

# 博道研究恒选混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25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                               | 5  |
| §4 管理人报告                                 | 6  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介                      | 7  |
| 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                     | 8  |
| 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                                | 9  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况                         | 9  |
| 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                   | 11 |
| 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                | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注                            | 12 |
| §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 |
| §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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月23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2023年07月01日起至2023年09月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 博道研究恒选混合   |
| 基金主代码      | 015104   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2022年06月02日  |
| 报告期末基金份额总额 | 71,336,433.19份   |
| 投资目标       | 在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | 本基金采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，在长期战略资产配置保持稳定的前提下，结合对国内外宏观经济形势的综合分析，确定合适的短期战术配置比例，动态优化投资组合。基于基金管理人研究团队对中长期趋势研究和定量的中短期行业景气度跟踪相结合，确定各行业配置比例；系统化吸收基金管理人研究团队重点推荐并融合股票基本面多因子选股思路，优选基本面良好的个股并动态调整个股配置权重。此外，本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，重点关注基本面良好、估值合理、具有持续核心竞争力的公司。本基金债券投资策略 |

|                 |   |                |
|-----------------|---|----------------|
|                 | 主要包括久期控制策略、期限结构配置策略、类属配置策略、骑乘策略、杠杆放大策略和换券等多种策略。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、国债期货投资策略和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×70%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×25%   |                |
| 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。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。         |                |
| 基金管理人           | 博道基金管理有限公司  |                |
| 基金托管人           | 国泰君安证券股份有限公司  |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 博道研究恒选混合A   | 博道研究恒选混合C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 015104  | 015105         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 57,885,572.87份  | 13,450,860.32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(2023年07月01日 - 2023年09月30日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 博道研究恒选混合A                      | 博道研究恒选混合C     |
| 1.本期已实现收益      | -2,765,102.27                  | -647,437.16   |
| 2.本期利润         | -4,170,054.01                  | -961,294.80   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0710                        | -0.0711       |
| 4.期末基金资产净值     | 47,217,646.16                  | 10,899,626.45 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.8157                         | 0.8103        |

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

博道研究恒选混合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      | -7.97%  | 0.90%     | -3.23%     | 0.66%         | -4.74%  | 0.24% |
| 过去六个月      | -11.60% | 0.83%     | -6.58%     | 0.62%         | -5.02%  | 0.21% |
| 过去一年       | -10.81% | 0.87%     | -0.90%     | 0.69%         | -9.91%  | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | -18.43% | 0.81%     | -5.97%     | 0.70%         | -12.46% | 0.11% |

博道研究恒选混合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      | -8.09%  | 0.90%     | -3.23%     | 0.66%         | -4.86%  | 0.24% |
| 过去六个月      | -11.82% | 0.83%     | -6.58%     | 0.62%         | -5.24%  | 0.21% |
| 过去一年       | -11.26% | 0.87%     | -0.90%     | 0.69%         | -10.36% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | -18.97% | 0.81%     | -5.97%     | 0.70%         | -13.00% | 0.11% |

#### 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

博道研究恒选混合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  
(2022年06月02日-2023年09月30日)



注：本基金基金合同生效日为 2022 年 6 月 2 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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。

博道研究恒选混合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  
(2022年06月02日-2023年09月30日)



注：本基金基金合同生效日为 2022 年 6 月 2 日，建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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 |        |   |
| 何晓彬 | 博道研究恒选混合的基金经理、研究副总监兼研究部总经理、专户投资二部总经理 | 2022-06-02  | -    | 19年    | 何晓彬先生，中国籍，经济学博士。2004年7月至2005年8月担任长城基金管理有限公司金融工程研究员，2006年3月至2010年6月担任交银施罗德基金管理有限公司金融工程部门总经理助理，2010年10月至2012年6月担任上海凯石投资管理有限公司金融工程部门总监，2012年7月至2014年6月担任交银施罗德基金管理有限公司专户投资部门副经理、投资经理，2014年7月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司量化高级投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司，现任研究副总监兼研究部总经理、专户投资二部总经理，同时兼任私募资产管理计划投资经理。具有基金从业资格。自2022年6月2日起担任博道研究恒选混合型证券投资基金基金经理至今。 |

## 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值(元)       | 任职时间       |
|-----|----------|---------|---------------|------------|
| 何晓彬 | 公募基金     | 1       | 58,117,272.61 | 2022-06-02 |
|     | 私募资产管理计划 | 2       | 33,995,964.85 | 2018-02-23 |

|  |      |   |               |   |
|--|------|---|---------------|---|
|  | 其他组合 | - | -             | - |
|  | 合计   | 3 | 92,113,237.46 | - |

#### 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1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

2023年三季度，市场情绪仍然较为低迷，长期问题短期化的悲观预期并未扭转，沪深300下跌3.98%，中证500下跌5.13%，中证1000下跌7.92%，创业板指下跌9.53%，恒生指数下跌5.85%。从行业来看，煤炭、非银、石油石化、银行、房地产表现较好，分



别上涨了10.37%、6.48%、5.79%、5.20%、1.55%，传媒、计算机、电力设备及新能源、国防军工表现较差，分别下跌14.19%、13.88%、13.53%、9.32%。

二季度经济基本面压制因素在三季度出现一定程度的改善，6月开始PMI出现连续边际改善，通胀底部基本确认，名义值进一步下行的压力较小，部分行业阶段性补库存，工业利润已经出现了明显改善，去库存压力最大的时间或已经过去。与此同时，政策力度也明显提升，各部门落实节奏明显加快，商品和债券市场对经济边际改善和政策力度增加都有一定的反应。海外方面，美国三季度经济较强，商品通胀升温，传递出年末再加息和利率长期维持高位的信号，全球流动性仍然处于煎熬震荡的环境，新兴市场资金流出压力较大。A股市场仍然被悲观情绪主导，对基本面边际改善的反应较为有限，尽管政策已经明显有托底举措，但市场仍然担忧尾部风险，隐含的市场定价可能过于悲观。

