

博道中证 1000 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 30 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2024年8月28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2024年01月01日起至2024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	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66

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.....	67
§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	71
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道中证1000指数增强型证券投资基金	
基金简称	博道中证1000指数增强	
基金主代码	017644	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年08月25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	155,061,742.61份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道中证1000指数增强A	博道中证1000指数增强C
下属分级基金的交易代码	017644	017645
报告期末下属分级基金的份额总额	118,997,671.59份	36,064,071.02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	本基金以中证1000指数为标的指数，通过量化选股模型构建股票组合，首先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，在控制跟踪误差的基础上力求获得超越标的指数的业

	绩表现。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证1000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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	博道中证1000指数 增强A	博道中证1000指数 增强C
本期已实现收益	-5,542,460.69	-1,912,227.62
本期利润	-13,598,003.09	-3,826,999.47
加权平均基金份额本期利润	-0.1168	-0.1052
本期加权平均净值利润率	-12.68%	-11.47%
本期基金份额净值增长率	-10.12%	-10.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-12,658,664.11	-3,944,903.69
期末可供分配基金份额利润	-0.1064	-0.1094
期末基金资产净值	106,339,007.48	32,119,167.33
期末基金份额净值	0.8936	0.8906
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-10.64%	-10.94%

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

博道中证1000指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.81%	1.26%	-8.15%	1.36%	2.34%	-0.10%
过去三个月	-3.35%	1.43%	-9.51%	1.42%	6.16%	0.01%
过去六个月	-10.12%	2.01%	-15.97%	1.87%	5.85%	0.14%
自基金合同生效起至今	-10.64%	1.62%	-17.29%	1.56%	6.65%	0.06%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

博道中证1000指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.84%	1.26%	-8.15%	1.36%	2.31%	-0.10%
过去三个月	-3.45%	1.44%	-9.51%	1.42%	6.06%	0.02%
过去六个月	-10.29%	2.01%	-15.97%	1.87%	5.68%	0.14%
自基金合同生效起至今	-10.94%	1.63%	-17.29%	1.56%	6.35%	0.07%

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

博道中证1000指数增强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
(2023年08月25日-2024年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年8月25日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道中证1000指数增强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
(2023年08月25日-2024年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2023年8月25日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本金为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了29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和博道明远混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨梦	博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道叁佰智航、博道伍佰智航、博道久航混合、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道红利智	2023-08-25	-	13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年7月担任上海博道投资管

	航股票的基金经理、 量化投资总监兼量 化投资部总经理			理有限公司投资经理助理、 投资经理。2017年8月加入 博道基金管理有限公司，现 任量化投资总监兼量化投 资部总经理。具有基金从业 资格。自2018年8月10日至2 024年4月27日担任博道启 航混合型证券投资基金基 金经理、自2019年1月3日起 担任博道中证500指数增强 型证券投资基金基金经理 至今、自2019年4月26日起 担任博道沪深300指数增强 型证券投资基金基金经理 至今、自2019年4月30日起 担任博道远航混合型证券 投资基金基金经理至今、自 2019年6月5日起担任博道 叁佰智航股票型证券投资 基金基金经理至今、自2019 年9月26日起担任博道伍佰 智航股票型证券投资基金 基金经理至今、自2019年12 月24日起担任博道久航混 合型证券投资基金基金经 理至今、自2021年5月7日至 2024年4月27日担任博道消 费智航股票型证券投资基 金基金经理、自2021年10月 26日起担任博道成长智航 股票型证券投资基金基金 经理至今、自2023年8月25 日起担任博道中证1000指 数增强型证券投资基金基 金经理至今、自2023年10月
--	----------------------------------	--	--	--

					31日起担任博道红利智航股票型证券投资基金基金经理至今。
--	--	--	--	--	------------------------------

注：

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生2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

2024年上半年，开年在小盘风险暴露、流动性负反馈作用下，市场情绪下降迅速，随后长期资金入市，市场出现V型反弹；二季度PMI边际回落，企业盈利仍然较弱。整体上半年，沪深300上涨0.89%，中证500下跌8.96%，中证1000下跌16.84%，上证指数下跌0.25%，创业板指下跌10.99%，恒生指数上涨3.94%。从行业来看，银行、煤炭、石油

石化、家电表现较好，分别上涨了19.19%、12.79%、11.36%、10.77%，消费者服务、计算机、商贸零售、传媒表现较差，分别下跌23.82%、21.62%、21.47%、21.45%。

从因子层面来看，由于2024年一季度市场波动率大幅提升，各大类因子表现分化，算法量价类因子在市场规律不明晰的情况下表现较弱，基本面和估值类因子表现较好。二季度市场环境企稳以后，基本面和估值类因子表现持续强势，AI量价表现也震荡上行。风险因子中，市值因子和非线性市值因子在一季度经历了较大的回撤，而通常量化增强类产品为了追求更大的超额空间，一般都会适度承担一定市值敞口的暴露，因此在风险因子高波动环境下，该类产品的运作经历了一次大考。

博道“指数+”系列产品对标不同的BETA，为适配不同风险偏好以及不同BETA配置需求的投资者，模型设置的风控参数也有所不同。少部分追求超额弹性、风险因子暴露略高的产品受到了市场环境的影响，超额出现了一定的波动；大部分产品风险因子暴露适中，超额波动较小且修复较快。在这轮市场考验过后，博道“指数+”系列产品在维持均衡的因子配置和较低的风格暴露下正常运行，模型层面我们继续在传统多因子模型和AI全流程多因子模型两套框架下持续迭代。

报告期间，本基金维持配置中证1000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2024年下半年，随着中国地产供求形势和新均衡的形成，我国将从债务驱动的高杠杆增长阶段，逐渐进入到创新驱动的高质量增长时代。对应的资本市场监管和金融统计方式都在发生变化，包括新国九条开启资本市场建设的新篇章、二季度统计局的金融增加值核算方式优化调整等，三中全会也勾勒了包括财税、要素市场化等更深层次的治理框架，相关政策红利可能成为新的投资线索。

