

博道嘉元混合型证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 03 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。本年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3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。

本报告期自2020年03月04日起至2020年12月31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	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
8.6 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	63
8.7 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	63
8.8 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	63
8.9 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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12 投资组合报告附注.....	64
§9 基金份额持有人信息.....	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
9.3 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.....	66
§10 开放式基金份额变动.....	66
§11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
11.2 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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	68
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道嘉元混合型证券投资基金	
基金简称	博道嘉元混合	
基金主代码	008793	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年03月04日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	649,987,526.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道嘉元混合A	博道嘉元混合C
下属分级基金的交易代码	008793	008794
报告期末下属分级基金的份额总额	617,343,929.46份	32,643,596.91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
------	-----------------------

	资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，确定并动态调整大类资产的投资比例。本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念，通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挑选出预期具有较好市场表现的行业，优选基本面因素良好、估值水平合理的上市公司构建股票组合。本基金债券投资策略主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择等积极的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合全价（总值）指数收益率×40%
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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛
	联系电话	021-80226288
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn
客户服务电话	400-085-2888	95559
传真	021-80226289	021-62701216
注册地址	上海市虹口区东大名路687号1幢262室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	200122	200336
法定代表人	莫泰山	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	《上海证券报》
------------	---------

露报纸名称	
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2020年03月04日（基金合同生效日）- 2020年12月31日	
	博道嘉元混合A	博道嘉元混合C
本期已实现收益	206,746,903.88	9,684,731.81
本期利润	446,273,254.99	19,612,131.77
加权平均基金份额本期利润	0.4398	0.4716
本期加权平均净值利润率	39.83%	40.75%
本期基金份额净值增长率	55.74%	55.10%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	
期末可供分配利润	190,644,480.15	9,896,809.59
期末可供分配基金份额利润	0.3088	0.3032
期末基金资产净值	961,455,070.99	50,628,692.47
期末基金份额净值	1.5574	1.5510

3.1.3 累计期末指标	2020年末	
基金份额累计净值增长率	55.74%	55.10%

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、本基金合同生效日为2020年03月04日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满一年。

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

博道嘉元混合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
过去三个月	22.44%	1.35%	8.30%	0.59%	14.14%	0.76%
过去六个月	35.38%	1.45%	14.35%	0.79%	21.03%	0.66%
自基金合同 生效起至今	55.74%	1.27%	15.50%	0.79%	40.24%	0.48%

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。

博道嘉元混合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
过去三个月	22.28%	1.35%	8.30%	0.59%	13.98%	0.76%
过去六个月	35.05%	1.45%	14.35%	0.79%	20.70%	0.66%
自基金合同 生效起至今	55.10%	1.27%	15.50%	0.79%	39.60%	0.48%

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：本基金基金合同生效日为2020年3月4日，本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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。

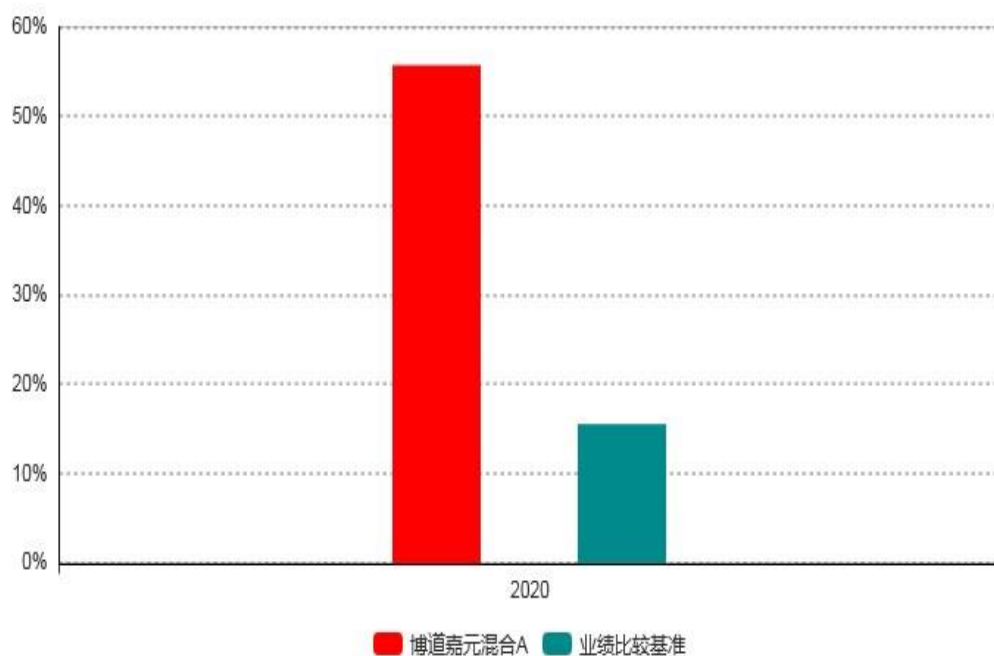
博道嘉元混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年03月04日-2020年12月31日)

