

# 博道伍佰智航股票型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	65
§9 开放式基金份额变动 .....	65
§10 重大事件揭示 .....	66
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
10.4 基金投资策略的改变 .....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
10.8 其他重大事件 .....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	68
§12 备查文件目录 .....	69
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	博道伍佰智航股票型证券投资基金	
基金简称	博道伍佰智航	
基金主代码	007831	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09月26日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	406,847,134.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
下属分级基金的交易代码	007831	007832
报告期末下属分级基金的份额总额	133,003,870.17份	273,843,264.62份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，以股票投资为主。本基金业绩比较基准中股票资产部分以中证500指数为基准指数，通过量化选股模型构建股票组合，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。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、参与融资业务的策略、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	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博道基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	王小飞
	联系电话	021-80226288	021-60637103
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-085-2888	021-60637228
传真		021-80226289	021-60635778
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200122	100033
法定代表人		莫泰山	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bdfund.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
本期已实现收益	6,241,042.63	4,099,449.59
本期利润	18,695,073.33	32,399,229.76
加权平均基金份额本期利润	0.1044	0.0808
本期加权平均净值利润率	7.11%	5.57%
本期基金份额净值增长率	7.28%	7.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	56,884,373.13	112,665,000.31
期末可供分配基金份额利润	0.4277	0.4114
期末基金资产净值	198,461,410.97	404,047,644.41
期末基金份额净值	1.4921	1.4755
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	49.21%	47.55%

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

博道伍佰智航A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.73%	0.84%	-0.77%	0.89%	4.50%	-0.05%
过去三个月	0.08%	0.80%	-5.10%	0.78%	5.18%	0.02%

过去六个月	7.28%	0.77%	2.20%	0.75%	5.08%	0.02%
过去一年	-3.45%	0.98%	-6.65%	0.91%	3.20%	0.07%
过去三年	22.68%	1.24%	2.48%	1.13%	20.20%	0.11%
自基金合同生效起至今	49.21%	1.27%	17.44%	1.20%	31.77%	0.07%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

#### 博道伍佰智航C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.71%	0.84%	-0.77%	0.89%	4.48%	-0.05%
过去三个月	0.01%	0.80%	-5.10%	0.78%	5.11%	0.02%
过去六个月	7.12%	0.77%	2.20%	0.75%	4.92%	0.02%
过去一年	-3.74%	0.98%	-6.65%	0.91%	2.91%	0.07%
过去三年	21.58%	1.24%	2.48%	1.13%	19.10%	0.11%
自基金合同生效起至今	47.55%	1.27%	17.44%	1.20%	30.11%	0.07%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

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

博道伍佰智航A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年09月26日-2023年06月30日)



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

博道伍佰智航C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年09月26日-2023年06月30日)



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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可[2017]822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本金为1亿元人民币。截至报告期末，公司旗下发行并管理了25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、博道成长智航股票型证券投资基金、博道盛兴一年持有期混合型证券投资基金、博道研究恒选混合型证券投资基金、博道和瑞多元稳健6个月持有期混合型证券投资基金、博道惠泰优选混合型证券投资基金和博道和祥多元稳健债券型证券投资基金。

#### 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、博道成长智航股票的基金经理、量化投资部总经理兼研究部副总经理	2019-09-26	-	12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

				<p>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兼研究部副总经理。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。</p>
--	--	--	--	--

注：

1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"为根据公司决

定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生8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

2023年上半年，市场先扬后抑，呈现出较强的小市值风格。沪深300下跌0.75%，中证500上涨2.29%，中证1000上涨5.10%，创业板指下跌5.61%，恒生指数下跌4.37%。从行业来看，通信、传媒、计算机表现较好，分别上涨45.4%、43.4%、32.3%，消费者服务、房地产、农林牧渔表现较差，分别下跌27.9%、14.1%、9.2%。

从因子层面来看，一季度因子表现延续去年四季度的格局，呈现强反转弱动量的格局，基本面动量类因子表现较差，估值和量价因子表现出色，二季度以来各类型因子均表现较好，景气类因子修复明显，弹性略大一些。博道“指数+”系列产品在相对均衡的因子权重配置下，一季度超额总体走平，二季度以来超额收益表现较好，逐渐体现出一季度多因子选股模型几项重要升级后的效果。

#### 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

展望下半年，尽管市场在中长期担忧下对短周期拐点越来越谨慎，需要更多的数据和更持续的改善做验证，但权益资产当前处于赔率和胜率都较高的底部区域，经济慢慢进入到低库存状态，一旦有需求端的边际利好出现，市场将有较为敏感的反应，因此，我们对权益资产维持积极的态度。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：博道伍佰智航股票型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	57,494,466.57	22,920,671.57
结算备付金		15,567.68	15,505.17
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	582,030,162.87	853,861,014.78
其中：股票投资		552,968,992.56	814,328,998.77
基金投资		-	-
债券投资		29,061,170.31	39,532,016.01
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		169,230.31	481,854.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		639,709,427.43	877,279,045.55
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		26,503,394.37	220,860.28
应付管理人报酬		747,990.99	988,161.64
应付托管费		126,583.11	167,227.36
应付销售服务费		115,766.64	154,528.73
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8.41	0.57
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	9,706,628.53	470,369.03
负债合计		37,200,372.05	2,001,147.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	406,847,134.79	633,529,811.52
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	195,661,920.59	241,748,086.42
净资产合计		602,509,055.38	875,277,897.94
负债和净资产总计		639,709,427.43	877,279,045.55

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

## 6.2 利润表

会计主体：博道伍佰智航股票型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		58,467,211.83	-124,830,374.75
1.利息收入		162,455.01	139,276.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	162,454.91	139,276.73
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		0.10	0.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,498,013.48	-173,875,579.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,415,028.91	-181,580,511.17
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	468,701.16	677,797.81
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	6,614,283.41	7,027,133.85
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	6.4.7.15	40,753,810.87	48,584,844.77
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.16	52,932.47	321,083.07
<b>减：二、营业总支出</b>		7,372,908.74	8,149,962.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,460,440.97	6,180,276.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	924,074.65	1,045,892.89
3. 销售服务费		868,587.72	829,549.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		21,857.67	943.83
其中：卖出回购金融资产 支出		21,857.67	943.83
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		3.94	0.50
8. 其他费用	6.4.7.17	97,943.79	93,299.71
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		51,094,303.09	-132,980,337.66
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		51,094,303.09	-132,980,337.66

