

# 博道成长智航股票型证券投资基金

2022年第1季度报告

2022年03月31日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

报告送出日期:2022年04月22日

## 目录

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示                                  | 3  |
| §2 基金产品概况                                | 3  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                         | 4  |
| 3.1 主要财务指标                               | 4  |
| 3.2 基金净值表现                               | 4  |
| §4 管理人报告                                 | 6  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介                      | 6  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明               | 8  |
| 4.3 公平交易专项说明                             | 8  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析                     | 9  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现                          | 9  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明                | 9  |
| §5 投资组合报告                                | 10 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况                         | 10 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                     | 10 |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细     | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合                   | 12 |
| 5.5 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债券投资明细     | 12 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 | 12 |
| 5.7 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    | 12 |
| 5.8 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权证投资明细     | 12 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明                 | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                | 13 |
| 5.11 投资组合报告附注                            | 13 |
| §6 开放式基金份额变动                             | 13 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况                    | 14 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况                     | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细                 | 14 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息                        | 14 |
| 8.1 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        | 14 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息                       | 14 |
| §9 备查文件目录                                | 15 |
| 9.1 备查文件目录                               | 15 |
| 9.2 存放地点                                 | 15 |
| 9.3 查阅方式                                 | 15 |

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 博道成长智航股票  |
| 基金主代码      | 013641  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2021年10月26日   |
| 报告期末基金份额总额 | 2,536,131,893.47份   |
| 投资目标       | 本基金重点关注成长风格相关上市公司股票的投资机会，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，重点关注成长风格相关上市公司股票的投资机会，选取中信成长风格指数为业绩比较基准中股票资产部分的基准指数，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。首先，综合考虑股票的盈利情况、风险情况等因素，筛选出满足一定基本面要求的股票，构建备选股票池。然后，综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合。最后，利用投资组合优化工具，最大化组合的预期收益，以此来确定 |

|                 |   |                       |
|-----------------|---|-----------------------|
|                 | 个股的投资权重, 并根据市场的变化及时调整投资组合, 力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、参与融资业务的策略和存托凭证投资策略详见法律文件。 |                       |
| 业绩比较基准          | 中信成长风格指数收益率×90%+同期银行活期存款利率(税后)×10%  |                       |
| 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。   |                       |
| 基金管理人           | 博道基金管理有限公司  |                       |
| 基金托管人           | 广发证券股份有限公司  |                       |
| 下属分级基金的基金简称     | 博道成长智航股票A   | 博道成长智航股票C             |
| 下属分级基金的交易代码     | 013641  | 013642                |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1, 480, 190, 711. 96份   | 1, 055, 941, 181. 51份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2022年01月01日 - 2022年03月31日) |                    |
|-----------------|--------------------------------|--------------------|
|                 | 博道成长智航股票A                      | 博道成长智航股票C          |
| 1. 本期已实现收益      | -194, 153, 217. 88             | -140, 120, 529. 06 |
| 2. 本期利润         | -254, 792, 557. 24             | -184, 104, 209. 45 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 1639                       | -0. 1653           |
| 4. 期末基金资产净值     | 1, 252, 937, 088. 36           | 891, 906, 827. 74  |
| 5. 期末基金份额净值     | 0. 8465                        | 0. 8447            |

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

## 博道成长智航股票A净值表现

| 阶段         | 净值增长率①  | 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      | -15.95% | 1.53%     | -17.62%    | 1.52%         | 1.67%  | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | -15.35% | 1.24%     | -13.88%    | 1.31%         | -1.47% | -0.07% |

## 博道成长智航股票C净值表现

| 阶段         | 净值增长率①  | 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      | -16.05% | 1.53%     | -17.62%    | 1.52%         | 1.57%  | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | -15.53% | 1.24%     | -13.88%    | 1.31%         | -1.65% | -0.07% |

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

博道成长智航股票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  
(2021年10月26日-2022年03月31日)



