

# 博道中证 500 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	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	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	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§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	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
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.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
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.....	69
§11 备查文件目录.....	70
11.1 备查文件目录.....	70
11.2 存放地点.....	70
11.3 查阅方式.....	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博道中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	博道中证500增强	
基金主代码	006593	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年01月03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	1,013,339,816.48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500增强A	博道中证500增强C
下属分级基金的交易代码	006593	006594
报告期末下属分级基金的份额总额	687,455,997.16份	325,883,819.32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500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	中证500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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	博道中证500增强A	博道中证500增强C
本期已实现收益	-4,270,260.26	-2,803,463.96
本期利润	-38,616,790.25	-19,601,057.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0507	-0.0592
本期加权平均净值利润率	-3.41%	-4.06%
本期基金份额净值增长率	-3.52%	-3.67%
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	251,671,121.20	110,821,620.85
期末可供分配基金份额利润	0.3661	0.3401
期末基金资产净值	1,006,723,088.33	468,721,651.59
期末基金份额净值	1.4644	1.4383
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	77.06%	74.18%

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500增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.29%	0.88%	-6.55%	0.91%	2.26%	-0.03%
过去三个月	-2.16%	1.05%	-6.16%	1.09%	4.00%	-0.04%
过去六个月	-3.52%	1.57%	-8.46%	1.53%	4.94%	0.04%
过去一年	-10.54%	1.22%	-16.71%	1.21%	6.17%	0.01%
过去三年	-21.18%	1.17%	-26.01%	1.14%	4.83%	0.03%
自基金合同生效起至今	77.06%	1.25%	19.33%	1.25%	57.73%	0.00%

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500增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.31%	0.88%	-6.55%	0.91%	2.24%	-0.03%
过去三个月	-2.24%	1.05%	-6.16%	1.09%	3.92%	-0.04%
过去六个月	-3.67%	1.57%	-8.46%	1.53%	4.79%	0.04%
过去一年	-10.80%	1.22%	-16.71%	1.21%	5.91%	0.01%
过去三年	-21.88%	1.17%	-26.01%	1.14%	4.13%	0.03%
自基金合同生效起至今	74.18%	1.25%	19.33%	1.25%	54.85%	0.00%

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500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01月03日-2024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。

博道中证500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01月03日-2024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、博道红利智航股票的基金经理、量化投资总监兼量	2019-01-03	-	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理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入

	化投资部总经理			<p>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2024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。</p>
--	---------	--	--	---

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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500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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	52,463,917.73	43,262,944.06
结算备付金		4,600.81	4,566.23
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,440,229,568.44	2,076,835,545.46
其中：股票投资		1,364,742,004.04	1,965,337,529.01
基金投资		-	-
债券投资		75,487,564.40	111,498,016.45
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		767,607.85	1,133,533.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,493,465,694.83	2,121,236,589.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		15,000,000.00	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,503,379.31	2,226,803.52
应付管理人报酬		923,298.16	1,353,276.98
应付托管费		123,106.42	180,436.94
应付销售服务费		114,466.96	216,420.60
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	356,704.06	309,424.87
负债合计		18,020,954.91	4,286,362.91
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,013,339,816.48	1,403,908,321.06
未分配利润	6.4.7.8	462,104,923.44	713,041,905.30
净资产合计		1,475,444,739.92	2,116,950,226.36
负债和净资产总计		1,493,465,694.83	2,121,236,589.27

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500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06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-50,433,070.22	67,056,643.24
1.利息收入		140,572.41	320,624.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	140,572.20	320,624.16
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		0.21	0.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		411,789.96	29,620,048.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,178,160.29	-2,098,355.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	631,780.31	1,477,103.47
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	18,958,169.94	30,241,301.34
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	-51,144,123.24	36,814,822.75
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	158,690.65	301,147.04
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,784,777.24</b>	<b>12,551,353.51</b>
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	6,015,637.13	9,631,706.23
2.托管费	6.4.10.2.2	802,084.97	1,284,227.48
3.销售服务费		719,245.14	1,219,496.98
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		5,376.35	88,741.82
其中：卖出回购金融资产支出		5,376.35	88,741.82
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	2.51

8.其他费用	6.4.7.17	242,433.65	327,178.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-58,217,847.46	54,505,289.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-58,217,847.46	54,505,289.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-58,217,847.46	54,505,289.73

### 6.3 净资产变动表

会计主体：博道中证500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	1,403,908,321.06	713,041,905.30	2,116,950,226.36
二、本期期初净资产	1,403,908,321.06	713,041,905.30	2,116,950,226.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-390,568,504.58	-250,936,981.86	-641,505,486.44
（一）、综合收益总额	-	-58,217,847.46	-58,217,847.46
（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）	-390,568,504.58	-192,719,134.40	-583,287,638.98
其中：1.基金申购款	118,279,137.98	55,331,351.35	173,610,489.33

2.基金赎回款	-508,847,642.56	-248,050,485.75	-756,898,128.31
(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	1,013,339,816.48	462,104,923.44	1,475,444,739.92
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	1,473,924,036.02	1,154,927,599.22	2,628,851,635.24
二、本期期初净资产	1,473,924,036.02	1,154,927,599.22	2,628,851,635.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	74,090,794.85	-184,567,250.90	-110,476,456.05
(一)、综合收益总额	-	54,505,289.73	54,505,289.73
(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)	74,090,794.85	33,367,368.71	107,458,163.56
其中：1.基金申购款	501,449,092.71	396,111,439.83	897,560,532.54
2.基金赎回款	-427,358,297.86	-362,744,071.12	-790,102,368.98
(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)	-	-272,439,909.34	-272,439,909.34

