

博道久航混合型证券投资基金

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:兴业证券股份有限公司

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。

基金托管人兴业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01月01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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	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	19
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
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	73
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	73
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	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12 投资组合报告附注	73
§8 基金份额持有人信息	74
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75

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	75
§9 开放式基金份额变动	75
§10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
10.4 基金投资策略的改变	76
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
10.8 其他重大事件	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	79
§12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道久航混合型证券投资基金	
基金简称	博道久航混合	
基金主代码	008318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年12月24日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	兴业证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	716,972,725.62份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道久航混合A	博道久航混合C
下属分级基金的交易代码	008318	008319
报告期末下属分级基金的份额总额	287,100,525.97份	429,872,199.65份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，结合宏观基本面、指数价量特征、风险偏好、资金流向等多维度因素的分析，确定和调整资产配置比例，根据对市场环境以及股票估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子表现的判断挑选个股构建股票组合，根据对利率、经济周期、宏观政策等因素的分析构建债券组合。本基金的可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、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×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	兴业证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	李少峰
	联系电话	021-80226288	021-20370710
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95562
传真		021-80226289	0591-38507797
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	福建省福州市湖东路268号证券大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	上海浦东新区长柳路36号兴业证券大厦11楼
邮政编码		200122	200135
法定代表人		莫泰山	苏军良

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 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	博道久航混合A	博道久航混合C
本期已实现收益	29,450,062.49	44,091,742.13
本期利润	45,021,363.88	63,602,349.10
加权平均基金份额本期利润	0.2118	0.2131
本期加权平均净值利润率	15.31%	15.74%
本期基金份额净值增长率	15.31%	15.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	144,026,733.92	198,090,212.31
期末可供分配基金份额利润	0.5017	0.4608
期末基金资产净值	431,127,259.89	627,962,411.96
期末基金份额净值	1.5017	1.4608
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	50.17%	46.08%

注：

- 1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

博道久航混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.92%	0.73%	2.47%	0.49%	3.45%	0.24%

过去三个月	8.39%	1.31%	1.27%	0.94%	7.12%	0.37%
过去六个月	15.31%	1.13%	1.08%	0.86%	14.23%	0.27%
过去一年	34.46%	1.44%	13.64%	1.15%	20.82%	0.29%
过去三年	9.70%	1.17%	-5.83%	0.90%	15.53%	0.27%
自基金合同生效起至今	50.17%	1.20%	9.24%	0.97%	40.93%	0.23%

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。

博道久航混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.87%	0.73%	2.47%	0.49%	3.40%	0.24%
过去三个月	8.25%	1.31%	1.27%	0.94%	6.98%	0.37%
过去六个月	15.02%	1.13%	1.08%	0.86%	13.94%	0.27%
过去一年	33.80%	1.44%	13.64%	1.15%	20.16%	0.29%
过去三年	8.07%	1.17%	-5.83%	0.90%	13.90%	0.27%
自基金合同生效起至今	46.08%	1.20%	9.24%	0.97%	36.84%	0.23%

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

博道久航混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月24日-2025年06月30日)



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道久航混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月24日-2025年06月30日)



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本金为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了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		
刘玮明	博道启航混合、博道叁佰智航、博道消费智航、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合、博道久航混合、博道红利智航股票的基金经理	2024-10-24	-	6年	刘玮明先生，中国籍，金融硕士。2019年6月加入博道基金管理有限公司，历任量化投资部专户投资经理兼任高级量化研究员。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。2月份市场总体呈现出高波风格占主导的特征，使得多因子模型的整体超额收益表现有一定的波动；3月份以来随着行情的扩散，模型的超额收益逐步得到较好的修复。在去年10月份和今年2月份的超额波动中，我们一直从组合优化和风控模型的角度探索系统化迭代的方向。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，本基金维持配置于六大表征主动权益基金不同投资风格的SMART BETA选股策略。

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

本报告期内，基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规的规定，遵守基金合同和托管协议的约定，勤勉尽责履行基金托管人职责，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

本次报告期内，基金托管人根据相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害基金份额持有人利益的行为，基金管理人在各重要方面的运作符合法律规定和基金合同约定。

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

基金托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、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：博道久航混合型证券投资基金

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	上年度末 2024年12月31日
-----	-----	--------------------	---------------------

资产：			
货币资金	6.4.7.1	142,860,603.79	23,542,322.04
结算备付金		64,052.53	63,673.14
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,017,803,294.70	423,767,802.39
其中：股票投资		963,243,556.58	400,516,211.41
基金投资		-	-
债券投资		54,559,738.12	23,251,590.98
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		2,090,246.02	105,585.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,162,818,197.04	447,479,382.85
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		-	5,000,000.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		102,125,766.90	330,289.74
应付管理人报酬		982,114.10	406,731.74
应付托管费		163,685.67	67,788.61

应付销售服务费		252,424.33	79,895.35
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	204,534.19	160,080.49
负债合计		103,728,525.19	6,044,785.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	716,972,725.62	343,247,752.53
未分配利润	6.4.7.8	342,116,946.23	98,186,844.39
净资产合计		1,059,089,671.85	441,434,596.92
负债和净资产总计		1,162,818,197.04	447,479,382.85

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：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		114,492,136.36	-15,490,351.23
1.利息收入		116,921.07	109,820.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	116,920.95	109,820.36
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		0.12	0.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		79,124,133.36	3,485,449.36

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.10	70,237,792.24	-2,061,453.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	222,075.52	272,412.06
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	8,664,265.60	5,274,490.46
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	35,081,908.36	-19,568,717.42
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	169,173.57	483,096.37
减：二、营业总支出		5,868,423.38	3,757,298.39
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,111,582.51	2,629,764.06
2.托管费	6.4.10.2.2	685,263.78	438,293.99
3.销售服务费		988,673.67	612,322.24
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		8,519.66	2,327.22
其中：卖出回购金融资产 支出		8,519.66	2,327.22
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.17	74,383.76	74,590.88
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		108,623,712.98	-19,247,649.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		108,623,712.98	-19,247,649.62

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		108,623,712.98	-19,247,649.62

6.3 净资产变动表

会计主体：博道久航混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01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	343,247,752.53	98,186,844.39	441,434,596.92
二、本期期初净资产	343,247,752.53	98,186,844.39	441,434,596.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	373,724,973.09	243,930,101.84	617,655,074.93
（一）、综合收益总额	-	108,623,712.98	108,623,712.98
（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）	373,724,973.09	135,306,388.86	509,031,361.95
其中：1.基金申购款	565,348,142.79	209,919,369.41	775,267,512.20
2.基金赎回款	-191,623,169.70	-74,612,980.55	-266,236,150.25
（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	716,972,725.62	342,116,946.23	1,059,089,671.85
项 目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	357,582,585.16	52,569,724.95	410,152,310.11
二、本期期初净资产	357,582,585.16	52,569,724.95	410,152,310.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,799,619.65	-19,355,322.59	-56,154,942.24
（一）、综合收益总额	-	-19,247,649.62	-19,247,649.62
（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）	-36,799,619.65	-107,672.97	-36,907,292.62
其中：1.基金申购款	290,260,611.33	26,299,232.61	316,559,843.94
2.基金赎回款	-327,060,230.98	-26,406,905.58	-353,467,136.56
（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	320,782,965.51	33,214,402.36	353,997,367.87

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

博道久航混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2205号《关于准予博道久航混合型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道久航混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,928,396,615.02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（2019）第0751号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道久航混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,929,027,886.06份基金份额，其中认购资金利息折合631,271.04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，基金托管人为兴业证券股份有限公司。

根据《博道久航混合型证券投资基金基金合同》和《博道久航混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道久航混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为50%-95%。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 $\times 80\%$ +上证国债指数收益率 $\times 20\%$ 。