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		51,094,303.09	-132,980,337.66

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：博道伍佰智航股票型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	633,529,811.52	-	241,748,086.42	875,277,897.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	633,529,811.52	-	241,748,086.42	875,277,897.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-226,682,676.73	-	-46,086,165.83	-272,768,842.56
（一）、综合收益总额	-	-	51,094,303.09	51,094,303.09
（二）、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）	-226,682,676.73	-	-97,180,468.92	-323,863,145.65

其中：1.基金申购款	150,362,877.33	-	73,072,522.34	223,435,399.67
2.基金赎回款	-377,045,554.06	-	-170,252,991.26	-547,298,545.32
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	406,847,134.79	-	195,661,920.59	602,509,055.38
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	675,161,338.42	-	472,056,093.11	1,147,217,431.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	675,161,338.42	-	472,056,093.11	1,147,217,431.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-101,745,265.86	-	-163,790,855.46	-265,536,121.32

（一）、综合收益总额	-	-	-132,980,337.66	-132,980,337.66
（二）、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）	-101,745,265.86	-	-30,810,517.80	-132,555,783.66
其中：1.基金申购款	114,538,120.52	-	60,588,014.14	175,126,134.66
2.基金赎回款	-216,283,386.38	-	-91,398,531.94	-307,681,918.32
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	573,416,072.56	-	308,265,237.65	881,681,310.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

莫泰山

张丽

严娅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

博道伍佰智航股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1387号《关于准予博道伍佰智航股票

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《博道伍佰智航股票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 758,118,385.63 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 0519 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 758,452,093.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 333,708.29 份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》和《博道伍佰智航股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、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、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货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 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2023年01月01日至2023年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及2023年01月01日至2023年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服

务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	3,515,627.48
等于：本金	3,515,355.28
加：应计利息	272.20
减：坏账准备	-
定期存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	53,978,839.09
等于：本金	53,972,875.26
加：应计利息	5,963.83
减：坏账准备	-
合计	57,494,466.57

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

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	543,405,344.03	-	552,968,992.56	9,563,648.53	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	28,305,616.97	537,349.77	29,061,170.31	218,203.57
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	28,305,616.97	537,349.77	29,061,170.31	218,203.57
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	571,710,961.00	537,349.77	582,030,162.87	9,781,852.10	

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

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.98
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	34,712.18
预提费用-信息披露费	459,507.37
其他应付	9,212,400.00
合计	9,706,628.53

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 博道伍佰智航A

金额单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	197,581,538.73	197,581,538.73
本期申购	9,468,495.02	9,468,495.02
本期赎回（以“-”号填列）	-74,046,163.58	-74,046,163.58
本期末	133,003,870.17	133,003,870.17

#### 6.4.7.7.2 博道伍佰智航C

金额单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	435,948,272.79	435,948,272.79
本期申购	140,894,382.31	140,894,382.31
本期赎回（以“-”号填列）	-302,999,390.48	-302,999,390.48
本期末	273,843,264.62	273,843,264.62

注：

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

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 博道伍佰智航A

单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	78,244,180.54	-1,017,431.43	77,226,749.11
本期利润	6,241,042.63	12,454,030.70	18,695,073.33
本期基金份额交易产生的变动数	-27,600,850.04	-2,863,431.60	-30,464,281.64
其中：基金申购款	4,034,928.70	433,768.26	4,468,696.96
基金赎回款	-31,635,778.74	-3,297,199.86	-34,932,978.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,884,373.13	8,573,167.67	65,457,540.80

## 6.4.7.8.2 博道伍佰智航C

单位：人民币元

项目 (博道伍佰智航C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	166,637,046.42	-2,115,709.11	164,521,337.31
本期利润	4,099,449.59	28,299,780.17	32,399,229.76
本期基金份额交易产生的变动数	-58,071,495.70	-8,644,691.58	-66,716,187.28
其中：基金申购款	61,325,460.60	7,278,364.78	68,603,825.38
基金赎回款	-119,396,956.30	-15,923,056.36	-135,320,012.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,665,000.31	17,539,379.48	130,204,379.79

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	4,827.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	157,564.72
结算备付金利息收入	62.51
其他	-
合计	162,454.91

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	5,395,188,194.38
减：卖出股票成本总额	5,372,059,332.07
减：交易费用	12,713,833.40
买卖股票差价收入	10,415,028.91

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	339,724.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	128,976.42
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	468,701.16

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,920,533.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,429,528.36
减：应计利息总额	362,006.43
减：交易费用	22.56
买卖债券差价收入	128,976.42

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,614,283.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,614,283.41

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	40,753,810.87
——股票投资	40,418,171.20
——债券投资	335,639.67
——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	40,753,810.87

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	52,932.47
合计	52,932.47

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中，A类份额将不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产，C类份额将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	3,724.24
合计	97,943.79

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于2023年8月12日公布的《博道基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，经与各基金托管人协商一致，决定自2023年8月14日起，调低旗下部分基金的管理费率和/或托管费率。调整后本基金管理费率和托管费率分别为1.20%和0.20%，本次调整将减少本基金在同等规模下所需承担支付的管理费和托管费。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构

中国建设银行股份有限公司

基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

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。

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 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。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,460,440.97	6,180,276.38
其中：支付销售机构的客户维护费	889,809.69	1,019,995.92

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.30%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	924,074.65	1,045,892.89

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.22%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×0.22%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	487,588.17	487,588.17
合计	-	487,588.17	487,588.17
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C	合计
博道基金 管理有限 公司	-	375,277.86	375,277.86
合计	-	375,277.86	375,277.86

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的基金资产净值×0.30%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道伍佰智航A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,999,697.30	1,999,697.30
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,680,000.00	-
报告期末持有的基金份额	319,697.30	1,999,697.30
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.24%	0.91%

