

博道中证 800 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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:华泰证券股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月27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2025年03月18日起至2025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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

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..... 68

§9 开放式基金份额变动..... 69

§10 重大事件揭示..... 69

10.1 基金份额持有人大会决议..... 69

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..... 69

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... 69

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..... 70

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..... 70

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... 70

10.8 其他重大事件..... 71

§11 备查文件目录..... 72

11.1 备查文件目录..... 72

11.2 存放地点..... 72

11.3 查阅方式..... 72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道中证800指数增强型证券投资基金	
基金简称	博道中证800指数增强	
基金主代码	023499	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年03月18日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	162,991,512.02份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道中证800指数增强A	博道中证800指数增强C
下属分级基金的交易代码	023499	023500
报告期末下属分级基金的份额总额	33,127,632.08份	129,863,879.94份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，以中证800指数为标的指数，通过量化选股模型构建股票组合，在控制跟踪误差的基础上力求获得超越标的指数的业绩表现。首先，综合考虑股票的市值、盈利情况、风险情况等因素，筛选出满足一定基本面要求的股票，构建备选股票池。然后，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，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合。最后，利用投资组合优化工具，在控制跟踪偏离过大风险的同时，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资

	产的80%。股票组合构建完成后，本基金管理人将对组合运作绩效持续跟踪，根据市场的变化及时调整投资组合。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、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证800指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	刘强
	联系电话	021-80226288	025-83387812
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	liuqiang@htsc.com
客户服务电话		400-085-2888	95597
传真		021-80226289	025-83387215
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	南京市江东中路228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	南京市江东中路228号
邮政编码		200122	210009
法定代表人		莫泰山	张伟

2.4 信息披露方式

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

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年03月18日（基金合同生效日）-2025年06月30日)	
	博道中证800指数增强A	博道中证800指数增强C
本期已实现收益	1,829,700.74	8,075,806.57
本期利润	2,624,873.13	11,933,265.74
加权平均基金份额本期利润	0.0424	0.0389
本期加权平均净值利润率	4.23%	3.89%
本期基金份额净值增长率	5.25%	5.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	博道中证800指数增强A	博道中证800指数增强C
期末可供分配利润	1,219,959.00	4,623,787.03
期末可供分配基金份额利润	0.0368	0.0356
期末基金资产净值	34,867,045.20	136,522,216.32
期末基金份额净值	1.0525	1.0513
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	博道中证800指数增强A	博道中证800指数增强C
基金份额累计净值增长率	5.25%	5.13%

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2025年3月18日，基金合同生效日至本报告期期末，本基金运作时间未满半年。

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

博道中证800指数增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.33%	0.68%	2.82%	0.59%	1.51%	0.09%
过去三个月	6.64%	1.05%	1.15%	1.12%	5.49%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	5.25%	0.98%	-1.83%	1.07%	7.08%	-0.09%

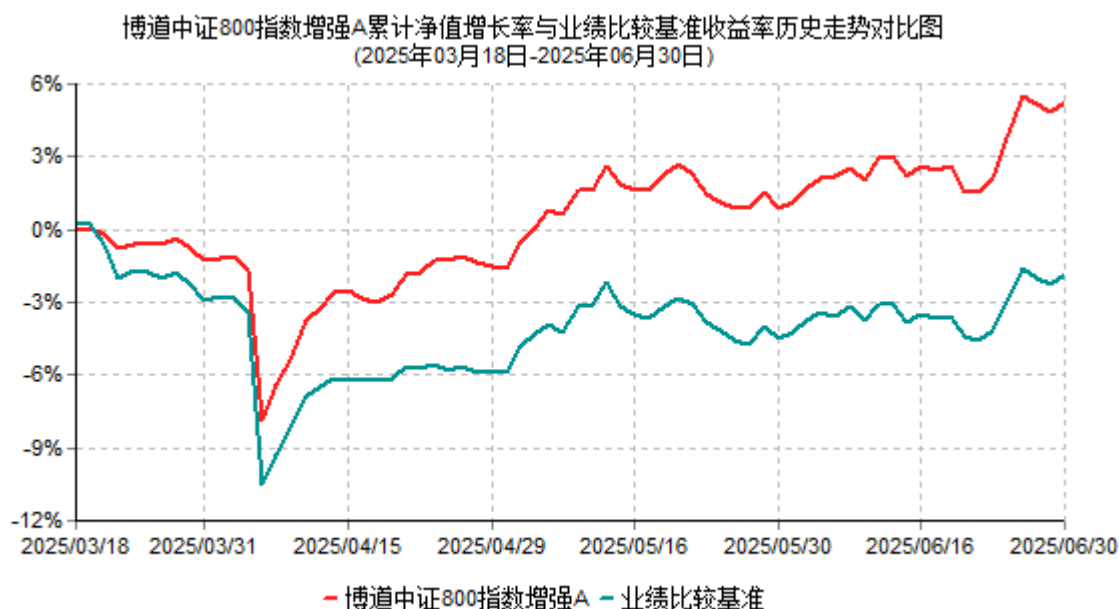
注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道中证800指数增强C

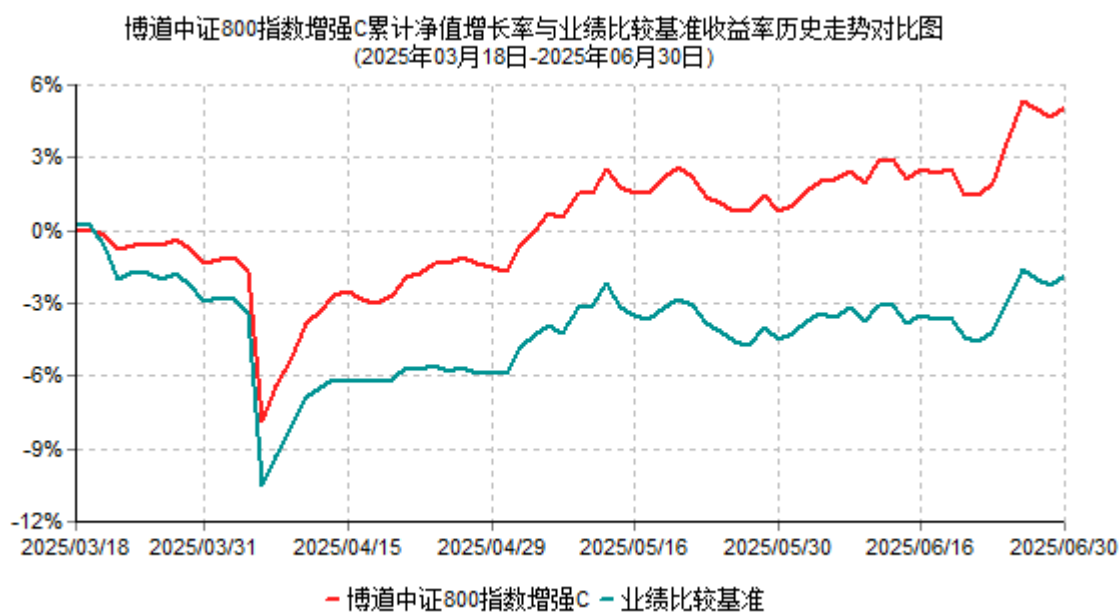
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.30%	0.68%	2.82%	0.59%	1.48%	0.09%
过去三个月	6.54%	1.05%	1.15%	1.12%	5.39%	-0.07%
自基金合同 生效起至今	5.13%	0.98%	-1.83%	1.07%	6.96%	-0.09%

