

# 博道久航混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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:兴业证券股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人兴业证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29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2023年01月01日起至2023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	6
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	74
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	74
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	74
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	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76

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.....	76
§9 开放式基金份额变动.....	76
§10 重大事件揭示.....	77
10.1 基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4 基金投资策略的改变.....	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
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.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8 其他重大事件.....	79
§11 备查文件目录.....	80
11.1 备查文件目录.....	80
11.2 存放地点.....	80
11.3 查阅方式.....	80

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博道久航混合型证券投资基金	
基金简称	博道久航混合	
基金主代码	008318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月24日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	兴业证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	171,564,185.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道久航混合A	博道久航混合C
下属分级基金的交易代码	008318	008319
报告期末下属分级基金的份额总额	113,600,836.15份	57,963,348.96份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，结合宏观基本面、指数价量特征、风险偏好、资金流向等多维度因素的分析，确定和调整资产配置比例，根据对市场环境以及股票估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子表现的判断挑选个股构建股票组合，根据对利率、经济周期、宏观政策等因素的分析构建债券组合。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	兴业证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶文瑛	李少峰
	联系电话	021-80226288	021-20370710
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95562
传真		021-80226289	0591-38507797
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	福建省福州市湖东路268号证券大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海浦东新区长柳路36号兴业证券大厦11楼
邮政编码		200122	200135
法定代表人		莫泰山	杨华辉

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	博道久航混合A	博道久航混合C
本期已实现收益	3,298,998.24	919,946.87
本期利润	5,815,013.44	1,899,368.16
加权平均基金份额本期利润	0.0443	0.0320
本期加权平均净值利润率	3.72%	2.73%
本期基金份额净值增长率	2.90%	2.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	20,443,180.90	9,234,461.66
期末可供分配基金份额利润	0.1800	0.1593
期末基金资产净值	134,044,017.05	67,197,810.62
期末基金份额净值	1.1800	1.1593
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	18.00%	15.93%

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

博道久航混合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	3.13%	0.73%	0.61%	0.69%	2.52%	0.04%

过去三个月	-2.19%	0.69%	-3.89%	0.64%	1.70%	0.05%
过去六个月	2.90%	0.71%	0.50%	0.64%	2.40%	0.07%
过去一年	-13.80%	0.87%	-9.38%	0.76%	-4.42%	0.11%
过去三年	7.45%	1.13%	-1.59%	0.93%	9.04%	0.20%
自基金合同生效起至今	18.00%	1.14%	5.11%	0.97%	12.89%	0.17%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道久航混合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	3.09%	0.73%	0.61%	0.69%	2.48%	0.04%
过去三个月	-2.31%	0.69%	-3.89%	0.64%	1.58%	0.05%
过去六个月	2.65%	0.71%	0.50%	0.64%	2.15%	0.07%
过去一年	-14.23%	0.87%	-9.38%	0.76%	-4.85%	0.11%
过去三年	5.84%	1.13%	-1.59%	0.93%	7.43%	0.20%
自基金合同生效起至今	15.93%	1.14%	5.11%	0.97%	10.82%	0.17%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，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



博道久航混合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  
(2019年12月24日-2023年06月30日)



注：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。

博道久航混合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  
(2019年12月24日-2023年06月30日)



注：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25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、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金和博道和祥多元稳健债券型证券投资基金。

#### 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、博道消费智航、博道成长智航股票的基金经理、量化投资部总经理兼研究部副总经理	2019-12-24	-	12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

				<p>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。</p>
--	--	--	--	--

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8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

2023年上半年，市场先扬后抑，呈现出较强的小市值风格。沪深300下跌0.75%，中证500上涨2.29%，中证1000上涨5.10%，创业板指下跌5.61%，恒生指数下跌4.37%。从行业来看，通信、传媒、计算机表现较好，分别上涨45.4%、43.4%、32.3%，消费者服务、房地产、农林牧渔表现较差，分别下跌27.9%、14.1%、9.2%。

从因子层面来看，一季度因子表现延续去年四季度的格局，呈现强反转弱动量的格局，基本面动量类因子表现较差，估值和量价因子表现出色，二季度以来各类型因子均表现较好，景气类因子修复明显，弹性略大一些。博道“指数+”系列产品在相对均衡的因子权重配置下，一季度超额总体走平，二季度以来超额收益表现较好，逐渐体现出一季度多因子选股模型几项重要升级后的效果。

#### 4.4.2 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 主要会计数据和财务指标"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。

#### 4.5 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，尽管市场在中长期担忧下对短周期拐点越来越谨慎，需要更多的数据和更持续的改善做验证，但权益资产当前处于赔率和胜率都较高的底部区域，经济慢慢进入到低库存状态，一旦有需求端的边际利好出现，市场将有较为敏感的反应，因此，我们对权益资产维持积极的态度。

本基金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。

#### 4.6 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。

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本次报告期内，基金托管人兴业证券股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定，遵守基金合同和托管协议的约定，勤勉尽责履行基金托管人职责，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本次报告期内，基金托管人根据相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害基金份额持有人利益的行为，基金管理人在各重要方面的运作符合法律规定和基金合同约定。

### 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

基金托管人复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

## §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：博道久航混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,106,441.84	8,071,419.27
结算备付金		62,518.39	62,142.97
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	188,372,868.93	240,519,808.19
其中：股票投资		179,693,212.75	228,791,036.55
基金投资		-	-
债券投资		8,679,656.18	11,728,771.64
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,982.45	6,372.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		202,547,811.61	248,659,742.73
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		240,764.82	472,892.74
应付管理人报酬		247,384.96	323,429.82
应付托管费		41,230.83	53,904.94
应付销售服务费		27,412.30	30,240.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	749,190.69	170,002.70
负债合计		1,305,983.94	1,050,470.44
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	171,564,185.11	216,858,036.62
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	29,677,642.56	30,751,235.67
净资产合计		201,241,827.67	247,609,272.29
负债和净资产总计		202,547,811.61	248,659,742.73

注：本报告期末基金份额净值请见"3.1 主要会计数据和财务指标"；基金份额请见"2.1 基金基本情况"。

## 6.2 利润表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		9,943,624.20	-24,816,927.32
1.利息收入		50,694.03	76,881.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	50,693.92	76,881.24
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		0.11	0.18
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,392,897.81	-44,076,292.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,999,676.05	-46,613,773.79
基金投资收益		-	-



债券投资收益	6.4.7.11	122,369.22	232,332.49
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	2,270,852.54	2,305,148.84
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	6.4.7.15	3,495,436.49	19,173,637.59
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.16	4,595.87	8,846.13
<b>减：二、营业总支出</b>		2,229,242.60	3,113,548.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,684,483.04	2,393,521.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	280,747.15	398,920.32
3. 销售服务费		172,459.34	231,846.29
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,250.22	-
其中：卖出回购金融资产 支出		7,250.22	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.29	0.18
8. 其他费用	6.4.7.17	84,302.56	89,260.15
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		7,714,381.60	-27,930,475.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		7,714,381.60	-27,930,475.88

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,714,381.60	-27,930,475.88

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	216,858,036.62	-	30,751,235.67	247,609,272.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	216,858,036.62	-	30,751,235.67	247,609,272.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,293,851.51	-	-1,073,593.11	-46,367,444.62
（一）、综合收益总额	-	-	7,714,381.60	7,714,381.60
（二）、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）	-45,293,851.51	-	-8,787,974.71	-54,081,826.22