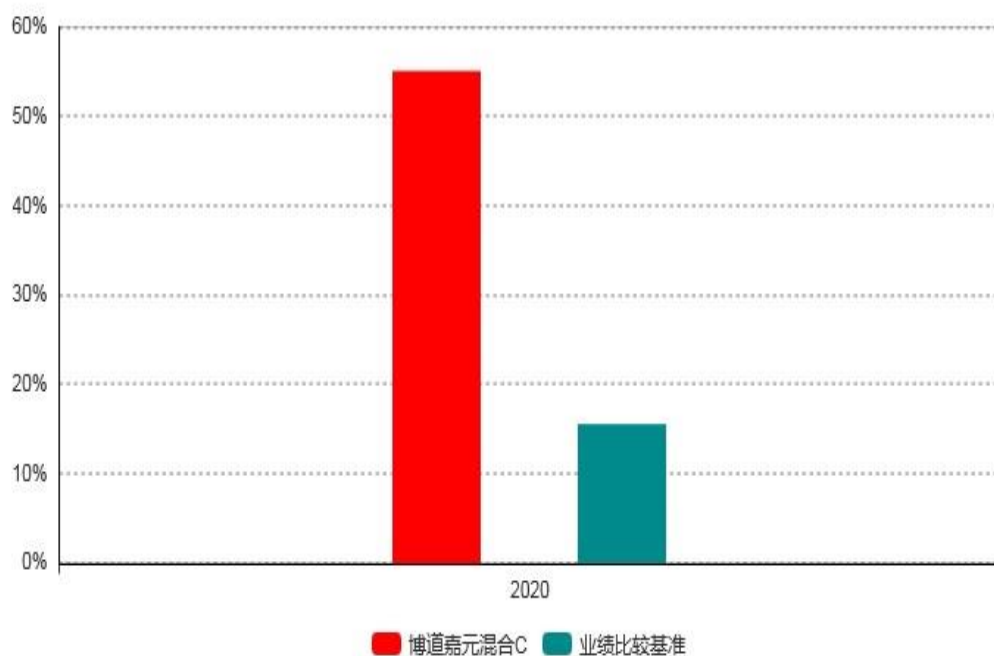


注：本基金基金合同生效日为 2020 年 3 月 4 日，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图示日期为 2020 年 03 月 04 日至 2020 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。



注：图示日期为 2020 年 03 月 04 日至 2020 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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，注册资本为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了16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和博道盛利6个月持有期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		
张迎军	博道嘉泰回报混合、博道嘉瑞混合、博道嘉元混合、博道嘉兴一年持有期混合、博道嘉丰混合的基金经理	2020-03-04	-	20年	张迎军先生，中国籍，经济学硕士。2000年7月至2003年3月担任申银万国证券研究所市场研究部、策略研究部研究员，2003年4月至2006年11月担任中国太平洋保险（集团）股份有限公司资金运用管理中心投资经理，2006年12月至2008年5月担任太平洋

					资产管理有限公司组合管理部组合经理，2008年8月至2015年7月担任交银施罗德基金管理有限公司基金经理、固定收益部副总经理、权益部副总经理、投资副总监，2015年9月至2018年11月担任上海放山资产管理有限公司总经理。2019年5月加入博道基金管理有限公司，现任研究副总监兼公募基金投资部总经理。具有基金从业资格。自2019年12月19日起担任博道嘉泰回报混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月30日起担任博道嘉瑞混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年3月4日起担任博道嘉元混合型证券投资基金基金经理至今、自2020年10月23日起担任博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年2月1日起担任博道嘉丰混合型证券投资基金的基金经理至今。
--	--	--	--	--	--

注：

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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，全部通过交易系统进行比例分配；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。

（3）公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

（5）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投资组合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。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020年沪深股市各大指数均上涨。具体而言，沪深300上涨27.21%，中证500上涨20.87%，创业板上涨64.96%。从行业来看，电力设备及新能源、食品饮料、消费者服务、国防军工、医药生物等涨幅居前，综合金融、房地产、通信、建筑等跌幅较大。

2020注定是不平凡的一年，因为受到新冠疫情这一巨大外部变量的冲击，全球经济步入衰退已成定局，但资本市场却是波谲云诡。美国经济数据创出了二战之后的最低水平，但美股却走出V型反转行情。而A股，也在新冠疫情冲击下，同样走出了比多数投资者预期强得多的市场走势。对投资者而言，2020年投资股市最大的挑战是来自于该如何理解股票定价的最核心因素。在过去，多数投资者大概率会把经济基本面放在分析框架的第一要素。本基金管理人认为，在经济基本面的上层还有一个更大的核心因素——大类资产配置在发挥更大的作用。从2019年开始，中国国内的大类资产再配置的时间窗口就已经打开，居民的资产主要通过公募基金这一渠道在向股票市场或者说权益资产转移。进入2020年后，公募基金发行愈发火爆便是例证。与此同时，海外市场的资金也在加快进入中国资本市场的步伐。无论是从境内资产再配置的视角，还是境外资产境内配置的视角，对权益资产而言都出现了明显的净流入，主要原因来自于长期的低利率环境，低利率使得长周期资金的机会成本降低。低利率压低了贴现率，抬高了一些稳定增长的公司的估值。当这个趋势发生的时候，尽管经济基本面并不尽如人意，但股票市场依然可以走出很好的行情。

