

博道盛利 6 个月持有期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:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行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	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
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	61
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	61
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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

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	64
§9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§11 备查文件目录	68
11.1 备查文件目录	68
11.2 存放地点	68
11.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	博道盛利6个月持有期混合
基金主代码	010404
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	36,725,251.52份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，确定并动态调整大类资产的投资比例。本基金债券投资通过对宏观经济、货币和财政政策的分析，利率走势和收益率曲线变化的判断，不同类别债券品种的利差和变化趋势以及个券流动性、到期收益率、信用等级、税收等因素的分析构建债券组合，主要包括久期管理策略、期限结构配置策略、类属配置策略、个券选择、可转债投资、信用债投资等积极的投资策略。本基金的股票投资策略是坚持行业配置策略与个股精选策略相结合的投资理念，采用自下而上的积极选股策略，对行业和个股投资价值进行评估，选择具备长期竞争优势和投资潜力的细分行业和个股进行投资，港股通投资重点关注A股稀缺性行业和个股、具有持续领先优势或核心竞争力的与A股同类公司相比具有估值优势的公司。本基金的资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略详

	见法律文件。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*75%+中证800指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：本基金对认/申购、转换转入的每份基金份额设定6个月的最短持有期限，基金份额在最短持有期限内不办理赎回及转换转出业务，最短持有期限为持有期起始日（含）至持有期到期日（不含），自持有期到期日（含该日）起可以提出赎回或转换转出申请。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文璜	王茵
	联系电话	021-80226288	010-63639180
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-085-2888	95595
传真		021-80226289	010-63639132
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200122	100033
法定代表人		莫泰山	吴利军

2.4 信息披露方式

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

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日- 2025年06月30日)
本期已实现收益	2,075,418.90
本期利润	1,019,688.10
加权平均基金份额本期利润	0.0224
本期加权平均净值利润率	2.12%
本期基金份额净值增长率	2.76%
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	2,773,813.02
期末可供分配基金份额利润	0.0755
期末基金资产净值	39,612,001.90
期末基金份额净值	1.0786
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	7.86%

注：

1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	1.65%	0.25%	0.99%	0.15%	0.66%	0.10%
过去三个月	0.65%	0.58%	1.31%	0.29%	-0.66%	0.29%
过去六个月	2.76%	0.50%	1.08%	0.27%	1.68%	0.23%
过去一年	13.52%	0.72%	6.68%	0.33%	6.84%	0.39%
过去三年	8.84%	0.57%	4.63%	0.27%	4.21%	0.30%
自基金合同 生效起至今	7.86%	0.54%	4.72%	0.28%	3.14%	0.26%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了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		
陈连权	博道盛利6个月持有	2022-02-09	-	18年	陈连权先生，中国籍，经济

	期混合、博道和祥多元稳健债券、博道中证同业存单AAA指数7天持有期、博道和裕多元稳健30天持有期债券、博道和盈利率债的基金经理、固定收益投资总监				学硕士。2007年8月至2015年5月担任交银施罗德基金管理有限公司投资研究部分析师、专户投资部副总经理，2015年5月至2017年11月担任富国基金管理有限公司固定收益研究部总经理、固定收益专户投资部总经理、固定收益投资总监兼基金经理，2018年2月至2021年12月担任上海远海资产管理有限公司副总经理、投资总监、研究总监。2021年12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

上半年，在经济复苏与关税冲击的交织影响下，股票与债券市场呈现出宽幅波动，国内经济虽然受到事件冲击影响，但仍处于回暖区间。总体看，沪深300上涨0.03%，中证500上涨3.31%，中证1000上涨6.69%；债券方面，十年期国债利率在一季度上行至高点1.90%后下行至1.62%，之后反弹至1.72%，收于1.65%，利率体系总体仍处于震荡状态。

上半年，经济复苏有所波折，在关税事件冲击下，经济动能虽然短暂下移，但是很快呈现企稳回升态势，PMI从年初49.1上行至3月份的50.5，而后回落至4月的49.0，又逐月回升，收于6月份的49.7，6月份工业增加值同比增速为6.8%，较3月份7.7%有所下滑，社会消费品零售总额同比增速从3月份的5.9%回升至5月份的6.4%，6月又回落到4.8%。价格方面，CPI同比在一季度最低录得-0.7%，6月份CPI同比上涨0.1%，PPI同比降幅持续扩大，从3月份的-2.5%进一步下滑至6月份的-3.6%。6月份，在海外地缘政治冲突影响下，原油价格波动带动一些能源化工及煤炭电力行业的工业品价格出现了部分上涨迹象。政策方面，二季度，7天OMO逆回购利率下降至1.4%，央行之前改变了MLF的招标方式，MLF政策利率的色彩逐步淡化，同时，央行在一季度暂停国债买卖后在二季度暂未重启，货币市场维持了偏宽松状态。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要会计数据和财务指标"及"3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较"部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，关税事件可能会打乱或延缓经济节奏，但不会根本性扭转增长动能，市场可能在负向事件的冲击与正向政策的支持中处于宽幅震荡区间，如果风险偏好延续回暖，经济体内部的流动性传导机制得以畅通，经济基本面与市场也将随之缓慢回升。

本基金上半年在基金合同约定的资产配置比例范围内总体维持较高的权益比例，债券灵活调整了久期。风格与选股方面，遵循多因子模型，在成长与价值当中总体保持均衡，市值风格适中。

本基金将继续坚持攻守兼备的投资思路，积极跟踪把握基本面与市场的变化，保持对市场的尊重及敬畏，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，时间范围为2025年4月7日至2025年6月30日。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生

任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金2025年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博道盛利6个月持有期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	1,434,635.13	1,909,206.61
结算备付金		13,020.42	10,447.30
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	38,789,550.84	54,533,667.01
其中：股票投资		16,471,441.25	25,583,973.17
基金投资		-	-
债券投资		22,318,109.59	28,949,693.84

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	800,000.00	1,699,869.32
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		30,019.98	124.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		41,067,226.37	58,153,314.99
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		1,130,000.00	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		236,557.17	263,410.58
应付管理人报酬		26,357.10	40,657.04
应付托管费		4,941.93	7,623.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	57,368.27	104,493.81
负债合计		1,455,224.47	416,184.61
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	36,725,251.52	55,008,607.67
未分配利润	6.4.7.8	2,886,750.38	2,728,522.71
净资产合计		39,612,001.90	57,737,130.38
负债和净资产总计		41,067,226.37	58,153,314.99

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：博道盛利6个月持有期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		1,316,014.38	-123,415.56
1.利息收入		58,634.39	100,203.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,240.90	15,088.61
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		48,393.49	85,114.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		2,312,902.83	444,368.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	620,206.98	-1,221,351.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,502,279.74	1,151,800.53
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	-99,429.07	-

