030	达安基因	91,970	2,508,941.60	0.45
95	600393	粤泰股份	881,000	2,502,040.00	0.45
96	600621	华鑫股份	129,500	2,499,350.00	0.45
97	600963	岳阳林纸	694,430	2,465,226.50	0.44
98	002414	高德红外	84,150	2,463,912.00	0.44
99	002136	安纳达	286,600	2,407,440.00	0.43

100	601116	三江购物	166,100	2,373,569.00	0.43
101	300037	新宙邦	42,600	2,345,556.00	0.42
102	603808	歌力思	180,800	2,328,704.00	0.42
103	300566	激智科技	87,300	2,302,974.00	0.41
104	601933	永辉超市	243,100	2,280,278.00	0.41
105	002829	星网宇达	64,100	2,230,039.00	0.40
106	300782	卓胜微	5,460	2,215,504.20	0.40
107	002417	深南股份	335,300	2,209,627.00	0.40
108	603577	汇金通	214,100	2,198,807.00	0.39
109	002401	中远海科	137,800	2,195,154.00	0.39
110	600519	贵州茅台	1,500	2,194,320.00	0.39
111	002174	游族网络	84,100	2,193,328.00	0.39
112	002311	海大集团	45,300	2,155,827.00	0.39
113	300674	宇信科技	49,800	2,148,870.00	0.39
114	002041	登海种业	169,600	2,145,440.00	0.38
115	600760	中航沈飞	64,800	2,126,736.00	0.38
116	600961	株冶集团	366,000	2,108,160.00	0.38
117	601388	怡球资源	1,168,010	1,997,297.10	0.36
118	601975	招商南油	835,100	1,995,889.00	0.36
119	603301	振德医疗	38,540	1,986,737.00	0.36
120	000858	五 粮 液	11,600	1,984,992.00	0.36
121	002270	华明装备	342,800	1,919,680.00	0.34
122	601595	上海电影	123,700	1,865,396.00	0.33
123	002487	大金重工	312,700	1,863,692.00	0.33
124	600051	宁波联合	211,200	1,852,224.00	0.33
125	300229	拓尔思	160,200	1,839,096.00	0.33
126	300768	迪普科技	38,800	1,796,052.00	0.32
127	600012	皖通高速	345,600	1,793,664.00	0.32
128	002838	道恩股份	61,200	1,786,428.00	0.32
129	603005	晶方科技	22,700	1,785,582.00	0.32
130	600685	中船防务	104,500	1,767,095.00	0.32

131	688396	华润微	42,491	1,761,251.95	0.32
132	300066	三川智慧	357,100	1,756,932.00	0.32
133	600436	片仔癀	10,200	1,736,550.00	0.31
134	000534	万泽股份	178,500	1,733,235.00	0.31
135	300192	科斯伍德	99,600	1,681,248.00	0.30
136	002945	华林证券	121,300	1,675,153.00	0.30
137	002698	博实股份	131,300	1,674,075.00	0.30
138	600566	济川药业	65,300	1,662,538.00	0.30
139	600153	建发股份	203,000	1,644,300.00	0.29
140	600496	精工钢构	481,500	1,613,025.00	0.29
141	600777	新潮能源	1,060,000	1,611,200.00	0.29
142	603679	华体科技	40,851	1,605,852.81	0.29
143	300628	亿联网络	23,300	1,590,458.00	0.29
144	600026	中远海能	245,200	1,583,992.00	0.28
145	603979	金诚信	152,730	1,574,646.30	0.28
146	601066	XD中信建	39,700	1,563,386.00	0.28
147	300462	华铭智能	68,900	1,562,652.00	0.28
148	002585	双星新材	243,800	1,533,502.00	0.27
149	600751	海航科技	471,900	1,477,047.00	0.26
150	603810	丰山集团	30,900	1,471,767.00	0.26
151	603533	掌阅科技	38,300	1,460,379.00	0.26
152	600036	招商银行	43,100	1,453,332.00	0.26
153	002583	海能达	190,900	1,448,931.00	0.26
154	300124	汇川技术	37,800	1,436,022.00	0.26
155	002107	沃华医药	128,800	1,429,680.00	0.26
156	300076	GQY视讯	285,600	1,393,728.00	0.25
157	000975	银泰黄金	88,600	1,389,248.00	0.25
158	002594	比亚迪	19,300	1,385,740.00	0.25
159	300690	双一科技	55,000	1,375,550.00	0.25
160	600455	博通股份	59,800	1,364,038.00	0.24
161	300147	香雪制药	134,600	1,320,426.00	0.24