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2025年3月18日，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，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。



注：本基金基金合同生效日为2025年3月18日，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，本基金尚处于建仓期，且运作时间未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本金为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了37只公募基金：博道启航混合型证券投资基金、博道卓远混合型证券投资基金、博道中证500指数增强型证券投资基金、博道沪深300指数增强型证券投资基金、博道远航混合型证券投资基金、博道叁佰智航股票型证券投资基金、博道志远混合型证券投资基金、博道伍佰智航股票型证券投资基金、博道嘉泰回报混合型证券投资基金、博道久航混合型证券投资基金、博道嘉瑞混合型证券投资基金、博道安远6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉元混合型证券投资基金、博道嘉兴一年持有期混合型证券投资基金、博道睿见一年持有期混合型证券投资基金、博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金、博道嘉丰混合型证券投资基金、博道消费智航股票型证券投资基金、博道盛彦混合型证券投资基金、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金、博道和祥多元稳健债券型证券投资基金、博道中证1000指数增强型证券投资基金、博道中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、博道红利智航股票型证券投资基金、博道明远混合型证券投资基金、博道和裕多元稳健30天持有期债券型证券投资基金、博道大盘成长股票型证券投资基金、博道大盘价值股票型证券投资基金、博道沪深300指数量化增强型证券投资基金、博道中证A500指数增强型证券投资基金、博道中证800指数增强型证券投资基金、博道和盈利率债债券型证券投资基金和博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金。

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、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道大盘	2025-03-18	-	14年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017

	成长股票、博道大盘价值股票、博道沪深300指数量化增强、博道中证A500指数增强、博道中证800指数增强、博道上证科创板综合指数增强的基金经理、量化投资总监兼量化投资部总经理				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。具有基金从业资格。
--	---	--	--	--	--

注：

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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1次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 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

2025年上半年，中国经济韧性有所体现，资本市场较为活跃。上半年国内经济基本面数据在国际形势动荡的背景下表现基本平稳，市场风险偏好明显改善，资本市场韧性较强，无风险利率保持低位。具体来看，上证指数上涨2.76%、沪深300上涨0.03%、中证500上涨3.31%、中证1000上涨6.69%，从中信行业表现来看，综合金融、有色金属、银行涨幅居前，分别上涨33.09%、18.22%、15.90%，煤炭、房地产、食品饮料跌幅较大，分别下跌10.77%、5.97%、5.87%。

从因子层面来看，一季度科技风格崛起，价值类因子表现承压，基本面类因子先抑后扬，表现居中，AI量价因子整体表现占优；二季度市场个股活跃度高，有利于量化模型创造超额收益，各类因子整体表现良好。对此，我们从风控模型的底层原理出发，利用AI模型重构风险因子体系，进行降维和提纯，再进行更精细的对风险暴露的控制，在同样的多因子模型和风险敞口参数下，组合的风险收益比和抗回撤能力得到了一定的提升。

报告期间，本基金维持配置中证800多因子选股增强模型。

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

展望后市，在美国经济政策变化的背景下海外流动性中期偏宽松，国内结构性增长的亮点逐步显现，同时股市仍然兼具一定的赔率和胜率，市场风险偏好不弱，量化增强类产品的配置价值仍值得关注。

本基金将继续坚持系统化投资的运作思路，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其适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金2025年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道中证800指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	28,489,677.84
结算备付金		23,601.80
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	159,989,082.14
其中：股票投资		159,989,082.14
基金投资		-
债券投资		-
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	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		218,730.76
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		188,721,092.54
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30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		16,955,930.99
应付管理人报酬		213,647.15
应付托管费		26,705.90
应付销售服务费		88,314.83
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	47,232.15
负债合计		17,331,831.02
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	162,991,512.02
未分配利润	6.4.7.8	8,397,749.50
净资产合计		171,389,261.52
负债和净资产总计		188,721,092.54

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：博道中证800指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年03月18日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
一、营业总收入		15,894,856.90
1.利息收入		75,527.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	69,058.00
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		6,469.28
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,166,683.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	7,448,762.10
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,145.59
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	3,715,776.02
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	4,652,631.56
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	14.35
减：二、营业总支出		1,336,718.03
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	836,586.97
2.托管费	6.4.10.2.2	104,573.34
3.销售服务费		347,925.57
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.17	47,632.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,558,138.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,558,138.87
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		14,558,138.87

6.3 净资产变动表

会计主体：博道中证800指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	387,243,272.99	-	387,243,272.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-224,251,760.97	8,397,749.50	-215,854,011.47
（一）、综合收益总额	-	14,558,138.87	14,558,138.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-224,251,760.97	-6,160,389.37	-230,412,150.34
其中：1.基金申购款	4,427,925.75	188,459.42	4,616,385.17
2.基金赎回款	-228,679,686.72	-6,348,848.79	-235,028,535.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	162,991,512.02	8,397,749.50	171,389,261.52

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

博道中证800指数增强型证券投资基金（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[2025]54号《关于准予博道中证800指数增强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《博道中证800指数增强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387,171,361.38元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2025]200Z0034号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道中证800指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年3月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为387,243,272.99份基金份额，其中认购资金利息折合71,911.61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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

根据《博道中证800指数增强型证券投资基金基金合同》和《博道中证800指数增强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。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道中证800指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、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、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）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及转融通证券出借业务。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90%，投资于标的指数成份股及备选成份股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证800指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注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2025年3月18日（基金合同生效日）至2025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2025年6月30日的财务状况以及2025年3月18日（基金合同生效日）至2025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。本财务报表的实际编制期间为2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日。

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

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、金融负债或权益工具。

(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业务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业务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。

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

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。

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。

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

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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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。

6.4.4.10 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

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2025年06月30日	
活期存款	1,386,104.59	
等于：本金	1,385,564.85	
加：应计利息	539.74	
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	27,103,573.25	
等于：本金	27,103,181.86	
加：应计利息	391.39	
减：坏账准备	-	
合计	28,489,677.84	

注：其他存款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			
		2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		155,336,450.58	-	159,989,082.14	4,652,631.56
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	155,336,450.58	-	159,989,082.14	4,652,631.56