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01月01日至2025年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2025年06月30日的财务状况以及2025年01月01日至2025年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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	2,199,894.74
等于：本金	2,199,053.40
加：应计利息	841.34
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	140,660,709.05
等于：本金	140,642,932.88
加：应计利息	17,776.17
减：坏账准备	-
合计	142,860,603.79

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		935,224,273.26	-	963,243,556.58	28,019,283.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	54,287,333.09	257,418.12	54,559,738.12	14,986.91
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	54,287,333.09	257,418.12	54,559,738.12	14,986.91
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	989,511,606.35	257,418.12	1,017,803,294.70	28,034,270.23

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	150.43
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	14,876.39
预提费用-信息披露费	189,507.37
合计	204,534.19

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道久航混合A

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	170,839,074.86	170,839,074.86
本期申购	138,520,282.24	138,520,282.24
本期赎回（以“-”号填列）	-22,258,831.13	-22,258,831.13
本期末	287,100,525.97	287,100,525.97

6.4.7.7.2 博道久航混合C

金额单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,408,677.67	172,408,677.67
本期申购	426,827,860.55	426,827,860.55
本期赎回（以“-”号填列）	-169,364,338.57	-169,364,338.57
本期末	429,872,199.65	429,872,199.65

注：

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

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 博道久航混合A

单位：人民币元

项目 (博道久航混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	78,667,116.48	-27,028,046.90	51,639,069.58
本期期初	78,667,116.48	-27,028,046.90	51,639,069.58
本期利润	29,450,062.49	15,571,301.39	45,021,363.88

本期基金份额交易产生的变动数	60,668,324.55	-13,302,024.09	47,366,300.46
其中：基金申购款	72,182,038.03	-15,844,389.50	56,337,648.53
基金赎回款	-11,513,713.48	2,542,365.41	-8,971,348.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	168,785,503.52	-24,758,769.60	144,026,733.92

6.4.7.8.2 博道久航混合C

单位：人民币元

项目 (博道久航混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,601,807.09	-27,054,032.28	46,547,774.81
本期期初	73,601,807.09	-27,054,032.28	46,547,774.81
本期利润	44,091,742.13	19,510,606.97	63,602,349.10
本期基金份额交易产生的变动数	117,719,076.26	-29,778,987.86	87,940,088.40
其中：基金申购款	201,242,981.23	-47,661,260.35	153,581,720.88
基金赎回款	-83,523,904.97	17,882,272.49	-65,641,632.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	235,412,625.48	-37,322,413.17	198,090,212.31

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	18,882.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	97,455.38
结算备付金利息收入	379.39
其他	203.83
合计	116,920.95

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	4,688,323,055.81
减：卖出股票成本总额	4,610,828,068.84
减：交易费用	7,257,194.73
买卖股票差价收入	70,237,792.24

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01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	249,273.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,198.17
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	222,075.52

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01月01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	25,497,745.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,126,980.76
减：应计利息总额	397,900.77

减：交易费用	62.41
买卖债券差价收入	-27,198.17

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01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	8,664,265.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,664,265.60

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01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	35,081,908.36
——股票投资	35,079,556.60
——债券投资	2,351.76
——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	35,081,908.36

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	141,335.23
转换费收入	27,838.34
合计	169,173.57

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01月01日至2025年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
合计	74,383.76

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
兴业证券股份有限公司	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		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券股份有限公司	9,824,848,262.30	100.00%	5,962,321,813.40	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		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券买	成交金额	占当期债券买

		卖成交 总额的 比例		卖成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限 公司	62,186,014.00	100.00%	31,053,616.00	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01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
兴业证券 股份有限 公司	69,002,000.00	100.00%	37,502,000.00	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 称	本期 2025年01月01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
兴业证券 股份有限 公司	4,283,149.35	100.00%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券股份有限公司	3,704,387.39	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01月01日至2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,111,582.51	2,629,764.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,035,438.32	642,889.06
应支付基金管理人的净管理费	3,076,144.19	1,986,875.00

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	685,263.78	438,293.99

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×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01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	0.00	182,641.27	182,641.27
兴业证券 股份有限 公司	0.00	78,760.13	78,760.13
合计	0.00	261,401.40	261,401.40
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道久航混合A	博道久航混合C	合计
博道基金 管理有限 公司	0.00	199,689.73	199,689.73
兴业证券 股份有限 公司	0.00	68,464.76	68,464.76
合计	0.00	268,154.49	268,154.49

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费＝前一日C类基金份额对应的基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道久航混合A

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年06月30日
报告期初持有的基金份额	999,800.18	1,999,800.18
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	999,800.18	1,999,800.18
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.35%	1.33%

博道久航混合C

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,000,200.00	1,000,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.23%	0.59%

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为50~100万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为50~100万份。）

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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
兴业证券股份有限公司	140,660,709.05	97,455.38	8,719,608.14	84,121.89

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

金额单位：人民币元

本期 2025年01月01日至2025年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
兴业证券股份有限公司	301392	汇成真空	网下发行	2,189	26,705.80

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	573	27,085.71	71,143.68	-
688411	海博思创	2025-01-20	6个月以上	科创板打新限售	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6个月以上	科创板打新限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6个月以上	创业板打新限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6个月以上	创业板打新限售	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-

				售						
688583	思看科技	2025-01-08	6个月以上	科创板打新限售	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025-06-19	1个月内(含)	科创板打新限售送股	-	79.68	52	-	4,143.36	-
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	-
301602	超研股份	2025-01-15	6个月以上	创业板打新限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6个月以上	创业板打新限售	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301501	恒鑫生活	2025-06-06	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	45.22	108	-	4,883.76	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6个月以上	创业板打新限售	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6个月(含)	创业板打新限售	-	77.87	52	-	4,049.24	-

				售送 股						
3015 35	浙江 华远	2025 -03-1 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	4.92	18.99	734	3,61 1.28	13,93 8.66	-
6887 57	胜科 纳米	2025 -03-1 8	6个月以 上	科创 板打 新限 售	9.08	25.94	536	4,86 6.88	13,90 3.84	-
0013 88	信通 电子	2025 -06-2 4	1个月内 (含)	新股 未上 市	16.42	16.42	843	13,84 2.06	13,84 2.06	-
6887 58	赛分 科技	2025 -01-0 2	6个月以 上	科创 板打 新限 售	4.32	16.97	777	3,35 6.64	13,18 5.69	-
6030 72	天和 磁材	2024 -12-2 4	6个月以 上	主板 打新 限售	12.30	54.45	226	2,77 9.80	12,30 5.70	-
3016 62	宏工 科技	2025 -04-1 0	6个月以 上	创业 板打 新限 售	26.60	82.50	143	3,80 3.80	11,79 7.50	-
3016 01	惠通 科技	2025 -01-0 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	11.80	33.85	342	4,03 5.60	11,57 6.70	-
0013 56	富岭 股份	2025 -01-1 6	6个月以 上	主板 打新 限售	5.30	14.44	709	3,75 7.70	10,23 7.96	-
3015 90	优优 绿能	2025 -05-2 8	6个月以 上	创业 板打	89.60	139.4 8	73	6,54 0.80	10,18 2.04	-

				新限售						
301658	首航新能	2025-03-26	6个月以上	创业板打新限售	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
603202	天有为	2025-04-16	6个月以上	主板打新限售	93.50	90.66	110	10,285.00	9,972.60	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6个月以上	创业板打新限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
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	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6个月以上	创业板打新限售	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6个月以上	主板打新限售	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
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	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6个月以上	创业板打新限售	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025-05-12	6个月以上	创业板打	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-