博道伍佰智航C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	1,000,048.61	1,000,048.61
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,000,048.61	1,000,048.61
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.37%	0.28%

注：

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

3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间0~10万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间0~10万份。）

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,515,627.48	4,827.68	2,200,685.85	5,380.10

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价	期末估	数量（单位）	期末成本总额	期末估值总额	备注

码					格	值	股)			
						单				
						价				
301 301	川宁 生物	2022- 12-20	6个月以上	创业板打 新限售	5.00	8.96	3,574	17,87 0.00	32,02 3.04	-
601 916	浙商 银行	2023- 06-27	1个月内 (含)	配股未上 市	2.02	2.64	31,08 0	62,78 1.60	82,05 1.20	-
301 291	明阳 电气	2023- 06-21	6个月以上	创业板打 新限售	38.1 3	31.0 3	979	37,32 9.27	30,37 8.37	-
688 582	芯动 联科	2023- 06-21	6个月以上	科创板打 新限售	26.7 4	40.6 8	648	17,32 7.52	26,36 0.64	-
688 435	英方 软件	2023- 01-12	6个月以上	科创板打 新限售	38.6 6	73.0 3	2,728	105,4 64.48	199,2 25.84	-
688 629	华丰 科技	2023- 06-16	6个月以上	科创板打 新限售	9.26	18.5 9	708	6,556. 08	13,16 1.72	-
301 397	溯联 股份	2023- 06-15	6个月以上	创业板打 新限售	53.2 7	40.2 0	362	19,28 3.74	14,55 2.40	-
301 210	金杨 股份	2023- 06-21	6个月以上	创业板打 新限售	57.8 8	49.1 7	281	16,26 4.28	13,81 6.77	-
688 620	安凯 微	2023- 06-15	6个月以上	科创板打 新限售	10.6 8	12.3 4	1,016	10,85 0.88	12,53 7.44	-
688 631	莱斯 信息	2023- 06-19	6个月以上	科创板打 新限售	25.2 8	29.8 7	336	8,494. 08	10,03 6.32	-
301 488	豪恩 汽电	2023- 06-26	1个月内 (含)	新股未上 市	39.7 8	39.7 8	2,356	93,72 1.68	93,72 1.68	-
301 488	豪恩 汽电	2023- 06-26	6个月以上	创业板打 新限售	39.7 8	39.7 8	262	10,42 2.36	10,42 2.36	-
688 429	时创 能源	2023- 06-20	6个月以上	科创板打 新限售	19.2 0	25.5 3	346	6,643. 20	8,833. 38	-
688 249	晶合 集成	2023- 04-24	6个月以上	科创板打 新限售	19.8 6	18.0 6	5,467	108,5 74.62	98,73 4.02	-
301 170	锡南 科技	2023- 06-16	6个月以上	创业板打 新限售	34.0 0	34.9 3	250	8,500. 00	8,732. 50	-

301295	美硕科技	2023-06-19	6个月以上	创业板打新限售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月以上	创业板打新限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月以上	科创板打新限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月以上	创业板打新限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月以上	科创板打新限售	5.69	5.41	10,322	58,732.18	55,842.02	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月以上	科创板打新限售	11.10	17.04	3,242	35,986.20	55,243.68	-
688485	九州一轨	2023-01-11	6个月以上	科创板打新限售	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月以上	科创板打新限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月以上	科创板打新限售	37.88	29.49	1,595	60,418.60	47,036.55	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月以上	创业板打新限售	23.77	42.89	1,092	25,956.84	46,835.88	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月以上	创业板打新限售	30.85	23.63	1,813	55,931.05	42,841.19	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月以上	创业板打新限售	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月以上	主板打新限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
688	日联	2023-	6个月以上	科创板打	152.	135.	260	39,61	35,35	-

531	科技	03-24		新限售	38	97		8.80	2.20	
688 484	南芯 科技	2023- 03-28	6个月以上	科创板打 新限售	39.9 9	36.7 1	838	33,51 1.62	30,76 2.98	-
688 146	中船 特气	2023- 04-13	6个月以上	科创板打 新限售	36.1 5	38.1 3	712	25,73 8.80	27,14 8.56	-
301 310	鑫宏 业	2023- 05-26	6个月以上	创业板打 新限售	67.2 8	65.4 3	409	27,51 7.52	26,76 0.87	-
688 352	颀中 科技	2023- 04-11	6个月以上	科创板打 新限售	12.1 0	12.0 7	2,113	25,56 7.30	25,50 3.91	-
688 507	索辰 科技	2023- 04-10	6个月以上	科创板打 新限售	245. 56	122. 11	140	34,37 8.40	17,09 5.40	-
688 507	索辰 科技	2023- 06-20	1-6个月 (含)	科创板打 新限售送 股	-	122. 11	67	-	8,181. 37	-
301 293	三博 脑科	2023- 04-25	6个月以上	创业板打 新限售	29.6 0	71.4 2	333	9,856. 80	23,78 2.86	-
301 303	真兰 仪表	2023- 02-13	6个月以上	创业板打 新限售	26.8 0	22.3 2	1,058	28,35 4.40	23,61 4.56	-
688 552	航天 南湖	2023- 05-08	6个月以上	科创板打 新限售	21.1 7	23.5 0	956	20,23 8.52	22,46 6.00	-
301 307	美利 信	2023- 04-14	6个月以上	创业板打 新限售	32.3 4	31.8 6	687	22,21 7.58	21,88 7.82	-
688 543	国科 军工	2023- 06-14	6个月以上	科创板打 新限售	43.6 7	53.0 5	410	17,90 4.70	21,75 0.50	-
001 287	中电 港	2023- 03-30	6个月以上	主板打新 限售	11.8 8	21.0 2	1,011	12,01 0.68	21,25 1.22	-
688 458	美芯 晟	2023- 05-15	6个月以上	科创板打 新限售	75.0 0	90.7 6	221	16,57 5.00	20,05 7.96	-
688 581	安杰 思	2023- 05-12	6个月以上	科创板打 新限售	125. 80	118. 03	163	20,50 5.40	19,23 8.89	-
301 317	鑫磊 股份	2023- 01-12	6个月以上	创业板打 新限售	20.6 7	26.1 7	694	14,34 4.98	18,16 1.98	-
301	天键	2023-	6个月以上	创业板打	46.1	35.7	493	22,75	17,60	-

