

# 博道研究恒选混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 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:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024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	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
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	11
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	14
§5 托管人报告	14
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 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60

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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博道研究恒选混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	66,128,916.14份	
基金合同存续期	不定期	
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	54,354,565.61份	11,774,350.53份

### 2.2 基金产品说明

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量化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。

### 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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	帅芳
	联系电话	021-80226288	021-38031815
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		400-085-2888	021-38917599-5
传真		021-80226289	021-38677819
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		200122	200041
法定代表人		莫泰山	朱健

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.bdfund.cn

址	
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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	博道研究恒选混合 A	博道研究恒选混合 C
本期已实现收益	-1,561,958.11	-350,369.94
本期利润	-1,542,007.29	-376,217.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0277	-0.0314
本期加权平均净值利润率	-3.68%	-4.20%
本期基金份额净值增长率	-3.63%	-3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-13,626,599.77	-3,042,736.75
期末可供分配基金份额利润	-0.2507	-0.2584
期末基金资产净值	40,727,965.84	8,731,613.78
期末基金份额净值	0.7493	0.7416
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-25.07%	-25.84%

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

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	-3.22%	0.58%	-2.90%	0.41%	-0.32%	0.17%
过去三个月	-1.16%	0.79%	-1.61%	0.59%	0.45%	0.20%
过去六个月	-3.63%	1.12%	-0.19%	0.74%	-3.44%	0.38%
过去一年	-15.46%	0.99%	-7.85%	0.68%	-7.61%	0.31%
自基金合同生效起至今	-25.07%	0.89%	-10.46%	0.70%	-14.61%	0.19%

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。

博道研究恒选混合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	-3.26%	0.58%	-2.90%	0.41%	-0.36%	0.17%
过去三个月	-1.29%	0.79%	-1.61%	0.59%	0.32%	0.20%
过去六个月	-3.86%	1.12%	-0.19%	0.74%	-3.67%	0.38%
过去一年	-15.88%	0.99%	-7.85%	0.68%	-8.03%	0.31%
自基金合同生效起至今	-25.84%	0.89%	-10.46%	0.70%	-15.38%	0.19%

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



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。



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29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个月持有期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、博道和祥多元稳健债券型证券投资基金、博道中证1000指数增强型证券投资基金、博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、博道红利智航股票型证券投资基金和博道明远混合型证券投资基金。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	-	20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总经理、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。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.3 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	49,459,579.62	2022-6-2
	私募资产管理计划	2	33,250,830.85	2018-2-23
	其他组合	-	-	-
	合计	3	82,710,410.47	-

注：表内各类产品的任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理该类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，沪深300上涨0.89%，创业板指数下跌10.99%，代表市场规模的指数中证100上涨1.44%，中证500下跌8.96%，中证1000下跌16.84%。

2024年开年，A股在年初流动性冲击下出现较大调整，之后市场情绪逐渐回暖，从股债跷跷板转为阶段性的股债双升，债市走“资产荒”的长期交易逻辑，权益市场波动的主要来源则是风险偏好和流动性，经济基本面未出现大幅变化，权益市场在流动性冲击下极具赔率后经历了明显的超跌反弹，低估值板块的超额收益较为明显。进入二季度，经济数据呈现出供给修复、需求回落的特征，结构上分化延续，景气度较高的主要是生产端、出口和电力投资，需求端和价格偏弱，整体仍然是量增价减的环境。4月政治局会议在稳增长方面释放了较为积极的信号，5月地产政策连续放松背景下，部分城市二手房成交有所好转。海外方面，美国降息预期依然“折返跑”频繁，最新的CPI数据增加了对通胀可持续下降的信心，但美联储仍然需要等待更多的证据，确认通胀的趋势，最新2024年降息预测下调为一次。当前国内市场对地产企稳和盈利周期回升的信心仍然不足，叠加地缘政治和贸易摩擦加剧，A股风险偏好有所下降。

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。

#### 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

往后看，随着地产供求形势和新均衡的形成，我国从债务驱动的高杠杆发展阶段，将逐渐进入到创新驱动的高质量增长时代。对应的资本市场监管和金融统计方式都在发生变化，包括新国九条开启资本市场建设的新篇章、二季度统计局的金融增加值核算方式优化调整等，而更深层次的治理框架已在三中全会中勾勒，相关政策未来可能成为新的投资线索。当前A股隐含回报仍十分具有吸引力，我们对市场保持信心和耐心。

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，坚持分域基本面量化选股，力争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

