

博道沪深 300 指数增强型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
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	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
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	65
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	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 备查文件目录.....	72
11.1 备查文件目录.....	72
11.2 存放地点.....	72
11.3 查阅方式.....	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	博道沪深300增强	
基金主代码	007044	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年04月26日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,277,153,748.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道沪深300增强A	博道沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	007044	007045
报告期末下属分级基金的份额总额	712,204,903.31份	564,948,845.42份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金以沪深300指数为标的指数，通过量化选股模型构建股票组合，从满足一定基本面要求的备选股票池中，综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合，然后利用投资组合优化工具，在控制跟踪偏离过大风险的同时，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。股票组合构建完成后，本基金管理人将对组合运作绩效持续跟踪，根据市场的变化及时调整投资组合。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、融资

	及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	张姗
	联系电话	021-80226288	400-61-95555
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-085-2888	400-61-95555
传真		021-80226289	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040
法定代表人		莫泰山	缪建民

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)	
	博道沪深300增强A	博道沪深300增强C
本期已实现收益	33,276,997.02	27,984,724.10
本期利润	42,135,006.58	37,658,220.83
加权平均基金份额本期利润	0.0712	0.0663
本期加权平均净值利润率	4.92%	4.70%
本期基金份额净值增长率	4.20%	4.00%
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	306,198,097.49	222,495,603.42
期末可供分配基金份额利润	0.4299	0.3938
期末基金资产净值	1,076,868,030.24	833,409,882.17
期末基金份额净值	1.5120	1.4752
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	51.20%	47.52%

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

博道沪深300增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.70%	0.60%	2.37%	0.55%	1.33%	0.05%
过去三个月	4.25%	1.16%	1.21%	1.04%	3.04%	0.12%
过去六个月	4.20%	1.00%	0.07%	0.97%	4.13%	0.03%
过去一年	18.50%	1.24%	13.12%	1.32%	5.38%	-0.08%
过去三年	1.28%	1.01%	-11.43%	1.05%	12.71%	-0.04%
自基金合同生效起至今	51.20%	1.12%	0.49%	1.14%	50.71%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道沪深300增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.67%	0.60%	2.37%	0.55%	1.30%	0.05%
过去三个月	4.15%	1.16%	1.21%	1.04%	2.94%	0.12%
过去六个月	4.00%	1.00%	0.07%	0.97%	3.93%	0.03%
过去一年	18.03%	1.24%	13.12%	1.32%	4.91%	-0.08%
过去三年	0.07%	1.01%	-11.43%	1.05%	11.50%	-0.04%
自基金合同生效起至今	47.52%	1.12%	0.49%	1.14%	47.03%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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

博道沪深300增强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04月26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。

博道沪深300增强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04月26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		
杨梦	博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道大盘	2019-04-26	-	14年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017

	成长股票、博道大盘价值股票、博道沪深300指数量化增强、博道中证A500指数增强、博道中证800指数增强、博道上证科创板综合指数增强的基金经理、量化投资总监兼量化投资部总经理				年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司。具有基金从业资格。
--	---	--	--	--	--

注：

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，本基金维持配置沪深300多因子选股增强模型。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金将继续坚持系统化投资的运作思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：博道沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	55,042,057.13	31,963,394.40
结算备付金		8,641.88	8,607.69
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,878,704,264.16	1,473,590,561.04
其中：股票投资		1,780,032,971.64	1,395,542,972.63
基金投资		-	-
债券投资		98,671,292.52	78,047,588.41
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		6,562,117.67	1,790,131.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,940,317,080.84	1,507,352,694.55
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		-	4,999,671.23
应付清算款		-	-
应付赎回款		28,229,723.61	37,555,304.19
应付管理人报酬		1,169,858.11	989,280.94
应付托管费		155,981.09	131,904.13
应付销售服务费		276,536.04	310,281.09
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	207,069.58	247,009.16
负债合计		30,039,168.43	44,233,450.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,277,153,748.73	1,020,776,861.36
未分配利润	6.4.7.8	633,124,163.68	442,342,382.45
净资产合计		1,910,277,912.41	1,463,119,243.81
负债和净资产总计		1,940,317,080.84	1,507,352,694.55

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：博道沪深300指数增强型证券投资基金

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		88,502,206.51	34,113,562.57

1.利息收入		18,574.46	51,854.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,574.28	51,854.41
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		0.18	0.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		69,448,039.17	43,770,766.17
其中：股票投资收益	6.4.7.10	45,324,515.07	33,880,741.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	518,816.00	336,389.37
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	23,604,708.10	9,553,634.87
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	18,531,506.29	-10,028,903.51
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	504,086.59	319,845.12
减：二、营业总支出		8,708,979.10	3,569,402.87
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	6,141,469.78	2,519,272.58
2.托管费	6.4.10.2.2	818,862.65	335,903.03
3.销售服务费		1,589,472.57	500,168.56
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		19,860.25	32,050.14

其中：卖出回购金融资产支出		19,860.25	32,050.14
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.10	-
8.其他费用	6.4.7.17	139,313.75	182,008.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,793,227.41	30,544,159.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,793,227.41	30,544,159.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,793,227.41	30,544,159.70

6.3 净资产变动表

会计主体：博道沪深300指数增强型证券投资基金

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	1,020,776,861.36	442,342,382.45	1,463,119,243.81
二、本期期初净资产	1,020,776,861.36	442,342,382.45	1,463,119,243.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	256,376,887.37	190,781,781.23	447,158,668.60
（一）、综合收益总额	-	79,793,227.41	79,793,227.41
（二）、本期基金份额交易产生的净	256,376,887.37	110,988,553.82	367,365,441.19

