

博道消费智航股票型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022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	9
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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	68
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	68
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	68
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	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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.....	70
§9 开放式基金份额变动.....	70
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
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.....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§12 备查文件目录.....	74
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道消费智航股票型证券投资基金
基金简称	博道消费智航
基金主代码	010998
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年05月07日
基金管理人	博道基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	498,084,727.27份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注消费主题相关上市公司股票的投资机会，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，业绩比较基准中股票资产部分以中信消费风格指数为基准指数，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金重点投资于中信消费风格指数涵盖的消费制造和消费服务业及与其密切相关上下游产业的上市公司，主要包括：食品饮料、医药、农林牧渔、家电、商贸零售、纺织服装、轻工制造、消费者服务、房地产、传媒等行业。对于当前未被归入前述行业，但后续因为科学技术发展、产业结构升级、并购重组、业务转型等原因，提供的产品或服务隶属于上述行业的公司，本基金也可将其纳入消费主题范畴。个股选择综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，综合评价后挑选符合一定标准的股票构建组合，其中投资于本基金界定的消费主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。最后，利用投资组合优化工具，最大化组合的预期收益，

	以此来确定个股的投资权重, 并根据市场的变化及时调整投资组合, 力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、参与融资业务的策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中信消费风格指数收益率×90%+同期银行活期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金, 理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国光大银行股份有限公司
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	95595
传真	021-80226289	010-63639132
注册地址	上海市虹口区东大名路687号1幢262室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200122	100033
法定代表人	莫泰山	李晓鹏

2.4 信息披露方式

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

基金中期报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室
------------	---------------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
本期已实现收益	-78,331,583.91
本期利润	-60,831,350.62
加权平均基金份额本期利润	-0.1173
本期加权平均净值利润率	-14.12%
本期基金份额净值增长率	-11.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	-96,622,081.82
期末可供分配基金份额利润	-0.1940
期末基金资产净值	429,643,520.52
期末基金份额净值	0.8626
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-13.74%

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

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	10.53%	1.05%	9.90%	1.00%	0.63%	0.05%
过去三个月	4.72%	1.48%	7.36%	1.33%	-2.64%	0.15%
过去六个月	-11.27%	1.46%	-6.94%	1.38%	-4.33%	0.08%
过去一年	-15.92%	1.37%	-13.08%	1.32%	-2.84%	0.05%
自基金合同生效起至今	-13.74%	1.30%	-9.14%	1.28%	-4.60%	0.02%

注：本基金的业绩比较基准请见“2.2 基金产品说明”，每日进行再平衡过程。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博道消费智航股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年05月07日-2022年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2021年5月7日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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22只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月定期开放混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金和博道研究恒选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		
杨梦	博道启航混合、博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道久航混合、博道消费智航、博道成长智航的基金经理、量化投资部总经	2021-05-07	-	11年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年1

	理兼研究部副总经理			<p>1月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司，现任量化投资部总经理兼研究部副总经理。具有基金从业资格。自2018年8月10日起担任博道启航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年1月3日起担任博道中证500指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月26日起担任博道沪深300指数增强型证券投资基金基金经理至今、自2019年4月30日起担任博道远航混合型证券投资基金基金经理至今、自2019年6月5日起担任博道叁佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年9月26日起担任博道伍佰智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2019年12月24日起担任博道久航混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年5月7日起担任博道消费智航股票型证券投资基金基金经理至今、自2021年10月26日起担任博道成长智航股票型证券投资基金基金经理至今。</p>
--	-----------	--	--	--

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10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

2022年上半年，多数指数为负收益，沪深300下跌9.22%，中证500下跌12.30%，创业板指数下跌15.41%；从行业来看，煤炭表现一枝独秀，成长行业虽然二季度有所反弹，但上半年整体仍然跌幅较大。从因子表现来看，一季度价值和量价类因子表现较好，二季度基本面趋势类型的因子尤其是成长因子表现较好。

上半年市场波动较大，A股呈现“V”形走势。外部因素叠加对全球大类资产都造成重大影响，压制了风险资产的估值，市场风险偏好下行，特别是长久期成长股受到更明显的制约。4月，美联储加速引导加息缩表预期，而国内经济基本面受到疫情冲击，市场盈利预期较为悲观，估值达到历史底部。5月以来，随着国内疫情管控取得一定成效，尤其6月起上海全面推动复工复产，市场情绪逐步修复，疫情后的“复苏”逻辑有所演绎，政策鼓励和支持的汽车消费，以及景气度比较高的成长板块，表现较为亮眼。

报告期间，本基金维持配置中信消费风格指数多因子选股增强模型，受选股因子适应性的影响，产品在本报告期间未能跑赢业绩比较基准。

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

展望未来，在政策支持同时经济内生修复的背景下，经济基本面和盈利增长将迎来一段时间的环比改善，这种宏观环境的好处在于，大部分行业都能找到向好的信号，市场情绪会相对较好，胜率可期；同时，从配置的角度而言，我们计算的两种标准化估值，一种用市盈率来衡量，一种用指数与宏观经济基本面的比价来衡量，均显示现在大致处于1倍标准差左右的较便宜的位置，对于长期配置也是较有吸引力的。

本基金管理人将继续坚持量化多因子的选股思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有长期竞争力的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由营运分管领导、督察长、基金事务部负责人、投委会主席、研究部负责人、投资运营部负责人、监察稽核部负责人及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§ 5 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，中国光大银行股份有限公司在博道消费智航股票型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《博道消费智航股票型证券投资基金2022年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：博道消费智航股票型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日