无。

#### 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

报告期内本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，时间范围为2024年1月17日至2024年2月25日。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在博道研究恒选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：博道研究恒选混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,328,862.19	2,547,608.87
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	47,792,855.37	51,220,439.61
其中：股票投资		44,843,708.65	47,978,141.31
基金投资		-	-
债券投资		2,949,146.72	3,242,298.30
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	400,000.00	199,868.76
应收清算款		-	335,769.21
应收股利		60,279.97	-
应收申购款		519.70	509.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		49,582,517.23	54,304,196.30
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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		14,929.04	830,674.72
应付管理人报酬		49,819.00	54,874.52
应付托管费		8,303.18	9,145.74
应付销售服务费		3,662.59	4,047.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	46,223.80	91,830.39
负债合计		122,937.61	990,573.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	66,128,916.14	68,666,486.17
未分配利润	6.4.7.8	-16,669,336.52	-15,352,863.04
净资产合计		49,459,579.62	53,313,623.13
负债和净资产总计		49,582,517.23	54,304,196.30

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：博道研究恒选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-1,497,064.12	-752,966.80
1.利息收入		14,405.37	32,415.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,965.35	16,286.42
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		5,440.02	16,129.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-1,506,544.98	-2,138,574.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,172,025.51	-2,740,903.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	30,708.91	47,330.56



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	634,771.62	554,998.62
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	-5,896.60	1,349,450.75
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	972.09	3,741.67
<b>减：二、营业总支出</b>		421,160.53	696,967.43
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	303,382.79	510,026.16
2.托管费	6.4.10.2.2	50,563.80	85,004.32
3.销售服务费		22,242.67	32,512.57
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	0.02
8.其他费用	6.4.7.17	44,971.27	69,424.36
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-1,918,224.65	-1,449,934.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-1,918,224.65	-1,449,934.23
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,918,224.65	-1,449,934.23

### 6.3 净资产变动表

会计主体：博道研究恒选混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	68,666,486.17	-15,352,863.04	53,313,623.13
二、本期期初净资产	68,666,486.17	-15,352,863.04	53,313,623.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,537,570.03	-1,316,473.48	-3,854,043.51
（一）、综合收益总额	-	-1,918,224.65	-1,918,224.65
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,537,570.03	601,751.17	-1,935,818.86
其中：1.基金申购款	600,711.88	-164,883.60	435,828.28
2.基金赎回款	-3,138,281.91	766,634.77	-2,371,647.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	66,128,916.14	-16,669,336.52	49,459,579.62
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	77,067,075.06	-7,279,806.73	69,787,268.33
二、本期期初净资产	77,067,075.06	-7,279,806.73	69,787,268.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,294,081.60	-1,058,652.48	-5,352,734.08
（一）、综合收益总额	-	-1,449,934.23	-1,449,934.23
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-4,294,081.60	391,281.75	-3,902,799.85
其中：1.基金申购款	1,043,285.95	-66,999.52	976,286.43
2.基金赎回款	-5,337,367.55	458,281.27	-4,879,086.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	72,772,993.46	-8,338,459.21	64,434,534.25

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

博道研究恒选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[2022]187号《关于准予博道研究恒选混合型证券投资基金注册的批复》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《博道研究恒选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252,457,001.88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（2022）第0338号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道研究恒选混合型证券投资基金基金合同》于2022年6月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为252,531,700.62份基金份额，其中认购资金利息折合74,698.74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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《博道研究恒选混合型证券投资基金基金合同》和《博道研究恒选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《博道研究恒选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）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债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60%-95%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%）。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以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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×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%。

## 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》、《博道研究恒选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2024年01月01日至2024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2024年06月30日的财务状况以及2024年01月01日至2024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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款		548,275.73
等于：本金		548,027.24
加：应计利息		248.49
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		780,586.46
等于：本金		780,363.33
加：应计利息		223.13
减：坏账准备		-
合计		1,328,862.19

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			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	47,098,623.12	-	44,843,708.65	-2,254,914.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	2,896,324.00	45,116.72	2,949,146.72	7,706.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,896,324.00	45,116.72	2,949,146.72	7,706.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		49,994,947.12	45,116.72	47,792,855.37	-2,247,208.47

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

无。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	400,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日



应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	4,972.24
预提费用-信息披露费	39,781.56
其他应付	1,470.00
合计	46,223.80

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 博道研究恒选混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,286,493.70	56,286,493.70
本期申购	378,769.16	378,769.16
本期赎回（以“-”号填列）	-2,310,697.25	-2,310,697.25
本期末	54,354,565.61	54,354,565.61

##### 6.4.7.7.2 博道研究恒选混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,379,992.47	12,379,992.47
本期申购	221,942.72	221,942.72
本期赎回（以“-”号填列）	-827,584.66	-827,584.66
本期末	11,774,350.53	11,774,350.53

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 博道研究恒选混合A

单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,901,926.38	-2,621,029.52	-12,522,955.90
本期期初	-9,901,926.38	-2,621,029.52	-12,522,955.90
本期利润	-1,561,958.11	19,950.82	-1,542,007.29
本期基金份额交易产生的变动数	424,133.81	14,229.61	438,363.42
其中：基金申购款	-77,148.63	-27,258.61	-104,407.24
基金赎回款	501,282.44	41,488.22	542,770.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,039,750.68	-2,586,849.09	-13,626,599.77