股利收益	6.4.7.14	289,845.18	513,918.65
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	-1,055,730.80	-686,019.92
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	207.96	18,033.15
减：二、营业总支出		296,326.28	540,466.09
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	192,071.57	375,201.92
2.托管费	6.4.10.2.2	36,013.40	70,350.30
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		596.06	-
其中：卖出回购金融资产支出		596.06	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		95.07	50.38
8.其他费用	6.4.7.17	67,550.18	94,863.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,019,688.10	-663,881.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,019,688.10	-663,881.65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,019,688.10	-663,881.65

6.3 净资产变动表

会计主体：博道盛利6个月持有期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	55,008,607.67	2,728,522.71	57,737,130.38
二、本期期初净资产	55,008,607.67	2,728,522.71	57,737,130.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,283,356.15	158,227.67	-18,125,128.48
（一）、综合收益总额	-	1,019,688.10	1,019,688.10
（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）	-18,283,356.15	-861,460.43	-19,144,816.58
其中：1.基金申购款	338,598.24	19,759.96	358,358.20
2.基金赎回款	-18,621,954.39	-881,220.39	-19,503,174.78
（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	36,725,251.52	2,886,750.38	39,612,001.90
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	114,847,247.92	-4,653,929.15	110,193,318.77
二、本期期初净资产	114,847,247.92	-4,653,929.15	110,193,318.77

产			
三、本期增减变动 额（减少以“-”号 填列）	-34,167,956.50	630,377.93	-33,537,578.57
（一）、综合收益 总额	-	-663,881.65	-663,881.65
（二）、本期基金 份额交易产生的净 资产变动数（净资 产减少以“-”号填 列）	-34,167,956.50	1,294,259.58	-32,873,696.92
其中：1.基金申购款	1,608,227.17	-75,274.87	1,532,952.30
2.基金赎回 款	-35,776,183.67	1,369,534.45	-34,406,649.22
（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	80,679,291.42	-4,023,551.22	76,655,740.20

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

博道盛利6个月持有期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[2020]2470号《关于准予博道盛利6个月持有期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《博道盛利6个月持有期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575,384,910.08元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2020）第1118号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年12月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为575,454,761.54份基金份额，其中认购资金利息折合69,851.46份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金对认/申购、转换转入的每份基金份额设定6个月的最短持有期限（因红利再投资所生成的基金份额的最短持有期限按照本基金合同的“基金的收益与分配”章节的约定另行计算），基金份额在最短持有期限内不办理赎回及转换转出业务，最短持有期限为持有期起始日(含)至持有期到期日(不含)，自持有期到期日(含该日)起可以提出赎回或转换转出申请。对于每份基金份额，持有期起始日指基金合同生效日或该基金份额申购确认日或该基金份额转换转入确认日，持有期到期日指该基金份额持有期起始日起至持有满6个月当月的月度对日的前一工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道盛利6个月持有期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）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为0%-45%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%）。本基金投资于可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）合计比例不超过基金资产的20%。本基金投资于同业存单比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率*75%+中证800指数收益率*20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总

局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2025年06月30日	
活期存款	574,881.43	
等于：本金	574,825.51	
加：应计利息	55.92	
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	859,753.70	
等于：本金	859,602.48	
加：应计利息	151.22	
减：坏账准备	-	
合计	1,434,635.13	

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		16,255,407.30	-	16,471,441.25	216,033.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,367,923.05	78,317.26	8,425,917.26	-20,323.05
	银行间市场	13,889,954.00	107,792.33	13,892,192.33	-105,554.00
	合计	22,257,877.05	186,109.59	22,318,109.59	-125,877.05

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	38,513,284.35	186,109.59	38,789,550.84	90,156.90

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	800,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	155.26
应付交易费用	510.00

其中：交易所市场	-
银行间市场	510.00
应付利息	-
预提费用-审计费	7,439.10
预提费用-信息披露费	39,671.58
预提费用-账户维护费	9,300.00
其他应付	292.33
合计	57,368.27

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,008,607.67	55,008,607.67
本期申购	338,598.24	338,598.24
本期赎回（以“-”号填列）	-18,621,954.39	-18,621,954.39
本期末	36,725,251.52	36,725,251.52

注：

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

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,843,277.49	885,245.22	2,728,522.71
本期期初	1,843,277.49	885,245.22	2,728,522.71
本期利润	2,075,418.90	-1,055,730.80	1,019,688.10
本期基金份额交易产生的变动数	-1,144,883.37	283,422.94	-861,460.43
其中：基金申购款	17,743.23	2,016.73	19,759.96
基金赎回款	-1,162,626.60	281,406.21	-881,220.39

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,773,813.02	112,937.36	2,886,750.38

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	4,244.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,786.83
结算备付金利息收入	1,209.96
其他	-
合计	10,240.90

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	142,184,409.43
减：卖出股票成本总额	141,356,117.34
减：交易费用	208,085.11
买卖股票差价收入	620,206.98

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	194,047.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,308,232.40
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	1,502,279.74

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	42,989,381.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	41,250,839.47
减：应计利息总额	429,088.94
减：交易费用	1,221.01
买卖债券差价收入	1,308,232.40

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

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
期货投资	-99,429.07

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	289,845.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	289,845.18

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	-1,055,730.80
——股票投资	507,784.79
——债券投资	-1,563,515.59
——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	-1,055,730.80

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	207.96
合计	207.96

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	7,439.10
信息披露费	39,671.58
汇划手续费	1,838.61
账户维护费-中债登	9,000.00
账户维护费-上清所	9,600.00
存托服务费	0.89
合计	67,550.18

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
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	192,071.57	375,201.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	93,110.89	153,145.22
应支付基金管理人的净管理费	98,960.68	222,056.70

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×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	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
当期发生的基金应支付的托管费	36,013.40	70,350.30

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.15%/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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	574,881.43	4,244.11	1,227,166.80	7,136.71

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年06月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,130,000.00元，截至2025年07月01日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人光大银行，其他存款存放于兴业证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；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：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为6.30%)。

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于锁定期届满后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自基金合同生效日满6个月起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，除卖出回购金融资产款余额中有1,130,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2025年6月30日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人自基金合同生效日满6个月起对基金组合资产中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40,830,363.48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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	-------	-------	--------	------	------	-----	----