资产：			
银行存款	6.4.7.1	18,058,366.08	20,698,701.69
结算备付金		92,952.66	92,213.56
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	412,470,919.08	503,560,548.77
其中：股票投资		395,656,605.38	483,590,548.77
基金投资		-	-
债券投资		16,814,313.70	19,970,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		144,736.89	67,720.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	181,646.92
资产总计		430,766,974.71	524,600,831.02
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
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		372,677.13	3,040,511.00
应付管理人报酬		498,018.46	674,535.02
应付托管费		83,003.08	112,422.48
应付销售服务费		-	-
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	169,755.52	148,682.18
负债合计		1,123,454.19	3,976,150.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	498,084,727.27	535,504,287.82
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-68,441,206.75	-14,879,607.48
净资产合计		429,643,520.52	520,624,680.34
负债和净资产总计		430,766,974.71	524,600,831.02

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：博道消费智航股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年05月07日（基金 合同生效日）至2021 年06月30日
一、营业总收入		-56,985,985.67	17,888,611.46

1. 利息收入		42,964.47	395,883.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,964.16	205,086.79
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		0.31	190,796.36
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-74,623,515.17	8,442,771.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-78,772,002.31	5,875,281.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	289,335.14	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	3,859,152.00	2,567,490.08
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	17,500,233.29	9,049,957.15
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	94,331.74	-
减：二、营业总支出		3,845,364.95	2,600,147.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,214,021.11	1,328,936.01
2. 托管费	6.4.10.2.	535,670.18	221,489.32

	2		
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,191.02	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,191.02	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.31	-
8. 其他费用	6.4.7.17	91,482.33	1,049,721.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-60,831,350.62	15,288,464.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-60,831,350.62	15,288,464.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-60,831,350.62	15,288,464.34

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博道消费智航股票型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	535,504,287.82	-	-14,879,607.48	520,624,680.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产 (基金净值)	535,504,287. 82	-	-14,879,607. 48	520,624,680. 34
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-37,419,560. 55	-	-53,561,599. 27	-90,981,159. 82
(一)、综合收益总 额	-	-	-60,831,350. 62	-60,831,350. 62
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	-37,419,560. 55	-	7,269,751.35	-30,149,809. 20
其中: 1. 基金申购款	30,064,062.9 0	-	-4,303,236.4 7	25,760,826.4 3
2. 基金赎回 款	-67,483,623. 45	-	11,572,987.8 2	-55,910,635. 63
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	498,084,727. 27	-	-68,441,206. 75	429,643,520. 52
项 目	上年度可比期间 2021年05月07日(基金合同生效日)至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	590,493,121. 54	-	-	590,493,121. 54
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-	-	15,288,464.3 4	15,288,464.3 4
(一)、综合收益总 额	-	-	15,288,464.3 4	15,288,464.3 4
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回 款	-	-	-	-
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	590,493,121. 54	-	15,288,464.3 4	605,781,585. 88

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

博道消费智航股票型证券投资基金（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[2020]2964号《关于准予博道消费智航股票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《博道消费智航股票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 590,299,610.06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（2021）第0468号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道消费智航股票型证券投资基金基金合同》于2021年5月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 590,493,121.54份基金份额，其中认购资金利息折合193,511.48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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道消费智航股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。基金管理人在进行融资融券等投资前，须与基金托管人就交收结算、核算估值等业务规则和流程进行沟通确定，在系统测试通过后才可投资，否则，由此产生的风险由基金管理人承担。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不低于80%，投资于本基金界定的消费主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，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信消费风格指数收益率×90%+同期银行活期存款利率（税后）×10%。

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》、

《博道消费智航股票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2022年1月1日至2022年6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2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则：

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具：

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具：

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)：

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。本基金目前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中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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则：

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)：

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则：

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息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相关交易费用及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。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）：

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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净资产转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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(可转换债券除外)或挂牌转让的固定收益品种，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。

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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果对比如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收利息和应收申购款，金额分别为 20,698,701.69 元、92,213.56 元、181,646.92 元和 67,720.08 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 20,701,676.29 元、92,255.74 元、0.00 元和 67,720.08 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 503,560,548.77 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 503,739,178.91 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,040,511.00 元、674,535.02 元、112,422.48 元和 8,682.18 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,040,511.00 元、674,535.02 元、112,422.48 元和 8,682.18 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	2,465,593.94	
等于：本金	2,465,050.59	
加：应计利息	543.35	
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	15,592,772.14	
等于：本金	15,590,741.15	
加：应计利息	2,030.99	
减：坏账准备	-	
合计	18,058,366.08	

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			
	2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	371,556,698.93	-	395,656,605.38	24,099,906.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市	16,467,957.00	311,013.70	16,814,313.70	35,343.00

券	场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,467,957.00	311,013.70	16,814,313.70	35,343.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		388,024,655.93	311,013.70	412,470,919.08	24,135,249.45

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	435.71
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	29,752.78
预提费用-信息披露费	139,507.37
其他应付	59.66
合计	169,755.52

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	535,504,287.82	535,504,287.82
本期申购	30,064,062.90	30,064,062.90
本期赎回（以“-”号填列）	-67,483,623.45	-67,483,623.45
本期末	498,084,727.27	498,084,727.27