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	1,548,014,830.87	970,360,348.32	2,518,375,179.19

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500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[2018]1696号《关于准予博道中证500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500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430,277,747.27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0002号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于2019年1月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为430,557,404.42份基金份额，其中认购资金利息折合279,657.15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500指数增强型证券投资基金基金合同》和《博道中证500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《博道中证500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中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×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500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	3,213,459.92
等于：本金	3,213,158.67
加：应计利息	301.25
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	49,250,457.81
等于：本金	49,243,795.86
加：应计利息	6,661.95
减：坏账准备	-
合计	52,463,917.73

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		1,436,370,187.96	-	1,364,742,004.04	-71,628,183.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	75,067,704.55	462,994.40	75,487,564.40	-43,134.55
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	75,067,704.55	462,994.40	75,487,564.40	-43,134.55
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,511,437,892.51	462,994.40	1,440,229,568.44	-71,671,318.47

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	315.20
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	49,726.04
预提费用-信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	217,524.98
其他应付	29,465.50
合计	356,704.06

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 博道中证500增强A

金额单位：人民币元

项目 (博道中证500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	837,196,066.97	837,196,066.97
本期申购	70,510,286.94	70,510,286.94
本期赎回（以“-”号填列）	-220,250,356.75	-220,250,356.75
本期末	687,455,997.16	687,455,997.16

##### 6.4.7.7.2 博道中证500增强C

金额单位：人民币元

项目 (博道中证500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	566,712,254.09	566,712,254.09
本期申购	47,768,851.04	47,768,851.04

本期赎回（以“-”号填列）	-288,597,285.81	-288,597,285.81
本期末	325,883,819.32	325,883,819.32

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500增强A

单位：人民币元

项目 (博道中证500增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	307,231,690.37	126,369,091.12	433,600,781.49
本期期初	307,231,690.37	126,369,091.12	433,600,781.49
本期利润	-4,270,260.26	-34,346,529.99	-38,616,790.25
本期基金份额交易产生的变动数	-51,290,308.91	-24,426,591.16	-75,716,900.07
其中：基金申购款	22,284,388.68	11,400,955.15	33,685,343.83
基金赎回款	-73,574,697.59	-35,827,546.31	-109,402,243.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	251,671,121.20	67,595,969.97	319,267,091.17

##### 6.4.7.8.2 博道中证500增强C

单位：人民币元

项目 (博道中证500增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	194,481,004.60	84,960,119.21	279,441,123.81
本期期初	194,481,004.60	84,960,119.21	279,441,123.81
本期利润	-2,803,463.96	-16,797,593.25	-19,601,057.21
本期基金份额交易产生的变动数	-80,855,919.79	-36,146,314.54	-117,002,234.33
其中：基金申购款	14,914,371.29	6,731,636.23	21,646,007.52
基金赎回款	-95,770,291.08	-42,877,950.77	-138,648,241.85

本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,821,620.85	32,016,211.42	142,837,832.27

#### 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	5,241.79	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	135,295.83	
结算备付金利息收入	34.58	
其他	-	
合计	140,572.20	

#### 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	9,110,865,559.51	
减：卖出股票成本总额	9,115,141,740.43	
减：交易费用	14,901,979.37	
买卖股票差价收入	-19,178,160.29	

#### 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	862,603.01	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-230,822.70	
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	631,780.31

#### 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	129,832,343.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	127,777,459.13
减：应计利息总额	2,285,281.43
减：交易费用	425.57
买卖债券差价收入	-230,822.70

#### 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	18,958,169.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,958,169.94

#### 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	-51,144,123.24
——股票投资	-51,295,496.37
——债券投资	151,373.13
——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	-51,144,123.24

#### 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	157,103.02
转换费收入	1,587.63
合计	158,690.65

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	49,726.04
信息披露费	59,672.34
汇划手续费	4,701.67
指数使用费	128,333.60
合计	242,433.65

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。

#### 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、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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,015,637.13	9,631,706.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,050,688.65	3,031,978.16
应支付基金管理人的净管理费	3,964,948.48	6,599,728.07

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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日

当期发生的基金应支付的托管费	802,084.97	1,284,227.48
----------------	------------	--------------

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 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500增强A	博道中证500增强C	合计
博道基金管理有限公司	-	43,737.16	43,737.16
招商银行股份有限公司	-	84,452.44	84,452.44
合计	-	128,189.60	128,189.60
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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500增强A	博道中证500增强C	合计
博道基金管理有限公司	-	245,469.19	245,469.19
招商银行股份有限公司	-	95,166.54	95,166.54
合计	-	340,635.73	340,635.73

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0.30%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×0.30%/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500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	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	1,999,600.08
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	-	1,140,000.00
报告期末持有的基金份额	-	859,600.08
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.09%

博道中证500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	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	620,000.00	1,000,000.00
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	-	380,000.00
报告期末持有的基金份额	620,000.00	620,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.19%	0.10%

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

上海博道投资管理有限公司及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，上海博道投资管理有限公司及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		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	3,213,459.92	5,241.79	2,844,111.88	4,852.70