2025年 06月30 日							
资产							
货币资金	1,434,635.13	-	-	-	-	-	1,434,635.13
结算备付金	13,020.42	-	-	-	-	-	13,020.42
交易性金融资产	3,038,117.26	-	-	2,037,605.48	17,242,386.85	16,471,441.25	38,789,550.84
买入返售金融资产	800,000.00	-	-	-	-	-	800,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	30,019.98	30,019.98
资产总计	5,285,772.81	-	-	2,037,605.48	17,242,386.85	16,501,461.23	41,067,226.37
负债							
卖出回购金融资产款	1,130,000.00	-	-	-	-	-	1,130,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	236,557.17	236,557.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,357.10	26,357.10
应付托管费	-	-	-	-	-	4,941.93	4,941.93
其他负债	-	-	-	-	-	57,368.27	57,368.27
负债总计	1,130,000.00	-	-	-	-	325,224.47	1,455,224.47
利率敏感度缺口	4,155,772.81	-	-	2,037,605.48	17,242,386.85	16,176,236.76	39,612,001.90
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	1,909,206.61	-	-	-	-	-	1,909,206.61
结算备付金	10,447.30	-	-	-	-	-	10,447.30
交易性金融资产	-	-	3,627,941.92	3,638,445.07	21,683,306.85	25,583,973.17	54,533,667.01
买入返售金融资产	1,699,869.32	-	-	-	-	-	1,699,869.32
应收申购款	-	-	-	-	-	124.75	124.75
资产总计	3,619,523.23	-	3,627,941.92	3,638,445.07	21,683,306.85	25,584,097.92	58,153,314.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	263,410.58	263,410.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,657.04	40,657.04
应付托管费	-	-	-	-	-	7,623.18	7,623.18
其他负债	-	-	-	-	-	104,493.81	104,493.81
负债总计	-	-	-	-	-	416,184.61	416,184.61
利率敏感度缺口	3,619,523.23	-	3,627,941.92	3,638,445.07	21,683,306.85	25,167,913.31	57,737,130.38

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

假设	除市场利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.市场利率下降25个基点	498,086.01	446,774.43

	2.市场利率上升25个基点	-478,794.82	-436,888.07
--	---------------	-------------	-------------

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。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0%-45%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%)，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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	16,471,441.25	41.58	25,583,973.17	44.31
交易性金融资	-	-	-	-

产－基金投资				
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	16,471,441.25	41.58	25,583,973.17	44.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	1.业绩比较基准收益率上升5%	806,180.07	1,420,261.75
	2.业绩比较基准收益率下降5%	-806,180.07	-1,420,261.75

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	16,471,441.25	29,222,418.24
第二层次	22,318,109.59	25,311,248.77
第三层次	-	-
合计	38,789,550.84	54,533,667.01

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	16,471,441.25	40.11
	其中：股票	16,471,441.25	40.11
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	22,318,109.59	54.35
	其中：债券	22,318,109.59	54.35
	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	800,000.00	1.95
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,447,655.55	3.53
8	其他各项资产	30,019.98	0.07
9	合计	41,067,226.37	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	30,755.00	0.08
B	采矿业	274,634.00	0.69
C	制造业	9,425,193.47	23.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,157,044.00	2.92
E	建筑业	219,941.00	0.56
F	批发和零售业	748,036.50	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	936,473.00	2.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	696,007.00	1.76
J	金融业	1,780,194.00	4.49
K	房地产业	89,245.00	0.23
L	租赁和商务服务业	346,506.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	51,472.48	0.13

N	水利、环境和公共设施管理业	234,658.80	0.59
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	453,803.00	1.15
S	综合	27,478.00	0.07
	合计	16,471,441.25	41.58

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	002206	海利得	36,600	187,026.00	0.47
2	603299	苏盐井神	16,600	157,202.00	0.40
3	600167	联美控股	24,800	139,376.00	0.35
4	601126	四方股份	8,200	133,414.00	0.34
5	000528	柳工	13,200	126,852.00	0.32
6	600299	安迪苏	13,000	125,450.00	0.32
7	601677	明泰铝业	10,000	124,200.00	0.31
8	688100	威胜信息	3,287	121,783.35	0.31
9	600312	平高电气	7,600	116,964.00	0.30
10	603187	海容冷链	9,900	116,424.00	0.29
11	601288	农业银行	19,100	112,308.00	0.28
12	601678	滨化股份	26,800	110,952.00	0.28
13	002479	富春环保	22,100	110,721.00	0.28
14	603387	基蛋生物	13,900	110,505.00	0.28
15	000902	新洋丰	7,900	109,257.00	0.28

16	002267	陕天然气	14,400	109,008.00	0.28
17	603566	普莱柯	8,000	108,880.00	0.27
18	300777	中简科技	3,000	108,750.00	0.27
19	002970	锐明技术	2,200	108,680.00	0.27
20	600900	长江电力	3,600	108,504.00	0.27
21	603103	横店影视	6,700	107,535.00	0.27
22	300662	科锐国际	3,600	106,956.00	0.27
23	603466	风语筑	10,600	106,954.00	0.27
24	002701	奥瑞金	17,900	106,505.00	0.27
25	002782	可立克	8,200	106,436.00	0.27
26	002001	新 和 成	5,000	106,350.00	0.27
27	301031	中熔电气	1,332	106,093.80	0.27
28	603170	宝立食品	8,500	105,995.00	0.27
29	605168	三人行	3,600	105,948.00	0.27
30	688526	科前生物	6,800	105,944.00	0.27
31	300788	中信出版	3,300	105,864.00	0.27
32	603297	永新光学	1,200	104,820.00	0.26
33	600073	光明肉业	14,100	104,058.00	0.26
34	002597	金禾实业	4,400	103,620.00	0.26
35	601208	东材科技	10,900	103,332.00	0.26
36	603989	艾华集团	6,700	103,180.00	0.26
37	300470	中密控股	2,800	102,956.00	0.26
38	300684	中石科技	4,300	102,684.00	0.26
39	603609	禾丰股份	12,400	102,424.00	0.26
40	600976	健民集团	2,600	101,946.00	0.26
41	600742	富维股份	10,700	101,757.00	0.26
42	000429	粤高速 A	7,600	101,308.00	0.26
43	600694	大商股份	5,430	100,726.50	0.25
44	601665	齐鲁银行	15,900	100,488.00	0.25
45	601528	瑞丰银行	17,300	100,167.00	0.25
46	600000	浦发银行	7,100	98,548.00	0.25

47	601311	骆驼股份	10,900	98,427.00	0.25
48	600919	江苏银行	8,200	97,908.00	0.25
49	600660	福耀玻璃	1,700	96,917.00	0.24
50	002807	江阴银行	20,300	96,425.00	0.24
51	600350	山东高速	9,000	95,940.00	0.24
52	002746	仙坛股份	16,400	95,448.00	0.24
53	603508	思维列控	3,600	95,328.00	0.24
54	601328	交通银行	11,800	94,400.00	0.24
55	600020	中原高速	19,700	94,166.00	0.24
56	601229	上海银行	8,700	92,307.00	0.23
57	600873	梅花生物	8,600	91,934.00	0.23
58	603235	天新药业	3,300	90,057.00	0.23
59	002833	弘亚数控	5,500	89,980.00	0.23
60	688330	宏力达	3,500	89,880.00	0.23
61	002745	木林森	11,400	89,832.00	0.23
62	300292	吴通控股	18,400	89,608.00	0.23
63	600123	兰花科创	13,700	89,324.00	0.23
64	300666	江丰电子	1,200	88,920.00	0.22
65	600718	东软集团	9,100	88,725.00	0.22
66	600125	铁龙物流	15,600	88,296.00	0.22
67	600035	楚天高速	20,400	86,496.00	0.22
68	000425	徐工机械	11,000	85,470.00	0.22
69	601169	北京银行	12,500	85,375.00	0.22
70	688059	华锐精密	1,810	84,635.60	0.21
71	000685	中山公用	9,600	84,288.00	0.21
72	002803	吉宏股份	5,900	84,134.00	0.21
73	002442	龙星科技	13,100	83,578.00	0.21
74	600582	天地科技	13,900	83,261.00	0.21
75	002170	芭田股份	8,100	83,025.00	0.21
76	000895	双汇发展	3,400	82,994.00	0.21
77	600377	宁沪高速	5,400	82,836.00	0.21