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-23,937,504.83	9,057,897.35	-14,879,607.48
本期利润	-78,331,583.91	17,500,233.29	-60,831,350.62
本期基金份额交易产生的变动数	5,647,006.92	1,622,744.43	7,269,751.35
其中：基金申购款	-3,537,577.98	-765,658.49	-4,303,236.47
基金赎回款	9,184,584.90	2,388,402.92	11,572,987.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-96,622,081.82	28,180,875.07	-68,441,206.75

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	9,630.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	32,636.64
结算备付金利息收入	696.92
其他	-
合计	42,964.16

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	1,963,862,119.70
减：卖出股票成本总额	2,037,921,461.13
减：交易费用	4,712,660.88
买卖股票差价收入	-78,772,002.31

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	187,890.09
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	101,445.05
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	289,335.14

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,119,158.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,962,195.32
减：应计利息总额	55,516.87
减：交易费用	1.72
买卖债券差价收入	101,445.05

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,859,152.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,859,152.00

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	17,500,233.29

——股票投资	17,473,730.29
——债券投资	26,503.00
——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	17,500,233.29

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	93,935.81
转换费收入	395.93
合计	94,331.74

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。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	2,222.18
合计	91,482.33

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。

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
中国光大银行股份有限公司	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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年05月07日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,214,021.11	1,328,936.01
其中：支付销售机构的客户维护费	1,330,755.27	579,054.55

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年05月07日（基金合同生 效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	535,670.18	221,489.32

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01	上年度可比期间 2021年05月07日（基金
----	------------------	---------------------------

	日至2022年06月30日	合同生效日)至2021年06月30日
基金合同生效日(2021年05月07日)持有的基金份额	0.00	3,000,166.93
报告期初持有的基金份额	3,000,166.93	0.00
报告期间申购/买入总份额	2,216,678.31	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,216,845.24	3,000,166.93
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.05%	0.51%

注:

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;
- 2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务;
- 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、基金投资和部门负责人持有本基金份额总量的数量区间10~50万份。

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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年05月07日(基金合同生效日) 至2021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
中国光大银行股份有限公司	2,465,593.94	9,630.60	1,917,067.14	51,307.47

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021-12-24	6个月以上	主板打新限售	57.58	60.26	43,681	2,515,151.98	2,632,217.06	-
600938	中国海油	2022-04-14	6个月以上	主板打新限售	10.80	15.86	42,002	453,621.60	666,151.72	-
688052	纳芯微	2022-04-14	6个月以上	科创板打新限售	230.00	350.81	1,305	300,150.00	457,807.05	-
688048	长光华芯	2022-03-25	6个月以上	科创板打新限售	80.80	111.97	3,011	243,288.80	337,141.67	-
688262	国芯科技	2021-12-28	6个月以上	科创板打新限售	41.98	47.75	4,606	193,359.88	219,936.50	-
3011	元道	2022	1个月内	新股	38.4	38.4	4,424	170,	170,	-

39	通信	-06-30	(含)	未上市	6	6		147.04	147.04	
301175	中科环保	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	39,649	151,459.18	151,459.18	-
688400	凌云光	2022-06-27	6个月以上	科创板打新限售	21.93	21.93	6,826	149,694.18	149,694.18	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	4,266	143,550.90	143,550.90	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月以上	创业板打新限售	19.18	32.07	1,218	23,361.24	39,061.26	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月以上	创业板打新限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月以上	创业板打新限售	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月以上	创业板打新限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月以上	创业板打新限售	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-

				售						
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月以上	创业板打新限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月以上	创业板打新限售	52.03	56.42	349	18,158.47	19,690.58	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月以上	创业板打新限售	38.46	38.46	492	18,922.32	18,922.32	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月以上	创业板打新限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月以上	创业板打新限售	72.88	31.38	388	28,277.44	12,175.44	-
301236	软通动力	2022-06-09	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	31.38	194	-	6,087.72	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月以上	创业板打新限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月以上	创业板打新限售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-

301153	中科江南	2022-05-10	6个月以上	创业板打新限售	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月以上	创业板打新限售	34.81	16.14	717	24,958.77	11,572.38	-
301109	军信股份	2022-06-17	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	16.14	358	-	5,778.12	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月以上	创业板打新限售	163.56	82.76	138	22,571.28	11,420.88	-
301150	中一科技	2022-06-10	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	82.76	69	-	5,710.44	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月以上	创业板打新限售	3.82	3.82	4,406	16,830.92	16,830.92	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月以上	创业板打新限售	56.88	56.42	297	16,893.36	16,756.74	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	创业板打新限售	109.30	45.69	242	26,450.60	11,056.98	-

301206	三元生物	2022-06-17	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	45.69	121	-	5,528.49	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月以上	创业板打新限售	33.65	33.65	475	15,983.75	15,983.75	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月以上	创业板打新限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月以上	创业板打新限售	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月以上	创业板打新限售	42.50	32.02	367	15,597.50	11,751.34	-
301103	何氏眼科	2022-06-01	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	32.02	110	-	3,522.20	-
301160	翔楼新材	2022-05-25	6个月以上	创业板打新限售	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月以上	创业板打新限售	35.68	29.84	490	17,483.20	14,621.60	-

301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月以上	创业板打新限售	39.88	31.09	459	18,304.92	14,270.31	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6个月以上	创业板打新限售	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月以上	创业板打新限售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月以上	创业板打新限售	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月以上	创业板打新限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月以上	创业板打新限售	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月以上	创业板打新限售	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月以上	创业板打新限售	37.23	25.39	474	17,647.02	12,034.86	-
301219	腾远钴业	2022-03-	6个月以上	创业板打	173.98	87.82	76	13,222.4	6,674.32	-