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

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。

本年度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

本年度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：博道中证1000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,495,080.89	2,951,009.39
结算备付金		1,023.35	1,014.62
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	135,710,472.36	152,846,450.05
其中：股票投资		128,219,418.87	144,732,871.97
基金投资		-	-
债券投资		7,491,053.49	8,113,578.08
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		107,159.11	37,706.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		139,313,735.71	155,836,180.29
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		400,000.00	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		234,103.30	312,528.98
应付管理人报酬		116,521.09	136,363.46
应付托管费		17,478.16	20,454.53
应付销售服务费		10,806.23	12,606.03
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	76,652.12	80,413.11
负债合计		855,560.90	562,366.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	155,061,742.61	156,228,422.56
未分配利润	6.4.7.8	-16,603,567.80	-954,608.38
净资产合计		138,458,174.81	155,273,814.18
负债和净资产总计		139,313,735.71	155,836,180.29

注：本报告期末基金份额净值请见"3.1 主要会计数据和财务指标"；基金份额请见"2.1 基金基本情况"。

6.2 利润表

会计主体：博道中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2024年0 6月30日
一、营业总收入		-16,477,437.20
1.利息收入		4,722.98

其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,722.27
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		0.71
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,575,803.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-8,311,641.71
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	67,748.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	1,668,090.22
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	-9,970,314.25
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	63,957.48
减：二、营业总支出		947,565.36
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	695,676.39
2.托管费	6.4.10.2.2	104,351.50
3.销售服务费		66,159.71
4.投资顾问费		-
5.利息支出		4,696.97
其中：卖出回购金融资产支出		4,696.97
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.17	76,680.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,425,002.56
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,425,002.56
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-17,425,002.56

6.3 净资产变动表

会计主体：博道中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 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	156,228,422.56	-954,608.38	155,273,814.18
二、本期期初净资产	156,228,422.56	-954,608.38	155,273,814.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,166,679.95	-15,648,959.42	-16,815,639.37
（一）、综合收益总额	-	-17,425,002.56	-17,425,002.56
（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）	-1,166,679.95	1,776,043.14	609,363.19
其中：1.基金申购款	36,481,650.73	-2,359,985.11	34,121,665.62
2.基金赎回款	-37,648,330.68	4,136,028.25	-33,512,302.43
（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	155,061,742.61	-16,603,567.80	138,458,174.81
-----------	----------------	----------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

博道中证1000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[2022]3054号《关于准予博道中证1000指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道中证1000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222,517,962.55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（2023）第0444号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》于2023年8月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为222,587,383.61份基金份额，其中认购资金利息折合69,421.06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《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》和《博道中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同

业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中证1000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》、《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年01月01日至2024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2024年06月30日的财务状况以及2024年01月01日至2024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 2024年06月30日
活期存款	1,477,852.51
等于：本金	1,477,737.04
加：应计利息	115.47
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	2,017,228.38
等于：本金	2,017,098.99
加：应计利息	129.39
减：坏账准备	-
合计	3,495,080.89

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		138,060,878.75	-	128,219,418.87	-9,841,459.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,425,380.85	72,833.49	7,491,053.49	-7,160.85
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,425,380.85	72,833.49	7,491,053.49	-7,160.85
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		145,486,259.60	72,833.49	135,710,472.36	-9,848,620.73

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	24.74
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	14,918.54
预提费用-信息披露费	59,672.34
其他应付	2,036.50
合计	76,652.12

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 博道中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,599,663.08	118,599,663.08
本期申购	32,085,450.86	32,085,450.86
本期赎回（以“-”号填列）	-31,687,442.35	-31,687,442.35
本期末	118,997,671.59	118,997,671.59

6.4.7.7.2 博道中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,628,759.48	37,628,759.48
本期申购	4,396,199.87	4,396,199.87
本期赎回（以“-”号填列）	-5,960,888.33	-5,960,888.33
本期末	36,064,071.02	36,064,071.02

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 博道中证1000指数增强A

单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-690,542.54	5,160.44	-685,382.10
本期期初	-690,542.54	5,160.44	-685,382.10
本期利润	-5,542,460.69	-8,055,542.40	-13,598,003.09
本期基金份额交易产生的变动数	-446,457.45	2,071,178.53	1,624,721.08
其中：基金申购款	-2,390,793.57	469,719.79	-1,921,073.78
基金赎回款	1,944,336.12	1,601,458.74	3,545,794.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,679,460.68	-5,979,203.43	-12,658,664.11

6.4.7.8.2 博道中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目 (博道中证1000指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-270,488.99	1,262.71	-269,226.28
本期期初	-270,488.99	1,262.71	-269,226.28
本期利润	-1,912,227.62	-1,914,771.85	-3,826,999.47
本期基金份额交易产生的变动数	45,616.17	105,705.89	151,322.06
其中：基金申购款	-314,155.51	-124,755.82	-438,911.33
基金赎回款	359,771.68	230,461.71	590,233.39

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,137,100.44	-1,807,803.25	-3,944,903.69

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	2,616.66	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	2,096.88	
结算备付金利息收入	8.73	
其他	-	
合计	4,722.27	

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额	777,211,796.37	
减：卖出股票成本总额	784,535,677.08	
减：交易费用	987,761.00	
买卖股票差价收入	-8,311,641.71	

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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	74,444.61	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,696.53	
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	67,748.08

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,268,128.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,110,894.15
减：应计利息总额	163,918.10
减：交易费用	12.38
买卖债券差价收入	-6,696.53

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,668,090.22
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,668,090.22

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-9,970,314.25
——股票投资	-9,969,233.40
——债券投资	-1,080.85
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,970,314.25

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	53,009.67
转换费收入	10,947.81
合计	63,957.48

注：

- 1.本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产；
- 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，A类份额将不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产，C类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
汇划手续费	2,089.91
合计	76,680.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。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3.35%公司股权转让于上海博道相形投资合伙企业(有限合伙),将持有的占比0.4%公司股权转让于张迎军。博道基金于2024年8月8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

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	695,676.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	179,689.14
应支付基金管理人的净管理费	515,987.25

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	104,351.50

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。

6.4.10.2.3 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 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		
	博道中证1000指数增强A	博道中证1000指数增强C	合计
博道基金管理有限公司	-	56,711.47	56,711.47
招商银行	-	0.00	0.00
合计	-	56,711.47	56,711.47

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

博道中证1000指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
报告期初持有的基金份额	22,000,050.08
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	22,000,050.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.49%

博道中证1000指数增强C

份额单位：份

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,725.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	1,000,725.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.77%

注：

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,477,852.51	2,616.66

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（2024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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月以上	创业板打新限售	126.89	188.01	158	20,048.62	29,705.58	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	1-6个月（含）	创业板打新限售送股	-	188.01	126	-	23,689.26	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	695	14,289.20	14,289.20	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	666	12,420.90	12,420.90	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	科创板打新限售	86.96	174.93	56	4,869.76	9,796.08	-
3013	汇成	2024	6个月以	创业	12.20	41.66	219	2,67	9,12	-

