

# 博道盛利 6 个月持有期混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月30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2021年01月01日起至2021年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	55
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	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57

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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
§11 备查文件目录.....	61
11.1 备查文件目录.....	61
11.2 存放地点.....	61
11.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	博道盛利6个月持有期混合
基金主代码	010404
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月24日
基金管理人	博道基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	354,325,699.40份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博道基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛
	联系电话	021-80226288
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn
客户服务电话	400-085-2888	95595
传真	021-80226289	010-63639132
注册地址	上海市虹口区东大名路687号1幢262室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200122	100033
法定代表人	莫泰山	李晓鹏

### 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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
	本期已实现收益
本期利润	17,722,735.75
加权平均基金份额本期利润	0.0311
本期加权平均净值利润率	3.06%
本期基金份额净值增长率	3.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
	期末可供分配利润
期末可供分配基金份额利润	0.0368
期末基金资产净值	367,375,723.94
期末基金份额净值	1.0368
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
	基金份额累计净值增长率

注：

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.11%	0.18%	-0.30%	0.19%	0.41%	-0.01%
过去三个月	3.34%	0.30%	1.34%	0.21%	2.00%	0.09%
过去六个月	3.21%	0.39%	1.27%	0.29%	1.94%	0.10%
自基金合同生效起至今	3.68%	0.38%	2.29%	0.29%	1.39%	0.09%

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

博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年12月24日-2021年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2020年12月24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，注册资本为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了19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个月定期开放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和博道盛彦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		
张建胜	博道盛利6个月持有期混合、博道盛彦混合的基金经理	2020-12-24	-	11年	张建胜先生，中国籍，MBA。2007年8月至2010年8月担任安永（中国）企业咨询有限公司分析师，2010年8月至2014年12月担任申银万国证券研究所有限公司分析师，2015年1月至2017年7月担任上海博道投资

					管理有限公司高级分析师、股票投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司，历任专户投资一部投资经理。具有基金从业资格。自2020年12月24日起担任博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金经理至今、自2021年6月1日起担任博道盛彦混合型证券投资基金的基金经理至今。
高凯	博道盛利6个月持有期混合的基金经理	2020-12-24	-	9年	高凯女士，中国籍，经济学硕士。2012年4月至2015年2月担任中银基金管理有限公司债券高级研究员，2015年2月至2015年7月担任九泰基金管理有限公司固定收益部投资经理助理，2015年8月至2016年4月担任中国人寿养老保险股份有限公司固定收益部投资经理助理，2016年5月至2018年9月担任创金合信基金管理有限公司固定收益部投资经理，2018年10月加入博道基金管理有限公司，历任专户投资二部投资经理。具有基金从业资格。自2020年12月24日起担任博道盛利6个月持有期混合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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2021年上半年权益市场震荡上行，但相较于去年波动明显加大，3月份市场遭遇了一次短暂而快速的急跌，市场结构化行情特征明显，新能源车、医疗服务、半导体为代表的高景气度赛道个股涨幅较为显著，与宏观经济相关性较强的周期类资产一季度表现较好，但二季度开始明显弱势。

作为2020年12月底新成立的产品，在前两个半月，本基金采用了渐进式加仓的策略，基于流动性环境较为温和且持仓个股隐含回报率尚可两个理由，在3月的市场波动中也基本维持了基准仓位水平。股票持仓偏向高景气度的核心资产为主，但自下而上的策略下行业相对均衡而分散。在6月份，由于产品迎来持有期的首次开放，因此提前降低了股票仓位，减持了部分热门赛道的高估值个股，并在月底产品开放影响消除后重新将股

票仓位调整至基准仓位附近。债券持仓操作上，上半年本基金注重防控信用风险，调整持仓结构，管理久期获取资本利得，获得稳健票息收益并保持组合的流动性。

#### 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

展望未来，我们相信虽然短期波动较难预测，但居民大类资产配置中增加权益资产的大趋势并不可逆，因此仍会较为积极地寻找结构性机会。由于流动性收缩的风险尚未消除，因此下半年仍会重视估值这一评价维度。基于“5年期隐含回报率”这一标尺，会适度降低估值吸引力已不够的热门赛道个股仓位，适度增加“二流赛道的一流公司”配置，并增加港股的关注力度。债券持仓方面，我们将密切关注美债收益率波动、大宗商品价格波动、国内经济修复斜率变化以及紧信用过程，保持对市场的尊重及敬畏，管理风险，并积极参与预期差带来的交易机会。

