# 博道中证500指数增强型证券投资基金

# 2021年年度报告

2021年12月31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:2022年03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。本年度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2022年3月29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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况** ..... 7
**3.1 主要会计数据和财务指标** ..... 7
**3.2 基金净值表现** ..... 8
**3.3 过去三年基金的利润分配情况** ..... 12
**§4 管理人报告** ..... 12
**4.1 基金管理人及基金经理情况** ..... 12
**4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明** ..... 14
**4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明** ..... 14
**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** ..... 15
**4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望** ..... 16
**4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况** ..... 16
**4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明** ..... 17
**4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明** ..... 18
**4.9 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** ..... 18
**§5 托管人报告** ..... 18
**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明** ..... 18
**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** ..... 18
**5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见** ..... 18
**§6 审计报告** ..... 18
**6.1 审计报告基本信息** ..... 18
**6.2 审计报告的基本内容** ..... 19
**§7 年度财务报表** ..... 21
**7.1 资产负债表** ..... 21
**7.2 利润表** ..... 23
**7.3 所有者权益（基金净值）变动表** ..... 25
**7.4 报表附注** ..... 26
**§8 投资组合报告** ..... 62
**8.1 期末基金资产组合情况** ..... 62
**8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合** ..... 63
**8.3 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** ..... 65
**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动** ..... 75
**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合** ..... 109
**8.6 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** ..... 110
**8.7 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** ..... 110
**8.8 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** ..... 110
**8.9 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** ..... 110
**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明** ..... 110

**8.11** 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 110
**8.12** 投资组合报告附注 ..... 110
**§9** 基金份额持有人信息 ..... 111
**9.1** 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 111
**9.2** 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 112
**9.3** 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 ..... 112
**§10** 开放式基金份额变动 ..... 113
**§11** 重大事件揭示 ..... 113
**11.1** 基金份额持有人大会决议 ..... 113
**11.2** 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 ..... 113
**11.3** 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 113
**11.4** 基金投资策略的改变 ..... 113
**11.5** 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 113
**11.6** 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 114
**11.7** 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 114
**11.8** 其他重大事件 ..... 115
**§12** 备查文件目录 ..... 118
**12.1** 备查文件目录 ..... 119
**12.2** 存放地点 ..... 119
**12.3** 查阅方式 ..... 119

# §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 | 1,834,344,363.54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 | 1,119,904,297.38份 | 714,440,066.16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 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-80226288 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | yewy@bdfund.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-085-2888 | 95555 |
| 传真 | | 021-80226289 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区东大名路687号1幢262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》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.bdfund.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
| --- | --- | --- |
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | 2021年 | | 2020年 | | 2019年01月03日（基金合同生效日）-2019年12月31日 | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| | 博道中证500增强A | 博道中证500增强C | 博道中证500增强A | 博道中证500增强C | 博道中证500增强A | 博道中证500增强C |
| 本期已实现收益 | 125,183,144.88 | 92,849,580.34 | 79,015,275.92 | 39,364,333.54 | 69,398,545.07 | 49,907,411.15 |
| 本期利润 | 162,700,987.20 | 119,240,855.63 | 77,605,213.17 | 33,169,095.73 | 79,711,389.37 | 53,546,975.85 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2704 | 0.2534 | 0.4812 | 0.4214 | 0.3714 | 0.3992 |
| 本期加权平均净值利润率 | 12.42% | 11.63% | 33.68% | 29.00% | 33.42% | 35.98% |
| 本期基金份额净值增长率 | 32.16% | 31.76% | 41.37% | 40.95% | 29.71% | 29.32% |
| 3.1.2 | 2021年末 | | 2020年末 | | 2019年末 | |

| **期末数据和指标** | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 期末可供分配利润 | 1,156,867,448.82 | 724,740,823.78 | 93,121,187.79 | 52,207,407.18 | 34,413,451.22 | 15,202,633.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0330 | 1.0144 | 0.6803 | 0.6702 | 0.1769 | 0.1733 |
| 期末基金资产净值 | 2,498,034,199.80 | 1,579,343,599.68 | 231,032,863.37 | 130,687,789.20 | 232,268,901.63 | 104,400,026.03 |
| 期末基金份额净值 | 2.2306 | 2.2106 | 1.6878 | 1.6777 | 1.1939 | 1.1903 |
| **3.1.3 累计期末指标** | 2021年末 | | 2020年末 | | 2019年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 142.33% | 140.17% | 83.36% | 82.28% | 29.71% | 29.32% |

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 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | | 准差② | 率③ | 率标准差④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.28% | 0.87% | 3.43% | 0.72% | -4.71% | 0.15% |
| 过去六个月 | 7.88% | 1.14% | 7.72% | 0.91% | 0.16% | 0.23% |
| 过去一年 | 32.16% | 1.09% | 14.83% | 0.92% | 17.33% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 142.33% | 1.31% | 73.71% | 1.31% | 68.62% | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.36% | 0.87% | 3.43% | 0.72% | -4.79% | 0.15% |
| 过去六个月 | 7.71% | 1.14% | 7.72% | 0.91% | -0.01% | 0.23% |
| 过去一年 | 31.76% | 1.09% | 14.83% | 0.92% | 16.93% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 140.17% | 1.31% | 73.71% | 1.31% | 66.46% | 0.00% |

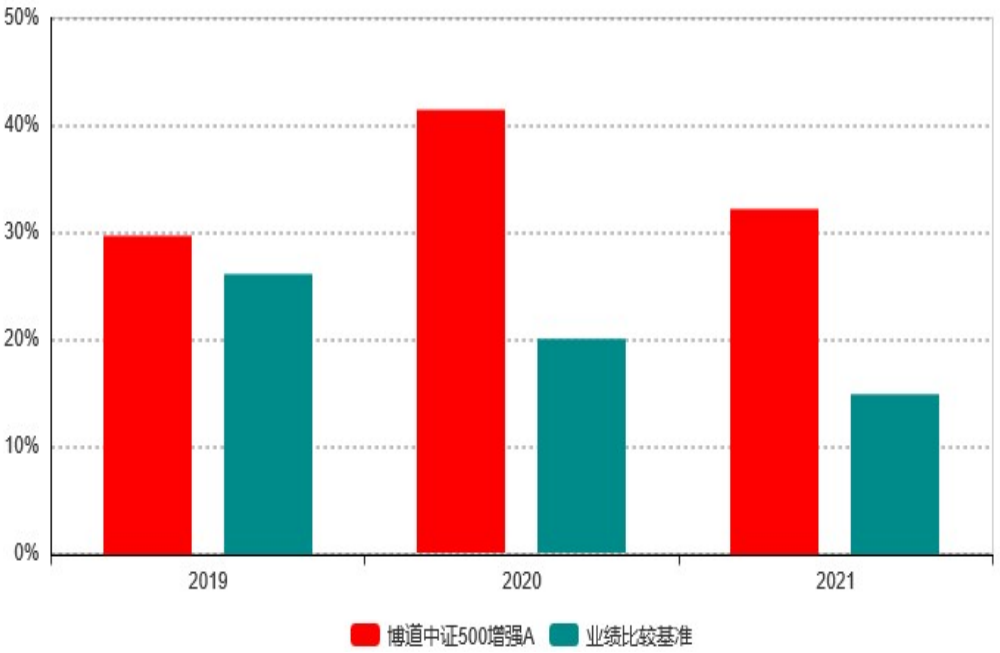
注：本基金的业绩比较基准请见"2.2　基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

### 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

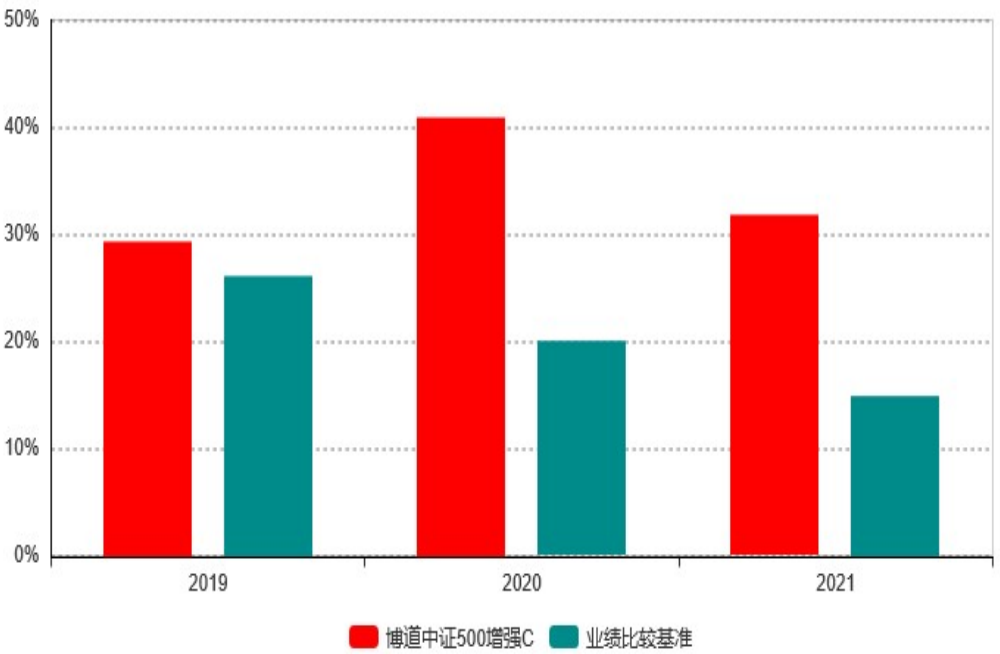
注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较




注：图示日期为 2019 年 01 月 03 日至 2021 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。



注：图示日期为2019年01月03日至2021年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

博道中证500增强A

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2021年 | 0 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2020年 | 0 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2019年 | 1.000 | 16,754,344.17 | 7,831,627.77 | 24,585,971.94 | - |
| 合计 | 1.0 | 16,754,344.17 | 7,831,627.77 | 24,585,971.94 | - |

博道中证500增强C

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2021年 | 0 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2020年 | 0 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2019年 | 1.000 | 14,086,339.11 | 4,383,435.62 | 18,469,774.73 | - |
| 合计 | 1.0 | 14,086,339.11 | 4,383,435.62 | 18,469,774.73 | - |

## §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20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、博道盛彦混合型证券投资基金和博道成长智航股票型证券投资基金。

### 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 | 博道启航混合、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、博道消费智航、博道成长智航的基金经理、量化投资部总经理、研究部副总经理 | 2019-01-03 | - | 10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月加入博道基金管理有限公司，现任量化投资部总经理、研究部副总经理。具有基金从业资格。自2018年8月10日起担任博道启航混合型证券投资基金基金经理至今、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日起担任博道消费智航股票型证券投资基金基金经理至今、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。 |

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 公平交易制度和控制方法

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下所管理的所有资产组合投资运作的公平。旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下：

（1）公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

（2）公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

（3）公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力，不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

（4）公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

（5）公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各投资组合公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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5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，全球经济复苏叠加供应链约束，通胀受益资产整体表现较好，南华能化指数涨幅33.07%，股票中周期风格也显著跑赢，各大指数中，沪深300下跌5.20%，中证500上涨15.58%，创业板指上涨12.02%，恒生指数下跌14.08%。从行业来看，电力设备新能源、基础化工、有色金属、煤炭、钢铁涨幅均超过40%，消费者服务、非银金融、家电跌幅较大。从因子表现来看，基本面趋势类型的因子全年表现较好，但在四季度遭遇了较大的超额回撤，价值类因子全年波动较大，12月以来表现相对强势。

经济基本面来看，国内一、三季度GDP低于两年复合潜在增速水平，分别为5%、4.9%，主要拖累来自疫情和地产，而出口则保持在较高景气区间，显示在疫情常态化背景下，全球供应链冲击不断，中国制造优势得以维持，也使得人民币成为全球最强势的货币之一。全年来看，市场演绎了比较极致的景气度行情，主要有两条主线：一是通胀链条，全球经济复苏叠加供应链约束，同时中国碳中和政策对国内传统能源供给形成约束，而需求侧承接疫情期间全球制造需求有所提升，全球定价和中国定价的大宗商品全年均出现较大幅度上涨，使得商品和周期股相对受益，而家电等中游制造行业相对受损；二是政策链条，在"把握稳增长压力较小的窗口期"，围绕"如何实现共同富裕、正确认识和把握资本、实现双碳目标"等，一系列致力于提升中国潜在增速的长期措施陆续推出，使得相关领域明显受益。

报告期间，本基金维持配置中证500多因子选股增强模型，产品在本报告期间获得了超越业绩比较基准的收益。

### 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

展望明年，中央经济工作会议重提"以经济建设为中心"，政府工作重心转向稳增长比较明确。货币政策和财政政策有望逆周期调节，一定程度对冲经济下行。同时，股票市场整体估值仍较为合理，全社会大类资产向股票等标准资产流动的大趋势不变。市场整体风险不大，但仍需寻找结构性的机会。

本基金管理人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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年度，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》等有关法规，本基金管

理人诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。结合本报告期新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，贯彻落实新法规及新的监管要求。公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）深化事前事中合规及风险管理，提高合规管理及风险控制有效性。

强化事前事中合规审查，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料等，着力防范各类合规风险。在风险管理方面，夯实事前防范、事中控制和事后监督等各阶段工作，重点加强对信用风险、流动性风险等风险的管理。

（三）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司监察稽核部坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

（四）强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

## 4.7 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。

### 4.8 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。

### 4.9 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

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2022)第25091号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| | |
|---|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 博道中证500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | (一) 我们审计的内容<br>我们审计了博道中证500指数增强型证券投资基金(以下简称"博道中证500指数增强基金")的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。<br>(二) 我们的意见<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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，公允反映了博道中证500指数增强基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。<br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博道中证500指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 |
| 强调事项 | 无 |
| 其他事项 | 无 |
| 其他信息 | 无 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 博道中证500指数增强基金的基金管理人博道基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估博道中证500指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博道中证500指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督博道中证500指数增强基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：<br>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。<br>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。<br>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰 |

| | |
|---|---|
| | 当性和作出会计估计及相关披露的合理性。<br>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对博道中证500指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致博道中证500指数增强基金不能持续经营。<br>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。<br>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 沈兆杰、朱容莹 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座11楼 |
| 审计报告日期 | 2022-03-25 |

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2021年12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 123,152,549.41 | 9,674,719.19 |
| 结算备付金 | | 5,332,225.98 | 302,978.11 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 3,977,581,409.56 | 354,601,089.10 |
| 其中：股票投资 | | 3,800,029,159.56 | 337,826,901.10 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 177,552,250.00 | 16,774,188.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,941,441.08 | 296,069.88 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 6,243,660.03 | 225,017.23 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 4,114,251,286.06 | 365,099,873.51 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 10,000,000.00 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 22,934,545.78 | 2,856,183.37 |
| 应付管理人报酬 | | 2,720,261.62 | 235,947.48 |
| 应付托管费 | | 362,701.55 | 31,459.67 |
| 应付销售服务费 | | 445,505.18 | 33,990.18 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 410,472.45 | 221,640.24 |
| 负债合计 | | 36,873,486.58 | 3,379,220.94 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 1,834,344,363.54 | 214,780,088.05 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 2,243,033,435.94 | 146,940,564.52 |
| 所有者权益合计 | | 4,077,377,799.48 | 361,720,652.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,114,251,286.06 | 365,099,873.51 |

注：

1.报告截止日2021年12月31日，A类基金份额净值2.2306元，C类基金份额净值2.2106元；基金份额总额1,834,344,363.54份，其中A类基金份额1,119,904,297.38份，C类基金份额714,440,066.16份。

## 7.2 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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | 351,543,007.94 | 123,196,838.04 |
| 1.利息收入 | | 3,051,181.96 | 449,651.44 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 566,562.06 | 79,764.95 |
| 债券利息收入 | | 2,484,619.79 | 369,886.24 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 0.11 | 0.25 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 收入 | | | |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 277,901,884.52 | 129,641,130.52 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 258,922,758.74 | 126,500,602.78 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13.2 | -211,256.93 | -12,723.89 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 19,190,382.71 | 3,153,251.63 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 63,909,117.61 | -7,605,300.56 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 6,680,823.85 | 711,356.64 |
| **减：二、费用** | | 69,601,165.11 | 12,422,529.14 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 17,493,462.08 | 2,583,359.16 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 2,332,461.67 | 344,447.91 |
| 3．销售服务费 | | 3,080,578.25 | 342,299.76 |
| 4．交易费用 | 7.4.7.18 | 45,843,624.45 | 8,768,654.83 |
| 5．利息支出 | | 202,831.15 | 3,903.55 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 202,831.15 | 3,903.55 |
| 6．税金及附加 | | - | - |
| 7．其他费用 | 7.4.7.19 | 648,207.51 | 379,863.93 |
| **三、利润总额（亏损总额** | | 281,941,842.83 | 110,774,308.90 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **以“-”号填列）** | | | |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 281,941,842.83 | 110,774,308.90 |

## 7.3 所有者权益（基金净值）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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31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) | 214,780,088.05 | 146,940,564.52 | 361,720,652.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 281,941,842.83 | 281,941,842.83 |
| 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） | 1,619,564,275.49 | 1,814,151,028.59 | 3,433,715,304.08 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,055,086,488.27 | 3,538,317,919.14 | 6,593,404,407.41 |
| 2.基金赎回款 | -1,435,522,212.78 | -1,724,166,890.55 | -3,159,689,103.33 |
| 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 | 1,834,344,363.54 | 2,243,033,435.94 | 4,077,377,799.48 |

| 益（基金净值） | | | |
|---|---|---|---|
| 项 目 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31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) | 282,250,549.12 | 54,418,378.54 | 336,668,927.66 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 110,774,308.90 | 110,774,308.90 |
| 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） | -67,470,461.07 | -18,252,122.92 | -85,722,583.99 |
| 其中：1.基金申购款 | 297,440,751.51 | 129,050,777.09 | 426,491,528.60 |
| 2.基金赎回款 | -364,911,212.58 | -147,302,900.01 | -512,214,112.59 |
| 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） | 214,780,088.05 | 146,940,564.52 | 361,720,652.57 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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 |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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%。

本财务报表由本基金的基金管理人博道基金管理有限公司于2022年3月25日批准报出。

### 7.4.2 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7.4.4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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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。本基金目前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。

### 7.4.4.4 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。

### 7.4.4.5 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。

### 7.4.4.6 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。

### 7.4.4.7 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。

### 7.4.4.8 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)。

### 7.4.4.9 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或票面利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。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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。

### 7.4.4.12 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。

### 7.4.4.13 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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 2,146,438.00 | 2,111,796.28 |
| 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 | 121,006,111.41 | 7,562,922.91 |
| 合计 | 123,152,549.41 | 9,674,719.19 |

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。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2021年12月31日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 3,729,721,409.24 | 3,800,029,159.56 | 70,307,750.32 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 177,603,774.27 | 177,552,250.00 | -51,524.27 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 177,603,774.27 | 177,552,250.00 | -51,524.27 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 3,907,325,183.51 | 3,977,581,409.56 | 70,256,226.05 |
| 项目 | | 上年度末 2020年12月31日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 331,422,873.36 | 337,826,901.10 | 6,404,027.74 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 16,831,107.30 | 16,774,188.00 | -56,919.30 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 16,831,107.30 | 16,774,188.00 | -56,919.30 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 348,253,980.66 | 354,601,089.10 | 6,347,108.44 |

注：如果本报告期末或上年度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。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 255.97 | 241.66 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | 27,613.04 | 1,277.60 |
| 应收结算备付金利息 | 2,410.43 | 136.95 |
| 应收债券利息 | 1,911,161.64 | 294,413.67 |
| 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 | 1,941,441.08 | 296,069.88 |

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 13,549.43 | 1,640.24 |
| 预提费用-审计费 | 90,000.00 | 50,000.00 |
| 预提费用-信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 其他应付 | 186,923.02 | 50,000.00 |
| 合计 | 410,472.45 | 221,640.24 |

### 7.4.7.9 实收基金

#### 7.4.7.9.1 博道中证500增强A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(博道中证500增强A) | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 136,881,915.18 | 136,881,915.18 |
| 本期申购 | 1,552,279,068.43 | 1,552,279,068.43 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -569,256,686.23 | -569,256,686.23 |
| 本期末 | 1,119,904,297.38 | 1,119,904,297.38 |

#### 7.4.7.9.2 博道中证500增强C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(博道中证500增强C) | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|---|---|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---|---|---|
| 上年度末 | 77,898,172.87 | 77,898,172.87 |
| 本期申购 | 1,502,807,419.84 | 1,502,807,419.84 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -866,265,526.55 | -866,265,526.55 |
| 本期末 | 714,440,066.16 | 714,440,066.16 |