				新限售						
301560	众捷汽车	2025-04-17	6个月以上	创业板打新限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6个月以上	主板打新限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6个月以上	主板打新限售	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025-03-12	6个月以上	主板打新限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6个月以上	主板打新限售	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6个月以上	主板打新限售	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
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	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6个月以上	主板打新限售	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
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	-

001335	信凯科技	2025-04-02	6个月以上	主板打新限售	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6个月以上	主板打新限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项	38.05	2025-07-11	39.98	48,600	1,767,210.87	1,849,230.00	-

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兴业证券开立于兴业银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于兴业证券，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(2024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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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0.22%。

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1,058,328,463.64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	142,860,603.79	-	-	-	-	-	142,860,603.79
结算备付金	64,052.53	-	-	-	-	-	64,052.53
交易性金融资产	6,380,046.25	-	48,179,691.87	-	-	963,243,556.58	1,017,803,294.70
应收申购款	-	-	-	-	-	2,090,246.02	2,090,246.02
资产总计	149,304,702.57	-	48,179,691.87	-	-	965,333,802.60	1,162,818,197.04
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	102,125,766.90	102,125,766.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	982,114.10	982,114.10
应付托管费	-	-	-	-	-	163,685.67	163,685.67
应付销	-	-	-	-	-	252,424.33	252,424.33

售服务费							
其他负债	-	-	-	-	-	204,534.19	204,534.19
负债总计	-	-	-	-	-	103,728,525.19	103,728,525.19
利率敏感度缺口	149,304,702.57	-	48,179,691.87	-	-	861,605,277.41	1,059,089,671.85
上年度末 2024年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	23,542,322.04	-	-	-	-	-	23,542,322.04
结算备付金	63,673.14	-	-	-	-	-	63,673.14
交易性金融资产	1,019,111.23	817,200.00	21,415,279.75	-	-	400,516,211.41	423,767,802.39
应收申购款	-	-	-	-	-	105,585.28	105,585.28
资产总计	24,625,106.41	817,200.00	21,415,279.75	-	-	400,621,796.69	447,479,382.85
负债							
卖出回购金融资产款	5,000,000.00	-	-	-	-	-	5,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	330,289.74	330,289.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	406,731.74	406,731.74
应付托管费	-	-	-	-	-	67,788.61	67,788.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	79,895.35	79,895.35
其他负债	-	-	-	-	-	160,080.49	160,080.49

负债总计	5,000,000.00	-	-	-	-	1,044,785.93	6,044,785.93
利率敏感度缺口	19,625,106.41	817,200.00	21,415,279.75	-	-	399,577,010.76	441,434,596.92

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.15% (2024年12月31日：5.27%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2024年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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占基金资产的50%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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		上年度末 2024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	963,243,556.58	90.95	400,516,211.41	90.73
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	963,243,556.58	90.95	400,516,211.41	90.73

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	上年度末 2024年12月31日
	1.中证800指数收益率上升5%	55,878,213.80	20,496,831.72
	2.中证800指数收益率下降5%	-55,878,213.80	-20,496,831.72

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	上年度末 2024年12月31日
第一层次	960,898,379.06	399,915,497.88
第二层次	56,424,353.66	23,279,327.48
第三层次	480,561.98	572,977.03
合计	1,017,803,294.70	423,767,802.39

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	963,243,556.58	82.84
	其中：股票	963,243,556.58	82.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,559,738.12	4.69
	其中：债券	54,559,738.12	4.69
	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	142,924,656.32	12.29
8	其他各项资产	2,090,246.02	0.18
9	合计	1,162,818,197.04	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	466,311.00	0.04
B	采矿业	28,879,360.00	2.73
C	制造业	602,756,834.55	56.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,964,239.00	2.45

E	建筑业	2,553,699.00	0.24
F	批发和零售业	19,933,945.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	5,515,539.29	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,118,795.59	2.94
J	金融业	227,428,192.95	21.47
K	房地产业	5,888,056.00	0.56
L	租赁和商务服务业	469,761.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	4,980,960.20	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	2,705,442.00	0.26
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	4,254,565.00	0.40
S	综合	327,856.00	0.03
	合计	963,243,556.58	90.95

7.2.2 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

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	000651	格力电器	395,400	17,761,368.00	1.68
2	002050	三花智控	658,200	17,363,316.00	1.64
3	601555	东吴证券	1,832,009	16,030,078.75	1.51
4	300476	胜宏科技	106,800	14,351,784.00	1.36
5	601288	农业银行	2,432,000	14,300,160.00	1.35
6	600030	中信证券	505,320	13,956,938.40	1.32

7	603596	伯特利	254,200	13,393,798.00	1.26
8	300604	长川科技	266,900	11,986,479.00	1.13
9	688018	乐鑫科技	78,424	11,457,746.40	1.08
10	601318	中国平安	197,000	10,929,560.00	1.03
11	000893	亚钾国际	330,600	9,964,284.00	0.94
12	300033	同花顺	35,751	9,760,380.51	0.92
13	600690	海尔智家	378,600	9,381,708.00	0.89
14	300803	指南针	113,300	9,138,778.00	0.86
15	300274	阳光电源	129,240	8,758,594.80	0.83
16	000750	国海证券	2,079,300	8,566,716.00	0.81
17	603799	华友钴业	229,800	8,507,196.00	0.80
18	002920	德赛西威	82,257	8,400,907.41	0.79
19	300014	亿纬锂能	180,300	8,259,543.00	0.78
20	601009	南京银行	697,300	8,102,626.00	0.77
21	601398	工商银行	1,057,300	8,024,907.00	0.76
22	600704	物产中大	1,486,800	7,835,436.00	0.74
23	300558	贝达药业	125,800	7,290,110.00	0.69
24	300207	欣旺达	362,000	7,261,720.00	0.69
25	600998	九州通	1,412,250	7,258,965.00	0.69
26	300787	海能实业	505,324	6,998,737.40	0.66
27	601211	国泰海通	358,032	6,859,893.12	0.65
28	600015	华夏银行	861,700	6,816,047.00	0.64
29	688608	恒玄科技	19,443	6,765,775.14	0.64
30	601336	新华保险	114,700	6,709,950.00	0.63
31	600535	天士力	419,000	6,557,350.00	0.62
32	002847	盐津铺子	81,140	6,523,656.00	0.62
33	603527	众源新材	598,000	6,500,260.00	0.61
34	601857	中国石油	718,900	6,146,595.00	0.58
35	002983	芯瑞达	287,886	6,100,304.34	0.58
36	002958	青农商行	1,657,600	5,983,936.00	0.57
37	600196	复星医药	235,500	5,908,695.00	0.56

38	600031	三一重工	326,400	5,858,880.00	0.55
39	688475	萤石网络	183,613	5,787,481.76	0.55
40	601328	交通银行	716,900	5,735,200.00	0.54
41	601658	邮储银行	1,045,600	5,719,432.00	0.54
42	601218	吉鑫科技	1,387,300	5,701,803.00	0.54
43	002056	横店东磁	394,200	5,577,930.00	0.53
44	003816	中国广核	1,478,600	5,382,104.00	0.51
45	300247	融捷健康	1,357,800	5,295,420.00	0.50
46	000783	长江证券	764,049	5,294,859.57	0.50
47	603379	三美股份	108,100	5,201,772.00	0.49
48	002179	中航光电	128,404	5,182,385.44	0.49
49	300679	电连技术	113,700	5,159,706.00	0.49
50	300990	同飞股份	102,200	5,099,780.00	0.48
51	000751	锌业股份	1,609,300	5,053,202.00	0.48
52	601628	中国人寿	120,800	4,975,752.00	0.47
53	600025	华能水电	509,900	4,869,545.00	0.46
54	600928	西安银行	1,236,300	4,846,296.00	0.46
55	300019	硅宝科技	242,700	4,790,898.00	0.45
56	600262	北方股份	208,400	4,751,520.00	0.45
57	603966	法兰泰克	508,511	4,718,982.08	0.45
58	603239	浙江仙通	311,100	4,700,721.00	0.44
59	000758	中色股份	932,900	4,692,487.00	0.44
60	000959	首钢股份	1,320,000	4,488,000.00	0.42
61	688578	艾力斯	47,817	4,448,893.68	0.42
62	000333	美的集团	61,246	4,421,961.20	0.42
63	688403	汇成股份	414,800	4,309,772.00	0.41
64	600638	新黄浦	734,800	4,305,928.00	0.41
65	002953	日丰股份	413,700	4,294,206.00	0.41
66	301282	金禄电子	172,200	4,268,838.00	0.40
67	300978	东箭科技	380,100	4,241,916.00	0.40
68	002891	中宠股份	68,500	4,238,095.00	0.40