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	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	科创板打新限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	科创板打新限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月以上	创业板打	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

				新限售						
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	科创板打新限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	创业板打新限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	创业板打新限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	创业板打新限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	科创板打新限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月以上	创业板打新限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-

				售						
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	创业板打新限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	创业板打新限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	主板打新限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	创业板打新限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	科创板打新限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
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	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	创业板打新限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆	2024-01-0	6个月以	主板	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-

	技术	3	上	打新限售						
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	主板打新限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	主板打新限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	主板打新限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	主板打新限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	主板打新限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	主板打新限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	主板打新限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	主板打新限售送股	-	15.25	40	-	610.00	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	主板打新限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

6033 50	安乃 达	2024 -06-2 6	6个月以 上	主板 打新 限售	20.56	20.56	106	2,17 9.36	2,17 9.36	-
------------	---------	--------------------	-----------	----------------	-------	-------	-----	--------------	--------------	---

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

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6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15,000,000.00元，截至2024年7月1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，其他存款存放于国金证券股份有限公

司、东方财富证券股份有限公司，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15,000,000.00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0.04%。

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1,491,421,648.06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	52,463,917.73	-	-	-	-	-	52,463,917.73
结算备付金	4,600.81	-	-	-	-	-	4,600.81
交易性金融资产	-	-	75,487,564.40	-	-	1,364,742,004.04	1,440,229,568.44
应收申购款	-	-	-	-	-	767,607.85	767,607.85
资产总计	52,468,518.54	-	75,487,564.40	-	-	1,365,509,611.89	1,493,465,694.83
负债							
卖出回购金融资产款	15,000,000.00	-	-	-	-	-	15,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,503,379.31	1,503,379.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	923,298.16	923,298.16
应付托管费	-	-	-	-	-	123,106.42	123,106.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	114,466.96	114,466.96
其他负债	-	-	-	-	-	356,704.06	356,704.06
负债总计	15,000,000.00	-	-	-	-	3,020,954.91	18,020,954.91
利率敏感度缺口	37,468,518.54	-	75,487,564.40	-	-	1,362,488,656.98	1,475,444,739.92
上年度末 2023年 12月31	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

日							
资产							
货币资金	43,262,944.06	-	-	-	-	-	43,262,944.06
结算备付金	4,566.23	-	-	-	-	-	4,566.23
交易性金融资产	-	-	111,498,016.45	-	-	1,965,337,529.01	2,076,835,545.46
应收申购款	-	-	-	-	-	1,133,533.52	1,133,533.52
资产总计	43,267,510.29	-	111,498,016.45	-	-	1,966,471,062.53	2,121,236,589.27
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,226,803.52	2,226,803.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,353,276.98	1,353,276.98
应付托管费	-	-	-	-	-	180,436.94	180,436.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	216,420.60	216,420.60
其他负债	-	-	-	-	-	309,424.87	309,424.87
负债总计	-	-	-	-	-	4,286,362.91	4,286,362.91
利率敏感度缺口	43,267,510.29	-	111,498,016.45	-	-	1,962,184,699.62	2,116,950,226.36

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5.12% (2023年12月31日：5.27%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (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 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	1,364,742,004.04	92.50	1,965,337,529.01	92.84
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	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	1,364,742,004.04	92.50	1,965,337,529.01	92.84

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500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500指数收益率上升5%	64,511,245.97	96,909,314.03
	2.中证500指数收益率下降5%	-64,511,245.97	-96,909,314.03

#### 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	1,364,208,616.88	1,964,014,164.82
第二层次	75,533,175.51	111,498,016.45
第三层次	487,776.05	1,323,364.19
合计	1,440,229,568.44	2,076,835,545.46

#### 6.4.14.2 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	1,364,742,004.04	91.38
	其中：股票	1,364,742,004.04	91.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,487,564.40	5.05
	其中：债券	75,487,564.40	5.05
	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	52,468,518.54	3.51
8	其他各项资产	767,607.85	0.05
9	合计	1,493,465,694.83	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	4,463,926.00	0.30
B	采矿业	87,356,422.34	5.92
C	制造业	746,163,287.01	50.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,957,935.20	3.93
E	建筑业	8,952,660.00	0.61
F	批发和零售业	10,323,172.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	26,696,492.00	1.81
H	住宿和餐饮业	456,950.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,825,308.00	6.16
J	金融业	112,442,153.30	7.62
K	房地产业	3,570,336.00	0.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,146,682.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	437,759.00	0.03

R	文化、体育和娱乐业	6,395,886.42	0.43
S	综合	-	-
	合计	1,159,188,969.27	78.57

### 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	-	-
C	制造业	168,300,191.67	11.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,873,761.00	0.13
E	建筑业	657,378.00	0.04
F	批发和零售业	7,678,336.00	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	3,388,803.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,175,492.38	0.89
J	金融业	4,345,514.00	0.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,991,721.00	0.27
M	科学研究和技术服务业	756,789.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	1,041,536.72	0.07
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	-	-
S	综合	343,512.00	0.02
	合计	205,553,034.77	13.93