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。

### 7.4.7.10 未分配利润

#### 7.4.7.10.1 博道中证500增强A

单位：人民币元

| 项目<br>(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 | 93,121,187.79 | 1,029,760.40 | 94,150,948.19 |
| 本期利润 | 125,183,144.88 | 37,517,842.32 | 162,700,987.20 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 938,563,116.15 | 182,714,850.88 | 1,121,277,967.03 |
| 其中：基金申购款 | 1,505,755,544.61 | 296,375,360.85 | 1,802,130,905.46 |
| 基金赎回款 | -567,192,428.46 | -113,660,509.97 | -680,852,938.43 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,156,867,448.82 | 221,262,453.60 | 1,378,129,902.42 |

#### 7.4.7.10.2 博道中证500增强C

单位：人民币元

| 项目<br>(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 | 52,207,407.18 | 582,209.15 | 52,789,616.33 |
| 本期利润 | 92,849,580.34 | 26,391,275.29 | 119,240,855.63 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 579,683,836.26 | 113,189,225.30 | 692,873,061.56 |
| 其中：基金申购款 | 1,446,276,090.43 | 289,910,923.25 | 1,736,187,013.68 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金赎回款 | -866,592,254.17 | -176,721,697.95 | -1,043,313,952.12 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 724,740,823.78 | 140,162,709.74 | 864,903,533.52 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 9,110.84 | 10,732.17 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | 525,927.87 | 66,917.02 |
| 结算备付金利息收入 | 31,523.35 | 2,115.76 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 566,562.06 | 79,764.95 |

### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 19,909,821,808.58 | 3,373,972,932.68 |
| 减：卖出股票成本总额 | 19,650,899,049.84 | 3,247,472,329.90 |
| 买卖股票差价收入 | 258,922,758.74 | 126,500,602.78 |

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31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 | -211,256.93 | -12,723.89 |
| 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 | -211,256.93 | -12,723.89 |

### 7.4.7.13.2 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 95,612,182.72 | 17,076,341.47 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 94,066,197.43 | 16,713,808.49 |
| 减：应收利息总额 | 1,757,242.22 | 375,256.87 |
| 买卖债券差价收入 | -211,256.93 | -12,723.89 |

### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年 |
|---|---|---|

| | 12月31日 | 12月31日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 19,190,382.71 | 3,153,251.63 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 19,190,382.71 | 3,153,251.63 |

### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 63,909,117.61 | -7,605,300.56 |
| ——股票投资 | 63,903,722.58 | -7,557,839.75 |
| ——债券投资 | 5,395.03 | -47,460.81 |
| ——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 | 63,909,117.61 | -7,605,300.56 |

### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 6,539,690.76 | 710,881.84 |
| 转换费收入 | 141,133.09 | 474.80 |
| 合计 | 6,680,823.85 | 711,356.64 |

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。

### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 45,843,622.45 | 8,768,652.83 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 期货市场交易费用 | 2.00 | 2.00 |
| 合计 | 45,843,624.45 | 8,768,654.83 |

### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 90,000.00 | 50,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 汇划手续费 | 11,379.60 | 9,863.93 |
| 指数使用费 | 426,427.91 | 200,000.00 |
| 开户费 | 400.00 | - |
| 合计 | 648,207.51 | 379,863.93 |

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 7.4.9 关联方关系

| 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("招商银行") | 基金托管人、基金销售机构 |
| 上海博道投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海博道如思投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东 |
| 上海博道如见投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东 |
| 上海博道如舍投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东 |
| 上海博道如知投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东 |
| 莫泰山 | 基金管理人的股东 |

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.经博道基金管理有限公司(以下简称"博道基金")股东会决议，批准上海博道相形投资合伙企业(有限合伙)将持有的博道基金4.5%的股权转让给张迎军，并于2021年4月27日完成了工商变更登记手续。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 17,493,462.08 | 2,583,359.16 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,213,690.26 | 517,407.94 |

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,332,461.67 | 344,447.91 |

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。

#### 7.4.10.2.3 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<br>2021年01月01日至2021年12月31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 | 0.00 | 762,818.82 | 762,818.82 |
| 招商银行 | 0.00 | 97,905.33 | 97,905.33 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 合计 | 0.00 | 860,724.15 | 860,724.15 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31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 | 0.00 | 62,123.79 | 62,123.79 |
| 招商银行 | 0.00 | 7,566.04 | 7,566.04 |
| 合计 | 0.00 | 69,689.83 | 69,689.83 |

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 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<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至<br>2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 报告期初持有的基金份额 | 1,999,600.08 | 1,999,600.08 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 1,999,600.08 | 1,999,600.08 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.18% | 0.93% |

博道中证500增强C

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至<br>2020年12月31日 |
|---|---|---|
| 报告期初持有的基金份额 | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期间因拆分变动份额 | 0.00 | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 1,000,000.00 | 1,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.14% | 0.47% |

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。

### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间10~50万份。

### 7.4.10.5 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<br>2021年01月01日至2021年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2020年01月01日至2020年12月31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 | 2,146,438.00 | 9,110.84 | 2,111,796.28 | 10,732.17 |

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。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 600941 | 中国移动 | 2021-12-24 | 2022-07-05 | 主板打新限售 | 57.58 | 57.58 | 69,889 | 4,024,208.62 | 4,024,208.62 | - |
| 600941 | 中国移动 | 2021-12-24 | 2022-01-05 | 新股未上市 | 57.58 | 57.58 | 29,953 | 1,724,693.74 | 1,724,693.74 | - |
| 601728 | 中国电信 | 2021-08-11 | 2022-02-21 | 主板打新限售 | 4.53 | 4.27 | 394,011 | 1,784,869.83 | 1,682,426.97 | - |
| 688148 | 芳源股份 | 2021-07-30 | 2022-02-07 | 科创板打新限售 | 4.58 | 34.00 | 11,860 | 54,318.80 | 403,240.00 | - |
| 688262 | 国芯科技 | 2021-12-28 | 2022-01-06 | 新股未上市 | 41.98 | 41.98 | 7,129 | 299,275.42 | 299,275.42 | - |
| 688800 | 瑞可达 | 2021-07-14 | 2022-01-24 | 科创板打新限售 | 15.02 | 133.53 | 1,967 | 29,544.34 | 262,653.51 | - |
| 6882 | 南网 | 2021 | 2022 | 科创 | 12.2 | 18.9 | 11,763 | 143, | 222, | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 48 | 科技 | -12-14 | -06-22 | 板打新限售 | 4 | 0 | | 979.12 | 320.70 | |
| 301155 | 海力风电 | 2021-11-17 | 2022-05-24 | 创业板打新限售 | 60.66 | 96.75 | 1,054 | 63,935.64 | 101,974.50 | - |
| 301136 | 招标股份 | 2021-12-31 | 2022-01-11 | 新股未上市 | 10.52 | 10.52 | 7,172 | 75,449.44 | 75,449.44 | - |
| 301087 | 可孚医疗 | 2021-10-15 | 2022-04-25 | 创业板打新限售 | 93.09 | 75.34 | 848 | 78,940.32 | 63,888.32 | - |
| 301050 | 雷电微力 | 2021-08-17 | 2022-02-24 | 创业板打新限售 | 60.64 | 234.74 | 233 | 14,129.12 | 54,694.42 | - |
| 301029 | 怡合达 | 2021-07-14 | 2022-01-24 | 创业板打新限售 | 14.14 | 89.87 | 462 | 6,532.68 | 41,519.94 | - |
| 688501 | 青达环保 | 2021-07-09 | 2022-01-17 | 科创板打新限售 | 10.57 | 21.11 | 1,759 | 18,592.63 | 37,132.49 | - |
| 301035 | 润丰股份 | 2021-07-21 | 2022-01-28 | 创业板打新限售 | 22.04 | 56.28 | 644 | 14,193.76 | 36,244.32 | - |
| 301090 | 华润材料 | 2021-10-19 | 2022-04-26 | 创业板打新限售 | 10.45 | 11.22 | 2,764 | 28,883.80 | 31,012.08 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301039 | 中集车辆 | 2021-07-01 | 2022-01-10 | 创业板打新限售 | 6.96 | 12.51 | 2,064 | 14,365.44 | 25,820.64 | - |
| 301058 | 中粮工科 | 2021-09-01 | 2022-03-09 | 创业板打新限售 | 3.55 | 18.24 | 1,386 | 4,920.30 | 25,280.64 | - |
| 301099 | 雅创电子 | 2021-11-10 | 2022-05-23 | 创业板打新限售 | 21.99 | 71.36 | 351 | 7,718.49 | 25,047.36 | - |
| 301221 | 光庭信息 | 2021-12-15 | 2022-06-22 | 创业板打新限售 | 69.89 | 88.72 | 280 | 19,569.20 | 24,841.60 | - |
| 301189 | 奥尼电子 | 2021-12-21 | 2022-06-28 | 创业板打新限售 | 66.18 | 56.62 | 435 | 28,788.30 | 24,629.70 | - |
| 301166 | 优宁维 | 2021-12-21 | 2022-06-28 | 创业板打新限售 | 86.06 | 94.50 | 253 | 21,773.18 | 23,908.50 | - |
| 301069 | 凯盛新材 | 2021-09-16 | 2022-03-28 | 创业板打新限售 | 5.17 | 44.21 | 539 | 2,786.63 | 23,829.19 | - |
| 301096 | 百诚医药 | 2021-12-13 | 2022-06-20 | 创业板打新限售 | 79.60 | 78.53 | 272 | 21,651.20 | 21,360.16 | - |
| 301093 | 华兰股份 | 2021-10- | 2022-05- | 创业板打 | 58.08 | 49.85 | 409 | 23,754.7 | 20,388.6 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 21 | 05 | 新限售 | | | | 2 | 5 | |
| 301018 | 申菱环境 | 2021-06-28 | 2022-01-07 | 创业板打新限售 | 8.29 | 26.06 | 782 | 6,482.78 | 20,378.92 | - |
| 300994 | 久祺股份 | 2021-08-02 | 2022-02-14 | 创业板打新限售 | 11.90 | 45.45 | 420 | 4,998.00 | 19,089.00 | - |
| 301100 | 风光股份 | 2021-12-10 | 2022-06-17 | 创业板打新限售 | 27.81 | 31.14 | 599 | 16,658.19 | 18,652.86 | - |
| 301088 | 戎美股份 | 2021-10-19 | 2022-04-28 | 创业板打新限售 | 33.16 | 24.67 | 704 | 23,344.64 | 17,367.68 | - |
| 301168 | 通灵股份 | 2021-12-02 | 2022-06-10 | 创业板打新限售 | 39.08 | 52.13 | 329 | 12,857.32 | 17,150.77 | - |
| 301101 | 明月镜片 | 2021-12-09 | 2022-06-16 | 创业板打新限售 | 26.91 | 43.36 | 371 | 9,983.61 | 16,086.56 | - |
| 301190 | 善水科技 | 2021-12-17 | 2022-06-24 | 创业板打新限售 | 27.85 | 27.46 | 575 | 16,013.75 | 15,789.50 | - |
| 301118 | 恒光股份 | 2021-11-09 | 2022-05-18 | 创业板打新限售 | 22.70 | 49.02 | 315 | 7,150.50 | 15,441.30 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301108 | 洁雅股份 | 2021-11-25 | 2022-06-06 | 创业板打新限售 | 57.27 | 53.71 | 280 | 16,035.60 | 15,038.80 | - |
| 301179 | 泽宇智能 | 2021-12-01 | 2022-06-08 | 创业板打新限售 | 43.99 | 50.77 | 295 | 12,977.05 | 14,977.15 | - |
| 301089 | 拓新药业 | 2021-10-20 | 2022-04-27 | 创业板打新限售 | 19.11 | 67.93 | 220 | 4,204.20 | 14,944.60 | - |
| 301180 | 万祥科技 | 2021-11-09 | 2022-05-16 | 创业板打新限售 | 12.20 | 22.72 | 654 | 7,978.80 | 14,858.88 | - |
| 301046 | 能辉科技 | 2021-08-10 | 2022-02-17 | 创业板打新限售 | 8.34 | 48.99 | 290 | 2,418.60 | 14,207.10 | - |
| 301111 | 粤万年青 | 2021-11-30 | 2022-06-07 | 创业板打新限售 | 10.48 | 36.68 | 379 | 3,971.92 | 13,901.72 | - |
| 301188 | 力诺特玻 | 2021-11-04 | 2022-05-11 | 创业板打新限售 | 13.00 | 20.48 | 647 | 8,411.00 | 13,250.56 | - |
| 301199 | 迈赫股份 | 2021-11-30 | 2022-06-07 | 创业板打新限售 | 29.28 | 32.00 | 402 | 11,770.56 | 12,864.00 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021-06- | 2022-01- | 创业板打 | 10.64 | 30.44 | 421 | 4,479.44 | 12,815.2 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 28 | 06 | 新限售 | | | | | 4 | |
| 301026 | 浩通科技 | 2021-07-08 | 2022-01-17 | 创业板打新限售 | 18.03 | 62.73 | 203 | 3,660.09 | 12,734.19 | - |
| 301126 | 达嘉维康 | 2021-11-30 | 2022-06-07 | 创业板打新限售 | 12.37 | 19.23 | 662 | 8,188.94 | 12,730.26 | - |
| 301092 | 争光股份 | 2021-10-21 | 2022-05-05 | 创业板打新限售 | 36.31 | 35.52 | 323 | 11,728.13 | 11,472.96 | - |
| 301048 | 金鹰重工 | 2021-08-11 | 2022-02-28 | 创业板打新限售 | 4.13 | 12.96 | 843 | 3,481.59 | 10,925.28 | - |
| 301028 | 东亚机械 | 2021-07-12 | 2022-01-20 | 创业板打新限售 | 5.31 | 13.50 | 733 | 3,892.23 | 9,895.50 | - |
| 300774 | 倍杰特 | 2021-07-26 | 2022-02-16 | 创业板打新限售 | 4.57 | 21.08 | 444 | 2,029.08 | 9,359.52 | - |
| 301182 | 凯旺科技 | 2021-12-16 | 2022-06-23 | 创业板打新限售 | 27.12 | 30.58 | 294 | 7,973.28 | 8,990.52 | - |
| 301062 | 上海艾录 | 2021-09-07 | 2022-03-14 | 创业板打新限售 | 3.31 | 17.01 | 523 | 1,731.13 | 8,896.23 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301193 | 家联科技 | 2021-12-02 | 2022-06-09 | 创业板打新限售 | 30.73 | 29.14 | 297 | 9,126.81 | 8,654.58 | - |
| 301052 | 果麦文化 | 2021-08-23 | 2022-02-28 | 创业板打新限售 | 8.11 | 33.64 | 252 | 2,043.72 | 8,477.28 | - |
| 301025 | 读客文化 | 2021-07-06 | 2022-01-24 | 创业板打新限售 | 1.55 | 20.88 | 403 | 624.65 | 8,414.64 | - |
| 301066 | 万事利 | 2021-09-13 | 2022-03-22 | 创业板打新限售 | 5.24 | 22.84 | 344 | 1,802.56 | 7,856.96 | - |
| 300814 | 中富电路 | 2021-08-04 | 2022-02-14 | 创业板打新限售 | 8.40 | 23.88 | 328 | 2,755.20 | 7,832.64 | - |
| 301133 | 金钟股份 | 2021-11-19 | 2022-05-26 | 创业板打新限售 | 14.33 | 26.95 | 286 | 4,098.38 | 7,707.70 | - |
| 301198 | 喜悦智行 | 2021-11-25 | 2022-06-02 | 创业板打新限售 | 21.76 | 29.20 | 262 | 5,701.12 | 7,650.40 | - |
| 301030 | 仕净科技 | 2021-07-15 | 2022-01-24 | 创业板打新限售 | 6.10 | 31.52 | 242 | 1,476.20 | 7,627.84 | - |
| 301081 | 严牌股份 | 2021-10- | 2022-04- | 创业板打 | 12.95 | 17.44 | 403 | 5,218.85 | 7,028.32 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 13 | 20 | 新限售 | | | | | | |
| 301033 | 迈普医学 | 2021-07-15 | 2022-01-26 | 创业板打新限售 | 15.14 | 59.97 | 108 | 1,635.12 | 6,476.76 | - |
| 301049 | 超越科技 | 2021-08-17 | 2022-02-24 | 创业板打新限售 | 19.34 | 32.92 | 196 | 3,790.64 | 6,452.32 | - |
| 301032 | 新柴股份 | 2021-07-15 | 2022-01-24 | 创业板打新限售 | 4.97 | 12.51 | 513 | 2,549.61 | 6,417.63 | - |
| 301056 | 森赫股份 | 2021-08-27 | 2022-03-07 | 创业板打新限售 | 3.93 | 11.09 | 572 | 2,247.96 | 6,343.48 | - |
| 301036 | 双乐股份 | 2021-07-21 | 2022-02-16 | 创业板打新限售 | 23.38 | 29.93 | 205 | 4,792.90 | 6,135.65 | - |
| 301072 | 中捷精工 | 2021-09-22 | 2022-03-29 | 创业板打新限售 | 7.46 | 33.41 | 181 | 1,350.26 | 6,047.21 | - |
| 301083 | 百胜智能 | 2021-10-13 | 2022-04-21 | 创业板打新限售 | 9.08 | 14.21 | 416 | 3,777.28 | 5,911.36 | - |
| 301063 | 海锅股份 | 2021-09-09 | 2022-03-24 | 创业板打新限售 | 17.40 | 36.11 | 153 | 2,662.20 | 5,524.83 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 001234 | 泰慕士 | 2021-12-31 | 2022-01-11 | 新股未上市 | 16.53 | 16.53 | 333 | 5,504.49 | 5,504.49 | - |
| 301038 | 深水规院 | 2021-07-22 | 2022-02-07 | 创业板打新限售 | 6.68 | 20.23 | 266 | 1,776.88 | 5,381.18 | - |
| 301027 | 华蓝集团 | 2021-07-08 | 2022-01-19 | 创业板打新限售 | 11.45 | 16.65 | 286 | 3,274.70 | 4,761.90 | - |
| 301037 | 保立佳 | 2021-07-21 | 2022-02-07 | 创业板打新限售 | 14.82 | 24.26 | 193 | 2,860.26 | 4,682.18 | - |
| 301073 | 君亭酒店 | 2021-09-22 | 2022-03-30 | 创业板打新限售 | 12.24 | 32.00 | 144 | 1,762.56 | 4,608.00 | - |
| 301053 | 远信工业 | 2021-08-25 | 2022-03-01 | 创业板打新限售 | 11.87 | 28.78 | 155 | 1,839.85 | 4,460.90 | - |
| 301057 | 汇隆新材 | 2021-08-31 | 2022-03-09 | 创业板打新限售 | 8.03 | 19.02 | 218 | 1,750.54 | 4,146.36 | - |
| 301079 | 邵阳液压 | 2021-10-11 | 2022-04-19 | 创业板打新限售 | 11.92 | 24.82 | 140 | 1,668.80 | 3,474.80 | - |

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。

### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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10,000,000.00元，截至2022年1月4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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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和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。

于2021年12月31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(2020年12月31日：同)。

### 7.4.13.3 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2021年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有10,000,000.00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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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7.4.12。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12月31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0.24%。

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12月31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4,081,487,671.99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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2021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 | 123,152,549.41 | - | - | - | - | - | 123,152,549.41 |
| 结算备付金 | 5,332,225.98 | - | - | - | - | - | 5,332,225.98 |
| 交易性金融资产 | - | - | 177,552,250.00 | - | - | 3,800,029,159.56 | 3,977,581,409.56 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,941,441.08 | 1,941,441.08 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 6,243,660.03 | 6,243,660.03 |
| 资产总计 | 128,484,775.39 | 0.00 | 177,552,250.00 | 0.00 | 0.00 | 3,808,214,260.67 | 4,114,251,286.06 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 10,000,000.00 | - | - | - | - | - | 10,000,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 22,934,545.78 | 22,934,545.78 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 2,720,261.62 | 2,720,261.62 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 362,701.55 | 362,701.55 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 445,505.18 | 445,505.18 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 410,472.45 | 410,472.45 |
| 负债总计 | 10,000,000.00 | - | - | - | - | 26,873,486.58 | 36,873,486.58 |
| 利率敏感度缺口 | 118,484,775.39 | 0.00 | 177,552,250.00 | 0.00 | 0.00 | 3,781,340,774.09 | 4,077,377,799.48 |
| 上年度末2020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 | | | | | | | |
| 银行存款 | 9,674,719.19 | - | - | - | - | - | 9,674,719.19 |
| 结算备付金 | 302,978.11 | - | - | - | - | - | 302,978.11 |
| 交易性金融资产 | 2,999,700.00 | 13,774,488.00 | - | - | - | 337,826,901.10 | 354,601,089.10 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 296,069.88 | 296,069.88 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 225,017.23 | 225,017.23 |
| 资产总计 | 12,977,397.30 | 13,774,488.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 338,347,988.21 | 365,099,873.51 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 2,856,183.37 | 2,856,183.37 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 235,947.48 | 235,947.48 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 31,459.67 | 31,459.67 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 33,990.18 | 33,990.18 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 221,640.24 | 221,640.24 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 3,379,220.94 | 3,379,220.94 |
| 利率敏感度缺口 | 12,977,397.30 | 13,774,488.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 334,968,767.27 | 361,720,652.57 |