78	600036	招商银行	1,800	82,710.00	0.21
79	002011	盾安环境	7,100	82,360.00	0.21
80	603638	艾迪精密	4,700	82,203.00	0.21
81	601939	建设银行	8,700	82,128.00	0.21
82	601988	中国银行	14,600	82,052.00	0.21
83	000592	平潭发展	26,800	81,740.00	0.21
84	688095	福昕软件	1,200	81,492.00	0.21
85	600143	金发科技	7,900	81,449.00	0.21
86	600039	四川路桥	8,200	81,180.00	0.20
87	603216	梦天家居	6,400	81,024.00	0.20
88	603708	家家悦	7,900	80,580.00	0.20
89	002249	大洋电机	12,200	80,276.00	0.20
90	002303	美盈森	22,400	79,744.00	0.20
91	600096	云天化	3,600	79,092.00	0.20
92	300232	洲明科技	10,700	77,468.00	0.20
93	002948	青岛银行	15,500	77,190.00	0.19
94	000936	华西股份	11,100	76,368.00	0.19
95	603368	柳药集团	4,500	76,095.00	0.19
96	600163	中闽能源	14,800	75,776.00	0.19
97	600901	江苏金租	12,500	75,750.00	0.19
98	601107	四川成渝	12,500	75,250.00	0.19
99	600016	民生银行	15,600	74,100.00	0.19
100	688239	航宇科技	2,099	73,423.02	0.19
101	603601	再升科技	17,400	70,644.00	0.18
102	601398	工商银行	9,100	69,069.00	0.17
103	002616	长青集团	11,500	68,310.00	0.17
104	600054	黄山旅游	5,800	68,092.00	0.17
105	600025	华能水电	7,100	67,805.00	0.17
106	603379	三美股份	1,400	67,368.00	0.17
107	600998	九州通	13,100	67,334.00	0.17
108	300596	利安隆	2,300	66,171.00	0.17

109	603267	鸿远电子	1,300	65,351.00	0.16
110	300303	聚飞光电	10,300	65,302.00	0.16
111	002108	沧州明珠	15,600	60,216.00	0.15
112	600323	瀚蓝环境	2,400	58,440.00	0.15
113	000893	亚钾国际	1,900	57,266.00	0.14
114	600062	华润双鹤	3,000	55,980.00	0.14
115	688508	芯朋微	1,000	55,820.00	0.14
116	600795	国电电力	11,400	55,176.00	0.14
117	600491	龙元建设	14,900	54,832.00	0.14
118	603113	金能科技	7,900	54,747.00	0.14
119	600176	中国巨石	4,800	54,720.00	0.14
120	002221	东华能源	5,600	54,096.00	0.14
121	603678	火炬电子	1,400	53,242.00	0.13
122	600075	新疆天业	12,500	52,875.00	0.13
123	600496	精工钢构	16,100	51,520.00	0.13
124	600728	佳都科技	9,400	51,230.00	0.13
125	601609	金田股份	7,300	51,173.00	0.13
126	600273	嘉化能源	5,900	49,914.00	0.13
127	600956	新天绿能	6,400	49,408.00	0.12
128	600483	福能股份	5,100	49,164.00	0.12
129	601168	西部矿业	2,700	44,901.00	0.11
130	600012	皖通高速	2,600	44,148.00	0.11
131	688232	新点软件	1,400	42,056.00	0.11
132	002925	盈趣科技	2,300	41,354.00	0.10
133	300395	菲利华	800	40,880.00	0.10
134	601919	中远海控	2,700	40,608.00	0.10
135	688029	南微医学	600	40,530.00	0.10
136	600008	首创环保	13,400	40,468.00	0.10
137	603876	鼎胜新材	4,400	39,996.00	0.10
138	603808	歌力思	4,800	39,840.00	0.10
139	002245	蔚蓝锂芯	3,100	39,773.00	0.10

140	002777	久远银海	2,100	38,346.00	0.10
141	603225	新凤鸣	3,600	38,340.00	0.10
142	600487	亨通光电	2,500	38,250.00	0.10
143	002344	海宁皮城	8,800	38,192.00	0.10
144	002912	中新赛克	1,600	38,160.00	0.10
145	002242	九阳股份	4,000	38,000.00	0.10
146	000623	吉林敖东	2,200	37,290.00	0.09
147	600887	伊利股份	1,300	36,244.00	0.09
148	600499	科达制造	3,600	35,280.00	0.09
149	603816	顾家家居	1,300	33,176.00	0.08
150	688261	东微半导	800	33,000.00	0.08
151	688566	吉贝尔	1,200	32,628.00	0.08
152	605499	东鹏饮料	100	31,405.00	0.08
153	000423	东阿阿胶	600	31,380.00	0.08
154	600938	中国海油	1,200	31,332.00	0.08
155	000686	东北证券	4,100	31,283.00	0.08
156	603529	爱玛科技	900	30,960.00	0.08
157	603893	瑞芯微	200	30,372.00	0.08
158	002472	双环传动	900	30,141.00	0.08
159	601298	青岛港	3,400	29,546.00	0.07
160	688128	中国电研	1,200	29,400.00	0.07
161	688282	理工导航	600	28,584.00	0.07
162	000791	甘肃能源	4,400	28,072.00	0.07
163	002293	罗莱生活	3,200	27,968.00	0.07
164	000538	云南白药	500	27,895.00	0.07
165	603565	中谷物流	2,900	27,695.00	0.07
166	000833	粤桂股份	2,200	27,478.00	0.07
167	600662	外服控股	5,300	27,083.00	0.07
168	000651	格力电器	600	26,952.00	0.07
169	600926	杭州银行	1,600	26,912.00	0.07
170	600710	苏美达	2,800	26,908.00	0.07