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	728,312,712.17	312,949,141.17	1,041,261,853.34
2.基金赎回款	-471,935,824.80	-201,960,587.35	-673,896,412.15
（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	1,277,153,748.73	633,124,163.68	1,910,277,912.41
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	439,600,647.63	92,041,121.77	531,641,769.40
二、本期期初净资产	439,600,647.63	92,041,121.77	531,641,769.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	310,168,231.01	105,942,147.98	416,110,378.99
（一）、综合收益总额	-	30,544,159.70	30,544,159.70
（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）	310,168,231.01	75,397,988.28	385,566,219.29
其中：1.基金申购款	522,055,747.48	123,819,319.20	645,875,066.68
2.基金赎回款	-211,887,516.47	-48,421,330.92	-260,308,847.39

（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	749,768,878.64	197,983,269.75	947,752,148.39

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

博道沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]133号《关于准予博道沪深300指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币550,014,639.37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0252号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》于2019年4月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为550,219,646.51份基金份额，其中认购资金利息折合205,007.14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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《博道沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和《博道沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/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《博道沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年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	2,242,866.72
等于：本金	2,242,655.43
加：应计利息	211.29
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	52,799,190.41
等于：本金	52,798,518.04
加：应计利息	672.37
减：坏账准备	-
合计	55,042,057.13

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		1,722,397,602.89	-	1,780,032,971.64	57,635,368.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	97,969,334.17	713,592.52	98,671,292.52	-11,634.17
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	97,969,334.17	713,592.52	98,671,292.52	-11,634.17
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,820,366,937.06	713,592.52	1,878,704,264.16	57,623,734.58

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	5,953.16
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	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	420.00
应付指数使用费	116,393.86
合计	207,069.58

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道沪深300增强A

金额单位：人民币元

项目 (博道沪深300增强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	465,008,426.49	465,008,426.49
本期申购	353,111,355.14	353,111,355.14
本期赎回（以“-”号填列）	-105,914,878.32	-105,914,878.32
本期末	712,204,903.31	712,204,903.31

6.4.7.7.2 博道沪深300增强C

金额单位：人民币元

项目 (博道沪深300增强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	555,768,434.87	555,768,434.87

本期申购	375,201,357.03	375,201,357.03
本期赎回（以“-”号填列）	-366,020,946.48	-366,020,946.48
本期末	564,948,845.42	564,948,845.42

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 博道沪深300增强A

单位：人民币元

项目 (博道沪深300增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	175,194,344.55	34,549,469.51	209,743,814.06
本期期初	175,194,344.55	34,549,469.51	209,743,814.06
本期利润	33,276,997.02	8,858,009.56	42,135,006.58
本期基金份额交易产生的变动数	97,726,755.92	15,057,550.37	112,784,306.29
其中：基金申购款	138,800,315.11	20,762,900.21	159,563,215.32
基金赎回款	-41,073,559.19	-5,705,349.84	-46,778,909.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	306,198,097.49	58,465,029.44	364,663,126.93

6.4.7.8.2 博道沪深300增强C

单位：人民币元

项目 (博道沪深300增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	191,584,372.56	41,014,195.83	232,598,568.39
本期期初	191,584,372.56	41,014,195.83	232,598,568.39
本期利润	27,984,724.10	9,673,496.73	37,658,220.83
本期基金份额交易产生的变动数	2,926,506.76	-4,722,259.23	-1,795,752.47
其中：基金申购款	134,993,903.11	18,392,022.74	153,385,925.85

基金赎回款	-132,067,396.35	-23,114,281.97	-155,181,678.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	222,495,603.42	45,965,433.33	268,461,036.75

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		4,244.14
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		12,223.32
结算备付金利息收入		34.19
其他		2,072.63
合计		18,574.28

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		4,835,896,938.11
减：卖出股票成本总额		4,785,557,988.65
减：交易费用		5,014,434.39
买卖股票差价收入		45,324,515.07

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		589,815.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-70,999.06

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	518,816.00

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	68,540,761.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	67,520,624.67
减：应计利息总额	1,091,030.48
减：交易费用	105.48
买卖债券差价收入	-70,999.06

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	23,604,708.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,604,708.10

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	18,531,506.29
——股票投资	18,559,058.67
——债券投资	-27,552.38
——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	18,531,506.29

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	455,763.23
转换费收入	48,323.36
合计	504,086.59

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	3,753.05
指数使用费	51,258.14
合计	139,313.75

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币50,000元。自2025年3月21日起，本基金指数使用费调整为由基金管理人承担。

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
招商银行股份有限公司	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	6,141,469.78	2,519,272.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,407,470.73	492,469.81
应支付基金管理人的净管理费	4,733,999.05	2,026,802.77

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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×0.75%/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	818,862.65	335,903.03
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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		
	博道沪深300增强A	博道沪深300增强C	合计
博道基金管理有限公司	0.00	592,264.90	592,264.90
招商银行股份有限公司	0.00	11,334.93	11,334.93
合计	0.00	603,599.83	603,599.83
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		
	博道沪深300增强A	博道沪深300增强C	合计
博道基金管理有限公司	0.00	233,498.80	233,498.80
招商银行股份有限公司	0.00	7,832.41	7,832.41
合计	0.00	241,331.21	241,331.21

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

博道沪深300增强C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	700,051.38	1,000,051.38
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	700,051.38	1,000,051.38
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.12%	0.29%

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；
- 4、报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金A类份额。

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0~10万份。（上年度末，除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。）

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
招商银行 股份有限 公司	2,242,866.72	4,244.14	4,006,505.81	5,731.67

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

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	-

				售						
301458	钧崑电子	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	-
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	-
603202	天有为	2025-04-16	6个月以上	主板打新限售	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
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	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6个月以上	创业板打新限售	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6个月以上	科创板打新限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通	2025-06-2	1个月内	新股	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-

	电子	4	(含)	未上市						
688758	赛分科技	2025-01-02	6个月以上	科创板打新限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月以上	主板打新限售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6个月以上	创业板打新限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6个月以上	创业板打新限售	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
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	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6个月以上	主板打新限售	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6个月以上	创业板打新限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
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	-
301658	首航	2025-03-2	6个月以	创业	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-