92	真空	-05-28	上	板打新限售				1.80	3.54	
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	16.97	472	4,200.80	8,009.84	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月以上	创业板打新限售	16.16	32.27	236	3,813.76	7,615.72	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	创业板打新限售	11.88	18.98	340	4,039.20	6,453.20	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	科创板打新限售	19.86	42.51	151	2,998.86	6,419.01	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	创业板打新限售	10.64	19.82	315	3,351.60	6,243.30	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	创业板打新限售	44.95	65.93	93	4,180.35	6,131.49	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	创业板打新限售	19.43	36.98	156	3,031.08	5,768.88	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	创业板打新限售	55.82	91.24	62	3,460.84	5,656.88	-

				售							
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月以上	科创板打新限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-	
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	科创板打新限售	15.69	18.79	262	4,110.78	4,922.98	-	
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	创业板打新限售	14.50	21.25	228	3,306.00	4,845.00	-	
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	创业板打新限售	28.01	37.83	119	3,333.19	4,501.77	-	
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	创业板打新限售	21.73	25.26	156	3,389.88	3,940.56	-	
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	主板打新限售	17.43	34.56	106	1,847.58	3,663.36	-	
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.20	15.96	221	3,580.20	3,527.16	-	
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	科创板打新限售	22.66	15.89	209	4,735.94	3,321.01	-	
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	创业板打	-	91.24	24	-	2,189.76	-	

				新限售送股						
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	主板打新限售	21.28	29.49	69	1,468.32	2,034.81	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	主板打新限售	17.39	20.60	86	1,495.54	1,771.60	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月以上	主板打新限售	72.46	68.06	25	1,811.50	1,701.50	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	主板打新限售	38.18	38.90	42	1,603.56	1,633.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	15.38	15.25	106	1,630.28	1,616.50	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	主板打新限售	23.35	25.13	64	1,494.40	1,608.32	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	主板打新限售	20.56	20.56	78	1,603.68	1,603.68	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.98	13.48	117	1,986.66	1,577.16	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	29.02	25.36	57	1,654.14	1,445.52	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	主板打新限售	18.65	18.65	74	1,380.10	1,380.10	-

001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	主板打新限售送股	-	15.25	31	-	472.75	-
--------	------	------------	----------	----------	---	-------	----	---	--------	---

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
300630	普利制药	2024-05-06	重大事项	8.65	2024-07-08	9.88	41,400	603,851.41	358,110.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024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400,000.00元，截至2024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2024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(2023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2024年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有400,000.00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2024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0.40%。

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2024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138,516,633.69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 2024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	3,495,080.89	-	-	-	-	-	3,495,080.89
结算备付金	1,023.35	-	-	-	-	-	1,023.35
交易性金融资产	-	-	7,491,053.49	-	-	128,219,418.87	135,710,472.36
应收申购款	-	-	-	-	-	107,159.11	107,159.11
资产总计	3,496,104.24	-	7,491,053.49	-	-	128,326,577.98	139,313,735.71
负债							
卖出回购金融资产款	400,000.00	-	-	-	-	-	400,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	234,103.30	234,103.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	116,521.09	116,521.09
应付托	-	-	-	-	-	17,478.16	17,478.16

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,806.23	10,806.23
其他负债	-	-	-	-	-	76,652.12	76,652.12
负债总计	400,000.00	-	-	-	-	455,560.90	855,560.90
利率敏感度缺口	3,096,104.24	-	7,491,053.49	-	-	127,871,017.08	138,458,174.81
上年度末 2023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	2,951,009.39	-	-	-	-	-	2,951,009.39
结算备付金	1,014.62	-	-	-	-	-	1,014.62
交易性金融资产	-	-	8,113,578.08	-	-	144,732,871.97	152,846,450.05
应收申购款	-	-	-	-	-	37,706.23	37,706.23
资产总计	2,952,024.01	-	8,113,578.08	-	-	144,770,578.20	155,836,180.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	312,528.98	312,528.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	136,363.46	136,363.46
应付托管费	-	-	-	-	-	20,454.53	20,454.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,606.03	12,606.03
其他负债	-	-	-	-	-	80,413.11	80,413.11
负债总计	-	-	-	-	-	562,366.11	562,366.11

计							
利率敏 感度缺 口	2,952,024.01	-	8,113,578.08	-	-	144,208,212.09	155,273,814.18

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2024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5.41%(2023年12月31日：5.23%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过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 2024年06月30日		上年度末 2023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	128,219,418.87	92.61	144,732,871.97	93.21
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	128,219,418.87	92.61	144,732,871.97	93.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证1000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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.中证1000指数收益率上升5%	6,283,047.52	7,182,730.34
	2.中证1000指数收益率下降5%	-6,283,047.52	-7,182,730.34

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	127,656,690.25	144,577,787.05
第二层次	7,520,747.37	8,113,578.08
第三层次	533,034.74	155,084.92
合计	135,710,472.36	152,846,450.05

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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	128,219,418.87	92.04
	其中：股票	128,219,418.87	92.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,491,053.49	5.38
	其中：债券	7,491,053.49	5.38
	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	3,496,104.24	2.51
8	其他各项资产	107,159.11	0.08
9	合计	139,313,735.71	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（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	279,272.00	0.20
B	采矿业	6,089,489.00	4.40
C	制造业	76,800,512.59	55.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,721,306.00	2.69

E	建筑业	1,296,144.00	0.94
F	批发和零售业	2,615,962.00	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	3,116,468.60	2.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,255,721.28	5.96
J	金融业	2,933,286.00	2.12
K	房地产业	443,592.00	0.32
L	租赁和商务服务业	782,476.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	1,080,162.93	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	499,089.16	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	402,762.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	323,297.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	108,639,540.56	78.46

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	55,440.00	0.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,823,777.12	9.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	349,651.00	0.25
E	建筑业	84,947.00	0.06
F	批发和零售业	661,111.80	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,239,789.09	1.62
J	金融业	367,030.30	0.27
K	房地产业	361,143.00	0.26
L	租赁和商务服务业	1,022,241.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	56,576.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	456,904.00	0.33
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	101,268.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	19,579,878.31	14.14