其中：1.基金申购款	2,654,410.02	-	479,283.75	3,133,693.77
2.基金赎回款	-47,948,261.53	-	-9,267,258.46	-57,215,519.99
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	171,564,185.11	-	29,677,642.56	201,241,827.67
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	255,571,046.46	-	120,448,827.83	376,019,874.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	255,571,046.46	-	120,448,827.83	376,019,874.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,319,366.59	-	-32,351,293.57	-45,670,660.16

（一）、综合收益总额	-	-	-27,930,475.88	-27,930,475.88
（二）、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）	-13,319,366.59	-	-4,420,817.69	-17,740,184.28
其中：1.基金申购款	19,432,631.68	-	5,511,624.27	24,944,255.95
2.基金赎回款	-32,751,998.27	-	-9,932,441.96	-42,684,440.23
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	242,251,679.87	-	88,097,534.26	330,349,214.13

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

博道久航混合型证券投资基金（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]2205号《关于准予博道久航混合型证券投资

资基金注册的批复》注册，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《博道久航混合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1,928,396,615.02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0751号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道久航混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,929,027,886.06份基金份额，其中认购资金利息折合631,271.04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，基金托管人为兴业证券股份有限公司。

根据《博道久航混合型证券投资基金基金合同》和《博道久航混合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《博道久航混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（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）。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为50%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金和应收申购款等。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800指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规

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》、《博道久航混合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2023年01月01日至2023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2023年06月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年06月30日止期间的经营成果和净资产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 2023年06月30日
活期存款	2,565,770.56
等于：本金	2,564,864.43
加：应计利息	906.13
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	11,540,671.28
等于：本金	11,539,061.77
加：应计利息	1,609.51
减：坏账准备	-
合计	14,106,441.84

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 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	179,728,927.71	-	179,693,212.75	-35,714.96	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,545,996.11	102,932.00	8,679,656.18	30,728.07
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,545,996.11	102,932.00	8,679,656.18	30,728.07
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	188,274,923.82	102,932.00	188,372,868.93	-4,986.89	

注：如果本报告期末本基金持有中国存托凭证，则股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 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 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16.13
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	189,507.37
其他应付	534,872.00
合计	749,190.69

**6.4.7.7 实收基金****6.4.7.7.1 博道久航混合A**

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	155,168,237.84	155,168,237.84

本期申购	1,245,835.74	1,245,835.74
本期赎回（以“-”号填列）	-42,813,237.43	-42,813,237.43
本期末	113,600,836.15	113,600,836.15

#### 6.4.7.7.2 博道久航混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,689,798.78	61,689,798.78
本期申购	1,408,574.28	1,408,574.28
本期赎回（以“-”号填列）	-5,135,024.10	-5,135,024.10
本期末	57,963,348.96	57,963,348.96

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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 博道久航混合A

单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	46,860,392.16	-24,094,574.12	22,765,818.04
本期利润	3,298,998.24	2,516,015.20	5,815,013.44
本期基金份额交易产生的变动数	-13,846,577.59	5,708,927.01	-8,137,650.58
其中：基金申购款	402,418.35	-162,123.34	240,295.01
基金赎回款	-14,248,995.94	5,871,050.35	-8,377,945.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,312,812.81	-15,869,631.91	20,443,180.90

##### 6.4.7.8.2 博道久航混合C

单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	17,495,988.01	-9,510,570.38	7,985,417.63
本期利润	919,946.87	979,421.29	1,899,368.16
本期基金份额交易产生的变动数	-1,136,127.74	485,803.61	-650,324.13
其中：基金申购款	430,097.74	-191,109.00	238,988.74
基金赎回款	-1,566,225.48	676,912.61	-889,312.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,279,807.14	-8,045,345.48	9,234,461.66

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	17,659.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	32,658.90
结算备付金利息收入	375.42
其他	-
合计	50,693.92

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	1,325,260,773.56
减：卖出股票成本总额	1,318,124,850.43
减：交易费用	3,136,247.08
买卖股票差价收入	3,999,676.05

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	74,458.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	47,910.50
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	122,369.22

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,436,826.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,135,884.81
减：应计利息总额	253,011.71
减：交易费用	19.43
买卖债券差价收入	47,910.50

**6.4.7.12 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。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,270,852.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,270,852.54

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	3,495,436.49
——股票投资	3,456,408.42
——债券投资	39,028.07
——资产支持证券投资	-
——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	3,495,436.49

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	4,593.58
转换费收入	2.29
合计	4,595.87

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产；
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，A类份额将不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产，C类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
合计	84,302.56

#### 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

根据本基金的基金管理人于2023年8月12日公布的《博道基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，经与各基金托管人协商一致，决定自2023年8月14日起，调低旗下部分基金的管理费率和/或托管费率。调整后本基金管理费率和托管费率分别为1.20%和0.20%，本次调整将减少本基金在同等规模下所需承担支付的管理费和托管费。

#### 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
兴业证券股份有限公司	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
兴业证券 股份有限 公司	2,583,759,778.74	100.00%	3,233,107,371.81	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限 公司	12,155,797.82	100.00%	15,023,863.60	100.00%

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限公司	62,502,000.00	100.00%	2,000.00	100.00%

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
兴业证券 股份有限公司	1,605,315.15	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
兴业证券 股份有限公司	2,203,779.44	100.00%	-	-

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。



### 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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,684,483.04	2,393,521.62
其中：支付销售机构的客户维护费	666,756.33	883,762.40

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	280,747.15	398,920.32

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/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 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金管理有限公司	-	3,673.24	3,673.24
兴业证券	-	75,927.85	75,927.85

股份有限 公司			
合计	-	79,601.09	79,601.09
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	4,026.19	4,026.19
兴业证券 股份有限 公司	-	105,551.17	105,551.17
合计	-	109,577.36	109,577.36

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0.50%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×0.50%÷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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

博道久航混合A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,999,800.18	1,999,800.18
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,999,800.18	1,999,800.18
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.76%	1.18%

博道久航混合C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.73%	1.36%

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.如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，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。

#### 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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业证券股份有限公司	11,540,671.28	32,658.90	10,963,709.92	58,038.22

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06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：张/股）	总金额
兴业证券股份有限公司	688435	英方软件	网下发行	2,508	96,959.28
兴业证券股份有限公司	301419	阿莱德	网下发行	3,292	81,641.60
兴业证券股份有限公司	688469	中芯集成	网下发行	23,942	136,229.98
兴业证券股份有限公司	301315	威士顿	网下发行	1,697	54,796.13
兴业证券股份有限公司	601916	浙商银行	配股	148,050	299,061.00
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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：张/股）	总金额
兴业证券股份有限公司	600030	中信证券	配股	24,915	359,523.45

兴业证券 股份有限 公司	301110	青木股份	网下发行	1,830	115,473.00
--------------------	--------	------	------	-------	------------

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023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	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601916	浙商银行	2023-06-27	1个月内（含）	配股未上市	2.02	2.64	148,050	299,061.00	390,852.00	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内（含）	新股未上市	39.78	39.78	1,480	58,874.40	58,874.40	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内（含）	新股未上市	55.00	55.00	907	49,885.00	49,885.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内（含）	新股未上市	36.90	36.90	1,192	43,984.80	43,984.80	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内（含）	新股未上市	25.82	25.82	1,557	40,201.74	40,201.74	-
688249	晶合集成	2023-04-2	6个月以上	科创板打	19.86	18.06	1,271	25,242.06	22,954.26	-