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。

### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.35%(2020年12月31日：4.64%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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。

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021年12月31日 | | 上年度末<br>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 | 3,800,029,159.56 | 93.20 | 337,826,901.10 | 93.39 |
| 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 | 3,800,029,159.56 | 93.20 | 337,826,901.10 | 93.39 |

### 7.4.13.4.3.2 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
| | 1.中证500指数收益率上升5% | 200,471,472.02 | 17,140,448.51 |
| | 2.中证500指数收益率下降5% | -200,471,472.02 | -17,140,448.51 |

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为3,790,243,920.14元，属于第二层次的余额为183,681,381.71元，属于第三层次的余额为3,656,107.71元(2020年12月31日：第一层次333,436,485.40元，第二层次21,164,603.70元，无第三层次)。

(ii) 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具3,656,107.71元(2020年12月31日：无)。本基金本年度购买或转入第三层次的金融工具2,666,254.98元(2020年度：无)，计入损益的利得或损失金额为989,852.73元，均为2021年12月31日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次交易性金融资产均为股票投资，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号－金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号－金融资产转移》、《企业会计准则第24号－套期会计》和《企业会计准则第37号-金融工具列报》(以下合称"新金融工具准则")相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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 | 3,800,029,159.56 | 92.36 |
| | 其中：股票 | 3,800,029,159.56 | 92.36 |
| 2 | 基金投资 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3 | 固定收益投资 | 177,552,250.00 | 4.32 |
| | 其中：债券 | 177,552,250.00 | 4.32 |
| | 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 | 128,484,775.39 | 3.12 |
| 8 | 其他各项资产 | 8,185,101.11 | 0.20 |
| 9 | 合计 | 4,114,251,286.06 | 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。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 182,672,188.41 | 4.48 |
| C | 制造业 | 2,036,711,627.43 | 49.95 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 91,682,685.30 | 2.25 |
| E | 建筑业 | 91,519,007.18 | 2.24 |
| F | 批发和零售业 | 62,487,921.13 | 1.53 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 58,185,642.25 | 1.43 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 339,547,003.53 | 8.33 |
| J | 金融业 | 118,988,701.07 | 2.92 |
| K | 房地产业 | 25,463,176.06 | 0.62 |
| L | 租赁和商务服务业 | 64,616,604.18 | 1.58 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| M | 科学研究和技术服务业 | 9,039,554.16 | 0.22 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 20,403,963.97 | 0.50 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 10,663,141.23 | 0.26 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 24,387,123.43 | 0.60 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,136,368,339.33 | 76.92 |

## 8.2.2 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 | 46,996,872.00 | 1.15 |
| C | 制造业 | 452,905,629.77 | 11.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,929,010.00 | 0.29 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 79,053.80 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 20,117,059.60 | 0.49 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 53,320,743.74 | 1.31 |
| J | 金融业 | 59,695,124.78 | 1.46 |
| K | 房地产业 | 2,904,471.00 | 0.07 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,843,423.00 | 0.09 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,585,078.98 | 0.09 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,811.84 | 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,263,933.72 | 0.20 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 663,660,820.23 | 16.28 |

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 8.3 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

### 8.3.1 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 | 600884 | 杉杉股份 | 1,924,873 | 63,078,088.21 | 1.55 |
| 2 | 000733 | 振华科技 | 484,400 | 60,201,232.00 | 1.48 |
| 3 | 300037 | 新宙邦 | 525,071 | 59,333,023.00 | 1.46 |
| 4 | 600765 | 中航重机 | 1,142,168 | 57,668,062.32 | 1.41 |
| 5 | 605358 | 立昂微 | 473,773 | 56,857,497.73 | 1.39 |
| 6 | 300363 | 博腾股份 | 630,400 | 56,389,280.00 | 1.38 |
| 7 | 600256 | 广汇能源 | 8,515,534 | 55,691,592.36 | 1.37 |
| 8 | 600862 | 中航高科 | 1,555,500 | 55,624,680.00 | 1.36 |
| 9 | 603589 | 口子窖 | 780,300 | 55,299,861.00 | 1.36 |
| 10 | 000988 | 华工科技 | 1,957,930 | 54,547,929.80 | 1.34 |
| 11 | 688099 | 晶晨股份 | 413,041 | 53,777,938.20 | 1.32 |
| 12 | 601615 | 明阳智能 | 2,058,969 | 53,739,090.90 | 1.32 |
| 13 | 688536 | 思瑞浦 | 69,071 | 53,046,528.00 | 1.30 |
| 14 | 002212 | 天融信 | 2,660,652 | 51,004,698.84 | 1.25 |
| 15 | 002180 | 纳思达 | 1,040,264 | 49,683,008.64 | 1.22 |
| 16 | 603456 | 九洲药业 | 882,117 | 49,627,902.42 | 1.22 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 17 | 603198 | 迎驾贡酒 | 698,215 | 48,491,031.75 | 1.19 |
| 18 | 601128 | 常熟银行 | 7,094,495 | 46,894,611.95 | 1.15 |
| 19 | 600803 | 新奥股份 | 2,514,368 | 46,163,796.48 | 1.13 |
| 20 | 601689 | 拓普集团 | 858,228 | 45,486,084.00 | 1.12 |
| 21 | 300751 | 迈为股份 | 69,643 | 44,731,698.90 | 1.10 |
| 22 | 603613 | 国联股份 | 405,577 | 43,599,527.50 | 1.07 |
| 23 | 688005 | 容百科技 | 371,958 | 42,990,905.64 | 1.05 |
| 24 | 002384 | 东山精密 | 1,544,088 | 41,844,784.80 | 1.03 |
| 25 | 600039 | 四川路桥 | 3,467,700 | 41,751,108.00 | 1.02 |
| 26 | 600233 | 圆通速递 | 2,347,300 | 39,152,964.00 | 0.96 |
| 27 | 000062 | 深圳华强 | 2,242,691 | 38,641,565.93 | 0.95 |
| 28 | 600415 | 小商品城 | 7,822,086 | 37,937,117.10 | 0.93 |
| 29 | 688188 | 柏楚电子 | 96,281 | 37,112,474.26 | 0.91 |
| 30 | 002372 | 伟星新材 | 1,465,445 | 35,639,622.40 | 0.87 |
| 31 | 601699 | 潞安环能 | 3,095,737 | 35,012,785.47 | 0.86 |
| 32 | 600201 | 生物股份 | 2,139,148 | 34,975,069.80 | 0.86 |
| 33 | 603444 | 吉比特 | 76,045 | 32,079,583.25 | 0.79 |
| 34 | 002294 | 信立泰 | 1,172,729 | 32,038,956.28 | 0.79 |
| 35 | 688065 | 凯赛生物 | 173,451 | 31,963,550.28 | 0.78 |
| 36 | 688006 | 杭可科技 | 295,131 | 31,750,192.98 | 0.78 |
| 37 | 002508 | 老板电器 | 875,500 | 31,535,510.00 | 0.77 |
| 38 | 600885 | 宏发股份 | 419,850 | 31,337,604.00 | 0.77 |
| 39 | 600516 | 方大炭素 | 2,890,495 | 31,275,155.90 | 0.77 |
| 40 | 000983 | 山西焦煤 | 3,737,447 | 30,908,686.69 | 0.76 |
| 41 | 000598 | 兴蓉环境 | 4,717,920 | 29,817,254.40 | 0.73 |
| 42 | 002128 | 电投能源 | 1,998,500 | 29,677,725.00 | 0.73 |
| 43 | 002430 | 杭氧股份 | 946,000 | 28,389,460.00 | 0.70 |
| 44 | 600380 | 健康元 | 2,143,516 | 27,522,745.44 | 0.68 |
| 45 | 300630 | 普利制药 | 493,000 | 27,134,720.00 | 0.67 |
| 46 | 300253 | 卫宁健康 | 1,617,241 | 27,104,959.16 | 0.66 |
| 47 | 002183 | 怡 亚 通 | 4,030,134 | 26,679,487.08 | 0.65 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 48 | 000039 | 中集集团 | 1,480,107 | 25,398,636.12 | 0.62 |
| 49 | 603290 | 斯达半导 | 65,600 | 24,993,600.00 | 0.61 |
| 50 | 300474 | 景嘉微 | 163,248 | 24,846,345.60 | 0.61 |
| 51 | 002797 | 第一创业 | 3,326,409 | 24,349,313.88 | 0.60 |
| 52 | 000877 | 天山股份 | 1,580,000 | 24,189,800.00 | 0.59 |
| 53 | 002396 | 星网锐捷 | 1,024,588 | 24,149,539.16 | 0.59 |
| 54 | 600348 | 华阳股份 | 2,010,600 | 23,825,610.00 | 0.58 |
| 55 | 603605 | 珀莱雅 | 111,735 | 23,275,517.85 | 0.57 |
| 56 | 000959 | 首钢股份 | 4,039,900 | 23,148,627.00 | 0.57 |
| 57 | 002867 | 周大生 | 1,283,338 | 22,817,749.64 | 0.56 |
| 58 | 002939 | 长城证券 | 1,747,800 | 22,634,010.00 | 0.56 |
| 59 | 002831 | 裕同科技 | 665,569 | 22,423,019.61 | 0.55 |
| 60 | 000519 | 中兵红箭 | 808,648 | 21,566,642.16 | 0.53 |
| 61 | 600486 | 扬农化工 | 163,288 | 21,423,385.60 | 0.53 |
| 62 | 600141 | 兴发集团 | 553,402 | 20,962,867.76 | 0.51 |
| 63 | 600737 | 中粮糖业 | 2,163,700 | 20,338,780.00 | 0.50 |
| 64 | 002048 | 宁波华翔 | 919,846 | 19,896,268.98 | 0.49 |
| 65 | 603712 | 七一二 | 453,006 | 19,615,159.80 | 0.48 |
| 66 | 002244 | 滨江集团 | 4,174,691 | 19,454,060.06 | 0.48 |
| 67 | 600970 | 中材国际 | 1,623,826 | 18,560,331.18 | 0.46 |
| 68 | 002572 | 索菲亚 | 829,400 | 18,412,680.00 | 0.45 |
| 69 | 000623 | 吉林敖东 | 968,554 | 17,889,192.38 | 0.44 |
| 70 | 603707 | 健友股份 | 424,385 | 17,824,170.00 | 0.44 |
| 71 | 600315 | 上海家化 | 438,071 | 17,702,449.11 | 0.43 |
| 72 | 601555 | 东吴证券 | 1,938,723 | 17,177,085.78 | 0.42 |
| 73 | 000960 | 锡业股份 | 846,394 | 16,530,074.82 | 0.41 |
| 74 | 688029 | 南微医学 | 76,936 | 16,361,979.12 | 0.40 |
| 75 | 300699 | 光威复材 | 193,500 | 16,346,880.00 | 0.40 |
| 76 | 603868 | 飞科电器 | 372,500 | 16,173,950.00 | 0.40 |
| 77 | 300308 | 中际旭创 | 372,943 | 15,850,077.50 | 0.39 |
| 78 | 300166 | 东方国信 | 1,462,100 | 15,790,680.00 | 0.39 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 79 | 000932 | 华菱钢铁 | 3,033,100 | 15,499,141.00 | 0.38 |
| 80 | 000629 | 攀钢钒钛 | 3,876,702 | 15,080,370.78 | 0.37 |
| 81 | 603228 | 景旺电子 | 428,012 | 14,779,254.36 | 0.36 |
| 82 | 300133 | 华策影视 | 2,140,059 | 14,488,199.43 | 0.36 |
| 83 | 002368 | 太极股份 | 506,000 | 13,935,240.00 | 0.34 |
| 84 | 002434 | 万里扬 | 941,500 | 13,877,710.00 | 0.34 |
| 85 | 000090 | 天健集团 | 2,262,400 | 13,280,288.00 | 0.33 |
| 86 | 600535 | 天士力 | 815,890 | 12,931,856.50 | 0.32 |
| 87 | 601636 | 旗滨集团 | 728,509 | 12,457,503.90 | 0.31 |
| 88 | 600867 | 通化东宝 | 1,126,627 | 12,347,831.92 | 0.30 |
| 89 | 002223 | 鱼跃医疗 | 310,920 | 11,752,776.00 | 0.29 |
| 90 | 603225 | 新凤鸣 | 722,670 | 10,731,649.50 | 0.26 |
| 91 | 300244 | 迪安诊断 | 317,639 | 10,663,141.23 | 0.26 |
| 92 | 002013 | 中航机电 | 586,200 | 10,657,116.00 | 0.26 |
| 93 | 002416 | 爱施德 | 917,090 | 10,436,484.20 | 0.26 |
| 94 | 603568 | 伟明环保 | 284,649 | 10,398,227.97 | 0.26 |
| 95 | 001872 | 招商港口 | 611,300 | 10,361,535.00 | 0.25 |
| 96 | 002266 | 浙富控股 | 1,405,300 | 10,005,736.00 | 0.25 |
| 97 | 601928 | 凤凰传媒 | 1,223,600 | 9,898,924.00 | 0.24 |
| 98 | 601117 | 中国化学 | 815,700 | 9,788,400.00 | 0.24 |
| 99 | 002028 | 思源电气 | 196,548 | 9,672,127.08 | 0.24 |
| 100 | 002985 | 北摩高科 | 78,000 | 9,395,880.00 | 0.23 |
| 101 | 600967 | 内蒙一机 | 783,715 | 9,365,394.25 | 0.23 |
| 102 | 603127 | 昭衍新药 | 78,312 | 9,039,554.16 | 0.22 |
| 103 | 300136 | 信维通信 | 352,833 | 8,933,731.56 | 0.22 |
| 104 | 002138 | 顺络电子 | 230,500 | 8,800,490.00 | 0.22 |
| 105 | 601000 | 唐山港 | 3,153,143 | 8,671,143.25 | 0.21 |
| 106 | 300009 | 安科生物 | 652,300 | 8,538,607.00 | 0.21 |
| 107 | 002191 | 劲嘉股份 | 560,300 | 8,477,339.00 | 0.21 |
| 108 | 600739 | 辽宁成大 | 428,700 | 8,368,224.00 | 0.21 |
| 109 | 600529 | 山东药玻 | 189,749 | 8,329,981.10 | 0.20 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 110 | 601016 | 节能风电 | 1,268,600 | 8,258,586.00 | 0.20 |
| 111 | 600170 | 上海建工 | 2,260,800 | 8,138,880.00 | 0.20 |
| 112 | 600764 | 中国海防 | 199,900 | 8,127,934.00 | 0.20 |
| 113 | 600908 | 无锡银行 | 1,399,238 | 7,933,679.46 | 0.19 |
| 114 | 300418 | 昆仑万维 | 340,400 | 7,880,260.00 | 0.19 |
| 115 | 000830 | 鲁西化工 | 511,789 | 7,809,900.14 | 0.19 |
| 116 | 002595 | 豪迈科技 | 279,500 | 7,758,920.00 | 0.19 |
| 117 | 600188 | 兖矿能源 | 321,113 | 7,555,788.89 | 0.19 |
| 118 | 600021 | 上海电力 | 580,581 | 7,443,048.42 | 0.18 |
| 119 | 000898 | 鞍钢股份 | 1,952,600 | 7,322,250.00 | 0.18 |
| 120 | 600623 | 华谊集团 | 768,209 | 6,990,701.90 | 0.17 |
| 121 | 603379 | 三美股份 | 297,733 | 6,782,357.74 | 0.17 |
| 122 | 300257 | 开山股份 | 420,700 | 6,680,716.00 | 0.16 |
| 123 | 600329 | 中新药业 | 207,500 | 6,517,575.00 | 0.16 |
| 124 | 001914 | 招商积余 | 296,600 | 6,009,116.00 | 0.15 |
| 125 | 002340 | 格林美 | 568,447 | 5,883,426.45 | 0.14 |
| 126 | 300763 | 锦浪科技 | 25,100 | 5,811,905.00 | 0.14 |
| 127 | 000887 | 中鼎股份 | 247,451 | 5,396,906.31 | 0.13 |
| 128 | 600282 | 南钢股份 | 1,457,000 | 5,390,900.00 | 0.13 |
| 129 | 600177 | 雅戈尔 | 736,400 | 5,073,796.00 | 0.12 |
| 130 | 600511 | 国药股份 | 159,900 | 5,041,647.00 | 0.12 |
| 131 | 002250 | 联化科技 | 277,600 | 4,988,472.00 | 0.12 |
| 132 | 002002 | 鸿达兴业 | 817,609 | 4,954,710.54 | 0.12 |
| 133 | 688521 | 芯原股份 | 54,487 | 4,215,114.32 | 0.10 |
| 134 | 300223 | 北京君正 | 31,052 | 4,160,968.00 | 0.10 |
| 135 | 000553 | 安道麦A | 490,200 | 4,137,288.00 | 0.10 |