##### 6.4.7.8.2 博道研究恒选混合C

单位：人民币元

项目 (博道研究恒选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,254,474.89	-575,432.25	-2,829,907.14
本期期初	-2,254,474.89	-575,432.25	-2,829,907.14
本期利润	-350,369.94	-25,847.42	-376,217.36
本期基金份额交易产生的变动数	120,835.61	42,552.14	163,387.75
其中：基金申购款	-54,573.32	-5,903.04	-60,476.36
基金赎回款	175,408.93	48,455.18	223,864.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,484,009.22	-558,727.53	-3,042,736.75

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	5,890.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,075.22
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	8,965.35

**6.4.7.10 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	184,521,970.62
减：卖出股票成本总额	186,299,696.37
减：交易费用	394,299.76
买卖股票差价收入	-2,172,025.51

**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 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	28,534.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,174.82
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	30,708.91

**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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,843,332.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,804,973.92
减：应计利息总额	36,180.95
减：交易费用	2.51
买卖债券差价收入	2,174.82

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	634,771.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	634,771.62

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
------	-------------------------------

1.交易性金融资产	-5,896.60
——股票投资	-8,520.60
——债券投资	2,624.00
——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	-5,896.60

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	972.09
合计	972.09

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	4,972.24

信息披露费	39,781.56
证券组合费	215.27
存托服务费	2.20
合计	44,971.27

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。经博道基金管理有限公司(以下简称“博道基金”)股东会决议批准,史伟将持有的占比3.35%公司股权转让于上海博道相形投资合伙企业(有限合伙),将持有的占比0.4%公司股权转让于张迎军。博道基金于2024年8月8日完成了工商变更登记手续。

##### 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
国泰君安证券股份有限公司	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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成	成交金额	占当期 股票成

		交总额的 比例		交总额的 比例
国泰君安 证券股份 有限公司	367,695,754.93	100.00%	373,538,379.49	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
国泰君安 证券股份 有限公司	1,510,152.20	100.00%	4,067,248.77	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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
国泰君安 证券股份	51,702,000.00	100.00%	178,602,000.00	100.00%

有限公司				
------	--	--	--	--

#### 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 2024年01月01日至2024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
国泰君安证券股份有限公司	266,023.38	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
国泰君安证券股份有限公司	270,596.05	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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	303,382.79	510,026.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	63,947.16	115,007.70



应支付基金管理人的净管理费	239,435.63	395,018.46
---------------	------------	------------

注:1、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%/1.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《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》,自2023年8月14日起,本基金管理费率由1.50%调整为1.20%。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,563.80	85,004.32

注:1、支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%/0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、根据基金管理人发布的《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》,自2023年8月14日起,本基金托管费率由0.25%调整为0.20%。

#### 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		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道研究恒选混合A	博道研究恒选混合C	合计
博道基金管理有限公司	-	1,868.77	1,868.77
国泰君安证券	-	15,699.13	15,699.13

合计	-	17,567.90	17,567.90
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 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		
	博道研究恒选混合A	博道研究恒选混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	2,310.27	2,310.27
国泰君安 证券股份 有限公司	-	22,605.89	22,605.89
合计	-	24,916.16	24,916.16

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**  
无。

#### 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

博道研究恒选混合A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	29,008,135.00	29,008,135.00
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	29,008,135.00	29,008,135.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	53.37%	49.01%
---------------------	--------	--------

博道研究恒选混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,315.00	1,000,315.00
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	1,000,315.00	1,000,315.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.50%	7.36%

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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间大于100万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间大于100万份。）

#### 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		上年度可比期间	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023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
国泰君安证券股份有限公司	780,586.46	3,075.22	684,022.56	4,106.39

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**

无。

#### **6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

#### **6.4.11 利润分配情况**

无。

#### **6.4.12 期末（2024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**

无。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

##### **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**

无。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人国泰君安证券开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于国泰君安证券，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2024年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2023年12月31日：同)。

#### 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2024年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发

行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2024年6月30日，本基金无流动性受限资产。

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2024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49,506,862.24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、债券投资和买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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							
货币资金	1,328,862.19	-	-	-	-	-	1,328,862.19
交易性金融资产	1,421,861.10	-	1,527,285.62	-	-	44,843,708.65	47,792,855.37
买入返售金融资产	400,000.00	-	-	-	-	-	400,000.00
应收股利	-	-	-	-	-	60,279.97	60,279.97
应收申购款	-	-	-	-	-	519.70	519.70
资产总计	3,150,723.29	-	1,527,285.62	-	-	44,904,508.32	49,582,517.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,929.04	14,929.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,819.00	49,819.00
应付托管费	-	-	-	-	-	8,303.18	8,303.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,662.59	3,662.59
其他负债	-	-	-	-	-	46,223.80	46,223.80
负债总计	-	-	-	-	-	122,937.61	122,937.61
利率敏	3,150,723.29	-	1,527,285.62	-	-	44,781,570.71	49,459,579.62