171	600015	华夏银行	3,400	26,894.00	0.07
172	600704	物产中大	5,100	26,877.00	0.07
173	002032	苏泊尔	500	26,195.00	0.07
174	600528	中铁工业	3,500	25,830.00	0.07
175	300124	汇川技术	400	25,828.00	0.07
176	002950	奥美医疗	3,000	25,800.00	0.07
177	603236	移远通信	300	25,740.00	0.06
178	605507	国邦医药	1,300	25,701.00	0.06
179	300699	光威复材	800	25,336.00	0.06
180	603301	振德医疗	1,200	25,332.00	0.06
181	300750	宁德时代	100	25,222.00	0.06
182	600757	长江传媒	2,700	25,056.00	0.06
183	601098	中南传媒	1,900	24,928.00	0.06
184	600866	星湖科技	3,500	24,185.00	0.06
185	002884	凌霄泵业	1,500	23,910.00	0.06
186	600729	重庆百货	800	23,864.00	0.06
187	000858	五粮液	200	23,780.00	0.06
188	601728	中国电信	3,000	23,250.00	0.06
189	603053	成都燃气	2,400	23,064.00	0.06
190	601577	长沙银行	2,300	22,862.00	0.06
191	000568	泸州老窖	200	22,680.00	0.06
192	601766	中国中车	3,200	22,528.00	0.06
193	600941	中国移动	200	22,510.00	0.06
194	600098	广州发展	3,600	22,500.00	0.06
195	002142	宁波银行	800	21,888.00	0.06
196	600563	法拉电子	200	21,818.00	0.06
197	603129	春风动力	100	21,650.00	0.05
198	601857	中国石油	2,500	21,375.00	0.05
199	002027	分众传媒	2,900	21,170.00	0.05
200	603689	皖天然气	2,500	21,050.00	0.05
201	688268	华特气体	400	20,148.00	0.05

202	600690	海尔智家	800	19,824.00	0.05
203	601156	东航物流	1,500	19,635.00	0.05
204	002352	顺丰控股	400	19,504.00	0.05
205	600064	南京高科	2,500	19,275.00	0.05
206	002543	万和电气	1,700	18,887.00	0.05
207	000563	陕国投 A	5,200	18,564.00	0.05
208	000027	深圳能源	2,900	18,502.00	0.05
209	603098	森特股份	1,800	18,342.00	0.05
210	600713	南京医药	3,600	18,216.00	0.05
211	000828	东莞控股	1,700	18,173.00	0.05
212	601326	秦港股份	5,600	18,088.00	0.05
213	000921	海信家电	700	17,990.00	0.05
214	002385	大北农	4,400	17,776.00	0.04
215	600809	山西汾酒	100	17,639.00	0.04
216	002958	青农商行	4,800	17,328.00	0.04
217	600236	桂冠电力	2,700	16,929.00	0.04
218	601518	吉林高速	6,100	16,714.00	0.04
219	600033	福建高速	4,700	16,638.00	0.04
220	000598	兴蓉环境	2,300	16,583.00	0.04
221	600132	重庆啤酒	300	16,530.00	0.04
222	603408	建霖家居	1,500	16,455.00	0.04
223	601801	皖新传媒	2,300	15,709.00	0.04
224	600406	国电南瑞	700	15,687.00	0.04
225	601083	锦江航运	1,400	15,554.00	0.04
226	600057	厦门象屿	2,200	15,466.00	0.04
227	300627	华测导航	440	15,400.00	0.04
228	601963	重庆银行	1,400	15,204.00	0.04
229	002270	华明装备	900	15,066.00	0.04
230	600879	航天电子	1,400	14,658.00	0.04
231	600489	中金黄金	1,000	14,630.00	0.04
232	688789	宏华数科	200	14,608.00	0.04

232	603583	捷昌驱动	400	14,608.00	0.04
234	600909	华安证券	2,500	14,575.00	0.04
235	600681	百川能源	4,100	14,391.00	0.04
236	600160	巨化股份	500	14,340.00	0.04
237	600517	国网英大	2,800	14,280.00	0.04
238	603730	岱美股份	2,500	14,225.00	0.04
239	000915	华特达因	400	14,140.00	0.04
240	002637	赞宇科技	1,400	13,972.00	0.04
241	600398	海澜之家	2,000	13,920.00	0.04
242	688401	路维光电	400	13,880.00	0.04
243	601006	大秦铁路	2,100	13,860.00	0.03
244	600515	海南机场	3,900	13,806.00	0.03
245	002228	合兴包装	3,900	13,767.00	0.03
246	000157	中联重科	1,900	13,737.00	0.03
247	003006	百亚股份	500	13,690.00	0.03
248	601877	正泰电器	600	13,602.00	0.03
249	002683	广东宏大	400	13,576.00	0.03
250	600675	中华企业	4,700	13,536.00	0.03
250	600061	国投资本	1,800	13,536.00	0.03
252	600153	建发股份	1,300	13,481.00	0.03
253	300476	胜宏科技	100	13,438.00	0.03
254	688628	优利德	400	13,420.00	0.03
255	688133	泰坦科技	582	13,397.64	0.03
256	000885	城发环境	1,000	13,320.00	0.03
257	000596	古井贡酒	100	13,315.00	0.03
258	600338	西藏珠峰	1,200	13,308.00	0.03
259	600179	安通控股	4,800	13,248.00	0.03
260	300206	理邦仪器	1,100	13,222.00	0.03
261	300365	恒华科技	2,000	13,180.00	0.03
262	300831	派瑞股份	900	13,167.00	0.03
263	002478	常宝股份	2,500	13,125.00	0.03

264	600888	新疆众和	1,900	12,958.00	0.03
265	603230	内蒙新华	1,000	12,910.00	0.03
266	300017	网宿科技	1,200	12,864.00	0.03
267	600674	川投能源	800	12,832.00	0.03
268	300502	新易盛	100	12,702.00	0.03
269	002739	万达电影	1,100	12,573.00	0.03
270	002004	华邦健康	3,000	12,510.00	0.03
271	002758	浙农股份	1,400	12,502.00	0.03
272	600479	千金药业	1,200	12,480.00	0.03
273	002706	良信股份	1,400	12,474.00	0.03
274	002545	东方铁塔	1,400	12,446.00	0.03
275	300160	秀强股份	2,200	12,364.00	0.03
276	600007	中国国贸	600	12,348.00	0.03
277	600308	华泰股份	3,600	12,312.00	0.03
278	605296	神农集团	400	12,296.00	0.03
279	603889	新澳股份	2,100	12,180.00	0.03
280	600011	华能国际	1,700	12,138.00	0.03
281	300900	广联航空	500	12,135.00	0.03
282	600183	生益科技	400	12,060.00	0.03
283	603035	常熟汽饰	900	11,970.00	0.03
284	000737	北方铜业	1,100	11,946.00	0.03
285	689009	九号公司	200	11,834.00	0.03
286	688334	西高院	688	11,819.84	0.03
287	300879	大叶股份	300	11,784.00	0.03
288	601390	中国中铁	2,100	11,781.00	0.03
289	300193	佳士科技	1,300	11,765.00	0.03
290	002311	海大集团	200	11,718.00	0.03
291	603369	今世缘	300	11,679.00	0.03
292	600958	东方证券	1,200	11,616.00	0.03
293	600863	内蒙华电	2,800	11,508.00	0.03
294	002966	苏州银行	1,300	11,414.00	0.03