### 8.3.2 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 | 002129 | 中环股份 | 694,700 | 29,003,725.00 | 0.71 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 1,034,661 | 27,325,397.01 | 0.67 |
| 3 | 000762 | 西藏矿业 | 432,300 | 22,968,099.00 | 0.56 |
| 4 | 300733 | 西菱动力 | 860,937 | 22,625,424.36 | 0.55 |
| 5 | 002738 | 中矿资源 | 254,700 | 17,920,692.00 | 0.44 |
| 6 | 002517 | 恺英网络 | 2,966,488 | 17,264,960.16 | 0.42 |
| 7 | 601878 | 浙商证券 | 1,262,939 | 16,645,536.02 | 0.41 |
| 8 | 688357 | 建龙微纳 | 85,976 | 16,502,233.44 | 0.40 |
| 9 | 002410 | 广联达 | 250,080 | 16,000,118.40 | 0.39 |
| 10 | 002240 | 盛新锂能 | 273,000 | 15,820,350.00 | 0.39 |
| 11 | 000657 | 中钨高新 | 967,617 | 15,559,281.36 | 0.38 |
| 12 | 603566 | 普莱柯 | 692,000 | 15,293,200.00 | 0.38 |
| 13 | 603713 | 密尔克卫 | 110,900 | 14,947,102.00 | 0.37 |
| 14 | 603986 | 兆易创新 | 74,376 | 13,079,019.60 | 0.32 |
| 15 | 600132 | 重庆啤酒 | 78,836 | 11,929,463.52 | 0.29 |
| 16 | 601158 | 重庆水务 | 1,861,000 | 11,929,010.00 | 0.29 |
| 17 | 601899 | 紫金矿业 | 1,219,900 | 11,833,030.00 | 0.29 |
| 18 | 300059 | 东方财富 | 295,737 | 10,974,800.07 | 0.27 |
| 19 | 688356 | 键凯科技 | 29,987 | 10,109,517.31 | 0.25 |
| 20 | 300833 | 浩洋股份 | 121,000 | 9,804,630.00 | 0.24 |
| 21 | 002648 | 卫星化学 | 232,963 | 9,325,508.89 | 0.23 |
| 22 | 002850 | 科达利 | 56,500 | 9,059,210.00 | 0.22 |
| 23 | 300171 | 东富龙 | 176,605 | 8,925,616.70 | 0.22 |
| 24 | 000423 | 东阿阿胶 | 173,300 | 8,448,375.00 | 0.21 |
| 25 | 688122 | 西部超导 | 86,882 | 8,422,341.08 | 0.21 |
| 26 | 300316 | 晶盛机电 | 119,338 | 8,293,991.00 | 0.20 |
| 27 | 600136 | 当代文体 | 1,226,500 | 8,217,550.00 | 0.20 |
| 28 | 600436 | 片仔癀 | 18,783 | 8,210,988.45 | 0.20 |
| 29 | 002286 | 保龄宝 | 603,200 | 8,155,264.00 | 0.20 |
| 30 | 002003 | 伟星股份 | 625,000 | 8,012,500.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 31 | 601882 | 海天精工 | 314,900 | 7,800,073.00 | 0.19 |
| 32 | 002756 | 永兴材料 | 47,500 | 7,030,950.00 | 0.17 |
| 33 | 300772 | 运达股份 | 146,865 | 6,459,122.70 | 0.16 |
| 34 | 688017 | 绿的谐波 | 36,848 | 6,432,186.88 | 0.16 |
| 35 | 688233 | 神工股份 | 71,879 | 6,339,727.80 | 0.16 |
| 36 | 600499 | 科达制造 | 251,800 | 6,249,676.00 | 0.15 |
| 37 | 002555 | 三七互娱 | 222,000 | 5,998,440.00 | 0.15 |
| 38 | 688200 | 华峰测控 | 11,461 | 5,866,885.90 | 0.14 |
| 39 | 000977 | 浪潮信息 | 161,400 | 5,782,962.00 | 0.14 |
| 40 | 600941 | 中国移动 | 99,842 | 5,748,902.36 | 0.14 |
| 41 | 002709 | 天赐材料 | 49,900 | 5,721,035.00 | 0.14 |
| 42 | 002402 | 和而泰 | 207,400 | 5,688,982.00 | 0.14 |
| 43 | 688595 | 芯海科技 | 44,999 | 5,600,125.55 | 0.14 |
| 44 | 300573 | 兴齐眼药 | 40,100 | 5,485,680.00 | 0.13 |
| 45 | 603043 | 广州酒家 | 221,040 | 5,318,222.40 | 0.13 |
| 46 | 601919 | 中远海控 | 275,240 | 5,144,235.60 | 0.13 |
| 47 | 300124 | 汇川技术 | 74,700 | 5,124,420.00 | 0.13 |
| 48 | 603979 | 金诚信 | 233,600 | 5,017,728.00 | 0.12 |
| 49 | 601677 | 明泰铝业 | 110,700 | 4,880,763.00 | 0.12 |
| 50 | 600837 | 海通证券 | 381,700 | 4,679,642.00 | 0.11 |
| 51 | 000063 | 中兴通讯 | 137,401 | 4,602,933.50 | 0.11 |
| 52 | 002687 | 乔治白 | 642,500 | 4,542,475.00 | 0.11 |
| 53 | 603995 | 甬金股份 | 78,300 | 4,530,438.00 | 0.11 |
| 54 | 603496 | 恒为科技 | 284,073 | 4,403,131.50 | 0.11 |
| 55 | 002371 | 北方华创 | 12,300 | 4,268,346.00 | 0.10 |
| 56 | 300073 | 当升科技 | 48,800 | 4,239,256.00 | 0.10 |
| 57 | 603236 | 移远通信 | 20,630 | 4,206,457.00 | 0.10 |
| 58 | 601666 | 平煤股份 | 472,300 | 3,953,151.00 | 0.10 |
| 59 | 600057 | 厦门象屿 | 452,700 | 3,843,423.00 | 0.09 |
| 60 | 600183 | 生益科技 | 152,766 | 3,597,639.30 | 0.09 |
| 61 | 000799 | 酒鬼酒 | 16,579 | 3,523,037.50 | 0.09 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 62 | 002597 | 金禾实业 | 67,000 | 3,440,450.00 | 0.08 |
| 63 | 002407 | 多氟多 | 74,700 | 3,360,753.00 | 0.08 |
| 64 | 688508 | 芯朋微 | 28,788 | 3,335,377.68 | 0.08 |
| 65 | 300735 | 光弘科技 | 217,530 | 3,278,177.10 | 0.08 |
| 66 | 300587 | 天铁股份 | 164,124 | 3,277,556.28 | 0.08 |
| 67 | 300623 | 捷捷微电 | 104,000 | 3,271,840.00 | 0.08 |
| 68 | 603019 | 中科曙光 | 117,500 | 3,239,475.00 | 0.08 |
| 69 | 601088 | 中国神华 | 143,200 | 3,224,864.00 | 0.08 |
| 70 | 603259 | 药明康德 | 27,096 | 3,213,043.68 | 0.08 |
| 71 | 600745 | 闻泰科技 | 24,700 | 3,193,710.00 | 0.08 |
| 72 | 600779 | 水井坊 | 26,100 | 3,131,739.00 | 0.08 |
| 73 | 603129 | 春风动力 | 18,100 | 3,131,300.00 | 0.08 |
| 74 | 300661 | 圣邦股份 | 9,968 | 3,080,112.00 | 0.08 |
| 75 | 002497 | 雅化集团 | 106,400 | 3,049,424.00 | 0.07 |
| 76 | 002594 | 比亚迪 | 11,200 | 3,002,944.00 | 0.07 |
| 77 | 002008 | 大族激光 | 55,000 | 2,970,000.00 | 0.07 |
| 78 | 300571 | 平治信息 | 50,400 | 2,951,424.00 | 0.07 |
| 79 | 600438 | 通威股份 | 65,600 | 2,949,376.00 | 0.07 |
| 80 | 002960 | 青鸟消防 | 60,400 | 2,932,420.00 | 0.07 |
| 81 | 300014 | 亿纬锂能 | 24,764 | 2,926,609.52 | 0.07 |
| 82 | 600641 | 万业企业 | 87,300 | 2,904,471.00 | 0.07 |
| 83 | 002916 | 深南电路 | 23,700 | 2,887,134.00 | 0.07 |
| 84 | 000625 | 长安汽车 | 187,500 | 2,848,125.00 | 0.07 |
| 85 | 688518 | 联赢激光 | 54,538 | 2,687,087.26 | 0.07 |
| 86 | 002920 | 德赛西威 | 18,914 | 2,676,520.14 | 0.07 |
| 87 | 603920 | 世运电路 | 119,230 | 2,658,829.00 | 0.07 |
| 88 | 603901 | 永创智能 | 161,600 | 2,601,760.00 | 0.06 |
| 89 | 002585 | 双星新材 | 94,600 | 2,561,768.00 | 0.06 |
| 90 | 601728 | 中国电信 | 394,011 | 1,682,426.97 | 0.04 |
| 91 | 688148 | 芳源股份 | 11,860 | 403,240.00 | 0.01 |
| 92 | 688262 | 国芯科技 | 7,129 | 299,275.42 | 0.01 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 93 | 688800 | 瑞可达 | 1,967 | 262,653.51 | 0.01 |
| 94 | 688248 | 南网科技 | 11,763 | 222,320.70 | 0.01 |
| 95 | 301155 | 海力风电 | 1,054 | 101,974.50 | 0.00 |
| 96 | 301136 | 招标股份 | 7,172 | 75,449.44 | 0.00 |
| 97 | 600927 | 永安期货 | 1,859 | 69,749.68 | 0.00 |
| 98 | 301087 | 可孚医疗 | 848 | 63,888.32 | 0.00 |
| 99 | 301050 | 雷电微力 | 233 | 54,694.42 | 0.00 |
| 100 | 301029 | 怡合达 | 462 | 41,519.94 | 0.00 |
| 101 | 688501 | 青达环保 | 1,759 | 37,132.49 | 0.00 |
| 102 | 301035 | 润丰股份 | 644 | 36,244.32 | 0.00 |
| 103 | 301090 | 华润材料 | 3,026 | 34,480.96 | 0.00 |
| 104 | 603230 | 内蒙新华 | 1,140 | 29,491.80 | 0.00 |
| 105 | 301058 | 中粮工科 | 1,460 | 26,729.56 | 0.00 |
| 106 | 301039 | 中集车辆 | 2,064 | 25,820.64 | 0.00 |
| 107 | 001317 | 三羊马 | 300 | 25,722.00 | 0.00 |
| 108 | 301099 | 雅创电子 | 351 | 25,047.36 | 0.00 |
| 109 | 301221 | 光庭信息 | 280 | 24,841.60 | 0.00 |
| 110 | 301189 | C奥尼 | 435 | 24,629.70 | 0.00 |
| 111 | 301166 | C优宁维 | 253 | 23,908.50 | 0.00 |
| 112 | 301069 | 凯盛新材 | 539 | 23,829.19 | 0.00 |
| 113 | 301096 | 百诚医药 | 272 | 21,360.16 | 0.00 |
| 114 | 301093 | 华兰股份 | 409 | 20,388.65 | 0.00 |
| 115 | 301018 | 申菱环境 | 782 | 20,378.92 | 0.00 |
| 116 | 300994 | 久祺股份 | 420 | 19,089.00 | 0.00 |
| 117 | 301100 | 风光股份 | 599 | 18,652.86 | 0.00 |
| 118 | 001296 | 长江材料 | 310 | 18,376.80 | 0.00 |
| 119 | 301088 | 戎美股份 | 704 | 17,367.68 | 0.00 |
| 120 | 301168 | 通灵股份 | 329 | 17,150.77 | 0.00 |
| 121 | 301101 | 明月镜片 | 371 | 16,086.56 | 0.00 |
| 122 | 301190 | 善水科技 | 575 | 15,789.50 | 0.00 |
| 123 | 301118 | 恒光股份 | 315 | 15,441.30 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 124 | 301108 | 洁雅股份 | 280 | 15,038.80 | 0.00 |
| 125 | 301179 | 泽宇智能 | 295 | 14,977.15 | 0.00 |
| 126 | 301089 | 拓新药业 | 220 | 14,944.60 | 0.00 |
| 127 | 301180 | 万祥科技 | 654 | 14,858.88 | 0.00 |
| 128 | 301046 | 能辉科技 | 290 | 14,207.10 | 0.00 |
| 129 | 301111 | 粤万年青 | 379 | 13,901.72 | 0.00 |
| 130 | 301188 | 力诺特玻 | 647 | 13,250.56 | 0.00 |
| 131 | 301199 | 迈赫股份 | 402 | 12,864.00 | 0.00 |
| 132 | 301020 | 密封科技 | 421 | 12,815.24 | 0.00 |
| 133 | 301026 | 浩通科技 | 203 | 12,734.19 | 0.00 |
| 134 | 301126 | 达嘉维康 | 662 | 12,730.26 | 0.00 |
| 135 | 301092 | 争光股份 | 323 | 11,472.96 | 0.00 |
| 136 | 301048 | 金鹰重工 | 843 | 10,925.28 | 0.00 |
| 137 | 301028 | 东亚机械 | 733 | 9,895.50 | 0.00 |
| 138 | 300774 | 倍杰特 | 444 | 9,359.52 | 0.00 |
| 139 | 301182 | 凯旺科技 | 294 | 8,990.52 | 0.00 |
| 140 | 301062 | 上海艾录 | 525 | 8,932.29 | 0.00 |
| 141 | 301193 | 家联科技 | 297 | 8,654.58 | 0.00 |
| 142 | 301052 | 果麦文化 | 252 | 8,477.28 | 0.00 |
| 143 | 301025 | 读客文化 | 403 | 8,414.64 | 0.00 |
| 144 | 301066 | 万事利 | 344 | 7,856.96 | 0.00 |
| 145 | 300814 | 中富电路 | 328 | 7,832.64 | 0.00 |
| 146 | 301133 | 金钟股份 | 286 | 7,707.70 | 0.00 |
| 147 | 301198 | 喜悦智行 | 262 | 7,650.40 | 0.00 |
| 148 | 301030 | 仕净科技 | 242 | 7,627.84 | 0.00 |
| 149 | 301038 | 深水规院 | 353 | 7,206.44 | 0.00 |
| 150 | 301081 | 严牌股份 | 403 | 7,028.32 | 0.00 |
| 151 | 301033 | 迈普医学 | 108 | 6,476.76 | 0.00 |
| 152 | 301049 | 超越科技 | 196 | 6,452.32 | 0.00 |
| 153 | 301032 | 新柴股份 | 513 | 6,417.63 | 0.00 |
| 154 | 301056 | 森赫股份 | 572 | 6,343.48 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 155 | 301036 | 双乐股份 | 205 | 6,135.65 | 0.00 |
| 156 | 301072 | 中捷精工 | 181 | 6,047.21 | 0.00 |
| 157 | 301083 | 百胜智能 | 416 | 5,911.36 | 0.00 |
| 158 | 301063 | 海锅股份 | 153 | 5,524.83 | 0.00 |
| 159 | 001234 | 泰慕士 | 333 | 5,504.49 | 0.00 |
| 160 | 301057 | 汇隆新材 | 273 | 5,238.11 | 0.00 |
| 161 | 301027 | 华蓝集团 | 286 | 4,761.90 | 0.00 |
| 162 | 301037 | 保立佳 | 193 | 4,682.18 | 0.00 |
| 163 | 301073 | 君亭酒店 | 144 | 4,608.00 | 0.00 |
| 164 | 301053 | 远信工业 | 155 | 4,460.90 | 0.00 |
| 165 | 301079 | 邵阳液压 | 140 | 3,474.80 | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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 | 002709 | 天赐材料 | 239,511,414.40 | 66.21 |
| 2 | 600089 | 特变电工 | 217,339,650.95 | 60.08 |
| 3 | 601233 | 桐昆股份 | 207,000,372.61 | 57.23 |
| 4 | 300316 | 晶盛机电 | 176,655,739.11 | 48.84 |
| 5 | 300037 | 新宙邦 | 171,026,413.69 | 47.28 |
| 6 | 601636 | 旗滨集团 | 160,550,073.30 | 44.39 |
| 7 | 600803 | 新奥股份 | 156,802,579.27 | 43.35 |
| 8 | 600885 | 宏发股份 | 156,777,250.27 | 43.34 |
| 9 | 600884 | 杉杉股份 | 154,803,653.04 | 42.80 |
| 10 | 002080 | 中材科技 | 149,467,730.33 | 41.32 |
| 11 | 601689 | 拓普集团 | 148,763,761.40 | 41.13 |
| 12 | 000039 | 中集集团 | 148,759,551.90 | 41.13 |
| 13 | 000799 | 酒鬼酒 | 147,519,766.93 | 40.78 |
| 14 | 000877 | 天山股份 | 142,892,786.68 | 39.50 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 15 | 002648 | 卫星化学 | 142,380,942.24 | 39.36 |
| 16 | 000519 | 中兵红箭 | 139,709,268.29 | 38.62 |
| 17 | 002867 | 周大生 | 138,551,618.10 | 38.30 |
| 18 | 000830 | 鲁西化工 | 136,501,396.32 | 37.74 |
| 19 | 600141 | 兴发集团 | 136,237,977.18 | 37.66 |
| 20 | 600563 | 法拉电子 | 134,989,900.61 | 37.32 |
| 21 | 601615 | 明阳智能 | 134,437,987.11 | 37.17 |
| 22 | 688099 | 晶晨股份 | 132,963,775.86 | 36.76 |
| 23 | 000009 | 中国宝安 | 132,150,667.49 | 36.53 |
| 24 | 600219 | 南山铝业 | 130,502,382.25 | 36.08 |
| 25 | 603444 | 吉比特 | 129,709,814.59 | 35.86 |
| 26 | 000887 | 中鼎股份 | 129,066,088.05 | 35.68 |
| 27 | 603486 | 科沃斯 | 128,318,517.91 | 35.47 |
| 28 | 300223 | 北京君正 | 126,432,183.42 | 34.95 |
| 29 | 600188 | 兖矿能源 | 120,926,382.27 | 33.43 |
| 30 | 002266 | 浙富控股 | 118,414,253.44 | 32.74 |
| 31 | 600765 | 中航重机 | 115,405,004.08 | 31.90 |
| 32 | 605358 | 立昂微 | 112,767,503.68 | 31.18 |
| 33 | 600549 | 厦门钨业 | 112,141,316.92 | 31.00 |
| 34 | 002183 | 怡 亚 通 | 111,475,092.47 | 30.82 |
| 35 | 000983 | 山西焦煤 | 108,341,099.71 | 29.95 |
| 36 | 002048 | 宁波华翔 | 108,323,921.94 | 29.95 |
| 37 | 601699 | 潞安环能 | 107,295,286.25 | 29.66 |
| 38 | 002396 | 星网锐捷 | 106,994,127.31 | 29.58 |
| 39 | 002408 | 齐翔腾达 | 106,150,929.81 | 29.35 |
| 40 | 688188 | 柏楚电子 | 105,723,049.72 | 29.23 |
| 41 | 600256 | 广汇能源 | 105,717,443.74 | 29.23 |
| 42 | 600039 | 四川路桥 | 105,340,332.00 | 29.12 |
| 43 | 000062 | 深圳华强 | 103,358,932.90 | 28.57 |
| 44 | 600779 | 水井坊 | 101,699,110.75 | 28.12 |
| 45 | 002180 | 纳思达 | 101,006,612.72 | 27.92 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 46 | 600808 | 马钢股份 | 100,613,220.92 | 27.82 |
| 47 | 601168 | 西部矿业 | 100,432,325.07 | 27.77 |
| 48 | 600348 | 华阳股份 | 100,176,480.51 | 27.69 |
| 49 | 000988 | 华工科技 | 98,970,909.86 | 27.36 |
| 50 | 000733 | 振华科技 | 98,633,087.41 | 27.27 |
| 51 | 600380 | 健康元 | 98,128,017.68 | 27.13 |
| 52 | 002985 | 北摩高科 | 97,687,854.94 | 27.01 |
| 53 | 600460 | 士兰微 | 97,479,900.72 | 26.95 |
| 54 | 603290 | 斯达半导 | 97,468,728.24 | 26.95 |
| 55 | 601128 | 常熟银行 | 97,085,807.64 | 26.84 |
| 56 | 601928 | 凤凰传媒 | 96,251,143.47 | 26.61 |
| 57 | 603568 | 伟明环保 | 95,644,163.64 | 26.44 |
| 58 | 000636 | 风华高科 | 95,516,612.60 | 26.41 |
| 59 | 000932 | 华菱钢铁 | 92,562,638.34 | 25.59 |
| 60 | 000960 | 锡业股份 | 90,524,761.74 | 25.03 |
| 61 | 603260 | 合盛硅业 | 90,375,877.49 | 24.98 |
| 62 | 600875 | 东方电气 | 89,879,641.52 | 24.85 |
| 63 | 600895 | 张江高科 | 88,110,235.29 | 24.36 |
| 64 | 600030 | 中信证券 | 87,921,370.35 | 24.31 |
| 65 | 002092 | 中泰化学 | 87,540,210.14 | 24.20 |
| 66 | 002156 | 通富微电 | 86,552,060.07 | 23.93 |
| 67 | 000630 | 铜陵有色 | 85,623,446.00 | 23.67 |
| 68 | 600862 | 中航高科 | 84,610,047.12 | 23.39 |
| 69 | 600329 | 中新药业 | 83,542,522.24 | 23.10 |
| 70 | 603198 | 迎驾贡酒 | 83,105,761.69 | 22.98 |
| 71 | 300474 | 景嘉微 | 82,772,361.90 | 22.88 |
| 72 | 002382 | 蓝帆医疗 | 81,980,037.67 | 22.66 |
| 73 | 688536 | 思瑞浦 | 81,650,665.26 | 22.57 |
| 74 | 600535 | 天士力 | 81,091,285.79 | 22.42 |
| 75 | 603589 | 口子窖 | 80,290,290.95 | 22.20 |
| 76 | 601598 | 中国外运 | 79,420,222.46 | 21.96 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 77 | 600008 | 首创环保 | 78,372,332.42 | 21.67 |
| 78 | 000999 | 华润三九 | 76,721,367.67 | 21.21 |
| 79 | 300363 | 博腾股份 | 76,305,646.23 | 21.10 |
| 80 | 000959 | 首钢股份 | 76,289,124.68 | 21.09 |
| 81 | 002212 | 天融信 | 76,275,911.49 | 21.09 |
| 82 | 300244 | 迪安诊断 | 76,196,881.67 | 21.07 |
| 83 | 600201 | 生物股份 | 75,461,295.85 | 20.86 |
| 84 | 002185 | 华天科技 | 75,268,959.78 | 20.81 |
| 85 | 300751 | 迈为股份 | 73,481,186.99 | 20.31 |
| 86 | 603456 | 九洲药业 | 72,664,374.73 | 20.09 |
| 87 | 600867 | 通化东宝 | 71,778,220.33 | 19.84 |
| 88 | 603613 | 国联股份 | 71,450,143.38 | 19.75 |
| 89 | 600707 | 彩虹股份 | 71,307,213.74 | 19.71 |
| 90 | 000898 | 鞍钢股份 | 70,687,811.70 | 19.54 |
| 91 | 000060 | 中金岭南 | 70,317,820.78 | 19.44 |
| 92 | 600998 | 九州通 | 70,051,945.50 | 19.37 |
| 93 | 600297 | 广汇汽车 | 69,954,123.98 | 19.34 |
| 94 | 000623 | 吉林敖东 | 68,596,028.59 | 18.96 |
| 95 | 600623 | 华谊集团 | 67,902,057.67 | 18.77 |
| 96 | 600325 | 华发股份 | 66,662,801.58 | 18.43 |
| 97 | 603156 | 养元饮品 | 66,525,014.91 | 18.39 |
| 98 | 600415 | 小商品城 | 66,113,974.72 | 18.28 |
| 99 | 002517 | 恺英网络 | 65,886,521.82 | 18.21 |
| 100 | 002572 | 索菲亚 | 65,545,037.13 | 18.12 |
| 101 | 000629 | 攀钢钒钛 | 65,237,588.44 | 18.04 |
| 102 | 600908 | 无锡银行 | 65,057,497.84 | 17.99 |
| 103 | 002410 | 广联达 | 64,735,571.47 | 17.90 |
| 104 | 002223 | 鱼跃医疗 | 64,195,227.96 | 17.75 |
| 105 | 000598 | 兴蓉环境 | 64,128,194.54 | 17.73 |
| 106 | 000717 | 韶钢松山 | 63,853,940.00 | 17.65 |
| 107 | 000807 | 云铝股份 | 63,385,722.16 | 17.52 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 108 | 688005 | 容百科技 | 63,248,808.04 | 17.49 |
| 109 | 002078 | 太阳纸业 | 63,072,282.20 | 17.44 |
| 110 | 601139 | 深圳燃气 | 62,789,706.70 | 17.36 |
| 111 | 601717 | 郑煤机 | 62,239,167.68 | 17.21 |
| 112 | 600787 | 中储股份 | 60,932,874.14 | 16.85 |
| 113 | 300207 | 欣旺达 | 60,610,255.23 | 16.76 |
| 114 | 603707 | 健友股份 | 60,584,614.33 | 16.75 |
| 115 | 002002 | 鸿达兴业 | 60,225,561.22 | 16.65 |
| 116 | 600511 | 国药股份 | 60,078,273.00 | 16.61 |
| 117 | 002129 | 中环股份 | 60,006,350.97 | 16.59 |
| 118 | 603225 | 新凤鸣 | 59,790,730.70 | 16.53 |
| 119 | 002244 | 滨江集团 | 59,783,040.05 | 16.53 |
| 120 | 600309 | 万华化学 | 59,767,618.75 | 16.52 |
| 121 | 600392 | 盛和资源 | 59,558,375.71 | 16.47 |
| 122 | 002797 | 第一创业 | 59,471,030.92 | 16.44 |
| 123 | 002013 | 中航机电 | 58,427,377.50 | 16.15 |
| 124 | 002268 | 卫 士 通 | 58,373,546.50 | 16.14 |
| 125 | 000825 | 太钢不锈 | 57,616,081.60 | 15.93 |
| 126 | 600418 | 江淮汽车 | 57,486,190.75 | 15.89 |
| 127 | 600315 | 上海家化 | 56,735,986.67 | 15.69 |
| 128 | 002372 | 伟星新材 | 56,119,474.01 | 15.51 |
| 129 | 600704 | 物产中大 | 55,724,009.07 | 15.41 |
| 130 | 002818 | 富森美 | 55,620,390.61 | 15.38 |
| 131 | 600782 | 新钢股份 | 54,893,587.74 | 15.18 |
| 132 | 600970 | 中材国际 | 54,806,876.87 | 15.15 |
| 133 | 002294 | 信立泰 | 54,696,672.19 | 15.12 |
| 134 | 002839 | 张家港行 | 54,100,379.25 | 14.96 |
| 135 | 002138 | 顺络电子 | 53,567,736.14 | 14.81 |
| 136 | 002191 | 劲嘉股份 | 52,798,344.45 | 14.60 |
| 137 | 600516 | 方大炭素 | 52,575,640.85 | 14.53 |
| 138 | 000686 | 东北证券 | 51,233,948.86 | 14.16 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 139 | 600755 | 厦门国贸 | 51,183,502.70 | 14.15 |
| 140 | 601866 | 中远海发 | 51,166,511.00 | 14.15 |
| 141 | 603605 | 珀莱雅 | 50,874,542.78 | 14.06 |
| 142 | 300133 | 华策影视 | 50,869,840.02 | 14.06 |
| 143 | 300458 | 全志科技 | 50,714,680.66 | 14.02 |
| 144 | 002511 | 中顺洁柔 | 50,313,511.89 | 13.91 |
| 145 | 601577 | 长沙银行 | 50,251,805.94 | 13.89 |
| 146 | 600060 | 海信视像 | 50,132,499.60 | 13.86 |
| 147 | 002416 | 爱施德 | 50,120,625.79 | 13.86 |
| 148 | 600827 | 百联股份 | 49,640,002.40 | 13.72 |
| 149 | 002815 | 崇达技术 | 49,608,055.00 | 13.71 |
| 150 | 601555 | 东吴证券 | 49,319,415.36 | 13.63 |
| 151 | 000739 | 普洛药业 | 49,208,178.06 | 13.60 |
| 152 | 002384 | 东山精密 | 49,044,994.44 | 13.56 |
| 153 | 002603 | 以岭药业 | 48,668,450.79 | 13.45 |
| 154 | 002028 | 思源电气 | 48,038,603.55 | 13.28 |
| 155 | 603077 | 和邦生物 | 47,785,791.40 | 13.21 |
| 156 | 601016 | 节能风电 | 46,263,441.00 | 12.79 |
| 157 | 600171 | 上海贝岭 | 46,111,947.06 | 12.75 |
| 158 | 600737 | 中粮糖业 | 46,094,090.13 | 12.74 |
| 159 | 603712 | 七一二 | 46,011,950.28 | 12.72 |
| 160 | 002110 | 三钢闽光 | 45,882,305.92 | 12.68 |
| 161 | 600633 | 浙数文化 | 45,762,404.80 | 12.65 |
| 162 | 300253 | 卫宁健康 | 45,448,360.99 | 12.56 |
| 163 | 000012 | 南 玻A | 45,235,443.22 | 12.51 |
| 164 | 601958 | 金钼股份 | 45,055,605.18 | 12.46 |
| 165 | 002368 | 太极股份 | 44,868,054.52 | 12.40 |
| 166 | 300699 | 光威复材 | 44,718,145.60 | 12.36 |
| 167 | 600233 | 圆通速递 | 44,694,450.00 | 12.36 |
| 168 | 600398 | 海澜之家 | 44,691,415.34 | 12.36 |