感度缺口							
上年度末 2023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							
货币资金	2,547,608.87	-	-	-	-	-	2,547,608.87
交易性金融资产	1,834,972.27	-	1,407,326.03	-	-	47,978,141.31	51,220,439.61
买入返售金融资产	199,868.76	-	-	-	-	-	199,868.76
应收清算款	-	-	-	-	-	335,769.21	335,769.21
应收申购款	-	-	-	-	-	509.85	509.85
资产总计	4,582,449.90	-	1,407,326.03	-	-	48,314,420.37	54,304,196.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	830,674.72	830,674.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,874.52	54,874.52
应付托管费	-	-	-	-	-	9,145.74	9,145.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,047.80	4,047.80
其他负债	-	-	-	-	-	91,830.39	91,830.39
负债总计	-	-	-	-	-	990,573.17	990,573.17
利率敏感度缺口	4,582,449.90	-	1,407,326.03	-	-	47,323,847.20	53,313,623.13

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2024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5.96% (2023年12月31日：6.08%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2023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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

**6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,637,546.76	-	7,637,546.76
应收股利	-	60,279.97	-	60,279.97
资产合计	-	7,697,826.73	-	7,697,826.73
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,697,826.73	-	7,697,826.73
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	5,639,972.52	-	5,639,972.52
资产合计	-	5,639,972.52	-	5,639,972.52

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	5,639,972.52	-	5,639,972.52

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.所有外币相对人民币升值5%	384,891.34	281,998.63
	2.所有外币相对人民币贬值5%	-384,891.34	-281,998.63

#### 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60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%)。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以后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2024年06月30日		2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	44,843,708.65	90.67	47,978,141.31	89.99
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	44,843,708.65	90.67	47,978,141.31	89.99

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准收益率上升5%	2,256,730.39	2,437,835.40
	2.业绩比较基准收益率下降5%	-2,256,730.39	-2,437,835.40

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	44,843,708.65	47,978,141.31
第二层次	2,949,146.72	3,242,298.30
第三层次	-	-
合计	47,792,855.37	51,220,439.61

##### 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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：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

无。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	44,843,708.65	90.44
	其中：股票	44,843,708.65	90.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,949,146.72	5.95
	其中：债券	2,949,146.72	5.95
	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	400,000.00	0.81
	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	1,328,862.19	2.68
8	其他各项资产	60,799.67	0.12
9	合计	49,582,517.23	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“7.2.2 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。

## 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	54,336.00	0.11
B	采矿业	2,674,912.00	5.41
C	制造业	25,785,879.95	52.14

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,603,589.00	3.24
E	建筑业	1,659,841.00	3.36
F	批发和零售业	581,992.00	1.18
G	交通运输、仓储和邮政业	962,796.00	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,421,804.50	2.87
J	金融业	1,430,773.00	2.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	118,305.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	190,158.00	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	233,149.44	0.47
R	文化、体育和娱乐业	488,626.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	37,206,161.89	75.23

### 7.2.2 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(%)
能源	557,944.10	1.13
原材料	204,440.32	0.41
工业	190,896.15	0.39
可选消费	1,220,401.93	2.47
医药卫生	311,280.92	0.63
金融	1,973,401.26	3.99
信息技术	1,222,319.48	2.47
通信服务	1,637,023.02	3.31
房地产	319,839.58	0.65
合计	7,637,546.76	15.44

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

## 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	300750	宁德时代	6,220	1,119,786.60	2.26
2	601899	紫金矿业	52,200	917,154.00	1.85
3	600690	海尔智家	16,200	459,756.00	0.93
3	06690	海尔智家	9,800	233,445.29	0.47
4	002595	豪迈科技	17,200	656,524.00	1.33
5	300274	阳光电源	9,900	614,097.00	1.24
6	600519	贵州茅台	400	586,956.00	1.19
7	000333	美的集团	9,100	586,950.00	1.19
8	03690	美团-W	5,710	578,986.85	1.17
9	00700	腾讯控股	1,600	543,811.25	1.10
10	300760	迈瑞医疗	1,800	523,638.00	1.06
11	000338	潍柴动力	32,100	521,304.00	1.05
12	600050	中国联通	108,100	508,070.00	1.03
13	600900	长江电力	17,500	506,100.00	1.02
14	601766	中国中车	65,200	489,652.00	0.99
15	01810	小米集团-W	30,800	463,261.77	0.94
16	002415	海康威视	14,800	457,468.00	0.92
17	003816	中国广核	93,300	431,979.00	0.87
18	605305	中际联合	16,740	431,724.60	0.87
19	01024	快手-W	10,200	429,625.86	0.87
20	600018	上港集团	67,900	392,462.00	0.79
21	300308	中际旭创	2,840	391,579.20	0.79
22	600887	伊利股份	14,787	382,096.08	0.77
23	603816	顾家家居	11,700	377,793.00	0.76