295	300866	安克创新	100	11,360.00	0.03
296	001696	宗申动力	500	11,225.00	0.03
297	601186	中国铁建	1,400	11,214.00	0.03
298	688257	新锐股份	760	11,134.00	0.03
299	600726	华电能源	4,700	10,998.00	0.03
300	601900	南方传媒	700	10,948.00	0.03
301	301498	乖宝宠物	100	10,937.00	0.03
302	603199	九华旅游	300	10,872.00	0.03
303	001965	招商公路	900	10,800.00	0.03
304	000726	鲁泰A	1,700	10,778.00	0.03
305	603337	杰克股份	300	10,764.00	0.03
306	601800	中国交建	1,200	10,668.00	0.03
307	601658	邮储银行	1,900	10,393.00	0.03
308	601668	中国建筑	1,800	10,386.00	0.03
309	002155	湖南黄金	580	10,353.00	0.03
310	688661	和林微纳	260	10,340.20	0.03
311	000987	越秀资本	1,500	10,290.00	0.03
312	600256	广汇能源	1,700	10,234.00	0.03
313	000878	云南铜业	800	10,176.00	0.03
314	002690	美亚光电	600	10,122.00	0.03
315	002441	众业达	1,100	9,977.00	0.03
316	000862	银星能源	1,800	9,846.00	0.02
317	605259	绿田机械	500	9,805.00	0.02
318	603939	益丰药房	400	9,788.00	0.02
319	002282	博深股份	1,300	9,711.00	0.02
320	002139	拓邦股份	700	9,667.00	0.02
321	000417	合百集团	1,700	9,622.00	0.02
322	000975	山金国际	500	9,470.00	0.02
323	002788	鹭燕医药	1,100	9,427.00	0.02
324	002318	久立特材	400	9,356.00	0.02
325	300573	兴齐眼药	180	9,322.20	0.02

326	601009	南京银行	800	9,296.00	0.02
327	600488	津药药业	2,200	9,174.00	0.02
328	301408	华人健康	600	9,126.00	0.02
329	600507	方大特钢	2,100	9,114.00	0.02
330	003816	中国广核	2,500	9,100.00	0.02
331	605277	新亚电子	500	8,980.00	0.02
332	600216	浙江医药	600	8,874.00	0.02
333	600219	南山铝业	2,300	8,809.00	0.02
334	002818	富森美	700	8,736.00	0.02
335	000553	安道麦A	1,200	8,664.00	0.02
336	600598	北大荒	600	8,652.00	0.02
337	002463	沪电股份	200	8,516.00	0.02
338	600351	亚宝药业	1,400	8,498.00	0.02
339	002454	松芝股份	1,100	8,492.00	0.02
340	600668	尖峰集团	600	8,490.00	0.02
341	002611	东方精工	700	8,442.00	0.02
342	002262	恩华药业	400	8,312.00	0.02
343	002953	日丰股份	800	8,304.00	0.02
344	600030	中信证券	300	8,286.00	0.02
345	603231	索宝蛋白	500	8,190.00	0.02
346	688035	德邦科技	200	8,124.00	0.02
347	600905	三峡能源	1,900	8,094.00	0.02
348	603296	华勤技术	100	8,068.00	0.02
349	603815	交建股份	1,100	8,041.00	0.02
350	002135	东南网架	1,900	8,018.00	0.02
351	002661	克明食品	800	8,008.00	0.02
352	002761	浙江建投	900	7,983.00	0.02
353	002050	三花智控	300	7,914.00	0.02
354	300019	硅宝科技	400	7,896.00	0.02
355	601369	陕鼓动力	900	7,893.00	0.02
356	600229	城市传媒	1,100	7,843.00	0.02

357	002244	滨江集团	800	7,800.00	0.02
358	603987	康德莱	1,000	7,700.00	0.02
359	601566	九牧王	900	7,686.00	0.02
360	605376	博迁新材	200	7,666.00	0.02
361	000415	渤海租赁	2,300	7,659.00	0.02
362	688179	阿拉丁	600	7,632.00	0.02
363	000880	潍柴重机	200	7,564.00	0.02
364	002876	三利谱	300	7,557.00	0.02
365	603203	快克智能	300	7,461.00	0.02
366	605118	力鼎光电	300	7,449.00	0.02
367	002905	金逸影视	800	7,424.00	0.02
368	002083	孚日股份	1,500	7,245.00	0.02
369	000333	美的集团	100	7,220.00	0.02
370	000999	华润三九	230	7,194.40	0.02
371	600218	全柴动力	800	7,176.00	0.02
372	002130	沃尔核材	300	7,146.00	0.02
373	002223	鱼跃医疗	200	7,120.00	0.02
374	601600	中国铝业	1,000	7,040.00	0.02
375	002340	格林美	1,100	6,985.00	0.02
376	600819	耀皮玻璃	1,200	6,984.00	0.02
377	603589	口子窖	200	6,960.00	0.02
378	600305	恒顺醋业	900	6,957.00	0.02
379	603259	药明康德	100	6,955.00	0.02
380	600600	青岛啤酒	100	6,946.00	0.02
381	300241	瑞丰光电	1,200	6,840.00	0.02
382	300641	正丹股份	300	6,837.00	0.02
383	600285	羚锐制药	300	6,801.00	0.02
384	300492	华图山鼎	100	6,788.00	0.02
385	003025	思进智能	500	6,770.00	0.02
386	301196	唯科科技	100	6,767.00	0.02
387	002029	七匹狼	1,000	6,740.00	0.02

388	002078	太阳纸业	500	6,730.00	0.02
389	000776	广发证券	400	6,724.00	0.02
390	002852	道道全	700	6,692.00	0.02
391	001378	德冠新材	300	6,651.00	0.02
392	601717	中创智领	400	6,648.00	0.02
393	002695	煌上煌	700	6,580.00	0.02
394	600780	通宝能源	1,100	6,523.00	0.02
395	603527	众源新材	600	6,522.00	0.02
396	600166	福田汽车	2,400	6,504.00	0.02
397	600173	卧龙新能	1,100	6,468.00	0.02
398	002304	洋河股份	100	6,455.00	0.02
399	600050	中国联通	1,200	6,408.00	0.02
400	603766	隆鑫通用	500	6,380.00	0.02
401	300346	南大光电	200	6,328.00	0.02
402	600928	西安银行	1,600	6,272.00	0.02
403	600459	贵研铂业	400	6,204.00	0.02
404	002588	史丹利	700	6,167.00	0.02
405	600490	鹏欣资源	1,400	6,146.00	0.02
406	688625	呈和科技	200	6,116.00	0.02
407	601319	中国人保	700	6,097.00	0.02
408	300251	光线传媒	300	6,081.00	0.02
409	003010	若羽臣	100	6,060.00	0.02
410	002825	纳尔股份	600	5,988.00	0.02
411	603759	海天股份	700	5,943.00	0.02
412	002595	豪迈科技	100	5,922.00	0.01
413	601128	常熟银行	800	5,896.00	0.01
414	000708	中信特钢	500	5,880.00	0.01
415	601336	新华保险	100	5,850.00	0.01
416	603486	科沃斯	100	5,823.00	0.01
417	000570	苏常柴 A	1,000	5,790.00	0.01
418	300910	瑞丰新材	100	5,775.00	0.01