		4		新限售						
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月以上	主板打新限售	9.60	9.41	2,402	23,059.20	22,602.82	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6个月以上	创业板打新限售	5.00	8.96	2,024	10,120.00	18,135.04	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月以上	创业板打新限售	29.60	71.42	217	6,423.20	15,498.14	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月以上	创业板打新限售	20.67	26.17	571	11,802.57	14,943.07	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月以上	创业板打新限售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月以上	科创板打新限售	11.10	17.04	821	9,113.10	13,989.84	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月以上	科创板打新限售	23.60	64.67	206	4,861.60	13,322.02	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月以上	创业板打新限售	23.77	42.89	310	7,368.70	13,295.90	-
6884	中芯	2023	6个月以	科创	5.69	5.41	2,395	13,62	12,95	-

69	集成	-04-28	上	板打 新限售				7.55	6.95	
3013 20	豪江 智能	2023 -06-01	6个月以 上	创业 板打 新限售	13.06	20.62	604	7,88 8.24	12,45 4.48	-
3012 60	格力 博	2023 -01-20	6个月以 上	创业 板打 新限售	30.85	23.63	505	15,57 9.25	11,93 3.15	-
6884 43	智翔 金泰	2023 -06-13	6个月以 上	科创 板打 新限售	37.88	29.49	399	15,11 4.12	11,76 6.51	-
3013 25	曼恩 斯特	2023 -05-04	6个月以 上	创业 板打 新限售	76.80	107.9 5	105	8,06 4.00	11,33 4.75	-
3013 10	鑫宏 业	2023 -05-26	6个月以 上	创业 板打 新限售	67.28	65.43	173	11,63 9.44	11,31 9.39	-
3013 03	真兰 仪表	2023 -02-13	6个月以 上	创业 板打 新限售	26.80	22.32	476	12,75 6.80	10,62 4.32	-
6884 78	晶升 股份	2023 -04-13	6个月以 上	科创 板打 新限售	32.52	42.37	249	8,09 7.48	10,55 0.13	-
6886 29	华丰 科技	2023 -06-16	6个月以 上	科创 板打 新限售	9.26	18.59	527	4,88 0.02	9,79 6.93	-

				售						
3013 99	英特 科技	2023 -05-1 6	6个月以 上	创业 板打 新限 售	43.99	51.57	185	8,13 8.15	9,54 0.45	-
6885 31	日联 科技	2023 -03-2 4	6个月以 上	科创 板打 新限 售	152.3 8	135.9 7	70	10,66 6.60	9,51 7.90	-
6885 62	航天 软件	2023 -05-1 5	6个月以 上	科创 板打 新限 售	12.68	22.31	418	5,30 0.24	9,32 5.58	-
3014 08	华人 健康	2023 -02-2 2	6个月以 上	创业 板打 新限 售	16.24	16.95	544	8,83 4.56	9,22 0.80	-
3013 07	美利 信	2023 -04-1 4	6个月以 上	创业 板打 新限 售	32.34	31.86	284	9,18 4.56	9,04 8.24	-
6885 82	芯动 联科	2023 -06-2 1	6个月以 上	科创 板打 新限 售	26.74	40.68	219	5,85 6.06	8,90 8.92	-
3013 83	天键 股份	2023 -05-3 1	6个月以 上	创业 板打 新限 售	46.16	35.72	244	11,26 3.04	8,71 5.68	-
3013 60	荣旗 科技	2023 -04-1 7	6个月以 上	创业 板打 新限 售	71.88	92.60	94	6,75 6.72	8,70 4.40	-
3013	威士	2023	6个月以	创业	32.29	51.12	170	5,48	8,69	-



15	顿	-06-13	上	板打新限售				9.30	0.40	
301387	光大同创	2023-04-10	6个月以上	创业板打新限售	58.32	45.36	187	10,905.84	8,482.32	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月以上	科创板打新限售	39.99	36.71	229	9,157.71	8,406.59	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月以上	创业板打新限售	41.20	42.69	194	7,992.80	8,281.86	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月以上	创业板打新限售	23.80	32.84	252	5,997.60	8,275.68	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月以上	创业板打新限售	38.13	31.03	255	9,723.15	7,912.65	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月以上	科创板打新限售	75.00	90.76	87	6,525.00	7,896.12	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月以上	创业板打新限售	28.75	21.02	372	10,695.00	7,819.44	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月以上	科创板打新限售	36.15	38.13	199	7,193.85	7,587.87	-

				售						
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月以上	科创板打新限售	35.00	51.23	148	5,180.00	7,582.04	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月以上	创业板打新限售	35.66	33.26	226	8,059.16	7,516.76	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月以上	科创板打新限售	11.18	14.59	515	5,757.70	7,513.85	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月以上	科创板打新限售	10.68	12.34	582	6,215.76	7,181.88	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月以上	创业板打新限售	37.40	36.07	198	7,405.20	7,141.86	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月以上	科创板打新限售	43.67	53.05	134	5,851.78	7,108.70	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月以上	科创板打新限售	12.10	12.07	587	7,102.70	7,085.09	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月以上	创业板打新限售	33.73	31.85	222	7,488.06	7,070.70	-
6885	航天	2023	6个月以	科创	21.17	23.50	297	6,28	6,97	-

52	南湖	-05-08	上	板打 新限售				7.49	9.50	
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月以上	科创板打 新限售	21.86	23.85	287	6,273.82	6,844.95	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月以上	创业板打 新限售	14.81	13.73	488	7,227.28	6,700.24	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月以上	创业板打 新限售	57.88	49.17	136	7,871.68	6,687.12	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月以上	科创板打 新限售	14.16	16.21	409	5,791.44	6,629.89	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月以上	科创板打 新限售	20.92	19.16	343	7,175.56	6,571.88	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月以上	创业板打 新限售	39.78	39.78	165	6,563.70	6,563.70	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月以上	创业板打 新限售	56.50	52.93	123	6,949.50	6,510.39	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月以上	创业板打 新限售	72.50	58.42	103	7,467.50	6,017.26	-

				售						
001287	中电港	2023-03-30	6个月以上	主板打新限售	11.88	21.02	286	3,397.68	6,011.72	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月以上	创业板打新限售	50.00	48.39	124	6,200.00	6,000.36	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月以上	科创板打新限售	125.80	118.03	50	6,290.00	5,901.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月以上	创业板打新限售	26.35	30.60	192	5,059.20	5,875.20	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月以上	创业板打新限售	24.66	22.51	259	6,386.94	5,830.09	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月以上	科创板打新限售	26.66	31.50	185	4,932.10	5,827.50	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月以上	创业板打新限售	53.27	40.20	144	7,670.88	5,788.80	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月以上	科创板打新限售	55.00	55.00	101	5,555.00	5,555.00	-
301203	国泰环保	2023-03-2	6个月以上	创业板打	46.13	34.40	161	7,426.93	5,538.40	-

		8		新限售						
688429	时创能源	2023-06-20	6个月以上	科创板打新限售	19.20	25.53	213	4,089.60	5,437.89	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月以上	创业板打新限售	29.99	23.79	227	6,807.73	5,400.33	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月以上	创业板打新限售	39.06	39.36	131	5,116.86	5,156.16	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月以上	创业板打新限售	34.00	34.93	147	4,998.00	5,134.71	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月以上	创业板打新限售	32.60	30.37	168	5,476.80	5,102.16	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月以上	主板打新限售	6.58	7.58	652	4,290.16	4,942.16	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月以上	创业板打新限售	36.90	36.90	133	4,907.70	4,907.70	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月以上	科创板打新限售	25.28	29.87	155	3,918.40	4,629.85	-
6884	友车	2023	6个月以	科创	33.99	29.49	155	5,26	4,57	-