24	002304	洋河股份	4,600	371,404.00	0.75
25	601857	中国石油	33,400	344,688.00	0.70
26	601628	中国人寿	11,000	341,550.00	0.69
27	600309	万华化学	4,200	339,612.00	0.69
28	002352	顺丰控股	9,400	335,486.00	0.68
29	01398	工商银行	53,000	224,446.27	0.45
29	601398	工商银行	19,200	109,440.00	0.22
30	01288	农业银行	72,000	219,481.29	0.44
30	601288	农业银行	23,700	103,332.00	0.21
31	01088	中国神华	5,500	180,459.65	0.36
31	601088	中国神华	3,200	141,984.00	0.29
32	600362	江西铜业	13,600	322,048.00	0.65
33	601138	工业富联	11,500	315,100.00	0.64
34	600872	中炬高新	13,800	313,122.00	0.63
35	600966	博汇纸业	61,400	293,492.00	0.59
36	600938	中国海油	8,700	287,100.00	0.58
37	000651	格力电器	7,300	286,306.00	0.58
38	601966	玲珑轮胎	15,400	282,898.00	0.57
39	601898	中煤能源	22,500	280,800.00	0.57
40	601127	赛力斯	3,000	273,360.00	0.55
41	688177	百奥泰	12,773	269,765.76	0.55
42	600031	三一重工	16,100	265,650.00	0.54
43	601668	中国建筑	49,200	261,252.00	0.53
44	601186	中国铁建	30,100	257,957.00	0.52
45	00981	中芯国际	10,500	164,063.36	0.33
45	688981	中芯国际	2,000	92,200.00	0.19
46	02666	环球医疗	66,000	256,006.74	0.52
47	600104	上汽集团	18,400	255,024.00	0.52
48	688008	澜起科技	4,432	253,333.12	0.51
49	600019	宝钢股份	37,900	252,035.00	0.51
50	002475	立讯精密	6,400	251,584.00	0.51



51	300394	天孚通信	2,840	251,112.80	0.51
52	688111	金山办公	1,101	250,477.50	0.51
53	601800	中国交建	27,700	247,638.00	0.50
54	601390	中国中铁	36,700	239,284.00	0.48
55	601006	大秦铁路	32,800	234,848.00	0.47
56	300015	爱尔眼科	22,592	233,149.44	0.47
57	00939	建设银行	44,000	231,711.20	0.47
58	600886	国投电力	12,700	231,648.00	0.47
59	600660	福耀玻璃	4,800	229,920.00	0.46
60	300408	三环集团	7,700	224,763.00	0.45
61	688408	中信博	2,400	220,992.00	0.45
62	300124	汇川技术	4,200	215,460.00	0.44
63	00941	中国移动	3,000	210,829.08	0.43
64	601618	中国中冶	67,600	209,560.00	0.42
65	02388	中银香港	9,500	208,524.56	0.42
66	03988	中国银行	59,000	207,315.26	0.42
67	03328	交通银行	37,000	207,004.95	0.42
68	03323	中国建材	80,000	204,440.32	0.41
68	00883	中国海洋石油	10,000	204,440.32	0.41
70	00992	联想集团	20,000	201,154.67	0.41
71	600989	宝丰能源	11,600	201,028.00	0.41
72	00552	中国通信服务	52,000	199,803.91	0.40
73	002993	奥海科技	5,300	197,160.00	0.40
74	000880	潍柴重机	24,100	192,559.00	0.39
75	00144	招商局港口	18,000	190,896.15	0.39
76	000768	中航西飞	7,900	189,837.00	0.38
77	300893	松原股份	6,600	188,562.00	0.38
78	603711	香飘飘	13,600	188,360.00	0.38
79	01658	邮储银行	45,000	188,103.35	0.38

80	600036	招商银行	5,500	188,045.00	0.38
81	601689	拓普集团	3,500	187,635.00	0.38
82	603556	海兴电力	4,000	187,320.00	0.38
83	300476	胜宏科技	5,800	187,108.00	0.38
84	000999	华润三九	4,390	186,926.20	0.38
85	002582	好想你	34,800	186,876.00	0.38
86	002463	沪电股份	5,100	186,150.00	0.38
87	02015	理想汽车— W	2,900	186,068.07	0.38
88	600011	华能国际	19,300	185,666.00	0.38
89	688277	天智航	23,800	184,212.00	0.37
90	600566	济川药业	5,800	183,918.00	0.37
91	688036	传音控股	2,401	183,772.54	0.37
92	002739	万达电影	15,100	182,559.00	0.37
93	601607	上海医药	9,500	181,545.00	0.37
94	688506	百利天恒	1,000	181,400.00	0.37
95	002028	思源电气	2,700	180,630.00	0.37
96	601669	中国电建	32,300	180,557.00	0.37
97	300573	兴齐眼药	1,100	180,400.00	0.36
98	688114	华大智造	3,800	180,158.00	0.36
99	605117	德业股份	2,420	179,902.80	0.36
100	000063	中兴通讯	6,400	179,008.00	0.36
101	601728	中国电信	29,100	178,965.00	0.36
102	603055	台华新材	17,600	178,288.00	0.36
103	002414	高德红外	30,100	177,289.00	0.36
104	600131	国网信通	10,500	177,135.00	0.36
105	300049	福瑞股份	3,500	176,190.00	0.36
106	01339	中国人民保 险集团	72,000	176,110.73	0.36
107	00268	金蝶国际	26,000	173,701.26	0.35
108	688777	中控技术	4,600	173,420.00	0.35