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 10 月 26 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

博道成长智航股票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  
(2021年10月26日-2022年03月31日)



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 10 月 26 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 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、博道消费智航、博道成长智航的基金经理、量化投资部总经理兼研究部副总经理 | 2021-10-26  | -    | 11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，现任量化投资部总经理兼研究部副总经理。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、自2021年5月7日起担任博道消费智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2021年10月26日起担任博道成长智航股票型证券投资基金基金经理至今。 |
|--|--|--|--|--|--|

#### 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》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，实现投资组合间公平交易分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现违反公平交易的行为。

##### 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6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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年一季度，宏观和全球环境复杂严峻，不确定性明显增加，大宗商品价格暴涨，权益市场出现持续大幅下跌，其中，沪深300下跌14.53%，中证500下跌14.06%，创业板下跌19.96%，恒生指数下跌5.99%。市场风格反复剧烈，从行业来看，煤炭表现较好，房地产、农林牧渔、银行相对抗跌，电子、国防军工、家电、汽车跌幅较大，均超过20%。从因子表现来看，价值因子持续表现较好，基本面类型的因子在后半季度修复明显。

当前宏观环境较为复杂，海外地缘政治冲突升级，流动性紧缩预期加剧，国内疫情发生频次有所增多，经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，估值和基本面的不确定性都有所抬升。国际政治方面，俄乌冲突升级，政治博弈加剧，短期导致大宗商品价格暴涨，经济增长预期下修，“滞胀”的担忧有所加剧。同时，局部的全球美元流动性冲击和因俄罗斯持仓被冻结引发的减持需要也可能带来影响，风险偏好明显降低。全球流动性方面，美国通胀形势严峻，紧缩趋势明确，对风险资产尤其是成长风格的资产形成压制。国内来看，政策从2021年12月的中央经济工作会议以来已经开始应对基本面的下行，但是，一方面，政策发力到周期下行趋势扭转具有时滞，经济和盈利企稳信号仍有待验证，另一方面，新的国内国际局势也使得“稳增长”难度有所加大，国内疫情发生规模和频次超预期，压制和推迟了消费的“正常化”修复，大宗商品涨价叠加需求走弱，导致中游制造盈利受到挤压。

报告期间，本基金维持配置中信成长风格指数多因子选股增强模型，产品在本报告期间跑赢了业绩比较基准。

市场在一季度的持续大幅下跌已经较为充分地反映了各方面的风险和悲观预期，各主流宽基指数的配置价值已经凸显。政策方面，金融稳定发展委员会会议回应了宏观经济、房地产、中概股、平台经济治理及香港金融市场稳定等方面的市场关切，提振了市场信心，而地产和金融表现相对抗跌，也表明市场对部分风险暴露领域的信心开始有所恢复，后续基本面见底或只是时间问题。

风险是涨出来的，价值是跌出来的。在市场情绪悲观的时候，不妨多一点乐观主义，坚定信心，相信中国经济长期的增长潜力，相信中国优秀公司风雨中成长的能力。

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，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                    | 金额(元)            | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-----------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资                  | 1,974,157,017.86 | 91.68            |
|    | 其中：股票                 | 1,974,157,017.86 | 91.68            |
| 2  | 基金投资                  | -                | -                |
| 3  | 固定收益投资                | 80,805,046.66    | 3.75             |
|    | 其中：债券                 | 80,805,046.66    | 3.75             |
|    | 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<br>返售金融资产 | -                | -                |
| 7  | 银行存款和结算备付金合<br>计      | 96,718,467.58    | 4.49             |
| 8  | 其他资产                  | 1,697,730.80     | 0.08             |
| 9  | 合计                    | 2,153,378,262.90 | 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。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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              | 14,336,938.22    | 0.67          |
| B  | 采矿业                   | 46,162,885.00    | 2.15          |
| C  | 制造业                   | 1,445,302,240.03 | 67.38         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生<br>生产和供应业 | 20,584,706.56    | 0.96          |
| E  | 建筑业                   | 20,548,680.00    | 0.96          |
| F  | 批发和零售业                | 26,332,919.02    | 1.23          |