79	科技	-05-04	上	板打 新限售				8.45	0.95	
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月以上	创业板打 新限售	25.82	25.82	173	4,466.86	4,466.86	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月以上	创业板打 新限售	44.18	25.10	162	7,157.16	4,066.20	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月以上	主板打 新限售	28.84	30.78	130	3,749.20	4,001.40	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月以上	主板打 新限售	17.80	17.89	212	3,773.60	3,792.68	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月以上	主板打 新限售	10.36	11.84	256	2,652.16	3,031.04	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月以上	主板打 新限售	11.66	12.26	217	2,530.22	2,660.42	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月以上	主板打 新限售	20.68	25.49	99	2,047.32	2,523.51	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月以上	主板打 新限售	27.93	33.03	76	2,122.68	2,510.28	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月以上	主板打 新限售	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青	2023-05-1	6个月以	主板	18.88	19.60	107	2,020.16	2,097.20	-

	科技	2	上	打新限售						
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月以上	主板打新限售	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月以上	主板打新限售	25.98	24.53	78	2,026.44	1,913.34	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月以上	主板打新限售	15.38	14.87	128	1,968.64	1,903.36	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月以上	主板打新限售	44.48	39.48	44	1,957.12	1,737.12	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	25.10	65	-	1,631.50	-

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

#### 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兴业证券开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于兴业证券，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2023年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.04%(2022年12月31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)。

### 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2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同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上市公司发行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2023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0.61%。

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2023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201,457,270.61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。

#### 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。

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 2023 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	14,106,441.84	-	-	-	-	-	14,106,441.84
结算备付金	62,518.39	-	-	-	-	-	62,518.39
交易性金融资产	511,717.67	-	8,089,540.82	-	78,397.69	179,693,212.75	188,372,868.93
应收申购款	-	-	-	-	-	5,982.45	5,982.45
资产总计	14,680,677.90	-	8,089,540.82	-	78,397.69	179,699,195.20	202,547,811.61
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	240,764.82	240,764.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	247,384.96	247,384.96
应付托管费	-	-	-	-	-	41,230.83	41,230.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	27,412.30	27,412.30

应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	-	749,190.69	749,190.69
负债总计	-	-	-	-	-	1,305,983.94	1,305,983.94
利率敏感度缺口	14,680,677.90	-	8,089,540.82	-	78,397.69	178,393,211.26	201,241,827.67
上年度末 2022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	8,071,419.27	-	-	-	-	-	8,071,419.27
结算备付金	62,142.97	-	-	-	-	-	62,142.97
交易性金融资产	11,222,305.48	-	506,466.16	-	-	228,791,036.55	240,519,808.19
应收申购款	-	-	-	-	-	6,372.30	6,372.30
资产总计	19,355,867.72	-	506,466.16	-	-	228,797,408.85	248,659,742.73
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	472,892.74	472,892.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	323,429.82	323,429.82
应付托管费	-	-	-	-	-	53,904.94	53,904.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,240.24	30,240.24
其他负债	-	-	-	-	-	170,002.70	170,002.70
负债总计	-	-	-	-	-	1,050,470.44	1,050,470.44
利率敏感度缺口	19,355,867.72	-	506,466.16	-	-	227,746,938.41	247,609,272.29

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2023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净资产的比例为4.31% (2022年12月31日：4.74%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2022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股票和债券，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占基金资产的50%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2023年06月30日		上年度末 2022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	179,693,212.75	89.29	228,791,036.55	92.40

产—股票投资				
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	179,693,212.75	89.29	228,791,036.55	92.40

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证800指数收益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：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	8,118,883.30	11,221,571.87
	2.中证800指数收益率下降5%	-8,118,883.30	-11,221,571.87

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	178,924,386.83	226,725,044.22
第二层次	8,815,697.69	11,728,771.64
第三层次	632,784.41	2,065,992.33
合计	188,372,868.93	240,519,808.19

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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股票和债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，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§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	179,693,212.75	88.72
	其中：股票	179,693,212.75	88.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,679,656.18	4.29
	其中：债券	8,679,656.18	4.29
	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	14,168,960.23	7.00
8	其他各项资产	5,982.45	0.00
9	合计	202,547,811.61	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	2,479,600.00	1.23
B	采矿业	2,781,990.48	1.38
C	制造业	112,169,386.67	55.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,476,792.82	2.72
E	建筑业	6,304,460.93	3.13
F	批发和零售业	2,238,313.77	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	5,988,409.00	2.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,877,524.46	1.93
J	金融业	33,687,078.22	16.74

K	房地产业	631,702.00	0.31
L	租赁和商务服务业	602,514.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	606,984.86	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,489,336.40	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,498.14	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,208,079.00	0.60
S	综合	135,542.00	0.07
	合计	179,693,212.75	89.29

### 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	600519	贵州茅台	4,205	7,110,655.00	3.53
2	601318	中国平安	130,597	6,059,700.80	3.01
3	000858	五粮液	30,703	5,022,089.71	2.50
4	600887	伊利股份	117,600	3,330,432.00	1.65
5	600642	申能股份	466,100	3,258,039.00	1.62
6	601668	中国建筑	511,100	2,933,714.00	1.46
7	300274	阳光电源	22,900	2,670,827.00	1.33
8	000596	古井贡酒	10,600	2,622,228.00	1.30
9	002060	粤水电	365,600	2,405,648.00	1.20
10	600837	海通证券	258,100	2,379,682.00	1.18
11	688390	固德威	14,200	2,369,412.00	1.18
12	601688	华泰证券	168,700	2,322,999.00	1.15



13	600517	国网英大	400,200	2,281,140.00	1.13
14	002352	顺丰控股	49,800	2,245,482.00	1.12
15	603345	安井食品	15,100	2,216,680.00	1.10
16	300750	宁德时代	9,540	2,182,656.60	1.08
17	601816	京沪高铁	413,400	2,174,484.00	1.08
18	600958	东方证券	223,652	2,169,424.40	1.08
19	601211	国泰君安	152,500	2,133,475.00	1.06
20	002568	百润股份	56,400	2,050,140.00	1.02
21	000783	长江证券	347,000	2,012,600.00	1.00
22	688599	天合光能	44,124	1,880,123.64	0.93
23	000333	美的集团	31,700	1,867,764.00	0.93
24	688063	派能科技	9,180	1,819,935.00	0.90
25	600031	三一重工	102,900	1,711,227.00	0.85
26	601567	三星医疗	126,100	1,592,643.00	0.79
27	002142	宁波银行	61,471	1,555,216.30	0.77
28	600312	平高电气	124,100	1,537,599.00	0.76
29	000685	中山公用	202,000	1,529,140.00	0.76
30	600919	江苏银行	206,700	1,519,245.00	0.75
31	601336	新华保险	40,900	1,503,893.00	0.75
32	603298	杭叉集团	62,100	1,462,455.00	0.73
33	000157	中联重科	204,500	1,380,375.00	0.69
34	603688	石英股份	12,100	1,377,464.00	0.68
35	600109	国金证券	157,500	1,365,525.00	0.68
36	002772	众兴菌业	119,500	1,350,350.00	0.67
37	300130	新国都	45,800	1,297,514.00	0.64
38	600926	杭州银行	110,300	1,296,025.00	0.64
39	002394	联发股份	150,300	1,279,053.00	0.64
40	300232	洲明科技	139,000	1,270,460.00	0.63
41	002139	拓邦股份	95,900	1,251,495.00	0.62
42	603367	辰欣药业	81,800	1,241,724.00	0.62
43	601077	渝农商行	344,400	1,236,396.00	0.61