基于本产品“偏债混合”的定位，除单纯的净值涨幅外，组合的韧性始终是本基金的追求目标之一，因此也建议持有人用“慢富”的心态投资此类产品，因为频繁的申赎所带来的交易成本长期而言会削弱持有回报。

本基金将继续秉持勤勉尽责，坚持以合理价格买入优秀公司的运作思路，严格控制信用风险暴露，积极调整持仓结构，力求获取较为稳健资本利得和票息收益，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期内无需预警说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金2021年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 中期财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	18,589,184.28	4,228,864.10
结算备付金		2,684,776.28	-
存出保证金		531,522.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	254,367,692.14	150,966,330.86
其中：股票投资		105,471,243.54	68,399,351.06
基金投资		-	-
债券投资		148,896,448.60	82,566,979.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	117,000,000.00	422,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,829,447.24	1,021,681.04
应收股利		651.77	-
应收申购款		8,391.60	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		396,011,665.31	578,216,876.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		28,036,668.12	-
应付管理人报酬		369,431.57	88,068.62
应付托管费		69,268.42	16,512.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		13,843.15	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	146,730.11	11,072.40
负债合计		28,635,941.37	115,653.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	354,325,699.40	575,454,761.54
未分配利润	6.4.7.10	13,050,024.54	2,646,460.58
所有者权益合计		367,375,723.94	578,101,222.12
负债和所有者权益总计		396,011,665.31	578,216,876.00

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

## 6.2 利润表

会计主体：博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
一、收入		20,977,293.11

1. 利息收入		6,178,002.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,086.21
债券利息收入		4,656,347.15
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,477,568.98
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,984,832.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,762,424.15
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13.2	-541,008.82
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-145,685.01
股利收益	6.4.7.15	909,101.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,328,784.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	143,243.26
<b>减：二、费用</b>		3,254,557.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,299,506.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	431,157.46
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	417,135.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		11,525.93
7. 其他费用	6.4.7.19	95,231.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		17,722,735.75
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		17,722,735.75

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	575,454,761.54	2,646,460.58	578,101,222.12
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	17,722,735.75	17,722,735.75
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-221,129,062.14	-7,319,171.79	-228,448,233.93
其中：1. 基金申购款	727,179.85	15,186.75	742,366.60
2. 基金赎回 款	-221,856,241.99	-7,334,358.54	-229,190,600.53
四、本期向基金份额 持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	354,325,699.40	13,050,024.54	367,375,723.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]2470号《关于准予博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币575,384,910.08元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2020）第1118号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年12月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为575,454,761.54份基金份额，其中认购资金利息折合69,851.46份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为0%-45%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%）。本基金投资于可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）合计比例不超过基金资产的20%。本基金投资于同业存单比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率\*75%+中证800指数收益率\*20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率\*5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《博道盛利6个月持有期混合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2021年01月01日至2021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2021年06月30日的财务状况以及2021年01月01日至2021年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2021年01月01日至2021年06月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	1,626,346.20
定期存款	-
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	16,962,838.08
合计	18,589,184.28

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 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		106,597,447.85	105,471,243.54	-1,126,204.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	138,841,155.25	139,102,448.60	261,293.35
	银行间市场	9,779,690.00	9,794,000.00	14,310.00
	合计	148,620,845.25	148,896,448.60	275,603.35
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		255,218,293.10	254,367,692.14	-850,600.96

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	26,440,514.99	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	26,440,514.99	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。按照国债期货每日无负债结算的结算规则、《基金国债期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-国债期货投资”与“证券清算款-国债期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-国债期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	117,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	117,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	318.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	9,254.27
应收结算备付金利息	1,078.79
应收债券利息	2,818,795.29
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	-
合计	2,829,447.24

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52,701.73
预提费用-审计费	25,335.45
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,185.56
合计	146,730.11

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	575,454,761.54	575,454,761.54
本期申购	727,179.85	727,179.85
本期赎回（以“-”号填列）	-221,856,241.99	-221,856,241.99
本期末	354,325,699.40	354,325,699.40

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、本基金自2020年12月14日至2020年12月22日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币575,384,910.08元，折合为575,384,910.08份基金份额。根据《博道盛利

6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币69,851.46元，折合为69,851.46份基金份额，划入基金份额持有人账户；