		10		新限售				8		
301219	腾远钴业	2022-05-24	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	87.82	61	-	5,357.02	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月以上	创业板打新限售	30.82	21.46	558	17,197.56	11,974.68	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月以上	创业板打新限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	创业板打新限售	55.57	30.03	390	21,672.30	11,711.70	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月以上	创业板打新限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月以上	创业板打新限售	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月以上	创业板打新限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月以上	创业板打新限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-

				售						
3011 25	腾亚 精工	2022 -05- 27	6个月以 上	创业 板打 新限 售	22.4 9	27.4 2	327	7,35 4.23	8,96 6.34	-
3011 63	宏德 股份	2022 -04- 11	6个月以 上	创业 板打 新限 售	26.2 7	32.3 3	277	7,27 6.79	8,95 5.41	-
3011 30	西点 药业	2022 -02- 16	6个月以 上	创业 板打 新限 售	22.5 5	37.7 0	237	5,34 4.35	8,93 4.90	-
3011 35	瑞德 智能	2022 -04- 01	6个月以 上	创业 板打 新限 售	31.9 8	26.2 6	338	10,8 09.2 4	8,87 5.88	-
3011 10	青木 股份	2022 -03- 04	6个月以 上	创业 板打 新限 售	63.1 0	39.8 5	202	12,7 46.2 0	8,04 9.70	-
3012 28	实朴 检测	2022 -01- 21	6个月以 上	创业 板打 新限 售	20.0 8	20.3 4	373	7,48 9.84	7,58 6.82	-
3011 96	唯科 科技	2022 -01- 04	6个月以 上	创业 板打 新限 售	64.0 8	37.5 2	192	12,3 03.3 6	7,20 3.84	-
3012 79	金道 科技	2022 -04- 06	6个月以 上	创业 板打 新限 售	31.2 0	22.8 1	296	9,23 5.20	6,75 1.76	-
3012	盛帮	2022	6个月以	创业	41.5	41.5	158	6,56	6,56	-

33	股份	-06- 24	上	板打 新限 售	2	2		0.16	0.16	
----	----	------------	---	---------------	---	---	--	------	------	--

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人光大银行，其他存款存放于东方证券股份有限公司和浙商证券股份有限公司，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2022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（2021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2022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(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。

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2022年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.33%。

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2022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424,675,810.41元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	18,058,366.08	-	-	-	-	-	18,058,366.08
结算备付金	92,952.66	-	-	-	-	-	92,952.66
交易性金融资产	16,814,313.70	-	-	-	-	395,656,605.38	412,470,919.08
应收申购款	-	-	-	-	-	144,736.89	144,736.89
资产总计	34,965,632.44	-	-	-	-	395,801,342.27	430,766,974.71
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	372,677.13	372,677.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	498,018.46	498,018.46
应付托管费	-	-	-	-	-	83,003.08	83,003.08
其他负债	-	-	-	-	-	169,755.52	169,755.52
负债总计	-	-	-	-	-	1,123,454.19	1,123,454.19
利率敏感度缺口	34,965,632.44	-	-	-	-	394,677,888.08	429,643,520.52
上年度末 2021 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	20,698,701.69	-	-	-	-	-	20,698,701.69
结算备付金	92,213.56	-	-	-	-	-	92,213.56
交易性金融资产	-	-	19,970,000.00	-	-	483,590,548.77	503,560,548.77

产							
应收利息	-	-	-	-	-	181,646.92	181,646.92
应收申购款	-	-	-	-	-	67,720.08	67,720.08
资产总计	20,790,915.25	-	19,970,000.00	-	-	483,839,915.77	524,600,831.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,040,511.00	3,040,511.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	674,535.02	674,535.02
应付托管费	-	-	-	-	-	112,422.48	112,422.48
其他负债	-	-	-	-	-	148,682.18	148,682.18
负债总计	-	-	-	-	-	3,976,150.68	3,976,150.68
利率敏感度缺口	20,790,915.25	-	19,970,000.00	-	-	479,863,765.09	520,624,680.34

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2022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资产净值的比例为3.91%（2021年12月31日：3.84%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种

进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的80%，投资于本基金界定的消费主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留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%，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 2022年06月30日		上年度末 2021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	395,656,605.38	92.09	483,590,548.77	92.89
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	395,656,605.38	92.09	483,590,548.77	92.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中信消费风格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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 中信消费风格指数收益率上升5%	19,018,853.16	24,755,397.48
	2. 中信消费风格指数收益率下降5%	-19,018,853.16	-24,755,397.48

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	389,941,166.90	475,605,610.12
第二层次	17,546,337.51	23,837,363.39
第三层次	4,983,414.67	4,117,575.26
合计	412,470,919.08	503,560,548.77

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，确定相关股票和债券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2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	395,656,605.38	91.85
	其中：股票	395,656,605.38	91.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,814,313.70	3.90
	其中：债券	16,814,313.70	3.90
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,151,318.74	4.21
8	其他各项资产	144,736.89	0.03