44	002966	苏州银行	187,400	1,227,470.00	0.61
45	002448	中原内配	165,500	1,158,500.00	0.58
46	002594	比亚迪	4,200	1,084,734.00	0.54
47	300454	深信服	9,400	1,064,550.00	0.53
48	600612	老凤祥	15,200	1,062,176.00	0.53
49	600582	天地科技	171,000	996,930.00	0.50
50	300674	宇信科技	55,900	988,312.00	0.49
51	688100	威胜信息	32,805	977,917.05	0.49
52	600329	达仁堂	21,600	969,624.00	0.48
53	002600	领益智造	137,400	949,434.00	0.47
54	002266	浙富控股	227,700	940,401.00	0.47
55	002056	横店东磁	49,900	908,679.00	0.45
56	688578	艾力斯	33,500	902,825.00	0.45
57	002402	和而泰	52,800	896,544.00	0.45
58	002603	以岭药业	34,200	878,598.00	0.44
59	000921	海信家电	31,822	857,602.90	0.43
60	605100	华丰股份	46,900	826,847.00	0.41
61	003011	海象新材	25,200	812,700.00	0.40
62	002533	金杯电工	98,700	805,392.00	0.40
63	002038	双鹭药业	79,700	804,173.00	0.40
64	601857	中国石油	107,300	801,531.00	0.40
65	300855	图南股份	22,340	789,048.80	0.39
66	600583	海油工程	134,300	785,655.00	0.39
67	002478	常宝股份	105,100	782,995.00	0.39
68	603567	珍宝岛	52,300	782,408.00	0.39
69	603121	华培动力	83,700	745,767.00	0.37
70	300413	芒果超媒	21,400	732,094.00	0.36
71	603566	普莱柯	31,200	725,400.00	0.36
72	688029	南微医学	8,862	722,784.72	0.36
73	601958	金钼股份	64,600	720,290.00	0.36
74	002422	科伦药业	23,900	709,352.00	0.35

75	603696	安记食品	73,900	697,616.00	0.35
76	300856	科思股份	8,700	685,299.00	0.34
77	600036	招商银行	20,877	683,930.52	0.34
78	688551	科威尔	10,400	682,032.00	0.34
79	300972	万辰生物	15,300	678,402.00	0.34
80	603488	展鹏科技	84,400	677,732.00	0.34
81	301101	明月镜片	16,400	672,892.00	0.33
82	300857	协创数据	25,300	664,884.00	0.33
83	603129	春风动力	4,100	663,790.00	0.33
84	300869	康泰医学	28,500	654,360.00	0.33
85	600785	新华百货	47,900	650,961.00	0.32
86	603768	常青股份	36,400	646,828.00	0.32
87	603156	养元饮品	25,900	639,730.00	0.32
88	000063	中兴通讯	13,819	629,317.26	0.31
89	600633	浙数文化	38,000	615,980.00	0.31
90	002223	鱼跃医疗	16,900	608,231.00	0.30
91	601137	博威合金	38,700	602,172.00	0.30
92	600060	海信视像	24,200	598,950.00	0.30
93	603628	清源股份	37,100	587,293.00	0.29
94	002025	航天电器	9,200	586,960.00	0.29
95	601916	浙商银行	219,450	579,348.00	0.29
96	603757	大元泵业	19,200	572,928.00	0.28
97	002956	西麦食品	36,600	572,058.00	0.28
98	002027	分众传媒	82,400	561,144.00	0.28
99	300246	宝莱特	43,800	545,310.00	0.27
100	300729	乐歌股份	29,900	533,416.00	0.27
101	600537	亿晶光电	69,300	529,452.00	0.26
102	600197	伊力特	19,400	527,098.00	0.26
103	300871	回盛生物	31,300	515,824.00	0.26
104	605499	东鹏饮料	2,900	501,410.00	0.25
105	000338	潍柴动力	40,200	500,892.00	0.25

106	601601	中国太保	18,300	475,434.00	0.24
107	002179	中航光电	10,400	471,640.00	0.23
108	605066	天正电气	49,900	469,559.00	0.23
109	605288	凯迪股份	10,900	469,136.00	0.23
110	002012	凯恩股份	71,700	466,767.00	0.23
111	000625	长安汽车	35,900	464,187.00	0.23
112	603215	比依股份	25,700	461,058.00	0.23
113	600351	亚宝药业	64,700	459,370.00	0.23
114	300970	华绿生物	19,300	450,848.00	0.22
115	300937	药易购	14,100	448,239.00	0.22
116	600748	上实发展	113,300	447,535.00	0.22
117	002563	森马服饰	71,900	447,218.00	0.22
118	000521	长虹美菱	58,500	446,940.00	0.22
119	601128	常熟银行	64,800	441,936.00	0.22
120	603508	思维列控	25,900	441,595.00	0.22
121	600267	海正药业	38,400	436,992.00	0.22
122	000919	金陵药业	55,600	434,792.00	0.22
123	600323	瀚蓝环境	22,900	433,497.00	0.22
124	300308	中际旭创	2,900	427,605.00	0.21
125	600458	时代新材	35,600	426,844.00	0.21
126	601519	大智慧	59,600	426,736.00	0.21
127	603697	有友食品	45,300	415,401.00	0.21
128	601966	玲珑轮胎	18,600	413,292.00	0.21
129	600420	国药现代	36,600	413,214.00	0.21
130	600587	新华医疗	11,600	409,828.00	0.20
131	600728	佳都科技	58,000	401,940.00	0.20
132	603045	福达合金	26,500	401,210.00	0.20
133	300943	春晖智控	23,350	396,016.00	0.20
134	300866	安克创新	4,500	393,750.00	0.20
135	002419	天虹股份	67,200	393,120.00	0.20
136	002576	通达动力	19,300	385,807.00	0.19

137	601319	中国人保	65,700	383,688.00	0.19
138	603003	龙宇股份	39,700	379,135.00	0.19
139	300206	理邦仪器	24,800	373,984.00	0.19
140	301004	嘉益股份	9,600	372,480.00	0.19
141	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.18
142	600616	金枫酒业	53,000	364,640.00	0.18
143	300434	金石亚药	26,900	364,226.00	0.18
144	600908	无锡银行	64,500	345,720.00	0.17
145	688072	拓荆科技	800	340,776.00	0.17
146	603027	千禾味业	16,100	340,032.00	0.17
147	000528	柳工	41,900	331,010.00	0.16
148	600488	津药药业	58,800	330,456.00	0.16
149	600129	太极集团	5,500	327,195.00	0.16
150	600551	时代出版	29,600	327,080.00	0.16
151	002620	瑞和股份	62,200	323,440.00	0.16
152	002459	晶澳科技	7,700	321,090.00	0.16
153	600170	上海建工	115,900	311,771.00	0.15
154	300545	联得装备	10,800	299,916.00	0.15
155	300872	天阳科技	19,100	296,814.00	0.15
156	600368	五洲交通	81,100	295,204.00	0.15
157	603040	新坐标	11,100	295,149.00	0.15
158	600390	五矿资本	54,800	294,824.00	0.15
159	002334	英威腾	23,100	294,294.00	0.15
160	000938	紫光股份	9,180	292,383.00	0.15
161	300638	广和通	12,700	288,036.00	0.14
162	300447	全信股份	14,900	285,931.00	0.14
163	600512	腾达建设	105,000	281,400.00	0.14
164	688128	中国电研	11,000	280,500.00	0.14
165	601628	中国人寿	7,700	269,192.00	0.13
166	600028	中国石化	41,500	263,940.00	0.13
167	301087	可孚医疗	5,300	261,290.00	0.13