我国政府控制新冠疫情措施得力，为受疫情冲击下的中国经济复苏创造了良好条件。2020年中国成为全球大国经济体中唯一正增长的国家。中国经济的复苏也为A股市场的上涨提供了坚实的经济基础，也使得中国资本市场成为吸引全球资金的避风港。

本基金管理人在建仓初期采取了快速建仓的策略。尽管受到新冠肺炎疫情的意外冲击，但本基金配置的医疗服务与CRO/CDMO、新能源汽车与光伏产业链、白酒与啤酒、基于5G及云计算、建材水泥工程机械等相关股票均获得了较好的投资收益。

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2021年，我们认为A股市场仍然具有较好的结构性行情机会。2021年上半年，随着逐步复苏的经济数据公布，优质上市公司业绩兑现与估值消化，股票市场中期走势依然向好。此外，2021年是十四五规划开局之年。到2021年2季度，库存周期之后的设备投资周期有可能在这个时间点开始，或者现在已经开启了。如果设备投资周期如期温和开启，即使不能显著提高中国经济增长速度，也可能使得中游的制造业的行业景气度往上走。制造业在现在A股里面的占比较高，再加上新的高新技术的投资，仍然可以给A股市场结构性行情提供新的基本面支持。因此，结构性行情依然会是相当时间内的市场投资主线。本基金构建组合时将继续坚守以下主线：以内需为主的主线、十四五规划受益行业主线以及具有稀缺性和业绩增长确定性的优质公司主线，这都将成为长期抗通胀的更优选择。本基金管理人将继续坚持以合理价格买入优秀公司的运作思路，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020年度，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等有关法规，本基金管理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。结合本报告期新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，贯彻落实新法规及新的监管要求。公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）深化事前事中合规及风险管理，提高合规管理及风险控制有效性。

强化事前事中合规审查，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料等，着力防范各类合规风险。在风险管理方面，夯实事前防范、事中控制和事后监督等各阶段工作，重点加强对信用风险、流动性风险等风险的管理。

（三）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司监察稽核部坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

（四）强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020年年度，基金托管人在博道嘉元混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2020年年度，博道基金管理有限公司在博道嘉元混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020年年度，由博道基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关博道嘉元混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第22645号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	博道嘉元混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了博道嘉元混合型证券投资基金(以下简称“博道嘉元混合基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表, 2020年3月4日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表

	附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了博道嘉元混合基金2020年12月31日的财务状况以及2020年3月4日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于博道嘉元混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	博道嘉元混合基金的基金管理人博道基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估博道嘉元混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算博道嘉元混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督博道嘉元混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平

的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对博道嘉元混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博道嘉元混合基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的

	审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞、沈兆杰
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼
审计报告日期	2021-03-29

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博道嘉元混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	11,279,598.21
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	7.4.7.2	927,850,875.13
其中：股票投资		762,187,205.39
基金投资		—
债券投资		165,663,669.74
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	70,000,000.00
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	1,186,806.62
应收股利		—

应收申购款		23,553,264.92
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		1,033,870,544.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负 债:		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		20,258,922.26
应付管理人报酬		1,133,500.00
应付托管费		151,133.32
应付销售服务费		21,466.96
应付交易费用	7.4.7.7	—
应交税费		681.43
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	221,077.45
负债合计		21,786,781.42
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	649,987,526.37
未分配利润	7.4.7.10	362,096,237.09
所有者权益合计		1,012,083,763.46
负债和所有者权益总计		1,033,870,544.88

注:

1、报告截止日2020年12月31日，A类基金份额净值1.5574元，C类基金份额净值1.5510元；基金份额总额649,987,526.37份，其中A类基金份额617,343,929.46份，C类基金份

额32,643,596.91份。

2、本财务报表的实际编制期间请见“7.4.4.1 会计年度”。

7.2 利润表

会计主体：博道嘉元混合型证券投资基金

本报告期：2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
一、收入		488,353,380.55
1. 利息收入		5,184,193.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	331,690.92
债券利息收入		1,673,221.17
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,179,281.59
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		228,001,791.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	209,195,567.90
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13.1	10,920,990.96
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	7,885,232.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	249,453,751.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,713,644.21
减：二、费用		22,467,993.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,410,502.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,921,400.28

3. 销售服务费		198,888.18
4. 交易费用	7.4.7.18	5,557,669.45
5. 利息支出		186,563.68
其中：卖出回购金融资产支出		186,563.68
6. 税金及附加		1,548.91
7. 其他费用	7.4.7.19	191,420.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		465,885,386.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		465,885,386.76

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博道嘉元混合型证券投资基金

本报告期：2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,893,704,147.39	-	1,893,704,147.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	465,885,386.76	465,885,386.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,243,716,621.02	-103,789,149.67	-1,347,505,770.69
其中：1. 基金申购款	531,958,456.64	199,012,212.26	730,970,668.90
2. 基金赎回	-1,775,675,077.66	-302,801,361.93	-2,078,476,439.59