9	合计	430,766,974.71	100.00
---	----	----------------	--------

注：银行存款和结算备付金合计余额包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	14,354,421.03	3.34
B	采矿业	3,056,490.72	0.71
C	制造业	332,562,061.22	77.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,341,840.00	0.55
E	建筑业	270,160.00	0.06
F	批发和零售业	10,892,711.16	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	292,950.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,625,260.11	1.31
J	金融业	2,632,820.00	0.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,918,805.31	1.14
M	科学研究和技术服务业	13,286,263.02	3.09
N	水利、环境和公共设施管理业	197,686.62	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,225,136.19	1.22
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	395,656,605.38	92.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	18,239	37,298,755.00	8.68
2	000858	五粮液	100,600	20,314,158.00	4.73
3	000568	泸州老窖	68,046	16,776,060.84	3.90
4	600887	伊利股份	323,600	12,604,220.00	2.93
5	002304	洋河股份	64,761	11,860,977.15	2.76
6	000333	美的集团	178,600	10,785,654.00	2.51
7	603259	药明康德	80,235	8,343,637.65	1.94
8	600809	山西汾酒	19,246	6,251,100.80	1.45
9	603392	万泰生物	35,055	5,444,041.50	1.27
10	300138	晨光生物	281,800	4,387,626.00	1.02
11	603317	天味食品	149,300	4,250,571.00	0.99
12	603882	金域医学	51,200	4,226,560.00	0.98
13	000651	格力电器	118,600	3,999,192.00	0.93
14	002344	海宁皮城	832,300	3,886,841.00	0.90
15	002615	哈尔斯	601,000	3,738,220.00	0.87
16	600380	健康元	296,700	3,664,245.00	0.85
17	688575	亚辉龙	168,237	3,519,518.04	0.82
18	300911	亿田智能	45,700	3,512,045.00	0.82
19	002419	天虹股份	492,100	3,508,673.00	0.82
20	300453	三鑫医疗	349,500	3,474,030.00	0.81
21	603868	飞科电器	45,662	3,458,896.50	0.81
22	600276	恒瑞医药	89,347	3,313,880.23	0.77
23	603919	金徽酒	97,083	3,299,851.17	0.77
24	300871	回盛生物	146,394	3,238,235.28	0.75
25	002216	三全食品	165,200	3,236,268.00	0.75

26	002432	九安医疗	51,400	3,087,084.00	0.72
27	603387	基蛋生物	214,076	3,052,723.76	0.71
28	000895	双汇发展	103,200	3,023,760.00	0.70
29	300363	博腾股份	37,680	2,938,663.20	0.68
30	300760	迈瑞医疗	9,382	2,938,442.40	0.68
31	300832	新产业	64,400	2,905,084.00	0.68
32	002756	永兴材料	17,600	2,678,896.00	0.62
33	002646	天佑德酒	139,200	2,665,680.00	0.62
34	002714	牧原股份	48,051	2,655,778.77	0.62
35	600597	光明乳业	210,000	2,652,300.00	0.62
36	300181	佐力药业	265,500	2,639,070.00	0.61
37	000921	海信家电	186,000	2,637,480.00	0.61
38	600941	中国移动	43,681	2,632,217.06	0.61
39	300390	天华超净	30,100	2,630,740.00	0.61
40	300573	兴齐眼药	17,000	2,606,440.00	0.61
41	603456	九洲药业	48,500	2,507,450.00	0.58
42	600600	青岛啤酒	24,000	2,494,080.00	0.58
43	300171	东富龙	73,200	2,482,212.00	0.58
44	600598	北大荒	167,000	2,464,920.00	0.57
45	600566	济川药业	89,400	2,428,104.00	0.57
46	002645	华宏科技	111,200	2,426,384.00	0.56
47	300057	万顺新材	251,800	2,384,546.00	0.56
48	002759	天际股份	87,100	2,367,378.00	0.55
49	300482	万孚生物	57,800	2,353,038.00	0.55
50	000596	古井贡酒	9,400	2,346,804.00	0.55
51	600863	内蒙华电	641,600	2,341,840.00	0.55
52	603198	迎驾贡酒	35,900	2,338,526.00	0.54
53	002240	盛新锂能	38,400	2,317,824.00	0.54
54	600132	重庆啤酒	15,800	2,316,280.00	0.54
55	000915	华特达因	56,000	2,315,600.00	0.54
56	600559	老白干酒	79,400	2,277,986.00	0.53

57	000567	海德股份	152,015	2,249,822.00	0.52
58	603676	卫信康	222,500	2,242,800.00	0.52
59	000989	九芝堂	239,389	2,178,439.90	0.51
60	300896	爱美客	3,600	2,160,036.00	0.50
61	688179	阿拉丁	40,721	2,086,544.04	0.49
62	000661	长春高新	8,300	1,937,386.00	0.45
63	300639	凯普生物	89,400	1,911,372.00	0.44
64	002932	明德生物	27,318	1,872,922.08	0.44
65	603309	维力医疗	115,300	1,826,352.00	0.43
66	600371	万向德农	136,800	1,826,280.00	0.43
67	688606	奥泰生物	14,803	1,800,340.86	0.42
68	300170	汉得信息	190,800	1,719,108.00	0.40
69	300217	东方电热	278,364	1,703,587.68	0.40
70	300087	荃银高科	101,950	1,678,097.00	0.39
71	603538	美诺华	52,334	1,666,837.90	0.39
72	002959	小熊电器	26,500	1,651,745.00	0.38
73	002416	爱施德	177,300	1,648,890.00	0.38
74	002891	中宠股份	64,850	1,648,487.00	0.38
75	003020	立方制药	55,850	1,643,107.00	0.38
76	000930	中粮科技	178,400	1,612,736.00	0.38
77	002461	珠江啤酒	188,118	1,595,240.64	0.37
78	603127	昭衍新药	14,000	1,593,200.00	0.37
79	002091	江苏国泰	141,800	1,524,350.00	0.35
80	688050	爱博医疗	6,783	1,520,748.60	0.35
81	002286	保龄宝	128,900	1,475,905.00	0.34
82	603288	海天味业	15,100	1,364,436.00	0.32
83	600690	海尔智家	49,400	1,356,524.00	0.32
84	300196	长海股份	71,667	1,353,789.63	0.32
85	000552	靖远煤电	313,800	1,352,478.00	0.31
86	002041	登海种业	62,500	1,318,125.00	0.31
87	688617	惠泰医疗	6,000	1,314,480.00	0.31