4、根据《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》、《博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》、《博道基金管理有限公司关于博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、定期定额投资业务的公告》、《博道基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换转入业务的公告》及《博道基金管理有限公司关于博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务的公告》的相关规定，本基金于2020年12月24日(基金合同生效日)至2021年3月23日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和定期定额投资业务自2021年3月24日起开始办理，转换转入业务自2021年3月26日起开始办理，赎回和转换出业务自2021年6月23日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,691.89	2,613,768.69	2,646,460.58
本期利润	21,051,520.39	-3,328,784.64	17,722,735.75
本期基金份额交易产生的变动数	-7,902,149.17	582,977.38	-7,319,171.79
其中：基金申购款	14,643.88	542.87	15,186.75
基金赎回款	-7,916,793.05	582,434.51	-7,334,358.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,182,063.11	-132,038.57	13,050,024.54

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	5,596.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	17,858.18
结算备付金利息收入	20,631.34

其他	-
合计	44,086.21

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	129,866,466.84
减：卖出股票成本总额	112,104,042.69
买卖股票差价收入	17,762,424.15

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-541,008.82
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	-541,008.82

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	296,967,557.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	293,047,208.23

减：应收利息总额	4,461,357.85
买卖债券差价收入	-541,008.82

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无权证投资收益。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	-145,685.01

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	909,101.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	909,101.83

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-3,464,369.65
——股票投资	-3,676,004.85
——债券投资	211,635.20
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	135,585.01
——权证投资	-
——期货投资	135,585.01
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	-3,328,784.64

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	143,243.25
转换费收入	0.01
合计	143,243.26

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	415,492.96
银行间市场交易费用	175.00
期货市场交易费用	1,467.98
合计	417,135.94

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,263.05
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	375.61
账户维护费-中债登	5,920.80
开户费	400.00
账户维护费-上清所	4,764.76
合计	95,231.59

#### 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。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国光大银行股份有限公司(“光大银行”)	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	基金托管人的关联方

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

**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 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,299,506.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,119,861.91

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	431,157.46

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年12月24日）持有的基金份额	2,999,516.78
报告期初持有的基金份额	2,999,516.78
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	2,999,516.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.85%

- 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、基金管理人博道基金认购本基金的交易委托直销柜台办理，适用费率为0.02%。

##### 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	1,626,346.20	5,596.69

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

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
光大证券股份有限公司	688601	力芯微	网下发行	1,174	42,827.52

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2021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	可流通日	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
688609	九联科技	2021-03-15	2021-09-23	科创板打新限售	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	33.22	87.50	786	26,110.92	68,775.00	-

300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	90.39	498	24,197.82	45,014.22	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	创业板打新限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
605162	新中港	2021-06-	2021-07-	新股未上	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

		29	07	市						
3009 86	志特 新材	2021 -04- 21	2021 -11- 01	创业 板打 新限 售	14.7 9	30.5 7	264	3,90 4.56	8,07 0.48	-
3009 87	川网 传媒	2021 -04- 28	2021 -11- 11	创业 板打 新限 售	6.79	26.8 1	301	2,04 3.79	8,06 9.81	-
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	创业 板打 新限 售	8.42	13.6 0	593	4,99 3.06	8,06 4.80	-
3009 93	玉马 遮阳	2021 -05- 17	2021 -11- 24	创业 板打 新限 售	12.1 0	19.2 9	410	4,96 1.00	7,90 8.90	-
3009 85	致远 新能	2021 -04- 21	2021 -10- 29	创业 板打 新限 售	24.9 0	24.8 1	295	7,34 5.50	7,31 8.95	-
3009 71	博亚 精工	2021 -04- 07	2021 -10- 15	创业 板打 新限 售	18.2 4	28.2 9	245	4,46 8.80	6,93 1.05	-
3009 91	创益 通	2021 -05- 12	2021 -11- 22	创业 板打 新限 售	13.0 6	26.5 1	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
3009 75	商络 电子	2021 -04- 14	2021 -10- 21	创业 板打 新限 售	5.48	13.0 3	492	2,69 6.16	6,41 0.76	-
3010	华立	2021	2021	创业	14.2	33.8	175	2,48	5,92	-