	新能	6	上	板打 新限售							
3016 65	泰禾 股份	2025 -04-0 2	6个月以 上	创业 板打 新限售	10.27	22.39	393	4,03 6.11	8,79 9.27	-	
6887 55	汉邦 科技	2025 -05-0 9	6个月以 上	科创 板打 新限售	22.77	39.33	203	4,62 2.31	7,98 3.99	-	
3011 73	毓恬 冠佳	2025 -02-2 4	6个月以 上	创业 板打 新限售	28.33	44.98	173	4,90 1.09	7,78 1.54	-	
0013 82	新亚 电缆	2025 -03-1 3	6个月以 上	主板 打新 限售	7.40	20.21	366	2,70 8.40	7,39 6.86	-	
6030 14	威高 血净	2025 -05-1 2	6个月以 上	主板 打新 限售	26.50	32.68	205	5,43 2.50	6,69 9.40	-	
3016 36	泽润 新能	2025 -04-3 0	6个月以 上	创业 板打 新限售	33.06	47.46	128	4,23 1.68	6,07 4.88	-	
3015 95	太力 科技	2025 -05-1 2	6个月以 上	创业 板打 新限售	17.05	29.10	196	3,34 1.80	5,70 3.60	-	
3015 60	众捷 汽车	2025 -04-1 7	6个月以 上	创业 板打 新限售	16.50	27.45	190	3,13 5.00	5,21 5.50	-	

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	-
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	-
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	-
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	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	77.87	52	-	4,049.24	-
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	2025-06-3	重大	38.05	2025-07-11	39.98	90,051	2,768,823.05	3,426,440.55	-

	光 子	0	事 项							
--	--------	---	--------	--	--	--	--	--	--	--

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招商银行，其他存款存放于东方证券股份有限公司，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：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同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。

6.4.13.1 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上市公司发行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0.21%。

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1,908,153,053.48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	55,042,057.13	-	-	-	-	-	55,042,057.13
结算备付金	8,641.88	-	-	-	-	-	8,641.88
交易性	10,734,680.99	2,344,089.42	85,592,522.11	-	-	1,780,032,971.64	1,878,704,264.16

金融资产							
应收申购款	-	-	-	-	-	6,562,117.67	6,562,117.67
资产总计	65,785,380.00	2,344,089.42	85,592,522.11	-	-	1,786,595,089.31	1,940,317,080.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	28,229,723.61	28,229,723.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,169,858.11	1,169,858.11
应付托管费	-	-	-	-	-	155,981.09	155,981.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	276,536.04	276,536.04
其他负债	-	-	-	-	-	207,069.58	207,069.58
负债总计	-	-	-	-	-	30,039,168.43	30,039,168.43
利率敏感度缺口	65,785,380.00	2,344,089.42	85,592,522.11	-	-	1,756,555,920.88	1,910,277,912.41
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	31,963,394.40	-	-	-	-	-	31,963,394.40
结算备付金	8,607.69	-	-	-	-	-	8,607.69
交易性金融资产	17,834,446.58	1,021,500.00	59,191,641.83	-	-	1,395,542,972.63	1,473,590,561.04
应收申购款	-	-	-	-	-	1,790,131.42	1,790,131.42
资产总计	49,806,448.67	1,021,500.00	59,191,641.83	-	-	1,397,333,104.05	1,507,352,694.55
负债							

卖出回购金融资产款	4,999,671.23	-	-	-	-	-	4,999,671.23
应付赎回款	-	-	-	-	-	37,555,304.19	37,555,304.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	989,280.94	989,280.94
应付托管费	-	-	-	-	-	131,904.13	131,904.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	310,281.09	310,281.09
其他负债	-	-	-	-	-	247,009.16	247,009.16
负债总计	4,999,671.23	-	-	-	-	39,233,779.51	44,233,450.74
利率敏感度缺口	44,806,777.44	1,021,500.00	59,191,641.83	-	-	1,358,099,324.54	1,463,119,243.81

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5.17% (2024年12月31日：5.33%)，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。

本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产总值的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于

非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日		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	1,780,032,971.64	93.18	1,395,542,972.63	95.38
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	1,780,032,971.64	93.18	1,395,542,972.63	95.38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末	上年度末

		2025年06月30日	2024年12月31日
	1.沪深300指数收益率上升5%	92,679,086.13	64,323,024.84
	2.沪深300指数收益率下降5%	-92,679,086.13	-64,323,024.84

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	1,776,105,506.61	1,394,909,451.27
第二层次	102,113,118.61	78,075,324.91
第三层次	485,638.94	605,784.86
合计	1,878,704,264.16	1,473,590,561.04

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	1,780,032,971.64	91.74
	其中：股票	1,780,032,971.64	91.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	98,671,292.52	5.09
	其中：债券	98,671,292.52	5.09
	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	55,050,699.01	2.84
8	其他各项资产	6,562,117.67	0.34
9	合计	1,940,317,080.84	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	23,563,549.56	1.23
B	采矿业	80,657,457.72	4.22
C	制造业	713,293,571.53	37.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,087,745.00	4.14
E	建筑业	24,833,412.00	1.30
F	批发和零售业	496,976.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	59,975,609.78	3.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	51,146,594.76	2.68
J	金融业	497,237,792.39	26.03
K	房地产业	736,749.00	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,941,080.00	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,462,688.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,557,433,225.74	81.53

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,910,971.00	0.20

C	制造业	176,266,634.70	9.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,904,365.00	0.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,344,714.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	3,047,954.00	0.16
H	住宿和餐饮业	190,740.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,837,863.00	0.36
J	金融业	13,719,757.00	0.72
K	房地产业	752,266.00	0.04
L	租赁和商务服务业	729,535.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	398,003.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	2,469,540.00	0.13
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	3,834,345.00	0.20
S	综合	193,058.00	0.01
	合计	222,599,745.90	11.65