69	300750	宁德时代	16,800	4,237,296.00	0.40
70	002160	常铝股份	979,700	4,232,304.00	0.40
71	688036	传音控股	52,177	4,158,506.90	0.39
72	601988	中国银行	729,100	4,097,542.00	0.39
73	603687	大胜达	546,200	4,058,266.00	0.38
74	601939	建设银行	424,300	4,005,392.00	0.38
75	601997	贵阳银行	639,100	3,987,984.00	0.38
76	601899	紫金矿业	203,600	3,970,200.00	0.37
77	000513	丽珠集团	110,000	3,964,400.00	0.37
78	002363	隆基机械	512,000	3,896,320.00	0.37
79	300037	新宙邦	107,700	3,791,040.00	0.36
80	603519	立霸股份	310,800	3,779,328.00	0.36
81	300539	横河精密	273,000	3,737,370.00	0.35
82	688772	珠海冠宇	260,200	3,718,258.00	0.35
83	002676	顺威股份	510,405	3,690,228.15	0.35
84	601808	中海油服	266,500	3,667,040.00	0.35
85	000690	宝新能源	794,600	3,615,430.00	0.34
86	002782	可立克	277,900	3,607,142.00	0.34
87	600583	海油工程	657,700	3,591,042.00	0.34
88	002126	银轮股份	147,300	3,576,444.00	0.34
89	600771	广誉远	176,000	3,548,160.00	0.34
90	002948	青岛银行	707,100	3,521,358.00	0.33
91	300400	劲拓股份	209,100	3,521,244.00	0.33
92	300739	明阳电路	236,300	3,506,692.00	0.33
93	300690	双一科技	143,200	3,466,872.00	0.33
94	300221	银禧科技	413,200	3,429,560.00	0.32
95	000166	申万宏源	678,000	3,403,560.00	0.32
96	600685	中船防务	124,601	3,387,901.19	0.32
97	601818	光大银行	812,100	3,370,215.00	0.32
98	600016	民生银行	705,100	3,349,225.00	0.32
99	688222	成都先导	206,200	3,315,696.00	0.31

100	600098	广州发展	525,200	3,282,500.00	0.31
101	600958	东方证券	335,200	3,244,736.00	0.31
102	601995	中金公司	90,200	3,189,472.00	0.30
103	605058	澳弘电子	103,400	3,159,904.00	0.30
104	002532	天山铝业	377,600	3,137,856.00	0.30
105	605020	永和股份	136,100	3,135,744.00	0.30
106	603601	再升科技	762,000	3,093,720.00	0.29
107	300373	扬杰科技	59,000	3,062,100.00	0.29
108	300222	科大智能	298,800	3,044,772.00	0.29
109	688392	骄成超声	44,600	3,038,598.00	0.29
110	300272	开能健康	462,000	3,035,340.00	0.29
111	002787	华源控股	365,100	2,982,867.00	0.28
112	301330	熵基科技	109,794	2,967,731.82	0.28
113	301489	思泉新材	51,120	2,938,888.80	0.28
114	601169	北京银行	418,600	2,859,038.00	0.27
115	000788	北大医药	443,600	2,816,860.00	0.27
116	002685	华东重机	373,500	2,812,455.00	0.27
117	688111	金山办公	10,009	2,803,020.45	0.26
118	603267	鸿远电子	55,500	2,789,985.00	0.26
119	300389	艾比森	238,600	2,762,988.00	0.26
120	600927	永安期货	186,500	2,762,065.00	0.26
121	001216	华瓷股份	203,000	2,740,500.00	0.26
122	600219	南山铝业	710,900	2,722,747.00	0.26
123	000568	泸州老窖	23,800	2,698,920.00	0.25
124	605138	盛泰集团	401,200	2,688,040.00	0.25
125	600742	富维股份	282,500	2,686,575.00	0.25
126	600295	鄂尔多斯	306,600	2,670,486.00	0.25
127	688786	悦安新材	114,600	2,670,180.00	0.25
128	600968	海油发展	642,100	2,619,768.00	0.25
129	002138	顺络电子	93,100	2,617,972.00	0.25
130	300672	国科微	30,600	2,598,552.00	0.25

131	301106	骏成科技	86,880	2,589,024.00	0.24
132	000738	航发控制	123,300	2,558,475.00	0.24
133	601229	上海银行	238,000	2,525,180.00	0.24
134	002593	日上集团	512,100	2,493,927.00	0.24
135	688590	新致软件	121,200	2,489,448.00	0.24
136	002339	积成电子	310,800	2,461,536.00	0.23
137	002454	松芝股份	316,000	2,439,520.00	0.23
138	600459	贵研铂业	156,670	2,429,951.70	0.23
139	002885	京泉华	168,000	2,377,200.00	0.22
140	300187	永清环保	455,700	2,324,070.00	0.22
141	600496	精工钢构	706,000	2,259,200.00	0.21
142	601236	红塔证券	265,300	2,247,091.00	0.21
143	603036	如通股份	129,800	2,223,474.00	0.21
144	300976	达瑞电子	44,200	2,200,718.00	0.21
145	002839	张家港行	488,000	2,196,000.00	0.21
146	002352	顺丰控股	44,800	2,184,448.00	0.21
147	300940	南极光	85,800	2,166,450.00	0.20
148	600062	华润双鹤	115,800	2,160,828.00	0.20
149	001288	运机集团	103,080	2,147,156.40	0.20
150	600036	招商银行	46,700	2,145,865.00	0.20
151	001301	尚太科技	44,000	2,145,440.00	0.20
152	600519	贵州茅台	1,506	2,122,737.12	0.20
153	300824	北鼎股份	177,400	2,116,382.00	0.20
154	688661	和林微纳	52,971	2,106,656.67	0.20
155	600681	百川能源	597,900	2,098,629.00	0.20
156	000776	广发证券	123,300	2,072,673.00	0.20
157	300196	长海股份	169,604	2,069,168.80	0.20
158	688258	卓易信息	42,600	2,063,118.00	0.19
159	300982	苏文电能	114,400	2,058,056.00	0.19
160	600018	上港集团	353,800	2,020,198.00	0.19
161	605066	天正电气	270,800	2,017,460.00	0.19