168	002580	圣阳股份	27,000	253,530.00	0.13
169	000400	许继电气	10,800	248,940.00	0.12
170	600020	中原高速	67,100	246,257.00	0.12
171	002236	大华股份	11,599	229,080.25	0.11
172	603209	兴通股份	10,800	229,068.00	0.11
173	301297	富乐德	10,147	228,408.97	0.11
174	601600	中国铝业	41,600	228,384.00	0.11
175	301211	亨迪药业	9,000	224,100.00	0.11
176	688120	华海清科	874	220,291.70	0.11
177	003006	百亚股份	12,700	219,456.00	0.11
178	002987	京北方	9,500	208,240.00	0.10
179	002893	京能热力	19,300	207,861.00	0.10
180	688496	清越科技	10,160	201,980.80	0.10
181	300407	凯发电气	22,100	201,773.00	0.10
182	301257	普蕊斯	3,300	185,460.00	0.09
183	688569	铁科轨道	4,401	185,150.07	0.09
184	002357	富临运业	27,200	182,784.00	0.09
185	300185	通裕重工	65,500	182,745.00	0.09
186	600897	厦门空港	8,800	182,072.00	0.09
187	301301	川宁生物	20,238	181,332.48	0.09
188	002017	东信和平	13,700	179,607.00	0.09
189	002612	朗姿股份	7,200	171,216.00	0.09
190	002511	中顺洁柔	15,300	170,595.00	0.08
191	002540	亚太科技	29,400	169,932.00	0.08
192	600035	楚天高速	41,300	168,504.00	0.08
193	002566	益盛药业	20,200	168,064.00	0.08
194	002077	大港股份	11,200	167,440.00	0.08
195	603689	皖天然气	19,000	166,630.00	0.08
196	301030	仕净科技	2,400	165,840.00	0.08
197	300842	帝科股份	1,800	164,592.00	0.08
198	000605	渤海股份	25,900	163,688.00	0.08

199	300194	福安药业	41,600	161,408.00	0.08
200	002393	力生制药	6,600	161,040.00	0.08
201	600269	赣粤高速	43,400	159,278.00	0.08
202	301039	中集车辆	11,800	156,114.00	0.08
203	688410	山外山	2,952	154,980.00	0.08
204	601311	骆驼股份	16,700	154,976.00	0.08
205	002728	特一药业	9,840	150,060.00	0.07
206	600985	淮北矿业	13,000	149,760.00	0.07
207	601163	三角轮胎	9,400	149,178.00	0.07
208	002454	松芝股份	17,500	148,225.00	0.07
209	600073	上海梅林	20,300	148,190.00	0.07
210	300997	欢乐家	10,100	147,157.00	0.07
211	603683	晶华新材	12,600	145,782.00	0.07
212	600629	华建集团	20,700	144,486.00	0.07
213	300304	云意电气	25,900	143,486.00	0.07
214	300314	戴维医疗	6,700	141,638.00	0.07
215	000153	丰原药业	14,000	141,400.00	0.07
216	600531	豫光金铅	22,200	139,860.00	0.07
217	002809	红墙股份	12,700	137,160.00	0.07
218	000551	创元科技	12,200	135,542.00	0.07
219	002788	鹭燕医药	14,200	135,326.00	0.07
220	002133	广宇集团	39,900	135,261.00	0.07
221	002412	汉森制药	20,400	134,028.00	0.07
222	605196	华通线缆	18,800	133,856.00	0.07
223	002358	森源电气	28,900	132,073.00	0.07
224	603393	新天然气	4,800	128,832.00	0.06
225	600372	中航电子	8,400	127,512.00	0.06
226	688639	华恒生物	1,400	126,672.00	0.06
227	300349	金卡智能	8,700	120,756.00	0.06
228	688629	华丰科技	5,267	119,859.73	0.06
229	300693	盛弘股份	3,100	114,452.00	0.06

230	603218	日月股份	6,000	113,940.00	0.06
231	688676	金盘科技	3,749	113,557.21	0.06
232	300811	铂科新材	1,900	112,936.00	0.06
233	002170	芭田股份	16,400	112,668.00	0.06
234	002500	山西证券	20,100	112,158.00	0.06
235	600516	方大炭素	18,000	111,600.00	0.06
236	688033	天宜上佳	5,800	110,896.00	0.06
237	300864	南大环境	5,000	109,900.00	0.05
238	300443	金雷股份	3,100	109,895.00	0.05
239	300512	中亚股份	12,100	109,626.00	0.05
240	300882	万胜智能	3,800	107,844.00	0.05
241	600705	中航产融	27,300	104,559.00	0.05
242	301280	珠城科技	2,922	104,490.72	0.05
243	301222	浙江恒威	3,500	103,075.00	0.05
244	688582	芯动联科	2,181	100,828.62	0.05
245	000705	浙江震元	12,500	100,625.00	0.05
246	601997	贵阳银行	19,500	100,620.00	0.05
247	600513	联环药业	10,400	100,464.00	0.05
248	000617	中油资本	13,600	98,328.00	0.05
249	002255	海陆重工	16,200	98,172.00	0.05
250	301029	怡合达	2,000	89,360.00	0.04
251	000563	陕国投 A	28,700	87,535.00	0.04
252	301291	明阳电气	2,543	82,501.45	0.04
253	688620	安凯微	5,814	77,395.32	0.04
254	301295	美硕科技	1,974	75,215.94	0.04
255	301210	金杨股份	1,353	69,155.73	0.03
256	301488	豪恩汽电	1,645	65,438.10	0.03
257	603861	白云电器	6,800	65,280.00	0.03
258	688429	时创能源	2,130	60,935.04	0.03
259	301397	溯联股份	1,438	60,654.40	0.03
260	601156	东航物流	4,400	57,200.00	0.03



261	605599	菜百股份	4,300	56,803.00	0.03
262	600757	长江传媒	6,600	56,760.00	0.03
263	300724	捷佳伟创	500	56,175.00	0.03
264	688603	天承科技	1,008	55,440.00	0.03
265	301170	锡南科技	1,466	54,201.51	0.03
266	002489	浙江永强	13,200	53,460.00	0.03
267	002688	金河生物	11,100	52,392.00	0.03
268	300773	拉卡拉	3,000	52,320.00	0.03
269	605577	龙版传媒	4,500	51,255.00	0.03
270	600202	哈空调	9,100	50,869.00	0.03
271	002730	电光科技	5,300	50,774.00	0.03
272	002660	茂硕电源	5,200	50,076.00	0.02
273	688631	莱斯信息	1,549	50,018.49	0.02
274	600888	新疆众和	6,300	49,896.00	0.02
275	300439	美康生物	4,400	49,764.00	0.02
276	601187	厦门银行	9,900	49,698.00	0.02
277	000926	福星股份	11,700	48,906.00	0.02
278	301261	恒工精密	1,325	48,892.50	0.02
279	603939	益丰药房	1,300	48,100.00	0.02
280	601518	吉林高速	20,200	48,076.00	0.02
281	301202	朗威股份	1,730	44,668.60	0.02
282	000987	越秀资本	6,900	43,815.00	0.02
283	603686	福龙马	4,200	43,806.00	0.02
284	002116	中国海诚	3,400	43,452.00	0.02
285	002423	中粮资本	5,400	43,200.00	0.02
286	600120	浙江东方	11,100	42,513.00	0.02
287	600760	中航沈飞	940	42,300.00	0.02
288	300284	苏交科	7,000	42,000.00	0.02
289	000937	冀中能源	6,500	41,470.00	0.02
290	600967	内蒙一机	4,100	41,410.00	0.02
291	000415	渤海租赁	19,700	41,370.00	0.02