| 169 | 601919 | 中远海控 | 44,672,618.10 | 12.35 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 170 | 002286 | 保龄宝 | 44,523,219.00 | 12.31 |
| 171 | 300146 | 汤臣倍健 | 44,185,936.33 | 12.22 |
| 172 | 603882 | 金域医学 | 44,045,598.06 | 12.18 |
| 173 | 002128 | 电投能源 | 43,931,507.83 | 12.15 |
| 174 | 601992 | 金隅集团 | 43,868,311.00 | 12.13 |
| 175 | 688357 | 建龙微纳 | 43,824,835.29 | 12.12 |
| 176 | 000513 | 丽珠集团 | 43,605,959.73 | 12.06 |
| 177 | 688122 | 西部超导 | 43,371,637.99 | 11.99 |
| 178 | 600500 | 中化国际 | 43,300,303.50 | 11.97 |
| 179 | 600823 | 世茂股份 | 42,774,590.92 | 11.83 |
| 180 | 600702 | 舍得酒业 | 42,648,923.28 | 11.79 |
| 181 | 002532 | 天山铝业 | 42,342,651.00 | 11.71 |
| 182 | 000090 | 天健集团 | 42,203,749.54 | 11.67 |
| 183 | 000970 | 中科三环 | 41,935,248.00 | 11.59 |
| 184 | 688006 | 杭可科技 | 41,901,813.35 | 11.58 |
| 185 | 600804 | 鹏博士 | 41,262,618.80 | 11.41 |
| 186 | 600739 | 辽宁成大 | 41,195,566.76 | 11.39 |
| 187 | 001872 | 招商港口 | 40,953,487.72 | 11.32 |
| 188 | 002465 | 海格通信 | 40,885,643.60 | 11.30 |
| 189 | 600809 | 山西汾酒 | 40,350,269.27 | 11.16 |
| 190 | 600153 | 建发股份 | 40,272,472.14 | 11.13 |
| 191 | 600486 | 扬农化工 | 40,270,242.68 | 11.13 |
| 192 | 600426 | 华鲁恒升 | 40,215,535.14 | 11.12 |
| 193 | 300009 | 安科生物 | 40,202,739.46 | 11.11 |
| 194 | 600507 | 方大特钢 | 39,440,333.97 | 10.90 |
| 195 | 000581 | 威孚高科 | 39,320,656.28 | 10.87 |
| 196 | 300418 | 昆仑万维 | 39,282,537.70 | 10.86 |
| 197 | 600307 | 酒钢宏兴 | 39,034,661.00 | 10.79 |
| 198 | 603566 | 普莱柯 | 38,900,157.77 | 10.75 |
| 199 | 002430 | 杭氧股份 | 38,738,053.56 | 10.71 |
| 200 | 002850 | 科达利 | 38,615,707.80 | 10.68 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 201 | 600057 | 厦门象屿 | 38,567,475.88 | 10.66 |
| 202 | 300630 | 普利制药 | 38,338,766.82 | 10.60 |
| 203 | 688065 | 凯赛生物 | 37,409,800.51 | 10.34 |
| 204 | 603228 | 景旺电子 | 37,337,059.48 | 10.32 |
| 205 | 300733 | 西菱动力 | 37,193,110.84 | 10.28 |
| 206 | 300059 | 东方财富 | 36,642,283.62 | 10.13 |
| 207 | 600643 | 爱建集团 | 36,609,309.12 | 10.12 |
| 208 | 600546 | 山煤国际 | 36,597,359.23 | 10.12 |
| 209 | 600183 | 生益科技 | 36,343,810.56 | 10.05 |
| 210 | 600436 | 片仔癀 | 36,323,634.97 | 10.04 |
| 211 | 600582 | 天地科技 | 36,239,460.00 | 10.02 |
| 212 | 600373 | 中文传媒 | 36,104,815.83 | 9.98 |
| 213 | 603986 | 兆易创新 | 36,080,481.35 | 9.97 |
| 214 | 000050 | 深天马A | 36,065,397.00 | 9.97 |
| 215 | 002508 | 老板电器 | 35,993,974.08 | 9.95 |
| 216 | 600529 | 山东药玻 | 35,579,933.11 | 9.84 |
| 217 | 600155 | 华创阳安 | 35,384,924.12 | 9.78 |
| 218 | 603496 | 恒为科技 | 35,301,323.45 | 9.76 |
| 219 | 002738 | 中矿资源 | 34,186,841.00 | 9.45 |
| 220 | 600195 | 中牧股份 | 34,118,493.93 | 9.43 |
| 221 | 002240 | 盛新锂能 | 34,113,041.00 | 9.43 |
| 222 | 601878 | 浙商证券 | 34,080,446.94 | 9.42 |
| 223 | 601000 | 唐山港 | 33,804,294.00 | 9.35 |
| 224 | 600271 | 航天信息 | 33,741,539.36 | 9.33 |
| 225 | 601456 | 国联证券 | 32,917,348.61 | 9.10 |
| 226 | 002434 | 万里扬 | 32,590,735.00 | 9.01 |
| 227 | 300661 | 圣邦股份 | 32,559,239.05 | 9.00 |
| 228 | 600132 | 重庆啤酒 | 32,497,177.79 | 8.98 |
| 229 | 002831 | 裕同科技 | 32,249,725.45 | 8.92 |
| 230 | 002736 | 国信证券 | 32,046,243.00 | 8.86 |
| 231 | 002064 | 华峰化学 | 31,899,406.00 | 8.82 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 232 | 300166 | 东方国信 | 31,260,498.20 | 8.64 |
| 233 | 600038 | 中直股份 | 30,834,084.86 | 8.52 |
| 234 | 000723 | 美锦能源 | 30,263,777.26 | 8.37 |
| 235 | 000977 | 浪潮信息 | 30,250,123.76 | 8.36 |
| 236 | 600435 | 北方导航 | 30,026,295.15 | 8.30 |
| 237 | 600571 | 信雅达 | 29,761,311.76 | 8.23 |
| 238 | 688029 | 南微医学 | 29,616,877.23 | 8.19 |
| 239 | 603355 | 莱克电气 | 29,552,104.88 | 8.17 |
| 240 | 000930 | 中粮科技 | 29,490,977.70 | 8.15 |
| 241 | 600497 | 驰宏锌锗 | 29,273,155.00 | 8.09 |
| 242 | 002010 | 传化智联 | 29,140,586.34 | 8.06 |
| 243 | 600729 | 重庆百货 | 29,130,873.85 | 8.05 |
| 244 | 601003 | 柳钢股份 | 29,123,165.00 | 8.05 |
| 245 | 000762 | 西藏矿业 | 29,049,024.01 | 8.03 |
| 246 | 603883 | 老百姓 | 28,990,278.28 | 8.01 |
| 247 | 000528 | 柳 工 | 28,982,844.79 | 8.01 |
| 248 | 002690 | 美亚光电 | 28,912,500.04 | 7.99 |
| 249 | 300308 | 中际旭创 | 28,856,189.82 | 7.98 |
| 250 | 300122 | 智飞生物 | 28,733,763.26 | 7.94 |
| 251 | 300463 | 迈克生物 | 28,665,604.95 | 7.92 |
| 252 | 000657 | 中钨高新 | 28,534,751.82 | 7.89 |
| 253 | 002472 | 双环传动 | 28,453,472.00 | 7.87 |
| 254 | 000778 | 新兴铸管 | 28,375,074.94 | 7.84 |
| 255 | 002948 | 青岛银行 | 28,251,077.00 | 7.81 |
| 256 | 688356 | 键凯科技 | 28,123,172.87 | 7.77 |
| 257 | 000937 | 冀中能源 | 27,935,869.48 | 7.72 |
| 258 | 002920 | 德赛西威 | 27,919,756.82 | 7.72 |
| 259 | 000897 | 津滨发展 | 27,783,966.00 | 7.68 |
| 260 | 002701 | 奥瑞金 | 27,625,865.64 | 7.64 |
| 261 | 600126 | 杭钢股份 | 27,310,788.20 | 7.55 |
| 262 | 600064 | 南京高科 | 27,201,833.49 | 7.52 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 263 | 002541 | 鸿路钢构 | 27,168,432.25 | 7.51 |
| 264 | 002939 | 长城证券 | 27,127,124.00 | 7.50 |
| 265 | 601899 | 紫金矿业 | 27,082,848.00 | 7.49 |
| 266 | 603259 | 药明康德 | 27,016,453.68 | 7.47 |
| 267 | 002135 | 东南网架 | 26,651,159.00 | 7.37 |
| 268 | 603379 | 三美股份 | 26,413,096.30 | 7.30 |
| 269 | 000063 | 中兴通讯 | 26,269,920.13 | 7.26 |
| 270 | 603806 | 福斯特 | 26,235,770.22 | 7.25 |
| 271 | 600820 | 隧道股份 | 26,017,855.52 | 7.19 |
| 272 | 601098 | 中南传媒 | 25,883,491.62 | 7.16 |
| 273 | 603713 | 密尔克卫 | 25,826,260.00 | 7.14 |
| 274 | 600556 | 天下秀 | 25,556,631.33 | 7.07 |
| 275 | 300725 | 药石科技 | 25,415,737.37 | 7.03 |
| 276 | 000938 | 紫光股份 | 25,115,666.13 | 6.94 |
| 277 | 688017 | 绿的谐波 | 24,906,545.01 | 6.89 |
| 278 | 300655 | 晶瑞电材 | 24,823,232.81 | 6.86 |
| 279 | 000725 | 京东方A | 24,662,197.00 | 6.82 |
| 280 | 300833 | 浩洋股份 | 24,454,355.39 | 6.76 |
| 281 | 300573 | 兴齐眼药 | 24,302,024.00 | 6.72 |
| 282 | 600499 | 科达制造 | 23,229,050.00 | 6.42 |
| 283 | 600176 | 中国巨石 | 23,044,093.53 | 6.37 |
| 284 | 600882 | 妙可蓝多 | 23,018,542.00 | 6.36 |
| 285 | 600409 | 三友化工 | 22,847,650.00 | 6.32 |
| 286 | 002328 | 新朋股份 | 22,803,385.10 | 6.30 |
| 287 | 688208 | 道通科技 | 22,774,666.17 | 6.30 |
| 288 | 600438 | 通威股份 | 22,705,346.56 | 6.28 |
| 289 | 603515 | 欧普照明 | 22,701,377.70 | 6.28 |
| 290 | 603719 | 良品铺子 | 22,700,547.22 | 6.28 |
| 291 | 688233 | 神工股份 | 22,503,635.47 | 6.22 |
| 292 | 600096 | 云天化 | 22,471,348.96 | 6.21 |
| 293 | 600097 | 开创国际 | 22,424,811.34 | 6.20 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 294 | 601677 | 明泰铝业 | 22,422,323.27 | 6.20 |
| 295 | 300639 | 凯普生物 | 22,325,186.06 | 6.17 |
| 296 | 603060 | 国检集团 | 22,102,849.22 | 6.11 |
| 297 | 603043 | 广州酒家 | 22,062,915.93 | 6.10 |
| 298 | 300748 | 金力永磁 | 21,998,377.95 | 6.08 |
| 299 | 000681 | 视觉中国 | 21,992,026.00 | 6.08 |
| 300 | 002254 | 泰和新材 | 21,968,376.20 | 6.07 |
| 301 | 002946 | 新乳业 | 21,879,943.98 | 6.05 |
| 302 | 600642 | 申能股份 | 21,876,100.87 | 6.05 |
| 303 | 600170 | 上海建工 | 21,815,111.00 | 6.03 |
| 304 | 600845 | 宝信软件 | 21,814,536.21 | 6.03 |
| 305 | 603733 | 仙鹤股份 | 21,689,249.00 | 6.00 |
| 306 | 002774 | 快意电梯 | 21,627,118.46 | 5.98 |
| 307 | 002233 | 塔牌集团 | 21,473,415.32 | 5.94 |
| 308 | 002756 | 永兴材料 | 21,395,304.00 | 5.91 |
| 309 | 000709 | 河钢股份 | 21,287,586.00 | 5.89 |
| 310 | 300211 | 亿通科技 | 21,278,118.50 | 5.88 |
| 311 | 600377 | 宁沪高速 | 21,117,147.13 | 5.84 |
| 312 | 600764 | 中国海防 | 20,995,906.94 | 5.80 |
| 313 | 600027 | 华电国际 | 20,857,556.86 | 5.77 |
| 314 | 002287 | 奇正藏药 | 20,810,544.87 | 5.75 |
| 315 | 603893 | 瑞芯微 | 20,780,300.44 | 5.74 |
| 316 | 600673 | 东阳光 | 20,646,870.95 | 5.71 |
| 317 | 002876 | 三利谱 | 20,497,476.40 | 5.67 |
| 318 | 601158 | 重庆水务 | 20,476,448.00 | 5.66 |
| 319 | 300861 | 美畅股份 | 20,361,951.08 | 5.63 |
| 320 | 300073 | 当升科技 | 20,140,729.75 | 5.57 |
| 321 | 603267 | 鸿远电子 | 20,130,830.97 | 5.57 |
| 322 | 300496 | 中科创达 | 20,001,449.83 | 5.53 |
| 323 | 603737 | 三棵树 | 19,809,671.34 | 5.48 |
| 324 | 600837 | 海通证券 | 19,785,751.00 | 5.47 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 325 | 601882 | 海天精工 | 19,775,468.00 | 5.47 |
| 326 | 688080 | 映翰通 | 19,746,992.20 | 5.46 |
| 327 | 000488 | 晨鸣纸业 | 19,723,858.35 | 5.45 |
| 328 | 002563 | 森马服饰 | 19,659,477.24 | 5.43 |
| 329 | 002791 | 坚朗五金 | 19,489,771.44 | 5.39 |
| 330 | 688595 | 芯海科技 | 19,456,711.32 | 5.38 |
| 331 | 300136 | 信维通信 | 19,375,411.60 | 5.36 |
| 332 | 600390 | 五矿资本 | 19,263,022.40 | 5.33 |
| 333 | 300124 | 汇川技术 | 19,175,100.76 | 5.30 |
| 334 | 000738 | 航发控制 | 19,064,597.84 | 5.27 |
| 335 | 002557 | 洽洽食品 | 19,053,652.31 | 5.27 |
| 336 | 000526 | 学大教育 | 19,053,016.00 | 5.27 |
| 337 | 600696 | 岩石股份 | 18,781,974.00 | 5.19 |
| 338 | 300671 | 富满微 | 18,734,898.12 | 5.18 |
| 339 | 603127 | 昭衍新药 | 18,714,287.09 | 5.17 |
| 340 | 603927 | 中科软 | 18,454,131.40 | 5.10 |
| 341 | 001914 | 招商积余 | 18,448,244.00 | 5.10 |
| 342 | 300171 | 东富龙 | 18,416,836.45 | 5.09 |
| 343 | 002023 | 海特高新 | 18,364,255.39 | 5.08 |
| 344 | 601600 | 中国铝业 | 18,259,006.80 | 5.05 |
| 345 | 600282 | 南钢股份 | 18,150,498.00 | 5.02 |
| 346 | 603599 | 广信股份 | 18,139,277.49 | 5.01 |
| 347 | 600006 | 东风汽车 | 18,123,457.00 | 5.01 |
| 348 | 603659 | 璞泰来 | 17,904,942.90 | 4.95 |
| 349 | 002966 | 苏州银行 | 17,859,078.02 | 4.94 |
| 350 | 300595 | 欧普康视 | 17,854,591.55 | 4.94 |
| 351 | 601678 | 滨化股份 | 17,683,829.00 | 4.89 |
| 352 | 603039 | 泛微网络 | 17,527,888.00 | 4.85 |
| 353 | 002595 | 豪迈科技 | 17,514,146.00 | 4.84 |
| 354 | 600456 | 宝钛股份 | 17,421,107.87 | 4.82 |
| 355 | 603345 | 安井食品 | 17,412,779.41 | 4.81 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 356 | 603612 | 索通发展 | 17,368,649.40 | 4.80 |
| 357 | 000423 | 东阿阿胶 | 17,187,993.00 | 4.75 |
| 358 | 601211 | 国泰君安 | 17,155,094.00 | 4.74 |
| 359 | 002925 | 盈趣科技 | 16,974,938.60 | 4.69 |
| 360 | 600817 | 宇通重工 | 16,943,160.00 | 4.68 |
| 361 | 300618 | 寒锐钴业 | 16,886,322.00 | 4.67 |
| 362 | 002497 | 雅化集团 | 16,850,772.00 | 4.66 |
| 363 | 300750 | 宁德时代 | 16,828,663.00 | 4.65 |
| 364 | 300772 | 运达股份 | 16,805,009.84 | 4.65 |
| 365 | 601777 | 力帆科技 | 16,621,352.00 | 4.60 |
| 366 | 600487 | 亨通光电 | 16,515,998.84 | 4.57 |
| 367 | 601117 | 中国化学 | 16,476,941.00 | 4.56 |
| 368 | 002056 | 横店东磁 | 16,475,203.56 | 4.55 |
| 369 | 688508 | 芯朋微 | 16,424,654.59 | 4.54 |
| 370 | 002312 | 川发龙蟒 | 16,370,565.00 | 4.53 |
| 371 | 002003 | 伟星股份 | 16,329,273.87 | 4.51 |
| 372 | 600901 | 江苏租赁 | 16,284,562.03 | 4.50 |
| 373 | 601900 | 南方传媒 | 16,200,609.00 | 4.48 |
| 374 | 002281 | 光迅科技 | 16,128,611.13 | 4.46 |
| 375 | 000833 | 粤桂股份 | 16,106,098.54 | 4.45 |
| 376 | 300357 | 我武生物 | 16,013,913.17 | 4.43 |
| 377 | 688368 | 晶丰明源 | 15,850,534.91 | 4.38 |
| 378 | 002812 | 恩捷股份 | 15,716,411.97 | 4.34 |
| 379 | 600577 | 精达股份 | 15,703,912.00 | 4.34 |
| 380 | 601789 | 宁波建工 | 15,635,861.00 | 4.32 |
| 381 | 601618 | 中国中冶 | 15,629,264.00 | 4.32 |
| 382 | 600202 | 哈空调 | 15,604,615.00 | 4.31 |
| 383 | 300609 | 汇纳科技 | 15,574,848.00 | 4.31 |
| 384 | 603868 | 飞科电器 | 15,452,278.00 | 4.27 |
| 385 | 002038 | 双鹭药业 | 15,411,637.14 | 4.26 |
| 386 | 600967 | 内蒙一机 | 15,407,362.55 | 4.26 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 387 | 688200 | 华峰测控 | 15,290,179.27 | 4.23 |
| 388 | 600519 | 贵州茅台 | 15,287,151.00 | 4.23 |
| 389 | 300257 | 开山股份 | 15,287,126.67 | 4.23 |
| 390 | 601512 | 中新集团 | 15,230,166.50 | 4.21 |
| 391 | 600586 | 金晶科技 | 14,940,994.04 | 4.13 |
| 392 | 603320 | 迪贝电气 | 14,929,492.60 | 4.13 |
| 393 | 600887 | 伊利股份 | 14,797,640.26 | 4.09 |
| 394 | 002440 | 闰土股份 | 14,716,628.38 | 4.07 |
| 395 | 601799 | 星宇股份 | 14,574,272.10 | 4.03 |
| 396 | 601179 | 中国西电 | 14,433,500.00 | 3.99 |
| 397 | 002555 | 三七互娱 | 14,394,921.54 | 3.98 |
| 398 | 300113 | 顺网科技 | 14,335,369.71 | 3.96 |
| 399 | 600728 | 佳都科技 | 14,127,731.22 | 3.91 |
| 400 | 300274 | 阳光电源 | 14,093,557.00 | 3.90 |
| 401 | 300482 | 万孚生物 | 13,992,395.20 | 3.87 |
| 402 | 002833 | 弘亚数控 | 13,746,499.80 | 3.80 |
| 403 | 300623 | 捷捷微电 | 13,731,317.54 | 3.80 |
| 404 | 688037 | 芯源微 | 13,713,210.10 | 3.79 |
| 405 | 601005 | 重庆钢铁 | 13,657,860.00 | 3.78 |
| 406 | 002433 | 太安堂 | 13,347,588.00 | 3.69 |
| 407 | 600985 | 淮北矿业 | 13,171,545.00 | 3.64 |
| 408 | 002705 | 新宝股份 | 12,915,309.86 | 3.57 |
| 409 | 603995 | 甬金股份 | 12,890,408.17 | 3.56 |
| 410 | 002906 | 华阳集团 | 12,782,389.00 | 3.53 |
| 411 | 600018 | 上港集团 | 12,762,289.99 | 3.53 |
| 412 | 300763 | 锦浪科技 | 12,740,268.30 | 3.52 |
| 413 | 603678 | 火炬电子 | 12,676,509.17 | 3.50 |
| 414 | 002230 | 科大讯飞 | 12,591,200.30 | 3.48 |
| 415 | 688378 | 奥来德 | 12,585,502.03 | 3.48 |
| 416 | 000997 | 新 大 陆 | 12,571,229.90 | 3.48 |
| 417 | 605111 | 新洁能 | 12,507,700.40 | 3.46 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 418 | 000683 | 远兴能源 | 12,505,869.00 | 3.46 |
| 419 | 603901 | 永创智能 | 12,369,426.64 | 3.42 |
| 420 | 603565 | 中谷物流 | 12,232,048.10 | 3.38 |
| 421 | 002402 | 和而泰 | 12,187,153.00 | 3.37 |
| 422 | 601333 | 广深铁路 | 12,180,208.00 | 3.37 |
| 423 | 002439 | 启明星辰 | 12,179,512.76 | 3.37 |
| 424 | 002636 | 金安国纪 | 12,163,678.00 | 3.36 |
| 425 | 002203 | 海亮股份 | 12,144,901.00 | 3.36 |
| 426 | 002585 | 双星新材 | 12,037,257.55 | 3.33 |
| 427 | 300034 | 钢研高纳 | 11,911,926.96 | 3.29 |
| 428 | 600021 | 上海电力 | 11,830,563.16 | 3.27 |
| 429 | 002241 | 歌尔股份 | 11,756,839.00 | 3.25 |
| 430 | 600958 | 东方证券 | 11,722,384.00 | 3.24 |
| 431 | 002458 | 益生股份 | 11,643,336.32 | 3.22 |
| 432 | 600581 | 八一钢铁 | 11,596,211.00 | 3.21 |
| 433 | 002765 | 蓝黛科技 | 11,527,063.00 | 3.19 |
| 434 | 000933 | 神火股份 | 11,448,711.20 | 3.17 |
| 435 | 300696 | 爱乐达 | 11,395,781.30 | 3.15 |
| 436 | 600584 | 长电科技 | 11,385,411.19 | 3.15 |
| 437 | 601668 | 中国建筑 | 11,336,955.00 | 3.13 |
| 438 | 300755 | 华致酒行 | 11,308,641.62 | 3.13 |
| 439 | 688185 | 康希诺 | 11,272,134.28 | 3.12 |
| 440 | 000498 | 山东路桥 | 11,208,609.00 | 3.10 |
| 441 | 600399 | 抚顺特钢 | 11,035,020.99 | 3.05 |
| 442 | 300088 | 长信科技 | 10,960,670.00 | 3.03 |
| 443 | 300571 | 平治信息 | 10,956,794.00 | 3.03 |
| 444 | 002493 | 荣盛石化 | 10,916,689.00 | 3.02 |
| 445 | 002371 | 北方华创 | 10,879,089.98 | 3.01 |
| 446 | 600641 | 万业企业 | 10,867,387.00 | 3.00 |
| 447 | 300014 | 亿纬锂能 | 10,818,989.00 | 2.99 |
| 448 | 002568 | 百润股份 | 10,760,606.55 | 2.97 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 449 | 002041 | 登海种业 | 10,614,586.00 | 2.93 |
| 450 | 601001 | 晋控煤业 | 10,594,066.00 | 2.93 |
| 451 | 002345 | 潮宏基 | 10,536,775.16 | 2.91 |
| 452 | 603833 | 欧派家居 | 10,473,735.10 | 2.90 |
| 453 | 002507 | 涪陵榨菜 | 10,416,388.50 | 2.88 |
| 454 | 300285 | 国瓷材料 | 10,344,432.00 | 2.86 |
| 455 | 002601 | 龙佰集团 | 10,318,405.00 | 2.85 |
| 456 | 603738 | 泰晶科技 | 10,294,395.00 | 2.85 |
| 457 | 603305 | 旭升股份 | 10,253,502.00 | 2.83 |
| 458 | 600746 | 江苏索普 | 10,166,755.70 | 2.81 |
| 459 | 300587 | 天铁股份 | 10,150,438.49 | 2.81 |
| 460 | 601869 | 长飞光纤 | 10,143,599.39 | 2.80 |
| 461 | 000998 | 隆平高科 | 10,010,499.00 | 2.77 |
| 462 | 688030 | 山石网科 | 9,997,979.81 | 2.76 |
| 463 | 688018 | 乐鑫科技 | 9,944,177.95 | 2.75 |
| 464 | 300593 | 新雷能 | 9,909,759.74 | 2.74 |
| 465 | 300070 | 碧水源 | 9,885,783.34 | 2.73 |
| 466 | 300413 | 芒果超媒 | 9,877,795.20 | 2.73 |
| 467 | 002615 | 哈尔斯 | 9,866,599.00 | 2.73 |
| 468 | 601952 | 苏垦农发 | 9,851,363.30 | 2.72 |
| 469 | 600273 | 嘉化能源 | 9,829,578.00 | 2.72 |
| 470 | 600338 | 西藏珠峰 | 9,782,803.60 | 2.70 |
| 471 | 600600 | 青岛啤酒 | 9,732,482.00 | 2.69 |
| 472 | 688111 | 金山办公 | 9,720,013.95 | 2.69 |
| 473 | 688298 | 东方生物 | 9,707,569.48 | 2.68 |
| 474 | 600216 | 浙江医药 | 9,662,683.00 | 2.67 |
| 475 | 601865 | 福莱特 | 9,653,365.00 | 2.67 |
| 476 | 600880 | 博瑞传播 | 9,578,627.00 | 2.65 |
| 477 | 002901 | 大博医疗 | 9,297,267.00 | 2.57 |
| 478 | 688396 | 华润微 | 9,267,689.77 | 2.56 |
| 479 | 603816 | 顾家家居 | 9,161,266.82 | 2.53 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 480 | 000786 | 北新建材 | 9,149,972.44 | 2.53 |
| 481 | 601088 | 中国神华 | 9,141,827.00 | 2.53 |
| 482 | 603611 | 诺力股份 | 9,115,121.00 | 2.52 |
| 483 | 002027 | 分众传媒 | 9,113,388.00 | 2.52 |
| 484 | 603489 | 八方股份 | 9,021,066.03 | 2.49 |
| 485 | 688521 | 芯原股份 | 9,006,482.93 | 2.49 |
| 486 | 300058 | 蓝色光标 | 8,997,195.00 | 2.49 |
| 487 | 002533 | 金杯电工 | 8,970,126.00 | 2.48 |
| 488 | 603026 | 石大胜华 | 8,959,912.00 | 2.48 |
| 489 | 002318 | 久立特材 | 8,897,222.00 | 2.46 |
| 490 | 300015 | 爱尔眼科 | 8,807,213.33 | 2.43 |
| 491 | 002030 | 达安基因 | 8,802,176.20 | 2.43 |
| 492 | 603897 | 长城科技 | 8,684,246.64 | 2.40 |
| 493 | 300291 | 华录百纳 | 8,508,592.00 | 2.35 |
| 494 | 002375 | 亚厦股份 | 8,506,732.00 | 2.35 |
| 495 | 002008 | 大族激光 | 8,492,791.55 | 2.35 |
| 496 | 601101 | 昊华能源 | 8,488,951.00 | 2.35 |
| 497 | 300017 | 网宿科技 | 8,453,715.00 | 2.34 |
| 498 | 688139 | 海尔生物 | 8,369,079.08 | 2.31 |
| 499 | 300138 | 晨光生物 | 8,251,486.62 | 2.28 |
| 500 | 688202 | 美迪西 | 8,220,439.89 | 2.27 |
| 501 | 600760 | 中航沈飞 | 8,187,150.60 | 2.26 |
| 502 | 002148 | 北纬科技 | 8,135,948.24 | 2.25 |
| 503 | 002653 | 海思科 | 8,111,359.61 | 2.24 |
| 504 | 300196 | 长海股份 | 8,079,809.59 | 2.23 |
| 505 | 603129 | 春风动力 | 8,071,281.00 | 2.23 |
| 506 | 603236 | 移远通信 | 8,037,859.30 | 2.22 |
| 507 | 600248 | 陕西建工 | 8,028,607.00 | 2.22 |
| 508 | 600056 | 中国医药 | 8,009,141.00 | 2.21 |
| 509 | 600123 | 兰花科创 | 8,008,009.00 | 2.21 |
| 510 | 000011 | 深物业A | 7,934,684.00 | 2.19 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 511 | 603393 | 新天然气 | 7,914,060.95 | 2.19 |
| 512 | 600386 | 北巴传媒 | 7,791,274.00 | 2.15 |
| 513 | 002043 | 兔 宝 宝 | 7,655,880.00 | 2.12 |
| 514 | 600533 | 栖霞建设 | 7,590,679.00 | 2.10 |
| 515 | 600136 | 当代文体 | 7,554,705.00 | 2.09 |
| 516 | 601966 | 玲珑轮胎 | 7,550,150.78 | 2.09 |
| 517 | 688002 | 睿创微纳 | 7,531,290.15 | 2.08 |
| 518 | 601801 | 皖新传媒 | 7,364,757.00 | 2.04 |
| 519 | 300726 | 宏达电子 | 7,324,024.78 | 2.02 |
| 520 | 300770 | 新媒股份 | 7,311,447.00 | 2.02 |
| 521 | 688039 | 当虹科技 | 7,311,081.27 | 2.02 |
| 522 | 000990 | 诚志股份 | 7,270,203.00 | 2.01 |
| 523 | 600667 | 太极实业 | 7,267,891.00 | 2.01 |
| 524 | 002049 | 紫光国微 | 7,266,340.00 | 2.01 |
| 525 | 600711 | 盛屯矿业 | 7,248,031.46 | 2.00 |