162	601319	中国人保	229,300	1,997,203.00	0.19
163	300512	中亚股份	232,600	1,995,708.00	0.19
164	002661	克明食品	198,700	1,988,987.00	0.19
165	002543	万和电气	178,500	1,983,135.00	0.19
166	000068	华控赛格	574,100	1,963,422.00	0.19
167	300489	光智科技	44,200	1,951,872.00	0.18
168	300206	理邦仪器	161,000	1,935,220.00	0.18
169	000931	中关村	355,700	1,931,451.00	0.18
170	300836	佰奥智能	42,720	1,899,758.40	0.18
171	002926	华西证券	209,100	1,869,354.00	0.18
172	688313	仕佳光子	48,600	1,849,230.00	0.17
173	603766	隆鑫通用	140,400	1,791,504.00	0.17
174	600999	招商证券	101,300	1,781,867.00	0.17
175	002230	科大讯飞	37,100	1,776,348.00	0.17
176	002250	联化科技	161,300	1,774,300.00	0.17
177	688981	中芯国际	19,400	1,710,498.00	0.16
178	002142	宁波银行	61,700	1,688,112.00	0.16
179	300026	红日药业	455,700	1,681,533.00	0.16
180	603987	康德莱	214,500	1,651,650.00	0.16
181	301260	格力博	83,400	1,644,648.00	0.16
182	601991	大唐发电	504,000	1,597,680.00	0.15
183	600900	长江电力	52,200	1,573,308.00	0.15
184	002821	凯莱英	17,800	1,570,850.00	0.15
185	600382	广东明珠	281,200	1,532,540.00	0.14
186	000657	中钨高新	128,200	1,520,452.00	0.14
187	688120	华海清科	8,947	1,509,358.90	0.14
188	601599	浙文影业	400,900	1,499,366.00	0.14
189	688593	新相微	91,600	1,495,828.00	0.14
190	002404	嘉欣丝绸	230,500	1,491,335.00	0.14
191	300434	金石亚药	154,000	1,481,480.00	0.14
192	000988	华工科技	31,500	1,480,815.00	0.14

193	002075	沙钢股份	253,200	1,473,624.00	0.14
194	002996	顺博合金	196,400	1,445,504.00	0.14
195	300760	迈瑞医疗	6,400	1,438,400.00	0.14
196	601528	瑞丰银行	248,200	1,437,078.00	0.14
197	600566	济川药业	52,300	1,377,059.00	0.13
198	603950	长源东谷	54,200	1,356,626.00	0.13
199	601860	紫金银行	447,700	1,343,100.00	0.13
200	601088	中国神华	33,100	1,341,874.00	0.13
201	300017	网宿科技	123,100	1,319,632.00	0.12
202	002823	凯中精密	92,300	1,294,969.00	0.12
203	301226	祥明智能	47,200	1,292,336.00	0.12
204	002637	赞宇科技	127,500	1,272,450.00	0.12
205	002487	大金重工	38,400	1,263,360.00	0.12
206	300828	锐新科技	76,300	1,261,239.00	0.12
207	000965	天保基建	319,500	1,239,660.00	0.12
208	002290	禾盛新材	39,600	1,237,500.00	0.12
208	001227	兰州银行	495,000	1,237,500.00	0.12
210	601766	中国中车	175,700	1,236,928.00	0.12
211	000598	兴蓉环境	167,700	1,209,117.00	0.11
212	601881	中国银河	70,500	1,209,075.00	0.11
213	002304	洋河股份	18,500	1,194,175.00	0.11
214	002202	金风科技	115,600	1,184,900.00	0.11
215	603659	璞泰来	63,000	1,183,140.00	0.11
216	300733	西菱动力	66,700	1,182,591.00	0.11
217	002491	通鼎互联	207,900	1,180,872.00	0.11
218	000957	中通客车	108,000	1,180,440.00	0.11
219	600109	国金证券	133,400	1,169,918.00	0.11
220	002728	特一药业	138,900	1,168,149.00	0.11
221	000425	徐工机械	150,200	1,167,054.00	0.11
222	002594	比亚迪	3,504	1,163,012.64	0.11
223	600981	汇鸿集团	408,800	1,160,992.00	0.11

224	000987	越秀资本	168,800	1,157,968.00	0.11
225	600825	新华传媒	169,900	1,155,320.00	0.11
226	000100	TCL科技	262,400	1,136,192.00	0.11
227	000672	上峰水泥	143,700	1,135,230.00	0.11
228	002686	亿利达	171,400	1,115,814.00	0.11
229	600908	无锡银行	176,700	1,114,977.00	0.11
230	601688	华泰证券	56,800	1,011,608.00	0.10
231	000009	中国宝安	111,900	993,672.00	0.09
232	600830	香溢融通	96,900	980,628.00	0.09
233	600941	中国移动	8,700	979,185.00	0.09
234	300148	天舟文化	187,900	950,774.00	0.09
235	001872	招商港口	47,800	949,308.00	0.09
236	300059	东方财富	41,000	948,330.00	0.09
237	300408	三环集团	27,500	918,500.00	0.09
238	002560	通达股份	116,200	917,980.00	0.09
239	600150	中国船舶	27,800	904,612.00	0.09
240	688558	国盛智科	35,600	898,544.00	0.08
241	002415	海康威视	32,400	898,452.00	0.08
242	601162	天风证券	179,300	883,949.00	0.08
243	603259	药明康德	12,700	883,285.00	0.08
244	603203	快克智能	34,500	858,015.00	0.08
245	603230	内蒙新华	66,100	853,351.00	0.08
246	002206	海利得	165,600	846,216.00	0.08
247	301025	读客文化	76,300	839,300.00	0.08
248	600926	杭州银行	49,800	837,636.00	0.08
249	002228	合兴包装	234,500	827,785.00	0.08
250	600507	方大特钢	189,900	824,166.00	0.08
251	002224	三力士	180,200	821,712.00	0.08
252	002908	德生科技	80,100	811,413.00	0.08
253	002057	中钢天源	86,700	805,443.00	0.08
254	002758	浙农股份	89,800	801,914.00	0.08

255	688256	寒武纪	1,331	800,596.50	0.08
256	601456	国联民生	76,900	795,915.00	0.08
257	601958	金钼股份	70,200	767,988.00	0.07
258	300752	隆利科技	34,000	764,320.00	0.07
259	300689	澄天伟业	17,000	757,690.00	0.07
260	688579	山大地纬	67,000	749,730.00	0.07
261	002539	云图控股	79,200	742,896.00	0.07
262	301221	光庭信息	14,200	737,974.00	0.07
263	603901	永创智能	69,400	731,476.00	0.07
264	301538	骏鼎达	13,600	723,520.00	0.07
265	600488	津药药业	172,900	720,993.00	0.07
266	600887	伊利股份	25,470	710,103.60	0.07
267	600011	华能国际	99,400	709,716.00	0.07
268	301195	北路智控	19,800	708,840.00	0.07
269	300048	合康新能	120,600	707,922.00	0.07
270	600578	京能电力	155,100	696,399.00	0.07
271	600084	中信尼雅	125,100	695,556.00	0.07
272	603218	日月股份	54,400	690,336.00	0.07
273	002090	金智科技	71,500	684,970.00	0.06
274	003033	征和工业	16,100	682,479.00	0.06
275	688778	厦钨新能	12,000	671,040.00	0.06
276	000039	中集集团	85,200	669,672.00	0.06
277	300562	乐心医疗	45,000	663,750.00	0.06
278	301107	瑜欣电子	22,220	661,045.00	0.06
279	688088	虹软科技	13,600	656,200.00	0.06
280	002350	北京科锐	95,400	654,444.00	0.06
281	000858	五粮液	5,500	653,950.00	0.06
282	300219	鸿利智汇	96,900	651,168.00	0.06
283	688667	菱电电控	12,200	649,162.00	0.06
284	002242	九阳股份	67,800	644,100.00	0.06
285	688288	鸿泉物联	21,800	632,418.00	0.06