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	649,987,526.37	362,096,237.09	1,012,083,763.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博道嘉元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]2387号《关于准予博道嘉元混合型证券投资基金注册的批复》核准，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道嘉元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1,893,347,802.56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（2020）第0144号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道嘉元混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,893,704,147.39份基金份额，其中认购资金利息折合356,344.83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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《博道嘉元混合型证券投资基金基金合同》和《博道嘉元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《博道嘉元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、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35%-80%。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沪深300指数收益率 $\times$ 60%+中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 40%。

本财务报表由本基金的基金管理人博道基金管理有限公司于2021年3月29日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博道嘉元混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年12月31日的财务状况以及2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2020年03月04日(基金合同生效日)至2020年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转

入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
活期存款	3,156,814.64
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	8,122,783.57
合计	11,279,598.21

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		542,116,129.16	762,187,205.39	220,071,076.23
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	136,280,994.90	165,663,669.74	29,382,674.84
	银行间市场	—	—	—
	合计	136,280,994.90	165,663,669.74	29,382,674.84
资产支持证券		—	—	—

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	678,397,124.06	927,850,875.13	249,453,751.07

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	70,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	70,000,000.00	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	722.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	5,001.08
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,197,922.33
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-16,839.78
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	-
合计	1,186,806.62

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31,077.45
预提费用-审计费	90,000.00
预提费用-信息披露费	100,000.00
合计	221,077.45

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 博道嘉元混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道嘉元混合A)	本期2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,833,662,661.56	1,833,662,661.56
本期申购	494,404,068.22	494,404,068.22
本期赎回（以“-”号填列）	-1,710,722,800.32	-1,710,722,800.32
本期末	617,343,929.46	617,343,929.46

7.4.7.9.2 博道嘉元混合C

金额单位：人民币元

项目	本期2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12
----	--------------------------------

(博道嘉元混合C)	月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	60,041,485.83	60,041,485.83
本期申购	37,554,388.42	37,554,388.42
本期赎回(以“-”号填列)	-64,952,277.34	-64,952,277.34
本期末	32,643,596.91	32,643,596.91

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、本基金自2020年2月24日至2020年2月28日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,893,347,802.56元，折合为1,893,347,802.56份基金份额（其中A类基金份额1,833,313,638.51份，C类基金份额60,034,164.05份）。根据《博道嘉元混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币356,344.83元，折合为356,344.83份基金份额（其中A类基金份额349,023.05份，C类基金份额7,321.78份），划入基金份额持有人账户；
- 4、根据《博道嘉元混合型证券投资基金基金合同》、《博道嘉元混合型证券投资基金招募说明书》及《博道基金管理有限公司关于博道嘉元混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2020年3月4日（基金合同生效日）至2020年5月21日止期间暂不向投资者开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自2020年5月22日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 博道嘉元混合A

单位：人民币元

项目 (博道嘉元混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	206,746,903.88	239,526,351.11	446,273,254.99
本期基金份额交易产生的变动数	-16,102,423.73	-86,059,689.73	-102,162,113.46
其中：基金申购款	136,072,500.40	53,021,196.66	189,093,697.06
基金赎回款	-152,174,924.13	-139,080,886.39	-291,255,810.52
本期已分配利润	-	-	-

本期末	190,644,480.15	153,466,661.38	344,111,141.53
-----	----------------	----------------	----------------

7.4.7.10.2 博道嘉元混合C

单位：人民币元

项目 (博道嘉元混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,684,731.81	9,927,399.96	19,612,131.77
本期基金份额交易产生的变动数	212,077.78	-1,839,113.99	-1,627,036.21
其中：基金申购款	8,555,983.99	1,362,531.21	9,918,515.20
基金赎回款	-8,343,906.21	-3,201,645.20	-11,545,551.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,896,809.59	8,088,285.97	17,985,095.56

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	125,755.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	205,935.42
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	331,690.92

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	2,013,399,145.00

减：卖出股票成本总额	1,804,203,577.10
买卖股票差价收入	209,195,567.90

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	667,229,094.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	652,032,134.58
减：应收利息总额	4,275,968.69
买卖债券差价收入	10,920,990.96

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,885,232.73
基金投资产生的股利收益	—
合计	7,885,232.73

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	249,453,751.07
——股票投资	220,071,076.23
——债券投资	29,382,674.84
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	249,453,751.07

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	5,713,516.42
转换费收入	127.79
合计	5,713,644.21

注：

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	5,557,669.45
银行间市场交易费用	—
合计	5,557,669.45

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	90,000.00
信息披露费	100,000.00
汇划手续费	1,020.55
开户费	400.00
合计	191,420.55

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海博道投资管理有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,410,502.74
其中：支付销售机构的客户维护费	8,539,033.18

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
----	--

当期发生的基金应支付的托管费	1,921,400.28
----------------	--------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值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×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道嘉元混合A	博道嘉元混合C	合计
交通银行	0.00	15,150.07	15,150.07
博道基金 管理有限 公司	0.00	101,975.26	101,975.26
合计	0.00	117,125.33	117,125.33