|   |                 |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 51,041,045.90    | 2.38  |
| H | 住宿和餐饮业          | 1,068,379.07     | 0.05  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 253,713,126.46   | 11.83 |
| J | 金融业             | 17,418,213.58    | 0.81  |
| K | 房地产业            | 6,220,434.00     | 0.29  |
| L | 租赁和商务服务业        | 27,206,345.81    | 1.27  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 20,712,541.59    | 0.97  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 2,669,392.00     | 0.12  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -                | -     |
| P | 教育              | -                | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 10,629,277.10    | 0.50  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 10,209,893.52    | 0.48  |
| S | 综合              | -                | -     |
|   | 合计              | 1,974,157,017.86 | 92.04 |

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 300750 | 宁德时代 | 208,144   | 106,632,171.20 | 4.97         |
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 218,548   | 27,460,556.20  | 1.28         |
| 3  | 600233 | 圆通速递 | 1,582,682 | 27,301,264.50  | 1.27         |
| 4  | 002371 | 北方华创 | 91,496    | 25,069,904.00  | 1.17         |
| 5  | 688005 | 容百科技 | 186,829   | 24,179,409.18  | 1.13         |
| 6  | 002008 | 大族激光 | 588,333   | 22,568,453.88  | 1.05         |
| 7  | 688099 | 晶晨股份 | 199,673   | 22,543,081.70  | 1.05         |
| 8  | 688122 | 西部超导 | 257,107   | 22,270,608.34  | 1.04         |
| 9  | 600718 | 东软集团 | 1,813,992 | 21,513,945.12  | 1.00         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 10 | 002049 | 紫光国微 | 103,349 | 21,139,004.46 | 0.99 |
|----|--------|------|---------|---------------|------|

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 80,335,013.70 | 3.75         |
| 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） | 470,032.96    | 0.02         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 80,805,046.66 | 3.77         |

#### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019666 | 22国债01 | 800,000 | 80,335,013.70 | 3.75         |
| 2  | 118007 | 山石转债   | 4,700   | 470,032.96    | 0.02         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.10 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。

**5.11 投资组合报告附注**

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2 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。

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 1,697,730.80 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,697,730.80 |

**5.11.4 报告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。

**5.11.5 报告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。

**5.11.6 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。

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

|                               | 博道成长智航股票A        | 博道成长智航股票C        |
|-------------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 1,621,392,996.40 | 1,171,980,429.74 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 23,543,582.19    | 15,996,772.99    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 164,745,866.63   | 132,036,021.22   |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -                | -                |

|             |                  |                  |
|-------------|------------------|------------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 1,480,190,711.96 | 1,055,941,181.51 |
|-------------|------------------|------------------|

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          | 博道成长智航股票A    | 博道成长智航股票C    |
|--------------------------|--------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 2,000,480.18 | 1,000,540.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | 3,204,896.06 | 0.00         |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 0.00         | 0.00         |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 5,205,376.24 | 1,000,540.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.35         | 0.09         |

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则买入/申购总份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则卖出/赎回总份额中包含该业务；

3、分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。非分级基金“报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）”的计算中，比例的分母采用期末基金份额总额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份）      | 交易金额（元）      | 适用费率   |
|----|------|------------|--------------|--------------|--------|
| 1  | 申购   | 2022-01-25 | 3,204,896.06 | 3,000,000.00 | 0.0005 |
| 合计 |      |            | 3,204,896.06 | 3,000,000.00 |        |

注：本基金管理人投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。自2022年1月1日起本基金已完成新金融工具准则的切换。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则未对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道成长智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道成长智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道成长智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道成长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成长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、报告期内博道成长智航股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 9.3 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](http://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

2022年04月22日