419	601218	吉鑫科技	1,400	5,754.00	0.01
420	601211	国泰海通	300	5,748.00	0.01
421	688186	广大特材	200	5,722.00	0.01
422	002299	圣农发展	400	5,716.00	0.01
423	688410	山外山	400	5,680.00	0.01
424	002864	盘龙药业	200	5,654.00	0.01
425	002138	顺络电子	200	5,624.00	0.01
426	600389	江山股份	300	5,580.00	0.01
427	688501	青达环保	200	5,570.00	0.01
428	601318	中国平安	100	5,548.00	0.01
429	603811	诚意药业	600	5,538.00	0.01
430	603612	索通发展	300	5,514.00	0.01
431	300182	捷成股份	1,000	5,510.00	0.01
432	603919	金徽酒	300	5,430.00	0.01
432	300724	捷佳伟创	100	5,430.00	0.01
434	301109	军信股份	360	5,356.80	0.01
435	000688	国城矿业	400	5,324.00	0.01
436	000786	北新建材	200	5,296.00	0.01
437	603596	伯特利	100	5,269.00	0.01
438	600276	恒瑞医药	100	5,190.00	0.01
439	603606	东方电缆	100	5,171.00	0.01
440	002215	诺普信	500	5,165.00	0.01
441	601881	中国银河	300	5,145.00	0.01
442	605337	李子园	400	5,120.00	0.01
443	601998	中信银行	600	5,100.00	0.01
444	000705	浙江震元	600	5,070.00	0.01
445	002102	能特科技	1,600	5,056.00	0.01
446	002034	旺能环境	300	5,037.00	0.01
447	300990	同飞股份	100	4,990.00	0.01
448	000514	渝开发	1,100	4,983.00	0.01
449	000042	中洲控股	700	4,977.00	0.01

450	600612	老凤祥	100	4,975.00	0.01
451	600354	敦煌种业	800	4,952.00	0.01
452	688150	莱特光电	200	4,944.00	0.01
453	301289	国缆检测	100	4,880.00	0.01
454	001301	尚太科技	100	4,876.00	0.01
455	603858	步长制药	300	4,872.00	0.01
456	600292	远达环保	400	4,824.00	0.01
457	301338	凯格精机	100	4,771.00	0.01
458	605016	百龙创园	230	4,744.90	0.01
459	600362	江西铜业	200	4,686.00	0.01
460	002849	威星智能	300	4,680.00	0.01
461	600531	豫光金铅	600	4,644.00	0.01
461	002959	小熊电器	100	4,644.00	0.01
463	603166	福达股份	300	4,641.00	0.01
464	002863	今飞凯达	900	4,563.00	0.01
465	600262	北方股份	200	4,560.00	0.01
466	001223	欧克科技	100	4,494.00	0.01
467	301220	亚香股份	100	4,490.00	0.01
468	601567	三星医疗	200	4,484.00	0.01
469	600961	株冶集团	400	4,472.00	0.01
470	601928	凤凰传媒	400	4,468.00	0.01
471	601555	东吴证券	500	4,375.00	0.01
472	002003	伟星股份	400	4,364.00	0.01
473	601138	工业富联	200	4,276.00	0.01
474	002885	京泉华	300	4,245.00	0.01
475	600639	浦东金桥	400	4,236.00	0.01
476	603983	丸美生物	100	4,213.00	0.01
477	000521	长虹美菱	600	4,164.00	0.01
478	001216	华瓷股份	300	4,050.00	0.01
479	601018	宁波港	1,100	4,026.00	0.01
480	601838	成都银行	200	4,020.00	0.01

481	605009	豪悦护理	100	3,978.00	0.01
482	600028	中国石化	700	3,948.00	0.01
483	603288	海天味业	100	3,891.00	0.01
484	600461	洪城环境	400	3,856.00	0.01
485	000551	创元科技	300	3,855.00	0.01
486	301509	金凯生科	100	3,779.00	0.01
487	601601	中国太保	100	3,751.00	0.01
488	300967	晓鸣股份	200	3,700.00	0.01
489	601001	晋控煤业	300	3,666.00	0.01
490	603586	金麒麟	200	3,664.00	0.01
491	002489	浙江永强	1,000	3,660.00	0.01
492	301376	致欧科技	200	3,650.00	0.01
493	603519	立霸股份	300	3,648.00	0.01
494	000513	丽珠集团	100	3,604.00	0.01
495	601077	渝农商行	500	3,570.00	0.01
496	603173	福斯达	100	3,555.00	0.01
497	301119	正强股份	100	3,536.00	0.01
498	600699	均胜电子	200	3,488.00	0.01
499	300622	博士眼镜	100	3,477.00	0.01
500	002763	汇洁股份	500	3,450.00	0.01
501	002107	沃华医药	600	3,432.00	0.01
502	002286	保龄宝	300	3,399.00	0.01
503	601827	三峰环境	400	3,360.00	0.01
504	301223	中荣股份	200	3,306.00	0.01
505	605599	菜百股份	200	3,270.00	0.01
506	002727	一心堂	200	3,268.00	0.01
507	688425	铁建重工	800	3,264.00	0.01
508	000795	英洛华	300	3,258.00	0.01
509	600105	永鼎股份	400	3,236.00	0.01
510	002466	天齐锂业	100	3,204.00	0.01
511	600547	山东黄金	100	3,193.00	0.01

512	600512	腾达建设	1,400	3,164.00	0.01
513	002290	禾盛新材	100	3,125.00	0.01
514	600337	美克家居	1,400	3,094.00	0.01
515	603920	世运电路	100	3,051.00	0.01
516	300908	仲景食品	100	3,011.00	0.01
517	603101	汇嘉时代	400	3,000.00	0.01
517	001227	兰州银行	1,200	3,000.00	0.01
519	002455	百川股份	400	2,992.00	0.01
520	301106	骏成科技	100	2,980.00	0.01
521	603938	三孚股份	200	2,876.00	0.01
522	300054	鼎龙股份	100	2,868.00	0.01
523	600987	航民股份	400	2,828.00	0.01
524	605080	浙江自然	100	2,780.00	0.01
525	603380	易德龙	100	2,660.00	0.01
526	603351	威尔药业	100	2,648.00	0.01
527	603697	有友食品	200	2,638.00	0.01
528	603950	长源东谷	100	2,503.00	0.01
529	301286	侨源股份	100	2,499.00	0.01
530	603665	康隆达	100	2,478.00	0.01
531	300893	松原安全	100	2,452.00	0.01
532	300824	北鼎股份	200	2,386.00	0.01
533	603948	建业股份	100	2,385.00	0.01
534	300748	金力永磁	100	2,384.00	0.01
535	600502	安徽建工	500	2,350.00	0.01
536	600268	国电南自	300	2,346.00	0.01
537	002402	和而泰	100	2,317.00	0.01
538	002736	国信证券	200	2,304.00	0.01
539	002491	通鼎互联	400	2,272.00	0.01
540	300484	蓝海华腾	100	2,237.00	0.01
541	003020	立方制药	100	2,232.00	0.01
542	601991	大唐发电	700	2,219.00	0.01