## 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	000728	国元证券	2,880,700	17,457,042.00	1.18
2	600549	厦门钨业	1,005,000	17,336,250.00	1.17
3	000513	丽珠集团	461,955	17,189,345.55	1.17
4	300529	健帆生物	618,100	16,818,501.00	1.14
5	600096	云天化	847,800	16,464,276.00	1.12
6	600566	济川药业	494,000	15,664,740.00	1.06
7	600873	梅花生物	1,559,000	15,621,180.00	1.06
8	600282	南钢股份	3,131,100	15,592,878.00	1.06
9	600909	华安证券	3,651,380	15,372,309.80	1.04
10	002340	格林美	2,409,700	15,349,789.00	1.04
11	601058	赛轮轮胎	1,094,600	15,324,400.00	1.04
12	002558	巨人网络	1,545,400	14,588,576.00	0.99
13	603379	三美股份	372,600	14,583,564.00	0.99
14	603658	安图生物	304,579	14,031,954.53	0.95
15	600380	健康元	1,242,900	13,883,193.00	0.94
16	601077	渝农商行	2,677,200	13,439,544.00	0.91
17	300207	欣旺达	863,600	13,100,812.00	0.89
18	600988	赤峰黄金	757,184	12,372,386.56	0.84
19	300394	天孚通信	134,900	11,927,858.00	0.81
20	002436	兴森科技	1,135,100	11,714,232.00	0.79
21	002078	太阳纸业	819,400	11,430,630.00	0.77
22	603338	浙江鼎力	185,900	11,232,078.00	0.76

23	600348	华阳股份	1,057,150	10,529,214.00	0.71
24	603786	科博达	160,300	10,283,245.00	0.70
25	601958	金钼股份	969,900	10,096,659.00	0.68
26	300296	利亚德	2,233,100	10,048,950.00	0.68
27	300601	康泰生物	635,840	9,925,462.40	0.67
28	002268	电科网安	694,600	9,884,158.00	0.67
29	600377	宁沪高速	780,300	9,831,780.00	0.67
30	000997	新大陆	701,000	9,750,910.00	0.66
31	000156	华数传媒	1,530,300	9,610,284.00	0.65
32	600985	淮北矿业	566,482	9,482,908.68	0.64
33	002465	海格通信	914,600	9,475,256.00	0.64
34	002518	科士达	527,400	9,334,980.00	0.63
35	600956	新天绿能	1,130,900	9,239,453.00	0.63
36	603056	德邦股份	700,200	9,172,620.00	0.62
37	601991	大唐发电	3,001,000	9,033,010.00	0.61
38	002138	顺络电子	322,340	8,851,456.40	0.60
39	002384	东山精密	427,200	8,843,040.00	0.60
40	600863	内蒙华电	1,905,600	8,841,984.00	0.60
41	000921	海信家电	271,600	8,756,384.00	0.59
42	300136	信维通信	447,100	8,754,218.00	0.59
43	601128	常熟银行	1,136,260	8,601,488.20	0.58
44	000738	航发控制	426,500	8,559,855.00	0.58
45	688772	珠海冠宇	573,918	8,551,378.20	0.58
46	601555	东吴证券	1,394,000	8,224,600.00	0.56
47	002240	盛新锂能	611,500	8,206,330.00	0.56
48	603298	杭叉集团	407,620	8,005,656.80	0.54
49	002273	水晶光电	469,639	7,974,470.22	0.54
50	603305	旭升集团	726,600	7,672,896.00	0.52
51	000830	鲁西化工	646,500	7,492,935.00	0.51
52	002532	天山铝业	915,400	7,423,894.00	0.50
53	600704	物产中大	1,699,900	7,377,566.00	0.50

54	603486	科沃斯	155,500	7,336,490.00	0.50
55	688169	石头科技	18,600	7,302,360.00	0.49
56	002683	广东宏大	359,100	7,228,683.00	0.49
57	688276	百克生物	248,291	7,044,015.67	0.48
58	000960	锡业股份	454,493	7,040,096.57	0.48
59	000683	远兴能源	1,005,200	6,945,932.00	0.47
60	600521	华海药业	406,600	6,932,530.00	0.47
61	603160	汇顶科技	100,100	6,881,875.00	0.47
62	600642	申能股份	778,600	6,875,038.00	0.47
63	300502	新易盛	65,100	6,871,305.00	0.47
64	600967	内蒙一机	953,000	6,861,600.00	0.47
65	002008	大族激光	328,485	6,832,488.00	0.46
66	601717	郑煤机	459,200	6,796,160.00	0.46
67	002624	完美世界	893,800	6,792,880.00	0.46
68	300861	美畅股份	348,290	6,739,411.50	0.46
69	600298	安琪酵母	240,600	6,719,958.00	0.46
70	000703	恒逸石化	946,300	6,709,267.00	0.45
71	603456	九洲药业	479,400	6,577,368.00	0.45
72	002563	森马服饰	1,127,800	6,552,518.00	0.44
73	002223	鱼跃医疗	174,000	6,542,400.00	0.44
74	000883	湖北能源	1,077,700	6,476,977.00	0.44
75	002128	电投能源	306,195	6,460,714.50	0.44
76	300002	神州泰岳	791,300	6,425,356.00	0.44
77	600060	海信视像	258,800	6,402,712.00	0.43
78	600968	海油发展	1,500,400	6,181,648.00	0.42
79	688213	思特威	126,800	6,149,800.00	0.42
80	600901	江苏金租	1,199,120	6,055,556.00	0.41
81	000887	中鼎股份	493,500	6,040,440.00	0.41
82	601636	旗滨集团	929,000	5,992,050.00	0.41
83	600329	达仁堂	181,500	5,878,785.00	0.40
84	600062	华润双鹤	299,900	5,872,042.00	0.40