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	002139	拓邦股份	130,400	1,384,848.00	1.00
2	300674	宇信科技	114,000	1,263,120.00	0.91
3	688800	瑞可达	43,717	1,227,573.36	0.89
4	300233	金城医药	82,100	1,224,932.00	0.88
5	601001	晋控煤业	72,900	1,204,308.00	0.87
6	605333	沪光股份	43,200	1,203,120.00	0.87
7	002020	京新药业	114,100	1,194,627.00	0.86

8	000795	英洛华	211,400	1,171,156.00	0.85
9	000550	江铃汽车	53,400	1,159,314.00	0.84
10	688776	国光电气	20,600	1,141,240.00	0.82
11	002961	瑞达期货	104,200	1,140,990.00	0.82
12	600586	金晶科技	193,800	1,124,040.00	0.81
13	300596	利安隆	40,600	1,101,478.00	0.80
14	300679	电连技术	26,800	1,078,164.00	0.78
15	688016	心脉医疗	10,401	1,019,818.05	0.74
16	002745	木林森	126,300	1,017,978.00	0.74
17	002274	华昌化工	136,700	1,014,314.00	0.73
18	603583	捷昌驱动	48,500	988,430.00	0.71
19	688076	诺泰生物	12,200	955,016.00	0.69
20	002635	安洁科技	60,800	938,752.00	0.68
21	300482	万孚生物	38,300	934,520.00	0.67
22	600888	新疆众和	123,200	871,024.00	0.63
23	002315	焦点科技	32,200	868,112.00	0.63
24	600810	神马股份	135,600	840,720.00	0.61
25	002267	陕天然气	111,200	840,672.00	0.61
26	000758	中色股份	165,300	839,724.00	0.61
27	002249	大洋电机	175,700	831,061.00	0.60
28	300687	赛意信息	58,800	818,496.00	0.59
29	600420	国药现代	74,300	793,524.00	0.57
30	688167	炬光科技	14,400	792,000.00	0.57
31	002402	和而泰	73,800	790,398.00	0.57
32	600711	盛屯矿业	214,200	786,114.00	0.57
33	300857	协创数据	13,600	775,200.00	0.56
34	603348	文灿股份	27,900	772,551.00	0.56
35	300953	震裕科技	13,900	753,380.00	0.54
36	688408	中信博	8,000	736,640.00	0.53
37	600662	外服控股	183,600	736,236.00	0.53
38	600882	妙可蓝多	58,300	727,001.00	0.53

39	600618	氯碱化工	82,100	720,838.00	0.52
40	000810	创维数字	83,800	719,004.00	0.52
41	603055	台华新材	70,800	717,204.00	0.52
42	300428	立中集团	38,300	711,997.00	0.51
43	688798	艾为电子	12,400	702,088.00	0.51
44	001338	永顺泰	71,300	698,740.00	0.50
45	300783	三只松鼠	31,500	688,905.00	0.50
46	000990	诚志股份	92,400	687,456.00	0.50
47	603919	金徽酒	37,500	681,375.00	0.49
48	002242	九阳股份	64,600	677,008.00	0.49
49	603995	甬金股份	38,600	676,272.00	0.49
50	002053	云南能投	55,800	674,622.00	0.49
51	603299	苏盐井神	70,700	671,650.00	0.49
52	603733	仙鹤股份	38,200	671,556.00	0.49
53	002891	中宠股份	31,700	661,579.00	0.48
54	688139	海尔生物	17,222	640,658.40	0.46
55	002978	安宁股份	22,400	624,064.00	0.45
56	603693	江苏新能	52,700	612,374.00	0.44
57	000828	东莞控股	65,600	591,056.00	0.43
58	603556	海兴电力	12,500	585,375.00	0.42
59	603983	丸美股份	21,000	578,130.00	0.42
60	000821	京山轻机	49,800	564,234.00	0.41
61	601369	陕鼓动力	70,300	563,806.00	0.41
62	300841	康华生物	11,000	557,040.00	0.40
63	688208	道通科技	23,000	555,220.00	0.40
64	000555	神州信息	59,400	553,608.00	0.40
65	002706	良信股份	80,100	549,486.00	0.40
66	600557	康缘药业	34,300	538,510.00	0.39
67	688578	艾力斯	8,417	536,499.58	0.39
68	002446	盛路通信	94,400	533,360.00	0.39
69	301071	力量钻石	19,200	532,032.00	0.38

70	301316	慧博云通	36,200	531,416.00	0.38
71	300856	科思股份	16,500	528,165.00	0.38
72	688018	乐鑫科技	5,321	525,076.28	0.38
73	600874	创业环保	93,300	521,547.00	0.38
74	688127	蓝特光学	27,793	511,113.27	0.37
75	688711	宏微科技	31,777	510,338.62	0.37
76	002275	桂林三金	41,000	508,810.00	0.37
77	600908	无锡银行	95,400	507,528.00	0.37
78	688383	新益昌	9,639	502,288.29	0.36
79	300031	宝通科技	34,800	500,076.00	0.36
80	000968	蓝焰控股	77,200	490,992.00	0.35
81	002906	华阳集团	18,300	489,708.00	0.35
82	600502	安徽建工	113,700	488,910.00	0.35
83	605507	国邦医药	29,300	487,845.00	0.35
84	002901	大博医疗	18,800	485,604.00	0.35
85	600780	通宝能源	82,100	484,390.00	0.35
86	603008	喜临门	27,700	480,041.00	0.35
87	603187	海容冷链	40,800	475,728.00	0.34
88	605090	九丰能源	16,200	469,800.00	0.34
89	000951	中国重汽	32,600	466,832.00	0.34
90	002544	普天科技	24,700	461,643.00	0.33
91	002705	新宝股份	32,700	460,089.00	0.33
92	000913	钱江摩托	29,100	458,616.00	0.33
93	600295	鄂尔多斯	46,100	457,312.00	0.33
94	603719	良品铺子	39,100	456,297.00	0.33
95	601886	江河集团	93,300	455,304.00	0.33
96	600971	恒源煤电	38,100	454,914.00	0.33
97	002550	千红制药	82,900	446,831.00	0.32
98	600007	中国国贸	20,200	443,592.00	0.32
99	603129	春风动力	3,100	441,254.00	0.32
100	688608	恒玄科技	2,974	435,334.12	0.31