注：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(如有)的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	10,900.05
预提费用-信息披露费	36,332.10
合计	47,232.15

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道中证800指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (博道中证800指数增强A)	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	64,453,642.28	64,453,642.28
本期申购	1,458,240.78	1,458,240.78
本期赎回（以“-”号填列）	-32,784,250.98	-32,784,250.98
本期末	33,127,632.08	33,127,632.08

6.4.7.7.2 博道中证800指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (博道中证800指数增强C)	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	322,789,630.71	322,789,630.71
本期申购	2,969,684.97	2,969,684.97
本期赎回（以“-”号填列）	-195,895,435.74	-195,895,435.74
本期末	129,863,879.94	129,863,879.94

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2025年3月4日至2025年3月14日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币387,171,361.38元，折合为387,171,361.38份基金份额（其中A类基金份额64,438,874.04份，C类基金份额322,732,487.34份）。根据《博道中证800指数增强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71,911.61元，折合为71,911.61份基金份额（其中A类基金份额14,768.24份，C类基金份额57,143.37份），划入基金份额持有人账户；
- 4、根据《博道中证800指数增强型证券投资基金基金合同》、《博道中证800指数增强

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中证800指数增强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2025年3月18日(基金合同生效日)至2025年6月17日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自2025年6月18日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 博道中证800指数增强A

单位：人民币元

项目 (博道中证800指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,829,700.74	795,172.39	2,624,873.13
本期基金份额交易产生的变动数	-609,741.74	-275,718.27	-885,460.01
其中：基金申购款	40,418.45	27,446.98	67,865.43
基金赎回款	-650,160.19	-303,165.25	-953,325.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,219,959.00	519,454.12	1,739,413.12

6.4.7.8.2 博道中证800指数增强C

单位：人民币元

项目 (博道中证800指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	8,075,806.57	3,857,459.17	11,933,265.74
本期基金份额交易产生的变动数	-3,452,019.54	-1,822,909.82	-5,274,929.36

其中：基金申购款	67,989.45	52,604.54	120,593.99
基金赎回款	-3,520,008.99	-1,875,514.36	-5,395,523.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,623,787.03	2,034,549.35	6,658,336.38

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
活期存款利息收入	32,968.53
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,497.65
结算备付金利息收入	23,591.80
其他	0.02
合计	69,058.00

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出股票成交总额	936,324,199.20
减：卖出股票成本总额	927,882,213.46
减：交易费用	993,223.64
买卖股票差价收入	7,448,762.10

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 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年
----	----------------------------------

	06月30日
债券投资收益——利息收入	1.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,143.72
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	2,145.59

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 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,846.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,699.94
减：应计利息总额	1.93
减：交易费用	0.67
买卖债券差价收入	2,143.72

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
----	--

股票投资产生的股利收益	3,715,776.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,715,776.02

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	4,652,631.56
——股票投资	4,652,631.56
——债券投资	-
——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	4,652,631.56

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金赎回费收入	14.35
合计	14.35

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。
具体以本基金最新的招募说明书为准。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
审计费用	10,900.05
信息披露费	36,332.10
开户费	400.00
合计	47,632.15

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

经博道基金管理有限公司(以下简称“博道基金”)股东会决议批准，史伟将持有的占比3%公司股权转让于杨梦。博道基金于2025年5月13日完成了工商变更登记手续。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
华泰证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
华泰证券股份有限 公司	2,019,078,811.54	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
华泰证券股份有限 公司	16,846.26	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
华泰证券股份有限 公司	136,011,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名	本期
------	----

称	2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券股份有限公司	395,606.23	100.00%	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	836,586.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	410,842.67
应支付基金管理人的净管理费	425,744.30

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	104,573.34

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期		
	2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道中证800指数增强A	博道中证800指数增强C	合计
华泰证券 股份有限 公司	0.00	344,277.50	344,277.50
合计	0.00	344,277.50	344,277.50

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0.40%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×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

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	
	2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券 股份有限	27,103,573.25	12,497.65

公司		
----	--	--

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025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
688775	影石创新	2025-06-04	6个月以上	科创板打新限售	47.27	124.16	331	15,646.37	41,096.96	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6个月以上	创业板打新限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
001388	信通电子	2025-06-24	1个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6个月以上	创业板打新限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-

				售						
688755	汉邦科技	2025-05-09	6个月以上	科创板打新限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
603014	威高血净	2025-05-12	6个月以上	主板打新限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301595	太力科技	2025-05-12	6个月以上	创业板打新限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6个月以上	主板打新限售	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月以上	主板打新限售	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月以上	主板打新限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月以上	主板打新限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分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

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
----	----	----	----	----	----	----	-------	--------	--------	----

代 码	名 称	日 期	原 因	估 值 单 价	日 期	开 盘 单 价				
688 313	仕 佳 光 子	202 5-0 6-3 0	重 大 事 项	38.0 5	202 5-07 -11	39.9 8	11,016	334,618.08	419,158.80	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人华泰证券开立于交通银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于华泰证券，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2025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。

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2025年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金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2025年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.31%。

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2025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171,232,923.71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 2025年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

货币资金	28,489,677.84	-	-	-	-	-	28,489,677.84
结算备付金	23,601.80	-	-	-	-	-	23,601.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	159,989,082.14	159,989,082.14
应收申购款	-	-	-	-	-	218,730.76	218,730.76
资产总计	28,513,279.64	-	-	-	-	160,207,812.90	188,721,092.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,955,930.99	16,955,930.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	213,647.15	213,647.15
应付托管费	-	-	-	-	-	26,705.90	26,705.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	88,314.83	88,314.83
其他负债	-	-	-	-	-	47,232.15	47,232.15
负债总计	-	-	-	-	-	17,331,831.02	17,331,831.02
利率敏感度缺口	28,513,279.64	-	-	-	-	142,875,981.88	171,389,261.52

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2025年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。

本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产总值的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股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，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30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	159,989,082.14	93.35
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	159,989,082.14	93.35

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证800指数收益率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025年06月30日
	1.中证800指数收益率上升5%	8,426,522.31
	2.中证800指数收益率下降5%	-8,426,522.31

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日
第一层次	159,457,784.05
第二层次	434,544.34
第三层次	96,753.75
合计	159,989,082.14

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估

值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	159,989,082.14	84.78
	其中：股票	159,989,082.14	84.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	28,513,279.64	15.11
8	其他各项资产	218,730.76	0.12
9	合计	188,721,092.54	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（指数投资）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	1,713,266.00	1.00
B	采矿业	6,649,591.51	3.88
C	制造业	64,958,019.99	37.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,729,008.00	3.93
E	建筑业	1,810,730.00	1.06
F	批发和零售业	3,221,366.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	4,312,717.00	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,156,701.00	3.59
J	金融业	39,616,408.00	23.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	284,138.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	1,007,852.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	620,455.68	0.36
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	137,080,253.18	79.98