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。

### 8.4.2 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 | 002709 | 天赐材料 | 245,266,334.17 | 67.81 |
| 2 | 600089 | 特变电工 | 226,240,808.00 | 62.55 |
| 3 | 601233 | 桐昆股份 | 192,287,066.67 | 53.16 |
| 4 | 002080 | 中材科技 | 184,068,228.74 | 50.89 |
| 5 | 300316 | 晶盛机电 | 177,912,615.79 | 49.19 |
| 6 | 600141 | 兴发集团 | 160,624,053.12 | 44.41 |
| 7 | 600563 | 法拉电子 | 158,000,495.14 | 43.68 |
| 8 | 000519 | 中兵红箭 | 150,449,494.37 | 41.59 |
| 9 | 000799 | 酒鬼酒 | 143,089,488.54 | 39.56 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 10 | 601636 | 旗滨集团 | 138,463,334.54 | 38.28 |
| 11 | 000887 | 中鼎股份 | 138,266,198.44 | 38.22 |
| 12 | 002648 | 卫星化学 | 135,381,498.82 | 37.43 |
| 13 | 600885 | 宏发股份 | 134,772,751.51 | 37.26 |
| 14 | 603486 | 科沃斯 | 134,305,006.76 | 37.13 |
| 15 | 000039 | 中集集团 | 132,482,517.66 | 36.63 |
| 16 | 600219 | 南山铝业 | 127,769,672.70 | 35.32 |
| 17 | 002408 | 齐翔腾达 | 125,276,167.66 | 34.63 |
| 18 | 000009 | 中国宝安 | 123,311,407.86 | 34.09 |
| 19 | 300223 | 北京君正 | 121,200,473.95 | 33.51 |
| 20 | 000877 | 天山股份 | 119,009,144.65 | 32.90 |
| 21 | 002266 | 浙富控股 | 118,652,171.77 | 32.80 |
| 22 | 603260 | 合盛硅业 | 117,810,358.20 | 32.57 |
| 23 | 002867 | 周大生 | 117,230,511.49 | 32.41 |
| 24 | 000830 | 鲁西化工 | 116,551,062.81 | 32.22 |
| 25 | 300037 | 新宙邦 | 114,928,283.22 | 31.77 |
| 26 | 600188 | 兖矿能源 | 111,710,574.75 | 30.88 |
| 27 | 600884 | 杉杉股份 | 111,461,430.89 | 30.81 |
| 28 | 600460 | 士兰微 | 111,394,198.02 | 30.80 |
| 29 | 600803 | 新奥股份 | 111,386,478.72 | 30.79 |
| 30 | 601689 | 拓普集团 | 108,774,661.12 | 30.07 |
| 31 | 600779 | 水井坊 | 107,080,216.18 | 29.60 |
| 32 | 600549 | 厦门钨业 | 103,779,683.06 | 28.69 |
| 33 | 600875 | 东方电气 | 103,075,890.27 | 28.50 |
| 34 | 601168 | 西部矿业 | 100,126,806.42 | 27.68 |
| 35 | 601615 | 明阳智能 | 99,959,125.70 | 27.63 |
| 36 | 600808 | 马钢股份 | 98,115,655.76 | 27.12 |
| 37 | 000630 | 铜陵有色 | 96,530,479.44 | 26.69 |
| 38 | 002048 | 宁波华翔 | 96,400,351.89 | 26.65 |
| 39 | 002092 | 中泰化学 | 92,141,194.84 | 25.47 |
| 40 | 002156 | 通富微电 | 92,052,519.68 | 25.45 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 41 | 688099 | 晶晨股份 | 91,817,972.63 | 25.38 |
| 42 | 002985 | 北摩高科 | 91,198,552.10 | 25.21 |
| 43 | 000636 | 风华高科 | 89,916,242.99 | 24.86 |
| 44 | 601928 | 凤凰传媒 | 89,192,000.35 | 24.66 |
| 45 | 000983 | 山西焦煤 | 88,886,546.10 | 24.57 |
| 46 | 603444 | 吉比特 | 88,664,031.21 | 24.51 |
| 47 | 603568 | 伟明环保 | 88,441,954.33 | 24.45 |
| 48 | 600765 | 中航重机 | 83,787,003.54 | 23.16 |
| 49 | 600895 | 张江高科 | 82,903,998.19 | 22.92 |
| 50 | 600348 | 华阳股份 | 81,295,623.26 | 22.47 |
| 51 | 002183 | 怡 亚 通 | 81,152,076.32 | 22.44 |
| 52 | 600039 | 四川路桥 | 81,116,576.70 | 22.43 |
| 53 | 601598 | 中国外运 | 79,026,251.77 | 21.85 |
| 54 | 002382 | 蓝帆医疗 | 78,910,989.67 | 21.82 |
| 55 | 002185 | 华天科技 | 76,512,198.79 | 21.15 |
| 56 | 002396 | 星网锐捷 | 76,347,521.30 | 21.11 |
| 57 | 000932 | 华菱钢铁 | 75,613,407.03 | 20.90 |
| 58 | 600008 | 首创环保 | 75,523,675.41 | 20.88 |
| 59 | 601699 | 潞安环能 | 75,118,308.12 | 20.77 |
| 60 | 603290 | 斯达半导 | 74,874,861.30 | 20.70 |
| 61 | 600535 | 天士力 | 74,167,354.45 | 20.50 |
| 62 | 000999 | 华润三九 | 74,080,960.36 | 20.48 |
| 63 | 000960 | 锡业股份 | 73,781,220.09 | 20.40 |
| 64 | 000807 | 云铝股份 | 71,528,697.79 | 19.77 |
| 65 | 300207 | 欣旺达 | 71,048,631.13 | 19.64 |
| 66 | 600380 | 健康元 | 70,675,992.16 | 19.54 |
| 67 | 300244 | 迪安诊断 | 70,518,923.66 | 19.50 |
| 68 | 000062 | 深圳华强 | 69,766,618.48 | 19.29 |
| 69 | 600392 | 盛和资源 | 68,787,588.00 | 19.02 |
| 70 | 600623 | 华谊集团 | 68,381,346.88 | 18.90 |
| 71 | 600998 | 九州通 | 66,210,593.23 | 18.30 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 72 | 600707 | 彩虹股份 | 65,526,707.37 | 18.12 |
| 73 | 300474 | 景嘉微 | 65,406,926.00 | 18.08 |
| 74 | 600329 | 中新药业 | 65,120,533.02 | 18.00 |
| 75 | 000898 | 鞍钢股份 | 64,459,520.87 | 17.82 |
| 76 | 600297 | 广汇汽车 | 64,095,265.28 | 17.72 |
| 77 | 603156 | 养元饮品 | 62,817,334.02 | 17.37 |
| 78 | 600325 | 华发股份 | 62,683,083.57 | 17.33 |
| 79 | 601717 | 郑煤机 | 62,582,558.86 | 17.30 |
| 80 | 002180 | 纳思达 | 61,854,504.40 | 17.10 |
| 81 | 600787 | 中储股份 | 61,487,880.18 | 17.00 |
| 82 | 600309 | 万华化学 | 61,323,827.91 | 16.95 |
| 83 | 600030 | 中信证券 | 60,550,465.10 | 16.74 |
| 84 | 600704 | 物产中大 | 60,547,250.80 | 16.74 |
| 85 | 688188 | 柏楚电子 | 58,439,047.84 | 16.16 |
| 86 | 002268 | 卫 士 通 | 58,400,377.30 | 16.15 |
| 87 | 601139 | 深圳燃气 | 57,777,394.54 | 15.97 |
| 88 | 002002 | 鸿达兴业 | 57,629,350.69 | 15.93 |
| 89 | 000060 | 中金岭南 | 57,455,065.85 | 15.88 |
| 90 | 002078 | 太阳纸业 | 57,116,620.36 | 15.79 |
| 91 | 600908 | 无锡银行 | 56,788,564.94 | 15.70 |
| 92 | 000623 | 吉林敖东 | 55,885,203.97 | 15.45 |
| 93 | 000825 | 太钢不锈 | 55,825,355.37 | 15.43 |
| 94 | 600511 | 国药股份 | 55,767,585.47 | 15.42 |
| 95 | 002223 | 鱼跃医疗 | 55,123,894.96 | 15.24 |
| 96 | 002818 | 富森美 | 55,101,944.62 | 15.23 |
| 97 | 605358 | 立昂微 | 54,988,273.16 | 15.20 |
| 98 | 600867 | 通化东宝 | 54,364,114.02 | 15.03 |
| 99 | 600418 | 江淮汽车 | 54,349,856.24 | 15.03 |
| 100 | 603707 | 健友股份 | 53,130,022.78 | 14.69 |
| 101 | 000959 | 首钢股份 | 53,030,111.85 | 14.66 |
| 102 | 000717 | 韶钢松山 | 52,908,458.00 | 14.63 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 103 | 000686 | 东北证券 | 52,520,581.07 | 14.52 |
| 104 | 002572 | 索菲亚 | 51,901,414.09 | 14.35 |
| 105 | 002839 | 张家港行 | 51,886,450.29 | 14.34 |
| 106 | 603198 | 迎驾贡酒 | 51,399,998.50 | 14.21 |
| 107 | 000739 | 普洛药业 | 50,928,962.60 | 14.08 |
| 108 | 600782 | 新钢股份 | 50,883,614.69 | 14.07 |
| 109 | 000629 | 攀钢钒钛 | 50,736,485.00 | 14.03 |
| 110 | 002815 | 崇达技术 | 50,643,753.05 | 14.00 |
| 111 | 002517 | 恺英网络 | 50,607,093.00 | 13.99 |
| 112 | 002013 | 中航机电 | 50,236,100.00 | 13.89 |
| 113 | 603077 | 和邦生物 | 50,136,466.28 | 13.86 |
| 114 | 603882 | 金域医学 | 49,787,950.72 | 13.76 |
| 115 | 002138 | 顺络电子 | 49,342,459.14 | 13.64 |
| 116 | 002191 | 劲嘉股份 | 48,671,947.40 | 13.46 |
| 117 | 600060 | 海信视像 | 48,212,295.21 | 13.33 |
| 118 | 601577 | 长沙银行 | 47,969,539.19 | 13.26 |
| 119 | 002603 | 以岭药业 | 47,540,957.52 | 13.14 |
| 120 | 300458 | 全志科技 | 47,292,988.66 | 13.07 |
| 121 | 603225 | 新凤鸣 | 46,844,555.37 | 12.95 |
| 122 | 002410 | 广联达 | 46,492,541.42 | 12.85 |
| 123 | 600633 | 浙数文化 | 46,190,497.74 | 12.77 |
| 124 | 002110 | 三钢闽光 | 46,049,114.34 | 12.73 |
| 125 | 000733 | 振华科技 | 45,994,406.07 | 12.72 |
| 126 | 600755 | 厦门国贸 | 45,601,213.39 | 12.61 |
| 127 | 600398 | 海澜之家 | 45,597,529.09 | 12.61 |
| 128 | 600171 | 上海贝岭 | 45,461,337.84 | 12.57 |
| 129 | 000012 | 南 玻A | 44,849,686.14 | 12.40 |
| 130 | 601128 | 常熟银行 | 44,847,011.48 | 12.40 |
| 131 | 601866 | 中远海发 | 44,794,740.76 | 12.38 |
| 132 | 601016 | 节能风电 | 44,593,433.81 | 12.33 |
| 133 | 601992 | 金隅集团 | 44,261,986.00 | 12.24 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 134 | 300146 | 汤臣倍健 | 43,662,911.66 | 12.07 |
| 135 | 000581 | 威孚高科 | 42,962,763.44 | 11.88 |
| 136 | 000970 | 中科三环 | 42,802,993.58 | 11.83 |
| 137 | 000988 | 华工科技 | 42,728,385.54 | 11.81 |
| 138 | 600702 | 舍得酒业 | 42,346,737.88 | 11.71 |
| 139 | 600827 | 百联股份 | 42,264,595.70 | 11.68 |
| 140 | 601958 | 金钼股份 | 42,101,590.28 | 11.64 |
| 141 | 002416 | 爱施德 | 41,788,424.17 | 11.55 |
| 142 | 601919 | 中远海控 | 41,784,180.22 | 11.55 |
| 143 | 002244 | 滨江集团 | 41,655,612.61 | 11.52 |
| 144 | 002028 | 思源电气 | 41,628,043.35 | 11.51 |
| 145 | 600507 | 方大特钢 | 41,315,387.29 | 11.42 |
| 146 | 600823 | 世茂股份 | 41,195,453.60 | 11.39 |
| 147 | 600256 | 广汇能源 | 40,731,276.46 | 11.26 |
| 148 | 600426 | 华鲁恒升 | 40,613,645.70 | 11.23 |
| 149 | 000513 | 丽珠集团 | 40,257,332.99 | 11.13 |
| 150 | 600804 | 鹏博士 | 40,007,397.55 | 11.06 |
| 151 | 600153 | 建发股份 | 39,789,637.14 | 11.00 |
| 152 | 002511 | 中顺洁柔 | 39,630,393.69 | 10.96 |
| 153 | 600201 | 生物股份 | 39,496,551.06 | 10.92 |
| 154 | 600373 | 中文传媒 | 39,457,021.94 | 10.91 |
| 155 | 002532 | 天山铝业 | 38,945,974.00 | 10.77 |
| 156 | 600809 | 山西汾酒 | 38,778,813.20 | 10.72 |
| 157 | 600970 | 中材国际 | 38,710,182.50 | 10.70 |
| 158 | 300133 | 华策影视 | 38,523,425.00 | 10.65 |
| 159 | 688122 | 西部超导 | 37,987,049.99 | 10.50 |
| 160 | 000937 | 冀中能源 | 37,526,549.77 | 10.37 |
| 161 | 600315 | 上海家化 | 37,301,283.11 | 10.31 |
| 162 | 600195 | 中牧股份 | 37,268,619.29 | 10.30 |
| 163 | 600500 | 中化国际 | 37,198,544.53 | 10.28 |
| 164 | 002465 | 海格通信 | 37,108,104.70 | 10.26 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 165 | 000598 | 兴蓉环境 | 36,964,673.86 | 10.22 |
| 166 | 002286 | 保龄宝 | 36,668,985.00 | 10.14 |
| 167 | 002797 | 第一创业 | 36,094,021.66 | 9.98 |
| 168 | 600739 | 辽宁成大 | 35,496,956.59 | 9.81 |
| 169 | 600271 | 航天信息 | 35,144,126.64 | 9.72 |
| 170 | 000723 | 美锦能源 | 34,956,223.56 | 9.66 |
| 171 | 603589 | 口子窖 | 34,852,457.69 | 9.64 |
| 172 | 600057 | 厦门象屿 | 34,814,259.40 | 9.62 |
| 173 | 600307 | 酒钢宏兴 | 34,725,480.00 | 9.60 |
| 174 | 000050 | 深天马A | 34,317,192.00 | 9.49 |
| 175 | 600546 | 山煤国际 | 34,153,613.55 | 9.44 |
| 176 | 603806 | 福斯特 | 33,654,571.72 | 9.30 |
| 177 | 600643 | 爱建集团 | 33,644,648.51 | 9.30 |
| 178 | 002064 | 华峰化学 | 33,222,848.15 | 9.18 |
| 179 | 300418 | 昆仑万维 | 33,182,453.98 | 9.17 |
| 180 | 001872 | 招商港口 | 33,050,182.61 | 9.14 |
| 181 | 600155 | 华创阳安 | 32,705,624.88 | 9.04 |
| 182 | 601456 | 国联证券 | 32,506,235.76 | 8.99 |
| 183 | 600435 | 北方导航 | 32,383,593.65 | 8.95 |
| 184 | 002372 | 伟星新材 | 32,326,836.20 | 8.94 |
| 185 | 600571 | 信雅达 | 32,120,011.56 | 8.88 |
| 186 | 300009 | 安科生物 | 31,782,488.78 | 8.79 |
| 187 | 600038 | 中直股份 | 31,774,702.43 | 8.78 |
| 188 | 600582 | 天地科技 | 31,594,768.74 | 8.73 |
| 189 | 600183 | 生益科技 | 31,113,963.60 | 8.60 |
| 190 | 002736 | 国信证券 | 30,971,107.68 | 8.56 |
| 191 | 600862 | 中航高科 | 30,853,667.05 | 8.53 |
| 192 | 300661 | 圣邦股份 | 30,818,306.28 | 8.52 |
| 193 | 002368 | 太极股份 | 30,743,876.95 | 8.50 |
| 194 | 600409 | 三友化工 | 30,630,636.00 | 8.47 |
| 195 | 000930 | 中粮科技 | 30,602,930.77 | 8.46 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 196 | 600497 | 驰宏锌锗 | 30,404,283.00 | 8.41 |
| 197 | 601555 | 东吴证券 | 30,292,677.01 | 8.37 |
| 198 | 600556 | 天下秀 | 30,275,479.68 | 8.37 |
| 199 | 601003 | 柳钢股份 | 30,056,401.80 | 8.31 |
| 200 | 002701 | 奥瑞金 | 30,048,486.76 | 8.31 |
| 201 | 002850 | 科达利 | 29,873,697.39 | 8.26 |
| 202 | 002472 | 双环传动 | 29,654,796.27 | 8.20 |
| 203 | 300699 | 光威复材 | 29,614,161.60 | 8.19 |
| 204 | 300463 | 迈克生物 | 29,502,945.44 | 8.16 |
| 205 | 603605 | 珀莱雅 | 29,241,275.66 | 8.08 |
| 206 | 600436 | 片仔癀 | 29,088,507.33 | 8.04 |
| 207 | 603355 | 莱克电气 | 28,581,367.20 | 7.90 |
| 208 | 600529 | 山东药玻 | 28,529,985.57 | 7.89 |
| 209 | 002690 | 美亚光电 | 28,480,153.77 | 7.87 |
| 210 | 000897 | 津滨发展 | 28,421,179.20 | 7.86 |
| 211 | 000528 | 柳 工 | 28,306,402.03 | 7.83 |
| 212 | 300059 | 东方财富 | 28,261,335.50 | 7.81 |
| 213 | 603883 | 老百姓 | 28,200,426.06 | 7.80 |
| 214 | 000090 | 天健集团 | 28,043,386.11 | 7.75 |
| 215 | 002212 | 天融信 | 28,031,393.69 | 7.75 |
| 216 | 002135 | 东南网架 | 27,663,993.00 | 7.65 |
| 217 | 002010 | 传化智联 | 27,319,475.21 | 7.55 |
| 218 | 600126 | 杭钢股份 | 27,247,440.00 | 7.53 |
| 219 | 603496 | 恒为科技 | 27,218,727.54 | 7.52 |
| 220 | 600064 | 南京高科 | 27,050,897.01 | 7.48 |
| 221 | 002948 | 青岛银行 | 26,898,116.08 | 7.44 |
| 222 | 600729 | 重庆百货 | 26,820,171.40 | 7.41 |
| 223 | 603613 | 国联股份 | 26,697,078.60 | 7.38 |
| 224 | 002791 | 坚朗五金 | 26,693,494.95 | 7.38 |
| 225 | 002129 | 中环股份 | 26,440,830.42 | 7.31 |
| 226 | 688357 | 建龙微纳 | 26,402,629.10 | 7.30 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 227 | 000778 | 新兴铸管 | 26,198,588.34 | 7.24 |
| 228 | 601098 | 中南传媒 | 26,160,943.40 | 7.23 |
| 229 | 002541 | 鸿路钢构 | 26,003,723.60 | 7.19 |
| 230 | 603228 | 景旺电子 | 25,767,351.69 | 7.12 |
| 231 | 600415 | 小商品城 | 25,679,908.00 | 7.10 |
| 232 | 000977 | 浪潮信息 | 25,540,010.55 | 7.06 |
| 233 | 603712 | 七一二 | 25,521,723.67 | 7.06 |
| 234 | 300122 | 智飞生物 | 25,447,595.31 | 7.04 |
| 235 | 601000 | 唐山港 | 25,275,529.34 | 6.99 |
| 236 | 600516 | 方大炭素 | 25,115,943.45 | 6.94 |
| 237 | 603986 | 兆易创新 | 24,988,551.65 | 6.91 |
| 238 | 600820 | 隧道股份 | 24,730,139.28 | 6.84 |
| 239 | 600096 | 云天化 | 24,696,601.77 | 6.83 |
| 240 | 000938 | 紫光股份 | 24,610,046.55 | 6.80 |
| 241 | 002920 | 德赛西威 | 24,598,355.41 | 6.80 |
| 242 | 300274 | 阳光电源 | 24,412,953.74 | 6.75 |
| 243 | 600737 | 中粮糖业 | 23,916,888.45 | 6.61 |
| 244 | 000681 | 视觉中国 | 23,897,632.74 | 6.61 |
| 245 | 002328 | 新朋股份 | 23,669,500.22 | 6.54 |
| 246 | 300748 | 金力永磁 | 23,640,675.02 | 6.54 |
| 247 | 300751 | 迈为股份 | 23,583,369.78 | 6.52 |
| 248 | 300655 | 晶瑞电材 | 23,531,683.80 | 6.51 |
| 249 | 688080 | 映翰通 | 23,469,391.18 | 6.49 |
| 250 | 600027 | 华电国际 | 23,342,711.43 | 6.45 |
| 251 | 603719 | 良品铺子 | 23,262,107.22 | 6.43 |
| 252 | 600132 | 重庆啤酒 | 23,235,688.83 | 6.42 |
| 253 | 600642 | 申能股份 | 22,975,634.43 | 6.35 |
| 254 | 603259 | 药明康德 | 22,959,359.80 | 6.35 |
| 255 | 002946 | 新乳业 | 22,939,812.78 | 6.34 |
| 256 | 603566 | 普莱柯 | 22,666,642.82 | 6.27 |