101	000837	秦川机床	58,900	433,504.00	0.31
102	300638	广和通	25,300	432,630.00	0.31
103	601969	海南矿业	68,200	432,388.00	0.31
104	002396	星网锐捷	32,600	430,646.00	0.31
105	002911	佛燃能源	47,100	430,494.00	0.31
106	688372	伟测科技	10,921	429,522.93	0.31
107	002171	楚江新材	64,300	423,737.00	0.31
108	601101	昊华能源	46,100	423,659.00	0.31
109	601975	招商南油	118,000	423,620.00	0.31
110	603599	广信股份	34,700	420,911.00	0.30
111	002967	广电计量	35,000	413,000.00	0.30
112	002993	奥海科技	11,100	412,920.00	0.30
113	600993	马应龙	15,200	405,384.00	0.29
114	301239	普瑞眼科	11,400	402,762.00	0.29
115	600750	江中药业	17,400	402,114.00	0.29
116	002597	金禾实业	20,000	397,800.00	0.29
117	300348	长亮科技	57,300	390,786.00	0.28
118	002832	比音勒芬	16,100	389,137.00	0.28
119	301268	铭利达	25,000	388,750.00	0.28
120	600475	华光环能	44,600	388,466.00	0.28
121	002839	张家港行	94,100	378,282.00	0.27
122	600623	华谊集团	64,600	373,388.00	0.27
123	300620	光库科技	10,100	371,478.00	0.27
124	300303	聚飞光电	75,600	367,416.00	0.27
125	600864	哈投股份	76,400	362,900.00	0.26
126	002011	盾安环境	36,900	362,727.00	0.26
127	002378	章源钨业	62,900	361,046.00	0.26
128	300573	兴齐眼药	2,200	360,800.00	0.26
129	000065	北方国际	34,600	358,802.00	0.26
130	300623	捷捷微电	20,400	352,920.00	0.25
131	600480	凌云股份	35,800	351,914.00	0.25

132	600507	方大特钢	93,000	347,820.00	0.25
133	600776	东方通信	35,300	346,999.00	0.25
134	002215	诺普信	46,200	344,190.00	0.25
135	002023	海特高新	37,200	340,380.00	0.25
136	300685	艾德生物	19,100	336,924.00	0.24
137	603025	大豪科技	24,200	334,444.00	0.24
138	002204	大连重工	78,300	334,341.00	0.24
139	603093	南华期货	38,100	329,946.00	0.24
140	600787	中储股份	68,200	328,042.00	0.24
141	301219	腾远钴业	8,500	325,210.00	0.23
142	603636	南威软件	41,500	319,550.00	0.23
143	600997	开滦股份	46,500	318,990.00	0.23
144	002265	建设工业	36,900	318,447.00	0.23
145	300079	数码视讯	77,100	313,026.00	0.23
146	002539	云图控股	43,500	310,155.00	0.22
147	600458	时代新材	30,700	310,070.00	0.22
148	601677	明泰铝业	26,700	308,652.00	0.22
149	603766	隆鑫通用	45,300	307,134.00	0.22
150	002332	仙琚制药	26,900	306,929.00	0.22
151	600409	三友化工	60,800	305,216.00	0.22
152	600012	皖通高速	21,700	303,149.00	0.22
153	002782	可立克	27,100	300,268.00	0.22
154	600797	浙大网新	64,800	300,024.00	0.22
155	002681	奋达科技	81,200	296,380.00	0.21
156	603871	嘉友国际	16,740	296,130.60	0.21
157	002777	久远银海	19,100	286,309.00	0.21
158	300115	长盈精密	23,400	280,566.00	0.20
159	600312	平高电气	14,400	280,080.00	0.20
160	000552	甘肃能化	80,200	278,294.00	0.20
161	600556	天下秀	75,800	275,912.00	0.20
162	002043	兔宝宝	25,500	264,435.00	0.19

163	600916	中国黄金	26,400	253,968.00	0.18
164	688586	江航装备	27,200	252,960.00	0.18
165	603281	江瀚新材	11,160	250,542.00	0.18
166	000688	国城矿业	26,300	250,376.00	0.18
167	002192	融捷股份	8,300	249,166.00	0.18
168	603098	森特股份	31,600	248,376.00	0.18
169	000902	新洋丰	20,800	246,896.00	0.18
170	600452	涪陵电力	19,400	245,798.00	0.18
171	000429	粤高速 A	23,500	244,635.00	0.18
172	002041	登海种业	29,800	240,784.00	0.17
173	688789	宏华数科	2,176	234,572.80	0.17
174	600559	老白干酒	12,800	232,704.00	0.17
175	002773	康弘药业	10,600	229,490.00	0.17
176	601609	金田股份	39,800	225,268.00	0.16
177	300475	香农芯创	7,600	224,732.00	0.16
178	605365	立达信	14,000	222,180.00	0.16
179	002929	润建股份	7,400	215,414.00	0.16
180	000403	派林生物	8,000	213,280.00	0.15
181	600575	淮河能源	54,400	211,616.00	0.15
182	688392	骄成超声	4,794	203,457.36	0.15
183	301080	百普赛斯	5,500	192,500.00	0.14
184	688091	上海谊众	8,400	189,756.00	0.14
185	603267	鸿远电子	5,500	187,550.00	0.14
186	688209	英集芯	14,768	183,270.88	0.13
187	001322	箭牌家居	25,000	182,750.00	0.13
188	688503	聚和材料	6,200	174,220.00	0.13
189	300443	金雷股份	11,300	173,229.00	0.13
190	002697	红旗连锁	36,300	168,069.00	0.12
191	300406	九强生物	10,800	166,104.00	0.12
192	600210	紫江企业	30,700	163,324.00	0.12
193	000848	承德露露	20,700	162,702.00	0.12