本基金报告期间坚持系统化基本面投资框架，从不同基本面收益来源分域量化选股构造多元策略复合配置，辅助小幅仓位管理平滑组合波动。

展望后市，当前沪深300加权ROE处于周期底部初现企稳回升迹象，PB处于历史较低水平，从长期配置角度，当前股权风险溢价具有较高配置价值。从短周期角度，地产或已出清，冲击最大的阶段可能正在过去，经济基本面拐点已现，当前位置不应该再过度悲观，可以耐心等待市场情绪的回暖。

本基金将继续借助系统化方式，从不同基本面收益来源分域构造多元策略复合配置，坚持量化成长风格选股，力争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 (%) |
|----|--------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 51,679,036.74 | 88.60         |
|    | 其中：股票  | 51,679,036.74 | 88.60         |
| 2  | 基金投资   | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 3,550,628.36  | 6.09          |
|    | 其中：债券  | 3,550,628.36  | 6.09          |
|    | 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          | 1,198,869.04  | 2.06   |
|   | 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      | 1,647,693.50  | 2.82   |
| 8 | 其他资产              | 250,462.82    | 0.43   |
| 9 | 合计                | 58,326,690.46 | 100.00 |

注：1、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；

2、本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值及占基金资产净值比例请见“5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合”部分披露。

## 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         | 662,040.00    | 1.14         |
| B  | 采矿业              | 1,227,635.00  | 2.11         |
| C  | 制造业              | 32,659,349.62 | 56.20        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,294,874.00  | 2.23         |
| E  | 建筑业              | 459,410.00    | 0.79         |
| F  | 批发和零售业           | 1,959,825.00  | 3.37         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,492,351.00  | 2.57         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 206,760.00    | 0.36         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,008,716.00  | 5.18         |
| J  | 金融业              | 216,657.00    | 0.37         |
| K  | 房地产业             | 210,345.00    | 0.36         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 991,368.00    | 1.71         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 163,742.00    | 0.28         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 207,756.00    | 0.36         |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 533,565.24    | 0.92  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 513,681.00    | 0.88  |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 45,808,074.86 | 78.82 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值(人民币)    | 占基金资产净值比例 (%) |
|------|--------------|---------------|
| 通信服务 | 1,919,908.62 | 3.30          |
| 医药卫生 | 149,023.11   | 0.26          |
| 信息技术 | 1,807,156.67 | 3.11          |
| 可选消费 | 1,994,873.48 | 3.43          |
| 合计   | 5,870,961.88 | 10.10         |

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

### 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   | 7,220  | 1,465,876.60 | 2.52          |
| 2  | 300760 | 迈瑞医疗   | 4,300  | 1,160,183.00 | 2.00          |
| 3  | 600519 | 贵州茅台   | 600    | 1,079,130.00 | 1.86          |
| 4  | 688012 | 中微公司   | 7,125  | 1,072,668.75 | 1.85          |
| 5  | 300274 | 阳光电源   | 10,500 | 939,855.00   | 1.62          |
| 6  | 600150 | 中国船舶   | 27,700 | 772,830.00   | 1.33          |
| 7  | 688111 | 金山办公   | 2,000  | 741,600.00   | 1.28          |
| 8  | 2015   | 理想汽车-W | 5,800  | 736,067.73   | 1.27          |
| 9  | 1024   | 快手-W   | 12,700 | 732,447.68   | 1.26          |
| 10 | 0981   | 中芯国际   | 23,000 | 423,165.07   | 0.73          |
| 10 | 688981 | 中芯国际   | 5,200  | 265,980.00   | 0.46          |

### 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      | 3,550,628.36 | 6.11    |
| 2  | 央行票据      | -            | -       |
| 3  | 金融债券      | -            | -       |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -       |
| 4  | 企业债券      | -            | -       |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -       |
| 6  | 中期票据      | -            | -       |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -       |
| 8  | 同业存单      | -            | -       |
| 9  | 其他        | -            | -       |
| 10 | 合计        | 3,550,628.36 | 6.11    |

#### 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  | 019694 | 23国债01 | 20,000 | 2,027,525.48 | 3.49          |
| 2  | 019688 | 22国债23 | 15,000 | 1,523,102.88 | 2.62          |

**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**  
本基金本报告期内未进行股指期货投资。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
本基金本报告期内未进行国债期货投资。

#### 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 | 250,462.82 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 250,462.82 |

### 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

|                               | 博道研究恒选混合A     | 博道研究恒选混合C     |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 59,185,915.10 | 13,587,078.36 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 170,540.37    | 101,211.86    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 1,470,882.60  | 237,429.90    |
| 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                   | 57,885,572.87 | 13,450,860.32 |

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

|                          | 博道研究恒选混合A     | 博道研究恒选混合C    |
|--------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 29,008,135.00 | 1,000,315.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             | -            |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             | -            |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 29,008,135.00 | 1,000,315.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 50.11         | 7.44         |

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

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、转换、红利再投等。

## §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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|---|----------------|------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 20230701-20230930      | 30,008,450.00 | -    | -    | 30,008,450.00 | 42.07% |
| 产品特有风险  |                |                        |               |      |      |               |        |
| <p>本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。</p> |                |                        |               |      |      |               |        |

## §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研究恒选混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道研究恒选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道研究恒选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道研究恒选混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道研究恒选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、报告期内博道研究恒选混合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

2023年10月25日