383	股份	05-31		新限售	6	2		6.88	9.96	
601 061	中信 金属	2023- 03-30	6个月以上	主板打新 限售	6.58	7.58	2,316	15,23 9.28	17,55 5.28	-
688 478	晶升 股份	2023- 04-13	6个月以上	科创板打 新限售	32.5 2	42.3 7	402	13,07 3.04	17,03 2.74	-
688 562	航天 软件	2023- 05-15	6个月以上	科创板打 新限售	12.6 8	22.3 1	726	9,205. 68	16,19 7.06	-
301 332	德尔 玛	2023- 05-09	6个月以上	创业板打 新限售	14.8 1	13.7 3	1,122	16,61 6.82	15,40 5.06	-
301 399	英特 科技	2023- 05-16	6个月以上	创业板打 新限售	43.9 9	51.5 7	293	12,88 9.07	15,11 0.01	-
301 408	华人 健康	2023- 02-22	6个月以上	创业板打 新限售	16.2 4	16.9 5	879	14,27 4.96	14,89 9.05	-
301 419	阿莱 德	2023- 02-02	6个月以上	创业板打 新限售	24.8 0	43.8 5	330	8,184. 00	14,47 0.50	-
688 334	西高 院	2023- 06-09	6个月以上	科创板打 新限售	14.1 6	16.2 1	888	12,57 4.08	14,39 4.48	-
688 593	新相 微	2023- 05-25	6个月以上	科创板打 新限售	11.1 8	14.5 9	959	10,72 1.62	13,99 1.81	-
301 387	光大 同创	2023- 04-10	6个月以上	创业板打 新限售	58.3 2	45.3 6	307	17,90 4.24	13,92 5.52	-
688 512	慧智 微	2023- 05-08	6个月以上	科创板打 新限售	20.9 2	19.1 6	721	15,08 3.32	13,81 4.36	-
301 382	蜂助 手	2023- 05-09	6个月以上	创业板打 新限售	23.8 0	32.8 4	408	9,710. 40	13,39 8.72	-
301 320	豪江 智能	2023- 06-01	6个月以上	创业板打 新限售	13.0 6	20.6 2	642	8,384. 52	13,23 8.04	-
688 433	华曙 高科	2023- 04-07	6个月以上	科创板打 新限售	26.6 6	31.5 0	418	11,14 3.88	13,16 7.00	-
301 360	荣旗 科技	2023- 04-17	6个月以上	创业板打 新限售	71.8 8	92.6 0	134	9,631. 92	12,40 8.40	-
301 315	威士 顿	2023- 06-13	6个月以上	创业板打 新限售	32.2 9	51.1 2	226	7,297. 54	11,55 3.12	-

688523	航天环宇	2023-05-26	6个月以上	科创板打新限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月以上	主板打新限售	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月以上	创业板打新限售	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月以上	创业板打新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月以上	创业板打新限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月以上	主板打新限售	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月以上	科创板打新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月以上	创业板打新限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月以上	创业板打新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月以上	创业板打新限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月以上	创业板打新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月以上	创业板打新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月以上	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月以上	创业板打新限售	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	创业板打新限售送股	-	25.10	96	-	2,409.60	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月以上	科创板打新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月以上	主板打新限售	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月以上	创业板打新限售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月以上	创业板打新限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月以上	创业板打新限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月以上	创业板打新限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月以上	主板打新限售	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月以上	主板打新限售	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月以上	主板打新限售	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月以上	主板打新限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月以上	主板打新限售	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月以上	主板打新限售	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月以上	主板打新限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月以上	主板打新限售	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月以上	主板打新限售	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，其他存款存放于浙商证券股份有限公司，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2023年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.26% (2022年12月31日：0.01%)。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.35%。

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2023年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为611,136,645.21元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	57,494,466.57	-	-	-	-	-	57,494,466.57
结算备付金	15,567.68	-	-	-	-	-	15,567.68
交易性金融资产	27,486,693.35	-	-	-	1,574,476.96	552,968,992.56	582,030,162.87
应收申	-	-	-	-	-	169,230.31	169,230.31

购款								
资产总计	84,996,727.60	-	-	-	1,574,476.96	553,138,222.87	639,709,427.43	
负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,503,394.37	26,503,394.37	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	747,990.99	747,990.99	
应付托管费	-	-	-	-	-	126,583.11	126,583.11	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	115,766.64	115,766.64	
应交税费	-	-	-	-	-	8.41	8.41	
其他负债	-	-	-	-	-	9,706,628.53	9,706,628.53	
负债总计	-	-	-	-	-	37,200,372.05	37,200,372.05	
利率敏感度缺口	84,996,727.60	-	-	-	1,574,476.96	515,937,850.82	602,509,055.38	
上年度末 2022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	22,920,671.57	-	-	-	-	-	22,920,671.57	
结算备付金	15,505.17	-	-	-	-	-	15,505.17	
交易性金融资产	12,242,515.07	-	27,192,479.68	-	97,021.26	814,328,998.77	853,861,014.78	
应收申购款	-	-	-	-	-	481,854.03	481,854.03	
资产总计	35,178,691.81	-	27,192,479.68	-	97,021.26	814,810,852.80	877,279,045.55	
负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	220,860.28	220,860.28	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	988,161.64	988,161.64	
应付托管费	-	-	-	-	-	167,227.36	167,227.36	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	154,528.73	154,528.73	
应交税费	-	-	-	-	-	0.57	0.57	

其他负债	-	-	-	-	-	470,369.03	470,369.03
负债总计	-	-	-	-	-	2,001,147.61	2,001,147.61
利率敏感度缺口	35,178,691.81	-	27,192,479.68	-	97,021.26	812,809,705.19	875,277,897.94