194	000915	华特达因	5,300	159,848.00	0.12
195	002991	甘源食品	2,600	157,690.00	0.11
196	002276	万马股份	21,900	157,023.00	0.11
197	002990	盛视科技	7,800	157,014.00	0.11
198	603565	中谷物流	17,700	154,698.00	0.11
199	688278	特宝生物	2,869	153,634.95	0.11
200	002649	博彦科技	18,900	150,444.00	0.11
201	002987	京北方	14,100	148,473.00	0.11
202	601702	华峰铝业	8,100	147,906.00	0.11
203	000597	东北制药	37,500	145,125.00	0.10
204	600929	雪天盐业	27,300	144,690.00	0.10
205	688128	中国电研	8,400	144,564.00	0.10
206	002468	申通快递	16,300	136,920.00	0.10
207	600710	苏美达	16,600	135,290.00	0.10
208	000657	中钨高新	14,800	135,272.00	0.10
209	300109	新开源	11,600	134,328.00	0.10
210	002292	奥飞娱乐	21,800	130,364.00	0.09
211	600602	云赛智联	11,400	125,856.00	0.09
212	600757	长江传媒	14,900	120,094.00	0.09
213	600577	精达股份	29,800	118,306.00	0.09
214	002948	青岛银行	34,700	116,939.00	0.08
215	002222	福晶科技	5,170	116,480.10	0.08
216	000582	北部湾港	15,600	116,064.00	0.08
217	603197	保隆科技	3,600	113,400.00	0.08
218	000030	富奥股份	22,600	110,966.00	0.08
219	601163	三角轮胎	7,200	109,584.00	0.08
220	603103	横店影视	7,900	109,336.00	0.08
221	003006	百亚股份	4,600	109,020.00	0.08
222	002859	洁美科技	5,400	108,432.00	0.08
223	000885	城发环境	8,800	107,096.00	0.08
224	688336	三生国健	5,200	105,820.00	0.08

225	603989	艾华集团	7,400	104,044.00	0.08
226	000498	山东路桥	19,800	103,554.00	0.07
227	603071	物产环能	8,200	102,746.00	0.07
228	603212	赛伍技术	9,100	100,464.00	0.07
229	688337	普源精电	3,800	95,836.00	0.07
230	600596	新安股份	12,600	95,760.00	0.07
231	002318	久立特材	4,100	95,653.00	0.07
232	300446	航天智造	8,000	95,200.00	0.07
233	601811	新华文轩	6,700	93,867.00	0.07
234	300850	新强联	6,100	91,622.00	0.07
235	301526	国际复材	27,325	90,992.25	0.07
236	600552	凯盛科技	9,500	89,585.00	0.06
237	600285	羚锐制药	3,600	87,156.00	0.06
238	603489	八方股份	3,180	85,796.40	0.06
239	600933	爱柯迪	5,800	85,782.00	0.06
240	000034	神州数码	3,700	84,693.00	0.06
241	601333	广深铁路	26,100	84,564.00	0.06
242	688351	微电生理	3,800	83,752.00	0.06
243	300770	新媒股份	2,500	83,450.00	0.06
244	600986	浙文互联	19,500	81,900.00	0.06
245	002534	西子洁能	8,100	81,081.00	0.06
246	300634	彩讯股份	4,700	79,101.00	0.06
247	600587	新华医疗	5,000	78,700.00	0.06
248	601952	苏垦农发	8,600	77,572.00	0.06
249	000019	深粮控股	13,300	76,342.00	0.06
250	600717	天津港	16,400	70,028.00	0.05
251	002079	苏州固锝	8,100	69,012.00	0.05
252	002038	双鹭药业	9,200	67,804.00	0.05
253	002807	江阴银行	17,600	66,352.00	0.05
254	002034	旺能环境	4,600	59,846.00	0.04
255	300973	立高食品	2,100	58,989.00	0.04

256	600422	昆药集团	3,300	58,839.00	0.04
257	300415	伊之密	2,800	58,184.00	0.04
258	002135	东南网架	14,600	57,816.00	0.04
259	002837	英维克	2,700	57,753.00	0.04
260	003039	顺控发展	4,500	56,385.00	0.04
261	000088	盐田港	12,300	55,719.00	0.04
262	600123	兰花科创	6,200	55,490.00	0.04
263	688389	普门科技	3,400	55,284.00	0.04
264	002698	博实股份	4,500	55,215.00	0.04
265	002545	东方铁塔	8,100	55,161.00	0.04
266	688596	正帆科技	1,635	53,955.00	0.04
267	601096	宏盛华源	13,124	53,677.16	0.04
268	603128	华贸物流	9,300	53,661.00	0.04
269	301078	孩子王	10,300	52,118.00	0.04
270	002239	奥特佳	22,500	51,750.00	0.04
271	300224	正海磁材	5,400	50,004.00	0.04
272	603013	亚普股份	3,700	49,839.00	0.04
273	688147	微导纳米	2,000	49,800.00	0.04
274	600449	宁夏建材	4,200	49,350.00	0.04
275	002287	奇正藏药	2,500	48,950.00	0.04
276	603383	顶点软件	1,500	48,105.00	0.03
277	002245	蔚蓝锂芯	6,100	47,275.00	0.03
278	600125	铁龙物流	7,800	46,566.00	0.03
279	600057	厦门象屿	6,800	46,240.00	0.03
280	300887	谱尼测试	6,100	45,140.00	0.03
281	002646	天佑德酒	4,300	43,989.00	0.03
282	300229	拓尔思	3,200	42,976.00	0.03
283	002946	新乳业	4,600	40,296.00	0.03
284	600006	东风汽车	6,300	40,257.00	0.03
285	300761	立华股份	1,700	38,488.00	0.03
286	600206	有研新材	4,100	36,490.00	0.03

287	002461	珠江啤酒	4,800	35,616.00	0.03
288	600223	福瑞达	4,900	34,643.00	0.03
289	300458	全志科技	1,400	32,914.00	0.02
290	002126	银轮股份	1,800	31,338.00	0.02
291	603169	兰石重装	6,800	30,600.00	0.02
292	601375	中原证券	8,900	30,349.00	0.02
293	688088	虹软科技	1,000	28,860.00	0.02
294	601279	英利汽车	7,700	28,721.00	0.02
295	605123	派克新材	500	28,090.00	0.02
296	002389	航天彩虹	2,000	27,780.00	0.02
297	002434	万里扬	4,300	21,070.00	0.02
298	603368	柳药集团	800	14,000.00	0.01
299	601033	永兴股份	221	3,527.16	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	601616	广电电气	231,100	672,501.00	0.49
2	000409	云鼎科技	77,200	623,004.00	0.45
3	603408	建霖家居	41,500	547,385.00	0.40
4	300743	天地数码	38,900	526,706.00	0.38
5	002026	山东威达	57,000	473,100.00	0.34
6	688480	赛恩斯	16,400	456,904.00	0.33
7	002380	科远智慧	24,000	439,200.00	0.32
8	001234	泰慕士	25,400	431,546.00	0.31
9	603682	锦和商管	105,000	418,950.00	0.30
10	002660	茂硕电源	53,700	398,454.00	0.29
11	601700	风范股份	84,300	370,077.00	0.27
12	300630	普利制药	41,400	358,110.00	0.26