7.2.2 报告期末（积极投资）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	609,958.00	0.36
C	制造业	19,027,093.82	11.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,019.00	0.03
E	建筑业	71,275.00	0.04
F	批发和零售业	403,204.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	435,689.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	964,886.14	0.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	376,212.00	0.22
L	租赁和商务服务业	21,546.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	168,748.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	423,468.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	362,730.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	22,908,828.96	13.37

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,500	6,342,840.00	3.70
2	300750	宁德时代	20,400	5,145,288.00	3.00
3	600900	长江电力	96,600	2,911,524.00	1.70
4	600030	中信证券	102,300	2,825,526.00	1.65
5	601288	农业银行	468,200	2,753,016.00	1.61
6	601398	工商银行	357,100	2,710,389.00	1.58
7	601318	中国平安	48,000	2,663,040.00	1.55
8	002594	比亚迪	7,800	2,588,898.00	1.51
9	000651	格力电器	55,500	2,493,060.00	1.45
10	000858	五粮液	20,500	2,437,450.00	1.42
11	600036	招商银行	47,400	2,178,030.00	1.27
12	601857	中国石油	254,600	2,176,830.00	1.27
13	300274	阳光电源	31,900	2,161,863.00	1.26
14	002352	顺丰控股	41,600	2,028,416.00	1.18
15	601658	邮储银行	358,000	1,958,260.00	1.14
16	601211	国泰海通	92,600	1,774,216.00	1.04
17	601009	南京银行	151,300	1,758,106.00	1.03
18	601336	新华保险	29,700	1,737,450.00	1.01
19	300476	胜宏科技	12,800	1,720,064.00	1.00
20	600704	物产中大	325,200	1,713,804.00	1.00
21	688475	萤石网络	53,064	1,672,577.28	0.98
22	300014	亿纬锂能	36,500	1,672,065.00	0.98
23	002714	牧原股份	39,400	1,655,194.00	0.97
24	601988	中国银行	281,700	1,583,154.00	0.92
25	601668	中国建筑	274,000	1,580,980.00	0.92
26	003816	中国广核	419,400	1,526,616.00	0.89

27	600998	九州通	293,300	1,507,562.00	0.88
28	601088	中国神华	36,000	1,459,440.00	0.85
29	601138	工业富联	66,600	1,423,908.00	0.83
30	688772	珠海冠宇	98,200	1,403,278.00	0.82
31	300207	欣旺达	69,900	1,402,194.00	0.82
32	300760	迈瑞医疗	6,200	1,393,450.00	0.81
33	688036	传音控股	17,242	1,374,187.40	0.80
34	002179	中航光电	33,100	1,335,916.00	0.78
35	600887	伊利股份	47,100	1,313,148.00	0.77
36	300604	长川科技	29,040	1,304,186.40	0.76
37	688111	金山办公	4,440	1,243,422.00	0.73
38	300803	指南针	15,400	1,242,164.00	0.72
39	300679	电连技术	27,000	1,225,260.00	0.71
40	601555	东吴证券	138,100	1,208,375.00	0.71
41	002050	三花智控	44,300	1,168,634.00	0.68
42	601939	建设银行	122,700	1,158,288.00	0.68
43	600941	中国移动	10,200	1,148,010.00	0.67
44	601328	交通银行	143,300	1,146,400.00	0.67
45	000063	中兴通讯	35,100	1,140,399.00	0.67
46	600011	华能国际	155,600	1,110,984.00	0.65
47	600690	海尔智家	44,500	1,102,710.00	0.64
48	002920	德赛西威	10,500	1,072,365.00	0.63
49	000750	国海证券	259,600	1,069,552.00	0.62
50	600018	上港集团	187,000	1,067,770.00	0.62
51	002138	顺络电子	34,700	975,764.00	0.57
52	300017	网宿科技	90,500	970,160.00	0.57
53	300033	同花顺	3,400	928,234.00	0.54
54	300496	中科创达	15,900	909,798.00	0.53
55	300558	贝达药业	15,500	898,225.00	0.52
56	600025	华能水电	93,200	890,060.00	0.52
57	601628	中国人寿	21,600	889,704.00	0.52

58	603799	华友钴业	22,600	836,652.00	0.49
59	600582	天地科技	136,000	814,640.00	0.48
60	601818	光大银行	185,400	769,410.00	0.45
61	000783	长江证券	107,500	744,975.00	0.43
62	300759	康龙化成	30,300	743,562.00	0.43
63	000708	中信特钢	61,900	727,944.00	0.42
64	000333	美的集团	10,000	722,000.00	0.42
65	601958	金钼股份	65,200	713,288.00	0.42
66	600219	南山铝业	185,500	710,465.00	0.41
67	600015	华夏银行	86,620	685,164.20	0.40
68	601166	兴业银行	28,600	667,524.00	0.39
69	601456	国联民生	62,300	644,805.00	0.38
70	000513	丽珠集团	17,700	637,908.00	0.37
71	601689	拓普集团	13,500	637,875.00	0.37
72	600016	民生银行	132,400	628,900.00	0.37
73	300015	爱尔眼科	49,716	620,455.68	0.36
74	600999	招商证券	34,800	612,132.00	0.36
75	601899	紫金矿业	30,700	598,650.00	0.35
76	601319	中国人保	68,500	596,635.00	0.35
77	600377	宁沪高速	38,000	582,920.00	0.34
78	000959	首钢股份	169,700	576,980.00	0.34
79	300373	扬杰科技	10,700	555,330.00	0.32
80	002142	宁波银行	20,100	549,936.00	0.32
81	600276	恒瑞医药	10,200	529,380.00	0.31
82	600050	中国联通	98,600	526,524.00	0.31
83	601808	中海油服	36,500	502,240.00	0.29
84	688256	寒武纪	800	481,200.00	0.28
85	601169	北京银行	63,700	435,071.00	0.25
86	600938	中国海油	16,500	430,815.00	0.25
87	002415	海康威视	15,400	427,042.00	0.25
88	600535	天士力	26,600	416,290.00	0.24