162	600477	杭萧钢构	363,335	1,318,906.05	0.24
163	603707	健友股份	20,300	1,310,771.00	0.24
164	603129	春风动力	19,100	1,302,811.00	0.23
165	002223	鱼跃医疗	34,200	1,244,880.00	0.22
166	300078	思创医惠	88,800	1,201,464.00	0.22
167	300658	延江股份	39,400	1,195,790.00	0.21
168	300649	杭州园林	68,400	1,170,324.00	0.21
169	603609	禾丰牧业	61,000	908,900.00	0.16
170	688208	道通科技	14,165	768,167.95	0.14
171	688598	金博股份	7,645	595,851.30	0.11
172	688558	N国盛	8,488	299,286.88	0.05
173	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.05
174	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
175	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
176	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.02
177	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
178	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
179	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
180	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
181	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
182	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
183	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
184	300839	N博汇	502	11,751.82	0.00
185	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
186	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
187	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
188	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
189	600475	华光环能	91	1,061.97	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	600745	闻泰科技	21,521,736.63	3.38
2	300686	智动力	17,260,102.00	2.71
3	300119	瑞普生物	16,462,360.00	2.59
4	601012	隆基股份	16,428,576.00	2.58
5	603360	百傲化学	16,275,528.30	2.56
6	603444	吉比特	16,116,466.23	2.53
7	603258	电魂网络	15,988,035.04	2.51
8	002697	红旗连锁	15,365,935.74	2.41
9	300497	富祥药业	15,319,938.20	2.41
10	002216	三全食品	15,053,333.00	2.37
11	300059	东方财富	15,010,623.14	2.36
12	603218	日月股份	14,692,159.60	2.31
13	300246	宝莱特	14,236,709.55	2.24
14	002847	盐津铺子	13,921,779.00	2.19
15	600603	广汇物流	13,902,733.12	2.18
16	002605	姚记科技	13,619,849.00	2.14
17	002324	普利特	13,553,669.90	2.13
18	300552	万集科技	13,409,325.39	2.11
19	300529	健帆生物	13,084,630.82	2.06
20	300433	蓝思科技	13,057,208.26	2.05
21	603609	禾丰牧业	12,912,858.00	2.03
22	600779	水井坊	12,893,041.88	2.03

注：“本期累计买入金额”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	600745	闻泰科技	19,482,805.44	3.06
2	300693	盛弘股份	17,033,610.50	2.68
3	000623	吉林敖东	16,600,022.00	2.61
4	600779	水井坊	15,961,546.09	2.51
5	300497	富祥药业	15,404,135.41	2.42
6	603609	禾丰牧业	15,185,993.00	2.39
7	300130	新国都	14,894,324.70	2.34
8	300563	神宇股份	14,635,762.00	2.30
9	600603	广汇物流	13,994,948.02	2.20
10	300515	三德科技	13,859,459.81	2.18
11	603730	岱美股份	13,840,607.00	2.17
12	300246	宝莱特	13,820,677.00	2.17
13	300119	瑞普生物	13,805,898.00	2.17
14	601012	隆基股份	13,498,337.00	2.12
15	600390	五矿资本	13,473,599.61	2.12
16	603360	百傲化学	13,227,658.12	2.08
17	300690	双一科技	13,136,650.80	2.06
18	300571	平治信息	13,127,087.96	2.06
19	603258	电魂网络	13,104,366.00	2.06
20	002847	盐津铺子	12,936,655.00	2.03
21	300498	温氏股份	12,787,515.50	2.01
22	300719	安达维尔	12,758,298.50	2.00

注：“本期累计卖出金额”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

买入股票成本（成交）总额	3,952,707,014.19
卖出股票收入（成交）总额	4,119,722,220.09

注：“买入股票成本”或“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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,719,413.60	4.43
	其中：政策性金融债	24,719,413.60	4.43
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	24,719,413.60	4.43

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	018013	国开2004	247,120	24,719,413.60	4.43

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					683,184.47
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率，进行更有效的现金头寸管理。本基金参与股指期货交易时，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行投资。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（1）2019年12月31日，杭州市公安局滨江区分局长河派出所发布行政处罚决定书（杭滨公（长）行罚决字[2019]51724号），对杭州电魂网络科技有限公司（以下简称“电魂网络”，股票代码603258）未履行信息审核职责，未履行网络安全信息安全管理义务等行为，决定给予警告的行政处罚。行政处罚的执行方式和期限：当场训诫。本基金采用量化选股策略，电魂网络是根据选股模型批量选择出来的个股，由于该事件并未影响到模型的选股指标体系，且本基金认为对电魂网络的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响，所以本基金遵循量化模型的选股结果，继续投资该股票。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无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 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	165,801.63
5	应收申购款	3,634,138.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,799,940.60

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

博道伍佰智航A	2,174	111,229.45	76,627,906.91	31.69%	165,184,909.29	68.31%
博道伍佰智航C	4,043	53,725.77	1,770,106.53	0.81%	215,443,184.35	99.19%
合计	6,061	75,734.38	78,398,013.44	17.08%	380,628,093.64	82.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博道伍佰智航A	125,376.60	0.05%
	博道伍佰智航C	6,134.27	0.00%
	合计	131,510.87	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	博道伍佰智航A	0~10
	博道伍佰智航C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	博道伍佰智航A	-
	博道伍佰智航C	-
	合计	0.00

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
基金合同生效日(2019年09月26)	274,561,475.68	483,890,618.24

日)基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	245,266,255.24	367,864,360.87
本报告期基金总申购份额	214,589,955.70	352,678,803.34
减:本报告期基金总赎回份额	218,043,394.74	503,329,873.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	241,812,816.20	217,213,290.88

注:

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人的重大人事变动:报告期内,经董事会审议通过,由史伟先生任公司副总经理。本公司已按规定将上述事项报监管机构备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),自本基金基金合同生效以来,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	2	8,054,729,840.58	100.00%	5,638,409.75	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
浙商证券	87,160,442.50	100.00%	1,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、本基金本报告期内交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
 - 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
 - 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；
- 3、基金交易单元的选择程序如下：
 - 1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
 - 2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

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	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-01-17
2	博道伍佰智航股票型证券投资基金2019年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
3	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-19
4	博道基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-24
5	博道伍佰智航股票型证券投资基金2019年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-28
6	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-03-28
7	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-04-22
8	博道伍佰智航股票型证券投资基金2020年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-22
9	博道基金管理有限公司高级管理人员任职公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
10	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加中信证券华南股份有限公司为代销机构的	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子	2020-04-29

	公告	披露网站	
11	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加嘉实财富管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-15
12	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-03
13	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-15

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道伍佰智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道伍佰智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道伍佰智航股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道伍佰智航股票型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道伍佰智航股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日