85	002557	洽洽食品	208,100	5,866,339.00	0.40
86	002372	伟星新材	380,100	5,861,142.00	0.40
87	002414	高德红外	994,200	5,855,838.00	0.40
88	601139	深圳燃气	875,530	5,848,540.40	0.40
89	688234	天岳先进	122,800	5,761,776.00	0.39
90	601990	南京证券	733,900	5,636,352.00	0.38
91	600299	安迪苏	579,800	5,624,060.00	0.38
92	002368	太极股份	248,700	5,608,185.00	0.38
93	600399	抚顺特钢	992,900	5,590,027.00	0.38
94	600906	财达证券	972,800	5,574,144.00	0.38
95	600529	山东药玻	219,700	5,567,198.00	0.38
96	000559	万向钱潮	1,244,900	5,552,254.00	0.38
97	600315	上海家化	306,400	5,447,792.00	0.37
98	601598	中国外运	960,700	5,408,741.00	0.37
99	300390	天华新能	314,500	5,403,110.00	0.37
100	603317	天味食品	456,044	5,203,462.04	0.35
101	601198	东兴证券	642,600	5,115,096.00	0.35
102	002423	中粮资本	679,900	5,092,451.00	0.35
103	001203	大中矿业	524,000	5,035,640.00	0.34
104	600177	雅戈尔	689,600	4,909,952.00	0.33
105	000878	云南铜业	385,100	4,798,346.00	0.33
106	002056	横店东磁	383,800	4,785,986.00	0.32
107	600126	杭钢股份	1,147,000	4,714,170.00	0.32
108	688475	萤石网络	138,017	4,707,759.87	0.32
109	600737	中粮糖业	480,800	4,610,872.00	0.31
110	600598	北大荒	357,400	4,463,926.00	0.30
111	002155	湖南黄金	244,500	4,425,450.00	0.30
112	002984	森麒麟	180,300	4,343,427.00	0.29
113	002025	航天电器	93,100	4,317,978.00	0.29
114	300724	捷佳伟创	79,300	4,282,993.00	0.29
115	300054	鼎龙股份	188,068	4,265,382.24	0.29

116	002939	长城证券	594,429	3,982,674.30	0.27
117	000937	冀中能源	594,300	3,981,810.00	0.27
118	301029	怡合达	193,400	3,802,244.00	0.26
119	002966	苏州银行	495,100	3,713,250.00	0.25
120	600416	湘电股份	372,300	3,700,662.00	0.25
121	600008	首创环保	1,365,510	3,659,566.80	0.25
122	600499	科达制造	432,600	3,646,818.00	0.25
123	600038	中直股份	87,500	3,597,125.00	0.24
124	600663	陆家嘴	404,800	3,570,336.00	0.24
125	002958	青农商行	1,286,700	3,448,356.00	0.23
126	601567	三星医疗	98,400	3,444,000.00	0.23
127	002595	豪迈科技	88,120	3,363,540.40	0.23
128	000630	铜陵有色	921,400	3,326,254.00	0.23
129	688029	南微医学	53,082	3,267,727.92	0.22
130	301236	软通动力	92,300	3,249,883.00	0.22
131	601016	节能风电	1,067,200	3,190,928.00	0.22
132	603568	伟明环保	152,900	3,146,682.00	0.21
133	600546	山煤国际	214,800	3,140,376.00	0.21
134	600699	均胜电子	209,000	3,097,380.00	0.21
135	688188	柏楚电子	16,600	3,063,530.00	0.21
136	600170	上海建工	1,424,800	3,063,320.00	0.21
137	603156	养元饮品	137,100	2,916,117.00	0.20
138	002791	坚朗五金	112,400	2,907,788.00	0.20
139	002195	岩山科技	1,136,200	2,851,862.00	0.19
140	601168	西部矿业	156,200	2,803,790.00	0.19
141	002028	思源电气	41,800	2,796,420.00	0.19
142	000423	东阿阿胶	44,500	2,785,700.00	0.19
143	002500	山西证券	591,400	2,779,580.00	0.19
144	600497	驰宏锌锗	505,800	2,700,972.00	0.18
145	601608	中信重工	685,400	2,611,374.00	0.18
146	601966	玲珑轮胎	141,200	2,593,844.00	0.18