89	000709	河钢股份	184,600	398,736.00	0.23
90	601633	长城汽车	18,200	390,936.00	0.23
91	000738	航发控制	18,700	388,025.00	0.23
92	600352	浙江龙盛	37,800	384,048.00	0.22
93	601881	中国银河	22,200	380,730.00	0.22
94	600295	鄂尔多斯	43,700	380,627.00	0.22
95	603596	伯特利	7,200	379,368.00	0.22
96	600196	复星医药	14,500	363,805.00	0.21
97	002001	新 和 成	16,900	359,463.00	0.21
98	000893	亚钾国际	11,800	355,652.00	0.21
99	600958	东方证券	36,700	355,256.00	0.21
100	601919	中远海控	23,400	351,936.00	0.21
101	000568	泸州老窖	3,000	340,200.00	0.20
102	688728	格科微	22,000	338,800.00	0.20
103	600927	永安期货	22,700	336,187.00	0.20
104	600959	江苏有线	95,700	329,208.00	0.19
105	000157	中联重科	43,400	313,782.00	0.18
106	601995	中金公司	8,600	304,096.00	0.18
107	300059	东方财富	13,100	303,003.00	0.18
108	300037	新宙邦	8,600	302,720.00	0.18
109	000039	中集集团	38,000	298,680.00	0.17
110	000776	广发证券	17,700	297,537.00	0.17
111	688578	艾力斯	3,124	290,656.96	0.17
112	600153	建发股份	27,400	284,138.00	0.17
113	000661	长春高新	2,800	277,704.00	0.16
114	000538	云南白药	4,900	273,371.00	0.16
115	002600	领益智造	31,000	266,290.00	0.16
116	600926	杭州银行	15,800	265,756.00	0.16
117	603259	药明康德	3,800	264,290.00	0.15
118	600928	西安银行	67,400	264,208.00	0.15
119	600521	华海药业	13,800	257,094.00	0.15

120	688778	厦钨新能	4,400	246,048.00	0.14
121	002532	天山铝业	29,500	245,145.00	0.14
122	600380	健康元	22,000	242,660.00	0.14
123	600566	济川药业	9,000	236,970.00	0.14
124	000977	浪潮信息	4,600	234,048.00	0.14
125	000426	兴业银锡	14,800	233,840.00	0.14
126	601611	中国核建	25,000	229,750.00	0.13
127	600426	华鲁恒升	10,600	229,702.00	0.13
128	002304	洋河股份	3,500	225,925.00	0.13
129	000792	盐湖股份	12,900	220,332.00	0.13
130	600499	科达制造	21,900	214,620.00	0.13
131	002430	杭氧股份	10,400	201,968.00	0.12
132	600188	兖矿能源	16,203	197,190.51	0.12
133	002958	青农商行	52,000	187,720.00	0.11
134	000625	长安汽车	14,200	181,192.00	0.11
135	601128	常熟银行	24,240	178,648.80	0.10
136	002025	航天电器	3,400	174,794.00	0.10
137	688041	海光信息	1,200	169,548.00	0.10
138	600031	三一重工	9,300	166,935.00	0.10
139	300308	中际旭创	1,100	160,446.00	0.09
140	601006	大秦铁路	24,000	158,400.00	0.09
141	601728	中国电信	19,800	153,450.00	0.09
142	603296	华勤技术	1,900	153,292.00	0.09
143	000768	中航西飞	5,500	150,370.00	0.09
144	002821	凯莱英	1,700	150,025.00	0.09
145	601991	大唐发电	46,600	147,722.00	0.09
146	688012	中微公司	810	147,663.00	0.09
147	688122	西部超导	2,825	146,561.00	0.09
148	600460	士兰微	5,800	143,956.00	0.08
149	600809	山西汾酒	800	141,112.00	0.08
150	688981	中芯国际	1,600	141,072.00	0.08

151	600585	海螺水泥	6,500	139,555.00	0.08
152	688099	晶晨股份	1,800	127,818.00	0.07
153	601601	中国太保	3,400	127,534.00	0.07
154	600968	海油发展	30,800	125,664.00	0.07
155	300724	捷佳伟创	2,300	124,890.00	0.07
156	002558	巨人网络	5,300	124,815.00	0.07
157	000166	申万宏源	23,800	119,476.00	0.07
158	002463	沪电股份	2,800	119,224.00	0.07
159	688385	复旦微电	2,405	118,494.35	0.07
160	600600	青岛啤酒	1,600	111,136.00	0.06
161	603379	三美股份	2,300	110,676.00	0.06
162	000009	中国宝安	12,300	109,224.00	0.06
163	601162	天风证券	21,700	106,981.00	0.06
164	600956	新天绿能	12,600	97,272.00	0.06
165	600062	华润双鹤	5,100	95,166.00	0.06
166	601598	中国外运	19,000	93,670.00	0.05
167	601766	中国中车	12,500	88,000.00	0.05
168	600166	福田汽车	31,500	85,365.00	0.05
169	600583	海油工程	15,300	83,538.00	0.05
170	002202	金风科技	7,700	78,925.00	0.05
171	300413	芒果超媒	3,500	76,370.00	0.04
172	601236	红塔证券	9,000	76,230.00	0.04
173	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.04
174	688676	金盘科技	2,006	67,100.70	0.04
175	300454	深信服	700	65,926.00	0.04
176	600760	中航沈飞	1,100	64,482.00	0.04
177	000937	冀中能源	11,200	64,400.00	0.04
178	600362	江西铜业	2,700	63,261.00	0.04
179	300498	温氏股份	3,400	58,072.00	0.03
180	601377	兴业证券	8,500	52,615.00	0.03
181	002736	国信证券	4,400	50,688.00	0.03