88	300633	开立医疗	43,600	1,309,308.00	0.30
89	603661	恒林股份	30,300	1,291,689.00	0.30
90	002572	索菲亚	45,600	1,254,000.00	0.29
91	000848	承德露露	128,400	1,242,912.00	0.29
92	002422	科伦药业	65,200	1,219,240.00	0.28
93	688314	康拓医疗	24,200	1,174,910.00	0.27
94	300498	温氏股份	54,764	1,165,925.56	0.27
95	688289	圣湘生物	39,098	1,157,691.78	0.27
96	603345	安井食品	6,600	1,107,942.00	0.26
97	002982	湘佳股份	26,600	1,095,388.00	0.25
98	600737	中粮糖业	131,000	985,120.00	0.23
99	603229	奥翔药业	25,740	979,664.40	0.23
100	603896	寿仙谷	24,600	953,988.00	0.22
101	000799	酒鬼酒	5,100	947,631.00	0.22
102	688363	华熙生物	6,635	943,364.30	0.22
103	688356	键凯科技	3,800	918,878.00	0.21
104	605377	华旺科技	50,401	902,681.91	0.21
105	600089	特变电工	32,300	884,697.00	0.21
106	600436	片仔癀	2,467	880,052.91	0.20
107	002841	视源股份	11,400	858,648.00	0.20
108	600929	雪天盐业	92,400	857,472.00	0.20
109	603816	顾家家居	14,900	843,787.00	0.20
110	600073	上海梅林	105,200	838,444.00	0.20
111	600195	中牧股份	67,520	827,795.20	0.19
112	300015	爱尔眼科	18,400	823,768.00	0.19
113	603668	天马科技	40,200	823,698.00	0.19
114	688166	博瑞医药	33,621	811,947.15	0.19
115	000553	安道麦A	64,800	784,728.00	0.18
116	300858	科拓生物	29,400	783,510.00	0.18
117	600415	小商品城	134,200	747,494.00	0.17
118	002129	TCL中环	12,400	730,236.00	0.17

119	600256	广汇能源	69,200	729,368.00	0.17
120	688621	阳光诺和	6,600	722,040.00	0.17
121	301004	嘉益股份	29,600	700,336.00	0.16
122	600938	中国海油	42,002	666,151.72	0.16
123	000929	兰州黄河	69,400	630,152.00	0.15
124	000869	张裕A	20,800	618,592.00	0.14
125	002821	凯莱英	2,100	606,900.00	0.14
126	600873	梅花生物	48,600	548,208.00	0.13
127	300401	花园生物	30,615	530,864.10	0.12
128	600702	舍得酒业	2,600	530,374.00	0.12
129	002507	涪陵榨菜	15,200	524,704.00	0.12
130	300146	汤臣倍健	24,200	523,930.00	0.12
131	603369	今世缘	10,100	515,100.00	0.12
132	000963	华东医药	11,000	496,760.00	0.12
133	002078	太阳纸业	40,000	492,400.00	0.11
134	300009	安科生物	48,600	491,346.00	0.11
135	603156	养元饮品	21,400	486,208.00	0.11
136	601118	海南橡胶	97,400	465,572.00	0.11
137	600993	马应龙	19,800	461,340.00	0.11
138	603719	良品铺子	16,000	458,080.00	0.11
139	688052	纳芯微	1,305	457,807.05	0.11
140	600839	四川长虹	156,000	449,280.00	0.10
141	300326	凯利泰	53,800	444,388.00	0.10
142	300869	康泰医学	15,600	440,856.00	0.10
143	600186	莲花健康	166,000	438,240.00	0.10
144	688297	中无人机	8,194	435,756.92	0.10
145	002773	康弘药业	29,000	433,260.00	0.10
146	002495	佳隆股份	157,200	430,728.00	0.10
147	603579	荣泰健康	17,400	428,910.00	0.10
148	300434	金石亚药	43,480	428,278.00	0.10
149	300915	海融科技	9,000	426,780.00	0.10

150	300289	利德曼	67,400	423,946.00	0.10
151	600916	中国黄金	36,000	421,200.00	0.10
152	300314	戴维医疗	39,600	420,552.00	0.10
153	688566	吉贝尔	22,800	419,064.00	0.10
154	603355	莱克电气	16,600	418,818.00	0.10
155	300625	三雄极光	34,800	418,296.00	0.10
156	600467	好当家	147,135	414,920.70	0.10
157	600251	冠农股份	38,900	414,674.00	0.10
158	300439	美康生物	34,000	412,760.00	0.10
159	603020	爱普股份	39,000	412,620.00	0.10
160	300970	华绿生物	21,800	412,456.00	0.10
161	002497	雅化集团	12,600	411,390.00	0.10
162	300233	金城医药	14,400	410,832.00	0.10
163	600664	哈药股份	134,400	404,544.00	0.09
164	002772	众兴菌业	57,600	404,352.00	0.09
165	002393	力生制药	19,000	403,180.00	0.09
166	600419	天润乳业	29,800	401,704.00	0.09
167	002566	益盛药业	49,600	400,768.00	0.09
168	600710	苏美达	67,800	400,020.00	0.09
169	601996	丰林集团	134,400	397,824.00	0.09
170	000541	佛山照明	77,500	397,575.00	0.09
171	601116	三江购物	37,700	393,211.00	0.09
172	002574	明牌珠宝	80,300	391,061.00	0.09
173	603976	正川股份	15,800	388,838.00	0.09
174	002723	金莱特	32,400	383,616.00	0.09
175	601838	成都银行	23,100	382,998.00	0.09
176	000625	长安汽车	22,100	382,772.00	0.09
177	002950	奥美医疗	30,000	378,600.00	0.09
178	000019	深粮控股	48,900	377,019.00	0.09
179	002466	天齐锂业	3,000	374,400.00	0.09
180	600211	西藏药业	9,000	373,590.00	0.09