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	64,245	90,554,612.40	4.74
2	300750	宁德时代	295,491	74,528,740.02	3.90
3	601318	中国平安	814,837	45,207,156.76	2.37
4	601398	工商银行	5,254,100	39,878,619.00	2.09
5	600900	长江电力	1,300,400	39,194,056.00	2.05
6	600030	中信证券	1,406,065	38,835,515.30	2.03
7	601288	农业银行	6,554,400	38,539,872.00	2.02
8	002594	比亚迪	106,929	35,490,804.39	1.86
9	000858	五粮液	294,537	35,020,449.30	1.83
10	000651	格力电器	730,000	32,791,600.00	1.72
11	002352	顺丰控股	554,250	27,025,230.00	1.41
12	300274	阳光电源	396,100	26,843,697.00	1.41
13	601658	邮储银行	4,771,900	26,102,293.00	1.37
14	601009	南京银行	2,208,243	25,659,783.66	1.34
15	601857	中国石油	2,911,000	24,889,050.00	1.30
16	601668	中国建筑	4,207,300	24,276,121.00	1.27
17	601211	国泰海通	1,244,044	23,835,883.04	1.25
18	300014	亿纬锂能	499,100	22,863,771.00	1.20
19	601328	交通银行	2,857,505	22,860,040.00	1.20
20	300760	迈瑞医疗	100,800	22,654,800.00	1.19
21	002714	牧原股份	524,556	22,036,597.56	1.15
22	601336	新华保险	356,800	20,872,800.00	1.09
23	600887	伊利股份	733,000	20,436,040.00	1.07
24	601988	中国银行	3,496,500	19,650,330.00	1.03
25	688111	金山办公	68,000	19,043,400.00	1.00
26	002920	德赛西威	186,100	19,006,393.00	0.99
27	601138	工业富联	888,400	18,993,992.00	0.99
28	601166	兴业银行	810,076	18,907,173.84	0.99
29	601939	建设银行	1,937,200	18,287,168.00	0.96
30	601899	紫金矿业	922,500	17,988,750.00	0.94
31	003816	中国广核	4,842,800	17,627,792.00	0.92

32	688036	传音控股	214,130	17,066,161.00	0.89
33	601088	中国神华	399,100	16,179,514.00	0.85
34	000063	中兴通讯	493,100	16,020,819.00	0.84
35	300033	同花顺	55,100	15,042,851.00	0.79
36	002179	中航光电	370,700	14,961,452.00	0.78
37	600690	海尔智家	585,800	14,516,124.00	0.76
38	000333	美的集团	200,130	14,449,386.00	0.76
39	600018	上港集团	2,510,100	14,332,671.00	0.75
40	300759	康龙化成	581,500	14,270,010.00	0.75
41	600276	恒瑞医药	274,113	14,226,464.70	0.74
42	002050	三花智控	507,700	13,393,126.00	0.70
43	600015	华夏银行	1,647,152	13,028,972.32	0.68
44	601818	光大银行	3,120,500	12,950,075.00	0.68
45	600011	华能国际	1,803,600	12,877,704.00	0.67
46	600941	中国移动	113,600	12,785,680.00	0.67
47	601689	拓普集团	268,600	12,691,350.00	0.66
48	600958	东方证券	1,303,300	12,615,944.00	0.66
49	600219	南山铝业	3,153,100	12,076,373.00	0.63
50	603799	华友钴业	310,520	11,495,450.40	0.60
51	600016	民生银行	2,380,900	11,309,275.00	0.59
52	601808	中海油服	794,200	10,928,192.00	0.57
53	600196	复星医药	418,200	10,492,638.00	0.55
54	000708	中信特钢	872,200	10,257,072.00	0.54
55	300059	东方财富	441,320	10,207,731.60	0.53
56	002415	海康威视	364,600	10,110,358.00	0.53
57	002142	宁波银行	365,081	9,988,616.16	0.52
58	601628	中国人寿	238,701	9,832,094.19	0.51
59	688012	中微公司	49,800	9,078,540.00	0.48
60	600050	中国联通	1,656,900	8,847,846.00	0.46
61	300015	爱尔眼科	678,100	8,462,688.00	0.44
62	000725	京东方 A	2,068,600	8,253,714.00	0.43

63	600025	华能水电	824,200	7,871,110.00	0.41
64	601169	北京银行	1,116,744	7,627,361.52	0.40
65	688256	寒武纪	11,400	6,857,100.00	0.36
66	600377	宁沪高速	441,600	6,774,144.00	0.35
67	000568	泸州老窖	58,700	6,656,580.00	0.35
68	000776	广发证券	374,000	6,286,940.00	0.33
69	600999	招商证券	346,500	6,094,935.00	0.32
70	600188	兖矿能源	485,416	5,907,512.72	0.31
71	601319	中国人保	671,200	5,846,152.00	0.31
72	000166	申万宏源	1,129,900	5,672,098.00	0.30
73	000157	中联重科	741,100	5,358,153.00	0.28
74	002001	新和成	244,910	5,209,235.70	0.27
75	601236	红塔证券	604,400	5,119,268.00	0.27
76	600919	江苏银行	428,300	5,113,902.00	0.27
77	601995	中金公司	142,100	5,024,656.00	0.26
78	601633	长城汽车	228,400	4,906,032.00	0.26
79	002600	领益智造	557,700	4,790,643.00	0.25
80	601919	中远海控	316,400	4,758,656.00	0.25
81	601006	大秦铁路	702,990	4,639,734.00	0.24
82	000661	长春高新	45,900	4,552,362.00	0.24
83	600426	华鲁恒升	208,000	4,507,360.00	0.24
84	000625	长安汽车	353,000	4,504,280.00	0.24
85	601881	中国银河	262,100	4,495,015.00	0.24
86	000977	浪潮信息	87,800	4,467,264.00	0.23
87	688981	中芯国际	49,120	4,330,910.40	0.23
88	002916	深南电路	38,500	4,150,685.00	0.22
89	000538	云南白药	73,633	4,107,985.07	0.22
90	300308	中际旭创	27,800	4,054,908.00	0.21
91	601766	中国中车	506,200	3,563,648.00	0.19
92	600926	杭州银行	205,300	3,453,146.00	0.18
93	002463	沪电股份	80,600	3,431,948.00	0.18