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为4.82% (2022年12月31日：4.52%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2022年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产不低于基金资产的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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	552,968,992.56	91.78	814,328,998.77	93.04
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	552,968,992.56	91.78	814,328,998.77	93.04

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.中证500指数收益率上升5%	27,581,980.64	40,898,916.15
	2.中证500指数收益率下降5%	-27,581,980.64	-40,898,916.15

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	552,480,330.18	812,166,655.37
第二层次	27,819,155.29	39,532,016.01
第三层次	1,730,677.40	2,162,343.40
合计	582,030,162.87	853,861,014.78

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	552,968,992.56	86.44
	其中：股票	552,968,992.56	86.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,061,170.31	4.54
	其中：债券	29,061,170.31	4.54
	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	57,510,034.25	8.99
8	其他各项资产	169,230.31	0.03
9	合计	639,709,427.43	100.00

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

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末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	3,535,770.00	0.59
B	采矿业	13,412,631.48	2.23
C	制造业	380,771,118.84	63.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,565,286.67	2.25
E	建筑业	10,196,740.15	1.69

F	批发和零售业	14,129,038.75	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	17,566,108.00	2.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,256,063.98	2.86
J	金融业	49,000,253.62	8.13
K	房地产业	477,160.00	0.08
L	租赁和商务服务业	130,333.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	9,722,765.45	1.61
N	水利、环境和公共设施管理业	11,617,241.76	1.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	11,564,698.00	1.92
S	综合	-	-
	合计	552,968,992.56	91.78

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002422	科伦药业	225,500	6,692,840.00	1.11
2	000783	长江证券	1,045,500	6,063,900.00	1.01
3	002600	领益智造	849,900	5,872,809.00	0.97
4	002025	航天电器	91,815	5,857,797.00	0.97
5	002568	百润股份	160,100	5,819,635.00	0.97
6	601958	金钼股份	461,700	5,147,955.00	0.85
7	002926	华西证券	610,600	5,074,086.00	0.84

8	603688	石英股份	43,773	4,983,118.32	0.83
9	002139	拓邦股份	370,200	4,831,110.00	0.80
10	600517	国网英大	837,800	4,775,460.00	0.79
11	603045	福达合金	308,035	4,663,649.90	0.77
12	001218	丽臣实业	197,120	4,456,883.20	0.74
13	600582	天地科技	759,300	4,426,719.00	0.73
14	300697	电工合金	369,500	4,426,610.00	0.73
15	002620	瑞和股份	849,200	4,415,840.00	0.73
16	601519	大智慧	614,300	4,398,388.00	0.73
17	000919	金陵药业	562,000	4,394,840.00	0.73
18	603508	思维列控	255,900	4,363,095.00	0.72
19	603367	辰欣药业	286,600	4,350,588.00	0.72
20	300206	理邦仪器	288,500	4,350,580.00	0.72
21	000751	锌业股份	1,310,700	4,325,310.00	0.72
22	301257	普蕊斯	76,800	4,316,160.00	0.72
23	003011	海象新材	133,620	4,309,245.00	0.72
24	603686	福龙马	412,900	4,306,547.00	0.71
25	605066	天正电气	457,500	4,305,075.00	0.71
26	002060	粤水电	653,500	4,300,030.00	0.71
27	002394	联发股份	504,600	4,294,146.00	0.71
28	002381	双箭股份	555,700	4,290,004.00	0.71
29	000528	柳工	542,700	4,287,330.00	0.71
30	002956	西麦食品	274,200	4,285,746.00	0.71
31	002357	富临运业	637,600	4,284,672.00	0.71
32	688186	广大特材	131,625	4,281,761.25	0.71
33	603199	九华旅游	123,900	4,280,745.00	0.71
34	601137	博威合金	275,100	4,280,556.00	0.71
35	300839	博汇股份	321,960	4,278,848.40	0.71
36	300622	博士眼镜	181,200	4,276,320.00	0.71
37	603757	大元泵业	143,200	4,273,088.00	0.71
38	601336	新华保险	116,146	4,270,688.42	0.71

39	600488	津药药业	758,600	4,263,332.00	0.71
40	002334	英威腾	334,580	4,262,549.20	0.71
41	300856	科思股份	54,100	4,261,457.00	0.71
42	600229	城市传媒	499,400	4,254,888.00	0.71
43	300246	宝莱特	341,150	4,247,317.50	0.70
44	601567	三星医疗	335,900	4,242,417.00	0.70
45	001210	金房能源	188,340	4,230,116.40	0.70
46	600035	楚天高速	1,035,900	4,226,472.00	0.70
47	000338	潍柴动力	339,200	4,226,432.00	0.70
48	300599	雄塑科技	513,500	4,226,105.00	0.70
49	002419	天虹股份	722,100	4,224,285.00	0.70
50	688510	航亚科技	212,352	4,223,681.28	0.70
51	600583	海油工程	720,800	4,216,680.00	0.70
52	600551	时代出版	381,400	4,214,470.00	0.70
53	003006	百亚股份	243,800	4,212,864.00	0.70
54	600351	亚宝药业	593,200	4,211,720.00	0.70
55	600926	杭州银行	358,000	4,206,500.00	0.70
56	002987	京北方	191,741	4,202,962.72	0.70
57	002448	中原内配	600,200	4,201,400.00	0.70
58	300674	宇信科技	237,200	4,193,696.00	0.70
59	600897	厦门空港	202,300	4,185,587.00	0.69
60	000605	渤海股份	659,600	4,168,672.00	0.69
61	300691	联合光电	235,100	4,142,462.00	0.69
62	600060	海信视像	167,300	4,140,675.00	0.69
63	600980	北矿科技	260,700	4,119,060.00	0.68
64	605258	协和电子	158,500	4,117,830.00	0.68
65	000921	海信家电	151,700	4,088,315.00	0.68
66	300232	洲明科技	445,200	4,069,128.00	0.68
67	603331	百达精工	272,600	4,029,028.00	0.67
68	603619	中曼石油	238,100	4,028,652.00	0.67
69	300041	回天新材	340,370	4,016,366.00	0.67