13	300872	天阳科技	26,600	352,450.00	0.25
14	300153	科泰电源	59,100	351,645.00	0.25
15	002066	瑞泰科技	43,500	345,825.00	0.25
16	301193	家联科技	20,900	333,564.00	0.24
17	002201	正威新材	70,000	331,100.00	0.24
18	300424	航新科技	26,785	327,580.55	0.24
19	000551	创元科技	36,900	322,137.00	0.23
20	002602	世纪华通	91,100	312,473.00	0.23
21	002589	瑞康医药	140,604	309,328.80	0.22
22	601500	通用股份	57,600	307,584.00	0.22
23	002729	好利科技	32,900	305,312.00	0.22
24	688253	英诺特	8,000	304,880.00	0.22
25	000605	渤海股份	64,900	300,487.00	0.22
26	603278	大业股份	46,800	290,628.00	0.21
27	000788	北大医药	57,500	286,925.00	0.21
28	002878	元隆雅图	22,700	285,339.00	0.21
29	001228	永泰运	13,500	284,580.00	0.21
30	603948	建业股份	17,000	276,760.00	0.20
31	605007	五洲特纸	21,700	274,071.00	0.20
32	603353	和顺石油	20,100	260,496.00	0.19
33	002824	和胜股份	19,800	252,648.00	0.18
34	002900	哈三联	27,100	248,778.00	0.18
35	688049	炬芯科技	11,047	244,359.64	0.18
36	603577	汇金通	35,100	243,594.00	0.18
37	000533	顺钠股份	72,300	237,867.00	0.17
38	002451	摩恩电气	41,400	222,318.00	0.16
39	002296	辉煌科技	20,700	213,417.00	0.15
40	601398	工商银行	36,079	205,650.30	0.15
41	002578	闽发铝业	77,200	203,036.00	0.15
42	301067	显盈科技	10,300	203,013.00	0.15
43	002879	长缆科技	15,200	199,576.00	0.14

44	600638	新黄浦	51,400	193,778.00	0.14
45	002404	嘉欣丝绸	36,300	192,027.00	0.14
46	300002	神州泰岳	21,700	176,204.00	0.13
47	002095	生意宝	14,100	172,584.00	0.12
48	600503	华丽家族	93,500	167,365.00	0.12
49	003025	思进智能	12,700	156,337.00	0.11
50	000333	美的集团	2,400	154,800.00	0.11
51	603192	汇得科技	10,500	141,015.00	0.10
52	003033	征和工业	6,000	139,020.00	0.10
53	601288	农业银行	31,000	135,160.00	0.10
54	002137	实益达	27,500	130,900.00	0.09
55	605080	浙江自然	6,900	109,158.00	0.08
56	002486	嘉麟杰	75,000	108,750.00	0.08
57	688616	西力科技	9,200	104,328.00	0.08
58	300018	中元股份	22,100	101,660.00	0.07
59	601999	出版传媒	19,400	101,268.00	0.07
60	300673	佩蒂股份	7,300	95,776.00	0.07
61	301317	鑫磊股份	5,700	88,578.00	0.06
62	003036	泰坦股份	10,800	86,292.00	0.06
63	301045	天禄科技	4,500	85,770.00	0.06
64	601956	东贝集团	18,700	85,646.00	0.06
65	600222	太龙药业	20,200	84,840.00	0.06
66	000404	长虹华意	15,800	84,214.00	0.06
67	301566	达利凯普	4,719	80,081.43	0.06
68	600241	时代万恒	13,600	75,616.00	0.05
69	000880	潍柴重机	9,400	75,106.00	0.05
70	605488	福莱新材	5,600	72,800.00	0.05
71	002692	远程股份	20,900	70,015.00	0.05
72	301299	卓创资讯	1,500	63,000.00	0.05
73	003019	宸展光电	2,475	62,691.75	0.05
74	002866	传艺科技	4,800	61,776.00	0.04

75	603926	铁流股份	7,300	60,590.00	0.04
76	002722	物产金轮	5,300	59,890.00	0.04
77	603909	建发合诚	6,800	56,576.00	0.04
78	002679	福建金森	8,000	55,440.00	0.04
79	301589	诺瓦星云	284	53,394.84	0.04
80	002469	三维化学	9,300	53,010.00	0.04
81	300513	恒实科技	6,100	49,715.00	0.04
82	301419	阿莱德	2,000	49,660.00	0.04
83	300681	英搏尔	3,800	49,552.00	0.04
84	000020	深华发 A	5,000	49,500.00	0.04
85	600900	长江电力	1,700	49,164.00	0.04
86	688160	步科股份	1,200	47,988.00	0.03
87	002576	通达动力	4,200	47,670.00	0.03
88	001238	浙江正特	2,400	47,568.00	0.03
89	301088	戎美股份	4,200	47,040.00	0.03
90	688665	四方光电	1,680	46,603.20	0.03
91	601668	中国建筑	8,700	46,197.00	0.03
92	603829	洛凯股份	3,900	46,137.00	0.03
93	688767	博拓生物	1,800	45,126.00	0.03
94	301578	辰奕智能	1,136	44,951.52	0.03
95	301126	达嘉维康	4,900	44,247.00	0.03
96	688080	映翰通	1,400	42,462.00	0.03
97	600114	东睦股份	2,900	41,731.00	0.03
98	002897	意华股份	1,100	41,426.00	0.03
99	002140	东华科技	5,000	38,750.00	0.03
100	301097	天益医疗	1,000	37,640.00	0.03
101	688435	英方软件	1,400	34,944.00	0.03
102	002418	康盛股份	18,100	34,209.00	0.02
103	002876	三利谱	1,400	33,768.00	0.02
104	000607	华媒控股	10,800	33,372.00	0.02
105	603630	拉芳家化	3,000	31,530.00	0.02