94	601688	华泰证券	190,300	3,389,243.00	0.18
95	603259	药明康德	47,800	3,324,490.00	0.17
96	300408	三环集团	98,300	3,283,220.00	0.17
97	600362	江西铜业	116,550	2,730,766.50	0.14
98	603296	华勤技术	31,600	2,549,488.00	0.13
99	000768	中航西飞	87,600	2,394,984.00	0.13
100	600460	士兰微	81,300	2,017,866.00	0.11
101	600585	海螺水泥	92,300	1,981,681.00	0.10
102	688041	海光信息	13,571	1,917,446.59	0.10
103	002304	洋河股份	29,600	1,910,680.00	0.10
104	000792	盐湖股份	111,100	1,897,588.00	0.10
105	600600	青岛啤酒	26,900	1,868,474.00	0.10
106	002493	荣盛石化	210,900	1,746,252.00	0.09
107	601225	陕西煤业	81,100	1,560,364.00	0.08
108	300433	蓝思科技	69,500	1,549,850.00	0.08
109	300498	温氏股份	89,400	1,526,952.00	0.08
110	600938	中国海油	56,900	1,485,659.00	0.08
111	002736	国信证券	120,500	1,388,160.00	0.07
112	601872	招商轮船	208,500	1,305,210.00	0.07
113	600809	山西汾酒	7,160	1,262,952.40	0.07
114	000895	双汇发展	51,450	1,255,894.50	0.07
115	600031	三一重工	68,800	1,234,960.00	0.06
116	600150	中国船舶	35,300	1,148,662.00	0.06
117	000408	藏格矿业	23,000	981,410.00	0.05
118	600482	中国动力	37,400	862,818.00	0.05
119	601377	兴业证券	136,300	843,697.00	0.04
120	300394	天孚通信	9,960	795,206.40	0.04
121	601728	中国电信	91,100	706,025.00	0.04
122	601127	赛力斯	5,168	694,165.76	0.04
123	688082	盛美上海	6,000	683,640.00	0.04
124	300628	亿联网络	19,600	681,296.00	0.04

125	601229	上海银行	63,800	676,918.00	0.04
126	601601	中国太保	17,900	671,429.00	0.04
127	688169	石头科技	4,160	651,248.00	0.03
128	600875	东方电气	37,100	621,054.00	0.03
129	600674	川投能源	34,200	548,568.00	0.03
130	300413	芒果超媒	24,800	541,136.00	0.03
131	603993	洛阳钼业	62,000	522,040.00	0.03
132	600085	同仁堂	13,400	483,204.00	0.03
133	002230	科大讯飞	10,052	481,289.76	0.03
134	600176	中国巨石	33,500	381,900.00	0.02
135	000786	北新建材	14,400	381,312.00	0.02
136	600584	长电科技	11,200	377,328.00	0.02
137	601799	星宇股份	3,000	375,000.00	0.02
138	000876	新希望	39,700	372,386.00	0.02
139	600066	宇通客车	14,700	365,442.00	0.02
140	300347	泰格医药	6,500	346,580.00	0.02
141	002459	晶澳科技	34,500	344,310.00	0.02
142	601058	赛轮轮胎	26,200	343,744.00	0.02
143	002028	思源电气	4,700	342,677.00	0.02
144	603806	福斯特	26,400	342,144.00	0.02
145	000975	山金国际	17,900	339,026.00	0.02
146	603369	今世缘	8,600	334,798.00	0.02
147	300661	圣邦股份	4,600	334,742.00	0.02
148	600161	天坛生物	17,300	331,987.00	0.02
149	002709	天赐材料	18,300	331,596.00	0.02
150	688599	天合光能	22,600	328,378.00	0.02
151	688472	阿特斯	35,800	327,570.00	0.02
152	603833	欧派家居	5,800	327,410.00	0.02
153	605117	德业股份	6,200	326,492.00	0.02
154	600588	用友网络	24,400	326,228.00	0.02
155	300316	晶盛机电	11,900	323,085.00	0.02

156	601865	福莱特	21,200	322,452.00	0.02
157	002648	卫星化学	18,600	322,338.00	0.02
158	603195	公牛集团	6,620	319,415.00	0.02
159	000983	山西焦煤	49,900	319,360.00	0.02
160	600233	圆通速递	24,700	318,383.00	0.02
161	300832	新产业	5,600	317,632.00	0.02
162	000630	铜陵有色	94,800	316,632.00	0.02
163	002180	纳思达	13,800	316,572.00	0.02
164	000999	华润三九	10,100	315,928.00	0.02
165	600061	国投资本	42,000	315,840.00	0.02
166	000807	云铝股份	19,700	314,806.00	0.02
167	300896	爱美客	1,800	314,658.00	0.02
168	002129	TCL中环	40,900	314,112.00	0.02
169	600026	中远海能	30,400	314,032.00	0.02
170	601699	潞安环能	29,500	311,225.00	0.02
171	600515	海南机场	87,600	310,104.00	0.02
172	300418	昆仑万维	9,200	309,396.00	0.02
173	601117	中国化学	40,100	307,567.00	0.02
174	601901	方正证券	38,800	306,908.00	0.02
175	300782	卓胜微	4,300	306,891.00	0.02
176	002601	龙佰集团	18,700	303,127.00	0.02
177	002252	上海莱士	43,800	300,906.00	0.02
178	000800	一汽解放	43,300	297,038.00	0.02
179	600803	新奥股份	15,700	296,730.00	0.02
180	002422	科伦药业	8,200	294,544.00	0.02
181	688303	大全能源	13,800	294,216.00	0.02
182	600332	白云山	11,100	292,596.00	0.02
183	601878	浙商证券	26,800	292,388.00	0.02
184	002236	大华股份	18,300	290,604.00	0.02
185	002049	紫光国微	4,400	289,784.00	0.02
186	002466	天齐锂业	8,900	285,156.00	0.01