181	603987	康德莱	18,600	370,698.00	0.09
182	603367	辰欣药业	31,200	370,032.00	0.09
183	300583	赛托生物	16,000	361,600.00	0.08
184	300739	明阳电路	21,400	342,828.00	0.08
185	300977	深圳瑞捷	11,775	339,120.00	0.08
186	688048	长光华芯	3,011	337,141.67	0.08
187	688677	海泰新光	3,654	336,131.46	0.08
188	605369	拱东医疗	2,600	322,920.00	0.08
189	603079	圣达生物	24,200	322,102.00	0.07
190	603050	科林电气	23,400	320,346.00	0.07
191	600499	科达制造	15,400	317,856.00	0.07
192	000726	鲁泰A	44,100	315,315.00	0.07
193	002521	齐峰新材	58,600	314,682.00	0.07
194	300765	新诺威	21,800	311,086.00	0.07
195	603556	海兴电力	20,400	310,488.00	0.07
196	688377	迪威尔	10,000	309,500.00	0.07
197	601666	平煤股份	22,700	308,493.00	0.07
198	600370	三房巷	86,600	303,966.00	0.07
199	603687	大胜达	32,600	303,832.00	0.07
200	002923	润都股份	17,680	302,681.60	0.07
201	603042	华脉科技	29,000	298,120.00	0.07
202	300634	彩讯股份	23,400	297,180.00	0.07
203	688336	三生国健	19,000	295,260.00	0.07
204	002658	雪迪龙	41,800	293,854.00	0.07
205	002099	海翔药业	42,400	293,832.00	0.07
206	600662	外服控股	43,400	292,950.00	0.07
207	002738	中矿资源	3,120	288,943.20	0.07
208	000565	渝三峡A	44,600	288,116.00	0.07
209	300239	东宝生物	36,200	285,980.00	0.07
210	002030	达安基因	16,600	285,354.00	0.07
211	688556	高测股份	3,502	282,611.40	0.07

212	002494	华斯股份	66,600	281,052.00	0.07
213	002167	东方锆业	38,200	279,624.00	0.07
214	002878	元隆雅图	14,000	270,200.00	0.06
215	601390	中国中铁	44,000	270,160.00	0.06
216	002365	永安药业	21,800	268,576.00	0.06
217	603908	牧高笛	2,800	266,420.00	0.06
218	300389	艾比森	23,600	245,204.00	0.06
219	600488	天药股份	56,800	244,240.00	0.06
220	600097	开创国际	23,800	233,954.00	0.05
221	688262	国芯科技	4,606	219,936.50	0.05
222	002299	圣农发展	11,400	218,652.00	0.05
223	300661	圣邦股份	1,200	218,424.00	0.05
224	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.05
225	601869	长飞光纤	6,400	197,888.00	0.05
226	600520	文一科技	22,200	194,916.00	0.05
227	301139	元道通信	4,916	189,069.36	0.04
228	605088	冠盛股份	13,600	183,328.00	0.04
229	603165	荣晟环保	12,400	181,040.00	0.04
230	600308	华泰股份	30,800	175,868.00	0.04
231	603889	新澳股份	27,000	170,640.00	0.04
232	301175	中科环保	44,055	168,290.10	0.04
233	301239	普瑞眼科	4,741	159,534.65	0.04
234	688400	凌云光	6,826	149,694.18	0.03
235	600645	中源协和	7,600	147,972.00	0.03
236	301219	腾远钴业	1,368	125,874.22	0.03
237	300834	星辉环材	3,894	117,742.74	0.03
238	301207	华兰疫苗	1,469	86,385.26	0.02
239	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
240	301238	瑞泰新材	1,218	39,061.26	0.01
241	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
242	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01

243	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
244	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
245	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
246	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
247	301302	华如科技	349	19,690.58	0.00
248	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
249	301236	软通动力	582	18,263.16	0.00
250	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
251	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
252	301109	军信股份	1,075	17,350.50	0.00
253	301150	中一科技	207	17,131.32	0.00
254	301206	三元生物	363	16,585.47	0.00
255	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
256	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
257	301103	何氏眼科	477	15,273.54	0.00
258	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
259	301216	万凯新材	490	14,621.60	0.00
260	301102	兆讯传媒	459	14,270.31	0.00
261	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
262	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
263	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
264	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
265	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
266	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
267	301123	奕东电子	474	12,034.86	0.00
268	301151	冠龙节能	558	11,974.68	0.00
269	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
270	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
271	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
272	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
273	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00