182	000895	双汇发展	1,900	46,379.00	0.03
183	601997	贵阳银行	6,800	42,432.00	0.02
184	000728	国元证券	5,300	41,817.00	0.02
185	600482	中国动力	1,800	41,526.00	0.02
186	600028	中国石化	7,200	40,608.00	0.02
187	601788	光大证券	2,200	39,556.00	0.02
188	002756	永兴材料	1,200	38,100.00	0.02
189	600392	盛和资源	2,800	36,876.00	0.02
190	300408	三环集团	1,100	36,740.00	0.02
191	601229	上海银行	3,300	35,013.00	0.02
192	300763	锦浪科技	610	35,007.90	0.02
193	603195	公牛集团	700	33,775.00	0.02
194	600398	海澜之家	4,500	31,320.00	0.02
195	603565	中谷物流	3,100	29,605.00	0.02
196	603156	养元饮品	1,300	27,508.00	0.02
197	600685	中船防务	1,000	27,190.00	0.02
198	601127	赛力斯	200	26,864.00	0.02
199	603605	珀莱雅	300	24,837.00	0.01
200	300394	天孚通信	300	23,952.00	0.01
201	002926	华西证券	2,600	23,244.00	0.01
202	601225	陕西煤业	1,200	23,088.00	0.01
203	600098	广州发展	3,600	22,500.00	0.01
204	001696	宗申动力	1,000	22,450.00	0.01
205	000027	深圳能源	3,500	22,330.00	0.01
206	300285	国瓷材料	1,200	20,820.00	0.01
207	300136	信维通信	900	20,160.00	0.01
208	002493	荣盛石化	2,400	19,872.00	0.01
209	300140	节能环保	2,700	16,659.00	0.01
210	603087	甘李药业	300	16,434.00	0.01
211	603288	海天味业	400	15,564.00	0.01
212	300573	兴齐眼药	300	15,537.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	300787	海能实业	88,524	1,226,057.40	0.72
2	603289	泰瑞机器	125,900	1,198,568.00	0.70
3	002160	常铝股份	209,400	904,608.00	0.53
4	300389	艾比森	70,290	813,958.20	0.47
5	002593	日上集团	130,600	636,022.00	0.37
6	301282	金禄电子	25,600	634,624.00	0.37
7	600262	北方股份	24,000	547,200.00	0.32
8	603527	众源新材	49,900	542,413.00	0.32
9	300644	南京聚隆	20,200	539,542.00	0.31
10	002676	顺威股份	72,100	521,283.00	0.30
11	002983	芯瑞达	23,387	495,570.53	0.29
12	300940	南极光	17,300	436,825.00	0.25
13	601218	吉鑫科技	105,500	433,605.00	0.25
14	002576	通达动力	26,200	430,990.00	0.25
15	000758	中色股份	84,100	423,023.00	0.25
16	688313	仕佳光子	11,016	419,158.80	0.24
17	001872	招商港口	20,700	411,102.00	0.24
18	300019	硅宝科技	19,200	379,008.00	0.22
19	002847	盐津铺子	4,700	377,880.00	0.22
20	600638	新黄浦	64,200	376,212.00	0.22
21	603103	横店影视	22,600	362,730.00	0.21
22	300990	同飞股份	7,200	359,280.00	0.21
23	301185	鸥玛软件	18,200	356,174.00	0.21
24	002107	沃华医药	61,700	352,924.00	0.21
25	603267	鸿远电子	6,900	346,863.00	0.20

26	002250	联化科技	29,200	321,200.00	0.19
27	000705	浙江震元	37,600	317,720.00	0.19
28	300836	佰奥智能	7,100	315,737.00	0.18
29	603089	正裕工业	23,500	307,145.00	0.18
30	600475	华光环能	28,600	298,012.00	0.17
31	300672	国科微	3,100	263,252.00	0.15
32	002454	松芝股份	33,100	255,532.00	0.15
33	301181	标榜股份	10,000	247,800.00	0.14
34	002715	登云股份	13,000	239,850.00	0.14
35	300690	双一科技	9,500	229,995.00	0.13
36	603586	金麒麟	12,500	229,000.00	0.13
37	300907	康平科技	7,800	213,798.00	0.12
38	000682	东方电子	20,400	208,896.00	0.12
39	301229	纽泰格	10,740	205,885.80	0.12
40	000911	广农糖业	27,900	202,833.00	0.12
41	600742	富维股份	21,300	202,563.00	0.12
42	000788	北大医药	31,200	198,120.00	0.12
43	000751	锌业股份	59,600	187,144.00	0.11
44	600382	广东明珠	34,300	186,935.00	0.11
45	301122	采纳股份	8,300	177,288.00	0.10
46	300111	向日葵	51,900	170,232.00	0.10
47	605020	永和股份	7,300	168,192.00	0.10
48	688579	山大地纬	14,400	161,136.00	0.09
49	300222	科大智能	14,600	148,774.00	0.09
50	300942	易瑞生物	13,200	126,456.00	0.07
51	301257	普蕊斯	4,100	126,280.00	0.07
52	300689	澄天伟业	2,700	120,339.00	0.07
53	603256	宏和科技	8,100	120,042.00	0.07
54	300489	光智科技	2,700	119,232.00	0.07
55	002206	海利得	19,900	101,689.00	0.06
56	002891	中宠股份	1,600	98,992.00	0.06

57	000657	中钨高新	8,100	96,066.00	0.06
58	002248	华东数控	10,800	94,500.00	0.06
59	603798	康普顿	8,400	91,392.00	0.05
60	600981	汇鸿集团	30,100	85,484.00	0.05
61	002701	奥瑞金	13,900	82,705.00	0.05
62	301323	新莱福	1,800	79,848.00	0.05
63	603926	铁流股份	6,600	74,976.00	0.04
64	603163	圣晖集成	2,500	71,275.00	0.04
65	002887	绿茵生态	8,500	71,060.00	0.04
66	300562	乐心医疗	4,800	70,800.00	0.04
67	301330	熵基科技	2,600	70,278.00	0.04
68	301168	通灵股份	2,000	69,820.00	0.04
69	002661	克明食品	6,900	69,069.00	0.04
70	688591	泰凌微	1,400	67,060.00	0.04
71	300206	理邦仪器	5,300	63,706.00	0.04
72	002885	京泉华	4,500	63,675.00	0.04
73	688661	和林微纳	1,540	61,245.80	0.04
74	600866	星湖科技	8,800	60,808.00	0.04
75	300247	融捷健康	15,500	60,450.00	0.04
76	002539	云图控股	6,300	59,094.00	0.03
77	002637	赞宇科技	5,900	58,882.00	0.03
78	605288	凯迪股份	1,100	57,321.00	0.03
79	300578	会畅通讯	2,700	56,619.00	0.03
80	300512	中亚股份	6,500	55,770.00	0.03
81	002057	中钢天源	5,900	54,811.00	0.03
82	688667	菱电电控	1,000	53,210.00	0.03
83	300922	天秦装备	1,900	53,086.00	0.03
84	688106	金宏气体	2,800	50,092.00	0.03
85	300219	鸿利智汇	7,300	49,056.00	0.03
86	300176	鸿特科技	6,500	45,240.00	0.03
87	000421	南京公用	6,700	44,019.00	0.03

88	688682	霍莱沃	1,380	43,194.00	0.03
89	688775	影石创新	331	41,096.96	0.02
90	300548	长芯博创	600	40,062.00	0.02
91	603601	再升科技	9,500	38,570.00	0.02
92	300790	宇瞳光学	1,700	35,547.00	0.02
93	688508	芯朋微	622	34,720.04	0.02
94	300196	长海股份	2,800	34,160.00	0.02
95	301036	双乐股份	900	33,678.00	0.02
96	301538	骏鼎达	620	32,984.00	0.02
97	688018	乐鑫科技	221	32,288.10	0.02
98	301529	福赛科技	1,000	31,330.00	0.02
99	300681	英搏尔	1,100	30,426.00	0.02
100	300187	永清环保	5,800	29,580.00	0.02
101	300467	迅游科技	1,300	27,911.00	0.02
102	300432	富临精工	2,000	26,140.00	0.02
103	603588	高能环境	4,400	24,816.00	0.01
104	688590	新致软件	1,200	24,648.00	0.01
105	000828	东莞控股	2,300	24,587.00	0.01
106	301362	民爆光电	600	24,486.00	0.01
107	688618	三旺通信	1,000	24,400.00	0.01
108	300547	川环科技	800	24,176.00	0.01
109	002996	顺博合金	3,200	23,552.00	0.01
110	000957	中通客车	2,100	22,953.00	0.01
111	688222	成都先导	1,400	22,512.00	0.01
112	300998	宁波方正	900	22,482.00	0.01
113	300590	移为通信	1,700	22,117.00	0.01
114	603682	锦和商管	3,800	21,546.00	0.01
115	300230	永利股份	4,300	21,027.00	0.01
116	301042	安联锐视	500	20,570.00	0.01
117	300314	戴维医疗	1,600	20,320.00	0.01
118	688621	阳光诺和	400	19,956.00	0.01