187	600741	华域汽车	16,100	284,165.00	0.01
188	300122	智飞生物	14,400	282,096.00	0.01
189	600027	华电国际	51,300	280,611.00	0.01
190	688223	晶科能源	54,000	280,260.00	0.01
191	000596	古井贡酒	2,100	279,615.00	0.01
192	600918	中泰证券	43,400	279,062.00	0.01
193	601877	正泰电器	12,300	278,841.00	0.01
194	300979	华利集团	5,300	278,621.00	0.01
195	600570	恒生电子	8,300	278,382.00	0.01
196	000301	东方盛虹	33,300	277,389.00	0.01
197	688126	沪硅产业	14,600	273,312.00	0.01
198	301236	软通动力	5,000	273,200.00	0.01
199	601021	春秋航空	4,900	272,685.00	0.01
200	002074	国轩高科	8,400	272,664.00	0.01
201	600372	中航机载	22,000	265,320.00	0.01
202	600160	巨化股份	9,200	263,856.00	0.01
203	301269	华大九天	2,100	260,148.00	0.01
204	688009	中国通号	50,600	260,084.00	0.01
205	600089	特变电工	21,500	256,495.00	0.01
206	600183	生益科技	8,500	256,275.00	0.01
207	000938	紫光股份	10,600	254,294.00	0.01
208	600438	通威股份	15,100	252,925.00	0.01
209	000963	华东医药	6,200	250,232.00	0.01
210	601618	中国中冶	83,800	249,724.00	0.01
211	601136	首创证券	12,500	248,500.00	0.01
212	688187	时代电气	5,800	247,370.00	0.01
213	601607	上海医药	13,800	246,744.00	0.01
214	603260	合盛硅业	5,200	246,480.00	0.01
215	601059	信达证券	14,400	246,240.00	0.01
216	600845	宝信软件	10,200	240,924.00	0.01
217	688396	华润微	5,000	235,800.00	0.01

218	601788	光大证券	13,000	233,740.00	0.01
219	600489	中金黄金	15,500	226,765.00	0.01
220	000002	万科A	34,900	224,058.00	0.01
221	002460	赣锋锂业	6,600	222,882.00	0.01
222	603986	兆易创新	1,700	215,101.00	0.01
223	688047	龙芯中科	1,600	213,424.00	0.01
224	002938	鹏鼎控股	6,600	211,398.00	0.01
225	600009	上海机场	6,400	203,328.00	0.01
226	001979	招商蛇口	23,100	202,587.00	0.01
227	600023	浙能电力	38,100	201,930.00	0.01
228	002241	歌尔股份	8,500	198,220.00	0.01
229	000100	TCL科技	45,600	197,448.00	0.01
230	688008	澜起科技	2,400	196,800.00	0.01
231	601360	三六零	19,200	195,840.00	0.01
232	600795	国电电力	39,100	189,244.00	0.01
233	001391	国货航	4,686	31,536.78	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300787	海能实业	946,558	13,109,828.30	0.69
2	603289	泰瑞机器	1,295,800	12,336,016.00	0.65
3	300389	艾比森	968,700	11,217,546.00	0.59
4	301282	金禄电子	348,000	8,626,920.00	0.45
5	300476	胜宏科技	59,900	8,049,362.00	0.42
6	300604	长川科技	147,000	6,601,770.00	0.35
7	002160	常铝股份	1,484,400	6,412,608.00	0.34
8	300803	指南针	78,550	6,335,843.00	0.33
9	300679	电连技术	133,600	6,062,768.00	0.32

10	688475	萤石网络	183,344	5,779,002.88	0.30
11	002983	芯瑞达	254,760	5,398,364.40	0.28
12	300207	欣旺达	254,900	5,113,294.00	0.27
13	300990	同飞股份	96,044	4,792,595.60	0.25
14	002593	日上集团	973,100	4,738,997.00	0.25
15	300940	南极光	181,600	4,585,400.00	0.24
16	601555	东吴证券	519,400	4,544,750.00	0.24
17	600998	九州通	883,400	4,540,676.00	0.24
18	002676	顺威股份	603,000	4,359,690.00	0.23
19	300644	南京聚隆	157,700	4,212,167.00	0.22
20	603103	横店影视	238,900	3,834,345.00	0.20
21	300672	国科微	41,900	3,558,148.00	0.19
22	002250	联化科技	318,500	3,503,500.00	0.18
23	688313	仕佳光子	90,051	3,426,440.55	0.18
24	002847	盐津铺子	41,700	3,352,680.00	0.18
25	300019	硅宝科技	160,800	3,174,192.00	0.17
26	300836	佰奥智能	63,140	2,807,835.80	0.15
27	001872	招商港口	139,800	2,776,428.00	0.15
28	000513	丽珠集团	70,200	2,530,008.00	0.13
29	688772	珠海冠宇	174,200	2,489,318.00	0.13
30	603089	正裕工业	189,900	2,481,993.00	0.13
31	600475	华光环能	237,000	2,469,540.00	0.13
32	603527	众源新材	225,500	2,451,185.00	0.13
33	000682	东方电子	226,900	2,323,456.00	0.12
34	002576	通达动力	135,800	2,233,910.00	0.12
35	300690	双一科技	91,300	2,210,373.00	0.12
36	603267	鸿远电子	43,900	2,206,853.00	0.12
37	000758	中色股份	418,800	2,106,564.00	0.11
38	002107	沃华医药	283,100	1,619,332.00	0.08
39	600704	物产中大	294,400	1,551,488.00	0.08
40	301185	鸥玛软件	78,700	1,540,159.00	0.08