11	科技	-06-09	-12-17	板打 新限售	0	4		5.00	2.00	
300967	晓鸣 股份	2021-04-02	2021-10-13	创业 板打 新限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰 生物	2021-04-08	2021-10-19	创业 板打 新限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300995	奇德 新材	2021-05-17	2021-11-26	创业 板打 新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈 仕	2021-06-04	2021-12-16	创业 板打 新限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波 方正	2021-05-25	2021-12-02	创业 板打 新限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电 科技	2021-06-15	2021-12-22	创业 板打 新限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福 泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业 板打 新限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪 节能	2021-06-09	2021-12-20	创业 板打 新限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

				售					
--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让；

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期；

3. 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人光大银行，其他存款存放于兴业证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	31,800,000.00	29,761,260.00
合计	31,800,000.00	29,761,260.00

注：未评级部分为国债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	9,794,000.00	-
合计	9,794,000.00	-

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	70,574,000.00	-
AAA以下	-	-
未评级	36,728,448.60	52,805,719.80
合计	107,302,448.60	52,805,719.80

注：未评级部分为国债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

**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或于约定开放日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2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度

指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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2021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0.14%。

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2021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375,337,896.40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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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							
银行存款	19,120,706.28	-	-	-	-	-	19,120,706.28
结算备付金	2,684,776.28	-	-	-	-	-	2,684,776.28
交易性金融资产	31,800,000.00	-	9,794,000.00	70,574,000.00	36,728,448.60	105,471,243.54	254,367,692.14
买入返售金融资产	117,000,000.00	-	-	-	-	-	117,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,829,447.24	2,829,447.24
应收股利	-	-	-	-	-	651.77	651.77
应收申购款	-	-	-	-	-	8,391.60	8,391.60
资产总计	170,605,482.56	-	9,794,000.00	70,574,000.00	36,728,448.60	108,309,734.15	396,011,665.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	28,036,668.12	28,036,668.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	369,431.57	369,431.57
应付托管费	-	-	-	-	-	69,268.42	69,268.42
应交税费	-	-	-	-	-	13,843.15	13,843.15
其他负债	-	-	-	-	-	146,730.11	146,730.11
负债总计	-	-	-	-	-	28,635,941.37	28,635,941.37
利率敏感度缺口	170,605,482.56	-	9,794,000.00	70,574,000.00	36,728,448.60	79,673,792.78	367,375,723.94

上年度末 2020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							
银行存款	4,228,864.10	-	-	-	-	-	4,228,864.10
交易性金融资产	-	-	29,761,260.00	-	52,805,719.80	68,399,351.06	150,966,330.86
买入返售金融资产	422,000,000.00	-	-	-	-	-	422,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,021,681.04	1,021,681.04
资产总计	426,228,864.10	-	29,761,260.00	-	52,805,719.80	69,421,032.10	578,216,876.00
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	88,068.62	88,068.62
应付托管费	-	-	-	-	-	16,512.86	16,512.86
其他负债	-	-	-	-	-	11,072.40	11,072.40
负债总计	-	-	-	-	-	115,653.88	115,653.88
利率敏感度缺口	426,228,864.10	-	29,761,260.00	-	52,805,719.80	69,305,378.22	578,101,222.12

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	1,919,796.37	2,298,476.95
	2. 市场利率上升25个基点	-1,833,922.88	-2,176,437.12

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	33,136,204.7 4	-	33,136,204.7 4
应收股利	-	651.77	-	651.77
资产合计	-	33,136,856.5 1	-	33,136,856.5 1
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	33,136,856.5 1	-	33,136,856.5 1
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折 合人民 币	港币折合人民 币	其他币 种折合 人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	11,738,858.0 6	-	11,738,858.0 6
资产合计	-	11,738,858.0 6	-	11,738,858.0 6
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口净额	-	11,738,858.06	-	11,738,858.06
---------------	---	---------------	---	---------------

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而可能采取的风险管理活动		
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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	港币相对人民币升值5%	1,656,842.83	586,942.90
	港币相对人民币贬值5%	-1,656,842.83	-586,942.90

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为0%-45%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的0%-50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值5%，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。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 2021年06月30日	上年度末 2020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	105,471,243.54	28.71	68,399,351.06	11.83
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	105,471,243.54	28.71	68,399,351.06	11.83

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	5,920,084.84	3,877,537.83
	2. 业绩比较基准下降5%	-5,920,084.84	-3,877,537.83