286	002080	中材科技	32,000	624,000.00	0.06
287	002001	新 和 成	29,000	616,830.00	0.06
288	600613	神奇制药	95,100	614,346.00	0.06
289	300432	富临精工	45,920	600,174.40	0.06
290	600796	钱江生化	102,100	599,327.00	0.06
291	600176	中国巨石	52,100	593,940.00	0.06
292	300454	深信服	6,300	593,334.00	0.06
293	600875	东方电气	35,400	592,596.00	0.06
294	603529	爱玛科技	17,200	591,680.00	0.06
295	003022	联泓新科	37,300	590,459.00	0.06
296	603586	金麒麟	32,200	589,904.00	0.06
297	688162	巨一科技	21,600	588,384.00	0.06
298	601799	星宇股份	4,700	587,500.00	0.06
299	600369	西南证券	135,000	587,250.00	0.06
300	601601	中国太保	15,600	585,156.00	0.06
301	002906	华阳集团	17,900	581,929.00	0.05
302	603639	海利尔	41,100	577,455.00	0.05
303	688677	海泰新光	14,800	577,348.00	0.05
304	688035	德邦科技	14,200	576,804.00	0.05
305	601166	兴业银行	24,500	571,830.00	0.05
306	002463	沪电股份	13,400	570,572.00	0.05
307	301223	中荣股份	34,400	568,632.00	0.05
308	603306	华懋科技	12,800	556,800.00	0.05
309	603798	康普顿	51,100	555,968.00	0.05
310	002600	领益智造	64,600	554,914.00	0.05
311	600866	星湖科技	80,000	552,800.00	0.05
312	300636	同和药业	71,600	549,888.00	0.05
313	603993	洛阳钼业	65,300	549,826.00	0.05
314	002876	三利谱	21,300	536,547.00	0.05
315	600582	天地科技	89,400	535,506.00	0.05
316	300833	浩洋股份	16,000	534,880.00	0.05

317	601577	长沙银行	53,800	534,772.00	0.05
318	603989	艾华集团	34,400	529,760.00	0.05
319	301387	光大同创	13,500	525,150.00	0.05
320	000157	中联重科	70,700	511,161.00	0.05
321	300099	尤洛卡	69,300	508,662.00	0.05
322	000708	中信特钢	43,200	508,032.00	0.05
323	600499	科达制造	51,800	507,640.00	0.05
324	000411	英特集团	46,900	502,768.00	0.05
325	688505	复旦张江	57,400	497,084.00	0.05
326	688099	晶晨股份	7,000	497,070.00	0.05
327	601668	中国建筑	85,900	495,643.00	0.05
328	000709	河钢股份	229,300	495,288.00	0.05
329	301220	亚香股份	11,000	493,900.00	0.05
330	601128	常熟银行	66,080	487,009.60	0.05
331	000977	浪潮信息	9,400	478,272.00	0.05
332	300964	本川智能	11,400	475,722.00	0.04
333	000726	鲁泰 A	74,400	471,696.00	0.04
334	600153	建发股份	45,300	469,761.00	0.04
335	002701	奥瑞金	78,600	467,670.00	0.04
336	002714	牧原股份	11,100	466,311.00	0.04
337	688012	中微公司	2,547	464,318.10	0.04
338	301362	民爆光电	11,300	461,153.00	0.04
339	603103	横店影视	28,400	455,820.00	0.04
340	688508	芯朋微	8,132	453,928.24	0.04
341	002936	郑州银行	219,700	452,582.00	0.04
342	002746	仙坛股份	76,900	447,558.00	0.04
343	300314	戴维医疗	35,000	444,500.00	0.04
344	688728	格科微	28,000	431,200.00	0.04
345	601126	四方股份	26,400	429,528.00	0.04
346	301036	双乐股份	11,200	419,104.00	0.04
347	600668	尖峰集团	28,900	408,935.00	0.04

348	300543	朗科智能	38,000	408,500.00	0.04
349	600785	新华百货	34,800	408,204.00	0.04
350	600166	福田汽车	150,100	406,771.00	0.04
351	000682	东方电子	38,600	395,264.00	0.04
352	688591	泰凌微	8,200	392,780.00	0.04
353	600352	浙江龙盛	38,600	392,176.00	0.04
354	688073	毕得医药	6,600	382,932.00	0.04
355	600475	华光环能	36,600	381,372.00	0.04
356	603628	清源股份	30,700	374,847.00	0.04
357	300111	向日葵	114,000	373,920.00	0.04
358	300404	博济医药	40,200	370,644.00	0.03
359	300623	捷捷微电	12,200	363,560.00	0.03
360	600919	江苏银行	30,000	358,200.00	0.03
361	300691	联合光电	18,700	358,105.00	0.03
362	600268	国电南自	45,200	353,464.00	0.03
363	001239	永达股份	23,300	348,102.00	0.03
364	601686	友发集团	60,600	344,208.00	0.03
365	000514	渝开发	75,600	342,468.00	0.03
366	002357	富临运业	37,000	342,250.00	0.03
367	002615	哈尔斯	40,300	338,923.00	0.03
368	301580	爱迪特	8,160	338,068.80	0.03
369	603089	正裕工业	25,700	335,899.00	0.03
370	002500	山西证券	57,500	335,800.00	0.03
371	600362	江西铜业	14,300	335,049.00	0.03
372	000027	深圳能源	51,800	330,484.00	0.03
373	301380	挖金客	9,000	330,120.00	0.03
374	000921	海信家电	12,800	328,960.00	0.03
375	000563	陕国投A	92,100	328,797.00	0.03
376	600805	悦达投资	66,100	327,856.00	0.03
377	300354	东华测试	8,300	322,704.00	0.03
378	600460	士兰微	12,900	320,178.00	0.03

379	600526	菲达环保	66,000	316,800.00	0.03
380	688362	甬矽电子	10,600	315,668.00	0.03
381	688128	中国电研	12,600	308,700.00	0.03
382	600600	青岛啤酒	4,400	305,624.00	0.03
383	002107	沃华医药	53,300	304,876.00	0.03
384	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
385	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
386	002263	大东南	7,600	31,388.00	0.00
387	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
388	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
389	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
390	001391	国货航	2,873	19,335.29	0.00
391	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
392	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
393	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
394	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
395	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
396	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
397	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
398	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
399	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
400	603194	中力股份	281	12,754.59	0.00
401	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
402	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
403	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
404	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
405	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
406	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
407	603202	天有为	110	9,972.60	0.00
408	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
409	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00

410	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
411	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
412	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
413	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
414	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
415	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
416	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
417	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
418	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
419	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
420	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
421	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
422	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
423	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
424	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
425	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
426	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	300476	胜宏科技	47,370,621.00	10.73
2	300502	新易盛	37,673,459.00	8.53
3	000651	格力电器	37,255,052.00	8.44
4	601318	中国平安	36,997,853.18	8.38
5	002594	比亚迪	33,764,655.00	7.65
6	002920	德赛西威	32,101,103.22	7.27
7	600030	中信证券	31,738,407.00	7.19

8	300033	同花顺	31,550,583.60	7.15
9	601555	东吴证券	30,598,166.62	6.93
10	601398	工商银行	30,484,610.00	6.91
11	601211	国泰海通	30,311,567.16	6.87
12	002050	三花智控	29,750,377.00	6.74
13	601288	农业银行	29,022,029.00	6.57
14	601988	中国银行	25,234,011.00	5.72
15	688018	乐鑫科技	25,008,999.60	5.67
16	300750	宁德时代	24,995,844.50	5.66
17	600690	海尔智家	24,524,728.00	5.56
18	001301	尚太科技	24,439,856.00	5.54
19	300803	指南针	23,365,094.50	5.29
20	000333	美的集团	22,841,299.00	5.17
21	300274	阳光电源	22,752,827.60	5.15
22	300558	贝达药业	22,508,411.00	5.10
23	688183	生益电子	22,434,133.54	5.08
24	300308	中际旭创	22,423,524.00	5.08
25	002714	牧原股份	21,410,657.00	4.85
26	002926	华西证券	21,219,369.00	4.81
27	601168	西部矿业	20,985,644.00	4.75
28	002352	顺丰控股	20,687,364.00	4.69
29	300207	欣旺达	20,496,951.00	4.64
30	000423	东阿阿胶	20,454,403.00	4.63
31	601658	邮储银行	20,370,183.00	4.61
32	603799	华友钴业	20,210,017.00	4.58
33	002179	中航光电	20,194,307.40	4.57
34	000975	山金国际	18,847,737.99	4.27
35	600900	长江电力	18,305,472.00	4.15
36	300059	东方财富	18,304,994.00	4.15
37	603596	伯特利	17,936,450.00	4.06
38	601939	建设银行	17,834,946.00	4.04