274	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
275	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
276	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
277	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
278	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
279	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
280	301196	唯科科技	192	7,203.84	0.00
281	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000568	泸州老窖	28,568,859.41	5.49
2	000858	五粮液	22,618,749.98	4.34
3	600519	贵州茅台	22,210,723.00	4.27
4	002304	洋河股份	19,979,816.53	3.84
5	600809	山西汾酒	19,609,292.05	3.77
6	603259	药明康德	16,836,935.56	3.23
7	603198	迎驾贡酒	16,443,566.00	3.16
8	300347	泰格医药	16,097,353.86	3.09
9	603127	昭衍新药	15,428,816.18	2.96
10	300759	康龙化成	14,374,359.74	2.76
11	603589	口子窖	13,870,561.25	2.66
12	603668	天马科技	12,258,832.00	2.35
13	603392	万泰生物	12,253,749.40	2.35
14	300363	博腾股份	12,241,470.80	2.35
15	600594	益佰制药	12,109,744.00	2.33
16	603369	今世缘	11,765,534.30	2.26
17	688050	爱博医疗	11,391,273.61	2.19

18	603896	寿仙谷	11,368,478.16	2.18
19	688578	艾力斯	11,288,885.28	2.17
20	600690	海尔智家	11,184,563.64	2.15
21	300760	迈瑞医疗	10,735,429.33	2.06
22	002507	涪陵榨菜	10,734,848.00	2.06
23	688298	东方生物	10,536,143.75	2.02
24	600887	伊利股份	10,519,717.00	2.02

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	000568	泸州老窖	30,239,104.94	5.81
2	600519	贵州茅台	28,891,116.10	5.55
3	600809	山西汾酒	24,313,429.40	4.67
4	000858	五粮液	21,785,537.00	4.18
5	603589	口子窖	21,302,076.59	4.09
6	603198	迎驾贡酒	21,000,940.00	4.03
7	603259	药明康德	20,224,571.21	3.88
8	300759	康龙化成	19,033,294.32	3.66
9	600690	海尔智家	18,328,552.76	3.52
10	300347	泰格医药	16,464,344.59	3.16
11	603566	普莱柯	15,950,302.49	3.06
12	300363	博腾股份	14,995,204.00	2.88
13	603369	今世缘	14,286,346.31	2.74
14	603127	昭衍新药	14,153,021.35	2.72
15	603668	天马科技	13,436,328.56	2.58
16	600702	舍得酒业	13,411,283.00	2.58
17	600436	片仔癀	13,071,557.52	2.51

18	600887	伊利股份	12,728,499.64	2.44
19	300760	迈瑞医疗	12,460,247.00	2.39
20	600779	水井坊	12,457,347.00	2.39
21	600415	小商品城	11,923,411.00	2.29
22	300896	爱美客	11,575,871.00	2.22
23	688050	爱博医疗	11,363,235.17	2.18
24	002304	洋河股份	11,200,071.00	2.15
25	600594	益佰制药	11,044,366.00	2.12
26	688578	艾力斯	10,707,578.00	2.06
27	002091	江苏国泰	10,559,332.12	2.03
28	600132	重庆啤酒	10,443,077.00	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,932,513,787.45
卖出股票收入（成交）总额	1,963,862,119.70

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	16,814,313.70	3.91
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	16,814,313.70	3.91

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	019658	21国债10	165,000	16,814,313.70	3.91

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	144,736.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	144,736.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
8,379	59,444.41	26,746,798.43	5.37%	471,337,928.84	94.63%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	683,739.45	0.14%

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年05月07日)基金份额总额	590,493,121.54
本报告期期初基金份额总额	535,504,287.82
本报告期基金总申购份额	30,064,062.90
减：本报告期基金总赎回份额	67,483,623.45
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	498,084,727.27

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及基金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	
东方证券	2	1,640,904,127.57	42.27%	1,005,280.80	42.23%	-
浙商证券	2	2,240,736,142.89	57.73%	1,375,463.03	57.77%	-

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
东方证券	1,712,424.90	42.14%	18,002,000.00	45.00%	-	-	-	-
浙商证券	2,351,309.40	57.86%	22,002,000.00	55.00%	-	-	-	-

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设立北京分公司的公告	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	2022-01-20
2	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	2022-01-24
3	博道消费智航股票型证券投资基金2021年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-01-24
4	博道基金管理有限公司关于公司自有资金申购旗下基金的公告	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	2022-01-25
5	博道基金管理有限公司关于博道消费智航股票型证券投资基金修订基金合同、托管协议并更新招募说明书、产品资料概要的提示性公告	上海证券报	2022-03-04
6	博道基金管理有限公司关于博道消费智航股票型证券投资	上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-04

	资基金参与存托凭证投资事宜修订相关法律文件的公告		
7	博道消费智航股票型证券投资基金基金合同	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-04
8	博道消费智航股票型证券投资基金托管协议	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-04
9	博道消费智航股票型证券投资基金（更新）招募说明书（2022年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-04
10	博道消费智航股票型证券投资基金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	2022-03-04
11	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	2022-03-31
12	博道消费智航股票型证券投资基金2021年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-03-31
13	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富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	2022-04-15
14	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人关联方承销证券的公告	上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-15
15	博道基金管理有限公司关于网上直销汇款交易相关业务调整的公告	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	2022-04-16
16	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	2022-04-22
17	博道消费智航股票型证券投资基金2022年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22

18	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商银行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	2022-05-18
19	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	2022-06-22

§ 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%的情况无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 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消费智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道消费智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道消费智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道消费智航股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道消费智航股票型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道消费智航股票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
二〇二二年八月三十一日