109	00857	中国石油股份	24,000	173,044.13	0.35
110	00119	保利置业集团	127,000	171,547.33	0.35
111	600030	中信证券	9,300	169,539.00	0.34
112	601633	长城汽车	6,700	169,510.00	0.34
113	600028	中国石化	26,800	169,376.00	0.34
114	600346	恒力石化	12,100	168,795.00	0.34
114	000538	云南白药	3,300	168,795.00	0.34
116	000858	五粮液	1,300	166,452.00	0.34
117	002233	塔牌集团	22,700	165,937.00	0.34
118	000915	华特达因	5,500	165,880.00	0.34
119	000166	申万宏源	37,100	159,901.00	0.32
120	01359	中国信达	267,000	158,395.61	0.32
121	601788	光大证券	10,700	156,434.00	0.32
122	600741	华域汽车	9,500	155,610.00	0.31
123	000708	中信特钢	11,330	153,748.10	0.31
124	01336	新华保险	11,200	152,308.04	0.31
125	600150	中国船舶	3,700	150,627.00	0.30
126	00688	中国海外发展	12,000	148,292.25	0.30
127	09626	哔哩哔哩-W	1,260	145,932.06	0.30
128	01347	华虹半导体	7,000	140,872.16	0.28
129	601225	陕西煤业	5,400	139,158.00	0.28
130	603587	地素时尚	11,200	137,536.00	0.28
131	002487	大金重工	6,000	137,280.00	0.28
132	600276	恒瑞医药	3,500	134,610.00	0.27
133	600582	天地科技	19,300	132,977.00	0.27
134	00780	同程旅行	8,800	124,810.82	0.25
135	603757	大元泵业	6,400	122,240.00	0.25

136	600755	厦门国贸	16,500	118,305.00	0.24
137	000090	天健集团	28,400	114,168.00	0.23
138	301128	强瑞技术	2,800	111,440.00	0.23
139	001328	登康口腔	4,400	111,320.00	0.23
140	600027	华电国际	16,000	111,040.00	0.22
141	03888	金山软件	5,200	107,020.86	0.22
142	300679	电连技术	2,600	104,598.00	0.21
143	002833	弘亚数控	5,700	103,968.00	0.21
144	601077	渝农商行	20,600	103,412.00	0.21
145	300529	健帆生物	3,800	103,398.00	0.21
146	002088	鲁阳节能	8,500	102,765.00	0.21
147	688012	中微公司	725	102,413.50	0.21
148	601058	赛轮轮胎	7,200	100,800.00	0.20
149	000703	恒逸石化	14,200	100,678.00	0.20
150	600502	安徽建工	23,400	100,620.00	0.20
151	600188	兖矿能源	4,400	100,012.00	0.20
152	688278	特宝生物	1,866	99,924.30	0.20
153	002726	龙大美食	15,200	99,712.00	0.20
154	002746	仙坛股份	17,400	99,702.00	0.20
155	600988	赤峰黄金	6,100	99,674.00	0.20
156	603977	国泰集团	9,800	99,666.00	0.20
157	600546	山煤国际	6,800	99,416.00	0.20
158	601688	华泰证券	8,000	99,120.00	0.20
159	002436	兴森科技	9,600	99,072.00	0.20
160	000877	天山股份	18,300	98,820.00	0.20
161	002448	中原内配	17,200	98,728.00	0.20
162	300251	光线传媒	11,600	97,556.00	0.20
163	603600	永艺股份	9,300	97,092.00	0.20
164	09868	小鹏汽车— W	3,600	97,090.90	0.20
165	300857	协创数据	1,700	96,900.00	0.20