147	300568	星源材质	304,400	2,496,080.00	0.17
148	600885	宏发股份	89,000	2,463,520.00	0.17
149	300017	网宿科技	306,700	2,422,930.00	0.16
150	601019	山东出版	199,500	2,358,090.00	0.16
151	000032	深桑达 A	151,600	2,270,968.00	0.15
152	600369	西南证券	632,500	2,264,350.00	0.15
153	300373	扬杰科技	57,700	2,244,530.00	0.15
154	002261	拓维信息	201,400	2,229,498.00	0.15
155	601928	凤凰传媒	194,900	2,136,104.00	0.14
156	300383	光环新网	251,400	2,124,330.00	0.14
157	000750	国海证券	719,500	2,093,745.00	0.14
158	002430	杭氧股份	93,600	2,082,600.00	0.14
159	002152	广电运通	198,600	2,077,356.00	0.14
160	600066	宇通客车	79,710	2,056,518.00	0.14
161	601233	桐昆股份	127,150	2,029,314.00	0.14
162	002867	周大生	154,400	2,016,464.00	0.14
163	600316	洪都航空	120,600	2,005,578.00	0.14
164	600339	中油工程	620,900	1,937,208.00	0.13
165	002507	涪陵榨菜	153,799	1,884,037.75	0.13
166	600481	双良节能	401,000	1,872,670.00	0.13
167	000729	燕京啤酒	209,700	1,851,651.00	0.13
168	003022	联泓新科	132,800	1,820,688.00	0.12
169	601666	平煤股份	156,578	1,753,673.60	0.12
170	000818	航锦科技	78,500	1,733,280.00	0.12
171	688348	昱能科技	28,951	1,708,109.00	0.12
172	600970	中材国际	139,400	1,681,164.00	0.11
173	002531	天顺风能	184,700	1,651,218.00	0.11
174	002439	启明星辰	95,000	1,639,700.00	0.11
175	300604	长川科技	57,900	1,573,143.00	0.11
176	300251	光线传媒	181,300	1,524,733.00	0.10
177	603529	爱玛科技	53,500	1,462,155.00	0.10

178	603228	景旺电子	45,300	1,440,540.00	0.10
179	600486	扬农化工	25,103	1,417,064.35	0.10
180	000563	陕国投 A	513,800	1,412,950.00	0.10
181	002065	东华软件	311,900	1,409,788.00	0.10
182	603728	鸣志电器	34,900	1,404,027.00	0.10
183	002429	兆驰股份	281,900	1,355,939.00	0.09
184	600578	京能电力	415,200	1,345,248.00	0.09
185	688617	惠泰医疗	2,800	1,277,080.00	0.09
186	002517	恺英网络	122,600	1,170,830.00	0.08
187	600583	海油工程	196,700	1,162,497.00	0.08
188	000598	兴蓉环境	145,400	1,093,408.00	0.07
189	603688	石英股份	36,600	1,083,726.00	0.07
190	601866	中远海发	398,200	1,027,356.00	0.07
191	601231	环旭电子	63,900	1,025,595.00	0.07
192	600995	南网储能	101,200	977,592.00	0.07
193	603444	吉比特	5,400	961,254.00	0.07
194	000155	川能动力	87,000	936,990.00	0.06
195	601997	贵阳银行	176,800	931,736.00	0.06
196	600827	百联股份	125,900	929,142.00	0.06
197	603000	人民网	44,600	891,554.00	0.06
198	000400	许继电气	25,800	887,778.00	0.06
199	002945	华林证券	88,500	883,230.00	0.06
200	000933	神火股份	41,000	829,430.00	0.06
201	300009	安科生物	77,300	660,142.00	0.04
202	601228	广州港	214,200	653,310.00	0.04
203	601216	君正集团	173,700	640,953.00	0.04
204	600079	人福医药	36,300	623,271.00	0.04
205	600350	山东高速	68,100	602,685.00	0.04
206	600879	航天电子	71,100	552,447.00	0.04
207	301165	锐捷网络	17,600	525,184.00	0.04
208	600258	首旅酒店	37,000	456,950.00	0.03

209	000958	电投产融	120,000	439,200.00	0.03
210	002625	光启技术	25,300	438,955.00	0.03
211	603882	金城医学	16,100	437,759.00	0.03
212	688819	天能股份	17,600	419,936.00	0.03
213	601098	中南传媒	30,351	376,959.42	0.03
214	000783	长江证券	75,300	363,699.00	0.02
215	603225	新凤鸣	21,900	341,421.00	0.02
216	300073	当升科技	9,100	312,221.00	0.02
217	688301	奕瑞科技	2,520	290,379.60	0.02

### 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	002660	茂硕电源	1,052,000	7,805,840.00	0.53
2	002201	正威新材	1,429,300	6,760,589.00	0.46
3	603577	汇金通	957,080	6,642,135.20	0.45
4	002578	闽发铝业	2,217,500	5,832,025.00	0.40
5	002879	长缆科技	412,400	5,414,812.00	0.37
6	301193	家联科技	333,400	5,321,064.00	0.36
7	601616	广电电气	1,811,900	5,272,629.00	0.36
8	688800	瑞可达	179,600	5,043,168.00	0.34
9	002824	和胜股份	386,142	4,927,171.92	0.33
10	688151	华强科技	376,055	4,681,884.75	0.32
11	605333	沪光股份	167,300	4,659,305.00	0.32
12	600184	光电股份	491,175	4,179,899.25	0.28
13	603353	和顺石油	294,100	3,811,536.00	0.26
14	002451	摩恩电气	679,500	3,648,915.00	0.25
15	688049	炬芯科技	161,249	3,566,827.88	0.24
16	605080	浙江自然	221,200	3,499,384.00	0.24