70	002402	和而泰	234,800	3,986,904.00	0.66
71	300130	新国都	139,100	3,940,703.00	0.65
72	688556	高测股份	73,600	3,911,104.00	0.65
73	603136	天目湖	150,500	3,882,900.00	0.64
74	600458	时代新材	321,200	3,851,188.00	0.64
75	601688	华泰证券	276,200	3,803,274.00	0.63
76	688100	威胜信息	126,065	3,757,997.65	0.62
77	603689	皖天然气	427,540	3,749,525.80	0.62
78	603298	杭叉集团	159,000	3,744,450.00	0.62
79	002478	常宝股份	501,000	3,732,450.00	0.62
80	300308	中际旭创	25,300	3,730,485.00	0.62
81	300185	通裕重工	1,328,500	3,706,515.00	0.62
82	688718	唯赛勃	209,579	3,627,812.49	0.60
83	603027	千禾味业	170,800	3,607,296.00	0.60
84	002772	众兴菌业	312,900	3,535,770.00	0.59
85	688551	科威尔	52,148	3,419,865.84	0.57
86	002566	益盛药业	405,000	3,369,600.00	0.56
87	300127	银河磁体	178,601	3,238,036.13	0.54
88	002249	大洋电机	554,085	3,158,284.50	0.52
89	002966	苏州银行	481,700	3,155,135.00	0.52
90	600109	国金证券	352,900	3,059,643.00	0.51
91	002154	报喜鸟	550,400	3,038,208.00	0.50
92	002454	松芝股份	347,200	2,940,784.00	0.49
93	600020	中原高速	799,900	2,935,633.00	0.49
94	002809	红墙股份	263,800	2,849,040.00	0.47
95	605177	东亚药业	113,800	2,804,032.00	0.47
96	002540	亚太科技	485,100	2,803,878.00	0.47
97	688013	天臣医疗	115,999	2,750,336.29	0.46
98	300900	广联航空	94,200	2,713,902.00	0.45
99	601163	三角轮胎	163,498	2,594,713.26	0.43
100	301087	可孚医疗	52,100	2,568,530.00	0.43

101	002017	东信和平	192,802	2,527,634.22	0.42
102	600967	内蒙一机	246,000	2,484,600.00	0.41
103	000026	飞亚达	200,400	2,416,824.00	0.40
104	002603	以岭药业	90,500	2,324,945.00	0.39
105	002056	横店东磁	125,100	2,278,071.00	0.38
106	603041	美思德	187,900	2,258,558.00	0.37
107	600267	海正药业	196,700	2,238,446.00	0.37
108	600958	东方证券	230,500	2,235,850.00	0.37
109	002763	汇洁股份	251,500	2,228,290.00	0.37
110	600757	长江传媒	257,700	2,216,220.00	0.37
111	000157	中联重科	326,700	2,205,225.00	0.37
112	603383	顶点软件	39,700	2,200,174.00	0.37
113	605378	野马电池	94,300	2,198,133.00	0.36
114	002967	广电计量	107,800	2,165,702.00	0.36
115	601555	东吴证券	308,800	2,143,072.00	0.36
116	002990	盛视科技	58,200	2,141,760.00	0.36
117	002955	鸿合科技	90,500	2,131,275.00	0.35
118	300265	通光线缆	205,200	2,129,976.00	0.35
119	605599	菜百股份	159,200	2,103,032.00	0.35
120	002973	侨银股份	175,600	2,036,960.00	0.34
121	002035	华帝股份	283,700	2,014,270.00	0.33
122	002732	燕塘乳业	92,100	1,991,202.00	0.33
123	603878	武进不锈	234,800	1,984,060.00	0.33
124	603197	保隆科技	35,400	1,920,450.00	0.32
125	300811	铂科新材	32,240	1,916,345.60	0.32
126	002223	鱼跃医疗	52,900	1,903,871.00	0.32
127	688586	江航装备	133,600	1,858,376.00	0.31
128	688080	映翰通	37,440	1,830,816.00	0.30
129	002976	瑞玛精密	64,100	1,792,877.00	0.30
130	000548	湖南投资	369,000	1,785,960.00	0.30
131	002446	盛路通信	187,600	1,772,820.00	0.29

132	600390	五矿资本	329,400	1,772,172.00	0.29
133	002179	中航光电	38,900	1,764,115.00	0.29
134	603859	能科科技	33,600	1,717,968.00	0.29
135	601319	中国人保	293,900	1,716,376.00	0.28
136	300822	贝仕达克	125,050	1,705,682.00	0.28
137	603488	展鹏科技	208,200	1,671,846.00	0.28
138	603798	康普顿	164,080	1,667,052.80	0.28
139	003000	劲仔食品	131,900	1,660,621.00	0.28
140	600664	哈药股份	502,700	1,653,883.00	0.27
141	002660	茂硕电源	169,600	1,633,248.00	0.27
142	603611	诺力股份	59,600	1,569,864.00	0.26
143	600170	上海建工	546,600	1,470,354.00	0.24
144	601177	杭齿前进	119,000	1,451,800.00	0.24
145	600531	豫光金铅	226,600	1,427,580.00	0.24
146	000685	中山公用	182,500	1,381,525.00	0.23
147	600261	阳光照明	376,300	1,373,495.00	0.23
148	600372	中航电子	90,100	1,367,718.00	0.23
149	002533	金杯电工	161,000	1,313,760.00	0.22
150	000576	甘化科工	123,200	1,305,920.00	0.22
151	600629	华建集团	183,400	1,280,132.00	0.21
152	688029	南微医学	15,424	1,257,981.44	0.21
153	603328	依顿电子	149,600	1,238,688.00	0.21
154	002612	朗姿股份	51,000	1,212,780.00	0.20
155	300852	四会富仕	28,800	1,194,048.00	0.20
156	003003	天元股份	112,300	1,188,134.00	0.20
157	600908	无锡银行	217,200	1,164,192.00	0.19
158	600633	浙数文化	70,400	1,141,184.00	0.19
159	300545	联得装备	40,200	1,116,354.00	0.19
160	603719	良品铺子	41,800	1,045,418.00	0.17
161	603551	奥普家居	79,600	1,029,228.00	0.17
162	002238	天威视讯	139,700	968,121.00	0.16