106	688151	华强科技	2,200	27,390.00	0.02
107	603681	永冠新材	2,100	26,775.00	0.02
108	301391	卡莱特	600	26,268.00	0.02
109	601916	浙商银行	9,500	26,220.00	0.02
110	002415	海康威视	800	24,728.00	0.02
111	600488	津药药业	7,000	24,010.00	0.02
112	605369	拱东医疗	600	23,940.00	0.02
113	603350	安乃达	773	15,892.88	0.01
114	603004	鼎龙科技	930	15,763.50	0.01
115	688393	安必平	1,000	15,330.00	0.01
116	603285	键邦股份	740	13,801.00	0.01
117	688692	达梦数据	56	9,796.08	0.01
118	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
119	301538	骏鼎达	86	7,846.64	0.01
120	301536	星宸科技	236	7,615.72	0.01
121	301565	中仑新材	340	6,453.20	0.00
122	688691	灿芯股份	151	6,419.01	0.00
123	301539	宏鑫科技	315	6,243.30	0.00
124	301580	爱迪特	93	6,131.49	0.00
125	301591	肯特股份	156	5,768.88	0.00
126	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
127	688709	成都华微	262	4,922.98	0.00
128	301588	美新科技	228	4,845.00	0.00
129	301502	华阳智能	119	4,501.77	0.00
130	301587	中瑞股份	156	3,940.56	0.00
131	001389	广合科技	106	3,663.36	0.00
132	688584	上海合晶	209	3,321.01	0.00
133	001387	雪祺电气	137	2,089.25	0.00
134	603082	北自科技	69	2,034.81	0.00
135	001359	平安电工	86	1,771.60	0.00
136	603325	博隆技术	25	1,701.50	0.00

137	603375	盛景微	42	1,633.80	0.00
138	603381	永臻股份	64	1,608.32	0.00
139	001379	腾达科技	117	1,577.16	0.00
140	603312	西典新能	57	1,445.52	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	600882	妙可蓝多	3,922,956.00	2.53
2	688800	瑞可达	3,746,452.87	2.41
3	601001	晋控煤业	3,745,395.00	2.41
4	688018	乐鑫科技	3,736,432.63	2.41
5	688209	英集芯	3,607,756.86	2.32
6	603171	税友股份	3,604,799.00	2.32
7	300662	科锐国际	3,507,861.00	2.26
8	000032	深桑达 A	3,466,495.00	2.23
9	688578	艾力斯	3,330,667.17	2.15
10	002706	良信股份	3,314,375.00	2.13
11	300596	利安隆	3,158,032.00	2.03
12	688776	国光电气	3,058,452.26	1.97
13	002901	大博医疗	3,028,476.00	1.95
14	002866	传艺科技	3,007,616.00	1.94
15	688016	心脉医疗	2,965,212.61	1.91
16	002961	瑞达期货	2,875,697.00	1.85
17	688167	炬光科技	2,780,709.41	1.79
18	600888	新疆众和	2,780,099.00	1.79
19	000828	东莞控股	2,745,427.00	1.77
20	601137	博威合金	2,716,901.00	1.75

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	688018	乐鑫科技	4,391,423.48	2.83
2	688209	英集芯	3,796,920.46	2.45
3	600882	妙可蓝多	3,773,104.00	2.43
4	000032	深桑达A	3,632,706.00	2.34
5	601137	博威合金	3,589,610.00	2.31
6	002706	良信股份	3,586,231.00	2.31
7	300662	科锐国际	3,521,702.00	2.27
8	002866	传艺科技	3,406,606.00	2.19
9	688578	艾力斯	3,404,054.44	2.19
10	603171	税友股份	3,393,860.00	2.19
11	603530	神马电力	2,982,403.00	1.92
12	600216	浙江医药	2,927,861.00	1.89
13	603236	移远通信	2,835,327.00	1.83
14	300768	迪普科技	2,825,060.00	1.82
15	002206	海利得	2,713,027.00	1.75
16	601001	晋控煤业	2,672,792.00	1.72
17	002516	旷达科技	2,661,121.00	1.71
18	300638	广和通	2,647,069.40	1.70
19	002961	瑞达期货	2,634,754.00	1.70
20	688088	虹软科技	2,519,847.66	1.62

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	777,991,457.38
卖出股票收入（成交）总额	777,211,796.37

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	7,491,053.49	5.41
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	7,491,053.49	5.41

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	019733	24国债02	56,000	5,660,091.84	4.09
2	019727	23国债24	15,000	1,527,285.62	1.10
3	019698	23国债05	3,000	303,676.03	0.22

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	107,159.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,159.11

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 中证1 000指 数增 强A	2,2 38	53,171.44	23,368,290.29	19.6 4%	95,629,381.30	80.36%
博道 中证1 000指 数增 强C	1,6 26	22,179.63	31,012,808.33	85.9 9%	5,051,262.69	14.01%
合计	3,8 43	40,349.14	54,381,098.62	35.0 7%	100,680,643.99	64.93%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	博道中证1000指 数增强A	3,863,620.33	3.25%
	博道中证1000指 数增强C	181.07	0.00%
	合计	3,863,801.40	2.49%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	博道中证1000指数 增强A	>100
	博道中证1000指数 增强C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	博道中证1000指数 增强A	>100
	博道中证1000指数 增强C	0
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道中证1000指数增强 A	博道中证1000指数增强 C
基金合同生效日(2023年08月25 日)基金份额总额	183,043,218.65	39,544,164.96
本报告期期初基金份额总额	118,599,663.08	37,628,759.48
本报告期基金总申购份额	32,085,450.86	4,396,199.87
减：本报告期基金总赎回份额	31,687,442.35	5,960,888.33

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	118,997,671.59	36,064,071.02

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，史伟先生不再担任公司副总经理。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	1,554,404,152.44	100.00%	499,400.73	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	12,333,605.00	100.00%	50,303,000.00	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，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
 - (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；
 - (4) 具有较强的为投资人提供资产配置及服务的能力，包括但不限于：产品筛选及评审流程完整，具有较为完善的资产配置，客户服务及陪伴体系等。
- 3、基金交易单元的选择程序如下：
 - (1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
 - (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧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	2024-01-12
2	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024-01-22
3	博道中证1000指数增强型证券投资基金2023年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
4	博道基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	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	2024-02-08
5	博道基金管理有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为博道中证1000指数增强型证券投资基金销售机构的公告	证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-05
6	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、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
7	博道中证1000指数增强型证券投资基金2023年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
8	博道基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024-04-22
9	博道中证1000指数增强型证券投资基金2024年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
10	博道基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券报、	2024-06-07

	提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	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	
11	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-26
12	博道基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27
13	博道中证1000指数增强型证券投资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	2024-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240130 - 20240318	30,012,083.33	-	-	30,012,083.33	19.35%

产品特有风险

本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道中证1000指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》；

- 4、《博道中证1000指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道中证1000指数增强型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道中证1000指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日