#### 6.4.14 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	105,471,243.54	26.63
	其中：股票	105,471,243.54	26.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	148,896,448.60	37.60
	其中：债券	148,896,448.60	37.60
	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	117,000,000.00	29.54
	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	21,273,960.56	5.37
8	其他各项资产	3,370,012.61	0.85
9	合计	396,011,665.31	100.00

注：1. 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。

2. 本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为33,136,204.74元，占基金资产净值比例为9.02%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,682,963.33	10.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	6,410.76	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	7,412,392.00	2.02
H	住宿和餐饮业	5,461,554.00	1.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,806,412.21	2.40
J	金融业	4,399,541.10	1.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,431,305.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	1,033,494.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,478,800.78	0.95
R	文化、体育和娱乐业	570,213.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	72,335,038.80	19.69

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
可选消费	7,491,332.73	2.04
电信业务	3,194,687.95	0.87
信息技术	22,450,184.06	6.11
合计	33,136,204.74	9.02

注：以上分类采用中证CICS一级分类标准编制。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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

					(%)
1	00700	腾讯控股	46,200	22,450,184.06	6.11
2	600588	用友网络	225,300	7,493,478.00	2.04
3	000100	TCL科技	846,200	6,473,430.00	1.76
4	03690	美团-W	22,100	5,891,825.35	1.60
5	600519	贵州茅台	2,800	5,758,760.00	1.57
6	002352	顺丰控股	82,900	5,612,330.00	1.53
7	600258	首旅酒店	228,900	5,461,554.00	1.49
8	002430	杭氧股份	157,600	5,451,384.00	1.48
9	603228	景旺电子	194,610	5,098,782.00	1.39
10	600887	伊利股份	126,200	4,647,946.00	1.27
11	601166	兴业银行	212,400	4,364,820.00	1.19
12	600079	人福医药	132,000	3,731,640.00	1.02
13	300015	爱尔眼科	49,011	3,478,800.78	0.95
14	002415	海康威视	51,000	3,289,500.00	0.90
15	01810	小米集团-W	142,200	3,194,687.95	0.87
16	600009	上海机场	37,400	1,800,062.00	0.49
17	06862	海底捞	47,000	1,599,507.38	0.44
18	300014	亿纬锂能	13,900	1,444,627.00	0.39
19	002127	南极电商	146,500	1,431,305.00	0.39
20	300760	迈瑞医疗	2,500	1,200,125.00	0.33
21	603259	药明康德	6,600	1,033,494.00	0.28
22	002609	捷顺科技	90,900	909,909.00	0.25
23	600438	通威股份	20,000	865,400.00	0.24
24	000681	视觉中国	44,100	570,213.00	0.16
25	603348	文灿股份	12,600	441,000.00	0.12
26	300792	壹网壹创	7,500	382,725.00	0.10
27	300115	长盈精密	15,300	315,180.00	0.09
28	002850	科达利	3,000	262,200.00	0.07
29	605305	中际联合	4,600	242,052.00	0.07
30	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.04

31	300979	华利集团	786	68,775.00	0.02
32	300981	中红医疗	498	45,014.22	0.01
33	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
34	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
35	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
36	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
37	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
38	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
39	603171	N税友	637	12,230.40	0.00
40	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
41	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
42	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
43	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
44	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
45	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
46	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
47	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
48	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
49	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
50	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
51	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
52	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
53	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
54	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
55	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
56	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
57	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
58	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
59	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
60	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
61	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

62	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	00700	腾讯控股	16,426,260.60	2.84
2	300015	爱尔眼科	9,235,160.67	1.60
3	01810	小米集团-W	8,528,475.32	1.48
4	000001	平安银行	7,653,099.75	1.32
5	002430	杭氧股份	7,307,786.25	1.26
6	600600	青岛啤酒	6,553,983.00	1.13
7	03690	美团-W	6,369,587.93	1.10
8	600519	贵州茅台	6,343,053.00	1.10
9	002352	顺丰控股	5,942,012.00	1.03
10	600588	用友网络	5,722,091.64	0.99
11	600009	上海机场	5,495,607.00	0.95
12	603228	景旺电子	4,834,069.20	0.84
13	300014	亿纬锂能	4,760,398.00	0.82
14	600887	伊利股份	4,400,968.85	0.76
15	600258	首旅酒店	4,031,858.44	0.70
16	000858	五粮液	3,875,781.00	0.67
17	00291	华润啤酒	3,640,618.68	0.63
18	000100	TCL科技	3,240,596.00	0.56
19	601166	兴业银行	3,188,096.00	0.55
20	600079	人福医药	2,960,001.00	0.51