163	301043	绿岛风	29,100	930,327.00	0.15
164	600373	中文传媒	66,000	879,120.00	0.15
165	603983	丸美股份	27,000	873,450.00	0.14
166	002367	康力电梯	93,800	856,394.00	0.14
167	003023	彩虹集团	41,400	849,114.00	0.14
168	600761	安徽合力	42,400	845,032.00	0.14
169	300349	金卡智能	60,800	843,904.00	0.14
170	603040	新坐标	31,700	842,903.00	0.14
171	603345	安井食品	5,700	836,760.00	0.14
172	688390	固德威	4,756	793,586.16	0.13
173	002500	山西证券	141,500	789,570.00	0.13
174	605288	凯迪股份	18,100	779,024.00	0.13
175	600197	伊力特	28,200	766,194.00	0.13
176	002236	大华股份	37,300	736,675.00	0.12
177	688078	龙软科技	14,165	730,205.75	0.12
178	600054	黄山旅游	53,100	679,680.00	0.11
179	002033	丽江股份	62,032	674,908.16	0.11
180	300447	全信股份	33,500	642,865.00	0.11
181	300855	图南股份	17,600	621,632.00	0.10
182	000700	模塑科技	110,900	618,822.00	0.10
183	601311	骆驼股份	66,000	612,480.00	0.10
184	002636	金安国纪	63,500	586,105.00	0.10
185	601966	玲珑轮胎	26,200	582,164.00	0.10
186	688626	翔宇医疗	11,800	537,018.00	0.09
187	603567	珍宝岛	35,869	536,600.24	0.09
188	301041	金百泽	15,700	519,984.00	0.09
189	300779	惠城环保	9,300	495,597.00	0.08
190	301101	明月镜片	11,900	488,257.00	0.08
191	600748	上实发展	120,800	477,160.00	0.08
192	600419	天润乳业	29,100	472,002.00	0.08
193	600420	国药现代	41,300	466,277.00	0.08

194	688799	华纳药厂	10,294	418,142.28	0.07
195	603013	亚普股份	26,000	407,680.00	0.07
196	688578	艾力斯	14,600	393,470.00	0.07
197	601686	友发集团	56,400	385,776.00	0.06
198	688525	佰维存储	4,614	368,612.46	0.06
199	002779	中坚科技	13,200	347,292.00	0.06
200	605009	豪悦护理	7,200	345,600.00	0.06
201	002077	大港股份	22,900	342,355.00	0.06
202	301301	川宁生物	35,740	320,230.40	0.05
203	301291	明阳电气	9,787	317,519.17	0.05
204	688599	天合光能	7,200	306,792.00	0.05
205	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.05
206	600315	上海家化	10,304	298,919.04	0.05
207	600728	佳都科技	42,500	294,525.00	0.05
208	000625	长安汽车	22,400	289,632.00	0.05
209	001296	长江材料	13,000	273,130.00	0.05
210	603758	秦安股份	24,100	256,424.00	0.04
211	688410	山外山	4,853	254,782.50	0.04
212	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.04
213	301297	富乐德	10,147	228,408.97	0.04
214	002012	凯恩股份	34,800	226,548.00	0.04
215	600612	老凤祥	3,100	216,628.00	0.04
216	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.03
217	002283	天润工业	28,700	184,254.00	0.03
218	600837	海通证券	19,500	179,790.00	0.03
219	300777	中简科技	3,700	174,862.00	0.03
220	688395	正弦电气	6,200	164,858.00	0.03
221	603283	赛腾股份	3,700	164,650.00	0.03
222	603215	比依股份	9,000	161,460.00	0.03
223	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.03
224	600031	三一重工	9,200	152,996.00	0.03

225	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.03
226	301280	珠城科技	4,175	149,298.00	0.02
227	600368	五洲交通	40,600	147,784.00	0.02
228	002443	金洲管道	21,500	143,190.00	0.02
229	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.02
230	300047	天源迪科	17,400	141,636.00	0.02
231	300129	泰胜风能	14,600	140,014.00	0.02
232	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.02
233	300063	天龙集团	30,100	130,333.00	0.02
234	603166	福达股份	18,600	125,364.00	0.02
235	000030	富奥股份	22,300	112,392.00	0.02
236	601916	浙商银行	42,280	111,619.20	0.02
237	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.02
238	300638	广和通	4,600	104,328.00	0.02
239	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
240	601890	亚星锚链	8,900	103,062.00	0.02
241	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
242	688249	晶合集成	5,467	98,734.02	0.02
243	601566	九牧王	7,700	92,554.00	0.02
244	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.02
245	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01
246	601601	中国太保	3,100	80,538.00	0.01
247	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
248	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
249	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
250	688469	中芯集成	10,322	55,842.02	0.01
251	688472	阿特斯	3,242	55,243.68	0.01
252	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
253	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.01
254	688443	智翔金泰	1,595	47,036.55	0.01
255	301358	湖南裕能	1,092	46,835.88	0.01

256	301260	格力博	1,813	42,841.19	0.01
257	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.01
258	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
259	688531	日联科技	260	35,352.20	0.01
260	688484	南芯科技	838	30,762.98	0.01
261	688146	中船特气	712	27,148.56	0.00
262	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
263	688352	硕中科技	2,113	25,503.91	0.00
264	688507	索辰科技	207	25,276.77	0.00
265	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
266	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
267	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
268	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
269	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
270	001287	中电港	1,011	21,251.22	0.00
271	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
272	601121	宝地矿业	2,532	19,344.48	0.00
273	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
274	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
275	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
276	601061	中信金属	2,316	17,555.28	0.00
277	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
278	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
279	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
280	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
281	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
282	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
283	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
284	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
285	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
286	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00

287	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
288	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
289	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
290	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
291	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
292	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
293	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
294	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
295	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
296	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
297	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
298	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
299	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
300	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
301	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
302	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
303	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
304	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
305	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
306	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
307	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
308	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
309	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
310	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
311	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
312	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
313	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
314	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
315	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
316	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
317	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00