17	601700	风范股份	797,100	3,499,269.00	0.24
18	001234	泰慕士	199,700	3,392,903.00	0.23
19	001202	炬申股份	299,100	3,388,803.00	0.23
20	603948	建业股份	204,300	3,326,004.00	0.23
21	002900	哈三联	358,200	3,288,276.00	0.22
22	001228	永泰运	154,000	3,246,320.00	0.22
23	603408	建霖家居	245,900	3,243,421.00	0.22
24	002589	瑞康医药	1,447,600	3,184,720.00	0.22
25	000533	顺钠股份	943,200	3,103,128.00	0.21
26	300743	天地数码	221,200	2,995,048.00	0.20
27	300424	航新科技	234,800	2,871,604.00	0.19
28	000409	云鼎科技	353,500	2,852,745.00	0.19
29	300872	天阳科技	214,300	2,839,475.00	0.19
30	002404	嘉欣丝绸	526,400	2,784,656.00	0.19
31	002095	生意宝	225,139	2,755,701.36	0.19
32	601398	工商银行	456,100	2,599,770.00	0.18
33	002897	意华股份	60,800	2,289,728.00	0.16
34	002026	山东威达	267,900	2,223,570.00	0.15
35	600114	东睦股份	152,900	2,200,231.00	0.15
36	603278	大业股份	334,500	2,077,245.00	0.14
37	002137	实益达	421,600	2,006,816.00	0.14
38	000990	诚志股份	265,300	1,973,832.00	0.13
39	688287	观典防务	368,400	1,937,784.00	0.13
40	688766	普冉股份	19,661	1,910,459.37	0.13
41	000605	渤海股份	404,700	1,873,761.00	0.13
42	002692	远程股份	555,600	1,861,260.00	0.13
43	002469	三维化学	320,700	1,827,990.00	0.12
44	003019	宸展光电	69,236	1,753,747.88	0.12
45	601288	农业银行	400,400	1,745,744.00	0.12
46	600202	哈空调	487,100	1,738,947.00	0.12
47	002035	华帝股份	273,800	1,705,774.00	0.12

48	603556	海兴电力	33,455	1,566,697.65	0.11
49	603897	长城科技	87,800	1,540,890.00	0.10
50	002418	康盛股份	725,700	1,371,573.00	0.09
51	601500	通用股份	252,200	1,346,748.00	0.09
52	000561	烽火电子	173,100	1,109,571.00	0.08
53	002296	辉煌科技	104,700	1,079,457.00	0.07
54	301299	卓创资讯	24,600	1,033,200.00	0.07
55	688480	赛恩斯	36,664	1,021,459.04	0.07
56	000551	创元科技	111,400	972,522.00	0.07
57	000550	江铃汽车	44,500	966,095.00	0.07
58	000020	深华发 A	95,300	943,470.00	0.06
59	002876	三利谱	38,200	921,384.00	0.06
60	300681	英搏尔	69,200	902,368.00	0.06
61	301419	阿莱德	36,000	893,880.00	0.06
62	000951	中国重汽	62,200	890,704.00	0.06
63	000555	神州信息	94,100	877,012.00	0.06
64	603536	惠发食品	110,800	876,428.00	0.06
65	600160	巨化股份	36,300	875,919.00	0.06
66	002863	今飞凯达	214,000	870,980.00	0.06
67	601956	东贝集团	187,800	860,124.00	0.06
68	002829	星网宇达	64,100	858,299.00	0.06
69	600488	津药药业	250,200	858,186.00	0.06
70	000333	美的集团	13,300	857,850.00	0.06
71	300673	佩蒂股份	64,500	846,240.00	0.06
72	688665	四方光电	30,200	837,748.00	0.06
73	603380	易德龙	41,700	837,336.00	0.06
74	003025	思进智能	66,800	822,308.00	0.06
75	688435	英方软件	32,400	808,704.00	0.05
76	000521	长虹美菱	106,600	808,028.00	0.05
77	600237	铜峰电子	146,200	763,164.00	0.05
78	300825	阿尔特	78,100	756,789.00	0.05

79	002878	元隆雅图	59,300	745,401.00	0.05
80	300952	恒辉安防	42,800	742,152.00	0.05
81	600406	国电南瑞	28,500	711,360.00	0.05
82	605007	五洲特纸	55,100	695,913.00	0.05
83	301088	戎美股份	60,900	682,080.00	0.05
84	002687	乔治白	158,700	666,540.00	0.05
85	300856	科思股份	20,800	665,808.00	0.05
86	601668	中国建筑	123,800	657,378.00	0.04
87	002722	物产金轮	52,100	588,730.00	0.04
88	600222	太龙药业	139,600	586,320.00	0.04
89	300771	智莱科技	66,100	581,019.00	0.04
90	002860	星帅尔	66,300	542,997.00	0.04
91	603052	可川科技	18,707	526,602.05	0.04
92	002333	罗普斯金	96,900	520,353.00	0.04
93	002787	华源控股	74,800	505,648.00	0.03
94	002380	科远智慧	27,600	505,080.00	0.03
95	002090	金智科技	57,500	496,800.00	0.03
96	300102	乾照光电	67,400	432,708.00	0.03
97	000404	长虹华意	77,600	413,608.00	0.03
98	301316	慧博云通	28,000	411,040.00	0.03
99	605198	安德利	15,100	398,640.00	0.03
100	000833	粤桂股份	73,400	343,512.00	0.02
101	603600	永艺股份	32,700	341,388.00	0.02
102	002843	泰嘉股份	22,100	338,351.00	0.02
103	688160	步科股份	8,400	335,916.00	0.02
104	002264	新华都	65,400	334,194.00	0.02
105	301526	国际复材	97,225	323,759.25	0.02
106	002996	顺博合金	50,400	294,840.00	0.02
107	300922	天秦装备	22,000	285,780.00	0.02
108	000880	潍柴重机	30,300	242,097.00	0.02
109	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.02