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	300015	爱尔眼科	10,245,926.46	1.77
2	000001	平安银行	8,490,599.00	1.47
3	600600	青岛啤酒	7,338,468.00	1.27
4	300014	亿纬锂能	6,577,203.00	1.14
5	00291	华润啤酒	6,145,763.86	1.06
6	600258	首旅酒店	6,017,724.00	1.04
7	002430	杭氧股份	5,703,370.86	0.99
8	01810	小米集团 - W	5,485,393.69	0.95
9	000858	五粮液	4,486,281.90	0.78
10	300760	迈瑞医疗	4,052,698.00	0.70
11	600036	招商银行	3,627,625.00	0.63
12	000100	TCL科技	3,384,761.00	0.59
13	600298	安琪酵母	3,034,830.00	0.52
14	600009	上海机场	2,924,231.00	0.51
15	600519	贵州茅台	2,612,955.00	0.45
16	603259	药明康德	2,606,773.59	0.45
17	603228	景旺电子	2,554,958.50	0.44
18	600588	用友网络	2,553,029.00	0.44
19	300476	胜宏科技	2,132,481.00	0.37
20	600887	伊利股份	1,832,627.00	0.32

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	152,851,940.02
卖出股票收入（成交）总额	129,866,466.84

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	68,528,448.60	18.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	70,574,000.00	19.21
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	9,794,000.00	2.67
9	其他	-	-
10	合计	148,896,448.60	40.53

### 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	019547	16国债19	389,940	36,728,448.60	10.00
2	019640	20国债10	318,000	31,800,000.00	8.66
3	155037	18电投13	100,000	10,213,000.00	2.78
4	143216	17京资02	100,000	10,177,000.00	2.77
5	155721	19通用01	100,000	10,055,000.00	2.74

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
T2109	10年期国债 2109	27	26,576,100.00	135,585.01	-
公允价值变动总额合计(元)					135,585.01
国债期货投资本期收益(元)					-145,685.01
国债期货投资本期公允价值变动(元)					135,585.01

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对中性。

## 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) 2021年3月12日，市场监管总局对腾讯控股有限公司（以下简称“腾讯控股”，股票代码00700）做出行政处罚决定（国市监处〔2021〕13号），因其收购猿辅导股权结构未依法申报违法实施的经营者集中，处以罚款50万元。2021年4月28日，市场监管总局对腾讯控股做出行政处罚决定（国市监处〔2021〕30号、国市监处〔2021〕31号），因其收购Bitauto Holdings Limited、上海阑途信息技术有限公司、股权分别构成未依法申报违法实施的经营者集中，各处以罚款50万元。

本基金认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。

(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	531,522.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	651.77
4	应收利息	2,829,447.24
5	应收申购款	8,391.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,370,012.61

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
15,065	23,519.79	2,999,516.78	0.85%	351,326,182.62	99.15%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	206,801.35	0.06%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

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

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2020年12月24日)基金份额总额	575,454,761.54
本报告期期初基金份额总额	575,454,761.54
本报告期基金总申购份额	727,179.85

减：本报告期基金总赎回份额	221,856,241.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	354,325,699.40

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本报告期内，基金管理人、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	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	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的比例		量的比例	
兴业证券股份有限公司	2	275,120,752.72	100.00%	207,214.30	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券股份有限公司	641,891,551.24	100.00%	11,255,701,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，上述交易单元均为本基金新增交易单元；
- 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；
- 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	中国证券报、公司网站、中	2021-03-19

	博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会基金电子披露网站	
2	博道基金管理有限公司关于旗下两只基金就参与存托凭证投资事宜修订相关法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-20
3	博道基金管理有限公司关于旗下两只基金修订基金合同、托管协议并更新招募说明书、产品资料概要的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2021-03-20
4	博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-20
5	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-24
6	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金2021年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
7	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	2021-04-22
8	博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金2021年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-04-22
9	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为销售机构的	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	2021-06-09

	公告	披露网站	
10	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	2021-06-18
11	博道基金管理有限公司关于博道盛利6个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务的公告	中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-18
12	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人关联方承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021-06-19

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

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

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

博道基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日