119	603966	法兰泰克	2,100	19,488.00	0.01
120	300543	朗科智能	1,800	19,350.00	0.01
121	688088	虹软科技	400	19,300.00	0.01
122	300539	横河精密	1,400	19,166.00	0.01
123	600496	精工钢构	5,600	17,920.00	0.01
124	300691	联合光电	900	17,235.00	0.01
125	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
126	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
127	300414	中光防雷	800	12,384.00	0.01
128	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.01
129	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
130	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
131	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
132	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
133	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
134	603382	海阳科技	105	2,350.95	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	600519	贵州茅台	18,783,756.00	10.96
2	300750	宁德时代	14,960,914.00	8.73
3	002594	比亚迪	13,106,980.00	7.65
4	601318	中国平安	10,792,597.00	6.30
5	600900	长江电力	9,505,382.00	5.55
6	000858	五粮液	8,944,645.00	5.22
7	300803	指南针	8,765,821.41	5.11
8	000333	美的集团	8,623,686.00	5.03

9	601398	工商银行	8,584,969.00	5.01
10	300476	胜宏科技	8,512,072.00	4.97
11	002714	牧原股份	8,379,613.00	4.89
12	600690	海尔智家	7,720,133.00	4.50
13	600276	恒瑞医药	7,361,299.00	4.30
14	601211	国泰海通	7,358,343.00	4.29
15	600030	中信证券	7,356,283.00	4.29
16	000651	格力电器	7,345,274.00	4.29
17	300308	中际旭创	7,237,317.00	4.22
18	600887	伊利股份	7,221,024.00	4.21
19	601668	中国建筑	7,131,790.00	4.16
20	601288	农业银行	6,994,120.00	4.08
21	601138	工业富联	6,831,229.00	3.99
22	601127	赛力斯	6,734,322.00	3.93
23	002415	海康威视	6,690,808.00	3.90
24	300014	亿纬锂能	6,416,436.00	3.74
25	300760	迈瑞医疗	6,394,901.00	3.73
26	300033	同花顺	6,331,098.00	3.69
27	688772	珠海冠宇	6,295,896.47	3.67
28	300558	贝达药业	6,104,837.00	3.56
29	000725	京东方 A	6,103,575.00	3.56
30	300274	阳光电源	6,087,822.00	3.55
31	300502	新易盛	6,046,959.00	3.53
32	601658	邮储银行	6,036,986.00	3.52
33	300207	欣旺达	5,983,691.00	3.49
34	600036	招商银行	5,975,882.00	3.49
35	601988	中国银行	5,870,926.00	3.43
36	600938	中国海油	5,835,709.00	3.40
37	688111	金山办公	5,711,467.08	3.33
38	300059	东方财富	5,693,935.00	3.32
39	600941	中国移动	5,592,714.00	3.26

40	601857	中国石油	5,574,029.00	3.25
41	300442	润泽科技	5,393,244.00	3.15
42	002352	顺丰控股	5,363,009.00	3.13
43	002179	中航光电	5,344,317.00	3.12
44	601818	光大银行	5,220,247.00	3.05
45	601336	新华保险	5,211,452.00	3.04
46	002107	沃华医药	5,199,686.00	3.03
47	600348	华阳股份	5,110,854.00	2.98
48	000783	长江证券	4,966,444.00	2.90
49	300787	海能实业	4,944,760.40	2.89
50	601939	建设银行	4,918,146.00	2.87
51	688313	仕佳光子	4,756,003.61	2.77
52	603288	海天味业	4,711,504.00	2.75
53	002920	德赛西威	4,704,058.00	2.74
54	600499	科达制造	4,597,562.00	2.68
55	601766	中国中车	4,580,994.00	2.67
56	600704	物产中大	4,577,852.00	2.67
57	600582	天地科技	4,531,166.00	2.64
58	600011	华能国际	4,471,133.00	2.61
59	600998	九州通	4,390,167.00	2.56
60	600096	云天化	4,297,137.00	2.51
61	688475	萤石网络	4,278,983.48	2.50
62	601328	交通银行	4,228,319.00	2.47
63	600170	上海建工	4,214,952.00	2.46
64	300573	兴齐眼药	4,203,861.00	2.45
65	688036	传音控股	4,201,643.27	2.45
66	601633	长城汽车	4,112,492.00	2.40
67	601919	中远海控	4,111,287.00	2.40
68	600547	山东黄金	4,110,056.72	2.40
69	000166	申万宏源	4,012,472.00	2.34
70	002983	芯瑞达	4,005,972.12	2.34

71	002001	新 和 成	3,992,456.00	2.33
72	601009	南京银行	3,983,526.00	2.32
73	600188	兖矿能源	3,973,142.59	2.32
74	603289	泰瑞机器	3,939,697.00	2.30
75	002268	电科网安	3,937,151.00	2.30
76	000538	云南白药	3,928,629.00	2.29
77	000423	东阿阿胶	3,855,490.00	2.25
78	600585	海螺水泥	3,849,313.00	2.25
79	002926	华西证券	3,825,097.00	2.23
80	600262	北方股份	3,803,677.00	2.22
81	300570	太辰光	3,793,083.00	2.21
82	000895	双汇发展	3,771,251.00	2.20
83	003816	中国广核	3,760,918.00	2.19
84	002821	凯莱英	3,718,941.00	2.17
85	601628	中国人寿	3,702,286.00	2.16
86	603087	甘李药业	3,679,660.00	2.15
87	300496	中科创达	3,667,081.00	2.14
88	300604	长川科技	3,652,215.60	2.13
89	002372	伟星新材	3,650,918.00	2.13
90	601218	吉鑫科技	3,547,220.00	2.07
91	601555	东吴证券	3,499,261.00	2.04
92	600958	东方证券	3,471,496.00	2.03
93	301297	富乐德	3,457,307.00	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	600519	贵州茅台	10,714,257.00	6.25
2	002594	比亚迪	10,059,144.00	5.87
3	300750	宁德时代	9,828,612.00	5.73
4	300803	指南针	8,361,488.05	4.88
5	300308	中际旭创	8,292,901.00	4.84
6	601318	中国平安	8,210,492.00	4.79
7	300476	胜宏科技	7,850,931.00	4.58
8	000333	美的集团	7,782,472.00	4.54
9	600276	恒瑞医药	7,633,501.00	4.45
10	600900	长江电力	7,261,625.00	4.24
11	300502	新易盛	6,815,599.40	3.98
12	002714	牧原股份	6,813,316.00	3.98
13	601127	赛力斯	6,732,199.00	3.93
14	601398	工商银行	6,451,983.00	3.76
15	600690	海尔智家	6,210,722.00	3.62
16	600887	伊利股份	5,999,676.16	3.50
17	601138	工业富联	5,942,170.00	3.47
18	601211	国泰海通	5,890,097.00	3.44
19	300059	东方财富	5,835,932.00	3.41
20	000858	五 粮 液	5,673,622.00	3.31
21	002415	海康威视	5,644,895.00	3.29
22	601668	中国建筑	5,603,776.00	3.27
23	000725	京东方 A	5,542,545.00	3.23
24	300442	润泽科技	5,483,210.00	3.20
25	300033	同花顺	5,472,175.00	3.19
26	600938	中国海油	5,367,645.00	3.13
27	600348	华阳股份	5,155,138.00	3.01
28	300558	贝达药业	5,030,098.00	2.93
29	601288	农业银行	5,016,295.00	2.93
30	002107	沃华医药	4,995,270.00	2.91
31	688313	仕佳光子	4,933,310.56	2.88