39	000893	亚钾国际	17,687,755.00	4.01
40	600060	海信视像	17,636,448.00	4.00
41	601127	赛力斯	17,513,727.00	3.97
42	600941	中国移动	17,458,623.00	3.95
43	600887	伊利股份	17,381,495.40	3.94
44	603893	瑞芯微	16,458,652.00	3.73
45	002001	新 和 成	16,382,376.77	3.71
46	603379	三美股份	16,227,990.10	3.68
47	601857	中国石油	16,091,551.00	3.65
48	601456	国联民生	15,872,210.00	3.60
49	000783	长江证券	15,823,937.40	3.58
50	000750	国海证券	15,319,923.00	3.47
51	600519	贵州茅台	14,897,679.00	3.37
52	002463	沪电股份	14,783,173.00	3.35
53	301489	思泉新材	14,649,349.60	3.32
54	300604	长川科技	14,609,604.00	3.31
55	601628	中国人寿	14,515,900.00	3.29
56	600276	恒瑞医药	14,498,859.20	3.28
57	688036	传音控股	14,495,330.20	3.28
58	600938	中国海油	14,485,937.00	3.28
59	000858	五 粮 液	14,196,354.00	3.22
60	002415	海康威视	14,157,107.00	3.21
61	601009	南京银行	13,840,544.00	3.14
62	600998	九州通	13,433,970.00	3.04
63	601336	新华保险	13,369,148.00	3.03
64	601328	交通银行	13,307,691.00	3.01
65	600582	天地科技	13,300,498.00	3.01
66	600958	东方证券	13,260,233.00	3.00
67	002056	横店东磁	13,199,220.00	2.99
68	600015	华夏银行	13,062,368.00	2.96
69	601899	紫金矿业	13,010,880.00	2.95

70	600704	物产中大	12,935,284.40	2.93
71	603527	众源新材	12,887,164.00	2.92
72	600583	海油工程	12,757,714.00	2.89
73	603239	浙江仙通	12,541,457.00	2.84
74	300001	特锐德	12,514,252.53	2.83
75	600066	宇通客车	12,341,130.00	2.80
76	300690	双一科技	11,972,184.00	2.71
77	600031	三一重工	11,893,359.00	2.69
78	605117	德业股份	11,832,171.00	2.68
79	002885	京泉华	11,817,042.00	2.68
80	300824	北鼎股份	11,748,757.00	2.66
81	300787	海能实业	11,706,148.80	2.65
82	002666	德联集团	11,687,308.00	2.65
83	002202	金风科技	11,650,886.00	2.64
84	300570	太辰光	11,578,156.00	2.62
85	600348	华阳股份	11,464,650.00	2.60
86	603687	大胜达	11,403,643.00	2.58
87	601995	中金公司	11,359,373.00	2.57
88	600219	南山铝业	11,322,032.00	2.56
89	000039	中集集团	11,319,842.00	2.56
90	003816	中国广核	11,279,265.00	2.56
91	600547	山东黄金	11,099,850.80	2.51
92	300014	亿纬锂能	10,979,480.00	2.49
93	002797	第一创业	10,976,479.00	2.49
94	601088	中国神华	10,954,789.00	2.48
95	002847	盐津铺子	10,903,543.00	2.47
96	688313	仕佳光子	10,724,010.97	2.43
97	300573	兴齐眼药	10,712,329.68	2.43
98	601138	工业富联	10,665,035.00	2.42
99	600499	科达制造	10,609,867.00	2.40
100	300661	圣邦股份	10,533,905.00	2.39

101	301330	熵基科技	10,454,467.47	2.37
102	301408	华人健康	10,452,648.00	2.37
103	300539	横河精密	10,415,888.55	2.36
104	000690	宝新能源	10,411,901.00	2.36
105	600988	赤峰黄金	10,282,688.00	2.33
106	002958	青农商行	10,270,251.00	2.33
107	002983	芯瑞达	10,261,053.10	2.32
108	600170	上海建工	10,222,990.00	2.32
109	000166	申万宏源	10,180,032.00	2.31
110	688608	恒玄科技	10,130,666.88	2.29
111	600535	天士力	10,116,372.00	2.29
112	000895	双汇发展	10,051,258.00	2.28
113	002952	亚世光电	10,028,995.00	2.27
114	002977	火箭科技	10,004,449.60	2.27
115	002916	深南电路	9,941,380.40	2.25
116	601818	光大银行	9,922,870.00	2.25
117	688772	珠海冠宇	9,856,157.17	2.23
118	300179	四方达	9,726,046.00	2.20
119	601633	长城汽车	9,693,421.00	2.20
120	000921	海信家电	9,675,199.00	2.19
121	603236	移远通信	9,618,532.50	2.18
122	603519	立霸股份	9,540,309.00	2.16
123	603288	海天味业	9,517,825.64	2.16
124	600901	江苏金租	9,484,163.58	2.15
125	301099	雅创电子	9,430,429.96	2.14
126	600600	青岛啤酒	9,429,822.00	2.14
127	000959	首钢股份	9,401,099.00	2.13
128	000554	泰山石油	9,329,682.00	2.11
129	600196	复星医药	9,269,660.00	2.10
130	688318	财富趋势	9,265,041.91	2.10
131	002142	宁波银行	9,226,330.00	2.09

132	002532	天山铝业	9,172,764.00	2.08
133	300763	锦浪科技	9,134,403.04	2.07
134	603296	华勤技术	9,095,550.00	2.06
135	300373	扬杰科技	9,059,970.00	2.05
136	600016	民生银行	9,025,689.00	2.04
137	600685	中船防务	8,966,259.25	2.03

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	300476	胜宏科技	41,334,469.00	9.36
2	300502	新易盛	41,223,665.40	9.34
3	002594	比亚迪	40,585,689.00	9.19
4	601318	中国平安	34,712,357.00	7.86
5	300750	宁德时代	27,112,473.00	6.14
6	601211	国泰海通	25,793,977.00	5.84
7	601398	工商银行	25,606,570.00	5.80
8	600900	长江电力	25,367,384.00	5.75
9	002920	德赛西威	25,144,573.00	5.70
10	002714	牧原股份	23,554,902.84	5.34
11	300308	中际旭创	23,445,584.00	5.31
12	688183	生益电子	23,013,731.38	5.21
13	002352	顺丰控股	22,775,200.00	5.16
14	000333	美的集团	22,415,251.48	5.08
15	300033	同花顺	22,349,738.00	5.06
16	000423	东阿阿胶	22,298,156.32	5.05
17	001301	尚太科技	22,113,612.54	5.01