292	600901	江苏金租	9,940	41,052.20	0.02
293	000156	华数传媒	4,700	40,890.00	0.02
294	000777	中核科技	2,900	39,121.00	0.02
295	605009	豪悦护理	800	38,400.00	0.02
296	600637	东方明珠	4,700	36,754.00	0.02
297	688019	安集科技	200	32,966.00	0.02
298	603983	丸美股份	900	29,115.00	0.01
299	600315	上海家化	952	27,617.52	0.01
300	688249	晶合集成	1,271	22,954.26	0.01
301	001286	陕西能源	2,402	22,602.82	0.01
302	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.01
303	301293	三博脑科	217	15,498.14	0.01
304	301317	鑫磊股份	571	14,943.07	0.01
305	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
306	688472	阿特斯	821	13,989.84	0.01
307	688361	中科飞测	206	13,322.02	0.01
308	301358	湖南裕能	310	13,295.90	0.01
309	688469	中芯集成	2,395	12,956.95	0.01
310	301320	豪江智能	604	12,454.48	0.01
311	301260	格力博	505	11,933.15	0.01
312	688443	智翔金泰	399	11,766.51	0.01
313	301325	曼恩斯特	105	11,334.75	0.01
314	301310	鑫宏业	173	11,319.39	0.01
315	301303	真兰仪表	476	10,624.32	0.01
316	688478	晶升股份	249	10,550.13	0.01
317	301399	英特科技	185	9,540.45	0.00
318	688531	日联科技	70	9,517.90	0.00
319	688562	航天软件	418	9,325.58	0.00
320	301408	华人健康	544	9,220.80	0.00
321	301307	美利信	284	9,048.24	0.00
322	301383	天键股份	244	8,715.68	0.00

323	301360	荣旗科技	94	8,704.40	0.00
324	301315	威士顿	170	8,690.40	0.00
325	301387	光大同创	187	8,482.32	0.00
326	688484	南芯科技	229	8,406.59	0.00
327	301141	中科磁业	194	8,281.86	0.00
328	301382	蜂助手	252	8,275.68	0.00
329	688458	美芯晟	87	7,896.12	0.00
330	301429	森泰股份	372	7,819.44	0.00
331	688146	中船特气	199	7,587.87	0.00
332	688535	华海诚科	148	7,582.04	0.00
333	301225	恒勃股份	226	7,516.76	0.00
334	688593	新相微	515	7,513.85	0.00
335	688543	国科军工	134	7,108.70	0.00
336	688352	颀中科技	587	7,085.09	0.00
337	301373	凌玮科技	222	7,070.70	0.00
338	688552	航天南湖	297	6,979.50	0.00
339	688523	航天环宇	287	6,844.95	0.00
340	301332	德尔玛	488	6,700.24	0.00
341	688334	西高院	409	6,629.89	0.00
342	688512	慧智微	343	6,571.88	0.00
343	301157	华塑科技	123	6,510.39	0.00
344	301232	飞沃科技	103	6,017.26	0.00
345	001287	中电港	286	6,011.72	0.00
346	301357	北方长龙	124	6,000.36	0.00
347	688581	安杰思	50	5,901.50	0.00
348	301428	世纪恒通	192	5,875.20	0.00
349	301376	致欧科技	259	5,830.09	0.00
350	688433	华曙高科	185	5,827.50	0.00
351	301281	科源制药	227	5,697.70	0.00
352	301203	国泰环保	161	5,538.40	0.00
353	301386	未来电器	227	5,400.33	0.00

354	301323	新莱福	131	5,156.16	0.00
355	301337	亚华电子	168	5,102.16	0.00
356	601061	中信金属	652	4,942.16	0.00
357	688479	友车科技	155	4,570.95	0.00
358	001380	华纬科技	130	4,001.40	0.00
359	603135	中重科技	212	3,792.68	0.00
360	601065	江盐集团	256	3,031.04	0.00
361	601133	柏诚股份	217	2,660.42	0.00
362	001328	登康口腔	99	2,523.51	0.00
363	001282	三联锻造	76	2,510.28	0.00
364	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
365	001324	长青科技	107	2,097.20	0.00
366	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
367	603125	常青科技	78	1,913.34	0.00
368	001360	南矿集团	128	1,903.36	0.00
369	001367	海森药业	44	1,737.12	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	16,863,867.34	6.81
2	601668	中国建筑	11,325,767.00	4.57
3	601318	中国平安	11,301,315.00	4.56
4	002299	圣农发展	10,883,332.00	4.40
5	601869	长飞光纤	10,774,134.00	4.35
6	000568	泸州老窖	10,074,386.00	4.07
7	688599	天合光能	10,015,249.20	4.04
8	002459	晶澳科技	9,994,339.20	4.04
9	600483	福能股份	9,562,249.00	3.86

10	002027	分众传媒	9,527,067.00	3.85
11	600570	恒生电子	9,448,749.00	3.82
12	603609	禾丰股份	9,355,793.00	3.78
13	600008	首创环保	9,335,663.00	3.77
14	002372	伟星新材	9,134,699.00	3.69
15	688390	固德威	8,844,554.53	3.57
16	601816	京沪高铁	8,527,528.00	3.44
17	300274	阳光电源	8,288,252.00	3.35
18	002594	比亚迪	8,056,034.00	3.25
19	002603	以岭药业	8,002,103.00	3.23
20	688063	派能科技	7,999,364.14	3.23
21	603345	安井食品	7,847,574.40	3.17
22	600809	山西汾酒	7,836,638.00	3.16
23	300413	芒果超媒	7,828,551.00	3.16
24	000858	五粮液	7,745,374.00	3.13
25	601100	恒立液压	7,589,612.00	3.07
26	600633	浙数文化	7,472,772.20	3.02
27	603688	石英股份	7,114,519.12	2.87
28	300033	同花顺	7,045,126.00	2.85
29	600642	申能股份	6,902,874.00	2.79
30	600566	济川药业	6,791,575.00	2.74
31	002056	横店东磁	6,756,807.00	2.73
32	000596	古井贡酒	6,731,133.66	2.72
33	000651	格力电器	6,721,519.00	2.71
34	601012	隆基绿能	6,670,917.49	2.69
35	000001	平安银行	6,664,074.80	2.69
36	600519	贵州茅台	6,597,977.00	2.66
37	002600	领益智造	6,496,363.00	2.62
38	688223	晶科能源	6,373,571.52	2.57
39	002371	北方华创	6,352,170.00	2.57
40	600060	海信视像	6,200,224.00	2.50

41	002352	顺丰控股	6,181,994.00	2.50
42	300751	迈为股份	6,158,581.80	2.49
43	300750	宁德时代	6,075,548.00	2.45
44	002139	拓邦股份	6,013,087.00	2.43
45	600795	国电电力	6,008,539.00	2.43
46	688126	沪硅产业	5,930,374.85	2.40
47	600958	东方证券	5,922,733.88	2.39
48	605499	东鹏饮料	5,856,086.00	2.37
49	605117	德业股份	5,815,044.00	2.35
50	601601	中国太保	5,791,190.00	2.34
51	601888	中国中免	5,667,358.00	2.29
52	600919	江苏银行	5,634,808.00	2.28
53	601567	三星医疗	5,625,194.00	2.27
54	688777	中控技术	5,575,107.34	2.25
55	002271	东方雨虹	5,571,652.00	2.25
56	600803	新奥股份	5,521,457.00	2.23
57	000938	紫光股份	5,443,614.60	2.20
58	600233	圆通速递	5,411,678.00	2.19
59	600557	康缘药业	5,347,395.81	2.16
60	600420	国药现代	5,278,903.00	2.13
61	605108	同庆楼	5,128,198.00	2.07
62	601688	华泰证券	5,093,204.00	2.06
63	601658	邮储银行	5,068,307.00	2.05
64	601128	常熟银行	5,064,009.00	2.05
65	002475	立讯精密	4,981,922.82	2.01
66	601138	工业富联	4,957,614.00	2.00