| 257 | 600845 | 宝信软件 | 22,655,917.79 | 6.26 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 258 | 000725 | 京东方A | 22,640,484.00 | 6.26 |
| 259 | 002434 | 万里扬 | 22,461,451.25 | 6.21 |
| 260 | 002557 | 洽洽食品 | 22,458,340.20 | 6.21 |
| 261 | 300253 | 卫宁健康 | 22,443,712.75 | 6.20 |
| 262 | 600673 | 东阳光 | 22,323,033.70 | 6.17 |
| 263 | 603737 | 三棵树 | 22,273,615.58 | 6.16 |
| 264 | 600097 | 开创国际 | 22,270,800.19 | 6.16 |
| 265 | 603733 | 仙鹤股份 | 22,248,548.29 | 6.15 |
| 266 | 600176 | 中国巨石 | 22,115,470.02 | 6.11 |
| 267 | 000063 | 中兴通讯 | 22,112,751.86 | 6.11 |
| 268 | 603456 | 九洲药业 | 22,087,075.63 | 6.11 |
| 269 | 300639 | 凯普生物 | 22,079,425.14 | 6.10 |
| 270 | 688208 | 道通科技 | 22,007,123.68 | 6.08 |
| 271 | 300725 | 药石科技 | 21,993,708.52 | 6.08 |
| 272 | 600882 | 妙可蓝多 | 21,979,748.81 | 6.08 |
| 273 | 002233 | 塔牌集团 | 21,901,094.12 | 6.05 |
| 274 | 688536 | 思瑞浦 | 21,693,163.88 | 6.00 |
| 275 | 603060 | 国检集团 | 21,681,850.79 | 5.99 |
| 276 | 300211 | 亿通科技 | 21,629,945.25 | 5.98 |
| 277 | 603515 | 欧普照明 | 21,482,589.34 | 5.94 |
| 278 | 603267 | 鸿远电子 | 21,466,895.28 | 5.93 |
| 279 | 601678 | 滨化股份 | 21,463,433.28 | 5.93 |
| 280 | 300573 | 兴齐眼药 | 21,223,054.92 | 5.87 |
| 281 | 002254 | 泰和新材 | 21,192,634.14 | 5.86 |
| 282 | 600438 | 通威股份 | 21,067,088.58 | 5.82 |
| 283 | 002738 | 中矿资源 | 20,946,546.00 | 5.79 |
| 284 | 002056 | 横店东磁 | 20,933,870.11 | 5.79 |
| 285 | 002876 | 三利谱 | 20,790,177.00 | 5.75 |
| 286 | 300595 | 欧普康视 | 20,754,511.21 | 5.74 |
| 287 | 000738 | 航发控制 | 20,742,275.09 | 5.73 |
| 288 | 603893 | 瑞芯微 | 20,589,250.00 | 5.69 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 289 | 002294 | 信立泰 | 20,485,343.00 | 5.66 |
| 290 | 000709 | 河钢股份 | 20,366,803.00 | 5.63 |
| 291 | 300496 | 中科创达 | 20,246,465.19 | 5.60 |
| 292 | 002774 | 快意电梯 | 20,223,910.24 | 5.59 |
| 293 | 002563 | 森马服饰 | 20,093,443.52 | 5.55 |
| 294 | 600696 | 岩石股份 | 19,916,379.69 | 5.51 |
| 295 | 601799 | 星宇股份 | 19,792,586.22 | 5.47 |
| 296 | 002705 | 新宝股份 | 19,761,980.61 | 5.46 |
| 297 | 600377 | 宁沪高速 | 19,728,023.28 | 5.45 |
| 298 | 600390 | 五矿资本 | 19,724,159.61 | 5.45 |
| 299 | 002312 | 川发龙蟒 | 19,591,241.19 | 5.42 |
| 300 | 300861 | 美畅股份 | 19,511,765.78 | 5.39 |
| 301 | 002287 | 奇正藏药 | 19,492,834.44 | 5.39 |
| 302 | 002925 | 盈趣科技 | 19,450,105.22 | 5.38 |
| 303 | 688005 | 容百科技 | 19,290,459.89 | 5.33 |
| 304 | 002128 | 电投能源 | 19,261,125.25 | 5.32 |
| 305 | 603345 | 安井食品 | 19,249,573.73 | 5.32 |
| 306 | 000526 | 学大教育 | 19,048,364.00 | 5.27 |
| 307 | 600486 | 扬农化工 | 18,716,921.46 | 5.17 |
| 308 | 300073 | 当升科技 | 18,625,601.25 | 5.15 |
| 309 | 600006 | 东风汽车 | 18,499,799.00 | 5.11 |
| 310 | 300166 | 东方国信 | 18,323,853.00 | 5.07 |
| 311 | 603599 | 广信股份 | 18,267,154.57 | 5.05 |
| 312 | 002240 | 盛新锂能 | 18,230,160.18 | 5.04 |
| 313 | 603379 | 三美股份 | 18,215,670.78 | 5.04 |
| 314 | 300363 | 博腾股份 | 18,122,857.75 | 5.01 |
| 315 | 600487 | 亨通光电 | 18,083,758.61 | 5.00 |
| 316 | 000488 | 晨鸣纸业 | 18,052,336.03 | 4.99 |
| 317 | 603659 | 璞泰来 | 17,838,411.00 | 4.93 |
| 318 | 688595 | 芯海科技 | 17,813,702.56 | 4.92 |
| 319 | 688356 | 键凯科技 | 17,714,572.84 | 4.90 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 320 | 601878 | 浙商证券 | 17,648,231.64 | 4.88 |
| 321 | 603927 | 中科软 | 17,619,217.00 | 4.87 |
| 322 | 300671 | 富满微 | 17,587,532.48 | 4.86 |
| 323 | 600499 | 科达制造 | 17,531,465.98 | 4.85 |
| 324 | 600817 | 宇通重工 | 17,363,164.18 | 4.80 |
| 325 | 601777 | 力帆科技 | 17,322,414.37 | 4.79 |
| 326 | 601677 | 明泰铝业 | 17,221,436.81 | 4.76 |
| 327 | 600456 | 宝钛股份 | 17,218,055.62 | 4.76 |
| 328 | 601211 | 国泰君安 | 17,143,438.00 | 4.74 |
| 329 | 300618 | 寒锐钴业 | 17,125,302.43 | 4.73 |
| 330 | 300750 | 宁德时代 | 17,064,913.76 | 4.72 |
| 331 | 002966 | 苏州银行 | 17,037,650.30 | 4.71 |
| 332 | 002281 | 光迅科技 | 16,955,174.99 | 4.69 |
| 333 | 002023 | 海特高新 | 16,830,456.69 | 4.65 |
| 334 | 688017 | 绿的谐波 | 16,827,036.11 | 4.65 |
| 335 | 601600 | 中国铝业 | 16,801,036.50 | 4.64 |
| 336 | 600985 | 淮北矿业 | 16,718,398.28 | 4.62 |
| 337 | 603612 | 索通发展 | 16,575,623.60 | 4.58 |
| 338 | 002756 | 永兴材料 | 16,517,332.66 | 4.57 |
| 339 | 603043 | 广州酒家 | 16,509,787.58 | 4.56 |
| 340 | 603039 | 泛微网络 | 16,447,066.00 | 4.55 |
| 341 | 300609 | 汇纳科技 | 16,394,672.00 | 4.53 |
| 342 | 601900 | 南方传媒 | 16,376,129.00 | 4.53 |
| 343 | 300357 | 我武生物 | 16,322,220.06 | 4.51 |
| 344 | 600586 | 金晶科技 | 16,005,568.36 | 4.42 |
| 345 | 600901 | 江苏租赁 | 15,662,809.06 | 4.33 |
| 346 | 002812 | 恩捷股份 | 15,617,882.00 | 4.32 |
| 347 | 000683 | 远兴能源 | 15,604,836.00 | 4.31 |
| 348 | 600577 | 精达股份 | 15,524,142.00 | 4.29 |
| 349 | 688233 | 神工股份 | 15,506,948.34 | 4.29 |
| 350 | 688368 | 晶丰明源 | 15,413,582.56 | 4.26 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 351 | 000833 | 粤桂股份 | 15,253,030.00 | 4.22 |
| 352 | 300124 | 汇川技术 | 15,236,515.50 | 4.21 |
| 353 | 605111 | 新洁能 | 15,098,149.80 | 4.17 |
| 354 | 600837 | 海通证券 | 15,079,219.00 | 4.17 |
| 355 | 600202 | 哈空调 | 15,038,642.48 | 4.16 |
| 356 | 300733 | 西菱动力 | 14,894,754.00 | 4.12 |
| 357 | 600887 | 伊利股份 | 14,873,480.55 | 4.11 |
| 358 | 600143 | 金发科技 | 14,823,458.24 | 4.10 |
| 359 | 600728 | 佳都科技 | 14,747,671.73 | 4.08 |
| 360 | 601512 | 中新集团 | 14,747,401.25 | 4.08 |
| 361 | 300308 | 中际旭创 | 14,721,289.71 | 4.07 |
| 362 | 600519 | 贵州茅台 | 14,711,882.00 | 4.07 |
| 363 | 300113 | 顺网科技 | 14,672,082.70 | 4.06 |
| 364 | 002440 | 闰土股份 | 14,668,190.00 | 4.06 |
| 365 | 002038 | 双鹭药业 | 14,617,268.20 | 4.04 |
| 366 | 601899 | 紫金矿业 | 14,585,035.00 | 4.03 |
| 367 | 601966 | 玲珑轮胎 | 14,375,741.90 | 3.97 |
| 368 | 002568 | 百润股份 | 14,308,255.70 | 3.96 |
| 369 | 601618 | 中国中冶 | 14,274,155.03 | 3.95 |
| 370 | 603678 | 火炬电子 | 14,256,708.49 | 3.94 |
| 371 | 601789 | 宁波建工 | 14,255,241.26 | 3.94 |
| 372 | 600170 | 上海建工 | 14,075,799.00 | 3.89 |
| 373 | 000657 | 中钨高新 | 14,072,125.60 | 3.89 |
| 374 | 300482 | 万孚生物 | 13,975,445.37 | 3.86 |
| 375 | 603816 | 顾家家居 | 13,927,320.60 | 3.85 |
| 376 | 002497 | 雅化集团 | 13,921,489.79 | 3.85 |
| 377 | 002833 | 弘亚数控 | 13,851,154.00 | 3.83 |
| 378 | 601179 | 中国西电 | 13,829,645.00 | 3.82 |
| 379 | 688037 | 芯源微 | 13,747,587.71 | 3.80 |
| 380 | 002433 | 太安堂 | 13,589,157.00 | 3.76 |
| 381 | 300833 | 浩洋股份 | 13,528,898.16 | 3.74 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 382 | 002230 | 科大讯飞 | 13,420,112.83 | 3.71 |
| 383 | 300088 | 长信科技 | 13,299,783.61 | 3.68 |
| 384 | 300630 | 普利制药 | 13,265,649.54 | 3.67 |
| 385 | 600282 | 南钢股份 | 13,122,363.30 | 3.63 |
| 386 | 603320 | 迪贝电气 | 13,120,182.77 | 3.63 |
| 387 | 601005 | 重庆钢铁 | 12,870,129.00 | 3.56 |
| 388 | 688378 | 奥来德 | 12,819,269.76 | 3.54 |
| 389 | 002241 | 歌尔股份 | 12,685,638.26 | 3.51 |
| 390 | 002439 | 启明星辰 | 12,675,690.30 | 3.50 |
| 391 | 600764 | 中国海防 | 12,668,073.97 | 3.50 |
| 392 | 002906 | 华阳集团 | 12,628,358.00 | 3.49 |
| 393 | 002765 | 蓝黛科技 | 12,464,456.00 | 3.45 |
| 394 | 000997 | 新 大 陆 | 12,413,326.95 | 3.43 |
| 395 | 688029 | 南微医学 | 12,412,223.74 | 3.43 |
| 396 | 002458 | 益生股份 | 12,385,987.68 | 3.42 |
| 397 | 603713 | 密尔克卫 | 12,352,200.00 | 3.41 |
| 398 | 002636 | 金安国纪 | 12,241,389.22 | 3.38 |
| 399 | 601882 | 海天精工 | 12,238,860.00 | 3.38 |
| 400 | 600018 | 上港集团 | 12,222,248.00 | 3.38 |
| 401 | 001914 | 招商积余 | 12,154,781.92 | 3.36 |
| 402 | 002030 | 达安基因 | 12,150,815.75 | 3.36 |
| 403 | 603565 | 中谷物流 | 12,110,598.90 | 3.35 |
| 404 | 000498 | 山东路桥 | 12,068,326.52 | 3.34 |
| 405 | 601869 | 长飞光纤 | 12,020,804.46 | 3.32 |
| 406 | 601333 | 广深铁路 | 11,987,549.00 | 3.31 |
| 407 | 688508 | 芯朋微 | 11,876,562.06 | 3.28 |
| 408 | 600581 | 八一钢铁 | 11,848,189.00 | 3.28 |
| 409 | 300696 | 爱乐达 | 11,772,107.44 | 3.25 |
| 410 | 002203 | 海亮股份 | 11,761,956.85 | 3.25 |
| 411 | 300171 | 东富龙 | 11,761,593.00 | 3.25 |
| 412 | 300755 | 华致酒行 | 11,663,588.71 | 3.22 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 413 | 002041 | 登海种业 | 11,594,572.94 | 3.21 |
| 414 | 600958 | 东方证券 | 11,516,677.32 | 3.18 |
| 415 | 000933 | 神火股份 | 11,480,591.00 | 3.17 |
| 416 | 601865 | 福莱特 | 11,426,186.85 | 3.16 |
| 417 | 002493 | 荣盛石化 | 11,146,011.50 | 3.08 |
| 418 | 300257 | 开山股份 | 11,131,876.00 | 3.08 |
| 419 | 600399 | 抚顺特钢 | 11,130,664.73 | 3.08 |
| 420 | 002430 | 杭氧股份 | 11,037,122.75 | 3.05 |
| 421 | 601001 | 晋控煤业 | 10,897,077.25 | 3.01 |
| 422 | 002444 | 巨星科技 | 10,869,909.39 | 3.01 |
| 423 | 002831 | 裕同科技 | 10,841,537.80 | 3.00 |
| 424 | 300034 | 钢研高纳 | 10,820,335.25 | 2.99 |
| 425 | 002595 | 豪迈科技 | 10,802,929.00 | 2.99 |
| 426 | 000786 | 北新建材 | 10,775,389.46 | 2.98 |
| 427 | 600584 | 长电科技 | 10,691,261.70 | 2.96 |
| 428 | 600746 | 江苏索普 | 10,688,120.70 | 2.95 |
| 429 | 601668 | 中国建筑 | 10,587,725.00 | 2.93 |
| 430 | 688018 | 乐鑫科技 | 10,576,917.50 | 2.92 |
| 431 | 002601 | 龙佰集团 | 10,557,277.98 | 2.92 |
| 432 | 300623 | 捷捷微电 | 10,545,776.25 | 2.92 |
| 433 | 603305 | 旭升股份 | 10,537,467.00 | 2.91 |
| 434 | 603738 | 泰晶科技 | 10,509,646.00 | 2.91 |
| 435 | 002027 | 分众传媒 | 10,426,199.11 | 2.88 |
| 436 | 300136 | 信维通信 | 10,416,538.53 | 2.88 |
| 437 | 603833 | 欧派家居 | 10,372,097.00 | 2.87 |
| 438 | 688030 | 山石网科 | 10,228,984.19 | 2.83 |
| 439 | 603026 | 石大胜华 | 10,215,996.00 | 2.82 |
| 440 | 300285 | 国瓷材料 | 10,206,715.00 | 2.82 |
| 441 | 688185 | 康希诺 | 10,155,122.86 | 2.81 |
| 442 | 300413 | 芒果超媒 | 10,142,153.00 | 2.80 |
| 443 | 300070 | 碧水源 | 9,976,115.00 | 2.76 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 444 | 300571 | 平治信息 | 9,960,082.00 | 2.75 |
| 445 | 603897 | 长城科技 | 9,932,104.15 | 2.75 |
| 446 | 300593 | 新雷能 | 9,863,080.04 | 2.73 |
| 447 | 600338 | 西藏珠峰 | 9,818,693.38 | 2.71 |
| 448 | 002585 | 双星新材 | 9,809,265.05 | 2.71 |
| 449 | 002318 | 久立特材 | 9,790,550.00 | 2.71 |
| 450 | 603901 | 永创智能 | 9,773,871.00 | 2.70 |
| 451 | 000998 | 隆平高科 | 9,753,512.00 | 2.70 |
| 452 | 002345 | 潮宏基 | 9,722,924.97 | 2.69 |
| 453 | 603127 | 昭衍新药 | 9,620,979.93 | 2.66 |
| 454 | 600273 | 嘉化能源 | 9,605,763.00 | 2.66 |
| 455 | 601952 | 苏垦农发 | 9,577,091.50 | 2.65 |
| 456 | 300058 | 蓝色光标 | 9,566,467.01 | 2.64 |
| 457 | 002615 | 哈尔斯 | 9,530,329.00 | 2.63 |
| 458 | 688202 | 美迪西 | 9,477,688.55 | 2.62 |
| 459 | 002901 | 大博医疗 | 9,456,389.00 | 2.61 |
| 460 | 688298 | 东方生物 | 9,453,211.13 | 2.61 |
| 461 | 600880 | 博瑞传播 | 9,388,265.58 | 2.60 |
| 462 | 600711 | 盛屯矿业 | 9,370,655.30 | 2.59 |
| 463 | 601101 | 昊华能源 | 9,369,831.60 | 2.59 |
| 464 | 688139 | 海尔生物 | 9,281,544.80 | 2.57 |
| 465 | 002533 | 金杯电工 | 9,277,284.00 | 2.56 |
| 466 | 000423 | 东阿阿胶 | 9,224,788.00 | 2.55 |
| 467 | 002507 | 涪陵榨菜 | 9,160,482.22 | 2.53 |
| 468 | 600216 | 浙江医药 | 9,134,848.00 | 2.53 |
| 469 | 600600 | 青岛啤酒 | 9,022,839.00 | 2.49 |
| 470 | 002131 | 利欧股份 | 9,011,043.00 | 2.49 |
| 471 | 603995 | 甬金股份 | 8,956,525.00 | 2.48 |
| 472 | 688002 | 睿创微纳 | 8,907,841.68 | 2.46 |
| 473 | 000501 | 鄂武商A | 8,906,164.00 | 2.46 |
| 474 | 000600 | 建投能源 | 8,896,428.61 | 2.46 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 475 | 603489 | 八方股份 | 8,821,265.54 | 2.44 |
| 476 | 688396 | 华润微 | 8,805,648.56 | 2.43 |
| 477 | 000990 | 诚志股份 | 8,799,909.93 | 2.43 |
| 478 | 002555 | 三七互娱 | 8,761,949.00 | 2.42 |
| 479 | 601158 | 重庆水务 | 8,618,727.00 | 2.38 |
| 480 | 002653 | 海思科 | 8,597,517.15 | 2.38 |
| 481 | 002384 | 东山精密 | 8,591,973.55 | 2.38 |
| 482 | 688111 | 金山办公 | 8,587,853.62 | 2.37 |
| 483 | 300772 | 运达股份 | 8,556,404.00 | 2.37 |
| 484 | 300017 | 网宿科技 | 8,551,798.00 | 2.36 |
| 485 | 688200 | 华峰测控 | 8,548,913.15 | 2.36 |
| 486 | 002375 | 亚厦股份 | 8,510,900.00 | 2.35 |
| 487 | 002003 | 伟星股份 | 8,484,324.00 | 2.35 |
| 488 | 600760 | 中航沈飞 | 8,468,109.72 | 2.34 |
| 489 | 300726 | 宏达电子 | 8,365,459.50 | 2.31 |
| 490 | 002148 | 北纬科技 | 8,289,829.36 | 2.29 |
| 491 | 000028 | 国药一致 | 8,179,333.16 | 2.26 |
| 492 | 600056 | 中国医药 | 8,090,098.00 | 2.24 |
| 493 | 300015 | 爱尔眼科 | 8,065,793.90 | 2.23 |
| 494 | 000762 | 西藏矿业 | 8,060,239.00 | 2.23 |
| 495 | 300138 | 晨光生物 | 8,043,455.77 | 2.22 |
| 496 | 600641 | 万业企业 | 7,953,923.60 | 2.20 |
| 497 | 600123 | 兰花科创 | 7,951,185.00 | 2.20 |
| 498 | 300101 | 振芯科技 | 7,943,303.28 | 2.20 |
| 499 | 000011 | 深物业A | 7,918,462.88 | 2.19 |
| 500 | 002402 | 和而泰 | 7,889,604.00 | 2.18 |
| 501 | 300291 | 华录百纳 | 7,884,416.00 | 2.18 |
| 502 | 600248 | 陕西建工 | 7,842,142.00 | 2.17 |
| 503 | 688516 | 奥特维 | 7,830,560.74 | 2.16 |
| 504 | 300196 | 长海股份 | 7,766,787.80 | 2.15 |
| 505 | 002745 | 木林森 | 7,762,874.00 | 2.15 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 506 | 600386 | 北巴传媒 | 7,722,716.00 | 2.13 |
| 507 | 603393 | 新天然气 | 7,709,412.17 | 2.13 |
| 508 | 603611 | 诺力股份 | 7,637,149.00 | 2.11 |
| 509 | 300014 | 亿纬锂能 | 7,594,527.88 | 2.10 |
| 510 | 600967 | 内蒙一机 | 7,449,312.00 | 2.06 |
| 511 | 300251 | 光线传媒 | 7,410,857.00 | 2.05 |
| 512 | 601801 | 皖新传媒 | 7,371,897.00 | 2.04 |
| 513 | 600533 | 栖霞建设 | 7,342,181.07 | 2.03 |
| 514 | 601117 | 中国化学 | 7,326,231.40 | 2.03 |
| 515 | 002429 | 兆驰股份 | 7,326,092.22 | 2.03 |
| 516 | 300548 | 博创科技 | 7,274,384.50 | 2.01 |