18	601988	中国银行	21,367,677.00	4.84
19	603893	瑞芯微	20,585,027.89	4.66
20	601288	农业银行	20,452,884.00	4.63
21	600030	中信证券	20,292,938.00	4.60
22	000651	格力电器	19,973,458.00	4.52
23	601168	西部矿业	19,875,580.00	4.50
24	000975	山金国际	19,572,475.60	4.43
25	600887	伊利股份	19,526,633.00	4.42
26	002926	华西证券	18,804,228.00	4.26
27	601555	东吴证券	18,432,429.00	4.18
28	300059	东方财富	18,404,434.02	4.17
29	300803	指南针	18,163,050.15	4.11
30	600060	海信视像	17,307,439.00	3.92
31	002415	海康威视	17,187,067.00	3.89
32	601127	赛力斯	17,166,070.00	3.89
33	000858	五粮液	17,102,456.00	3.87
34	002001	新和成	17,043,723.00	3.86
35	600941	中国移动	16,994,384.65	3.85
36	600690	海尔智家	16,987,319.00	3.85
37	600938	中国海油	16,825,705.00	3.81
38	603799	华友钴业	16,386,608.08	3.71
39	002179	中航光电	15,755,555.20	3.57
40	000783	长江证券	15,723,671.00	3.56
41	300274	阳光电源	15,716,883.20	3.56
42	600066	宇通客车	15,584,783.00	3.53
43	601456	国联民生	15,563,023.00	3.53
44	002463	沪电股份	15,278,881.00	3.46
45	600276	恒瑞医药	15,030,063.00	3.40
46	300558	贝达药业	14,789,142.00	3.35
47	601658	邮储银行	14,715,206.00	3.33
48	605117	德业股份	14,638,436.12	3.32

49	688018	乐鑫科技	14,471,376.60	3.28
50	002916	深南电路	14,361,032.20	3.25
51	000933	神火股份	14,340,929.00	3.25
52	601939	建设银行	14,173,507.00	3.21
53	600348	华阳股份	13,779,716.00	3.12
54	600958	东方证券	13,761,445.00	3.12
55	300207	欣旺达	13,524,592.00	3.06
56	600519	贵州茅台	13,122,592.00	2.97
57	002666	德联集团	13,004,027.00	2.95
58	002050	三花智控	12,917,093.00	2.93
59	301099	雅创电子	12,562,176.78	2.85
60	600582	天地科技	12,522,699.00	2.84
61	300001	特锐德	12,488,383.00	2.83
62	300570	太辰光	12,476,291.00	2.83
63	301489	思泉新材	12,422,671.80	2.81
64	000725	京东方 A	12,242,388.00	2.77
65	600600	青岛啤酒	12,201,834.40	2.76
66	002977	火箭科技	12,136,973.16	2.75
67	000554	泰山石油	12,126,234.60	2.75
68	600547	山东黄金	12,059,097.20	2.73
69	000895	双汇发展	12,027,282.50	2.72
70	603379	三美股份	11,897,312.00	2.70
71	600160	巨化股份	11,809,563.20	2.68
72	601138	工业富联	11,785,720.00	2.67
73	600170	上海建工	11,380,273.00	2.58
74	301408	华人健康	11,319,104.00	2.56
75	600583	海油工程	11,314,021.00	2.56
76	002797	第一创业	11,245,683.00	2.55
77	300573	兴齐眼药	11,009,183.36	2.49
78	000039	中集集团	10,879,148.50	2.46
79	601336	新华保险	10,800,082.78	2.45

80	600988	赤峰黄金	10,737,725.00	2.43
81	688036	传音控股	10,719,865.38	2.43
82	688313	仕佳光子	10,682,346.70	2.42
83	300661	圣邦股份	10,666,465.00	2.42
84	002202	金风科技	10,622,670.48	2.41
85	002952	亚世光电	10,556,998.00	2.39
86	600901	江苏金租	10,538,236.04	2.39
87	300824	北鼎股份	10,418,737.00	2.36
88	002885	京泉华	10,311,305.60	2.34
89	002578	闽发铝业	10,310,688.00	2.34
90	600096	云天化	10,267,273.00	2.33
91	600143	金发科技	10,251,452.00	2.32
92	300179	四方达	10,227,832.00	2.32
93	601088	中国神华	10,131,313.00	2.30
94	601857	中国石油	10,038,702.00	2.27
95	002690	美亚光电	9,971,797.00	2.26
96	601628	中国人寿	9,924,061.00	2.25
97	300763	锦浪科技	9,905,226.00	2.24
98	603296	华勤技术	9,835,888.54	2.23
99	603236	移远通信	9,747,062.98	2.21
100	600499	科达制造	9,593,916.00	2.17
101	603288	海天味业	9,589,815.64	2.17
102	688318	财富趋势	9,580,753.69	2.17
103	600563	法拉电子	9,475,036.00	2.15
104	601633	长城汽车	9,381,386.40	2.13
105	600219	南山铝业	9,366,969.00	2.12
106	301338	凯格精机	9,353,197.00	2.12
107	002996	顺博合金	9,198,129.80	2.08
108	601899	紫金矿业	9,162,681.00	2.08

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	5,138,475,857.41
卖出股票收入（成交）总额	4,688,323,055.81

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	54,559,738.12	5.15
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	54,559,738.12	5.15

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	019773	25国债08	384,000	38,518,661.26	3.64
2	019749	24国债15	63,000	6,380,046.25	0.60
3	019766	25国债01	55,000	5,524,240.69	0.52
4	019758	24国债21	41,000	4,136,789.92	0.39

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）2025年1月2日，中国证券监督管理委员会公示〔2025〕1号行政处罚决定书，对东吴证券股份有限公司责令改正，给予警告，针对国美通讯项目，没收保荐业务收入943,396.23元，并处以100万元罚款，没收承销业务违法所得4,716,981.13元，并处以50万元罚款；针对紫鑫药业项目，没收保荐业务收入2,068,000元，并处以4,136,000元罚款。

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。

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。

2024年12月31日，浙江证监局公示行政监管措施决定书，对杭州长川科技股份有限公司采取出具警示函的行政监管措施。

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	2,090,246.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,090,246.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户	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	持有份额	占总份 额比例

	数 (户)			比例		
博道 久航 混合A	6,377	45,021.25	143,520,848.78	49.99%	143,579,677.19	50.01%
博道 久航 混合C	15,461	27,803.65	353,411,926.78	82.21%	76,460,272.87	17.79%
合计	21,675	33,078.33	496,932,775.56	69.31%	220,039,950.06	30.69%

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	博道久航混合A	1,987,895.84	0.69%
	博道久航混合C	154,465.92	0.04%
	合计	2,142,361.76	0.30%

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	博道久航混合A	50~100
	博道久航混合C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道久航混合A	0
	博道久航混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道久航混合A	博道久航混合C
基金合同生效日(2019年12月24日)基金份额总额	1,054,254,547.59	874,773,338.47
本报告期期初基金份额总额	170,839,074.86	172,408,677.67
本报告期基金总申购份额	138,520,282.24	426,827,860.55
减：本报告期基金总赎回份额	22,258,831.13	169,364,338.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	287,100,525.97	429,872,199.65

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

本报告期内托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
兴业证券	2	9,824,848,262.30	100.00%	4,283,149.35	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
兴业证券	62,186,014.00	100.00%	69,002,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
 - (1) 经营行为稳健规范，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调整旗下部分基金单笔申购最低金额、单笔赎回最低份额及最低保留余额的公告	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	2025-01-16
2	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	2025-01-22
3	博道久航混合型证券投资基金2024年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-22
4	博道基金管理有限公司关于增加东方证券股份有限公司为博道久航混合型证券投资基金销售机构的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-20
5	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构的公告	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	2025-03-03
6	博道基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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披露网站	2025-03-08
7	博道基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31

8	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	2025-03-31
9	博道久航混合型证券投资基金2024年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	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
11	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	2025-04-22
12	博道久航混合型证券投资基金2025年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-22
13	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披露网站	2025-05-15
14	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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250101 - 20250101	71,998,190.98	19,229,471.86	-	91,227,662.84	12.72%
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回。							

回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道久航混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道久航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道久航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道久航混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道久航混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道久航混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日