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	300308	中际旭创	20,021,165.00	8.09
2	600519	贵州茅台	15,478,929.00	6.25
3	002299	圣农发展	13,668,153.00	5.52
4	000651	格力电器	12,697,991.00	5.13
5	603609	禾丰股份	12,223,918.06	4.94
6	000568	泸州老窖	11,266,353.32	4.55
7	601318	中国平安	10,920,686.00	4.41
8	601869	长飞光纤	10,870,805.00	4.39
9	600008	首创环保	10,796,061.00	4.36
10	601668	中国建筑	10,618,609.00	4.29
11	002594	比亚迪	10,392,183.00	4.20
12	600809	山西汾酒	9,859,074.00	3.98
13	600483	福能股份	9,732,695.00	3.93
14	600570	恒生电子	9,366,447.68	3.78
15	002459	晶澳科技	9,195,630.55	3.71
16	601012	隆基绿能	8,978,009.40	3.63
17	002372	伟星新材	8,906,256.00	3.60
18	600036	招商银行	8,664,037.00	3.50
19	002027	分众传媒	8,421,611.00	3.40
20	002371	北方华创	8,316,319.00	3.36
21	000921	海信家电	8,309,877.00	3.36
22	688599	天合光能	7,892,409.68	3.19
23	600060	海信视像	7,861,659.00	3.18
24	600795	国电电力	7,822,852.00	3.16
25	601100	恒立液压	7,587,016.00	3.06
26	300502	新易盛	7,577,157.00	3.06
27	300033	同花顺	7,541,797.04	3.05
28	300274	阳光电源	7,435,581.46	3.00
29	300413	芒果超媒	7,286,922.00	2.94

30	300750	宁德时代	7,226,134.00	2.92
31	600633	浙数文化	7,178,489.88	2.90
32	688063	派能科技	7,123,892.38	2.88
33	605117	德业股份	7,063,136.52	2.85
34	600732	爱旭股份	6,980,833.00	2.82
35	002603	以岭药业	6,976,491.00	2.82
36	600566	济川药业	6,905,925.80	2.79
37	000001	平安银行	6,780,050.60	2.74
38	002050	三花智控	6,566,948.00	2.65
39	688223	晶科能源	6,347,531.08	2.56
40	601816	京沪高铁	6,333,335.16	2.56
41	688390	固德威	6,202,246.26	2.50
42	600233	圆通速递	6,195,535.00	2.50
43	688126	沪硅产业	6,184,296.59	2.50
44	600438	通威股份	6,077,936.00	2.45
45	600089	DR特变电	6,064,010.13	2.45
46	601888	中国中免	6,058,891.48	2.45
47	002139	拓邦股份	6,009,149.00	2.43
48	601601	中国太保	5,957,334.00	2.41
49	002600	领益智造	5,877,762.00	2.37
50	002304	洋河股份	5,698,479.00	2.30
51	002056	横店东磁	5,679,233.00	2.29
52	600557	康缘药业	5,669,456.67	2.29
53	603688	石英股份	5,608,905.00	2.27
54	600481	双良节能	5,592,005.64	2.26
55	000596	古井贡酒	5,581,976.00	2.25
56	688777	中控技术	5,554,351.19	2.24
57	000725	京东方 A	5,527,469.00	2.23
58	002463	沪电股份	5,519,027.80	2.23
59	600150	中国船舶	5,503,687.00	2.22
60	002271	东方雨虹	5,484,945.00	2.22



61	000938	紫光股份	5,477,248.00	2.21
62	300751	迈为股份	5,340,927.00	2.16
63	600803	新奥股份	5,313,592.00	2.15
64	688617	惠泰医疗	5,259,163.23	2.12
65	601567	三星医疗	5,206,497.00	2.10
66	603345	安井食品	5,178,833.00	2.09
67	605108	同庆楼	5,088,911.00	2.06
68	601658	邮储银行	5,063,850.00	2.05

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	1,265,570,618.21
卖出股票收入（成交）总额	1,325,260,773.56

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	8,601,258.49	4.27
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)	78,397.69	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,679,656.18	4.31

**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	019688	22国债23	80,000	8,089,540.82	4.02
2	019638	20国债09	5,000	511,717.67	0.25
3	127085	韵达转债	662	78,397.69	0.04

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

**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）2022年8月22日，中国平安保险（集团）股份有限公司（证券代码601318）因未按照规定进行国际收支统计申报，收到国家外汇监管局责令改正、给予警告，处罚款人民币30万元的行政处罚决定（深外管检〔2022〕23号）。

本基金采用量化选股策略，上述股票是根据选股模型批量选择出来的个股，由于上述事件并未影响到模型的选股指标体系，且本基金认为不会对公司的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，继续投资上述股票。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,982.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,982.45

**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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
博道 久航 混合A	3,4 56	32,870.61	5,494,659.14	4.84%	108,106,177.01	95.16%
博道 久航 混合C	2,3 09	25,103.23	1,000,200.00	1.73%	56,963,148.96	98.27%
合计	5,6 21	30,522.00	6,494,859.14	3.79%	165,069,325.97	96.21%

## 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	博道久航混 合A	13.51	0.00%
	博道久航混 合C	6.84	0.00%
	合计	20.35	0.00%

## 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	博道久航混合A	0
	博道久航混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	博道久航混合A	0
	博道久航混合C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道久航混合A	博道久航混合C
基金合同生效日(2019年12月24日)基金份额总额	1,054,254,547.59	874,773,338.47
本报告期期初基金份额总额	155,168,237.84	61,689,798.78
本报告期基金总申购份额	1,245,835.74	1,408,574.28
减：本报告期基金总赎回份额	42,813,237.43	5,135,024.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	113,600,836.15	57,963,348.96

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：无

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：本次报告期内，基金托管人兴业证券于2023年6月26日聘任陈丹同志担任资产托管部总经理，魏东晞同志因退休不再担任资产托管部总经理职务；于2023年6月6日聘任冯大伟同志任资产托管部副总经理，王波同志不再担任资产托管部副总经理。

### 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本次报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	2,583,759,778.74	100.00%	1,605,315.15	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
兴业证券	12,155,797.82	100.00%	62,502,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金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；

（4）具有较强的为投资人提供资产配置及服务的能力，包括但不限于：产品筛选及评审流程完整，具有较为完善的资产配置，客户服务及陪伴体系等。

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关于旗下证券投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-13
2	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	2023-01-20
3	博道久航混合型证券投资基金2022年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
4	博道基金管理有限公司关于旗下证券投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-03
5	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	2023-03-31
6	博道久航混合型证券投资基金2022年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	博道基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”（养老金客户）适用范围的公告	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	2023-04-04
8	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	2023-04-21
9	博道久航混合型证券投资基金2023年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21

10	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
11	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球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	2023-05-04
12	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	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	2023-06-06
13	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
14	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-29

## §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久航混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道久航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道久航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道久航混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道久航混合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、报告期内博道久航混合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](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  
二〇二三年八月三十一日