166	603103	横店影视	7,000	96,880.00	0.20
167	605389	长龄液压	4,600	96,554.00	0.20
168	002837	英维克	4,500	96,255.00	0.19
169	300928	华安鑫创	2,700	95,958.00	0.19
170	300791	仙乐健康	3,800	95,760.00	0.19
171	300858	科拓生物	6,500	95,680.00	0.19
172	601918	新集能源	9,800	95,550.00	0.19
173	300199	翰宇药业	8,800	95,480.00	0.19
174	688110	东芯股份	5,000	95,350.00	0.19
175	002867	周大生	7,300	95,338.00	0.19
176	002653	海思科	3,100	95,170.00	0.19
177	002643	万润股份	9,500	95,000.00	0.19
178	603516	淳中科技	3,000	94,710.00	0.19
179	300832	新产业	1,400	94,416.00	0.19
180	300492	华图山鼎	1,000	94,200.00	0.19
181	603313	梦百合	12,600	94,122.00	0.19
182	000550	江铃汽车	4,300	93,353.00	0.19
183	605060	联德股份	6,400	91,968.00	0.19
184	002240	盛新锂能	6,700	89,914.00	0.18
185	600166	福田汽车	39,400	88,650.00	0.18
186	600729	重庆百货	3,900	87,204.00	0.18
187	000012	南玻A	17,000	85,680.00	0.17
188	600704	物产中大	19,600	85,064.00	0.17
189	02382	舜宇光学科 技	1,800	79,266.26	0.16
190	688041	海光信息	1,000	70,320.00	0.14
191	600929	雪天盐业	12,600	66,780.00	0.14
192	688578	艾力斯	1,000	63,740.00	0.13
193	689009	九号公司	1,600	58,896.00	0.12
194	300005	探路者	11,400	57,114.00	0.12
195	601928	凤凰传媒	5,200	56,992.00	0.12

196	688611	杭州柯林	2,131	56,791.15	0.11
197	603328	依顿电子	7,200	56,592.00	0.11
198	300673	佩蒂股份	4,300	56,416.00	0.11
199	002322	理工能科	3,500	56,070.00	0.11
200	000680	山推股份	6,000	55,620.00	0.11
201	002635	安洁科技	3,600	55,584.00	0.11
202	06618	京东健康	2,850	55,274.18	0.11
203	603583	捷昌驱动	2,700	55,026.00	0.11
204	688581	安杰思	1,120	54,801.60	0.11
205	300979	华利集团	900	54,765.00	0.11
206	601811	新华文轩	3,900	54,639.00	0.11
207	300761	立华股份	2,400	54,336.00	0.11
208	000528	柳工	4,800	53,712.00	0.11
209	002106	莱宝高科	4,900	53,410.00	0.11
210	603992	松霖科技	2,900	53,331.00	0.11
211	300502	新易盛	500	52,775.00	0.11
212	002533	金杯电工	5,300	52,735.00	0.11
213	000830	鲁西化工	4,500	52,155.00	0.11
214	002154	报喜鸟	9,300	50,592.00	0.10
215	603337	杰克股份	1,900	50,008.00	0.10
216	002563	森马服饰	8,600	49,966.00	0.10
217	601985	中国核电	4,600	49,036.00	0.10
218	600062	华润双鹤	2,500	48,950.00	0.10
219	600170	上海建工	22,700	48,805.00	0.10
220	600177	雅戈尔	6,800	48,416.00	0.10
221	600618	氯碱化工	5,500	48,290.00	0.10
222	300014	亿纬锂能	1,200	47,904.00	0.10
223	600587	新华医疗	2,990	47,062.60	0.10
224	603508	思维列控	2,500	46,875.00	0.09
225	002697	红旗连锁	10,100	46,763.00	0.09
226	688362	甬矽电子	2,400	46,704.00	0.09

227	002701	奥瑞金	11,200	46,592.00	0.09
228	000887	中鼎股份	3,800	46,512.00	0.09
229	605183	确成股份	3,000	46,380.00	0.09
230	002249	大洋电机	9,800	46,354.00	0.09
231	002545	东方铁塔	6,800	46,308.00	0.09
232	002498	汉缆股份	14,000	46,060.00	0.09
233	601038	一拖股份	2,900	45,849.00	0.09
234	605599	菜百股份	3,600	45,828.00	0.09
235	002543	万和电气	4,600	45,816.00	0.09
236	002046	国机精工	4,500	45,765.00	0.09
237	300841	康华生物	900	45,576.00	0.09
238	600761	安徽合力	2,100	45,444.00	0.09
239	002064	华峰化学	6,300	45,171.00	0.09
240	600623	华谊集团	7,800	45,084.00	0.09
241	600674	川投能源	2,400	45,000.00	0.09
242	600210	紫江企业	8,400	44,688.00	0.09
243	603367	辰欣药业	3,200	44,608.00	0.09
244	600480	凌云股份	4,500	44,235.00	0.09
245	688271	联影医疗	400	43,880.00	0.09
246	603408	建霖家居	3,300	43,527.00	0.09
247	300724	捷佳伟创	800	43,208.00	0.09
248	600025	华能水电	4,000	43,120.00	0.09
249	605377	华旺科技	3,220	42,665.00	0.09
250	002035	华帝股份	6,700	41,741.00	0.08
251	000589	贵州轮胎	8,200	41,574.00	0.08
252	301029	怡合达	2,100	41,286.00	0.08
253	603355	莱克电气	1,900	41,040.00	0.08
254	002555	三七互娱	3,100	40,455.00	0.08
255	603368	柳药集团	2,300	40,250.00	0.08
256	688631	莱斯信息	600	37,212.00	0.08
257	300871	回盛生物	3,700	35,298.00	0.07