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道嘉元混合A

份额单位：份

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金合同生效日（2020年03月04日）持有的基金份额	1,999,940.18

报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	1,999,940.18
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.31%

博道嘉元混合C

份额单位：份

项目	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金合同生效日（2020年03月04日）持有的基金份额	1,000,270.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	1,000,270.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.15%

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、基金管理人博道基金认购本基金的交易委托直销柜台办理，A类适用费率为0.03%，C类适用费率为零。

7.4.10.4.2 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除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年03月04日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,156,814.64	125,755.50

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
601995	中金公司	2020-10-22	2021-05-06	主板打新限售	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
688561	奇安信	2020-07-16	2021-01-22	科创板打新限售	56.10	122.83	11,326	635,388.60	1,391,172.58	-
688521	芯原股份	2020-08-11	2021-02-18	科创板打新限售	38.53	77.99	13,200	508,596.00	1,029,468.00	-

688301	奕瑞科技	2020-09-09	2021-03-18	科创板打新限售	119.60	162.72	2,427	290,269.20	394,921.44	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	创业板打新限售	25.70	88.29	3,998	102,748.60	352,983.42	-
688578	艾力斯	2020-11-23	2021-06-02	科创板打新限售	22.73	24.79	10,734	243,983.82	266,095.86	-
688556	高测股份	2020-07-29	2021-02-08	科创板打新限售	14.41	26.93	6,896	99,371.36	185,709.28	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	创业板打新限售	118.27	603.36	270	31,932.90	162,907.20	-
688510	航亚科技	2020-12-07	2021-06-16	科创板打新限售	8.17	25.53	5,991	48,946.47	152,950.23	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688013	天臣医疗	2020-09-21	2021-03-29	科创板打新限售	18.62	28.68	3,022	56,269.64	86,670.96	-
688698	伟创电气	2020-12-22	2021-06-29	科创板打新限售	10.75	15.29	4,751	51,073.25	72,642.79	-

				售						
688585	上纬新材	2020-09-21	2021-03-29	科创板打新限售	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
688156	路德环境	2020-09-14	2021-03-22	科创板打新限售	15.91	20.07	2,602	41,397.82	52,222.14	-
688618	三旺通信	2020-12-23	2021-06-30	科创板打新限售	34.08	46.16	1,117	38,067.36	51,560.72	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	创业板打新限售	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-07-01	创业板打新限售	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-

				售						
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	创业板打新限售	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	创业板打新限售	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	创业板打新限售	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	创业板打新限售	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	创业板打新限售	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-30	创业板打新限售	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	创业板打新限售	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	创业板打新限售	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
3008	爱克	2020	2021	创业	27.9	30.1	479	13,3	14,4	-

89	股份	-09-09	-03-16	板打 新限售	7	2		97.6 3	27.4 8	
3008 90	翔丰 华	2020 -09-10	2021 -03-18	创业 板打 新限售	14.6 9	48.8 5	286	4,20 1.34	13,9 71.1 0	-
3009 25	法本 信息	2020 -12-21	2021 -06-30	创业 板打 新限售	20.0 8	37.3 3	353	7,08 8.24	13,1 77.4 9	-
3008 95	铜牛 信息	2020 -09-17	2021 -03-24	创业 板打 新限售	12.6 5	45.3 0	283	3,57 9.95	12,8 19.9 0	-
3008 76	蒙泰 高新	2020 -08-14	2021 -02-25	创业 板打 新限售	20.0 9	36.6 2	350	7,03 1.50	12,8 17.0 0	-
3009 07	康平 科技	2020 -11-11	2021 -05-18	创业 板打 新限售	14.3 0	26.8 5	473	6,76 3.90	12,7 00.0 5	-
3008 79	大叶 股份	2020 -08-25	2021 -03-01	创业 板打 新限售	10.5 8	27.1 2	466	4,93 0.28	12,6 37.9 2	-
3008 82	万胜 智能	2020 -08-27	2021 -03-10	创业 板打 新限售	10.3 3	25.7 9	440	4,54 5.20	11,3 47.6 0	-
3009 11	亿田 智能	2020 -11-24	2021 -06-03	创业 板打 新限售	24.3 5	33.0 6	309	7,52 4.15	10,2 15.5 4	-

				售						
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	创业板打新限售	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	创业板打新限售	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	创业板打新限售	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	创业板打新限售	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	创业板打新限售	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	创业板打新限售	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