41	601991	大唐发电	481,900	1,527,623.00	0.08
42	000705	浙江震元	180,100	1,521,845.00	0.08
43	601218	吉鑫科技	367,400	1,510,014.00	0.08
44	603256	宏和科技	97,200	1,440,504.00	0.08
45	600262	北方股份	62,300	1,420,440.00	0.07
46	688591	泰凌微	24,800	1,187,920.00	0.06
47	301229	纽泰格	55,640	1,066,618.80	0.06
48	600927	永安期货	71,200	1,054,472.00	0.06
49	688728	格科微	67,000	1,031,800.00	0.05
50	300222	科大智能	97,500	993,525.00	0.05
51	002715	登云股份	53,400	985,230.00	0.05
52	002138	顺络电子	32,100	902,652.00	0.05
53	300017	网宿科技	78,100	837,232.00	0.04
54	600382	广东明珠	148,700	810,415.00	0.04
55	688018	乐鑫科技	5,480	800,628.00	0.04
56	688778	厦钨新能	13,600	760,512.00	0.04
57	000783	长江证券	100,200	694,386.00	0.04
58	300373	扬杰科技	12,300	638,370.00	0.03
59	002025	航天电器	11,700	601,497.00	0.03
60	300489	光智科技	13,300	587,328.00	0.03
61	600638	新黄浦	93,100	545,566.00	0.03
62	600057	厦门象屿	75,600	531,468.00	0.03
63	000911	广农糖业	69,400	504,538.00	0.03
64	002891	中宠股份	8,000	494,960.00	0.03
65	600981	汇鸿集团	171,200	486,208.00	0.03
66	300496	中科创达	8,300	474,926.00	0.02
67	300942	易瑞生物	48,400	463,672.00	0.02
68	000893	亚钾国际	15,100	455,114.00	0.02
69	301181	标榜股份	17,400	431,172.00	0.02
70	600742	富维股份	44,800	426,048.00	0.02
71	300907	康平科技	14,800	405,668.00	0.02

72	301257	普蕊斯	12,000	369,600.00	0.02
73	300432	富临精工	25,900	338,513.00	0.02
74	301323	新莱福	7,300	323,828.00	0.02
75	000959	首钢股份	92,400	314,160.00	0.02
76	002139	拓邦股份	21,000	290,010.00	0.02
77	000828	东莞控股	25,400	271,526.00	0.01
78	600885	宏发股份	11,860	264,596.60	0.01
79	601696	中银证券	24,000	256,560.00	0.01
80	000423	东阿阿胶	4,900	256,270.00	0.01
81	002701	奥瑞金	42,800	254,660.00	0.01
82	603586	金麒麟	13,900	254,648.00	0.01
83	600866	星湖科技	36,000	248,760.00	0.01
84	603939	益丰药房	9,900	242,253.00	0.01
85	603605	珀莱雅	2,900	240,091.00	0.01
86	002185	华天科技	23,400	236,340.00	0.01
87	000728	国元证券	29,800	235,122.00	0.01
88	000729	燕京啤酒	18,100	234,033.00	0.01
89	600132	重庆啤酒	4,200	231,420.00	0.01
90	002821	凯莱英	2,600	229,450.00	0.01
91	600060	海信视像	9,800	225,596.00	0.01
92	688777	中控技术	5,000	224,550.00	0.01
93	002966	苏州银行	25,400	223,012.00	0.01
94	600096	云天化	10,100	221,897.00	0.01
95	002078	太阳纸业	16,400	220,744.00	0.01
96	002032	苏泊尔	4,200	220,038.00	0.01
97	600862	中航高科	8,400	219,072.00	0.01
98	000921	海信家电	8,500	218,450.00	0.01
99	002850	科达利	1,900	215,023.00	0.01
100	002472	双环传动	6,400	214,336.00	0.01
101	688099	晶晨股份	3,000	213,030.00	0.01
102	603606	东方电缆	4,100	212,011.00	0.01

103	600988	赤峰黄金	8,500	211,480.00	0.01
104	600298	安琪酵母	6,000	211,020.00	0.01
105	688188	柏楚电子	1,600	210,656.00	0.01
106	600486	扬农化工	3,600	208,800.00	0.01
107	688608	恒玄科技	600	208,788.00	0.01
108	000933	神火股份	12,500	208,000.00	0.01
109	688122	西部超导	4,000	207,520.00	0.01
110	600398	海澜之家	29,800	207,408.00	0.01
111	002244	滨江集团	21,200	206,700.00	0.01
112	002223	鱼跃医疗	5,800	206,480.00	0.01
113	002837	英维克	6,900	204,999.00	0.01
114	600873	梅花生物	19,100	204,179.00	0.01
115	002273	水晶光电	10,200	203,694.00	0.01
116	603596	伯特利	3,800	200,222.00	0.01
117	000733	振华科技	4,000	200,200.00	0.01
118	002353	杰瑞股份	5,700	199,500.00	0.01
119	600153	建发股份	19,100	198,067.00	0.01
120	300454	深信服	2,100	197,778.00	0.01
121	600801	华新水泥	16,700	197,728.00	0.01
122	600563	法拉电子	1,800	196,362.00	0.01
123	601168	西部矿业	11,800	196,234.00	0.01
124	600985	淮北矿业	17,300	196,182.00	0.01
125	603979	金诚信	4,200	195,048.00	0.01
125	600256	广汇能源	32,400	195,048.00	0.01
127	603129	春风动力	900	194,850.00	0.01
128	603899	晨光股份	6,700	194,233.00	0.01
129	600673	东阳光	16,600	193,058.00	0.01
130	600109	国金证券	21,900	192,063.00	0.01
131	600754	锦江酒店	8,500	190,740.00	0.01
132	000932	华菱钢铁	43,300	190,520.00	0.01
133	600487	亨通光电	12,400	189,720.00	0.01