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。

### 8.4.3 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 | 23,049,197,585.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 19,909,821,808.58 |

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。

## 8.5 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 | 177,552,250.00 | 4.35 |
| 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 | 177,552,250.00 | 4.35 |

**8.6 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 | 019658 | 21国债10 | 800,000 | 79,880,000.00 | 1.96 |
| 2 | 019641 | 20国债11 | 650,000 | 65,162,500.00 | 1.60 |
| 3 | 019654 | 21国债06 | 325,000 | 32,509,750.00 | 0.80 |

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

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

**8.12.2 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。**

**8.12.3 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 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,941,441.08 |
| 5 | 应收申购款 | 6,243,660.03 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 8,185,101.11 |

**8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 份额 | 持有 | 户均持有的 | 持有人结构 |
| --- | --- | --- | --- |

| 级别 | 人户数(户) | 基金份额 | 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 | 88,074 | 12,715.49 | 394,237,842.34 | 35.20% | 725,666,455.04 | 64.80% |
| 博道中证500增强C | 73,446 | 9,727.42 | 314,742,669.87 | 44.05% | 399,697,396.29 | 55.95% |
| 合计 | 157,019 | 11,682.31 | 708,980,512.21 | 38.65% | 1,125,363,851.33 | 61.35% |

## 9.2 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 | 1,139,566.50 | 0.10% |
| | 博道中证500增强C | 62,871.72 | 0.01% |
| | 合计 | 1,202,438.22 | 0.07% |

## 9.3 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 |
| | 博道中证500增强C | 0 |
| | 合计 | 0 |

# §10 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 | 136,881,915.18 | 77,898,172.87 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,552,279,068.43 | 1,502,807,419.84 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 569,256,686.23 | 866,265,526.55 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,119,904,297.38 | 714,440,066.16 |

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。

# §11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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：无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：自2021年10月27日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 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)，本期审计费用请见“7.4.7.19其他费用”。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。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 | 83,265,124.24 | 0.19% | 119,723.28 | 0.46% | - |
| 国金证券 | 2 | 42,832,156,855.78 | 99.81% | 25,699,496.28 | 99.54% | - |

### 11.7.2 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 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 331,913,804.90 | 100.00% | 2,502,002,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

注：

1、报告期内，本基金新增加交易单元为东方财富证券股份有限公司；

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。

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| --- | --- | --- | --- |
| 1 | 博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021-01-22 |
| 2 | 博道中证500指数增强型证券投资基金2020年第四季度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-22 |
| 3 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-01 |
| 4 | 博道基金管理有限公司关于旗下两只基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号--指数基金指引》修订相关法律文件的公告 | 中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-26 |
| 5 | 博道基金管理有限公司关于 | 中国证券报 | 2021-03-26 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 旗下两只基金修订基金合同并更新招募说明书、产品资料概要的提示性公告 | | |
| 6 | 博道中证500指数增强型证券投资基金基金合同、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 | 2021-03-26 |
| 7 | 博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021-03-31 |
| 8 | 博道中证500指数增强型证券投资基金2020年年度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-31 |
| 9 | 博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021-04-22 |
| 10 | 博道中证500指数增强型证券投资基金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 |
| 11 | 博道基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为博道中证500指数增强型证券投资基金销售机构的公告 | 中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-18 |
| 12 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-07 |
| 13 | 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 | 2021-06-09 |
| 14 | 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 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 15 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行费率优惠活动的公告 | 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 | 2021-06-30 |
| 16 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行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 | 2021-07-05 |
| 17 | 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 | 2021-07-21 |
| 18 | 博道中证500指数增强型证券投资基金2021年第二季度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-21 |
| 19 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）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 | 2021-08-10 |
| 20 | 博道基金管理有限公司关于博道中证500指数增强型证券投资基金调整单笔申购最低金额、单笔赎回最低份额及最低保留余额的公告 | 中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-08-14 |
| 21 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-08-31 |
| 22 | 博道基金管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2021-08-31 |
| 23 | 博道中证500指数增强型证券投资基金2021年中期报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-08-31 |
| 24 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金参与腾安基金 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司 | 2021-09-07 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 销售（深圳）有限公司赎回费率优惠活动的公告 | 网站、中国证监会基金电子披露网站 | |
| 25 | 博道基金管理有限公司关于博道中证500指数增强型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入和定期定额投资）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 | 2021-09-07 |
| 26 | 博道基金管理有限公司关于增加中国银行股份有限公司为博道中证500指数增强型证券投资基金销售机构的公告 | 中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-09-08 |
| 27 | 博道基金管理有限公司关于博道中证500指数增强型证券投资基金调整大额申购（含转换转入和定期定额投资）限制金额的公告 | 中国证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-09-14 |
| 28 | 博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通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 | 2021-09-17 |
| 29 | 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 | 2021-10-27 |
| 30 | 博道中证500指数增强型证券投资基金2021年第三季度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-27 |
| 31 | 博道中证500指数增强型证券投资基金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 | 2021-11-12 |

## §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予博道中证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。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

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

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

**博道基金管理有限公司**

**二〇二二年三月三十一日**