110	300566	激智科技	15,800	221,042.00	0.01
111	601096	宏盛华源	39,171	160,209.39	0.01
112	301566	达利凯普	5,755	97,662.35	0.01
113	301578	辰奕智能	1,527	60,423.39	0.00
114	603004	鼎龙科技	1,948	33,018.60	0.00
115	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
116	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
117	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
118	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
119	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
120	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
121	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
122	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
123	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
124	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
125	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
126	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
127	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
128	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
129	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
130	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
131	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
132	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
133	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
134	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
135	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
136	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
137	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
138	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
139	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
140	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00

141	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
142	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
143	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	300394	天孚通信	67,226,307.59	3.18
2	002463	沪电股份	54,022,221.30	2.55
3	000975	银泰黄金	49,376,801.46	2.33
4	300136	信维通信	45,602,551.84	2.15
5	000519	中兵红箭	45,477,731.86	2.15
6	002558	巨人网络	44,123,458.00	2.08
7	600348	华阳股份	43,868,325.00	2.07
8	600399	抚顺特钢	43,702,012.00	2.06
9	300724	捷佳伟创	43,367,184.00	2.05
10	600988	赤峰黄金	41,593,110.64	1.96
11	600282	南钢股份	41,496,547.00	1.96
12	300207	欣旺达	41,001,633.00	1.94
13	600066	宇通客车	40,885,112.00	1.93
14	600699	均胜电子	40,316,088.20	1.90
15	002025	航天电器	39,319,489.10	1.86
16	600380	健康元	39,257,886.00	1.85
17	002422	科伦药业	38,259,566.00	1.81
18	002624	完美世界	37,945,190.89	1.79
19	000636	风华高科	37,003,569.00	1.75
20	600566	济川药业	36,919,519.30	1.74

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	300394	天孚通信	83,198,539.59	3.93
2	002463	沪电股份	56,059,407.40	2.65
3	600348	华阳股份	54,481,956.50	2.57
4	002472	双环传动	51,533,929.00	2.43
5	002624	完美世界	51,489,428.00	2.43
6	300748	金力永磁	50,839,718.85	2.40
7	688169	石头科技	50,663,893.74	2.39
8	600066	宇通客车	50,538,302.00	2.39
9	000519	中兵红箭	50,536,359.85	2.39
10	600282	南钢股份	50,527,173.00	2.39
11	300136	信维通信	49,975,127.00	2.36
12	000975	银泰黄金	48,927,907.05	2.31
13	601555	东吴证券	47,971,545.40	2.27
14	000636	风华高科	47,564,940.53	2.25
15	600038	中直股份	44,042,749.64	2.08
16	002558	巨人网络	42,912,732.15	2.03
17	002422	科伦药业	42,876,283.31	2.03
18	002384	东山精密	42,146,363.81	1.99
19	601098	中南传媒	41,675,685.21	1.97
20	601666	平煤股份	41,618,192.54	1.97

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	8,565,841,711.83
卖出股票收入（成交）总额	9,110,865,559.51

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	75,487,564.40	5.12
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	75,487,564.40	5.12

### 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	428,000	43,259,273.31	2.93
2	019740	24国债09	300,000	30,102,558.90	2.04
3	019698	23国债05	21,000	2,125,732.19	0.14

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2月4日，国元证券股份有限公司（证券代码000728）因廉洁从业管理存在不足等4项问题，被安徽证监局采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案（中国证券监督管理委员会安徽监管局行政监管措施决定书（2024）12号）。

本基金采用量化选股策略，上述股票是根据选股模型批量选择出来的个股，由于上述事件并未影响到模型的选股指标体系，且本基金认为不会对公司的投资价值构成实质性负面影响，所以本基金遵循量化模型的选股结果，继续投资上述股票。

(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	767,607.85



6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	767,607.85

#### 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500增强A	51,340	13,390.26	138,593,295.79	20.16%	548,862,701.37	79.84%
博道中证5	32,864	9,916.13	52,616,187.55	16.15%	273,267,631.77	83.85%

00增 强C						
合计	82, 035	12,352.53	191,209,483.34	18.8 7%	822,130,333.14	81.13%

## 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500增强A	1,197,981.33	0.17%
	博道中证500增强C	25,012.78	0.01%
	合计	1,222,994.11	0.12%

## 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500增强A	10~50
	博道中证500增强C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	博道中证500增强A	0~10
	博道中证500增强C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道中证500增强A	博道中证500增强C
基金合同生效日(2019年01月03 日)基金份额总额	245,859,663.45	184,697,740.97
本报告期期初基金份额总额	837,196,066.97	566,712,254.09
本报告期基金总申购份额	70,510,286.94	47,768,851.04

减：本报告期基金总赎回份额	220,250,356.75	288,597,285.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	687,455,997.16	325,883,819.32

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	
东方财富证券	2	151,991,283.41	0.86%	78,905.94	0.86%	-
国金证券	2	17,522,755,124.84	99.14%	9,134,377.19	99.14%	-

### 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
东方财富证券	21,071,307.00	14.40%	2,000.00	0.00%	-	-	-	-
国金证券	125,307,611.00	85.60%	60,002,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
  - (1) 经营行为稳健规范，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500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
6	博道中证500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
7	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
8	博道中证500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

9	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	2024-06-07
10	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
11	博道中证500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 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道中证500指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道中证500指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道中证500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500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500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](http://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