注：

- 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月；根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。
- 2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。
- 3、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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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交通银行，其他存款存放于国金证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2020年12月31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11.15%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2020年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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期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7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2020年12月31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0.65%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2020年12月31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1,007,043,859.60元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资和买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	11,279,598.21	-	-	-	-	-	11,279,598.21
交易性金融资产	45,549,444.60	-	7,282,520.40	6,964,555.26	105,867,149.48	762,187,205.39	927,850,875.13
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	-	-	70,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,186,806.62	1,186,806.62
应收申购款	-	-	-	-	-	23,553,264.92	23,553,264.92
资产总计	126,829,042.81	-	7,282,520.40	6,964,555.26	105,867,149.48	786,927,276.93	1,033,870,544.88
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,258,922.26	20,258,922.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,133,500.00	1,133,500.00
应付托管费	-	-	-	-	-	151,133.32	151,133.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,466.96	21,466.96
应交税费	-	-	-	-	-	681.43	681.43
其他负债	-	-	-	-	-	221,077.45	221,077.45
负债总计	-	-	-	-	-	21,786,781.42	21,786,781.42
利率敏感度缺口	126,829,042.81	-	7,282,520.40	6,964,555.26	105,867,149.48	765,140,495.51	1,012,083,763.46

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为16.37%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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35%-80%，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	762,187,205.39	75.31
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	762, 187, 205. 39	75. 31

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300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 2020年12月31日
	1. 沪深300指数收益率上升5%	44, 378, 720. 12
	2. 沪深300指数收益率下降5%	-44, 378, 720. 12

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为868,462,750.24元,属于第二层次的余额为59,388,124.89元,无属于第三层次的余额。

(ii) 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	762,187,205.39	73.72
	其中：股票	762,187,205.39	73.72
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	165,663,669.74	16.02
	其中：债券	165,663,669.74	16.02
	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	70,000,000.00	6.77
	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	11,279,598.21	1.09
8	其他各项资产	24,740,071.54	2.39

9	合计	1,033,870,544.88	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	442,436,921.54	43.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	11,840,466.00	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	129,182,184.87	12.76
J	金融业	11,272,992.21	1.11
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	16,844,375.52	1.66
M	科学研究和技术服务业	65,445,340.06	6.47
N	水利、环境和公共设施管理业	67,303.24	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	84,430,200.09	8.34
R	文化、体育和娱乐业	642,124.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	762,187,205.39	75.31

8.2.2 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。

8.3 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	152,200	53,438,942.00	5.28
2	002230	科大讯飞	1,157,156	47,292,965.72	4.67
3	300015	爱尔眼科	612,899	45,900,006.11	4.54
4	600438	通威股份	1,091,957	41,974,827.08	4.15
5	600519	贵州茅台	21,000	41,958,000.00	4.15
6	603259	药明康德	304,183	40,979,533.76	4.05
7	688023	安恒信息	145,657	37,885,385.70	3.74
8	300274	阳光电源	522,100	37,737,388.00	3.73
9	300347	泰格医药	214,118	34,603,609.98	3.42
10	002410	广联达	416,359	32,784,107.66	3.24
11	600600	青岛啤酒	293,002	29,124,398.80	2.88
12	600966	博汇纸业	1,354,400	20,356,632.00	2.01
13	000977	浪潮信息	754,606	20,283,809.28	2.00
14	300760	迈瑞医疗	42,200	17,977,200.00	1.78
15	002791	坚朗五金	123,812	17,828,928.00	1.76
16	002127	南极电商	1,231,314	16,844,375.52	1.66
17	603737	三棵树	104,240	15,792,360.00	1.56
18	002601	龙蟠佰利	500,400	15,397,308.00	1.52
19	002352	顺丰控股	134,200	11,840,466.00	1.17
20	600309	万华化学	127,900	11,644,016.00	1.15
21	300763	锦浪科技	73,800	10,996,200.00	1.09
22	600346	恒力石化	368,705	10,312,678.85	1.02
23	002821	凯莱英	33,236	9,942,217.04	0.98
24	300725	药石科技	62,723	8,655,774.00	0.86

25	603127	昭衍新药	81,530	8,406,558.30	0.83
26	300759	康龙化成	69,777	8,401,150.80	0.83
27	300476	胜宏科技	387,800	8,364,846.00	0.83
28	300363	博腾股份	215,300	7,862,756.00	0.78
29	000710	贝瑞基因	200,800	7,642,448.00	0.76
30	600031	三一重工	193,700	6,775,626.00	0.67
31	601166	兴业银行	317,100	6,617,877.00	0.65
32	000425	徐工机械	1,181,900	6,346,803.00	0.63
33	300572	安车检测	148,996	6,090,956.48	0.60
34	002493	荣盛石化	212,900	5,878,169.00	0.58
35	600588	用友网络	128,581	5,640,848.47	0.56
36	300724	捷佳伟创	36,400	5,299,840.00	0.52
37	300601	康泰生物	29,100	5,077,950.00	0.50
38	688008	澜起科技	59,400	4,923,072.00	0.49
39	002049	紫光国微	33,500	4,482,635.00	0.44
40	300014	亿纬锂能	53,000	4,319,500.00	0.43
41	600763	通策医疗	14,200	3,926,584.00	0.39
42	002050	三花智控	131,100	3,231,615.00	0.32
43	002439	启明星辰	106,591	3,113,523.11	0.31
44	600926	杭州银行	197,100	2,940,732.00	0.29
45	300751	迈为股份	4,100	2,775,741.00	0.27
46	600298	安琪酵母	47,600	2,430,932.00	0.24
47	601636	旗滨集团	157,100	2,010,880.00	0.20
48	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.17
49	688561	奇安信	11,326	1,391,172.58	0.14
50	688521	芯原股份	13,200	1,029,468.00	0.10
51	688106	金宏气体	26,075	792,680.00	0.08
52	300251	光线传媒	53,200	642,124.00	0.06
53	688301	奕瑞科技	2,427	394,921.44	0.04
54	300999	金龙鱼	3,998	352,983.42	0.03
55	688578	艾力斯	10,734	266,095.86	0.03