258	300122	智飞生物	1,200	33,636.00	0.07
-----	--------	------	-------	-----------	------

#### 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	1,394,716.00	2.62
2	300750	宁德时代	1,286,368.00	2.41
3	600887	伊利股份	1,162,812.18	2.18
4	601899	紫金矿业	1,118,858.00	2.10
5	002304	洋河股份	963,174.00	1.81
6	002415	海康威视	870,874.00	1.63
7	688253	英诺特	869,355.79	1.63
8	002595	豪迈科技	851,282.00	1.60
9	300394	天孚通信	847,812.00	1.59
10	688333	铂力特	846,724.25	1.59
11	300893	松原股份	786,390.00	1.48
12	605117	德业股份	782,228.00	1.47
13	688506	百利天恒	779,884.06	1.46
14	688167	炬光科技	777,252.72	1.46
15	002028	思源电气	761,746.00	1.43
16	600114	东睦股份	759,354.00	1.42
17	000333	美的集团	757,712.00	1.42
18	688147	微导纳米	750,990.60	1.41
19	000858	五粮液	747,198.00	1.40
20	601088	中国神华	741,684.00	1.39

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	1,479,139.00	2.77
2	300750	宁德时代	1,075,001.00	2.02
3	601088	中国神华	993,663.00	1.86
4	688147	微导纳米	978,514.86	1.84
5	600887	伊利股份	927,753.00	1.74
6	688253	英诺特	880,837.31	1.65
7	688333	铂力特	845,311.47	1.59
8	002595	豪迈科技	828,873.00	1.55
9	601233	桐昆股份	825,731.00	1.55
10	000858	五粮液	782,959.00	1.47
11	688127	蓝特光学	779,504.49	1.46
12	301015	百洋医药	772,290.00	1.45
13	600114	东睦股份	762,710.00	1.43
14	300394	天孚通信	742,818.00	1.39
15	688167	炬光科技	733,966.00	1.38
16	600820	隧道股份	725,854.00	1.36
17	600989	宝丰能源	725,442.00	1.36
18	688169	石头科技	724,685.90	1.36
19	688506	百利天恒	697,221.67	1.31
20	688336	三生国健	694,570.35	1.30

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	183,173,784.31
卖出股票收入（成交）总额	184,521,970.62

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,949,146.72	5.96
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	2,949,146.72	5.96

### 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	019727	23国债24	15,000	1,527,285.62	3.09
2	019709	23国债16	14,000	1,421,861.10	2.87

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  
无。

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  
无。

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  
无。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 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。

**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	60,279.97
4	应收利息	-
5	应收申购款	519.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,799.67

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博道研究恒选混合A	617	88,094.92	29,056,962.73	53.46%	25,297,602.88	46.54%
博道研究恒选混合C	506	23,269.47	1,000,315.00	8.50%	10,774,035.53	91.50%
合计	1,104	59,899.38	30,057,277.73	45.45%	36,071,638.41	54.55%

### 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	博道研究恒选混合A	3,109,099.29	5.72%
	博道研究恒选混合C	3,345.96	0.03%
	合计	3,112,445.25	4.71%

### 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	博道研究恒选混合A	>100
	博道研究恒选混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道研究恒选混合A	>100
	博道研究恒选混合C	0
	合计	>100

### §9 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
基金合同生效日(2022年06月02日)基金份额总额	79,187,405.71	173,344,294.91
本报告期期初基金份额总额	56,286,493.70	12,379,992.47
本报告期基金总申购份额	378,769.16	221,942.72
减：本报告期基金总赎回份额	2,310,697.25	827,584.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	54,354,565.61	11,774,350.53

注：

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

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理（主持工作）。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

### 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

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰	2	367,695,754.93	100.0	266,023.38	100.0	-

君安 证券			0%		0%	
----------	--	--	----	--	----	--

### 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
国泰君安证券	1,510,152.20	100.00%	51,702,000.00	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部分基金2024年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-01-05

2	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧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	2024-01-12
3	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	2024-01-22
4	博道研究恒选混合型证券投资基金2023年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
5	博道基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	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	2024-02-08
6	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
7	博道研究恒选混合型证券投资基金2023年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
8	博道基金管理有限公司旗下全部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	2024-04-22
9	博道研究恒选混合型证券投资基金2024年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
10	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	2024-06-07
11	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加国信证券股份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	2024-06-26
12	博道研究恒选混合型证券投资基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27



## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	20240101 - 20240630	30,008,450.00	-	-	30,008,450.00	45.38%

#### 产品特有风险

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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日