134	002595	豪迈科技	3,200	189,504.00	0.01
135	600863	内蒙华电	46,000	189,060.00	0.01
136	600578	京能电力	41,800	187,682.00	0.01
137	300450	先导智能	7,500	186,375.00	0.01
138	600095	湘财股份	18,300	183,549.00	0.01
139	300414	中光防雷	9,000	139,320.00	0.01
140	688775	影石创新	573	71,143.68	0.00
141	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
142	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
143	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
144	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
145	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
146	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
147	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
148	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
149	002517	恺英网络	800	15,448.00	0.00
150	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
151	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
152	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
153	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
154	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
155	603194	中力股份	291	13,208.49	0.00
156	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
157	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
158	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
159	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
160	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
161	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
162	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
163	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
164	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00

165	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
166	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
167	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
168	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
169	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
170	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
171	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
172	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
173	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
174	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
175	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
176	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
177	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
178	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
179	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
180	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
181	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	600519	贵州茅台	63,637,915.00	4.35
2	600030	中信证券	58,457,588.40	4.00
3	601211	国泰海通	57,201,920.40	3.91
4	601668	中国建筑	56,942,528.00	3.89
5	300308	中际旭创	53,608,546.00	3.66
6	601138	工业富联	49,898,717.00	3.41
7	601658	邮储银行	46,960,955.00	3.21

8	300033	同花顺	46,637,762.00	3.19
9	002714	牧原股份	45,859,116.00	3.13
10	300760	迈瑞医疗	44,717,726.00	3.06
11	300274	阳光电源	44,298,456.00	3.03
12	601988	中国银行	43,725,880.00	2.99
13	000651	格力电器	42,441,954.00	2.90
14	300750	宁德时代	41,856,084.30	2.86
15	601939	建设银行	41,722,796.00	2.85
16	002594	比亚迪	40,951,847.00	2.80
17	601127	赛力斯	40,766,855.12	2.79
18	300014	亿纬锂能	40,129,788.00	2.74
19	601857	中国石油	36,274,447.00	2.48
20	601318	中国平安	36,180,884.00	2.47
21	300059	东方财富	35,429,887.20	2.42
22	300787	海能实业	35,060,423.44	2.40
23	300502	新易盛	34,336,111.00	2.35
24	002920	德赛西威	33,255,362.00	2.27
25	600938	中国海油	32,798,818.00	2.24
26	688111	金山办公	32,062,050.12	2.19
27	601328	交通银行	31,172,398.15	2.13
28	002230	科大讯飞	31,070,416.80	2.12
29	601336	新华保险	29,652,182.00	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	300308	中际旭创	55,724,215.00	3.81

2	601138	工业富联	51,448,399.25	3.52
3	601668	中国建筑	48,987,270.98	3.35
4	601127	赛力斯	45,299,192.00	3.10
5	000333	美的集团	45,077,557.00	3.08
6	002594	比亚迪	44,222,431.75	3.02
7	601318	中国平安	43,709,498.10	2.99
8	300502	新易盛	42,684,065.40	2.92
9	601988	中国银行	42,015,242.00	2.87
10	600938	中国海油	41,859,832.00	2.86
11	601211	国泰海通	41,745,599.00	2.85
12	600660	福耀玻璃	35,938,064.30	2.46
13	300059	东方财富	35,123,439.00	2.40
14	600276	恒瑞医药	33,239,845.20	2.27
15	600030	中信证券	33,002,872.35	2.26
16	300033	同花顺	32,173,421.00	2.20
17	600031	三一重工	31,776,120.00	2.17
18	002714	牧原股份	31,179,284.00	2.13
19	002230	科大讯飞	30,947,212.00	2.12
20	605117	德业股份	30,884,765.28	2.11
21	600406	国电南瑞	30,670,383.93	2.10
22	600941	中国移动	29,758,199.94	2.03
23	688041	海光信息	29,566,103.09	2.02

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	5,151,488,928.99
卖出股票收入（成交）总额	4,835,896,938.11

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	98,671,292.52	5.17
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	98,671,292.52	5.17

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	019766	25国债01	510,000	51,224,777.26	2.68
2	019758	24国债21	276,000	27,847,658.96	1.46
3	019749	24国债15	106,000	10,734,680.99	0.56
4	019773	25国债08	65,000	6,520,085.89	0.34
5	019723	23国债20	23,000	2,344,089.42	0.12

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

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

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

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,562,117.67
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,562,117.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博道沪深300增强A	95,992	7,419.42	455,358,530.28	63.94%	256,846,373.03	36.06%
博道沪深300增	43,077	13,114.86	446,960,232.41	79.12%	117,988,613.01	20.88%

强C						
合计	13 8,3 78	9,229.46	902,318,762.69	70.6 5%	374,834,986.04	29.35%

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	博道沪深300增强A	770,750.38	0.11%
	博道沪深300增强C	33,214.64	0.01%
	合计	803,965.02	0.06%

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	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	博道沪深300增强A	0~10
	博道沪深300增强C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	博道沪深300增强A	0~10
	博道沪深300增强C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道沪深300增强A	博道沪深300增强C
基金合同生效日(2019年04月26 日)基金份额总额	252,433,048.55	297,786,597.96
本报告期期初基金份额总额	465,008,426.49	555,768,434.87
本报告期基金总申购份额	353,111,355.14	375,201,357.03
减：本报告期基金总赎回份额	105,914,878.32	366,020,946.48

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	712,204,903.31	564,948,845.42

注：

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	9,985,383,043.18	100.00%	1,956,350.12	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
东方证券	95,606,687.51	100.00%	283,502,000.00	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	博道沪深300指数增强型证券投资基金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
4	关于博道基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
5	博道沪深300指数增强型证券投资基金基金合同	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
6	博道沪深300指数增强型证券投资基金（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	2025-03-20
7	博道沪深300指数增强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	2025-03-20
8	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
9	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

10	博道沪深300指数增强型证券投资基金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
11	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
12	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
13	博道沪深300指数增强型证券投资基金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
14	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
15	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沪深300指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道沪深300指数增强型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道沪深300指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日