56	688556	高测股份	6,896	185,709.28	0.02
57	300896	爱美客	270	162,907.20	0.02
58	688510	航亚科技	5,991	152,950.23	0.02
59	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
60	688013	天臣医疗	3,022	86,670.96	0.01
61	688698	伟创电气	4,751	72,642.79	0.01
62	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.01
63	688156	路德环境	2,602	52,222.14	0.01
64	688618	三旺通信	1,117	51,560.72	0.01
65	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
66	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
67	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
68	300894	N火星人	628	23,217.16	0.00
69	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
70	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
71	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
72	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
73	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
74	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
75	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
76	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
77	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
78	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
79	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
80	605500	森林包装	762	14,980.92	0.00
81	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
82	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
83	300925	C法本	353	13,177.49	0.00
84	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
85	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
86	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00

87	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
88	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
89	605155	N西大门	350	10,668.00	0.00
90	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
91	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
92	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
93	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
94	300922	C天秦	287	9,063.46	0.00
95	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
96	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
97	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
98	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
99	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	94,117,937.12	9.30
2	600600	青岛啤酒	77,848,387.54	7.69
3	000977	浪潮信息	72,918,543.83	7.20
4	002410	广联达	59,172,213.73	5.85
5	600309	万华化学	54,648,228.10	5.40
6	688023	安恒信息	54,546,245.65	5.39
7	002233	塔牌集团	53,630,552.45	5.30
8	600438	通威股份	50,940,208.68	5.03
9	002127	南极电商	50,192,951.31	4.96
10	603939	益丰药房	50,029,887.76	4.94
11	300751	迈为股份	47,263,494.00	4.67
12	000998	隆平高科	46,477,310.42	4.59

13	000725	京东方 A	45,677,882.00	4.51
14	603259	药明康德	44,351,777.06	4.38
15	002013	中航机电	44,228,225.19	4.37
16	300347	泰格医药	43,557,017.41	4.30
17	300015	爱尔眼科	43,322,068.48	4.28
18	600720	祁连山	42,579,749.02	4.21
19	000063	中兴通讯	39,743,204.54	3.93
20	002044	美年健康	39,578,353.47	3.91
21	000425	徐工机械	38,419,994.07	3.80
22	600519	贵州茅台	38,243,234.87	3.78
23	300003	乐普医疗	38,013,776.28	3.76
24	300750	宁德时代	37,352,755.56	3.69
25	300363	博腾股份	35,322,139.50	3.49
26	000401	冀东水泥	34,091,748.64	3.37
27	002043	兔宝宝	33,327,908.81	3.29
28	002701	奥瑞金	33,182,709.40	3.28
29	000338	潍柴动力	31,983,047.30	3.16
30	300496	中科创达	31,123,767.00	3.08
31	601878	浙商证券	31,077,910.49	3.07
32	000333	美的集团	30,833,547.14	3.05
33	600926	杭州银行	29,335,222.40	2.90
34	603127	昭衍新药	28,219,642.42	2.79
35	601066	中信建投	27,486,059.00	2.72
36	000860	顺鑫农业	26,360,781.53	2.60
37	000001	平安银行	26,184,531.80	2.59
38	002709	天赐材料	25,817,734.80	2.55
39	002439	启明星辰	23,056,778.45	2.28
40	002415	海康威视	22,765,296.81	2.25
41	300146	汤臣倍健	22,511,589.00	2.22
42	300454	深信服	22,264,587.09	2.20
43	600185	格力地产	21,809,339.64	2.15

44	300572	安车检测	21,523,791.80	2.13
45	000710	贝瑞基因	21,207,396.00	2.10
46	603737	三棵树	20,485,183.20	2.02
47	300274	阳光电源	20,269,489.90	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600600	青岛啤酒	82,265,970.94	8.13
2	300751	迈为股份	65,019,698.00	6.42
3	603939	益丰药房	59,410,218.89	5.87
4	600309	万华化学	59,364,915.12	5.87
5	002410	广联达	57,794,581.26	5.71
6	002233	塔牌集团	53,741,051.42	5.31
7	002230	科大讯飞	48,690,374.43	4.81
8	600438	通威股份	47,389,885.11	4.68
9	000998	隆平高科	46,846,386.13	4.63
10	000977	浪潮信息	45,946,612.15	4.54
11	002013	中航机电	45,406,363.07	4.49
12	000725	京东方A	44,896,488.00	4.44
13	600720	祁连山	43,501,437.43	4.30
14	002127	南极电商	42,357,122.56	4.19
15	000063	中兴通讯	41,635,620.00	4.11
16	300363	博腾股份	41,116,181.00	4.06
17	002043	兔宝宝	39,171,930.65	3.87
18	002044	美年健康	37,110,603.55	3.67
19	300003	乐普医疗	36,353,465.64	3.59
20	603127	昭衍新药	35,646,182.28	3.52