543	600750	江中药业	100	2,183.00	0.01
544	300685	艾德生物	100	2,153.00	0.01
545	002553	南方精工	100	2,148.00	0.01
546	601003	柳钢股份	600	2,112.00	0.01
547	600548	深高速	200	2,094.00	0.01
548	600475	华光环能	200	2,084.00	0.01
549	000550	江铃汽车	100	2,033.00	0.01
550	300207	欣旺达	100	2,006.00	0.01
551	002043	兔宝宝	200	1,960.00	0.00
552	300119	瑞普生物	100	1,942.00	0.00
553	002517	恺英网络	100	1,931.00	0.00
554	002357	富临运业	200	1,850.00	0.00
555	002048	宁波华翔	100	1,841.00	0.00
556	603365	水星家纺	100	1,836.00	0.00
557	603500	祥和实业	200	1,832.00	0.00
558	600266	城建发展	400	1,816.00	0.00
559	600755	厦门国贸	300	1,815.00	0.00
560	600031	三一重工	100	1,795.00	0.00
561	600874	创业环保	300	1,791.00	0.00
562	603079	圣达生物	100	1,715.00	0.00
563	600875	东方电气	100	1,674.00	0.00
564	600821	金开新能	300	1,629.00	0.00
565	603067	振华股份	100	1,524.00	0.00
566	600197	伊力特	100	1,492.00	0.00
567	600731	湖南海利	200	1,458.00	0.00
568	603639	海利尔	100	1,405.00	0.00
569	000600	建投能源	200	1,382.00	0.00
570	601038	一拖股份	100	1,307.00	0.00
571	603309	维力医疗	100	1,272.00	0.00
572	601997	贵阳银行	200	1,248.00	0.00
573	603618	杭电股份	200	1,220.00	0.00

574	600858	银座股份	200	1,198.00	0.00
575	002204	大连重工	200	1,194.00	0.00
576	600635	大众公用	300	1,170.00	0.00
577	600467	好当家	500	1,155.00	0.00
578	001299	美能能源	100	1,124.00	0.00
579	002258	利尔化学	100	1,104.00	0.00
580	603798	康普顿	100	1,088.00	0.00
581	002893	京能热力	100	1,069.00	0.00
582	002533	金杯电工	100	974.00	0.00
583	601061	中信金属	100	791.00	0.00
584	600210	紫江企业	100	683.00	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	600519	贵州茅台	741,965.00	1.29
2	601311	骆驼股份	556,431.00	0.96
3	688239	航宇科技	534,464.00	0.93
4	000528	柳 工	529,442.00	0.92
5	688100	威胜信息	498,591.82	0.86
6	600901	江苏金租	463,319.00	0.80
7	002206	海 利 得	461,391.00	0.80
8	601398	工商银行	460,677.00	0.80
9	300662	科锐国际	455,607.00	0.79
10	605123	派克新材	454,449.00	0.79
11	002367	康力电梯	452,386.00	0.78
12	300770	新媒股份	441,714.00	0.77
13	000895	双汇发展	439,223.00	0.76

14	600435	北方导航	434,017.00	0.75
15	000725	京东方 A	431,672.00	0.75
16	300292	吴通控股	425,898.00	0.74
17	002468	申通快递	422,770.00	0.73
18	002088	鲁阳节能	418,243.00	0.72
19	600312	平高电气	416,952.00	0.72
20	601766	中国中车	415,463.00	0.72

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	600519	贵州茅台	745,816.00	1.29
2	601311	骆驼股份	626,108.00	1.08
3	688239	航宇科技	608,554.32	1.05
4	600219	南山铝业	591,415.00	1.02
5	000528	柳 工	551,176.00	0.95
6	600901	江苏金租	523,575.00	0.91
7	601398	工商银行	516,080.00	0.89
8	000885	城发环境	514,735.00	0.89
9	605123	派克新材	512,942.00	0.89
10	002088	鲁阳节能	503,016.00	0.87
11	300770	新媒股份	499,242.00	0.86
12	600496	精工钢构	489,704.00	0.85
13	000725	京东方 A	484,418.00	0.84
14	601528	瑞丰银行	482,286.70	0.84
15	688100	威胜信息	479,158.35	0.83
16	002001	新 和 成	474,731.00	0.82

17	000672	上峰水泥	468,860.60	0.81
18	300502	新易盛	466,196.00	0.81
19	601222	林洋能源	463,482.00	0.80
20	002367	康力电梯	458,961.00	0.79

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	131,735,800.63
卖出股票收入（成交）总额	142,184,409.43

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	8,425,917.26	21.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,892,192.33	35.07
	其中：政策性金融债	13,892,192.33	35.07
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	22,318,109.59	56.34

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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例(%)
1	250205	25国开05	140,000	13,892,192.33	35.07
2	019749	24国债15	30,000	3,038,117.26	7.67
3	019742	24特国01	20,000	2,284,514.52	5.77
4	019751	24国债16	20,000	2,037,605.48	5.14
5	019756	24特国06	10,000	1,065,680.00	2.69

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，并充分考虑国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等因素，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期内按照相关法律法规的规定，以审慎的态度进行国债期货投资，在一定程度上对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

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12月27日，国家金融监督管理总局北京监管局公示京金罚决字〔2024〕43号行政处罚决定书，给予国家开发银行罚款60万元的行政处罚。

2024年8月2日，辽宁证监局公示〔2024〕13号行政监管措施决定书，对联美量子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	30,019.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,019.98

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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,238	16,409.85	0.00	0.00%	36,725,251.52	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	389,488.50	1.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年12月24日)基金份额总额	575,454,761.54
本报告期期初基金份额总额	55,008,607.67
本报告期基金总申购份额	338,598.24
减：本报告期基金总赎回份额	18,621,954.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,725,251.52

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：2025年1月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

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容诚会计师事务所(特殊普通合伙)。容诚会计师事务所(特殊普通合伙)自2024年12月19日起为本基金提供审计服务。

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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
兴业证券	2	273,920,210.06	100.00%	119,606.76	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	23,529,103.40	100.00%	625,882,000.00	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
2	博道盛利6个月持有期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
3	博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金（更新）招募说明书（2025年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-28
4	博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-28
5	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
6	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
7	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
8	博道盛利6个月持有期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
9	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
10	博道盛利6个月持有期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
11	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	2025-05-15

		网站、中国证监会基金电子披露网站	
12	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 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道盛利6个月持有期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、报告期内博道盛利6个月持有期混合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