32	603288	海天味业	4,867,989.00	2.84
33	600030	中信证券	4,855,420.00	2.83
34	300014	亿纬锂能	4,766,167.70	2.78
35	000651	格力电器	4,762,115.00	2.78
36	300760	迈瑞医疗	4,695,192.00	2.74
37	600547	山东黄金	4,680,540.04	2.73
38	300274	阳光电源	4,496,234.00	2.62
39	600941	中国移动	4,474,924.00	2.61
40	600499	科达制造	4,443,839.00	2.59
41	688772	珠海冠宇	4,443,617.19	2.59
42	601818	光大银行	4,412,649.00	2.57
43	601766	中国中车	4,371,230.00	2.55
44	688111	金山办公	4,362,114.91	2.55
45	000783	长江证券	4,338,170.00	2.53
46	601988	中国银行	4,300,575.00	2.51
47	300207	欣旺达	4,242,487.00	2.48
48	601658	邮储银行	4,235,904.00	2.47
49	600096	云天化	4,199,767.00	2.45
50	603087	甘李药业	4,194,358.00	2.45
51	300787	海能实业	4,176,415.60	2.44
52	002821	凯莱英	4,174,430.00	2.44
53	600036	招商银行	4,134,382.00	2.41
54	002352	顺丰控股	4,122,777.00	2.41
55	300573	兴齐眼药	4,082,863.80	2.38
56	600170	上海建工	4,069,231.00	2.37
57	603893	瑞芯微	3,880,029.00	2.26
58	601336	新华保险	3,877,756.00	2.26
59	601939	建设银行	3,876,501.00	2.26
60	601857	中国石油	3,843,089.00	2.24
61	601919	中远海控	3,837,841.00	2.24
62	002179	中航光电	3,798,681.00	2.22

63	301297	富乐德	3,724,770.00	2.17
64	002001	新 和 成	3,717,043.00	2.17
65	002268	电科网安	3,691,841.00	2.15
66	300570	太辰光	3,662,841.00	2.14
67	300763	锦浪科技	3,650,273.00	2.13
68	000166	申万宏源	3,643,653.00	2.13
69	002372	伟星新材	3,624,477.00	2.11
70	002463	沪电股份	3,623,194.00	2.11
71	002983	芯瑞达	3,617,752.79	2.11
72	000538	云南白药	3,611,019.00	2.11
73	002926	华西证券	3,575,279.00	2.09
74	600188	兖矿能源	3,551,981.00	2.07
75	000895	双汇发展	3,542,919.00	2.07
76	600011	华能国际	3,493,732.00	2.04
77	600582	天地科技	3,477,122.00	2.03
78	000423	东阿阿胶	3,471,334.00	2.03
79	002920	德赛西威	3,443,740.00	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	1,083,218,664.04
卖出股票收入（成交）总额	936,324,199.20

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

无。

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

无。

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

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或者在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（1）2024年8月7日，中国证券监督管理委员会贵州监管局公示〔2024〕26号行政监管措施决定书，对中信证券股份有限公司采取出具警示函的行政监管措施。

2024年12月20日，深圳证监局公示〔2024〕254号行政监管措施决定书，对中信证券股份有限公司采取出具警示函的行政监管措施。

2025年1月27日，中国人民银行公示银罚决字〔2024〕67号行政处罚决定书，给予中国农业银行股份有限公司警告，没收违法所得487.594705万元，罚款4672.941544万元的行政处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	218,730.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	218,730.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数	户均持有的 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

	(户)					
博道 中证8 00指 数增 强A	895	37,014.11	49,519.53	0.15%	33,078,112.55	99.85%
博道 中证8 00指 数增 强C	3,4 78	37,338.67	3,333,001.06	2.57%	126,530,878.88	97.43%
合计	4,2 98	37,922.64	3,382,520.59	2.08%	159,608,991.43	97.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	博道中证800指数 增强A	-	-
	博道中证800指数 增强C	1.00	0.00%
	合计	1.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	博道中证800指数 增强A	0
	博道中证800指数 增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	博道中证800指数 增强A	0

	博道中证800指数增强C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道中证800指数增强A	博道中证800指数增强C
基金合同生效日(2025年03月18日)基金份额总额	64,453,642.28	322,789,630.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,458,240.78	2,969,684.97
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	32,784,250.98	195,895,435.74
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	33,127,632.08	129,863,879.94

注：

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：报告期内，经董事会审议通过，聘任邵东先生担任公司首席信息官，张丽女士不再兼任公司首席信息官，继续担任公司首席运营官。本公司已按规定将上述事项公告并报监管机构备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	2,019,078,811.54	100.00%	395,606.23	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证	16,846.26	100.00%	136,011,000.0	100.00%	-	-	-	-

券			0					
---	--	--	---	--	--	--	--	--

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，财务状况良好；

(2) 具备良好的合规风控能力，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(3) 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；

(4) 具有较强的全方位金融服务及研究能力和水平，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。
- 4、报告期内，本基金已严格遵守证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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博道中证800指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
2	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得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	2025-04-07
3	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	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-05-13
4	博道基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	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	2025-05-15

		披露网站	
5	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	2025-06-06
6	博道基金管理有限公司关于博道中证800指数增强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	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-16

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道中证800指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道中证800指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道中证800指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道中证800指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道中证800指数增强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、报告期内博道中证800指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）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
二〇二五年八月二十九日