21	000425	徐工机械	33,199,578.00	3.28
22	000333	美的集团	33,005,124.25	3.26
23	300347	泰格医药	32,638,433.16	3.22
24	000401	冀东水泥	30,517,749.81	3.02
25	603259	药明康德	29,854,049.88	2.95
26	000338	潍柴动力	29,366,057.42	2.90
27	300015	爱尔眼科	29,318,178.98	2.90
28	002701	奥瑞金	28,733,358.00	2.84
29	000860	顺鑫农业	27,003,053.39	2.67
30	601066	中信建投	26,446,938.67	2.61
31	300496	中科创达	26,330,968.15	2.60
32	600926	杭州银行	26,302,595.00	2.60
33	000001	平安银行	25,149,905.00	2.48
34	300454	深信服	24,811,244.64	2.45
35	601878	浙商证券	24,144,593.27	2.39
36	002709	天赐材料	24,121,457.64	2.38
37	300146	汤臣倍健	22,593,585.17	2.23

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。

8.4.3 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	2,348,595,885.46
卖出股票收入（成交）总额	2,013,399,145.00

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。

8.5 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	52,831,965.00	5.22
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)	112,831,704.74	11.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	165,663,669.74	16.37

8.6 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	019627	20国债01	455,540	45,549,444.60	4.50
2	113586	上机转债	88,250	36,591,980.00	3.62
3	128095	恩捷转债	67,909	14,920,965.48	1.47
4	113583	益丰转债	84,110	11,360,737.70	1.12
5	128096	奥瑞转债	80,442	9,327,249.90	0.92

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,186,806.62
5	应收申购款	23,553,264.92
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	24,740,071.54

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113586	上机转债	36,591,980.00	3.62
2	128095	恩捷转债	14,920,965.48	1.47

3	113583	益丰转债	11,360,737.70	1.12
4	128096	奥瑞转债	9,327,249.90	0.92
5	128049	华源转债	6,964,555.26	0.69
6	123044	红相转债	4,555,309.50	0.45
7	113035	福莱转债	1,651,968.90	0.16
8	127017	万青转债	1,495,746.60	0.15
9	113588	润达转债	381,021.50	0.04

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 嘉元 混合A	6,818	90,546.19	75,321,560.74	12.20%	542,022,368.72	87.80%
博道 嘉元 混合C	1,568	20,818.62	17,468,244.06	53.51%	15,175,352.85	46.49%
合计	8,279	78,510.39	92,789,804.80	14.28%	557,197,721.57	85.720%

9.2 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	博道嘉元混合A	2,128,656.51	0.34%
	博道嘉元混合C	82,134.91	0.25%
	合计	2,210,791.42	0.34%

9.3 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	博道嘉元混合A	50~100
	博道嘉元混合C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道嘉元混合A	50~100
	博道嘉元混合C	0
	合计	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	博道嘉元混合A	博道嘉元混合C
基金合同生效日(2020年03月04日)基金份额总额	1,833,662,661.56	60,041,485.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	494,404,068.22	37,554,388.42
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,710,722,800.32	64,952,277.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	617,343,929.46	32,643,596.91

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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），本期审计费用请见“7.4.7.19其他费用”。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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	

国金证券	2	4,240,358,007.93	100.00%	3,392,286.01	100.00%	-
------	---	------------------	---------	--------------	---------	---

11.7.2 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
国金证券	1,250,391,551.85	100.00%	39,975,003,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

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

11.8 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博道嘉元混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-05
2	博道基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-24

3	博道基金管理有限公司高级管理人员任职公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
4	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加中信证券华南股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-29
5	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加嘉实财富管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-15
6	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
7	博道基金管理有限公司关于博道嘉元混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
8	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-03
9	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-15
10	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-06
11	博道基金管理有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、	2020-07-21

	全部基金季度报告提示性公告	证券时报、证券日报	
12	博道嘉元混合型证券投资基金2020年第二季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-21
13	博道嘉元混合型证券投资基金基金产品资料概要	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-08-28
14	博道基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-08-31
15	博道嘉元混合型证券投资基金2020年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-08-31
16	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	2020-10-14
17	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2020-10-28
18	博道嘉元混合型证券投资基金2020年第三季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-10-28
19	博道基金管理有限公司关于旗下五只基金就参与存托凭证投资事宜修订相关法律文件的公告	中国证券报、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	2020-11-28
20	博道基金管理有限公司关于旗下五只基金修订基金合同、托管协议并更新招募说明书、产品资料概要的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2020-11-28
21	博道嘉元混合型证券投资基金基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-11-28

§ 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嘉元混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道嘉元混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道嘉元混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道嘉元混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道嘉元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、报告期内博道嘉元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
二〇二一年三月三十一日