318	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
319	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
320	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600833	第一医药	24,584,740.00	2.81
2	000751	锌业股份	22,874,109.30	2.61
3	300900	广联航空	22,777,767.40	2.60
4	002139	拓邦股份	22,195,999.00	2.54
5	603399	吉翔股份	21,851,658.00	2.50
6	300839	博汇股份	21,611,296.00	2.47
7	600958	东方证券	20,511,551.32	2.34
8	601958	金钼股份	20,106,161.00	2.30
9	601163	三角轮胎	19,976,089.00	2.28
10	300965	恒宇信通	19,687,782.24	2.25
11	603027	千禾味业	19,456,561.80	2.22
12	002250	联化科技	19,172,329.22	2.19
13	601555	东吴证券	18,545,357.16	2.12
14	601699	潞安环能	18,439,430.00	2.11
15	300545	联得装备	18,247,308.00	2.08
16	688335	复洁环保	18,199,901.09	2.08
17	601567	三星医疗	17,999,601.62	2.06
18	600519	贵州茅台	17,794,906.00	2.03
19	605168	三人行	17,743,086.65	2.03
20	002603	以岭药业	17,637,303.13	2.02
21	603345	安井食品	17,600,345.00	2.01

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	600833	第一医药	26,242,963.00	3.00
2	601163	三角轮胎	23,188,467.00	2.65
3	000921	海信家电	22,902,788.23	2.62
4	300545	联得装备	20,834,500.00	2.38
5	601699	潞安环能	20,701,574.00	2.37
6	300777	中简科技	20,701,090.58	2.37
7	000623	吉林敖东	20,608,783.81	2.35
8	688063	派能科技	20,537,348.52	2.35
9	300900	广联航空	20,531,574.39	2.35
10	603920	世运电路	20,168,995.50	2.30
11	300856	科思股份	20,152,345.67	2.30
12	003000	劲仔食品	19,901,937.16	2.27
13	300447	全信股份	19,894,110.27	2.27
14	300965	恒宇信通	19,744,050.52	2.26
15	603399	吉翔股份	19,616,966.13	2.24
16	600958	东方证券	19,035,289.00	2.17
17	688335	复洁环保	18,453,037.72	2.11
18	000751	锌业股份	18,308,665.00	2.09
19	605168	三人行	18,277,694.68	2.09
20	300789	唐源电气	18,132,669.85	2.07
21	603056	德邦股份	18,128,762.96	2.07
22	002139	拓邦股份	18,119,365.00	2.07
23	300839	博汇股份	18,023,732.80	2.06
24	600790	轻纺城	17,973,763.14	2.05
25	300377	赢时胜	17,644,634.38	2.02
26	003020	立方制药	17,613,692.80	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。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,070,281,154.66
卖出股票收入（成交）总额	5,395,188,194.38

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	27,486,693.35	4.56
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)	1,574,476.96	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,061,170.31	4.82

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019679	22国债14	179,530	18,275,775.27	3.03
2	019638	20国债09	90,000	9,210,918.08	1.53
3	127082	亚科转债	12,822	1,574,476.96	0.26

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**  
本基金本报告期内未进行股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

(1) 2023年6月27日，金堆城钼业股份有限公司（证券代码601958）因未如实披露存在的独立性不足问题，被中国证监会陕西监管局采取出具警示函的监管措施（陕证监措施字[2023]25号）。

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

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

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

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	169,230.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	169,230.31

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博道伍佰智航A	4,080	32,598.99	26,603,305.76	20.00%	106,400,564.41	80.00%
博道伍佰智航C	5,105	53,642.17	137,359,151.06	50.16%	136,484,113.56	49.84%

合计	8,973	45,341.26	163,962,456.82	40.30%	242,884,677.97	59.70%
----	-------	-----------	----------------	--------	----------------	--------

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博道伍佰智航A	574,870.36	0.43%
	博道伍佰智航C	27,256.81	0.01%
	合计	602,127.17	0.15%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	博道伍佰智航A	0~10
	博道伍佰智航C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	博道伍佰智航A	0~10
	博道伍佰智航C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道伍佰智航A	博道伍佰智航C
基金合同生效日(2019年09月26日)基金份额总额	274,561,475.68	483,890,618.24
本报告期期初基金份额总额	197,581,538.73	435,948,272.79
本报告期基金总申购份额	9,468,495.02	140,894,382.31
减：本报告期基金总赎回份额	74,046,163.58	302,999,390.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	133,003,870.17	273,843,264.62

注：

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

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的 比例		量的比 例	
浙商 证券	2	10,450,003,882.62	100.0 0%	6,492,546.56	100.0 0%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债 券成交总 额的比例	成交金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例	成交金额	占当期基 金成交总 额的比例
浙商证 券	20,530,658. 55	100.00%	171,002,000. 00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
  - (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
  - (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
  - (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面；
  - (4) 具有较强的为投资人提供资产配置及服务的能力，包括但不限于：产品筛选及评审流程完整，具有较为完善的资产配置，客户服务及陪伴体系等。
- 3、基金交易单元的选择程序如下：
  - (1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
  - (2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博道基金管理有限公司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	2023-01-20
2	博道伍佰智航股票型证券投	公司网站、中国证监会基金	2023-01-20

	资基金2022年第四季度报告	电子披露网站	
3	博道基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西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、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-17
4	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	2023-03-31
5	博道伍佰智航股票型证券投资基金2022年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	博道基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”（养老金客户）适用范围的公告	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	2023-04-04
7	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2023-04-21
8	博道伍佰智航股票型证券投资基金2023年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-21
9	博道基金管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-04
10	博道基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

机构	1	20230201-20230613	118,352,265.90	87,324,511.32	172,002,400.10	33,674,377.12	8.28%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。</p>							

## §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伍佰智航股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道伍佰智航股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道伍佰智航股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道伍佰智航股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道伍佰智航股票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、报告期内博道伍佰智航股票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网站（[www.bdfund.cn](http://www.bdfund.cn)）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

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

博道基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日